

新沃通盈灵活配置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：新沃基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工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，投资者在做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

| | |
|--|-----------|
| §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 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 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..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表..... | 15 |
| 6.2 利润表..... | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 17 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 18 |
| §7 投资组合报告..... | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 36 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 36 |
| 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..... | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 40 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 40 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 40 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 40 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 40 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 40 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 40 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 40 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 42 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 42 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 42 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 42 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 43 |
| §10 重大事件揭示..... | 44 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 44 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 44 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 44 |
| 10.8 其他重大事件..... | 45 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 47 |
| 11.1 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..... | 47 |

| | |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 47 |
| §12 备查文件目录..... | 48 |
| 12.1 备查文件目录..... | 48 |
| 12.2 存放地点..... | 48 |
| 12.3 查阅方式..... | 48 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 基金名称 | 新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 新沃通盈灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 002564 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 9 月 22 日 |
| 基金管理人 | 新沃基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 8,265,677.74 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金以风险管理为前提，通过把握中国稳增长与促转型的发展现状，灵活运用多种投资策略，挖掘各大类资产配置机会，力求高于业绩比较基准的长期资产增值。 |
| 投资策略 | 本基金在深度把握中国经济发展与转型的基础上，通过自上而下的宏观-中观-微观的资产配置策略，以及自下而上的精选行业、个股的基本面分析策略，再通过定性分析和定量分析相结合的选股方法，辅以多种事件驱动、量化研究等工具策略，在风险管理的前提下顺势利导运用多样化的投资策略实现基金资产长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 65%×沪深 300 指数收益率+35%×中证全债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但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 | | 新沃基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 王靖飞 | 郭明 |
| | 联系电话 | 400-698-9988 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | service@sinvofund.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-698-9988 | 95588 |
| 传真 | | 010-58290555 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 山东省青岛市崂山区苗岭路 15 号青岛金融中心大厦 702 室 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |

| | | |
|-------|------------------------------------|-------------------|
| 办公地址 | 北京市海淀区丹棱街 3 号 中国电子大厦 B 座 1616 室 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | 100080 | 100140 |
| 法定代表人 | 朱灿 | 陈四清 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.sinvofund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|--------------------------------|
| 注册登记机构 | 新沃基金管理有限公司 | 北京市海淀区丹棱街 3 号中国电子大厦 B 座 1616 室 |

§ 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 - 2021年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 1,155,268.26 |
| 本期利润 | 2,494,697.10 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2710 |
| 本期加权平均净值利润率 | 13.89% |
| 本期基金份额净值增长率 | 22.16% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 3,971,043.49 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4804 |
| 期末基金资产净值 | 18,910,436.07 |
| 期末基金份额净值 | 2.288 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 208.72% |

