

# 新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

### 2021 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月二十七日

## 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                       | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| <b>2 基金简介</b> .....                          | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                 | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8  |
| <b>4 管理人报告</b> .....                         | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 11 |
| 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.....             | 11 |
| 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.....                 | 11 |
| <b>5 托管人报告</b> .....                         | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....                  | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 12 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....     | 12 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | 12 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 12 |
| 6.2 利润表.....                                 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 16 |
| 6.4 报表附注.....                                | 18 |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | 58 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 58 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 60 |
| 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.....       | 66 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 67 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 67 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....      | 69 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....   | 70 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....      | 70 |
| 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....                | 71 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 71 |
| 7.11 投资组合报告附注.....                           | 72 |
| <b>8 基金份额持有人信息</b> .....                     | 74 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 74 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人.....                        | 75 |
| 8.3 末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....                 | 76 |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....              | 77        |
| <b>9 开放式基金份额变动</b> .....               | <b>78</b> |
| <b>10 重大事件揭示</b> .....                 | <b>79</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                 | 79        |
| 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 ..... | 79        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....      | 79        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                   | 79        |
| 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....              | 79        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....    | 79        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....           | 79        |
| 10.8 其他重大事件 .....                      | 80        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....         | <b>82</b> |
| <b>12 备查文件目录</b> .....                 | <b>82</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                      | 83        |
| 12.2 存放地点 .....                        | 83        |
| 12.3 查阅方式 .....                        | 83        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                        |                   |
|-----------------|------------------------|-------------------|
| 基金名称            | 新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金 |                   |
| 基金简称            | 新华安康多元收益一年持有期混合        |                   |
| 基金主代码           | 010401                 |                   |
| 交易代码            | 010401                 |                   |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                 |                   |
| 基金合同生效日         | 2020 年 12 月 16 日       |                   |
| 基金管理人           | 新华基金管理股份有限公司           |                   |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司             |                   |
| 报告期末基金份额总额      | 1,175,979,487.67 份     |                   |
| 基金合同存续期         | 不定期                    |                   |
| 下属分级基金的基金简称     | 新华安康多元收益一年持有期混合 A      | 新华安康多元收益一年持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 010401                 | 010402            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,051,709,136.10 份     | 124,270,351.57 份  |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间动态配置，在控制下行风险的前提下，力争实现长期稳健的投资回报。   |
| 投资策略   | 本基金将密切关注宏观经济运行状况，通过对国家财政和货币政策、资本市场资金环境、证券市场走势等因素的综合分析，判断未来一段时间各类资产的风险收益情况、相对收益率，主动调整股票、债券和现金类资产在给定区间内的动态配置比例，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×15% + 中债综合指数（财富）收益率×80%+金融机构人民币活期存款利率（税后）×5%。   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，预期收益和预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。   |

### 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        | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 齐岩                  | 张燕                     |
|             | 联系电话 | 010-68779688        | 0755-83199084          |
|             | 电子邮箱 | qiyan@ncfund.com.cn | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 4008198866          | 95555                  |

|       |   |                    |
|-------|---|--------------------|
| 传真    | 010-68779528  | 0755-83195201      |
| 注册地址  | 重庆市江北区聚贤岩广场6号<br>力帆中心2号楼19层                                   | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 办公地址  | 重庆市江北区聚贤岩广场6号<br>力帆中心2号楼19层，北京市海<br>淀区西三环北路11号海通时代<br>商务中心C1座 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 邮政编码  | 400010  | 518040             |
| 法定代表人 | 翟晨曦   | 缪建民                |

## 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 | 新华基金管理股份有限公司 | 重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层 |

## 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（2021年1月1日至2021年6月30日） |                   |
|---------------|---------------------------|-------------------|
|               | 新华安康多元收益一年持有期混合 A         | 新华安康多元收益一年持有期混合 C |
| 本期已实现收益       | 27,069,964.75             | 3,081,042.81      |
| 本期利润          | 23,175,948.69             | 2,668,941.31      |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0233                    | 0.0216            |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.29%                     | 2.13%             |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.35%                     | 2.15%             |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日)          |                   |
|               | 新华安康多元收益一年持有期混合 A         | 新华安康多元收益一年持有期混合 C |
| 期末可供分配利润      | 28,789,961.48             | 3,127,905.71      |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0274                    | 0.0252            |

|                     |                         |                   |
|---------------------|-------------------------|-------------------|
| 期末基金资产净值            | 1,081,015,706.35        | 127,459,744.88    |
| 期末基金份额净值            | 1.0279                  | 1.0257            |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | <b>报告期末(2021年6月30日)</b> |                   |
|                     | 新华安康多元收益一年持有期混合 A       | 新华安康多元收益一年持有期混合 C |
| 基金份额累计净值增长率         | 2.79%                   | 2.57%             |

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，不是当期发生数）；

4、本基金自 2020 年 12 月 16 日成立，至 2021 年 6 月 30 日披露日未满一年。

## 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

新华安康多元收益一年持有期混合 A

| 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.20%    | 0.09%       | -0.14%     | 0.13%         | 0.34%  | -0.04% |
| 过去三个月      | 1.69%    | 0.11%       | 1.54%      | 0.15%         | 0.15%  | -0.04% |
| 过去六个月      | 2.35%    | 0.14%       | 1.88%      | 0.20%         | 0.47%  | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.79%    | 0.14%       | 3.15%      | 0.20%         | -0.36% | -0.06% |

新华安康多元收益一年持有期混合 C

| 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.17%    | 0.09%       | -0.14%     | 0.13%         | 0.31%  | -0.04% |
| 过去三个月      | 1.59%    | 0.11%       | 1.54%      | 0.15%         | 0.05%  | -0.04% |
| 过去六个月      | 2.15%    | 0.14%       | 1.88%      | 0.20%         | 0.27%  | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.57%    | 0.14%       | 3.15%      | 0.20%         | -0.58% | -0.06% |

注：1、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15% + 中债综合指数（财富）收益率×80%+金融机构人民币活期存款利率（税后）×5%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3、本基金合同生效日为 2020 年 12 月 16 日，至 2021 年 6 月 30 日披露日未满一年。

### 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

新华安康多元收益一年持有期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

(2020 年 12 月 16 日至 2021 年 6 月 30 日)

新华安康多元收益一年持有期混合 A



新华安康多元收益一年持有期混合 C





注：1、本基金建仓期为 6 个月，本报告期，本基金已完成建仓，且建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

2、本基金合同生效日为 2020 年 12 月 16 日，至 2021 年 6 月 30 日披露日未满一年。

## 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 2021 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、新华丰盈回报债券型证券投资基金、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、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、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、新华恒益量化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。

#### 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 |        |   |
| 姚秋 | 本基金基金经理，新华基金管理股份有限公司总经理助理、平衡投资部总监、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理。 | 2020-12-16      | -    | 11     | 经济学博士、注册金融分析师，历任中国建设银行北京分行投资银行部投资研究工作、中国工商银行资产管理部固定收益投资经理。      |
| 于航 | 本基金基金经理助理，新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫回报混合型证券                            | 2020-06-03      | -    | 6      | 统计学硕士，历任新华基金股票交易员，固定收益与平衡投资部研究员，从事宏观研究、策略研究、信用研究、转债研究等多个方向研究工作。 |

|  |   |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|
|  | <p>投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华壹诺宝货</p> |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|

|  |                                 |  |  |  |  |
|--|---------------------------------|--|--|--|--|
|  | 币市场基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理。 |  |  |  |  |
|--|---------------------------------|--|--|--|--|

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》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安康多元一年持有期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》、《新华安康多元一年持有期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

