

中加科丰价值精选混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年03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。

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	19
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	26
7.4 报表附注	28
§8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	70
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	70
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	70
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	71
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	71

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
8.12 投资组合报告附注.....	71
§9 基金份额持有人信息.....	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	72
§10 开放式基金份额变动.....	72
§11 重大事件揭示.....	73
11.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
11.4 基金投资策略的改变.....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
11.8 其他重大事件.....	74
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
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.....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
§13 备查文件目录.....	77
13.1 备查文件目录.....	77
13.2 存放地点.....	77
13.3 查阅方式.....	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中加科丰价值精选混合型证券投资基金
基金简称	中加科丰价值精选混合
基金主代码	008356
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年05月08日
基金管理人	中加基金管理有限公司
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	1,069,168,112.49份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超过业绩比较基准的投资回报，力争实现资产的长期、稳健增值。
投资策略	本基金通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上，力争实现长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中债总全价（总值）指数收益率×60%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，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		中加基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凌	姜敏
	联系电话	400-00-95526	4006800000
	电子邮箱	service@bobbs.com	jiangmin@citicbank.com

客户服务电话	400-00-95526	95558
传真	010-83197627	010-85230024
注册地址	北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	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	北京市西城区南纬路35号	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	100050	100020
法定代表人	夏英	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	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bobbns.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
注册登记机构	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35号

§ 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05月08日（基金合同生效日）-2020年12月31日
本期已实现收益	85,870,191.42	32,681,045.69

本期利润	66,689,505.52	63,024,047.19
加权平均基金份额本期利润	0.0937	0.1270
本期加权平均净值利润率	7.96%	11.92%
本期基金份额净值增长率	8.35%	12.60%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	184,934,125.52	35,577,077.41
期末可供分配基金份额利润	0.1730	0.0533
期末基金资产净值	1,295,717,640.31	747,077,625.42
期末基金份额净值	1.2119	1.1185
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末
基金份额累计净值增长率	22.01%	12.60%

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

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

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	0.94%	0.12%	1.12%	0.31%	-0.18%	-0.19%
过去六个月	3.53%	0.17%	-0.86%	0.41%	4.39%	-0.24%
过去一年	8.35%	0.20%	-0.38%	0.47%	8.73%	-0.27%
自基金合同生效起至今	22.01%	0.25%	9.74%	0.48%	12.27%	-0.23%

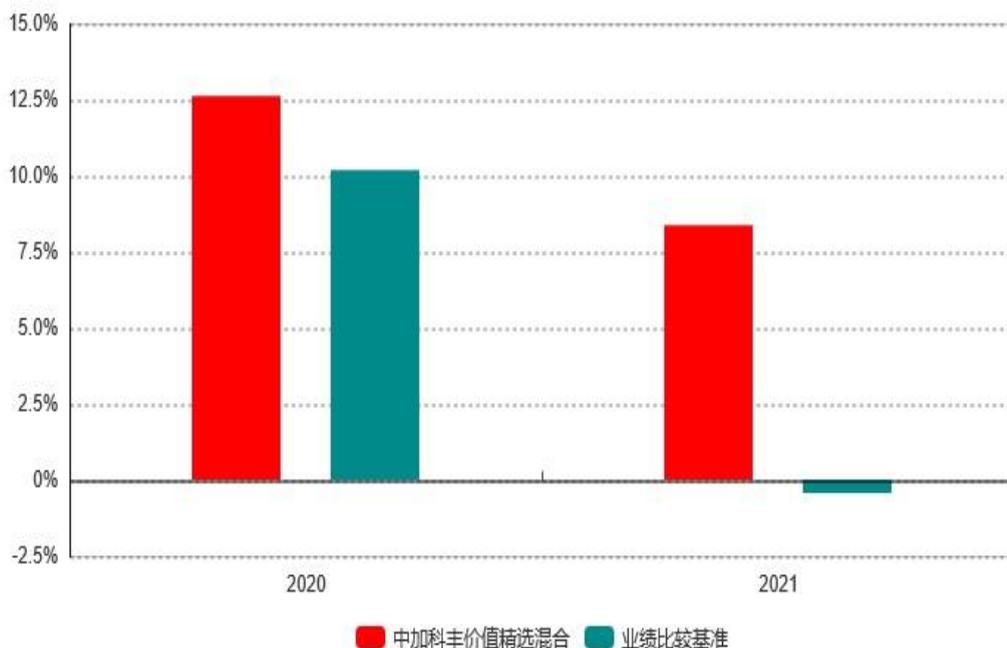
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1. 本基金基金合同于2020年5月8日生效，截至本报告期末，本基金基金合同生效已满一年。

2. 按基金合同规定，本基金建仓期为6个月，截至本报告期末，本基金建仓期已结束。建仓期结束时，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021年	-	-	-	-	-
2020年	0.074	4,875,459.00	66,925.42	4,942,384.42	-
合计	0.074	4,875,459.00	66,925.42	4,942,384.42	-

§ 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

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地种业（集团）有限公司6%、有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

本报告期内，本公司共管理六十二只基金，分别是中加货币市场基金（A/C）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加丰润纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加丰尚纯债债券型证券投资基金、中加丰泽纯债债券型证券投资基金、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加丰享纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加颐享纯债债券型证券投资基金、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金、中加颐信纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加颐睿纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐智纯债债券型证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金、中加裕盈纯债债券型证券投资基金、中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金、中加颐瑾六个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加民丰纯债债券型证券投资基金、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金、中加享润两年定期开放债券型证券投资基金、中加优选中高等级债券型证券投资基金（A/C）、中加科盈混合型证券投资基金（A/C）、中加优享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加安瑞稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金、中加中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、中加聚庆六个月定期开放混合型证券投资基金（A/C）、中加核心智造混合型证券投资基金（A/C）、中加优势企业混合型证券投资基金（A/C）、中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中加博裕纯债债券型证券投资基金、中加新兴成长混合型证券投资基金（A/C）、中加中证500指数增强型证券投资基金（A/C）、中加科享混合型证券投资基金（A/C）、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中加新兴消费混合型证券投资基金（A/C）、中加穗盈纯债债券型证券投资基金、中加聚隆六个月持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加科鑫混合型证券投资基金（A/C）、中加中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、中加聚优一年定期开放混合型证券投资基金（A/C）、中加消费优选混合型证券投资基金（A/C）、中加喜利回报一年持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加优悦一年定期开放债券型证券投资基金、中加科瑞混合型证券投资基金（A/C）、中加中债-1-5年政策性金融债指数证券投资基金。

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		
冯汉杰	本基金基金经理	2020-05-08	-	12	冯汉杰先生，清华大学数学硕士。2009年7月至2016年6月历任泰康资产管理有限公司研究员、投资经理。2016年8月至2018年6月任中欧基金管理有限公司投资经理。2018年7月加入中加基金管理有限公司。曾任中加科盈混合型证券投资基金（2019年11月29日至2021年1月7日）、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金（2019年10月23日至2021年2月8日）的基金经理，现任中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金（2018年12月5日至今）、中加聚庆六个月定期开放混合型证券投资基金（2020年5月22日至今）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金（2020年5月8日至今）、中加核心智造混合型证券投资基金（2020年7月22日至今）、中加聚隆六个月持有期混合型证券投资基金（2021年3月24日至今）、