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

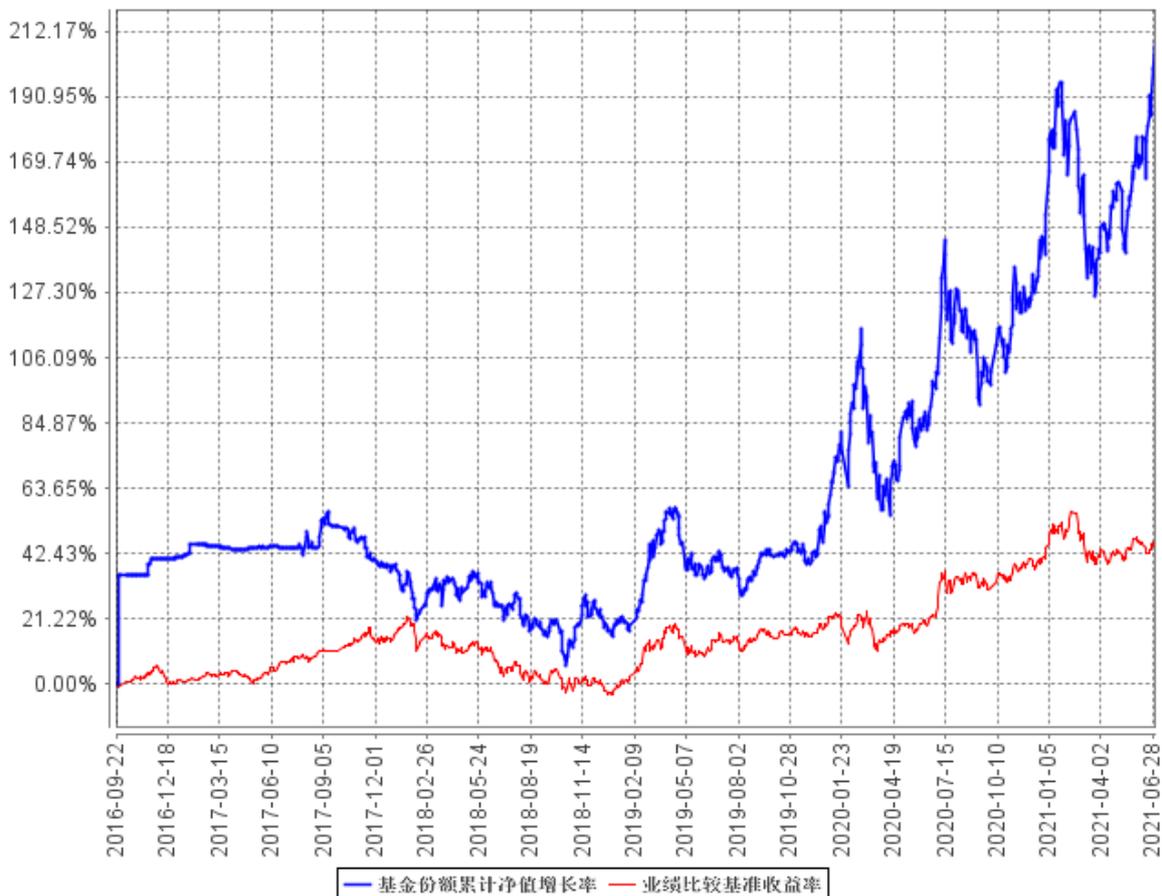
3.2 基金净值表现

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 10.96% | 2.05% | -1.40% | 0.58% | 12.36% | 1.47% |
| 过去三个月 | 28.40% | 1.82% | 2.85% | 0.70% | 25.55% | 1.12% |
| 过去六个月 | 22.16% | 2.11% | 0.82% | 0.95% | 21.34% | 1.16% |
| 过去一年 | 53.15% | 2.05% | 18.06% | 0.94% | 35.09% | 1.11% |
| 过去三年 | 146.29% | 1.80% | 37.47% | 0.91% | 108.82% | 0.89% |
| 自基金合同生效起至今 | 208.72% | 1.82% | 45.32% | 0.80% | 163.40% | 1.02% |

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本着公允性原则、可复制性原则和再平衡等原则，本基金选取“65%×沪深 300 指数收益率+35%×中证全债指数收益率”作为本基金的比较基准。

§ 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

新沃基金管理有限公司成立于 2015 年 8 月，是一家经中国证监会核准设立的全国性基金管理公司，经营范围包括公募基金管理业务、证券投资基金销售服务和中国证监会许可的其他业务。截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 4 只公募基金，分别是新沃通宝货币市场基金、新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金、新沃通利纯债债券型证券投资基金、新沃创新领航混合型证券投资基金。

未来，公司将继续秉承“专业创造机会，合作实现价值”的发展理念，坚持“以人为本”的发展战略，坚守“诚信、专业、合作、超越”的价值准则，致力于经过长期努力跻身国内一流基金管理公司行列，力求为广大投资者提供稳定的投资回报。

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 | | |
| 陈乐华 | 本基金的基金经理 | 2019 年 9 月 30 日 | - | 14 年 | 中央财经大学金融学硕士，中国籍。2007 年 7 月至 2010 年 5 月任职于中信建投证券，担任研究发展部经理；2010 年 5 月至 2016 年 10 月任职于华宝兴业基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理、高级分析师等职务；2016 年 11 月至 2018 年 8 月任职于北信瑞丰基金管理有限公司，担任基金经理；2018 年 9 月加入新沃基金管理有限公司，任投资研究部研究总监，现任新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新沃创新领航混合型证券投资基金基金经理。 |

- 1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
- 2、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。

4.1.3 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

本报告期末基金经理无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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。