2021 年上半年，国内疫情控制得当，出口和地产表现出较强的韧性，制造业投资有一定回升，基建明显走弱。总体来看，经济增长动能有走弱趋势，货币环境呈现偏宽松态势。

一季度，股票市场和债券市场都有明显调整，经历了估值消化后，部分增量资金敢于入场，二季度股票市场和债券市场表现均较好。我们整体上维持股票的持仓水平和债券的久期水平，没有对总敞口进行明显调节。股票方面，我们根据观察池中标的的估值水平变化的对比情况，适度进行了持仓结构调整。减配的标的主要集中在食品饮料、医药、工程机械、非银金融、家电等行业，增配的标的主要集中在化工、地产等短期热度不高的行业和汽车零部件等估值较为合理但未来盈利增长确定性较高的行业。整体持仓结构中，行业配置力度上较为均匀。债券方面，我们维持中短久期，以票息策略为主，坚持高等级无瑕疵的选债标准，严格防范潜在信用风险；我们维持一定比例的债性转债的持仓水平，其中主要以银行转债为主。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，新华安康多元 A 份额净值为 1.0279 元，本报告期份额净值增长率为 2.35%，同期比较基准的增长率为 1.88%；新华安康多元 C 份额净值为 1.0257 元，本报告期份额净值增长率为 2.15%，同期比较基准的增长率为 1.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济显现出一定的边际走弱迹象，消费恢复进程缓慢，基建、地产增速边际下行。7 月份，央行进行了一次准备金率的普遍下调，市场将其解读为货币政策边际放松的信号。一方面，受出口数据持续超预期的影响，经济虽有走弱但稳增长压力不大；另一方面，疫情导致的经济 K 型复苏，使得不同微观主体之间的财富差距有所拉大。在此情况下，政策并不急于用强力措施托举经济增长，

但以小微企业为代表的资金来源较为脆弱的经营主体，在后疫情时代举步维艰，需要得到政策的呵护。因此，政府在制定政策时，需要兼顾稳增长与调结构两个目标，而“宽货币、结构性紧信用”应该是当下的最优选择，在宏观环境没有大的变化的前提下，这个基调也有望保持。

股票市场整体估值水平较二季度进一步下行，但结构性分化的现象仍在进一步愈演愈烈。以新能源、半导体、军工为代表的少数行业，估值水平不断抬升，在增量资金有限的情况下，市场呈现此消彼长，其余多数行业走势疲弱。这几个优势行业的共同之处，除增速较快之外，还在于恰好处于国家鼓励的高端制造领域。不可否认，制造业优势企业的崛起能够明显增加我国国力，具有强大竞争力的企业也更可能为股东带来丰厚回报。但理想与现实之间仍存在较大鸿沟。同质性强、众多资本趋之若鹜的行业，企业的生存环境会很快发生恶化。增速快的行业中，并不见得更容易找到好的企业。我们一方面要防范低估值陷阱（即短期估值偏低但长期业绩负增长），也要留意在主流资金普遍防范低估值陷阱、放大悲观预期的背景下，低估值板块带来的投资机会；既要关注产业趋势变革的趋势，也要清醒地看到潜在的高估与过剩的风险。

部分业绩增速较快、经营状况稳定且估值仍在合理水平的弱周期中小市值企业，仍有较好的性价比。但需要注意的是，在壳价值已经消失、中小市值标的大量上市的今天，进行估值的纵向比较并不能提供重要线索。在过去半年多时间里，中小市值标的整体性跑赢，但不宜简单外推这个趋势。

对于债券资产，利率债与高等级票息策略仍是未来一段时间的合理选择，信用债市场分层格局可能会进一步强化。

对于股票资产中的价值成长类标的，包括可选与必选消费、医药（非创新药相关）以及部分已经得到时间检验的传统行业龙头，这部分资产估值整体处于合理水平，需要重点关注基本面的边际变化。除此之外，部分细分行业中，市值较小、估值较低但基本面具有改善趋势和改善空间的公司值得密切关注。对于地产、采掘、非银金融等行业集中度仍有待于进一步提升的传统行业，考虑目前较为合理的估值水平，我们会密切跟踪这些行业自身的基本面变化，例如行业内的企业数量变化、行业份额变化等，供给格局的变化对公司价值带来的影响可能大于需求变化。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.6.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

###### 4.6.1.1 估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部门、交易部、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长，运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

#### 4.6.1.2 基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部门相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

#### 4.6.1.3 投资管理部门的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

#### 4.6.1.4 交易部的职责分工

- ① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；

- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

#### 4.6.1.5 监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资管理部门问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

#### 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

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情况。

## 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存



在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 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：新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            | -                              | -                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 15,270,615.21                  | 203,072,225.28                   |
| 结算备付金           |            | -                              | -                                |
| 存出保证金           |            | 64,644.25                      | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 1,183,428,540.89               | 350,084,942.92                   |
| 其中：股票投资         |            | 136,170,557.04                 | 112,018,481.72                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 1,047,257,983.85               | 238,066,461.20                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          |            | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        |            | -                              | 385,880,137.94                   |
| 应收证券清算款         |            | 604,348.14                     | 35,402,009.48                    |
| 应收利息            | 6.4.7.3    | 18,290,846.69                  | 3,240,212.93                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 545,356.33                     | 21,454.85                        |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            |            | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 1,218,204,351.51               | 977,700,983.40                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            | -                              | -                                |
| 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       |            | 8,647,875.68                   | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 689,106.09                     | 279,146.45                       |
| 应付托管费           |            | 147,665.60                     | 59,817.10                        |
| 应付销售服务费         |            | 41,779.26                      | 20,125.00                        |

|               |         |                  |                |
|---------------|---------|------------------|----------------|
| 应付交易费用        | 6.4.7.4 | 76,976.56        | 80,492.00      |
| 应交税费          |         | 76,014.09        | -              |
| 应付利息          |         | 811.42           | -              |
| 应付利润          |         | -                | -              |
| 递延所得税负债       |         | -                | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.5 | 48,671.58        | -              |
| 负债合计          |         | 9,728,900.28     | 439,580.55     |
| <b>所有者权益：</b> |         | -                | -              |
| 实收基金          | 6.4.7.6 | 1,175,979,487.67 | 973,145,341.85 |
| 未分配利润         | 6.4.7.7 | 32,495,963.56    | 4,116,061.00   |
| 所有者权益合计       |         | 1,208,475,451.23 | 977,261,402.85 |
| 负债和所有者权益总计    |         | 1,218,204,351.51 | 977,700,983.40 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金 A 类份额净值 1.0279 元，基金 A 类份额 1,051,709,136.10 份；基金 C 类份额净值 1.0257 元，基金 C 类份额 124,270,351.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期                              |
|-----------------------|----------|---------------------------------|
|                       |          | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| <b>一、收入</b>           |          | <b>31,364,942.39</b>            |
| 1.利息收入                |          | 18,079,158.55                   |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.8  | 83,126.32                       |
| 债券利息收入                |          | 17,678,088.37                   |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                               |
| 买入返售金融资产收入            |          | 317,943.86                      |
| 证券出借利息收入              |          | -                               |
| 其他利息收入                |          | -                               |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 17,591,901.40                   |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.9  | 16,220,296.45                   |
| 基金投资收益                |          | -                               |
| 债券投资收益                | 6.4.7.10 | 483,929.14                      |
| 资产支持证券投资收益            |          | -                               |
| 贵金属投资收益               |          | -                               |
| 衍生工具收益                |          | -                               |
| 股利收益                  | 6.4.7.11 | 887,675.81                      |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.12 | -4,306,117.56                   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                               |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     |          | -                               |

|                            |          |                      |
|----------------------------|----------|----------------------|
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>5,520,052.39</b>  |
| 1. 管理人报酬                   |          | 3,943,228.08         |
| 2. 托管费                     |          | 844,977.44           |
| 3. 销售服务费                   |          | 248,488.42           |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.13 | 194,725.68           |
| 5. 利息支出                    |          | 163,707.20           |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 163,707.20           |
| 6.税金及附加                    |          | 54,334.31            |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.14 | 70,591.26            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>25,844,890.00</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>25,844,890.00</b> |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）                        | 973,145,341.85                        | 4,116,061.00  | 977,261,402.85   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 25,844,890.00 | 25,844,890.00    |
| 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）      | 202,834,145.82                        | 2,535,012.56  | 205,369,158.38   |
| 其中：1.基金申购款                             | 202,844,060.41                        | 2,535,110.71  | 205,379,171.12   |
| 2.基金赎回款                                | -9,914.59                             | -98.15        | -10,012.74       |
| 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）                        | 1,175,979,487.67                      | 32,495,963.56 | 1,208,475,451.23 |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