					中加聚优一年定期开放混合型证券投资基金（2021年6月30日至今）、中加喜力回报一年持有期混合型证券投资基金（2021年9月1日至今）的基金经理。
于跃	本基金基金经理	2020-05-13	-	9	于跃先生，伦敦帝国理工大学金融数学硕士。2012年5月至2015年5月，任职于民生证券股份有限公司，担任固收投资经理助理；2015年6月至2019年11月，任职于中信建投证券股份有限公司，任固定收益投资经理。2019年12月加入中加基金管理有限公司，曾任中加优享纯债债券型证券投资基金基金经理（2020年3月4日至2021年8月20日）、中加丰裕纯债债券型证券投资基金基金经理（2020年5月7日至2021年8月20日）、中加颐信纯债债券型证券投资基金（2020年3月4日至2021年12月21日）。现任中加享利三年定期开放债券型证券投资基金基金经理（2020年2月19日至今）、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金（2020年3月3日至今）、中加颐享纯债债券型证券投资基金（2020年3月3日至今）、中加瑞利纯债债券型证券投资基金（2

					020年3月4日至今)、中加科丰价值精选混合型证券投资基金(2020年5月13日至今)、中加瑞合纯债债券型证券投资基金(2020年11月25日至今)、中加科亨混合型证券投资基金(2020年11月4日至今)、中加颐睿纯债债券型证券投资基金(2021年12月15日至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

- 1、任职日期说明：冯汉杰的任职日期以本基金基金合同生效公告为准，于跃的任职日期以本基金增聘基金经理的公告为准。
- 2、离任日期说明：无。
- 3、证券从业年限的计算标准：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。
- 4、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定。公司通过事前控制、事中控制、事后控制的方法，保证各投资组合的公平交易，防止不同组合之间的利益输送，保护各类资产委托人的利益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》，对买卖债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，本基金的基金管理人不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了同日反向交易控制的规则，并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时，公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，定期对组合间的同向交易进行分析。本报告期内，本公司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未超过该证券当日成交量的5%。投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果，表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

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

2021年一季度，债券市场整体表现偏弱。1月初资金面异常宽松，隔夜融资成本位于1%以下，债市加杠杆情绪浓厚，交易活跃，国债期货震荡上涨，此后央行公开市场投放量缩减至50亿甚至是20亿，被市场解读为“不急转弯”的用意，10年国债收益率继续下行；月中经济金融数据频超预期，尤其是四季度6.5%的GDP同比，创下近年来新高，而MLF与TMLF并未全额对冲，流动性边际收紧；进入到下旬全国疫情零星散发，加之疫苗对变异病毒存在不确定性，债市阶段性反弹，但紧接着“钱荒”式流动性紧张，债券接连下挫。2月初央行操作格外谨慎，迟迟不投放跨春节资金，流动性偏紧格局持续，债市预期也发生改变，国债期货连续多日下跌，同时股票市场的狂热风险偏好急速提升；春节假期期间，亚洲股市继续大涨，大宗商品价格走高，通胀预期发酵，节后债券市场再次进入下跌通道；紧接着油价、铜、锂、镍等频频创下历史新高，全球债券收益率齐步上行；临近月末核心资产连续下挫，叠加流动性转松，债市企稳反弹。3月初抱团核心股票继续调整，风险偏好总体回落，与此同时资金面呈现“两会”特征，流动性较为充裕，国债期货顺势反弹；月中经济金融数据落地，信贷好于预期，工业生产较强，而内需消费较为羸弱，同期美债收益率再度走高，全球通胀升温，国内债市承压；进入到下旬市场担忧的地方债供给迟迟没有落地，反而随着财政投放资金面较为宽松，叠加投资者杠杆和久期偏低，债市再度进入温和上涨阶段。

二季度，债市维持震荡偏强的格局。四月初工业品价格持续上涨，通胀阴云挥之不去，与此同时对于缴税扰动的担忧始终都在，债市情绪显得非常谨慎，收益率普遍有所上行；月中1季度经济数据公布，仅有0.6%的GDP环比低于市场预期，地方债发行量也

迟迟未到，债券在多重利好下开启一波上涨行情；进入到下旬税期扰动略有显现，但 DR007 始终平稳，流动性确认合理充裕的情况下，杠杆套息策略成为首选，长久期品种则在风险偏好影响下呈现震荡走势。五一长假期间，海外消息总体平静，而大宗商品的冲高让债市有所承压，行情走势颇为震荡；中旬 1 季度货币政策执行报告发布，流动性合理充裕预期得到强化，而且央行开辟专栏阐明通胀影响可控，此后伴随着国常会多次强调“保供稳价”，大宗商品价格大幅下挫，债市进入上涨阶段；经济金融数据总体符合预期，并未对市场带来太多扰动，反而是地方债发行量迟迟不及预期，资金面持续宽松助力收益率回落，临近月末缴税走款叠加跨月导致流动性边际收紧，获利了结盘增多。进入六月，月初随着大宗商品价格持续上涨，通胀再度扰动市场，此外地方债供给放量加剧了投资者担忧，期间中美重启对话上证指数上涨，风险偏好同样不利于债券标的，国债期货震荡下挫；中旬数据陆续公布，成为交易的重点，PPI 同比达到 9% 着实超出预期，其他总体平稳，并未对市场带来太多扰动；进入下旬，资金面推升行情再度出现，DR007 维持稳定，年中跨季时点，央行也将 100 亿滚续操作改成 300 亿，债券情绪显著回暖。

三季度，债券市场开启一波大牛市。七月初国务院常务会议意外提及降准，当周周五央行宣布全面降准，一系列货币政策大大超出市场预期，债券市场连续数日大涨；中旬降准资金落地但流动性并未显著宽松，反而是在缴税和地方债供给的压力下，融资成本偏高，加上上半年经济数据并未走弱，两年 GDP 平均增长甚至较一季度好转，PPI 同样处在高位，利率进入震荡区间；下旬中央办公厅发布的“双减”文件引发连锁反应，恐慌情绪从教育股扩散到整个权益市场，风险偏好急速回落，作为避险资产的债券标的再度迎来上涨行情。八月现券利率整体震荡。月初受上月 PMI 明显走弱、资金宽松及国内疫情持续发酵影响，利率延续此前下行趋势。8 月第二周随着 15 号文补充通知的下发，媒体密集报道专项债将加快发行，资金也有所转紧，市场开始担忧宽信用发力，虽然期间公布的外贸、金融数据均偏弱，但市场已对此有所预期，利率明显反弹。随后多空方面消息并存，债市再次开始震荡。进入九月，9 月资金整体先紧后松。上半月由于银行体系超储率偏低，叠加央行公开市场仅维持每天 100 亿 7 天期逆回购的常规操作，并未向市场投放多余流动性，DR001 基本维持在 2.1% 以上；月中央行等量续作 6000 亿 MLF，降准后首次未净回笼 MLF，市场多空解读不一，但对短期流动性影响不大；下半月央行于 9 月 17 日开始提前呵护跨季流动性，资金逐渐转松，但由于投放期限侧重于 14 天而非 7 天，资金利率直至临近季末才明显下行。除了资金面的影响外，美联储 taper 预期和黑色系商品大涨也对债券市场偏利空，全月债券市场整体偏震荡。