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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《新沃基金管理有限公司公平交易管理办法》，在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面对公平交易制度予以落实，确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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，全球新冠疫情依然此起彼伏，印度、东南亚和欧洲轮番出现新一波的新冠疫情冲击。得益于国内新冠疫苗接种的快速推进以及有效的疫情控制措施，中国国内并未再度爆发大规模疫情。在此背景下，国内经济继续保持复苏步伐。由于基数原因，二季度各项经济指标增速相比今年一季度有不同程度的放缓，但整体仍处在比较高的水平。

A 股市场在经历了春节后的快速下跌后开始震荡向上步伐，个股的结构性情较为明显。报告期内，除了上证 50 指数小幅收跌外，其他主要指数均有不同程度的涨幅，其中，上证指数上涨 3.4%，深成指上涨 4.78%，中小 100 指数上涨 3.66%，创业板指数上涨 17.22%，科创 50 指数上涨 14.01%，科创板和创业板指数的涨幅明显大于上证指数。板块表现方面（中信一级行业指数），基础化工、钢铁、电力设备及新能源和综合行业涨幅靠前，行业指数涨幅均在 20%以上；非银金融、家电和军工行业跌幅靠前，行业指数跌幅均在 10%以上。

报告期间，本基金的仓位一直比较稳定，主要精力放在精选个股方面。报告期内，本基金降

低了化工等传统周期性板块的配置，增加了医疗和医美等未来发展前景较好的板块配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.288 元；本报告期基金份额净值增长率为 22.16%，业绩比较基准收益率为 0.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，我们认为中国经济总体将维持稳定增长的步伐，国外疫情迟迟不能结束对于中国的外需而言其实是一种正向的促进。目前，大家一致比较担心的美国会在下半年收缩流动性，从而会对包括中国在内的广大新兴市场国家的经济和证券市场造成较大的负面影响。我们认为，在美国疫情好转后，其货币政策转向将不可避免，但其对我国经济的影响相对有限。从近几年来陆续实施的各项政策来看，我们国家对科技创新和提升国家硬科技实力的决心是非常强的，我们相信未来中国经济依然能在转型升级中保持稳定增长。

股票市场将继续受益于国内较为宽松的货币环境以及居民资产配置向股市的倾斜，我们继续乐观看待股市下半年的表现。我们继续看好以芯片为首的半导体板块、新能源汽车产业链中的汽车零部件以及锂电池板块、医药医美板块的投资机会。另外，我们也对军工板块的潜在投资机会保持关注和跟踪。

未来，我们将依然严格恪守投资边界，继续坚持自上而下和自下而上相结合的选股思路，积极寻找优质标的，力争获取较高的收益。我们将继续重点投资和配置新能源汽车及智能驾驶产业链、半导体芯片及设备产业链、5G 及相关衍生产业链和创新药及高端医疗器械产业链中的优质公司，力争为持有人带来较好的业绩回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，为建立健全有效的估值政策和程序，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由投资研究部、监察稽核部、基金事务部相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值委员会依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并

征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值委员会审议，同时按流程对外公布。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

(3) 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

(4) 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况；本基金于 2021 年 1 月 4 日至 2021 年 6 月 30 日期间出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会报告并提出解决方案，本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金的管理人——新沃基金管理有限公司在新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新沃基金管理有限公司编制和披露的新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：新沃通盈灵活配置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 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,142,356.06 | 805,993.07 |
| 结算备付金 | | 38,849.96 | 14,709.96 |
| 存出保证金 | | 5,206.41 | 4,587.96 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 17,739,266.00 | 12,503,188.00 |
| 其中：股票投资 | | 17,739,266.00 | 12,503,188.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 205,094.45 | 222,464.31 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 120.48 | 109.27 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 54,686.95 | 4,283.57 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 19,185,580.31 | 13,555,336.14 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 240,439.14 | 165,849.11 |
| 应付管理人报酬 | | 8,820.07 | 7,021.13 |
| 应付托管费 | | 2,205.02 | 1,755.27 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 7,240.91 | 4,556.04 |
| 应交税费 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 16,439.10 | 37,000.00 |
| 负债合计 | | 275,144.24 | 216,181.55 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 8,265,677.74 | 7,120,000.17 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 10,644,758.33 | 6,219,154.42 |
| 所有者权益合计 | | 18,910,436.07 | 13,339,154.59 |
| 负债和所有者权益总计 | | 19,185,580.31 | 13,555,336.14 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.288 元，基金份额总额 8,265,677.74 份。