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

新华安康多元收益一年持有期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【2020】2398 号文《关于准予新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册募集，由新华基金管理股份有限公司发起募集的契约型开放式混合型证券投资基金，存续期不限定。于 2020 年 11 月 5 日通过新华基金管理股份有限公司的直销中心和取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议代为办理基金销售业务的代销机构公开发售，发行期限：2020 年 11 月 5 日至 2020 年 12 月 11 日。首次募集资金总额 972,434,382.13 元，其中募集资金产生利息 463,126.33 元。基金募集的基金份额为 972,434,382.13 份，其中净认购 A 类份额为 849,283,456.20 份和 C 类基金份额为 122,687,799.60 份，募集期银行利息折算 A 类基金份额为 434,123.31 份和 C 类基金份额为 29,003.02 份，并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2020]第 36010011 号验资报告予以验证。2020 年 12 月 16 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》及《新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、政府机构债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中国证监会允许本基金投资的永续债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债、政府支持机构债、政府支持债券等各类债券）、货币市场工具、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单和银行存款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（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票的比例为基金资产的 0-40%；每个交易日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要

求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15% + 中债综合指数（财富）收益率×80%+ 金融机构人民币活期存款利率（税后）×5%。

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 2021 年 8 月 26 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，按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华安康多元收益一年持有期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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### （1）金融资产的分类

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

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金

融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并

进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **6.4.4.7 实收基金**

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

#### **6.4.4.8 损益平准金**

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现



金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 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

本基金本报告期内无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无会计差错更正。

#### 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<br>2021年6月30日 |
|------|-------------------|
| 活期存款 | 15,270,615.21     |
| 定期存款 | -                 |
| 其他存款 | -                 |
| 合计   | 15,270,615.21     |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021年6月30日 |                  |               |
|---------------|-------------------|------------------|---------------|
|               | 成本                | 公允价值             | 公允价值变动        |
| 股票            | 137,443,070.78    | 136,170,557.04   | -1,272,513.74 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -                | -             |
| 债券            | 交易所市场             | 28,249,983.85    | 162,196.61    |
|               | 银行间市场             | 1,018,475,295.85 | 532,704.15    |
|               | 合计                | 1,046,563,083.09 | 694,900.76    |
| 资产支持证券        | -                 | -                | -             |
| 基金            | -                 | -                | -             |
| 其他            | -                 | -                | -             |
| 合计            | 1,184,006,153.87  | 1,183,428,540.89 | -577,612.98   |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

##### 6.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2021年6月30日 |
|----------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,343.52          |
| 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  | 29.10         |
| 应收债券利息     | 18,289,474.07 |
| 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         | -             |
| 合计         | 18,290,846.69 |

注：1、应收结算备付金利息包括存出保证金利息。

2、本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 68,334.75              |
| 银行间市场应付交易费用 | 8,641.81               |
| 合计          | 76,976.56              |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 48,671.58              |
| 合计          | 48,671.58              |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.6 实收基金

新华安康多元收益一年持有期混合 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |      |
|----|----------------------------|------|
|    | 基金份额                       | 账面金额 |
|    |                            |      |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 上年度末          | 850,348,249.26   | 850,348,249.26   |
| 本期申购          | 201,370,801.43   | 201,370,801.43   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -9,914.59        | -9,914.59        |
| 本期末           | 1,051,709,136.10 | 1,051,709,136.10 |

新华安康多元收益一年持有期混合 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额                       | 账面金额           |
| 上年度末          | 122,797,092.59             | 122,797,092.59 |
| 本期申购          | 1,473,258.98               | 1,473,258.98   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                          | -              |
| 本期末           | 124,270,351.57             | 124,270,351.57 |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

**6.4.7.7 未分配利润**

新华安康多元收益一年持有期混合 A

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           | 356,300.78    | 3,258,031.23  | 3,614,332.01  |
| 本期利润           | 27,069,964.75 | -3,894,016.06 | 23,175,948.69 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,363,695.95  | 1,152,593.60  | 2,516,289.55  |
| 其中：基金申购款       | 1,363,703.27  | 1,152,684.43  | 2,516,387.70  |
| 基金赎回款          | -7.32         | -90.83        | -98.15        |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 28,789,961.48 | 516,608.77    | 29,306,570.25 |

新华安康多元收益一年持有期混合 C

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           | 31,313.77    | 470,415.22  | 501,728.99   |
| 本期利润           | 3,081,042.81 | -412,101.50 | 2,668,941.31 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 15,549.13    | 3,173.88    | 18,723.01    |
| 其中：基金申购款       | 15,549.13    | 3,173.88    | 18,723.01    |
| 基金赎回款          | -            | -           | -            |

|         |              |           |              |
|---------|--------------|-----------|--------------|
| 本期已分配利润 | -            | -         | -            |
| 本期末     | 3,127,905.71 | 61,487.60 | 3,189,393.31 |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 26,294.48                             |
| 定期存款利息收入  | 36,416.66                             |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 20,415.18                             |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 83,126.32                             |

注：1、结算备付金利息收入包括存出保证金利息收入。

2、本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 59,757,568.72                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 43,537,272.27                         |
| 买卖股票差价收入   | 16,220,296.45                         |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.10 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 214,343,962.78                        |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 210,758,089.30                        |
| 减：应收利息总额               | 3,101,944.34                          |
| 买卖债券差价收入               | 483,929.14                            |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

## 6.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 887,675.81                 |
| 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            | 887,675.81                 |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

## 6.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | -4,306,117.56              |
| ——股票投资                     | -4,884,125.12              |
| ——债券投资                     | 578,007.56                 |
| ——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<br>预估增值税 | -                          |
| 合计                         | -4,306,117.56              |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

## 6.4.7.13 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 185,800.68                 |
| 银行间市场交易费用 | 8,925.00                   |
| 合计        | 194,725.68                 |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

## 6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 39,671.58                  |
| 信息披露费   | -                          |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 债券账户维护费 | 18,000.00                  |
| 汇划手续费   | 12,619.68                  |
| 其他      | 300.00                     |
| 合计      | 70,591.26                  |

注：本基金 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

#### 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

截至资产负债表日，本基金并无需要作披露的或有事项。

##### 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     |
|--------------|-------------|
| 招商银行股份有限公司   | 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 |
| 恒泰证券股份有限公司   | 基金管理人股东     |

#### 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

本基金于 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年，本基金无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易



本基金于 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年，本基金无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金于 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年，本基金无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金于 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年，本基金无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年，本基金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<br>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  | 3,943,228.08               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,679,148.37               |

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 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×0.70%/当年天数

2、本基金于 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年，可比期间无对比数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>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 | 844,977.44                 |

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值 0.15% 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×0.15%/当年天数。

2、本基金于 2020 年 12 月 16 日成立, 报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年, 可比期间无对比数据。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                       |          |
|----------------|----------------------------|-----------------------|----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费           |                       |          |
|                | 新华安康多元收益<br>一年持有期混合 A      | 新华安康多元收益一年<br>持有期混合 C | 合计       |
| 新华基金管理股份有限公司   | -                          | 3.71                  | 3.71     |
| 恒泰证券股份有限公司     | -                          | 1,970.58              | 1,970.58 |
| 合计             | -                          | 1,974.29              | 1,974.29 |

注: 1、本基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40%年费率计提。

其计算公式为: 日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

2、本基金于 2020 年 12 月 16 日成立, 报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年, 可比期间无对比数据。

### 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

1、本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

2、本基金于 2020 年 12 月 16 日成立, 报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年, 可比期间无对比数据。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金于 2020 年 12 月 16 日成立, 报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年, 本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。

#### 6.4.10.4.2 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

本基金于 2020 年 12 月 16 日成立, 报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年, 报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

## 6.4.10.5 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |           |
|------------|----------------------------|-----------|
|            | 期末余额                       | 当期利息收入    |
| 招商银行股份有限公司 | 15,270,615.21              | 26,294.48 |

