

# 鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	19
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>20</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	20
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>21</b>
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>24</b>
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>66</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	66
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	66
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	67
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	81
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	82
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	83
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	83

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	83
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	83
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	83
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	84
8.12 投资组合报告附注 .....	84
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>86</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	86
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	86
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	86
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	86
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>87</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>88</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	88
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	88
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	88
11.4 基金投资策略的改变 .....	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	88
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	88
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	89
11.8 其他重大事件 .....	90
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>93</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	93
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	93
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>94</b>
13.1 备查文件目录 .....	94
13.2 存放地点 .....	94
13.3 查阅方式 .....	94

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	鑫元鑫趋势	
基金主代码	004944	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年8月24日	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	98,980,064.35份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C
下属分级基金的交易代码:	004944	004948
报告期末下属分级基金的份额总额	75,724,954.58份	23,255,109.77份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在秉承价值投资理念的情况下，严格控制投资组合风险，并在追求资金的安全与长期稳定增长的基础上，通过积极主动的资产配置，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采用自上而下为主的分析模式、定性分析和定量分析相结合的研究方式，跟踪宏观经济基本面、政策面和资金等多方面因素，评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，并利用上述大类资产之间的相互关联性进行灵活的资产配置，制定本基金的大类资产配置比例，并适时进行调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鑫元基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕	胡波
	联系电话	021-20892000 转	021-61618888
	电子邮箱	service@xyamc.com	hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		4006066188	95528
传真		021-20892111	021-63602540
注册地址		上海市静安区中山北路909号12层	上海市中山东一路12号
办公地址		上海市静安区中山北路909	上海市北京东路689号

	号 12 层	
邮政编码	200070	200001
法定代表人	洪伟	郑杨

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xyamc.com">http://www.xyamc.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市静安区中山北路 909 号 12 层 鑫元基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	鑫元基金管理有限公司	上海市静安区中山北路 909 号 12 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年		2020 年		2019 年	
	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C
本期已实现收益	46,405,866.57	8,340,772.75	27,265,252.89	6,380,331.69	3,582,363.68	-1,105,032.65
本期利润	29,382,578.31	4,314,498.99	51,548,133.74	11,798,332.78	12,685,114.95	1,908,033.96
加权平均基金份额本期利润	0.2484	0.1947	0.3493	0.3988	0.2540	0.0462
本期加权平均	16.03%	12.73%	29.35%	33.88%	26.31%	4.92%

净值利润率						
本期基金份额净值增长率	14.24%	13.79%	41.84%	41.29%	9.41%	8.95%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	41,118,105.03	11,875,543.47	26,651,674.88	2,988,083.00	-4,934,120.86	-1,145,427.73
期末可供分配基金份额利润	0.5430	0.5107	0.1593	0.1401	-0.0380	-0.0498



期末基金资产净值	125,964,401 .10	37,906,446 .11	243,654,211 .02	30,562,057 .19	133,333,912 .37	23,313,099 .95
期末基金份额净值	1.6634	1.6300	1.4560	1.4325	1.0265	1.0139
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	66.34%	63.00%	45.60%	43.25%	2.65%	1.39%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鑫元鑫趋势 A

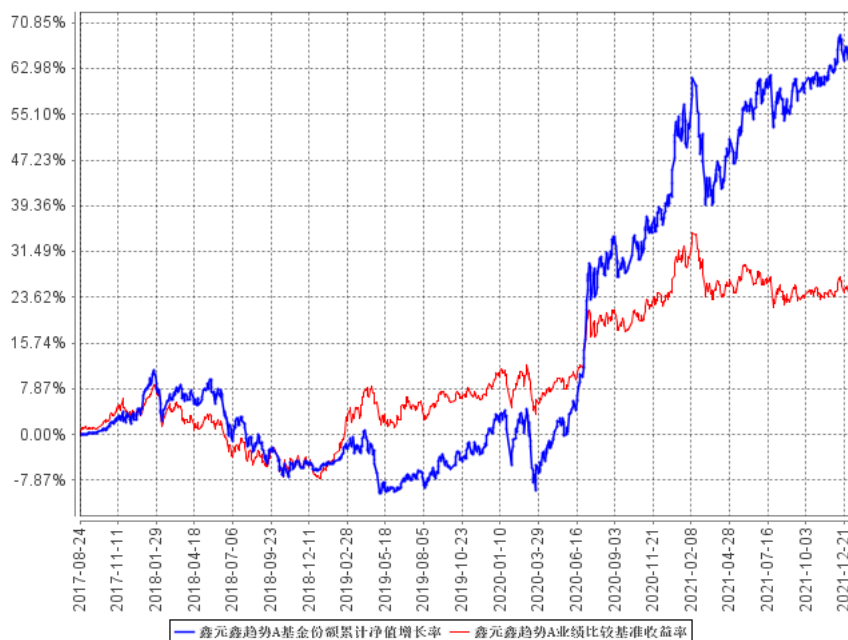
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.75%	0.59%	1.28%	0.40%	2.47%	0.19%
过去六个月	3.33%	0.77%	-1.45%	0.51%	4.78%	0.26%
过去一年	14.24%	0.99%	-0.48%	0.59%	14.72%	0.40%
过去三年	77.30%	0.97%	38.43%	0.64%	38.87%	0.33%
自基金合同生效起至今	66.34%	0.88%	25.42%	0.63%	40.92%	0.25%

鑫元鑫趋势 C

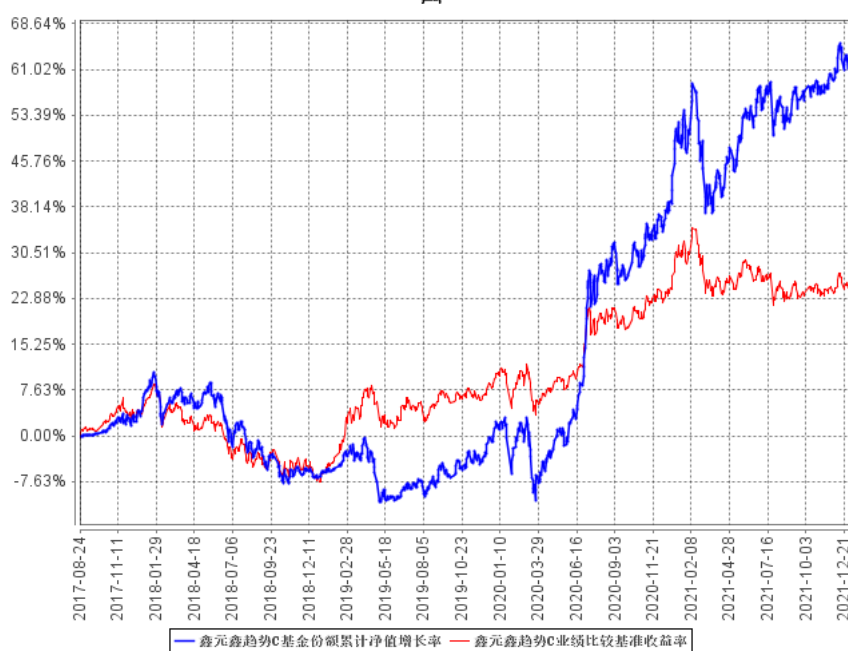
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.64%	0.59%	1.28%	0.40%	2.36%	0.19%
过去六个月	3.13%	0.77%	-1.45%	0.51%	4.58%	0.26%
过去一年	13.79%	0.99%	-0.48%	0.59%	14.27%	0.40%
过去三年	75.16%	0.97%	38.43%	0.64%	36.73%	0.33%
自基金合同生效起至今	63.00%	0.88%	25.42%	0.63%	37.58%	0.25%