6.2 利润表

会计主体：新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 2,627,826.73 | 2,537,071.58 |
| 1.利息收入 | | 2,616.51 | 4,352.44 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 2,616.51 | 4,352.44 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 1,168,582.74 | -22,482.37 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 1,130,215.71 | -44,174.26 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.1 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 38,367.03 | 21,691.89 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 1,339,428.84 | 2,368,958.26 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 117,198.64 | 186,243.25 |
| 减：二、费用 | | 133,129.63 | 133,916.75 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 53,719.36 | 41,775.70 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 13,429.89 | 10,443.89 |

| | | | |
|----------------------------|------------|--------------|--------------|
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 39,941.28 | 35,748.02 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 26,039.10 | 45,949.14 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 2,494,697.10 | 2,403,154.83 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 2,494,697.10 | 2,403,154.83 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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） | 7,120,000.17 | 6,219,154.42 | 13,339,154.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 2,494,697.10 | 2,494,697.10 |
| 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） | 1,145,677.57 | 1,930,906.81 | 3,076,584.38 |
| 其中：1.基金申购款 | 9,203,484.57 | 10,023,672.22 | 19,227,156.79 |
| 2.基金赎回款 | -8,057,807.00 | -8,092,765.41 | -16,150,572.41 |
| 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） | 8,265,677.74 | 10,644,758.33 | 18,910,436.07 |
| 项目 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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) | 2,675,499.00 | 386,875.40 | 3,062,374.40 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 2,403,154.83 | 2,403,154.83 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 7,691,340.82 | 2,335,713.09 | 10,027,053.91 |
| 其中：1.基金申购款 | 27,564,689.08 | 9,125,248.93 | 36,689,938.01 |
| 2.基金赎回款 | -19,873,348.26 | -6,789,535.84 | -26,662,884.10 |
| 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) | 10,366,839.82 | 5,125,743.32 | 15,492,583.14 |

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：

邢凯

邢凯

韩丹

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2016]394号《关于准予新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由新沃基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币201,825,420.01元,经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1247号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为201,825,782.39份基金份额,其中认购资金利息折合362.38份基金份额。本基金的基金管理人为新沃基金管理有限公司(以下简称“新沃基金”),基金托管人为

中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新沃通盈灵活配置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(包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、资产支持证券等)、权证、货币市场工具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相关规定)。本基金股票资产占基金资产的比例为 0%-95%,持有的权证合计市值占基金资产的比例为 0%-3%;保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值 5%。本基金的业绩比较基准为 $65% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 35% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

本基金的财务报表于 2021 年 8 月 25 日已经本基金的基金管理人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止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

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相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通

知》、财税[2008]1号《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[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号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，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) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

(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) 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、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

(7) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 2021年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 1,142,356.06 |
| 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： | 1,142,356.06 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 | | |
|---------------|-------------------|---------------|--------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 12,774,467.05 | 17,739,266.00 | 4,964,798.95 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 12,774,467.05 | 17,739,266.00 | 4,964,798.95 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 100.58 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 17.50 |
| 应收债券利息 | - |
| 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 | 2.40 |
| 合计 | 120.48 |

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 7,240.91 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 7,240.91 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 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 | 16,439.10 |
| 合计 | 16,439.10 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 7,120,000.17 | 7,120,000.17 |
| 本期申购 | 9,203,484.57 | 9,203,484.57 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -8,057,807.00 | -8,057,807.00 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 8,265,677.74 | 8,265,677.74 |

6.4.7.10 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 | 2,293,823.85 | 3,925,330.57 | 6,219,154.42 |
| 本期利润 | 1,155,268.26 | 1,339,428.84 | 2,494,697.10 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 521,951.38 | 1,408,955.43 | 1,930,906.81 |
| 其中：基金申购款 | 4,168,554.60 | 5,855,117.62 | 10,023,672.22 |
| 基金赎回款 | -3,646,603.22 | -4,446,162.19 | -8,092,765.41 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,971,043.49 | 6,673,714.84 | 10,644,758.33 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 2,337.03 |
| 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 | 236.01 |
| 其他 | 43.47 |
| 合计 | 2,616.51 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|---------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额 | 17,189,863.59 |
| 减：卖出股票成本总额 | 16,059,647.88 |
| 买卖股票差价收入 | 1,130,215.71 |