注：1、本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2、本基金于 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年，可比期间无对比数据。

## 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

2、本基金于 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年，可比期间无对比数据。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金于 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年，本报告期内无利润分配情况。

## 6.4.12 期末（2021 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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 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 |
| 688131               | 皓元医药 | 2021-06-01 | 2021-12-08 | 新股锁定期内 | 64.99 | 247.10 | 1,955.00  | 127,055.45 | 483,080.50 | -  |
| 688660               | 电气风电 | 2021-05-11 | 2021-11-19 | 新股锁定期内 | 5.44  | 7.26   | 51,238.00 | 278,734.72 | 371,987.88 | -  |
| 300957               | 贝泰妮  | 2021-03-18 | 2021-09-27 | 新股锁定期内 | 47.33 | 251.96 | 853.00    | 40,372.49  | 214,921.88 | -  |
| 688677               | 海泰新光 | 2021-02-18 | 2021-08-26 | 新股锁定   | 35.76 | 103.23 | 1,768.00  | 63,223.68  | 182,510.64 | -  |

|        |      |            |            |        |       |        |          |           |            |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|-----------|------------|---|
|        |      |            |            | 期内     |       |        |          |           |            |   |
| 688323 | 瑞华泰  | 2021-04-21 | 2021-10-28 | 新股锁定期内 | 5.97  | 22.78  | 4,513.00 | 26,942.61 | 102,806.14 | - |
| 688070 | 纵横股份 | 2021-02-02 | 2021-08-10 | 新股锁定期内 | 23.16 | 34.47  | 2,407.00 | 55,746.12 | 82,969.29  | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021-04-15 | 2021-10-26 | 新股锁定期内 | 33.22 | 87.50  | 925.00   | 30,728.50 | 80,937.50  | - |
| 688611 | 杭州柯林 | 2021-04-01 | 2021-10-12 | 新股锁定期内 | 33.44 | 42.34  | 1,400.00 | 46,816.00 | 59,276.00  | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021-04-19 | 2021-10-27 | 新股锁定期内 | 48.59 | 90.39  | 601.00   | 29,202.59 | 54,324.39  | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021-06-30 | 2021-07-09 | 网下中签   | 21.96 | 21.96  | 2,469.00 | 54,219.24 | 54,219.24  | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021-04-08 | 2021-10-15 | 新股锁定期内 | 28.28 | 115.71 | 360.00   | 10,180.80 | 41,655.60  | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 网下中签   | 10.64 | 10.64  | 3,789.00 | 40,314.96 | 40,314.96  | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 网下中签   | 9.46  | 9.46   | 2,609.00 | 24,681.14 | 24,681.14  | - |
| 300953 | 震裕科技 | 2021-03-11 | 2021-09-22 | 新股锁定期内 | 28.77 | 99.85  | 240.00   | 6,904.80  | 23,964.00  | - |
| 301009 | 可靠股份 | 2021-06-08 | 2021-12-17 | 新股锁定期内 | 12.54 | 27.89  | 801.00   | 10,044.54 | 22,339.89  | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021-06-22 | 2021-12-30 | 新股锁定期内 | 7.64  | 38.83  | 462.00   | 3,529.68  | 17,939.46  | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021-06-28 | 2021-07-07 | 网下中签   | 6.42  | 6.42   | 2,693.00 | 17,289.06 | 17,289.06  | - |
| 300982 | 苏文电能 | 2021-04-19 | 2021-10-27 | 新股锁定期内 | 15.83 | 45.29  | 317.00   | 5,018.11  | 14,356.93  | - |
| 300968 | 格林精密 | 2021-04-06 | 2021-10-15 | 新股锁定期内 | 6.87  | 12.07  | 1,162.00 | 7,982.94  | 14,025.34  | - |
| 301013 | 利和兴  | 2021-06-21 | 2021-12-29 | 新股锁定   | 8.72  | 27.11  | 471.00   | 4,107.12  | 12,768.81  | - |

|        |      |            |            |        |       |       |          |           |           |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|----------|-----------|-----------|---|
|        |      |            |            | 期内     |       |       |          |           |           |   |
| 300997 | 欢乐家  | 2021-05-26 | 2021-12-02 | 新股锁定期内 | 4.94  | 13.05 | 928.00   | 4,584.32  | 12,110.40 | - |
| 301002 | 崧盛股份 | 2021-05-27 | 2021-12-07 | 新股锁定期内 | 18.71 | 57.62 | 201.00   | 3,760.71  | 11,581.62 | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 网下中签   | 31.56 | 31.56 | 349.00   | 11,014.44 | 11,014.44 | - |
| 300955 | 嘉亨家化 | 2021-03-16 | 2021-09-24 | 新股锁定期内 | 16.53 | 46.07 | 232.00   | 3,834.96  | 10,688.24 | - |
| 300996 | 普联软件 | 2021-05-26 | 2021-12-03 | 新股锁定期内 | 20.81 | 42.23 | 241.00   | 5,015.21  | 10,177.43 | - |
| 300956 | 英力股份 | 2021-03-16 | 2021-09-27 | 新股锁定期内 | 12.85 | 25.80 | 371.00   | 4,767.35  | 9,571.80  | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021-03-29 | 2021-10-11 | 新股锁定期内 | 3.40  | 16.37 | 576.00   | 1,958.40  | 9,429.12  | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021-03-03 | 2021-09-13 | 新股锁定期内 | 11.72 | 27.08 | 340.00   | 3,984.80  | 9,207.20  | - |
| 301016 | 雷尔伟  | 2021-06-23 | 2021-12-30 | 新股锁定期内 | 13.75 | 32.98 | 275.00   | 3,781.25  | 9,069.50  | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021-03-31 | 2021-10-11 | 新股锁定期内 | 8.24  | 31.54 | 286.00   | 2,356.64  | 9,020.44  | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021-03-23 | 2021-09-30 | 新股锁定期内 | 8.48  | 22.07 | 394.00   | 3,341.12  | 8,695.58  | - |
| 300950 | 德固特  | 2021-02-24 | 2021-09-03 | 新股锁定期内 | 8.41  | 39.13 | 219.00   | 1,841.79  | 8,569.47  | - |
| 605162 | 新中港  | 2021-06-29 | 2021-07-07 | 网下中签   | 6.07  | 6.07  | 1,377.00 | 8,358.39  | 8,358.39  | - |
| 300958 | 建工修复 | 2021-03-18 | 2021-09-29 | 新股锁定期内 | 8.53  | 27.22 | 300.00   | 2,559.00  | 8,166.00  | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021-04-21 | 2021-11-01 | 新股锁定期内 | 14.79 | 30.57 | 264.00   | 3,904.56  | 8,070.48  | - |

|        |      |            |            |        |       |       |        |          |          |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|--------|----------|----------|---|
| 300987 | 川网传媒 | 2021-04-28 | 2021-11-11 | 新股锁定期内 | 6.79  | 26.81 | 301.00 | 2,043.79 | 8,069.81 | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021-04-15 | 2021-10-26 | 新股锁定期内 | 8.42  | 13.60 | 593.00 | 4,993.06 | 8,064.80 | - |
| 300993 | 玉马遮阳 | 2021-05-17 | 2021-11-24 | 新股锁定期内 | 12.10 | 19.29 | 410.00 | 4,961.00 | 7,908.90 | - |
| 300971 | 博亚精工 | 2021-04-07 | 2021-10-15 | 新股锁定期内 | 18.24 | 28.29 | 245.00 | 4,468.80 | 6,931.05 | - |
| 301004 | 嘉益股份 | 2021-06-18 | 2021-12-27 | 新股锁定期内 | 7.81  | 21.94 | 312.00 | 2,436.72 | 6,845.28 | - |
| 300991 | 创益通  | 2021-05-12 | 2021-11-22 | 新股锁定期内 | 13.06 | 26.51 | 254.00 | 3,317.24 | 6,733.54 | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021-04-14 | 2021-10-21 | 新股锁定期内 | 5.48  | 13.03 | 492.00 | 2,696.16 | 6,410.76 | - |
| 301011 | 华立科技 | 2021-06-09 | 2021-12-17 | 新股锁定期内 | 14.20 | 33.84 | 175.00 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021-04-02 | 2021-10-13 | 新股锁定期内 | 4.54  | 11.54 | 507.00 | 2,301.78 | 5,850.78 | - |
| 300972 | 万辰生物 | 2021-04-08 | 2021-10-19 | 新股锁定期内 | 7.19  | 12.65 | 430.00 | 3,091.70 | 5,439.50 | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021-03-22 | 2021-09-29 | 新股锁定期内 | 12.08 | 23.06 | 234.00 | 2,826.72 | 5,396.04 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021-06-28 | 2022-01-06 | 新股锁定期内 | 10.64 | 10.64 | 421.00 | 4,479.44 | 4,479.44 | - |
| 301007 | 德迈仕  | 2021-06-04 | 2021-12-16 | 新股锁定期内 | 5.29  | 14.44 | 303.00 | 1,602.87 | 4,375.32 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021-05-25 | 2021-12-02 | 新股锁定期内 | 6.02  | 21.32 | 201.00 | 1,210.02 | 4,285.32 | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021-06-15 | 2021-12-22 | 新股锁定   | 8.05  | 24.26 | 170.00 | 1,368.50 | 4,124.20 | - |