2021 年四季度利率呈倒 V 型走势，利率前高后低，10 年国债收益率高点接近 3.05% 低点在 2.77% 附近，最大波动幅度约 30bp。大宗商品价格，宽货币与宽信用博弈是市场交易主线。具体来看：10 月上半月市场交易逻辑依旧落在供给不足带来的通胀担忧上，在此期间 10 年国债收益率上行近 20bp。一方面是供暖及工业生产需求旺盛，煤价持续上行，

动力煤活跃合约价格一度涨至1800元/吨；另一方面，降准等预期中的宽松政策迟迟未落地，债市的恐慌情绪逐渐发酵，市场情绪在央行三季度金融统计数据新闻发布会期间最为悲观。10月下半月至11月上半月，10年国债收益率震荡下行约10bp，进入四季度第一个利率快速下行期。利率下行的最初推动力是煤炭保供稳价政策助推煤价下跌，可以看到动力煤价格顶点基本对应四季度利率高点。随着煤价逐渐回落到正常区间，市场将关注点重新放回房地产基本面回落的经济停滞风险。11月下半月，10年国债收益率再次下行10bp附近，进入四季度第二个利率快速下行期，市场极端乐观情绪发生在南非奥密戎新冠新毒株被发现之时。本次利率下行的逻辑为宽松政策预期发酵。在此期间先有总理在世界经济论坛全球企业家特别对话会及专家和企业家座谈会上称“当前中国面临新的下行压力，继续面向市场主体需求制定实施宏观政策”；后有央行三季度货币政策执行报告删除“管好货币总闸门”和“不搞大水漫灌”。12月前两句市场一直在进一步的宽货币和来年经济开门红的预期之间摇摆，利率窄幅震荡。在此期间虽然有降准落地，但由于此前该事件已被price in，市场对此反应非常有限。直至12月下旬降准资金落地，宽松资金面及来年降息预期带动10年期国债收益率再次下行8bp左右，出现四季度第三个利率快速下行期，其特征为中端收益率下行幅度明显大于短端与长端，活跃券成交量明显压缩。

报告期内，一季度本基金固收部分适当加仓短久期信用债，赚取稳定息差。在二季度的操作中，基金固收部分增配长久期利率债，拉长产品久期，赚取资本利得。三季度，基金固收部分保持高杠杆高久期的操作，同时在市场调整的时候及时止盈。四季度，基金固收部分适当加仓短久期高等级信用债和中长久期利率债，将杠杆维持在适当位置，赚取稳定息差，同时通过长久期利率债波段交易增厚盈利。

权益方面，2021年，A股市场继续延续了分化的特征，在整体市场表现平平的背景下，涌现了不少结构性的投资机会，包括周期、新能源、中小市值等等，但是这些机会在时间上的持续性都并不长，持续获得高收益的难度较大，因此去年投资者的平均回报依然平平，但是方差极大。2021年，随着时间推移，行情散乱化的特征不断加强，尤其到了四季度，各种热点、概念、小市值有了爆发式的表现。2021前三季度，全部A股收益中位数跌幅超过1%，但是全年涨幅中位数接近9%，显示出四季度行情实际上是近几年少见的全面火热。

对于2021年的权益行情，在2020年时本基金的基调判断是相对保守的，认为市场的预期收益率需要明显降低。从整体来看，市场大体符合这一判断，但是局部热点的强度超出本基金的预期。不断涌现、更新的热点，本基金认为其本质是流动性泛滥、但是基本面整体疲软下的资产荒行情。充裕资金面对不断下行的整体收益率，并没有选择下调风险偏好而是不断地在场内左冲右突。本基金认为，股票市场的长期回报仍然是由基本面决定，历史上的大多数资产荒都将以资产荒收尾。而不断散乱化的行情特征，本身也更多是牛市中后期的特征。2021年全年，出于预期收益率下降的判断，本基金控制并缓

慢降低仓位水平，而在个股选择上则继续保持自下而上策略，依据预期收益率的变化，主要的操作包括削减了金融行业的配置，增加了部分新增标的，而对大多数涨跌幅仍在可接受范围内的标的则持续持有，基金的换手率继续保持低水平。全年来看，本基金绝对收益水平超过此前的预期，并且好于股票型基金的平均水平。这主要还是得益于基金投资的部分个股短期透支了长期涨幅所致，当然对于这一类标的，本基金也都做了相应的减持。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加科丰价值精选混合基金份额净值为1.2119元，本报告期内，基金份额净值增长率为8.35%，同期业绩比较基准收益率为-0.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券方面，展望后市，未来一段时间债市预计以震荡为主1月社融及信贷超预期、海外货币政策收紧压力持续加大一定程度上改变了市场的乐观心态，但1月金融数据的政策信号意义大于实际影响，往后看政策力度能否延续、内需何时真正反转仍然存在不确定性。目前中美利差还有80BP，基本位于合意区间下沿、尚未压缩到极低的位置，而人民币与美元双边汇率保持在6.40以下，国内货币政策在稳增长出现显著成效前不会转向，现阶段海外环境虽不利好债券，但对国内债市的传导有限，短期内债市预计维持震荡格局。中期来看，海外产能恢复与基数效应影响下的出口回落、通胀缓解及政策路径明确引发的海外货币政策预期修正均对债券偏利好，市场将逐步开始对宽财政政策持续性的博弈，而跨周期政策框架决定了宽财政的力度必然是有限的，建议关注届时的债券投资机会。

权益方面，本基金从2020年底开始认为市场长期收益率开始走低，应当随之调整对于股票市场的配置，并在2021年开始缓慢地按照计划执行，已经基本执行完毕。目前，本基金仍然认为对于股票市场保持一个适度中性的配置是比较合适的。目前股票市场面对的基本面组合，并不支持很高的系统性机会或系统性风险。从长期角度看，经济增长仍会缓慢下行，金融周期也一定会面临反转，而目前市场的整体估值水平已经高于合理水平，尽管幅度还可控。因此长期来看，对于股票市场的收益率水平不能给予太高期待。而中短期来看，不算太过分的估值水平，偏低的利率水平，今年的稳增长环境，也不支持出现太大的系统性风险。超预期的中短期系统性机会主要可能来自于稳增长的超预期，而超预期的中短期系统性风险则主要可能来自于通胀水平和海外市场波动。而结构性的风险，目前依然明显存在。这些观点本基金在此前都曾表达过，目前并没有太大的改变。本基金将继续保持对于市场的关注，根据判断的变化，及时调整组合。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规，切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，由督察长、监察稽核部门定期与不定期的对基金的投资、交易、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。加强合规风险的事前控制，认真履行依法监督检查职责，促进基金运作的合法合规性和风险管理水平的提高；严格事前的监督审查和控制机制，对基金募集、市场营销、受托资产的投资管理、信息披露等方面均进行事先的合法合规审查工作；在风控系统中设置投资合规参数，对投资行为进行事中监控和预警；根据业务发展情况开展专项稽核，通过事后检查的方式促使投资运作合法合规。除此之外，公司监察稽核部门对各业务部门拟定的制度规范进行合规性审核，确保业务流程的合法合规；对公司员工进行法律法规宣导并组织合规培训，增强员工合规意识并营造公司整体的合规文化氛围。