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|---------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 38,367.03 |
| 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 | 38,367.03 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 1,339,428.84 |
| ——股票投资 | 1,339,428.84 |
| ——债券投资 | - |
| ——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 | 1,339,428.84 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 117,198.64 |
| 合计 | 117,198.64 |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，对持有期内的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 39,941.28 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 交易基金产生的费用 | - |
| 其中：申购费 | - |
| 赎回费 | - |
| 合计 | 39,941.28 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 7,439.10 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 其他手续费 | 600.00 |
| 银行间账户维护费 | 18,000.00 |
| 合计 | 26,039.10 |

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

无。

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 |
|--------------|---------------------|
| 新沃基金 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行 | 基金托管人 |
| 新沃联合资产管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 新沃资本控股集团有限公司 | 基金管理人的股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

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 2021年1月1日至2021年6月 30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 53,719.36 | 41,775.70 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 15,570.81 | 10,744.67 |

注：支付基金管理人新沃基金的管理人报酬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。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 13,429.89 | 10,443.89 |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
| 基金合同生效日（2016 年 9 月 22 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 1,878,908.13 | 1,878,908.13 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 1,878,908.13 | 1,878,908.13 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 22.73% | 18.12% |

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|--------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 1,142,356.06 | 2,337.03 | 815,700.99 | 3,903.97 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按适用利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金以风险管理为前提，通过把握中国稳增长与促转型的发展现状，灵活运用多种投资策略，挖掘各大类资产配置机会，力求高于业绩比较基准的长期资产增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

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

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

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 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 | 1,142,356.06 | - | - | - | 1,142,356.06 |
| 结算备付金 | 38,849.96 | - | - | - | 38,849.96 |
| 存出保证金 | 5,206.41 | - | - | - | 5,206.41 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 17,739,266.00 | 17,739,266.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 205,094.45 | 205,094.45 |
| 应收利息 | - | - | - | 120.48 | 120.48 |
| 应收申购款 | - | - | - | 54,686.95 | 54,686.95 |

| | | | | | |
|---------------------|--------------|------|------|----------------|---------------|
| 资产总计 | 1,186,412.43 | - | - | -17,999,167.88 | 19,185,580.31 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 240,439.14 | 240,439.14 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 8,820.07 | 8,820.07 |
| 应付托管费 | - | - | - | 2,205.02 | 2,205.02 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 7,240.91 | 7,240.91 |
| 其他负债 | - | - | - | 16,439.10 | 16,439.10 |
| 负债总计 | - | - | - | 275,144.24 | 275,144.24 |
| 利率敏感度缺口 | 1,186,412.43 | - | - | -17,724,023.64 | 18,910,436.07 |
| 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 | 805,993.07 | - | - | - | 805,993.07 |
| 结算备付金 | 14,709.96 | - | - | - | 14,709.96 |
| 存出保证金 | 4,587.96 | - | - | - | 4,587.96 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -12,503,188.00 | 12,503,188.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 222,464.31 | 222,464.31 |
| 应收利息 | - | - | - | 109.27 | 109.27 |
| 应收申购款 | - | - | - | 4,283.57 | 4,283.57 |
| 资产总计 | 825,290.99 | - | - | -12,730,045.15 | 13,555,336.14 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 165,849.11 | 165,849.11 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 7,021.13 | 7,021.13 |
| 应付托管费 | - | - | - | 1,755.27 | 1,755.27 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 4,556.04 | 4,556.04 |
| 其他负债 | - | - | - | 37,000.00 | 37,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 216,181.55 | 216,181.55 |
| 利率敏感度缺口 | 825,290.99 | - | - | -12,513,863.60 | 13,339,154.59 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。于2021年6月30日，本基金未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

本基金在深度把握中国经济发展与转型的基础上，通过自上而下的宏观-中观-微观的资产配置策略，以及自下而上的精选行业、个股的基本面分析策略，再通过定性分析和定量分析相互结合的选股方法，辅以多种事件驱动、量化研究等工具策略，在风险管理的前提下因势利导运用多样化的投资策略实现基金资产长期增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