|                             |      |            |            |        |        |        |          |            |            |    |
|-----------------------------|------|------------|------------|--------|--------|--------|----------|------------|------------|----|
|                             |      |            |            | 期内     |        |        |          |            |            |    |
| 301010                      | 晶雪节能 | 2021-06-09 | 2021-12-20 | 新股锁定期内 | 7.83   | 17.61  | 218.00   | 1,706.94   | 3,838.98   | -  |
| 301021                      | 英诺激光 | 2021-06-28 | 2022-01-06 | 新股锁定期内 | 9.46   | 9.46   | 290.00   | 2,743.40   | 2,743.40   | -  |
| <b>6.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b> |      |            |            |        |        |        |          |            |            |    |
| 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：张) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 113050                      | 南银转债 | 2021-06-17 | 2021-07-01 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 3,460.00 | 345,995.45 | 345,995.45 | -  |

注：本基金于 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于 2020 年 12 月 16 日成立，报告截止日 2021 年 6 月 30 日未满一年，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

截止 2021 年 6 月 30 日，本基金从事银行间市场债券正回购形成的卖出回购金融资产款余额为 8,647,875.68 元，于 2021 年 7 月 1 日前全部到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按银行间市场规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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       |
|--------|----------|------------|--------|-----------|--------------|
| 190215 | 19 国开 15 | 2021-07-01 | 99.53  | 92,000.00 | 9,156,760.00 |
| 合计     |          |            |        | 92,000.00 | 9,156,760.00 |

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购。

#### 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

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。

##### 6.4.13.2.1 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<br>2021年6月30日 | 上年末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | 40,175,000.00     | 0.00               |
| A-1 以下 | 0.00              | 0.00               |
| 未评级    | 79,103,000.00     | 208,456,461.20     |
| 合计     | 119,278,000.00    | 208,456,461.20     |

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021年6月30日 | 上年末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | 0.00              | 0.00               |
| A-1 以下 | 0.00              | 0.00               |
| 未评级    | 0.00              | 0.00               |
| 合计     | 0.00              | 0.00               |

注：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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021年6月30日 | 上年末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | 0.00              | 0.00               |
| A-1 以下 | 0.00              | 0.00               |



|     |      |      |
|-----|------|------|
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计  | 0.00 | 0.00 |

注：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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021年6月30日 | 上年末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 819,705,983.85    | 0.00               |
| AAA 以下 | 0.00              | 0.00               |
| 未评级    | 108,274,000.00    | 29,610,000.00      |
| 合计     | 927,979,983.85    | 29,610,000.00      |

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021年6月30日 | 上年末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 0.00              | 0.00               |
| AAA 以下 | 0.00              | 0.00               |
| 未评级    | 0.00              | 0.00               |
| 合计     | 0.00              | 0.00               |

注：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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021年6月30日 | 上年末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 0.00              | 0.00               |
| AAA 以下 | 0.00              | 0.00               |
| 未评级    | 0.00              | 0.00               |
| 合计     | 0.00              | 0.00               |

注：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约

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<br>2021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              | 15,270,615.21  | -              | -              | -              | 15,270,615.21    |
| 结算备付金             | -              | -              | -              | -              | -                |
| 存出保证金             | 64,644.25      | -              | -              | -              | 64,644.25        |
| 交易性金融资产           | 240,618,000.00 | 700,047,148.40 | 106,592,835.45 | 136,170,557.04 | 1,183,428,540.89 |
| 衍生金融资产            | -              | -              | -              | -              | -                |
| 买入返售金融资产          | -              | -              | -              | -              | -                |
| 应收证券清算款           | -              | -              | -              | 604,348.14     | 604,348.14       |
| 应收利息              | -              | -              | -              | 18,290,846.69  | 18,290,846.69    |
| 应收股利              | -              | -              | -              | -              | -                |
| 应收申购款             | -              | -              | -              | 545,356.33     | 545,356.33       |
| 递延所得税资产           | -              | -              | -              | -              | -                |
| 其他资产              | -              | -              | -              | -              | -                |

|  |                |                |                |                |                  |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------|
| 资产总计                                   | 255,953,259.46 | 700,047,148.40 | 106,592,835.45 | 155,611,108.20 | 1,218,204,351.51 |
| 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                              | 8,647,875.68   | -              | -              | -              | 8,647,875.68     |
| 应付证券清算款                                | -              | -              | -              | -              | -                |
| 应付赎回款                                  | -              | -              | -              | -              | -                |
| 应付管理人报酬                                | -              | -              | -              | 689,106.09     | 689,106.09       |
| 应付托管费                                  | -              | -              | -              | 147,665.60     | 147,665.60       |
| 应付销售服务费                                | -              | -              | -              | 41,779.26      | 41,779.26        |
| 应付交易费用                                 | -              | -              | -              | 76,976.56      | 76,976.56        |
| 应交税费                                   | -              | -              | -              | 76,014.09      | 76,014.09        |
| 应付利息                                   | -              | -              | -              | 811.42         | 811.42           |
| 应付利润                                   | -              | -              | -              | -              | -                |
| 递延所得税负债                                | -              | -              | -              | -              | -                |
| 其他负债                                   | -              | -              | -              | 48,671.58      | 48,671.58        |
| 负债总计                                   | 8,647,875.68   | -              | -              | 1,081,024.60   | 9,728,900.28     |
| 利率敏感度缺口                                | 247,305,383.78 | 700,047,148.40 | 106,592,835.45 | 154,530,083.60 | 1,208,475,451.23 |
| <b>上年度末</b><br><b>2020 年 12 月 31 日</b> | <b>1 年以内</b>   | <b>1-5 年</b>   | <b>5 年以上</b>   | <b>不计息</b>     | <b>合计</b>        |
| 资产                                     |                |                |                |                |                  |
| 银行存款                                   | 203,072,225.28 | -              | -              | -              | 203,072,225.28   |
| 结算备付金                                  | -              | -              | -              | -              | -                |
| 存出保证金                                  | -              | -              | -              | -              | -                |
| 交易性金融资产                                | 208,456,461.20 | -              | 29,610,000.00  | 112,018,481.72 | 350,084,942.92   |
| 衍生金融资产                                 | -              | -              | -              | -              | -                |
| 买入返售金融资产                               | 385,880,137.94 | -              | -              | -              | 385,880,137.94   |
| 应收证券清算款                                | -              | -              | -              | 35,402,009.48  | 35,402,009.48    |
| 应收利息                                   | -              | -              | -              | 3,240,212.93   | 3,240,212.93     |

|           |                |   |               |                |                |
|-----------|----------------|---|---------------|----------------|----------------|
| 应收股利      | -              | - | -             | -              | -              |
| 应收申购款     | -              | - | -             | 21,454.85      | 21,454.85      |
| 其他资产      | -              | - | -             | -              | -              |
| 资产总计      | 797,408,824.42 | - | 29,610,000.00 | 150,682,158.98 | 977,700,983.40 |
| 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   | -              | - | -             | -              | -              |
| 应付赎回款     | -              | - | -             | -              | -              |
| 应付管理人报酬   | -              | - | -             | 279,146.45     | 279,146.45     |
| 应付托管费     | -              | - | -             | 59,817.10      | 59,817.10      |
| 应付销售服务费   | -              | - | -             | 20,125.00      | 20,125.00      |
| 应付交易费用    | -              | - | -             | 80,492.00      | 80,492.00      |
| 应付税费      | -              | - | -             | -              | -              |
| 应付利息      | -              | - | -             | -              | -              |
| 应付利润      | -              | - | -             | -              | -              |
| 其他负债      | -              | - | -             | -              | -              |
| 负债总计      | -              | - | -             | 439,580.55     | 439,580.55     |
| 利率敏感度缺口   | 797,408,824.42 | - | 29,610,000.00 | 150,242,578.43 | 977,261,402.85 |