### 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

鑫元鑫趋势A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



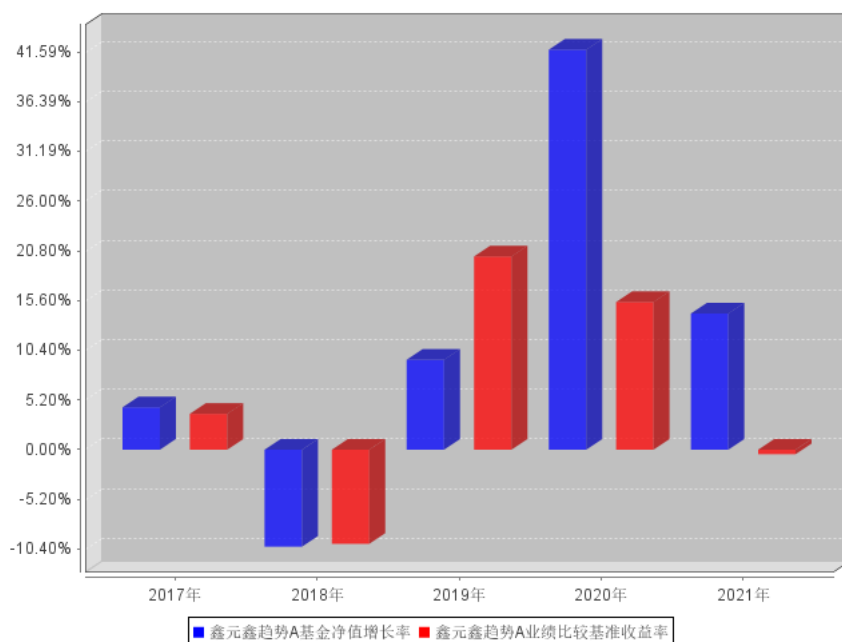
鑫元鑫趋势C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



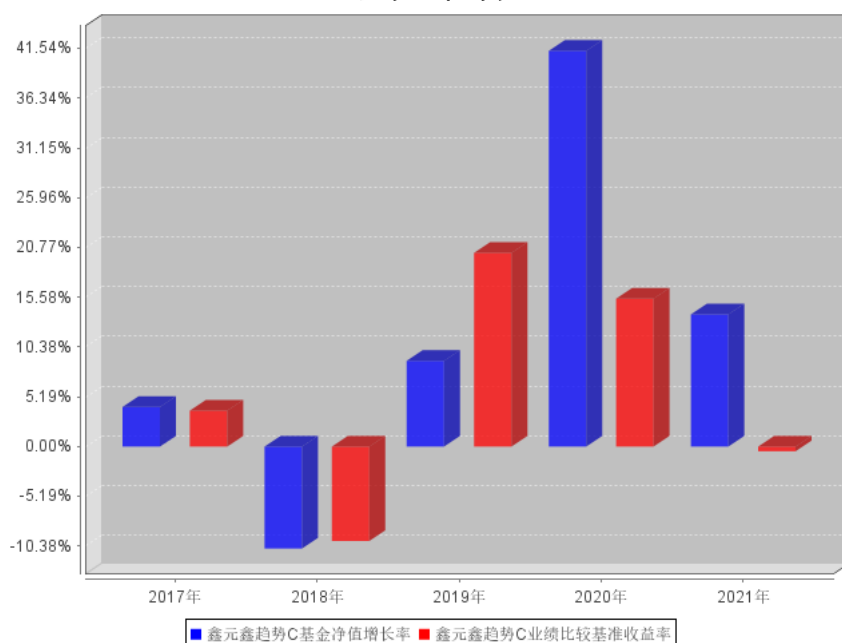
注：本基金的合同生效日为 2017 年 8 月 24 日。根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

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

鑫元鑫趋势A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



鑫元鑫趋势C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未实施利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为鑫元基金管理有限公司，本公司经中国证监会证监许可[2013]1115 号文批准于 2013 年 8 月成立，由南京银行股份有限公司发起，与南京高科股份有限公司联合组建；注册资本 17 亿元人民币，总部设在上海。经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理（包括特定对象投资咨询）和中国证监会许可的其他业务。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司旗下管理 48 只证券投资基金——鑫元货币市场基金、鑫元恒鑫收益增强债券型发起式证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元合享纯债债券型证券投资基金、鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元安鑫宝货币市场基金、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金、鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、鑫元聚利债券型证券投资基金、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元招利债券型证券投资基金、鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元添利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金、鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金、鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金、鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元全利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金、鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元臻利债券型证券投资基金、鑫元承利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元悦利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元永利债券型证券投资基金、鑫元恒利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元安睿三年定期开放债券型证券投资基金、鑫元泽利债券型证券投资基金、鑫元富利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、鑫元中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、鑫元锦利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元一年定期开放中高等级债券型证券投资基金、鑫元中短债债券型证券投资基金、鑫元安硕两年定期开放债券型证券投资基金、鑫元安鑫回报混合型证券投资基金、鑫元乾利债券型证券投资基金、鑫元鑫动力混合型证券投资基金、鑫元金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁玥	本基金的基金经理、权益投资部总经理、基金投资决策委员会委员	2017年9月4日	-	13年	<p>学历：金融工程硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。曾任中国国际金融有限公司研究部副总经理。2015年7月加入鑫元基金，历任信用研究主管、市场研究部总监，现任权益投资部总经理、基金经理。</p> <p>现任鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金、鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的基金经理。</p>
曹建华	本基金的基金经理、信用研究主管。	2021年9月28日	-	6年	<p>学历：理学硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。历任远东国际租赁有限公司风险评估专员。2016年6月加入鑫元基金，历任研究员、信用研究主管、基金经理助理，现任基金经理。</p> <p>现任鑫元恒鑫收益增强债券型发起式证券投资基金、鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元增利定期开放债券型发起</p>

					式证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。
赵慧	本基金的基金经理、固定收益部总经理助理。	2018年11月13日	2021年9月28日	8年	学历：经济学硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。历任北京汇致资本管理有限公司交易员、南京银行金融市场部资产管理部和金融市场部投资交易中心债券交易员，2014年6月加入鑫元基金担任基金经理助理，现固定收益部总经理助理、基金经理。现任鑫元货币市场基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元安鑫宝货币市场基金、鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元悦利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元富利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元中短债债券型证券投资基金、鑫元安鑫回报混合型证券投资基金的基金经理。

- 注：1. 基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离职日期为根据公司决议确定的解聘日期；
2. 非首任基金经理，任职日期和离任日期分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；
3. 证券从业的含义遵从《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

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内本基金的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

在本报告期内，基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定，基金投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规，制定并不断完善公司内部关于公平交易管理的各项制度和要求，规范公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动，同时涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

在研究工作层面，公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。在投资决策层面，公司执行自上而下的分级投资权限管理体系，依次为投资决策委员会、投资分管领导、投资组合经理，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和投资分管领导等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行不合理干预。投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易执行层面，公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。不同投资组合下达同一证券的同向交易指令时，按照“价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡”的原则在各投资组合间公平分配交易机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易部询价机制，严格防范交易对手风险并审查价格公允性；对于一级市场申购投资行为，遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。在事后分析层面，公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部关于公平交易管理的各项制度规范，进一步完善境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易活动。本公司通过系统控制和人工控制等各种方式，确保本公司管理的不同投



投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的相关环节均得到公平对待。

报告期内，公司整体公平交易制度执行情况良好，通过对不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易价格和交易时机进行监控分析，未发现违反公平交易要求的情况。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司已制订并不断完善内部异常交易监控管理相关制度，通过系统和人工相结合的方式进行基金投资交易行为的日常监督检查，执行异常交易行为的监控、分析与记录工作机制。报告期内未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 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

回顾 2021 年的 A 股市场，各大指数整体表现为区间震荡的走势，全年上证指数、深证成指、沪深 300 指数的涨幅分别为 4.80%、2.67%、-5.20%；振幅分别为 12.06%、21.01%、24.31%。仅创业板指数的表现稍显突出，全年上涨 12.02%，当然振幅也达到 32.77%。各行业板块之间的轮动颇为明显：年初以各行业龙头为代表的核心资产大幅上涨，经历春节之后的快速下跌；二季度至三季度，在行业景气度和市场流动性双重支持下，新能源行业获得了业绩与估值的双击，无论个股还是行业整体都有了相当的涨幅。三季度末开始的电力供应局部性紧张，又推升了煤炭、有色等传统周期性行业。最后在稳增长政策放松的预期下，房地产行业在四季度出现了一定幅度的反弹。

年内大部分时间里，本基金在整体仓位上较为积极。坚定持有受益于海外资产配置的方向、基本面扎实的个股，用分散化持股来降低组合波动率，并充分利用科创板和创业板打新，为投资者增厚收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内鑫元鑫趋势 A 的基金份额净值增长率为 14.24%，鑫元鑫趋势 C 的基金份额净值增长率为 13.79%，同期业绩比较基准收益率为-0.48%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望全年，美国及海外方主要经济体货币转向收紧是为全球资产价格定调的宏观背景。疫情后的经济复苏趋于尾声，能源价格和劳动工资的上涨会螺旋式提升通胀预期，从而导致美联储可