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 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 17,739,266.00 | 93.81 | 12,503,188.00 | 93.73 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 17,739,266.00 | 93.81 | 12,503,188.00 | 93.73 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|-------------------------|-----------------------------|------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2021 年 6 月 | 上年度末（2020 年 12 月 |

| | | 30 日) | 31 日) |
|--|----------------|------------------|---------------|
| | 沪深 300 指数上升 5% | 1, 225, 927. 72 | 846, 676. 24 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -1, 225, 927. 72 | -846, 676. 24 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 17, 739, 266. 00 元，无属于第二层或第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，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 | 17,739,266.00 | 92.46 |
| | 其中：股票 | 17,739,266.00 | 92.46 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,181,206.02 | 6.16 |
| 8 | 其他各项资产 | 265,108.29 | 1.38 |
| 9 | 合计 | 19,185,580.31 | 100.00 |

7.2 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

金额单位：人民币元

| 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 | - | - |
| C | 制造业 | 16,017,490.00 | 84.70 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,045,226.00 | 5.53 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|---------------|-------|
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 676,550.00 | 3.58 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 17,739,266.00 | 93.81 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 300782 | 卓胜微 | 2,600 | 1,397,500.00 | 7.39 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 2,600 | 1,390,480.00 | 7.35 |
| 3 | 300661 | 圣邦股份 | 4,800 | 1,213,104.00 | 6.41 |
| 4 | 002460 | 赣锋锂业 | 9,300 | 1,126,137.00 | 5.96 |
| 5 | 603501 | 韦尔股份 | 3,400 | 1,094,800.00 | 5.79 |
| 6 | 002371 | 北方华创 | 3,600 | 998,568.00 | 5.28 |
| 7 | 002906 | 华阳集团 | 28,300 | 893,714.00 | 4.73 |
| 8 | 300496 | 中科创达 | 5,600 | 879,536.00 | 4.65 |
| 9 | 002920 | 德赛西威 | 7,900 | 869,632.00 | 4.60 |
| 10 | 300725 | 药石科技 | 4,700 | 746,877.00 | 3.95 |
| 11 | 300415 | 伊之密 | 33,600 | 722,400.00 | 3.82 |
| 12 | 300896 | 爱美客 | 900 | 709,992.00 | 3.75 |
| 13 | 300347 | 泰格医药 | 3,500 | 676,550.00 | 3.58 |
| 14 | 688363 | 华熙生物 | 2,400 | 666,864.00 | 3.53 |
| 15 | 601689 | 拓普集团 | 17,400 | 651,282.00 | 3.44 |
| 16 | 300408 | 三环集团 | 13,800 | 585,396.00 | 3.10 |
| 17 | 688366 | 昊海生科 | 2,700 | 565,110.00 | 2.99 |
| 18 | 300037 | 新宙邦 | 5,600 | 560,560.00 | 2.96 |
| 19 | 300957 | 贝泰妮 | 1,700 | 461,873.00 | 2.44 |
| 20 | 002138 | 顺络电子 | 10,700 | 414,839.00 | 2.19 |
| 21 | 603678 | 火炬电子 | 4,800 | 324,000.00 | 1.71 |
| 22 | 688301 | 奕瑞科技 | 1,100 | 308,000.00 | 1.63 |
| 23 | 002497 | 雅化集团 | 9,800 | 223,244.00 | 1.18 |
| 24 | 688083 | 中望软件 | 300 | 165,690.00 | 0.88 |
| 25 | 002979 | 雷赛智能 | 3,000 | 86,010.00 | 0.45 |

| | | | | | |
|----|--------|-----|-----|----------|------|
| 26 | 002407 | 多氟多 | 200 | 7,108.00 | 0.04 |
|----|--------|-----|-----|----------|------|