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

| 假设 | 其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点 |                                 |                          |             |
|----|---------------------------|---------------------------------|--------------------------|-------------|
| 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |             |
|    |                           | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日          | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |             |
|    |                           | 市场利率上升 25.00 bp                 | -3,894,734.91            | -681,335.14 |
|    |                           | 市场利率下降 25.00 bp                 | 3,965,222.69             | 693,978.98  |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产与负债均以人民币计价，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<br>2021年6月30日 |                      | 上年度末<br>2020年12月31日 |                      |
|---------------|-------------------|----------------------|---------------------|----------------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 136,170,557.04    | 11.27                | 112,018,481.72      | 11.46                |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -                    | -                   | -                    |
| 交易性金融资产—债券投资  | 1,047,257,983.85  | 86.66                | 238,066,461.20      | 24.36                |
| 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            | 1,183,428,540.89  | 97.93                | 350,084,942.92      | 35.82                |

##### 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                         | 上年度末 |
|    |                            |                             |      |

|  |                | 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 12 月 31 日 |
|--|----------------|-----------------|------------------|
|  | 沪深 300 指数上升 1% | 1,108,422.79    | 981,212.94       |
|  | 沪深 300 指数下降 1% | -1,108,422.79   | -981,212.94      |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 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              | 136,170,557.04   | 11.18         |
|    | 其中：股票             | 136,170,557.04   | 11.18         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,047,257,983.85 | 85.97         |
|    | 其中：债券             | 1,047,257,983.85 | 85.97         |
|    | 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      | 15,270,615.21    | 1.25          |
| 8  | 其他各项资产            | 19,505,195.41    | 1.60          |
| 9  | 合计                | 1,218,204,351.51 | 100.00        |

### 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 | 11,290.28 | 0.00          |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| B | 采矿业              | 4,029,000.00   | 0.33  |
| C | 制造业              | 72,120,846.12  | 5.97  |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,109,020.39   | 0.26  |
| E | 建筑业              | 25,371.37      | 0.00  |
| F | 批发和零售业           | 1,443,350.22   | 0.12  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,671,800.00   | 0.39  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 6,022,877.64   | 0.50  |
| J | 金融业              | 15,263,697.10  | 1.26  |
| K | 房地产业             | 13,652,261.84  | 1.13  |
| L | 租赁和商务服务业         | -              | -     |
| M | 科学研究和技术服务业       | 7,873,180.50   | 0.65  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 16,861.58      | 0.00  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -     |
| P | 教育               | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | 3,715,100.00   | 0.31  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 4,215,900.00   | 0.35  |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 136,170,557.04 | 11.27 |

### 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  | 300059 | 东方财富 | 204,000 | 6,689,160.00 | 0.55         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 3,000   | 6,170,100.00 | 0.51         |
| 3  | 600750 | 江中药业 | 420,000 | 5,565,000.00 | 0.46         |
| 4  | 601799 | 星宇股份 | 23,800  | 5,372,136.00 | 0.44         |
| 5  | 600690 | 海尔智家 | 191,000 | 4,948,810.00 | 0.41         |
| 6  | 002242 | 九阳股份 | 150,500 | 4,889,745.00 | 0.40         |
| 7  | 603589 | 口子窖  | 72,000  | 4,873,680.00 | 0.40         |
| 8  | 601318 | 中国平安 | 75,000  | 4,821,000.00 | 0.40         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 9  | 601006 | 大秦铁路 | 710,000 | 4,671,800.00 | 0.39 |
| 10 | 300416 | 苏试试验 | 185,000 | 4,236,500.00 | 0.35 |
| 11 | 300251 | 光线传媒 | 390,000 | 4,215,900.00 | 0.35 |
| 12 | 000002 | 万科 A | 175,000 | 4,166,750.00 | 0.34 |
| 13 | 601225 | 陕西煤业 | 340,000 | 4,029,000.00 | 0.33 |
| 14 | 600048 | 保利地产 | 322,746 | 3,885,861.84 | 0.32 |
| 15 | 300244 | 迪安诊断 | 97,000  | 3,715,100.00 | 0.31 |
| 16 | 000333 | 美的集团 | 52,000  | 3,711,240.00 | 0.31 |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 100,000 | 3,683,000.00 | 0.30 |
| 18 | 001979 | 招商蛇口 | 315,000 | 3,449,250.00 | 0.29 |
| 19 | 000999 | 华润三九 | 118,900 | 3,180,575.00 | 0.26 |
| 20 | 002967 | 广电计量 | 72,000  | 3,153,600.00 | 0.26 |
| 21 | 000651 | 格力电器 | 60,000  | 3,126,000.00 | 0.26 |
| 22 | 600900 | 长江电力 | 150,000 | 3,096,000.00 | 0.26 |
| 23 | 300363 | 博腾股份 | 36,600  | 3,078,792.00 | 0.25 |
| 24 | 002001 | 新和成  | 96,000  | 2,753,280.00 | 0.23 |
| 25 | 600588 | 用友网络 | 80,000  | 2,660,800.00 | 0.22 |
| 26 | 600570 | 恒生电子 | 28,000  | 2,611,000.00 | 0.22 |
| 27 | 300639 | 凯普生物 | 75,085  | 2,478,555.85 | 0.21 |
| 28 | 600383 | 金地集团 | 210,000 | 2,150,400.00 | 0.18 |
| 29 | 600872 | 中炬高新 | 46,000  | 1,932,920.00 | 0.16 |
| 30 | 000860 | 顺鑫农业 | 45,000  | 1,898,100.00 | 0.16 |
| 31 | 000568 | 泸州老窖 | 8,000   | 1,887,520.00 | 0.16 |
| 32 | 002475 | 立讯精密 | 36,400  | 1,674,400.00 | 0.14 |
| 33 | 002643 | 万润股份 | 90,000  | 1,600,200.00 | 0.13 |
| 34 | 601398 | 工商银行 | 300,000 | 1,551,000.00 | 0.13 |
| 35 | 000739 | 普洛药业 | 50,000  | 1,470,000.00 | 0.12 |
| 36 | 601601 | 中国太保 | 50,000  | 1,448,500.00 | 0.12 |
| 37 | 601933 | 永辉超市 | 300,000 | 1,419,000.00 | 0.12 |
| 38 | 002747 | 埃斯顿  | 32,000  | 1,249,600.00 | 0.10 |
| 39 | 002901 | 大博医疗 | 15,795  | 1,151,297.55 | 0.10 |
| 40 | 600309 | 万华化学 | 10,000  | 1,088,200.00 | 0.09 |
| 41 | 000858 | 五粮液  | 3,600   | 1,072,404.00 | 0.09 |
| 42 | 002557 | 洽洽食品 | 20,000  | 862,000.00   | 0.07 |
| 43 | 600031 | 三一重工 | 28,200  | 819,774.00   | 0.07 |
| 44 | 002555 | 三七互娱 | 30,000  | 720,600.00   | 0.06 |
| 45 | 000001 | 平安银行 | 31,800  | 719,316.00   | 0.06 |
| 46 | 688131 | 皓元医药 | 1,955   | 483,080.50   | 0.04 |
| 47 | 688660 | 电气风电 | 51,238  | 371,987.88   | 0.03 |
| 48 | 300957 | 贝泰妮  | 853     | 214,921.88   | 0.02 |
| 49 | 688677 | 海泰新光 | 1,768   | 182,510.64   | 0.02 |
| 50 | 688323 | 瑞华泰  | 4,513   | 102,806.14   | 0.01 |
| 51 | 688070 | 纵横股份 | 2,407   | 82,969.29    | 0.01 |
| 52 | 300979 | 华利集团 | 925     | 80,937.50    | 0.01 |