同时，基金管理人还制定了具体、严格的投资授权流程和权限；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并根据相关规定呈报中国证监会或其派出机构以及公司董事会。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组和风险内控小组。公司负责人（或其指定管理人员）任估值小组负责人，成员由固定收益部负责人、投资研究部门相关业务负责人、运营保障部门负责人、基金会计人员、投资研究相关人员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司分管风险管理业务的副总经理任风险内控小组负责人，成员包括风险管理部门、监察稽核部门相关人员、交易员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

- 1、若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、基金可供分配利润为正的前提下，方可进行收益分配；
- 6、投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；
- 7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定；
- 8、本基金本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于人民币五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，对中加科丰价值精选混合型证券投资基金2021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，中加基金管理有限公司在中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金的投资运作、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，中加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2021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、投资组合报告等信息真实、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	毕马威华振审字第2202411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	中加科丰价值精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的中加科丰价值精选混合型证券投资基金（以下简称“中加科丰基金”）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，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了中加科丰基金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。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“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，我们独立于中加科丰基金，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	-
其他事项	-
其他信息	<p>中加科丰基金管理人中加基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括中加科丰基金2021年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作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，基金管理人管理层负责评估中加科丰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，除非中加科丰基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督中加科丰基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于</p>

	<p>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）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中加科丰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中加科丰基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	李砾、刘宇宁

会计师事务所的地址	中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2022-03-29

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中加科丰价值精选混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	138,675,054.83	50,163,034.70
结算备付金		105,397.92	165,596.82
存出保证金		38,999.99	73,586.47
交易性金融资产	7.4.7.2	1,193,598,787.66	769,071,252.25
其中：股票投资		191,527,787.66	135,630,252.25
基金投资		-	-
债券投资		1,002,071,000.00	633,441,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,352,145.21	1,757,052.86
应收利息	7.4.7.5	17,433,830.28	8,524,006.64
应收股利		-	-
应收申购款		348,773.13	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,355,552,989.02	829,754,529.74
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2021年12月31日	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		55,999,682.00	81,989,677.01
应付证券清算款		1,653,602.64	-
应付赎回款		799,375.25	-
应付管理人报酬		534,609.86	374,960.53
应付托管费		89,101.66	62,493.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	463,959.56	85,471.59
应交税费		64,618.66	46,364.53
应付利息		19,621.61	28,937.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	210,777.47	89,000.00
负债合计		59,835,348.71	82,676,904.32
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,069,168,112.49	667,950,879.42
未分配利润	7.4.7.10	226,549,527.82	79,126,746.00
所有者权益合计		1,295,717,640.31	747,077,625.42
负债和所有者权益总计		1,355,552,989.02	829,754,529.74

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值为1.2119元，基金份额总额1,069,168,112.49份。

7.2 利润表

会计主体：中加科丰价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2021年01月01日至 2021年12月31日	2020年05月08日（基金 合同生效日）至2020年 12月31日
一、收入		75,780,369.35	66,596,210.76
1. 利息收入		25,697,160.66	11,337,085.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	225,136.39	138,680.74
债券利息收入		25,345,383.98	10,923,454.27
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		126,640.29	274,950.92
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		69,066,045.70	24,916,014.72
其中：股票投资收益	7.4.7.12	67,969,791.20	24,335,722.12
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-2,313,079.13	-982,161.57
资产支持证券投资 收益	7.4.7.14. 3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	3,409,333.63	1,562,454.17
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.18	-19,180,685.90	30,343,001.50
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.19	197,848.89	108.61
减：二、费用		9,090,863.83	3,572,163.57
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	5,001,204.66	2,049,306.69

2. 托管费	7.4.10.2. 2	833,534.26	341,551.07
3. 销售服务费	7.4.10.2. 3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	903,041.61	441,164.46
5. 利息支出		2,045,671.27	527,565.90
其中：卖出回购金融资产支出		2,045,671.27	527,565.90
6. 税金及附加		53,603.68	30,775.45
7. 其他费用	7.4.7.21	253,808.35	181,800.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		66,689,505.52	63,024,047.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		66,689,505.52	63,024,047.19

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中加科丰价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	667,950,879.42	79,126,746.00	747,077,625.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	66,689,505.52	66,689,505.52
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	401,217,233.07	80,733,276.30	481,950,509.37

列)			
其中：1. 基金申购款	842,047,139.33	147,570,948.48	989,618,087.81
2. 基金赎回款	-440,829,906.26	-66,837,672.18	-507,667,578.44
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）	1,069,168,112.49	226,549,527.82	1,295,717,640.31
项 目	上年度可比期间		
	2020年05月08日（基金合同生效日）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）	350,071,562.96	-	350,071,562.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	63,024,047.19	63,024,047.19
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）	317,879,316.46	21,045,083.23	338,924,399.69
其中：1. 基金申购款	317,879,345.59	21,045,085.88	338,924,431.47
2. 基金赎回款	-29.13	-2.65	-31.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净	-	-4,942,384.42	-4,942,384.42

值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	667,950,879.42	79,126,746.00	747,077,625.42

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：

夏英

陈昕

陈昕

—————

—————

—————

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

中加科丰价值精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2019年11月7日证监许可[2019]2221号文准予募集注册，由中加基金管理有限公司（以下简称“中加基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）公开募集。本基金为契约型开放式混合型基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金，托管人为中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）。

本基金通过中加基金及基金代销机构共同销售，募集期为2020年4月28日起至2020年4月30日。本基金于2020年5月8日成立，成立之日基金实收份额为350,071,562.96份（含利息转份额31,204.87份），发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中加科丰价值精选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具（含同业存单）、债券回购、银行存款、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况、2021年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金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所采用的会计政策、会计估计相一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

(2) 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

(3) 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

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

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

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

(1) 所转移金融资产的账面价值

(2) 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益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确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认,合同利率与实际利率法确定的收入差异较小的可采用合同利率。

公允价值变动损益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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、托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认,合同利率与实际利率法确定的支出差异较小的可采用合同利率。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊,则于发生时直接计入基金损益;如需采用预提或待摊的方法,预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;
- 2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;
- 4、每一基金份额享有同等分配权;
- 5、基金可供分配利润为正的前提下,方可进行收益分配;

6、投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；

7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中债金融估值中心有限公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]

85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(2)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(3)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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

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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按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。

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

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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	138,675,054.83	50,163,034.70
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	138,675,054.83	50,163,034.70

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		181,256,277.90	191,527,787.66	10,271,509.76
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	1,001,180,194.16	1,002,071,000.00	890,805.84
	合计	1,001,180,194.16	1,002,071,000.00	890,805.84
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,182,436,472.06	1,193,598,787.66	11,162,315.60
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		101,072,831.01	135,630,252.25	34,557,421.24
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	637,655,419.74	633,441,000.00	-4,214,419.74
	合计	637,655,419.74	633,441,000.00	-4,214,419.74
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		738,728,250.75	769,071,252.25	30,343,001.50

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	10,405.36	4,707.14
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	52.14	81.95
应收债券利息	17,423,353.42	8,519,181.14
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	19.36	36.41
合计	17,433,830.28	8,524,006.64