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 | 002906 | 华阳集团 | 962,917.91 | 7.22 |
| 2 | 300661 | 圣邦股份 | 738,205.00 | 5.53 |
| 3 | 002979 | 雷赛智能 | 720,008.00 | 5.40 |
| 4 | 300408 | 三环集团 | 718,002.00 | 5.38 |
| 5 | 300750 | 宁德时代 | 705,739.00 | 5.29 |
| 6 | 600346 | 恒力石化 | 701,636.00 | 5.26 |
| 7 | 300782 | 卓胜微 | 668,791.00 | 5.01 |
| 8 | 300415 | 伊之密 | 651,300.00 | 4.88 |
| 9 | 300725 | 药石科技 | 637,986.00 | 4.78 |
| 10 | 002138 | 顺络电子 | 625,432.00 | 4.69 |
| 11 | 000710 | 贝瑞基因 | 588,511.00 | 4.41 |
| 12 | 688363 | 华熙生物 | 564,780.83 | 4.23 |
| 13 | 600703 | 三安光电 | 561,746.00 | 4.21 |
| 14 | 002460 | 赣锋锂业 | 550,133.00 | 4.12 |
| 15 | 600584 | 长电科技 | 546,624.69 | 4.10 |
| 16 | 688366 | 昊海生科 | 542,726.71 | 4.07 |
| 17 | 000902 | 新洋丰 | 538,247.00 | 4.04 |
| 18 | 603501 | 韦尔股份 | 536,780.00 | 4.02 |
| 19 | 300896 | 爱美客 | 524,084.00 | 3.93 |
| 20 | 300347 | 泰格医药 | 498,667.00 | 3.74 |
| 21 | 300567 | 精测电子 | 492,788.00 | 3.69 |
| 22 | 002850 | 科达利 | 464,785.00 | 3.48 |
| 23 | 300957 | 贝泰妮 | 455,525.00 | 3.41 |
| 24 | 601689 | 拓普集团 | 440,248.00 | 3.30 |
| 25 | 300496 | 中科创达 | 423,143.00 | 3.17 |
| 26 | 688301 | 奕瑞科技 | 403,475.00 | 3.02 |
| 27 | 603986 | 兆易创新 | 397,282.00 | 2.98 |
| 28 | 002185 | 华天科技 | 393,793.00 | 2.95 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 29 | 000915 | 华特达因 | 391,187.00 | 2.93 |
| 30 | 002407 | 多氟多 | 369,567.00 | 2.77 |
| 31 | 603678 | 火炬电子 | 348,401.00 | 2.61 |
| 32 | 300027 | 华谊兄弟 | 345,390.00 | 2.59 |
| 33 | 002497 | 雅化集团 | 343,559.90 | 2.58 |
| 34 | 002920 | 德赛西威 | 309,220.00 | 2.32 |
| 35 | 002957 | 科瑞技术 | 308,451.00 | 2.31 |
| 36 | 002371 | 北方华创 | 273,972.00 | 2.05 |

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

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 | 002497 | 雅化集团 | 1,638,755.00 | 12.29 |
| 2 | 002493 | 荣盛石化 | 1,063,260.00 | 7.97 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 916,083.00 | 6.87 |
| 4 | 600584 | 长电科技 | 791,214.00 | 5.93 |
| 5 | 002850 | 科达利 | 741,287.00 | 5.56 |
| 6 | 600346 | 恒力石化 | 685,034.34 | 5.14 |
| 7 | 000710 | 贝瑞基因 | 651,473.00 | 4.88 |
| 8 | 603986 | 兆易创新 | 639,908.00 | 4.80 |
| 9 | 002185 | 华天科技 | 617,275.00 | 4.63 |
| 10 | 002460 | 赣锋锂业 | 593,423.00 | 4.45 |
| 11 | 002979 | 雷赛智能 | 590,129.25 | 4.42 |
| 12 | 002080 | 中材科技 | 588,274.00 | 4.41 |
| 13 | 000902 | 新洋丰 | 498,922.00 | 3.74 |
| 14 | 603659 | 璞泰来 | 479,728.00 | 3.60 |
| 15 | 300782 | 卓胜微 | 466,992.00 | 3.50 |
| 16 | 600703 | 三安光电 | 404,424.00 | 3.03 |
| 17 | 000915 | 华特达因 | 396,843.00 | 2.98 |
| 18 | 300567 | 精测电子 | 384,107.00 | 2.88 |
| 19 | 300027 | 华谊兄弟 | 332,340.00 | 2.49 |
| 20 | 300136 | 信维通信 | 326,096.00 | 2.44 |
| 21 | 300037 | 新宙邦 | 325,424.00 | 2.44 |
| 22 | 002407 | 多氟多 | 313,747.00 | 2.35 |
| 23 | 603290 | 斯达半导 | 311,171.00 | 2.33 |
| 24 | 002957 | 科瑞技术 | 301,388.00 | 2.26 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 25 | 300661 | 圣邦股份 | 294,631.00 | 2.21 |
|----|--------|------|------------|------|