能会因此超预期地连续加息，引发全球金融市场的调整。国内政策已经在去年底的经济工作会议上明确了稳增长的基调。货币政策跨周期调节，保持相对宽松，但是宽货币之后宽信用的效果，还有待市场验证。全球通胀水平、严控“房住不炒”和地方融资平台收紧等结构性改革的长期措施可能成为宽信用的束缚。因此，在国内经济增速压力较大，稳增长政策的力度和效果有待验证，叠加海外存在超预期紧缩等情况下，上半年市场可能承压。下半年，在经济缓步走出压力区，稳增长的政策效果逐渐显现，海外货币紧缩不确定性下降的背景下，代表稳增长的低估值品种和受益于景气度回升的成长股，将带动市场逐步回升。

我们组合的配置策略将坚持攻守兼备，一方面配置一部分低估值且受益于稳增长的传统行业龙头，以平抑组合的波动性；另一方面会继续在景气成长行业中积极布局，精选细分行业景气度持续向上，且具备核心竞争力的上市公司。尽管这一宗旨与往年相同，但在估值容忍度上要比去年更严苛，这是在全球货币紧缩的大背景下做出的相应调整。我们认为能源革命带动的高景气赛道是长周期的，短期面临约束进行修正只是阶段性的，待经济见底、上游产能投放等约束打开仍将继续维持景气。而且在新能源基础设施、新型电力系统、绿电运营等领域还有很多可以延伸和拓展的机会。在电动化上半场完成后，智能化下半场的机会也有很多值得挖掘。在过去两年受损的行业中，也存在不少困境反转的机会值得布局。当然，这需要管理人团队对行业格局有深入的理解，对行业发展趋势有深刻的洞见，对行业的商业模式有充分的预判。这些很难，但管理人团队会尽一百二十分的努力，去研究，去挖掘，去遴选。

2022 年的 A 股开局不利，在市场的波动中，我们需要多一份耐心，等待市场从“复杂博弈”走向“增长证明”。对于宏观的不确定性保持敬畏，扎实研究中微观基本面，不断校准增长的幅度和确定性，从而优化组合。长期投资不是一路坦途，会经历各种意料不到的沟沟坎坎，希望我们能够经受颠簸带来的压力，最终带给投资者满意的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人在监察稽核工作中一方面将坚持投资者利益至上、坚持违法违规零容忍、严防触犯三条底线作为公司的最高经营宗旨和全体员工的根本行为准则，为全面风险管理、全程风险管理与全员风险管理相关内部控制管理规范的推行提供相对有利的内部控制环境；另一方面依据不断发展变化的外部经营环境、监管环境与业务实践对于公司内部控制与风险管理持续进行动态的调整与修正。监察稽核工作致力于保障本基金运作合法合规，切实维护基金份额持有人利益；致力于保障各项法律法规和内部管理制度贯彻执行，推动各项内部控制与风险管理机制的逐步优化与完善，促进公司各项业务合法合规运作。

本报告期内完成的监察稽核工作主要包括：一是密切关注法律法规与监管规范性文件的更新情况，及时进行内部传达以及组织员工学习理解；二是协调内部管理制度体系的修订和完善，推动公司各业务部门持续完善管理制度和业务流程建设，防范日常运作中发生违法违规行为与风险事件；三是从投资决策、研究支持、交易执行、投资监督与风险管理、关联交易管理、公平交易与异常交易监控、内幕交易防控等各方面持续加强对于投资管理业务的内部控制，保障基金投资运作合法合规；四是通过外部和内部培训、日常投资申报管理、员工行为规范管理等方式不断强化员工的合规意识，规范员工行为操守，严格防范利益冲突；五是对基金运作过程中的营销与销售、会计核算估值、信息技术支持等方面进行内部控制与合规管理；六是执行基金运作过程中的临时公告、定期报告、招募说明书更新等相关信息披露工作；七是通过独立开展定期或不定期内部审计，监督检查各业务条线相关内部控制措施设计的合理性以及执行的有效性，针对发现的问题相应提出改进建议并督促相关业务部门及时落实改进措施。

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本公司成立估值委员会，并制订有关工作规则。估值委员会对估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制，确保基金估值的公允、合理。成员包括公司总经理、基金运营部分管领导、投研条线分管领导、交易部分管领导、督察长、固定收益部负责人、权益投资部负责人、市场研究部负责人、风险管理部负责人、监察稽核部负责人、交易部负责人、基金运营部负责人等。本公司使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序；基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。公司基金经理可参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间债券市场及证券交易所上市流通或挂牌转让的固定收益品种的估值数据。

#### **4.8 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。截止报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。

## § 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由鑫元基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 61444343_B20 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估鑫元鑫趋势灵活配置混合型证</p>

	<p>券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p>

	<p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈露	蔺育化
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2022 年 3 月 22 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,689,062.00	492,296.89
结算备付金		5,834,600.50	3,750,280.50
存出保证金		27,353.40	78,672.34
交易性金融资产	7.4.7.2	195,116,492.56	354,022,022.31
其中：股票投资		133,771,692.36	233,784,022.31
基金投资		-	-
债券投资		61,344,800.20	120,238,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		747,273.33	174,982.52
应收利息	7.4.7.5	681,614.60	1,618,327.49
应收股利		-	-
应收申购款		3,073.97	1,099.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		204,099,470.36	360,137,681.96
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		39,799,602.00	85,299,147.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,125.43	176,716.07
应付管理人报酬		123,097.39	180,587.96
应付托管费		23,080.77	33,860.26
应付销售服务费		12,254.34	10,800.03
应付交易费用	7.4.7.7	97,599.40	42,557.73
应交税费		-	1.00
应付利息		-18,136.18	-11,463.15



应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	189,000.00	189,206.85
负债合计		40,228,623.15	85,921,413.75
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	98,980,064.35	188,675,460.65
未分配利润	7.4.7.10	64,890,782.86	85,540,807.56
所有者权益合计		163,870,847.21	274,216,268.21
负债和所有者权益总计		204,099,470.36	360,137,681.96

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 98,980,064.35 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.6634 元，份额总额 75,724,954.58 份；下属 C 类基金份额净值 1.6300 元，份额总额 23,255,109.77 份。

## 7.2 利润表

会计主体：鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		38,060,295.28	67,204,881.14
1.利息收入		2,173,319.11	1,292,010.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	83,524.55	136,456.36
债券利息收入		2,089,794.56	1,044,853.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	110,700.95
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		56,899,194.71	35,991,000.41
其中：股票投资收益	7.4.7.12	54,223,753.52	33,641,413.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	142,108.37	45,062.38
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,533,332.82	2,304,524.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-21,049,562.02	29,700,881.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	37,343.48	220,988.27

列)			
<b>减：二、费用</b>		4,363,217.98	3,858,414.62
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,740,449.25	1,671,972.63
2. 托管费	7.4.10.2.2	326,334.26	313,494.87
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	135,358.52	137,841.55
4. 交易费用	7.4.7.19	433,246.10	750,237.80
5. 利息支出		1,507,834.70	763,765.44
其中：卖出回购金融资产支出		1,507,834.70	763,765.44
6. 税金及附加		0.15	1.54
7. 其他费用	7.4.7.20	219,995.00	221,100.79
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		33,697,077.30	63,346,466.52
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		33,697,077.30	63,346,466.52

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	188,675,460.65	85,540,807.56	274,216,268.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,697,077.30	33,697,077.30
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）	-89,695,396.30	-54,347,102.00	-144,042,498.30
其中：1. 基金申购款	22,326,871.52	13,178,705.66	35,505,577.18
2. 基金赎回款	-112,022,267.82	-67,525,807.66	-179,548,075.48
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	98,980,064.35	64,890,782.86	163,870,847.21

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	152,885,948.75	3,761,063.57	156,647,012.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	63,346,466.52	63,346,466.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	35,789,511.90	18,433,277.47	54,222,789.37
其中：1. 基金申购款	270,138,058.73	51,244,078.63	321,382,137.36
2. 基金赎回款	-234,348,546.83	-32,810,801.16	-267,159,347.99
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）	188,675,460.65	85,540,807.56	274,216,268.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
龙艺

\_\_\_\_\_  
徐小锋

\_\_\_\_\_  
包颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鑫元鑫趋势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[2015]1919 号文《关于准予鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和证监许可[2017]746 号《关于准予鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》核准,由鑫元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《鑫元鑫趋势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 216,116,330.24 元,业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(2017)第 786 号验资报告予以验证。经