注：其他为应收存出保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	436,099.99	70,722.65
银行间市场应付交易费用	27,859.57	14,748.94
合计	463,959.56	85,471.59

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	1,477.47	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用-审计费	80,300.00	80,000.00
预提费用-信息披露费	120,000.00	-
预提费用-账户维护费	9,000.00	9,000.00
合计	210,777.47	89,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	667,950,879.42	667,950,879.42
本期申购	842,047,139.33	842,047,139.33
本期赎回（以“-”号填列）	-440,829,906.26	-440,829,906.26
本期末	1,069,168,112.49	1,069,168,112.49

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,577,077.41	43,549,668.59	79,126,746.00
本期利润	85,870,191.42	-19,180,685.90	66,689,505.52
本期基金份额交易产生的变动数	63,486,856.69	17,246,419.61	80,733,276.30
其中：基金申购款	114,492,291.16	33,078,657.32	147,570,948.48
基金赎回款	-51,005,434.47	-15,832,237.71	-66,837,672.18
本期已分配利润	-	-	-

本期末	184,934,125.52	41,615,402.30	226,549,527.82
-----	----------------	---------------	----------------

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月08日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	213,231.17	95,451.59
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	3,209.01	10,888.35
其他	8,696.21	32,340.80
合计	225,136.39	138,680.74

注：其他包含存出保证金利息收入和申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月08日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	302,866,730.70	130,693,621.22
减：卖出股票成本总额	234,896,939.50	106,357,899.10
买卖股票差价收入	67,969,791.20	24,335,722.12

7.4.7.13 基金投资收益

本基金在报告期内及上年度均无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月08日（基金合同生效 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	-2,313,079.13	-982,161.57
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	-2,313,079.13	-982,161.57

注：本基金本报告期内无债转股业务。

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年05月08日（基金合同生效日） 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	1,871,143,193.57	72,454,051.81
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,844,099,435.98	71,503,631.48
减：应收利息总额	29,356,836.72	1,932,581.90
买卖债券差价收入	-2,313,079.13	-982,161.57

7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期及上年度均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金于本报告期内及上年度均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期及上年度均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期及上年度均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月08日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,409,333.63	1,562,454.17
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	3,409,333.63	1,562,454.17

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年05月08日（基金合同生效日） 至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-19,180,685.90	30,343,001.50
——股票投资	-24,285,911.48	34,557,421.24
——债券投资	5,105,225.58	-4,214,419.74
——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	-19,180,685.90	30,343,001.50

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月08日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	197,839.97	0.10
转换费收入	8.92	-
其他	-	108.51
合计	197,848.89	108.61

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月08日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	872,783.33	432,589.46
银行间市场交易费用	30,258.28	8,575.00
合计	903,041.61	441,164.46

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月08日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
审计费用	80,300.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	16,428.35	-
上清所账户维护费	17,880.00	10,500.00
中债登账户维护费	18,000.00	10,500.00
其他费用	1,200.00	400.00
证券账户开户费	-	400.00
合计	253,808.35	181,800.00

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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
中加基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人
北京银行股份有限公司	基金管理人股东
The Bank of Nova Scotia	基金管理人股东
有研科技集团有限公司	基金管理人股东
北京乾融投资（集团）有限公司	基金管理人股东
中地种业（集团）有限公司	基金管理人股东
绍兴越华开发经营有限公司	基金管理人股东
北银丰业资产管理有限公司	基金管理人控股子公司
中加国际资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

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

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度均无应支付关联方的佣金。

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01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年05月08日（基金合同 生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,001,204.66	2,049,306.69
其中：支付销售机构的客户维护费	290,637.85	-

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年05月08日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	833,534.26	341,551.07

注：支付基金托管人中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10% /当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间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 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年05月08日（基金合同生效日） 至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	138,675,054.83	213,231.17	50,163,034.70	95,451.59

注：本基金通过“中信银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于2021年12月31日的相关余额为人民币144,397.91元(2020年12月31日：人民币239,183.29元)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与各关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	首次公开发行带锁定期	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行带锁定期	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行带锁定期	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301018	申菱环境	2021-06-	2022-01-	首次公开发行	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.9	-

		28	07	带锁定期					2	
3010 39	中集 车辆	2021 -07- 01	2022 -01- 10	首次公 开发行 带锁定期	6.96	12.5 1	2,064	14,3 65.4 4	25,8 20.6 4	-
6887 93	倍轻 松	2021 -07- 07	2022 -01- 17	首次公 开发行 带锁定期	27.4 0	101. 73	1,454	39,8 39.6 0	147, 915. 42	-
3010 26	浩通 科技	2021 -07- 08	2022 -01- 17	首次公 开发行 带锁定期	18.0 3	62.7 3	203	3,66 0.09	12,7 34.1 9	-
3010 27	华蓝 集团	2021 -07- 08	2022 -01- 19	首次公 开发行 带锁定期	11.4 5	16.6 5	286	3,27 4.70	4,76 1.90	-
3010 28	东亚 机械	2021 -07- 12	2022 -01- 20	首次公 开发行 带锁定期	5.31	13.5 0	733	3,89 2.23	9,89 5.50	-
3010 25	读客 文化	2021 -07- 06	2022 -01- 24	首次公 开发行 带锁定期	1.55	20.8 8	403	624. 65	8,41 4.64	-
3010 30	仕净 科技	2021 -07- 15	2022 -01- 24	首次公 开发行 带锁定期	6.10	31.5 2	242	1,47 6.20	7,62 7.84	-
3010 32	新柴 股份	2021 -07- 15	2022 -01- 24	首次公 开发行 带锁定期	4.97	12.5 1	513	2,54 9.61	6,41 7.63	-

3010 29	怡合 达	2021 -07- 14	2022 -01- 24	首次公 开发行 带锁定 期	14.1 4	89.8 7	462	6,53 2.68	41,5 19.9 4	-
3010 33	迈普 医学	2021 -07- 15	2022 -01- 26	首次公 开发行 带锁定 期	15.1 4	59.9 7	108	1,63 5.12	6,47 6.76	-
3008 14	中富 电路	2021 -08- 04	2022 -02- 14	首次公 开发行 带锁定 期	8.40	23.8 8	328	2,75 5.20	7,83 2.64	-
3009 94	久祺 股份	2021 -08- 02	2022 -02- 14	首次公 开发行 带锁定 期	11.9 0	45.4 5	420	4,99 8.00	19,0 89.0 0	-
3010 46	能辉 科技	2021 -08- 10	2022 -02- 17	首次公 开发行 带锁定 期	8.34	48.9 9	290	2,41 8.60	14,2 07.1 0	-
3010 48	金鹰 重工	2021 -08- 11	2022 -02- 28	首次公 开发行 带锁定 期	4.13	12.9 6	843	3,48 1.59	10,9 25.2 8	-
3010 49	超越 科技	2021 -08- 17	2022 -02- 24	首次公 开发行 带锁定 期	19.3 4	32.9 2	196	3,79 0.64	6,45 2.32	-
3010 56	森赫 股份	2021 -08- 27	2022 -03- 07	首次公 开发行 带锁定 期	3.93	11.0 9	572	2,24 7.96	6,34 3.48	-
3010 57	汇隆 新材	2021 -08- -	2022 -03- -	首次公 开发行	8.03	19.0 2	218	1,75 0.54	4,14 6.36	-