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

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

| | |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 19,956,297.04 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 17,189,863.59 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 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 | 5,206.41 |
| 2 | 应收证券清算款 | 205,094.45 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 120.48 |
| 5 | 应收申购款 | 54,686.95 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 265,108.29 |

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|--------------|------------|--------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 1,660 | 4,979.32 | 2,574,452.31 | 31.15% | 5,691,225.43 | 68.85% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 54,446.29 | 0.6587% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（ 2016 年 9 月 22 日 ）基金份额总额 | 201,825,782.39 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 7,120,000.17 |
| 本报告期基金总申购份额 | 9,203,484.57 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 8,057,807.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 8,265,677.74 |

§ 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，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，王靖飞先生担任本公司督察长职务，邢凯先生不再代任本公司督察长职务，具体信息请参见基金管理人于 2021 年 2 月 25 日披露的《新沃基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金托管人根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本基金托管人资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期末内无涉及本基金管理人、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

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙）自 2020 年 11 月 19 日起为本基金提供审计服务至今。

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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | |
| 国金证券 | 2 | 21,958,607.03 | 59.11% | 11,227.27 | 57.71% | - |
| 申万宏源证券 | 1 | 9,926,808.06 | 26.72% | 7,259.70 | 37.31% | - |
| 渤海证券 | 1 | 3,836,933.54 | 10.33% | 810.77 | 4.17% | - |
| 财通证券 | 2 | 1,423,812.00 | 3.83% | 158.45 | 0.81% | - |
| 中银国际证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 联讯证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、根据中国证监会《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）的规定及《新沃基金管理有限公司交易席位管理办法》，本基金管理人制定了券商选择标准和租用交易单元的程序，在对证券公司综合评估的基础上，选择财务状况良好，经营行为规范，研究实力较强的证券公司，向其租用专用交易席位。确定选用交易单元的券商后，本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租赁协议，并通知基金托管人。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：本基金本报告期内退租粤开证券 1 个席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|--------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 | - | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 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 | 新沃基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年 12 月 31 日基金份额净值和基金份额累计净值公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2021 年 1 月 1 日 |
| 2 | 新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2021 年 1 月 21 日 |
| 3 | 新沃基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2021 年 1 月 29 日 |
| 4 | 新沃基金管理有限公司关于增加 | 指定报刊和/或管理 | 2021 年 2 月 8 日 |

| | | | |
|----|---|--------------|-----------------|
| | 众惠基金销售有限公司为基金销售机构的公告 | 人网站 | |
| 5 | 新沃基金管理有限公司关于增加联储证券有限责任公司为新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2021 年 3 月 12 日 |
| 6 | 新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2021 年 3 月 30 日 |
| 7 | 新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2021 年 4 月 21 日 |
| 8 | 新沃基金管理有限公司关于增加财咨道信息技术有限公司为基金销售机构的公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2021 年 4 月 29 日 |
| 9 | 新沃基金管理有限公司关于调整旗下部分基金投资范围、增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2021 年 4 月 29 日 |
| 10 | 新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2021 年 4 月 29 日 |
| 11 | 新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2021 年 4 月 29 日 |
| 12 | 新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2021 年第 1 号) | 指定报刊和/或管理人网站 | 2021 年 4 月 29 日 |
| 13 | 新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新) | 指定报刊和/或管理人网站 | 2021 年 4 月 29 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

| 投资者类别 | 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 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2021/01/01-2021/01/19;2021/03/26-2021/06/30 | 1,878,908.13 | - | - | 1,878,908.13 | 22.73% |

产品特有风险

- (1) 赎回申请延期办理的风险
高比例投资者大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。
- (2) 基金净值大幅波动的风险
当高比例投资者大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。
- (3) 基金规模较小导致的风险
高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。
- (4) 提前终止基金合同的风险
高比例投资者赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《关于申请募集注册新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

12.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

新沃基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日