向中国证监会备案,《鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 8 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 216,127,039.02 份基金份额,其中认购资金利息折合 10,708.78 份基金份额。本基金的基金管理人为鑫元基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及基金合同的有关规定,经与基金托管人协商一致并报监管机构备案,基金管理人对基金合同进行了修订,并对赎回费相关规则进行了调整。该修订自 2018 年 3 月 31 日起生效。

根据《鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金自募集期起根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别,即 A 类基金份额和 C 类基金份额。其中在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元鑫趋势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(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债、可转换债券含分离交易可转债、可交换债、短期融资券、超短期融资券等)、权证、股指期货、国债期货、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款(包括但不限于协议存款、定期存款及其他银行存款等)、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)。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。基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例为 0-95%;权证资产占基金资产净值的比例为 0%-3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持现金或者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、应收申购款等。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许,本基金管理人在履行适当程序后,可对上述资产配置比例进行调整。基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 $\times$ 50%+上证国债指数收益率 $\times$ 50%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会

计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

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

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产分类

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和

其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重

新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

(7)资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(8)国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认,并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账;

(9)权证收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

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

(11)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(12)其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。



#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，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。

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 7.4.6.4 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	1,689,062.00	492,296.89
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：	1,689,062.00	492,296.89

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	114,153,579.84	133,771,692.36	19,618,112.52	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	61,316,683.31	61,344,800.20	28,116.89
	银行间市场	-	-	-
	合计	61,316,683.31	61,344,800.20	28,116.89
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	175,470,263.15	195,116,492.56	19,646,229.41	
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	193,201,935.37	233,784,022.31	40,582,086.94	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	120,124,295.51	120,238,000.00	113,704.49
	银行间市场	-	-	-
	合计	120,124,295.51	120,238,000.00	113,704.49
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	313,326,230.88	354,022,022.31	40,695,791.43	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

**7.4.7.4 买入返售金融资产****7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：无。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：无。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	265.04	179.46
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	2,625.60	1,687.60
应收债券利息	678,711.66	1,616,425.03
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	12.30	35.40
合计	681,614.60	1,618,327.49

**7.4.7.6 其他资产**

注：无。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	97,599.40	42,557.73
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	97,599.40	42,557.73

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
----	--------------------	---------------------

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	206.85
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	189,000.00	189,000.00
合计	189,000.00	189,206.85

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鑫元鑫趋势 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	167,340,702.11	167,340,702.11
本期申购	8,711,911.88	8,711,911.88
本期赎回（以“-”号填列）	-100,327,659.41	-100,327,659.41
- 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	75,724,954.58	75,724,954.58

金额单位：人民币元

鑫元鑫趋势 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,334,758.54	21,334,758.54
本期申购	13,614,959.64	13,614,959.64
本期赎回（以“-”号填列）	-11,694,608.41	-11,694,608.41
- 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	23,255,109.77	23,255,109.77

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鑫元鑫趋势 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	26,651,674.88	49,661,834.03	76,313,508.91
本期利润	46,405,866.57	-17,023,288.26	29,382,578.31
本期基金份额交易产生的变动数	-31,939,436.42	-23,517,204.28	-55,456,640.70
其中：基金申购款	4,223,455.11	1,426,837.74	5,650,292.85
基金赎回款	-36,162,891.53	-24,944,042.02	-61,106,933.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,118,105.03	9,121,341.49	50,239,446.52

单位：人民币元

鑫元鑫趋势 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,988,083.00	6,239,215.65	9,227,298.65
本期利润	8,340,772.75	-4,026,273.76	4,314,498.99
本期基金份额交易产生的变动数	546,687.72	562,850.98	1,109,538.70
其中：基金申购款	4,189,099.58	3,339,313.23	7,528,412.81
基金赎回款	-3,642,411.86	-2,776,462.25	-6,418,874.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,875,543.47	2,775,792.87	14,651,336.34

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	22,954.85	99,763.04
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	59,995.20	32,738.89
其他	574.50	3,954.43
合计	83,524.55	136,456.36

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日

股票投资收益——买卖股票差价收入	54,223,753.52	33,641,413.46
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	54,223,753.52	33,641,413.46

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
卖出股票成交总额	190,962,956.03	255,378,137.31
减：卖出股票成本总额	136,739,202.51	221,736,723.85
买卖股票差价收入	54,223,753.52	33,641,413.46

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	142,108.37	45,062.38
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	142,108.37	45,062.38

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	227,230,631.06	51,406,757.89



减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	222,623,317.00	50,464,908.66
减：应收利息总额	4,465,205.69	896,786.85
买卖债券差价收入	142,108.37	45,062.38

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月
----	--------------------------	-------------------------------

	月 31 日	31 日
股票投资产生的股利收益	2,533,332.82	2,304,524.57
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	2,533,332.82	2,304,524.57

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-21,049,562.02	29,700,881.94
——股票投资	-20,963,974.42	29,629,569.13
——债券投资	-85,587.60	71,312.81
——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	-21,049,562.02	29,700,881.94

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	37,342.99	220,988.27
转换费收入	0.49	-
合计	37,343.48	220,988.27

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
----	---	--

交易所市场交易费用	433,246.10	750,237.80
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	433,246.10	750,237.80

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
债券账户维护费	36,000.00	36,000.00
银行汇划费用	2,795.00	3,900.79
上清所证书查询费	1,200.00	1,200.00
合计	219,995.00	221,100.79

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鑫元基金管理有限公司（“鑫元基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构
南京银行股份有限公司（“南京银行”）	基金管理人股东、基金销售机构
南京高科股份有限公司	基金管理人股东

鑫沅资产管理有限公司（“鑫沅资产”）	基金管理人的子公司
--------------------	-----------

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,740,449.25	1,671,972.63
其中：支付销售机构的客户维护费	26,673.41	92,012.52

注：基金管理费逐日累计至每月月底，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	326,334.26	313,494.87

注：基金托管费逐日累计至每月月底，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

## 7.4.10.2.3 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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C	合计
浦发银行	-	345.59	345.59
南京银行	-	2,930.83	2,930.83
鑫元基金	-	122,877.23	122,877.23
合计	-	126,153.65	126,153.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C	合计
浦发银行	-	292.49	292.49
南京银行	-	710.99	710.99
鑫元基金	-	118,534.09	118,534.09
合计	-	119,537.57	119,537.57

注：基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C
基金合同生效日（2017 年 8 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	20,000,000.00
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	-	20,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	20.2061%

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C
基金合同生效日（2017 年 8 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	20,000,000.00
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	-	20,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	10.6002%

注：（1）期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

（2）本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	1,689,062.00	22,954.85	492,296.89	99,763.04

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688262	国芯	2021年	2022	新股	41.98	41.98	2,283	95,840.34	95,840.34	-

	科技	12月28日	2021年1月6日	未上市						
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新股上市	10.52	10.52	6,945	73,061.40	73,061.40	-
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
601728	中国电信	2021年8月11日	2022年2月21日	新股流通受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2022年1月4日	新股流通受限	38.85	293.00	2,149	83,488.65	629,657.00	-
688296	和达科技	2021年7月19日	2022年1月27日	新股流通受限	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
688265	南模生物	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	84.62	65.03	1,108	93,758.96	72,053.24	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
688501	青达环保	2021年7月9日	2022年1月17日	新股流通受限	10.57	21.11	1,759	18,592.63	37,132.49	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	60.64	234.74	150	9,096.00	35,211.00	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年5月23日	新股流通受限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301069	凯盛	2021年	2022年	新股	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-



	新材	9月16日	2021年3月28日	流通受限						
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年4月27日	新股流通受限	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股流通受限	60.66	96.75	194	11,768.04	18,769.50	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股流通受限	22.04	56.28	331	7,295.24	18,628.68	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新股流通受限	12.03	17.12	1,045	12,571.35	17,890.40	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股流通受限	10.07	16.76	929	9,355.03	15,570.04	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股流通受限	25.80	33.65	450	11,610.00	15,142.50	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股流通受限	6.96	12.51	1,204	8,379.84	15,062.04	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301180	万祥	2021年	2022年	新股	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-