		31	09	带锁定期						
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	首次公开发行带锁定期	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	首次公开发行带锁定期	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	首次公开发行带锁定期	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	首次公开发行带锁定期	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	首次公开发行带锁定期	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	首次公开发行带锁定期	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	首次公开发行带锁定期	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	首次公开发行带锁定期	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-

301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	首次公开发行带锁定期	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	首次公开发行带锁定期	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	首次公开发行带锁定期	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
688722	同益中	2021-10-08	2022-04-19	首次公开发行带锁定期	4.51	10.19	3,687	16,628.37	37,570.53	-
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	首次公开发行带锁定期	93.09	75.34	411	38,259.99	30,964.74	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	首次公开发行带锁定期	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	首次公开发行带锁定期	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	首次公开发行带锁定期	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301093	华兰股份	2021-10-	2022-05-	首次公 开发行	58.08	49.85	409	23,754.7	20,388.6	-

		21	05	带锁定期				2	5	
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	首次公开发行带锁定期	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	首次公开发行带锁定期	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	首次公开发行带锁定期	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301180	万祥科技	2021-11-09	2022-05-16	首次公开发行带锁定期	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
688182	灿勤科技	2021-11-09	2022-05-16	首次公开发行带锁定期	10.50	20.44	18,387	193,063.50	375,830.28	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	首次公开发行带锁定期	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301185	鸥玛软件	2021-11-11	2022-05-19	首次公开发行带锁定期	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301099	雅创电子	2021-11-10	2022-05-23	首次公开发行带锁定期	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-

6882 65	南模 生物	2021 -12- 21	2022 -06- 28	首次公 开发行 带锁定 期	84.6 2	65.0 3	2,374	200, 887. 88	154, 381. 22	-
------------	----------	--------------------	--------------------	------------------------	-----------	-----------	-------	--------------------	--------------------	---

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2021年12月31日，本基金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2021年12月31日止，本基金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55,999,682.00元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估 值单价	数量（张）	期末估值总额
200207	20国开07	2022-01-04	100.84	75,000	7,563,000.00
210206	21国开06	2022-01-04	100.07	527,000	52,736,890.00
合计				602,000	60,299,890.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金在日常经营活动中面临各种金融工具的风险，主要

包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在控制风险并保持资产流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指本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。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人中信银行股份有限公司和信用风险较低的股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金投资于信用类产品以及投资于资产支持证券的信用级别评级应为BBB以上（含BBB），在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	20,150,000.00	89,893,000.00
A-1以下	-	-
未评级	130,097,000.00	109,774,000.00

合计	150,247,000.00	199,667,000.00
----	----------------	----------------

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为期限在一年及以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 以上数据不含同业存单及资产支持证券。

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	405,364,000.00	303,055,000.00
AAA以下	224,620,000.00	110,621,000.00
未评级	221,840,000.00	20,098,000.00
合计	851,824,000.00	433,774,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券主要为期限在一年以上的国债、政策性金融债及其他未有第三方机构评级的债务融资工具。

3. 以上数据不含同业存单及资产支持证券。

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。

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的投资品种比例等。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，除前文披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。

于2021年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有55,999,682.00元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金的流动性风险管理，按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性风险管理相关制度，对基金组合资产流动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金管理人定期对基金面临的利率敏感度缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	138,675,054.83	-	-	-	138,675,054.83
结算备付金	105,397.92	-	-	-	105,397.92
存出保证金	38,999.99	-	-	-	38,999.99
交易性金融资产	362,459,000.00	639,612,000.00	-	191,527,787.66	1,193,598,787.66
应收证券清算款	-	-	-	5,352,145.21	5,352,145.21
应收利息	-	-	-	17,433,830.28	17,433,830.28
应收申购款	-	-	-	348,773.13	348,773.13
资产总计	501,278,452.74	639,612,000.00	-	214,662,536.28	1,355,552,989.02
负债					
卖出回购金融资产款	55,999,682.00	-	-	-	55,999,682.00
应付证券清算款	-	-	-	1,653,602.64	1,653,602.64
应付赎回款	-	-	-	799,375.25	799,375.25
应付管理人报酬	-	-	-	534,609.86	534,609.86
应付托管费	-	-	-	89,101.66	89,101.66
应付交易费用	-	-	-	463,959.56	463,959.56
应交税费	-	-	-	64,618.66	64,618.66
应付利息	-	-	-	19,621.61	19,621.61
预提费用	-	-	-	209,300.00	209,300.00

应付赎回费	-	-	-	1,477.47	1,477.47
负债总计	55,999,682.00	-	-	3,835,666.71	59,835,348.71
利率敏感度缺口	445,278,770.74	639,612,000.00	-	210,826,869.57	1,295,717,640.31
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	50,163,034.70	-	-	-	50,163,034.70
结算备付金	165,596.82	-	-	-	165,596.82
存出保证金	73,586.47	-	-	-	73,586.47
交易性金融资产	512,159,000.00	121,282,000.00	-	135,630,252.25	769,071,252.25
应收证券清算款	-	-	-	1,757,052.86	1,757,052.86
应收利息	-	-	-	8,524,006.64	8,524,006.64
资产总计	562,561,217.99	121,282,000.00	-	145,911,311.75	829,754,529.74
负债					
卖出回购金融资产款	81,989,677.01	-	-	-	81,989,677.01
应付管理人报酬	-	-	-	374,960.53	374,960.53
应付托管费	-	-	-	62,493.42	62,493.42
应付交易费用	-	-	-	85,471.59	85,471.59
应交税费	-	-	-	46,364.53	46,364.53
应付利息	-	-	-	28,937.24	28,937.24
预提费	-	-	-	89,000.00	89,000.00

用					
负债总计	81,989,677.01	-	-	687,227.31	82,676,904.32
利率敏感度缺口	480,571,540.98	121,282,000.00	-	145,224,084.44	747,077,625.42

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率下降25个基点	3,482,196.73	1,108,521.75
	市场利率上升25个基点	-3,482,196.73	-1,108,521.75

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格的风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法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	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	191,527,787.66	14.78	135,630,252.25	18.15
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,002,071,000.00	77.34	633,441,000.00	84.79
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	1,193,598,787.66	92.12	769,071,252.25	102.94

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较标准以外的其他市场变量保持不变； Beta系数是根据成立以来的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	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）	
分析		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	23,092,675.94	-
	业绩比较基准下降5%	-23,092,675.94	-

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 以公允价值计量的资产和负债

本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次列示如下。公允价值计量结果所属层次取

决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于2021年12月31日，本基金持有的持续以公允价值计量的资产总额为人民币1,193,598,787.66元，属于第一层次的交易性金融资产为人民币189,920,718.55元，均为股票投资；属于第二层次的交易性金融资产为人民币1,003,373,289.20元，其中股票投资为人民币1,302,289.20元，债券投资为人民币1,002,071,000.00元；属于第三层次的交易性金融资产为人民币304,779.91元，均为股票投资。