|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 53 | 688611 | 杭州柯林 | 1,400 | 59,276.00 | 0.00 |
| 54 | 300981 | 中红医疗 | 601   | 54,324.39 | 0.00 |
| 55 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24 | 0.00 |
| 56 | 301020 | 密封科技 | 4,210 | 44,794.40 | 0.00 |
| 57 | 300973 | 立高食品 | 360   | 41,655.60 | 0.00 |
| 58 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.00 |
| 59 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 60 | 300953 | 震裕科技 | 240   | 23,964.00 | 0.00 |
| 61 | 301009 | 可靠股份 | 801   | 22,339.89 | 0.00 |
| 62 | 301015 | 百洋医药 | 462   | 17,939.46 | 0.00 |
| 63 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 64 | 300982 | 苏文电能 | 317   | 14,356.93 | 0.00 |
| 65 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 66 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 67 | 301013 | 利和兴  | 471   | 12,768.81 | 0.00 |
| 68 | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 69 | 300997 | 欢乐家  | 928   | 12,110.40 | 0.00 |
| 70 | 301002 | 崧盛股份 | 201   | 11,581.62 | 0.00 |
| 71 | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 72 | 300955 | 嘉亨家化 | 232   | 10,688.24 | 0.00 |
| 73 | 300996 | 普联软件 | 241   | 10,177.43 | 0.00 |
| 74 | 300956 | 英力股份 | 371   | 9,571.80  | 0.00 |
| 75 | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 76 | 300952 | 恒辉安防 | 340   | 9,207.20  | 0.00 |
| 77 | 301016 | 雷尔伟  | 275   | 9,069.50  | 0.00 |
| 78 | 300966 | 共同药业 | 286   | 9,020.44  | 0.00 |
| 79 | 300961 | 深水海纳 | 394   | 8,695.58  | 0.00 |
| 80 | 300950 | 德固特  | 219   | 8,569.47  | 0.00 |
| 81 | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 82 | 300958 | 建工修复 | 300   | 8,166.00  | 0.00 |
| 83 | 300986 | 志特新材 | 264   | 8,070.48  | 0.00 |
| 84 | 300987 | 川网传媒 | 301   | 8,069.81  | 0.00 |
| 85 | 300978 | 东箭科技 | 593   | 8,064.80  | 0.00 |
| 86 | 300993 | 玉马遮阳 | 410   | 7,908.90  | 0.00 |
| 87 | 300971 | 博亚精工 | 245   | 6,931.05  | 0.00 |
| 88 | 301004 | 嘉益股份 | 312   | 6,845.28  | 0.00 |
| 89 | 300991 | 创益通  | 254   | 6,733.54  | 0.00 |
| 90 | 300975 | 商络电子 | 492   | 6,410.76  | 0.00 |
| 91 | 301011 | 华立科技 | 175   | 5,922.00  | 0.00 |
| 92 | 300967 | 晓鸣股份 | 507   | 5,850.78  | 0.00 |
| 93 | 300972 | 万辰生物 | 430   | 5,439.50  | 0.00 |
| 94 | 300960 | 通业科技 | 234   | 5,396.04  | 0.00 |
| 95 | 605011 | 杭州热电 | 525   | 4,662.00  | 0.00 |
| 96 | 301007 | 德迈仕  | 303   | 4,375.32  | 0.00 |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 97 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 98 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 99 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 0.00 |

#### 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  | 002242 | 九阳股份 | 5,898,123.00 | 0.60            |
| 2  | 300251 | 光线传媒 | 4,930,059.00 | 0.50            |
| 3  | 603589 | 口子窖  | 4,317,661.00 | 0.44            |
| 4  | 300244 | 迪安诊断 | 4,253,092.00 | 0.44            |
| 5  | 001979 | 招商蛇口 | 3,999,550.00 | 0.41            |
| 6  | 300416 | 苏试试验 | 3,629,819.00 | 0.37            |
| 7  | 000860 | 顺鑫农业 | 3,006,647.00 | 0.31            |
| 8  | 600383 | 金地集团 | 2,693,245.00 | 0.28            |
| 9  | 002967 | 广电计量 | 2,485,272.00 | 0.25            |
| 10 | 000425 | 徐工机械 | 2,324,000.00 | 0.24            |
| 11 | 300639 | 凯普生物 | 2,296,670.52 | 0.24            |
| 12 | 002643 | 万润股份 | 2,073,425.00 | 0.21            |
| 13 | 601601 | 中国太保 | 2,070,202.00 | 0.21            |
| 14 | 000999 | 华润三九 | 2,034,117.00 | 0.21            |
| 15 | 300363 | 博腾股份 | 2,000,858.00 | 0.20            |
| 16 | 000568 | 泸州老窖 | 1,863,960.00 | 0.19            |
| 17 | 002475 | 立讯精密 | 1,700,780.00 | 0.17            |
| 18 | 002901 | 大博医疗 | 1,245,843.75 | 0.13            |
| 19 | 600031 | 三一重工 | 1,157,262.00 | 0.12            |
| 20 | 002557 | 洽洽食品 | 1,151,760.00 | 0.12            |

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（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  | 601818 | 光大银行 | 7,498,400.00 | 0.77            |
| 2  | 601398 | 工商银行 | 5,623,000.00 | 0.58            |
| 3  | 600309 | 万华化学 | 5,101,819.00 | 0.52            |
| 4  | 600741 | 华域汽车 | 3,839,661.20 | 0.39            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 5  | 600900 | 长江电力 | 3,112,361.00 | 0.32 |
| 6  | 000425 | 徐工机械 | 2,856,000.00 | 0.29 |
| 7  | 601668 | 中国建筑 | 2,554,000.00 | 0.26 |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药 | 1,839,852.00 | 0.19 |
| 9  | 300363 | 博腾股份 | 1,825,366.00 | 0.19 |
| 10 | 002242 | 九阳股份 | 1,467,658.00 | 0.15 |
| 11 | 688538 | 和辉光电 | 1,463,084.33 | 0.15 |
| 12 | 300957 | 贝泰妮  | 1,249,554.00 | 0.13 |
| 13 | 601166 | 兴业银行 | 1,166,156.00 | 0.12 |
| 14 | 601318 | 中国平安 | 878,992.00   | 0.09 |
| 15 | 688425 | 铁建重工 | 871,216.08   | 0.09 |
| 16 | 601933 | 永辉超市 | 768,000.00   | 0.08 |
| 17 | 300979 | 华利集团 | 765,897.50   | 0.08 |
| 18 | 688696 | 极米科技 | 695,179.00   | 0.07 |
| 19 | 601006 | 大秦铁路 | 672,000.00   | 0.07 |
| 20 | 300981 | 中红医疗 | 671,920.54   | 0.07 |

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（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

单位：人民币元

|               |               |
|---------------|---------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 72,573,472.71 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 59,757,568.72 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 7.5 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      | 8,876,000.00   | 0.73         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 148,434,000.00 | 12.28        |
|    | 其中：政策性金融债 | 138,369,000.00 | 11.45        |
| 4  | 企业债券      | 20,898,000.00  | 1.73         |
| 5  | 企业短期融资券   | 80,307,000.00  | 6.65         |
| 6  | 中期票据      | 769,369,000.00 | 63.66        |

|    |           |                  |       |
|----|-----------|------------------|-------|
| 7  | 可转债（可交换债） | 19,373,983.85    | 1.60  |
| 8  | 同业存单      | -                | -     |
| 9  | 其他        | -                | -     |
| 10 | 合计        | 1,047,257,983.85 | 86.66 |