	科技	11月9日	2021年5月16日	流通股受限							
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-	
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-	
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	116.88	116.08	119	13,908.72	13,813.52	-	
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	新股流通受限	22.70	49.02	266	6,038.20	13,039.32	-	
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-	
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-	
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-	
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-	
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股流通受限	26.91	43.36	282	7,588.62	12,227.52	-	
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-	
301138	华研	2021年	2022年	新股	26.17	44.86	263	6,882.71	11,798.18	-	

	精机	12月8日	2021年6月15日	流通受限							
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股流通受限	69.89	88.72	124	8,666.36	11,001.28	-	
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-	
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	86.06	94.50	106	9,122.36	10,017.00	-	
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-	
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股流通受限	10.45	11.22	847	8,851.15	9,503.34	-	
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-	
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股流通受限	93.09	75.34	124	11,543.16	9,342.16	-	
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	新股流通受限	39.08	52.13	178	6,956.24	9,279.14	-	
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-	
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-	
301062	上海	2021年	2022年	新股	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-	

	艾录	9月7日	2021年3月14日	流通受限							
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股流通受限	27.81	31.14	281	7,814.61	8,750.34	-	
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-	
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	29.28	32.00	256	7,495.68	8,192.00	-	
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	66.18	56.62	140	9,265.20	7,926.80	-	
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-	
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-	
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-	
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-	
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股流通受限	27.85	27.46	264	7,352.40	7,249.44	-	
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-	
301179	泽宇	2021年	2022年	新股	43.99	50.77	134	5,894.66	6,803.18	-	

	智能	12月1日	年月日	6月8日	流通受限							
301193	家联科技	2021年12月2日	年月日	2022年6月9日	新股流通受限	30.73	29.14	231	7,098.63	6,731.34	-	
301093	华兰股份	2021年10月21日	年月日	2022年5月5日	新股流通受限	58.08	49.85	135	7,840.80	6,729.75	-	
301096	百诚医药	2021年12月13日	年月日	2022年6月20日	新股流通受限	79.60	78.53	85	6,766.00	6,675.05	-	
301033	迈普医学	2021年7月15日	年月日	2022年1月26日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-	
301049	超越科技	2021年8月17日	年月日	2022年2月24日	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-	
301032	新柴股份	2021年7月15日	年月日	2022年1月24日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-	
301056	森赫股份	2021年8月27日	年月日	2022年3月7日	新股流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-	
301092	争光股份	2021年10月21日	年月日	2022年5月5日	新股流通受限	36.31	35.52	177	6,426.87	6,287.04	-	
301088	戎美股份	2021年10月19日	年月日	2022年4月28日	新股流通受限	33.16	24.67	251	8,323.16	6,192.17	-	
301036	双乐股份	2021年7月21日	年月日	2022年2月16日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-	
301041	金百	2021年	2022年		新股	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-	

	泽	8月2日	2022年2月11日	流通股受限							
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-	
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股流通受限	57.27	53.71	112	6,414.24	6,015.52	-	
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-	
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-	
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-	
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-	
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-	
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-	
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-	
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-	
301057	汇隆	2021年	2022年	新股	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-	

	新材	8月31日	2021年3月9日	流通受限						
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股流通受限	6.90	21.78	59	407.10	1,285.02	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股流通受限	11.87	28.78	26	308.62	748.28	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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
113052	兴业转债	2021年12月30日	2022年1月14日	新债未上市	100.00	100.00	1,780	178,000.00	178,000.00	-
113052	兴业转债	2021年12月27日	2022年1月14日	新债未上市	100.00	100.00	1,450	145,000.00	145,000.00	-

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 39,799,602.00 元,于 2022 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金,在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种,其预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现基金合同中约定的投资目标。

本基金的基金管理人实行全员风险管理,风险管理是公司所有部门、全体员工的应尽职责。公司建立董事会、经营管理层、独立风险管理部门、业务部门四级风险管理组织架构,并分别明确风险管理职能与责任。董事会对公司的风险管理负有最终责任,董事会下设风险控制与合规审计委员会,负责研究、确定公司风险管理理念,指导公司风险管理体系的建设;经营管理层负责组织、部署风险管理工作,经营管理层设风险控制委员会,负责确定风险管理理念、原则、目标和方法,促进风险管理环境、文化的形成,组织风险管理体系建设,审议风险管理制度和流程,审议重大风险事件;独立风险管理部门负责协同相关业务部门落实投资风险、操作风险、合规风险、道德风险等各类风险的控制和管理,督促、检查各业务部门、各业务环节的风险管理工作;各业务部门负责根据职能分工贯彻落实风险管理程序,执行风险管理措施。根据风险管理工作要求,各业务部门健全完善规章制度和操作流程,严格遵守风险管理制度、流程和限额,严格执行从风险识别、风险测量、风险控制、风险评价到风险报告的风险管理程序,对本部门发生风险事件承担直接责任,及时、准确、全面、客观地将本部门及本部门发现的风险信息向风险管理部门报告。



### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的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。本基金根据存款存放银行的资质，评估并控制银行存款的信用风险。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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	31,004,800.00	119,886,000.00
合计	31,004,800.00	119,886,000.00

注：未评级部分为国债。

#### 7.4.13.2.2 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 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

#### 7.4.13.2.3 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 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

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	323,000.00	352,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	30,017,000.20	0.00
合计	30,340,000.20	352,000.00

注：未评级部分为国债。

#### 7.4.13.2.5 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 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

#### 7.4.13.2.6 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 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

#### 7.4.13.3 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在基金运作周期内的每个开放日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。

于 2021 年 12 月 31 日,除卖出回购金融资产款余额中有 39,799,602.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系,审慎评估各类资产的流动性,针对性制定流动性风险管理措施,对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控本基金的组合资产持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标,对本基金的流动性风险进行持续的监测和分析。同时,本基金的基金管理人在基金运作周期内的每个开放日对本基金的申购赎回情况进行监控,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配,确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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,控制相关的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

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

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“期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券”。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%。

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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金开展银行存款、交易所及银行间市场交易的固定收益品种等各类计息业务，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5 年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,689,062.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,689,062.00
结算备付金	5,834,600.50	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	5,834,600.50
存出保证金	27,353.40	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	27,353.40
交易性金融资产	0.00	25,004,500.20	36,017,300.00	0.00	323,000.00	133,771,692.36	195,116,492.56
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	747,273.33	747,273.33
应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	681,614.60	681,614.60
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,073.97	3,073.97

其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	7,551,015.90	25,004,500.20	36,017,300.00	0.00	323,000.00	135,203,654.26	204,099,470.36
负债							
卖出回购 金融资产 款	39,799,602.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	39,799,602.00
应付证券 清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回 款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,125.43	2,125.43
应付管理 人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	123,097.39	123,097.39
应付托管 费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	23,080.77	23,080.77
应付销售 服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	12,254.34	12,254.34
应付交易 费用	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	97,599.40	97,599.40
应付税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-18,136.18	-18,136.18
应付利润	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	189,000.00	189,000.00
短期借款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金 融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融 负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
负债总计	39,799,602.00	0.00	0.00	0.00	0.00	429,021.15	40,228,623.15
利率敏感 度缺口	-32,248,586.10	25,004,500.20	36,017,300.00	0.00	323,000.00	134,774,633.11	163,870,847.21
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	492,296.89	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	492,296.89
结算备付 金	3,750,280.50	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,750,280.50
存出保证 金	78,672.34	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	78,672.34
交易性金 融资产	34,996,500.00	0.00	84,889,500.00	0.00	352,000.00	233,784,022.31	354,022,022.31
应收证券 清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	174,982.52	174,982.52

应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,618,327.49	1,618,327.49
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,099.91	1,099.91
资产总计	39,317,749.73	0.00	84,889,500.00	0.00	352,000.00	235,578,432.23	360,137,681.96
负债							
卖出回购金融资产款	85,299,147.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	85,299,147.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	176,716.07	176,716.07
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	180,587.96	180,587.96
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	33,860.26	33,860.26
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	10,800.03	10,800.03
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	42,557.73	42,557.73
应付税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1.00	1.00
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-11,463.15	-11,463.15
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	189,206.85	189,206.85
负债总计	85,299,147.00	0.00	0.00	0.00	0.00	622,266.75	85,921,413.75
利率敏感度缺口	-45,981,397.27	0.00	84,889,500.00	0.00	352,000.00	234,956,165.48	274,216,268.21