于2020年12月31日，本基金持有的持续以公允价值计量的资产总额为人民币769,071,252.25元，属于第一层次的交易性金融资产为人民币134,118,908.04元，均为股票投资；属于第二层次的交易性金融资产为人民币634,805,983.09元，其中股票投资为人民币1,364,983.09元，债券投资为人民币633,441,000.00元；属于第三层次的交易性金融资产为人民币146,361.12元，均为股票投资。

于2021年12月31日，本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次，账面价值为人民币1,607,069.11元(2020年12月31日：人民币1,511,344.21元)。于2021年12月31日，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具在三个层次之间发生了转换，由第二层次转换为第一层次，账面价值为人民币902,398.52元(2020年12月31日：无)。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(a) 第二层次及第三层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2020年12月31日：无)。

7.4.14.2其他金融工具的公允价值(期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 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	191,527,787.66	14.13
	其中：股票	191,527,787.66	14.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,002,071,000.00	73.92
	其中：债券	1,002,071,000.00	73.92
	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	138,780,452.75	10.24
8	其他各项资产	23,173,748.61	1.71
9	合计	1,355,552,989.02	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	15,403,680.00	1.19
C	制造业	119,399,947.06	9.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	212,883.75	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	19,573,962.15	1.51

H	住宿和餐饮业	3,597,483.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	618,167.46	0.05
J	金融业	17,916,469.00	1.38
K	房地产业	7,516,763.28	0.58
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	330,501.56	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	6,890,342.19	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	37,906.44	0.00
S	综合	-	-
	合计	191,527,787.66	14.78

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601088	中国神华	684,000	15,403,680.00	1.19
2	688026	洁特生物	143,996	12,694,687.36	0.98
3	600276	恒瑞医药	204,480	10,369,180.80	0.80
4	000429	粤高速 A	1,236,086	9,147,036.40	0.71
5	000002	万科 A	380,403	7,516,763.28	0.58
6	603043	广州酒家	291,220	7,006,753.20	0.54
7	600019	宝钢股份	975,860	6,987,157.60	0.54
8	300791	仙乐健康	167,299	6,976,368.30	0.54

9	600323	瀚蓝环境	327,100	6,862,558.00	0.53
10	688596	正帆科技	257,666	6,660,666.10	0.51
11	600350	山东高速	1,279,700	6,603,252.00	0.51
12	603855	华荣股份	251,100	6,347,808.00	0.49
13	601633	长城汽车	126,800	6,154,872.00	0.48
14	000895	双汇发展	182,800	5,767,340.00	0.45
15	601601	中国太保	166,800	4,523,616.00	0.35
16	601939	建设银行	702,900	4,118,994.00	0.32
17	002206	海利得	406,000	3,605,280.00	0.28
18	600258	首旅酒店	137,500	3,592,875.00	0.28
19	000513	丽珠集团	87,600	3,522,396.00	0.27
20	600919	江苏银行	568,500	3,314,355.00	0.26
21	000001	平安银行	197,100	3,248,208.00	0.25
22	002311	海大集团	44,000	3,225,200.00	0.25
23	688212	澳华内镜	84,243	3,181,858.11	0.25
24	002675	东诚药业	193,500	3,053,430.00	0.24
25	600079	人福医药	135,400	3,049,208.00	0.24
26	300476	胜宏科技	99,200	3,000,800.00	0.23
27	000333	美的集团	40,200	2,967,162.00	0.23
28	300421	力星股份	131,000	2,871,520.00	0.22
29	688558	国盛智科	61,678	2,787,845.60	0.22
30	601166	兴业银行	142,400	2,711,296.00	0.21
31	300775	三角防务	55,000	2,688,950.00	0.21
32	002925	盈趣科技	72,060	2,452,201.80	0.19
33	002867	周大生	129,400	2,300,732.00	0.18
34	002352	顺丰控股	27,500	1,895,300.00	0.15
35	601006	大秦铁路	294,100	1,882,240.00	0.15
36	603187	海容冷链	35,952	1,705,922.40	0.13
37	300673	佩蒂股份	81,300	1,665,024.00	0.13
38	688550	瑞联新材	16,551	1,641,362.67	0.13
39	002701	奥瑞金	194,100	1,358,700.00	0.10

40	300760	迈瑞医疗	3,100	1,180,480.00	0.09
41	002444	巨星科技	27,097	826,729.47	0.06
42	688656	浩欧博	6,635	418,005.00	0.03
43	688595	芯海科技	3,190	396,995.50	0.03
44	688182	灿勤科技	18,387	375,830.28	0.03
45	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.02
46	688246	嘉和美康	7,719	282,206.64	0.02
47	688097	博众精工	3,983	185,846.78	0.01
48	688265	南模生物	2,374	154,381.22	0.01
49	688793	倍轻松	1,454	147,915.42	0.01
50	301046	能辉科技	2,891	146,077.80	0.01
51	688345	博力威	2,332	138,987.20	0.01
52	688609	九联科技	10,372	130,894.64	0.01
53	688359	三孚新科	2,213	129,814.58	0.01
54	301078	孩子王	7,551	122,178.69	0.01
55	301028	东亚机械	7,329	100,722.42	0.01
56	301030	仕净科技	2,417	77,945.59	0.01
57	688217	睿昂基因	1,040	75,628.80	0.01
58	688571	杭华股份	8,200	69,618.00	0.01
59	301056	森赫股份	5,716	65,653.80	0.01
60	301032	新柴股份	5,124	65,484.54	0.01
61	688616	西力科技	3,918	52,422.84	0.00
62	688618	三旺通信	1,117	49,583.63	0.00
63	603565	中谷物流	1,625	46,133.75	0.00
64	301068	大地海洋	1,436	43,660.68	0.00
65	301079	邵阳液压	1,396	43,352.80	0.00
66	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
67	688681	科汇股份	1,899	38,245.86	0.00
68	688722	同益中	3,687	37,570.53	0.00
69	688067	爱威科技	1,259	35,012.79	0.00
70	003026	中晶科技	460	34,063.00	0.00

71	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
72	301087	可孚医疗	411	30,964.74	0.00
73	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
74	605077	华康股份	618	25,863.30	0.00
75	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
76	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
77	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
78	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
79	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
80	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
81	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
82	001216	华瓷股份	1,177	19,667.67	0.00
83	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
84	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
85	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
86	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
87	300986	志特新材	264	16,898.64	0.00
88	300997	欢乐家	928	16,082.24	0.00
89	300614	百川畅银	329	15,792.00	0.00
90	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
91	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
92	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
93	300985	致远新能	295	14,460.90	0.00
94	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
95	300933	中辰股份	1,112	13,588.64	0.00
96	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
97	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
98	300942	易瑞生物	443	12,784.98	0.00
99	003005	竞业达	412	12,776.12	0.00
100	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00

10 1	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
10 2	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
10 3	300993	玉马遮阳	410	11,771.10	0.00
10 4	300987	川网传媒	301	11,678.80	0.00
10 5	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
10 6	300937	药易购	244	11,114.20	0.00
10 7	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
10 8	301002	崧盛股份	201	10,813.80	0.00
10 9	300882	万胜智能	572	10,759.32	0.00
11 0	300945	曼卡龙	474	9,968.22	0.00
11 1	300889	爱克股份	479	9,263.86	0.00
11 2	300879	大叶股份	466	9,212.82	0.00
11 3	300950	德固特	219	9,143.25	0.00
11 4	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
11 5	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
11 6	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
11	300881	盛德鑫泰	291	8,081.07	0.00