#### 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

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  | 101900397 | 19 中化工 MTN001 | 650,000 | 65,520,000.00 | 5.42         |
| 2  | 101769015 | 17 鲁国资 MTN001 | 500,000 | 51,525,000.00 | 4.26         |
| 3  | 101751004 | 17 中节能 MTN001 | 500,000 | 50,820,000.00 | 4.21         |
| 4  | 101900906 | 19 京津冀 MTN002 | 500,000 | 50,655,000.00 | 4.19         |
| 5  | 101900956 | 19 陕延油 MTN008 | 500,000 | 50,610,000.00 | 4.19         |

#### 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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

#### 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

本基金本报告期末无权证投资。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金在股指期货的投资中以套期

保值为目的，主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

## 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

本基金本报告期末投资国债期货。若本基金投资国债期货，本基金在国债期货的投资中以套期保值为目的，综合利用对冲策略和套利策略，实现降低组合波动和增加组合收益的目标。对冲策略主要包括套期保值和久期调整，国债期货具有高杠杆、高流动性、可做空等优势，通过运用国债期货对冲可以降低债券持仓风险从而降低业绩波动，另外通过国债期货也可以来调节组合久期实现低成本调仓的目标。套利策略则通过利用国债期货与基差的交易性机会来拓宽组合盈利模式从而提高组合投资业绩。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金合同尚无投资基金的投资政策。

### 7.12.2 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

本基金本报告期末无基金投资。

## 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本报告期末本基金投资的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 本报告期内，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之外的股票。

### 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 | 64,644.25 |

|   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 604,348.14    |
| 3 | 应收股利    | -             |
| 4 | 应收利息    | 18,290,846.69 |
| 5 | 应收申购款   | 545,356.33    |
| 6 | 其他应收款   | -             |
| 7 | 待摊费用    | -             |
| 8 | 其他      | -             |
| 9 | 合计      | 19,505,195.41 |

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 110059 | 浦发转债 | 11,050,148.40 | 0.91         |

#### 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

| 份额级别    | 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 |
| 新华安康多元收 | 17,387   | 60,488.25 | 0.00  | 0.00%  | 1,051,709,136. | 100.00 |

|                   |        |           |      |       |                  |         |
|-------------------|--------|-----------|------|-------|------------------|---------|
| 益一年持有期混合 A        |        |           |      |       | 10               | %       |
| 新华安康多元收益一年持有期混合 C | 1,326  | 93,718.21 | 0.00 | 0.00% | 124,270,351.57   | 100.00% |
| 合计                | 18,713 | 62,842.92 | 0.00 | 0.00% | 1,175,979,487.67 | 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               | 份额级别              | 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 | 新华安康多元收益一年持有期混合 A | 198.16    | 0.00%    |
|                  | 新华安康多元收益一年持有期混合 C | 21,006.28 | 0.02%    |
|                  | 合计                | 21,204.44 | 0.00%    |

## 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                             | 份额级别              | 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 | 新华安康多元收益一年持有期混合 A | 0                 |
|                                | 新华安康多元收益一年持有期混合 C | 0                 |
|                                | 合计                | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 新华安康多元收益一年持有期混合 A | 0                 |
|                                | 新华安康多元收益一年持有期混合 C | 0                 |
|                                | 合计                | 0                 |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 新华安康多元收益一年持有期混合 A | 新华安康多元收益一年持有期混合 C |
|---------------------------------|-------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2020 年 12 月 16 日）基金份额总额 | 849,717,579.51    | 122,716,802.62    |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 850,348,249.26    | 122,797,092.59    |
| 本报告期基金总申购份额                     | 201,370,801.43    | 1,473,258.98      |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 9,914.59          | -                 |

|              |                  |                |
|--------------|------------------|----------------|
| 本报告期基金拆分变动份额 | -                | -              |
| 本报告期末基金份额总额  | 1,051,709,136.10 | 124,270,351.57 |

## 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

2021 年 4 月 9 日，翟晨曦女士担任本基金基金管理人董事长职务，张宗友先生担任本基金基金管理人联席董事长职务。

2021 年 5 月 26 日，于春玲女士担任本基金基金管理人总经理职务。

本报告期本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事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

自 2021 年 1 月 8 日，本基金投资策略增加存托凭证的投资策略。

### 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

为进一步维护基金持有人利益，促进会计师事务所提供更优质的服务，2021 年 2 月 1 日本基金会计师事务所由瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）变更为致同会计师事务所（特殊普通合伙）。本次变更事项经本基金管理人董事会审议通过，经基金托管人同意，并已向中国证券监督管理委员会及其派出机构报备。

### 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

本基金管理人本报告期收到重庆证监局出具的行政监管措施，目前已采取措施改进。

本基金托管人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

### 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 |    |
|      |        |      |              |           |            |    |



|      |   |               |        |           |        |   |
|------|---|---------------|--------|-----------|--------|---|
| 华创证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 广发证券 | 1 | 67,948,148.33 | 54.78% | 49,690.38 | 54.78% | - |
| 长江证券 | 1 | 56,097,093.06 | 45.22% | 41,024.02 | 45.22% | - |

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》（证监基金字[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3个交易席位，其中报告期内新增0个交易席位，退租0个交易席位。

#### 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、研究员和交易员分别打分，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 | 成交金额 | 占当期回 | 成交金额 | 占当期权 |
|      |      |      |      |      |      |      |

|      |                    | 券成交总<br>额的比例 |                      | 购成交总<br>额的比例 |   | 证成交总<br>额的比例 |
|------|--------------------|--------------|----------------------|--------------|---|--------------|
| 广发证券 | 612,451.90         | 0.55%        | -                    | -            | - | -            |
| 长江证券 | 109,836,658.<br>20 | 99.45%       | 1,023,100,<br>000.00 | 100.00%      | - | -            |

## 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调整网上直销汇款交易优惠费率的公告                                | 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 | 2021-01-04 |
| 2  | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司基金申购、定期定额投资业务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 | 2021-01-05 |
| 3  | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告                             | 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 | 2021-01-08 |
| 4  | 新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在蚂蚁(杭州)基金销售有限公司基金转换补差费公告                   | 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 | 2021-01-08 |
| 5  | 新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜台交易优惠费率的公告                                  | 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 | 2021-01-08 |
| 6  | 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天风证券股份有限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 | 2021-01-16 |
| 7  | 新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在恒泰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 | 2021-01-16 |
| 8  | 新华基金管理股份有限公司基金改聘会计师事务所公告                                       | 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 | 2021-02-03 |
| 9  | 新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在天风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 | 2021-02-26 |
| 10 | 新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告                                     | 中国证券报、公司网站、电子信披网站                 | 2021-04-10 |
| 11 | 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                        | 2021-04-16 |

|    |   |                                   |            |
|----|---|-----------------------------------|------------|
|    | 金增加阳光人寿保险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         | 报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站           |            |
| 12 | 新华基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站 | 2021-04-21 |
| 13 | 新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告             | 公司网站、电子信披网站                       | 2021-04-21 |
| 14 | 新华基金管理股份有限公司关于法定代表人变更的公告                          | 中国证券报、公司网站、电子信披网站                 | 2021-05-08 |
| 15 | 新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告                        | 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 | 2021-05-27 |
| 16 | 新华基金管理股份有限公司旗下部分基金在平安银行股份有限公司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 | 2021-05-27 |
| 17 | 新华基金管理股份有限公司关于在北京植信基金销售有限公司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 | 2021-06-26 |

## 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

本报告期末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安康多元一年持有期混合型证券投资基金募集的文件
- (二)关于申请募集新华安康多元一年持有期混合型证券投资基金之法律意见书
- (三)新华安康多元一年持有期混合型证券投资基金基金合同
- (四)新华安康多元一年持有期混合型证券投资基金托管协议
- (五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (六)《新华安康多元一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》(更新)
- (七)《新华安康多元一年持有期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、营业执照及公司章程
- (九)基金托管人业务资格批件和营业执照
- (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

二〇二一年八月二十七日