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 市场利率下降 25个基点	75,706.19	115,899.65
2. 市场利率上升 25个基点	-75,441.17	-115,597.84	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”为主的分析模式、定性分析和定量分析相结合的研究方式，跟踪宏观经济基本面、政策面和资金等多方面因素，评估符合基金合同约定范围的大类资产的估值水平和投资价值，并利用上述大类资产之间的相互关联性进行灵活的资产配置，制定本基金的大类资产配置比例，并适时进行调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产占基金资产的 0%-95%，权证资产占基金资产净值的比例为 0%-3%，基金保留的现金或者投资于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%。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	133,771,692.36	81.63	233,784,022.31	85.26
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	133,771,692.36	81.63	233,784,022.31	85.26

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变
	以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	沪深 300 指数上升 1%	1,363,961.17	2,395,931.12
	沪深 300 指数下降 1%	-1,363,961.17	-2,395,931.12

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 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银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项、卖出回购金融资产款以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 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资产中属于第一层次的余额为人民币 130,283,857.05 元，属于第二层次的余额为人民币 64,832,635.51 元，无划分为第三层次的余额。（于 2020 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 230,361,152.43 元，属于第二层次的余额为人民币 123,660,869.88 元，无划分为第三层次的余额）。

###### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

##### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

##### 7.4.14.3 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号-金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号-金



融资产转移》、《企业会计准则第 24 号-套期会计》和《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,实施上述新准则对 2022 年 1 月 1 日所有者权益影响不重大。

除上述事项外,截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	133,771,692.36	65.54
	其中：股票	133,771,692.36	65.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	61,344,800.20	30.06
	其中：债券	61,344,800.20	30.06
	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	7,523,662.50	3.69
8	其他各项资产	1,459,315.30	0.72
9	合计	204,099,470.36	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,504,456.80	0.92
B	采矿业	3,261,408.14	1.99
C	制造业	80,706,680.59	49.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,108,918.00	1.90
E	建筑业	2,028,429.85	1.24
F	批发和零售业	1,330,508.55	0.81
G	交通运输、仓储和邮政业	3,757,435.34	2.29
H	住宿和餐饮业	162,828.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,380,608.66	3.89
J	金融业	23,889,456.00	14.58
K	房地产业	1,911,584.00	1.17
L	租赁和商务服务业	1,753,823.00	1.07
M	科学研究和技术服务业	1,986,307.03	1.21

N	水利、环境和公共设施管理业	235,460.11	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,132,556.98	0.69
R	文化、体育和娱乐业	621,231.31	0.38
S	综合	-	-
	合计	133,771,692.36	81.63

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,600	7,380,000.00	4.50
2	300750	宁德时代	10,000	5,880,000.00	3.59
3	600036	招商银行	59,300	2,888,503.00	1.76
4	000858	五粮液	11,500	2,560,590.00	1.56
5	000568	泸州老窖	10,000	2,538,700.00	1.55
6	300059	东方财富	59,108	2,193,497.88	1.34
7	002142	宁波银行	50,010	1,914,382.80	1.17
8	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	1.03
9	000001	平安银行	100,000	1,648,000.00	1.01
10	600900	长江电力	64,700	1,468,690.00	0.90
11	300274	阳光电源	10,000	1,458,000.00	0.89
12	002594	比亚迪	5,200	1,394,224.00	0.85
13	300760	迈瑞医疗	3,600	1,370,880.00	0.84
14	000776	广发证券	55,000	1,352,450.00	0.83
15	601888	中国中免	5,700	1,250,637.00	0.76
16	300014	亿纬锂能	10,003	1,182,154.54	0.72
17	601166	兴业银行	60,100	1,144,304.00	0.70
18	600809	山西汾酒	3,580	1,130,492.40	0.69
19	603288	海天味业	10,430	1,096,297.30	0.67
20	002049	紫光国微	4,800	1,080,000.00	0.66
21	300896	爱美客	2,000	1,072,220.00	0.65
22	002241	歌尔股份	19,800	1,071,180.00	0.65
23	002475	立讯精密	20,997	1,033,052.40	0.63
24	002352	顺丰控股	14,200	978,664.00	0.60

25	600276	恒瑞医药	18,656	946,045.76	0.58
26	603259	药明康德	7,652	907,374.16	0.55
27	601398	工商银行	180,500	835,715.00	0.51
28	002714	牧原股份	15,270	814,807.20	0.50
29	600030	中信证券	30,400	802,864.00	0.49
30	603501	韦尔股份	2,500	776,925.00	0.47
31	600436	片仔癀	1,700	743,155.00	0.45
32	002304	洋河股份	4,500	741,285.00	0.45
33	600887	伊利股份	17,600	729,696.00	0.45
34	300015	爱尔眼科	15,865	670,772.20	0.41
35	601919	中远海控	35,750	668,167.50	0.41
36	002812	恩捷股份	2,600	651,040.00	0.40
37	688499	利元亨	2,149	629,657.00	0.38
38	601288	农业银行	214,000	629,160.00	0.38
39	600406	国电南瑞	15,480	619,664.40	0.38
40	601668	中国建筑	117,300	586,500.00	0.36
41	601899	紫金矿业	59,400	576,180.00	0.35
42	300122	智飞生物	4,600	573,160.00	0.35
43	601816	京沪高铁	117,100	565,593.00	0.35
44	002371	北方华创	1,600	555,232.00	0.34
45	600031	三一重工	24,300	554,040.00	0.34
46	600690	海尔智家	18,400	549,976.00	0.34
47	000002	万科 A	27,400	541,424.00	0.33
48	000725	京东方 A	106,800	539,340.00	0.33
49	601601	中国太保	19,700	534,264.00	0.33
50	300124	汇川技术	7,700	528,220.00	0.32
51	002493	荣盛石化	28,950	525,732.00	0.32
52	600048	保利发展	33,600	525,168.00	0.32
53	601328	交通银行	112,600	519,086.00	0.32
54	600111	北方稀土	10,700	490,060.00	0.30
55	002460	赣锋锂业	3,400	485,690.00	0.30
56	600893	航发动力	7,600	482,296.00	0.29
57	600745	闻泰科技	3,600	465,480.00	0.28
58	600104	上汽集团	22,300	460,049.00	0.28
59	600585	海螺水泥	11,400	459,420.00	0.28
60	600019	宝钢股份	63,300	453,228.00	0.28
61	002459	晶澳科技	4,600	426,420.00	0.26
62	601088	中国神华	18,822	423,871.44	0.26
63	601766	中国中车	69,300	422,037.00	0.26

64	600016	民生银行	101,500	395,850.00	0.24
65	601818	光大银行	118,000	391,760.00	0.24
66	601658	邮储银行	76,100	388,110.00	0.24
67	000538	云南白药	3,700	387,205.00	0.24
68	603799	华友钴业	3,500	386,085.00	0.24
69	600346	恒力石化	16,800	385,896.00	0.24
70	600028	中国石化	91,000	384,930.00	0.23
71	601211	国泰君安	21,500	384,635.00	0.23
72	002129	中环股份	9,200	384,100.00	0.23
73	600999	招商证券	21,180	373,827.00	0.23
74	000063	中兴通讯	11,100	371,850.00	0.23
75	002179	中航光电	3,600	362,016.00	0.22
76	601066	中信建投	12,300	359,775.00	0.22
77	603806	福斯特	2,700	352,485.00	0.22
78	002311	海大集团	4,800	351,840.00	0.21
79	002027	分众传媒	42,900	351,351.00	0.21
80	300498	温氏股份	18,160	349,761.60	0.21
81	600010	包钢股份	125,200	349,308.00	0.21
82	000338	潍柴动力	19,500	348,855.00	0.21
83	600050	中国联通	88,600	348,198.00	0.21
84	002230	科大讯飞	6,600	346,566.00	0.21
85	601985	中国核电	41,000	340,300.00	0.21
86	600588	用友网络	9,440	338,707.20	0.21
87	601669	中国电建	41,900	338,552.00	0.21
88	600837	海通证券	27,600	338,376.00	0.21
89	603986	兆易创新	1,912	336,225.20	0.21
90	601225	陕西煤业	27,500	335,500.00	0.20
91	601877	正泰电器	6,200	334,118.00	0.20
92	300433	蓝思科技	14,500	333,210.00	0.20
93	601390	中国中铁	57,500	332,925.00	0.20
94	000166	申万宏源	64,500	330,240.00	0.20
95	300782	卓胜微	1,000	326,800.00	0.20
96	600150	中国船舶	12,800	317,312.00	0.19
97	601633	长城汽车	6,400	310,656.00	0.19
98	002709	天赐材料	2,700	309,555.00	0.19
99	603659	璞泰来	1,921	308,531.81	0.19
100	601100	恒立液压	3,748	306,586.40	0.19
101	601988	中国银行	100,500	306,525.00	0.19
102	601857	中国石油	62,100	304,911.00	0.19