7					
11 8	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
11 9	300931	通用电梯	672	7,808.64	0.00
12 0	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
12 1	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
12 2	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
12 3	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
12 4	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
12 5	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
12 6	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
12 7	300886	华业香料	191	5,794.94	0.00
12 8	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
12 9	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
13 0	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
13 1	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
13 2	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
13 3	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00

13 4	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
13 5	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601633	长城汽车	11,438,319.00	1.53
2	600276	恒瑞医药	11,304,712.10	1.51
3	600019	宝钢股份	11,015,407.40	1.47
4	300791	仙乐健康	10,288,497.85	1.38
5	601088	中国神华	10,241,868.00	1.37
6	688026	洁特生物	9,983,021.84	1.34
7	601601	中国太保	9,633,701.00	1.29
8	600919	江苏银行	9,085,460.00	1.22
9	600350	山东高速	8,590,505.00	1.15
10	000429	粤高速 A	8,568,996.69	1.15
11	000001	平安银行	7,972,928.00	1.07
12	600323	瀚蓝环境	7,363,546.36	0.99
13	001914	招商积余	7,225,389.00	0.97
14	000002	万科 A	7,188,457.01	0.96
15	688596	正帆科技	6,276,939.93	0.84
16	603855	华荣股份	6,257,745.41	0.84
17	002206	海利得	6,164,818.00	0.83
18	300775	三角防务	6,030,080.00	0.81
19	000895	双汇发展	6,012,117.00	0.80
20	601939	建设银行	5,929,005.00	0.79

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	601633	长城汽车	45,067,187.33	6.03
2	002206	海利得	16,595,213.00	2.22
3	002925	盈趣科技	9,919,497.00	1.33
4	000001	平安银行	9,124,717.00	1.22
5	600919	江苏银行	8,141,503.50	1.09
6	688301	奕瑞科技	7,631,819.94	1.02
7	002191	劲嘉股份	6,860,516.00	0.92
8	001914	招商积余	6,518,359.00	0.87
9	300791	仙乐健康	6,382,432.77	0.85
10	000932	华菱钢铁	6,269,847.00	0.84
11	601088	中国神华	6,110,250.00	0.82
12	600887	伊利股份	5,990,374.00	0.80
13	601318	中国平安	4,956,398.00	0.66
14	000538	云南白药	4,856,066.00	0.65
15	002444	巨星科技	4,635,359.75	0.62
16	600019	宝钢股份	4,506,491.00	0.60
17	601166	兴业银行	4,277,701.00	0.57
18	002027	分众传媒	4,006,508.00	0.54
19	600036	招商银行	3,862,438.00	0.52
20	601808	中海油服	3,812,519.00	0.51

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	315,080,386.39
卖出股票收入（成交）总额	302,866,730.70

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照成交单价乘以成交数量填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	262,377,000.00	20.25
	其中：政策性金融债	211,075,000.00	16.29
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,177,000.00	3.87
6	中期票据	689,517,000.00	53.22
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,002,071,000.00	77.34

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	210206	21国开06	1,000,000	100,070,000.00	7.72
2	200207	20国开07	500,000	50,420,000.00	3.89
3	101900299	19江北国资MT N001	300,000	31,395,000.00	2.42
4	1928022	19兴业银行二 级01	300,000	30,912,000.00	2.39
5	102100559	21青岛国信MT N001	300,000	30,633,000.00	2.36

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	38,999.99
2	应收证券清算款	5,352,145.21
3	应收股利	-
4	应收利息	17,433,830.28
5	应收申购款	348,773.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,173,748.61

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
6,303	169,628.45	1,007,099,636.27	94.19%	62,068,476.22	5.81%

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	24,071.08	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年05月08日)基金份额总额	350,071,562.96
本报告期期初基金份额总额	667,950,879.42
本报告期基金总申购份额	842,047,139.33
减：本报告期基金总赎回份额	440,829,906.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,069,168,112.49

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

涉及基金管理人的重大人事变动：无。

涉及基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

1. 2021年3月15日，中信银行股份有限公司对外公告，李庆萍女士因工作安排原因，辞去本行董事长、执行董事及董事会战略发展委员会主席和委员职务。

2. 2021年6月23日，中信银行股份有限公司收到《中国银保监会关于中信银行朱鹤新任职资格的批复》（银保监【2021】492号），中国银行保险监督管理委员会（简称“银保监会”）已核准朱鹤新先生担任本行非执行董事、董事长的任职资格。

3. 2021年9月4日，中信银行股份有限公司收到已完成法定代表人变更的工商登记手续的通知，自2021年9月2日起，法定代表人由李庆萍女士变更为朱鹤新先生。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内应支付审计费80,300.00元，目前已提供审计服务的年限为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

本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员在本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

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	
华泰证券	2	330,770,480.94	55.47%	241,891.91	55.47%	-
华西证券	2	265,567,473.29	44.53%	194,208.08	44.53%	-

注：1. 公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

- (1) 基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；
- (2) 公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；
- (3) 研究服务实力。

2. 券商及交易单元的选择流程如下：

(1) 投资研究部经集体讨论后遵照《中加基金管理有限公司交易单元管理办法》标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；

(2) 公司执行委员会负责审批、确定券商名单及相应的席位租用安排；

(3) 券商名单及相应的席位租用安排确定后，由监察稽核门部负责审查相关协议内容，交易室负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

3. 投资研究部于每年第一季度内根据《券商选择标准评分表》对券商进行重新评估，拟定是否需要新增、续用或取消券商、调整相应席位安排，并报公司执行委员会审批、确定。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中加基金管理有限公司关于旗下部分基金开通基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-01
2	中加科丰价值精选混合型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
3	中加科丰价值精选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-08
4	中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-08
5	中加基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-08
6	中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-10
7	中加科丰价值精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-10
8	关于中加科丰价值精选混合型证券投资基金恢复大额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-10
9	中加科丰价值精选混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
10	中加科丰价值精选混合型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21
11	中加基金管理有限公司关于中加科丰价值精选混合型证券投资基金增加珠海盈米财富管理有限公司为代理销售	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-06

	机构并开通基金定期定额投资业务的公告		
12	中加科丰价值精选混合型证券投资基金暂停大额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-14
13	中加科丰价值精选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-02
14	中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-02
15	中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-07
16	中加科丰价值精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-07
17	中加科丰价值精选混合型证券投资基金2021年第二季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-20
18	中加科丰价值精选混合型证券投资基金2021年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-27
19	中加科丰价值精选混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-19
20	中加科丰价值精选混合型证券投资基金2021年第三季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-26

§ 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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

类别		20%的时间区间					
机构	1	20210101-20210225	227,353,540.08	0.00	227,353,540.08	0.00	0.00%
	2	20210101-20210526	137,323,995.24	0.00	0.00	137,323,995.24	12.84%
产品特有风险							
本基金报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，该投资者所持有的基金份额的占比较大，该投资者在赎回所持有的基金份额时，存在基金份额净值波动的风险；另外，该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时，基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中加科丰价值精选混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加科丰价值精选混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼

基金托管人地址：北京市东城区朝阳门北大街9号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：www.bobbns.com

中加基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日