103	002821	凯莱英	700	304,500.00	0.19
104	600989	宝丰能源	17,500	303,800.00	0.19
105	000661	长春高新	1,100	298,540.00	0.18
106	688036	传音控股	1,900	298,110.00	0.18
107	300413	芒果超媒	5,200	297,544.00	0.18
108	001979	招商蛇口	22,300	297,482.00	0.18
109	688111	金山办公	1,100	291,500.00	0.18
110	000596	古井贡酒	1,194	291,336.00	0.18
111	601229	上海银行	40,700	290,191.00	0.18
112	603993	洛阳钼业	51,000	284,580.00	0.17
113	600196	复星医药	5,800	283,852.00	0.17
114	000625	长安汽车	18,240	277,065.60	0.17
115	600660	福耀玻璃	5,700	268,698.00	0.16
116	601169	北京银行	60,500	268,620.00	0.16
117	300759	康龙化成	1,900	268,413.00	0.16
118	000895	双汇发展	8,500	268,175.00	0.16
119	603392	万泰生物	1,200	265,800.00	0.16
120	600570	恒生电子	4,258	264,634.70	0.16
121	601360	三六零	20,500	260,760.00	0.16
122	002050	三花智控	10,270	259,831.00	0.16
123	300999	金龙鱼	4,100	258,013.00	0.16
124	300316	晶盛机电	3,700	257,150.00	0.16
125	600958	东方证券	17,300	255,002.00	0.16
126	600741	华域汽车	8,900	251,870.00	0.15
127	601138	工业富联	20,900	249,128.00	0.15
128	300454	深信服	1,300	248,300.00	0.15
129	600919	江苏银行	42,350	246,900.50	0.15
130	000100	TCL 科技	40,000	246,800.00	0.15
131	300142	沃森生物	4,300	241,660.00	0.15
132	300408	三环集团	5,400	240,840.00	0.15
133	601628	中国人寿	8,000	240,720.00	0.15
134	601336	新华保险	6,000	233,280.00	0.14
135	601865	福莱特	4,000	231,760.00	0.14
136	601600	中国铝业	37,500	228,375.00	0.14
137	688012	中微公司	1,800	227,880.00	0.14
138	600085	同仁堂	5,000	224,900.00	0.14
139	300628	亿联网络	2,750	223,987.50	0.14
140	600926	杭州银行	17,200	220,504.00	0.13
141	600886	国投电力	19,200	220,224.00	0.13

142	603833	欧派家居	1,480	218,300.00	0.13
143	300661	圣邦股份	700	216,300.00	0.13
144	600132	重庆啤酒	1,400	211,848.00	0.13
145	603486	科沃斯	1,400	211,330.00	0.13
146	600176	中国巨石	11,545	210,119.00	0.13
147	002736	国信证券	18,300	210,084.00	0.13
148	600600	青岛啤酒	2,100	207,900.00	0.13
149	600029	南方航空	30,500	207,705.00	0.13
150	600089	特变电工	9,800	207,466.00	0.13
151	002236	大华股份	8,800	206,624.00	0.13
152	300207	欣旺达	4,900	206,584.00	0.13
153	600460	士兰微	3,800	205,960.00	0.13
154	000963	华东医药	5,100	205,020.00	0.13
155	600015	华夏银行	36,600	204,960.00	0.13
156	300033	同花顺	1,400	202,412.00	0.12
157	601117	中国化学	16,800	201,600.00	0.12
158	603369	今世缘	3,700	201,280.00	0.12
159	002013	中航机电	11,000	199,980.00	0.12
160	600763	通策医疗	1,000	199,000.00	0.12
161	002601	龙佰集团	6,900	197,271.00	0.12
162	300601	康泰生物	2,000	197,080.00	0.12
163	600845	宝信软件	3,230	196,480.90	0.12
164	002648	卫星化学	4,900	196,147.00	0.12
165	600547	山东黄金	10,420	196,104.40	0.12
166	600426	华鲁恒升	6,240	195,312.00	0.12
167	601618	中国中冶	50,700	194,181.00	0.12
168	000723	美锦能源	11,900	193,137.00	0.12
169	600011	华能国际	19,900	192,831.00	0.12
170	300751	迈为股份	300	192,690.00	0.12
171	000799	酒鬼酒	900	191,250.00	0.12
172	603290	斯达半导	500	190,500.00	0.12
173	601377	兴业证券	19,200	189,696.00	0.12
174	002074	国轩高科	3,700	189,625.00	0.12
175	601155	新城控股	6,500	189,345.00	0.12
176	002938	鹏鼎控股	4,400	186,692.00	0.11
177	000938	紫光股份	8,160	186,456.00	0.11
178	000733	振华科技	1,500	186,420.00	0.11
179	688008	澜起科技	2,200	184,514.00	0.11
180	601901	方正证券	23,500	184,240.00	0.11

181	002920	德赛西威	1,300	183,963.00	0.11
182	601799	星宇股份	900	183,825.00	0.11
183	002555	三七互娱	6,700	181,034.00	0.11
184	000786	北新建材	5,000	179,150.00	0.11
185	002602	世纪华通	21,300	178,707.00	0.11
186	000301	东方盛虹	9,200	177,928.00	0.11
187	002756	永兴材料	1,200	177,624.00	0.11
188	601727	上海电气	36,200	175,932.00	0.11
189	601111	中国国航	19,200	175,296.00	0.11
190	300012	华测检测	6,500	174,655.00	0.11
191	601868	中国能建	63,845	174,296.85	0.11
192	603899	晨光文具	2,700	174,177.00	0.11
193	002916	深南电路	1,400	170,548.00	0.10
194	601689	拓普集团	3,200	169,600.00	0.10
195	600383	金地集团	13,000	168,610.00	0.10
196	600779	水井坊	1,400	167,986.00	0.10
197	601916	浙商银行	47,900	167,650.00	0.10
198	002120	韵达股份	8,190	167,567.40	0.10
199	300496	中科创达	1,200	166,104.00	0.10
200	601788	光大证券	11,100	165,723.00	0.10
201	600918	中泰证券	16,600	165,502.00	0.10
202	600875	东方电气	7,700	164,934.00	0.10
203	600233	圆通速递	9,800	163,464.00	0.10
204	002791	坚朗五金	900	163,431.00	0.10
205	002080	中材科技	4,800	163,296.00	0.10
206	688169	石头科技	200	162,600.00	0.10
207	002414	高德红外	6,708	162,400.68	0.10
208	300763	锦浪科技	700	162,085.00	0.10
209	601939	建设银行	27,552	161,454.72	0.10
210	002202	金风科技	9,800	161,406.00	0.10
211	600219	南山铝业	34,100	160,611.00	0.10
212	603260	合盛硅业	1,200	158,364.00	0.10
213	600754	锦江酒店	2,700	158,220.00	0.10
214	600584	长电科技	5,100	158,202.00	0.10
215	600183	生益科技	6,700	157,785.00	0.10
216	002007	华兰生物	5,410	157,647.40	0.10
217	600885	宏发股份	2,100	156,744.00	0.10
218	300450	先导智能	2,100	156,177.00	0.10
219	603882	金域医学	1,400	155,918.00	0.10



220	600795	国电电力	48,700	154,379.00	0.09
221	300347	泰格医药	1,200	153,360.00	0.09
222	603737	三棵树	1,100	153,065.00	0.09
223	688126	沪硅产业	5,900	152,338.00	0.09
224	601995	中金公司	3,100	151,993.00	0.09
225	600061	国投资本	18,368	150,984.96	0.09
226	600188	兖矿能源	6,400	150,592.00	0.09
227	002600	领益智造	20,300	149,408.00	0.09
228	601233	桐昆股份	7,000	148,260.00	0.09
229	002180	纳思达	3,100	148,056.00	0.09
230	603707	健友股份	3,498	146,916.00	0.09
231	300595	欧普康视	2,550	146,293.50	0.09
232	601615	明阳智能	5,600	146,160.00	0.09
233	600522	中天科技	8,600	145,856.00	0.09
234	000157	中联重科	20,300	145,551.00	0.09
235	600298	安琪酵母	2,400	144,864.00	0.09
236	600018	上港集团	26,300	144,124.00	0.09
237	000977	浪潮信息	4,012	143,749.96	0.09
238	601878	浙商证券	10,900	143,662.00	0.09
239	002340	格林美	13,800	142,830.00	0.09
240	601966	玲珑轮胎	3,900	142,545.00	0.09
241	601555	东吴证券	15,899	140,865.14	0.09
242	603160	汇顶科技	1,300	140,101.00	0.09
243	600563	法拉电子	600	139,440.00	0.09
244	603816	顾家家居	1,800	138,888.00	0.08
245	002064	华峰化学	13,300	138,852.00	0.08
246	300390	天华超净	1,700	137,700.00	0.08
247	601881	中国银河	12,300	137,637.00	0.08
248	600332	白云山	4,000	136,800.00	0.08
249	600038	中直股份	1,700	136,510.00	0.08
250	601021	春秋航空	2,400	136,320.00	0.08
251	000425	徐工机械	22,700	135,973.00	0.08
252	300037	新宙邦	1,200	135,600.00	0.08
253	603456	九洲药业	2,400	135,024.00	0.08
254	600115	中国东航	26,100	134,676.00	0.08
255	603185	上机数控	800	133,584.00	0.08
256	300146	汤臣倍健	4,900	132,104.00	0.08
257	603198	迎驾贡酒	1,900	131,955.00	0.08
258	600362	江西铜业	5,900	131,747.00	0.08

259	601636	旗滨集团	7,700	131,670.00	0.08
260	002252	上海莱士	19,300	131,626.00	0.08
261	603568	伟明环保	3,600	131,508.00	0.08
262	600009	上海机场	2,800	130,732.00	0.08
263	688006	杭可科技	1,200	129,096.00	0.08
264	300285	国瓷材料	3,000	127,710.00	0.08
265	600674	川投能源	10,200	127,500.00	0.08
266	601216	君正集团	24,300	127,089.00	0.08
267	600256	广汇能源	19,400	126,876.00	0.08
268	300699	光威复材	1,500	126,720.00	0.08
269	688122	西部超导	1,300	126,022.00	0.08
270	002385	大北农	12,000	125,880.00	0.08
271	002568	百润股份	2,100	125,643.00	0.08
272	603267	鸿远电子	700	125,608.00	0.08
273	603605	珀莱雅	600	124,986.00	0.08
274	600803	新奥股份	6,800	124,848.00	0.08
275	002384	东山精密	4,600	124,660.00	0.08
276	601838	成都银行	10,300	123,600.00	0.08
277	603517	绝味食品	1,800	122,994.00	0.08
278	300529	健帆生物	2,290	122,057.00	0.07
279	300073	当升科技	1,400	121,618.00	0.07
280	600141	兴发集团	3,200	121,216.00	0.07
281	603589	口子窖	1,700	120,479.00	0.07
282	000066	中国长城	8,500	120,360.00	0.07
283	603345	安井食品	700	119,546.00	0.07
284	603939	益丰药房	2,166	119,368.26	0.07
285	000739	普洛药业	3,400	119,306.00	0.07
286	603338	浙江鼎力	1,480	118,784.80	0.07
287	000783	长江证券	15,700	118,378.00	0.07
288	600486	扬农化工	900	118,080.00	0.07
289	300003	乐普医疗	5,200	117,676.00	0.07
290	600352	浙江龙盛	9,300	117,459.00	0.07
291	002624	完美世界	5,750	116,782.50	0.07
292	600516	方大炭素	10,780	116,639.60	0.07
293	000738	航发控制	3,800	115,064.00	0.07
294	000825	太钢不锈	16,300	114,752.00	0.07
295	603019	中科曙光	4,160	114,691.20	0.07
296	300724	捷佳伟创	1,000	114,300.00	0.07
297	600161	天坛生物	3,940	114,102.40	0.07

298	601108	财通证券	10,200	113,424.00	0.07
299	000703	恒逸石化	10,600	112,572.00	0.07
300	002850	科达利	700	112,238.00	0.07
301	002353	杰瑞股份	2,800	112,000.00	0.07
302	300726	宏达电子	1,100	110,066.00	0.07
303	002223	鱼跃医疗	2,900	109,620.00	0.07
304	002024	苏宁易购	26,600	109,592.00	0.07
305	601607	上海医药	5,500	109,285.00	0.07
306	000831	五矿稀土	2,800	109,256.00	0.07
307	600642	申能股份	14,700	108,339.00	0.07
308	002028	思源电气	2,200	108,262.00	0.07
309	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.07
310	603613	国联股份	1,000	107,500.00	0.07
311	300144	宋城演艺	7,500	107,400.00	0.07
312	002372	伟星新材	4,400	107,008.00	0.07
313	601198	东兴证券	9,200	106,996.00	0.07
314	000519	中兵红箭	4,000	106,680.00	0.07
315	300251	光线传媒	8,300	106,655.00	0.07
316	600079	人福医药	4,700	105,844.00	0.06
317	000630	铜陵有色	30,400	105,792.00	0.06
318	002409	雅克科技	1,300	105,521.00	0.06
319	300676	华大基因	1,200	105,360.00	0.06
320	601933	永辉超市	26,000	105,300.00	0.06
321	002405	四维图新	6,600	105,072.00	0.06
322	600606	绿地控股	24,180	104,941.20	0.06
323	300253	卫宁健康	6,230	104,414.80	0.06
324	601990	南京证券	10,500	104,055.00	0.06
325	603127	昭衍新药	900	103,887.00	0.06
326	300558	贝达药业	1,300	103,779.00	0.06
327	000333	美的集团	1,400	103,334.00	0.06
328	002673	西部证券	12,800	103,296.00	0.06
329	600487	亨通光电	6,800	102,816.00	0.06
330	688009	中国通号	20,600	102,588.00	0.06
331	688002	睿创微纳	1,300	102,141.00	0.06
332	600160	巨化股份	7,900	101,989.00	0.06
333	002508	老板电器	2,800	100,856.00	0.06
334	002531	天顺风能	5,200	100,828.00	0.06
335	002444	巨星科技	3,300	100,683.00	0.06
336	000932	华菱钢铁	19,700	100,667.00	0.06

337	000807	云铝股份	9,000	100,530.00	0.06
338	600369	西南证券	19,000	100,510.00	0.06
339	600705	中航产融	25,300	100,441.00	0.06
340	601162	天风证券	24,800	100,440.00	0.06
341	002407	多氟多	2,200	98,978.00	0.06
342	002507	涪陵榨菜	2,600	98,280.00	0.06
343	603658	安图生物	1,780	98,006.80	0.06
344	300308	中际旭创	2,300	97,750.00	0.06
345	000423	东阿阿胶	2,000	97,500.00	0.06
346	601077	渝农商行	25,300	97,405.00	0.06
347	688202	美迪西	200	97,118.00	0.06
348	603233	大参林	2,300	96,853.00	0.06
349	601872	招商轮船	23,620	96,842.00	0.06
350	600655	豫园股份	9,400	96,820.00	0.06
351	000591	太阳能	8,600	96,320.00	0.06
352	600109	国金证券	8,500	96,305.00	0.06
353	000728	国元证券	12,500	96,250.00	0.06
354	600521	华海药业	4,440	96,170.40	0.06
355	688262	国芯科技	2,283	95,840.34	0.06
356	002939	长城证券	7,400	95,830.00	0.06
357	000629	攀钢钒钛	24,600	95,694.00	0.06
358	601319	中国人保	20,300	95,410.00	0.06
359	603712	七一二	2,200	95,260.00	0.06
360	600021	上海电力	7,400	94,868.00	0.06
361	002497	雅化集团	3,300	94,578.00	0.06
362	600027	华电国际	17,500	93,625.00	0.06
363	000983	山西焦煤	11,310	93,533.70	0.06
364	600143	金发科技	7,400	93,092.00	0.06
365	600549	厦门钨业	4,100	92,783.00	0.06
366	601699	潞安环能	8,200	92,742.00	0.06
367	300677	英科医疗	1,600	92,544.00	0.06
368	603218	日月股份	2,800	92,260.00	0.06
369	002557	洽洽食品	1,500	92,040.00	0.06
370	600177	雅戈尔	13,300	91,637.00	0.06
371	000800	一汽解放	8,900	91,581.00	0.06
372	002456	欧菲光	9,400	91,180.00	0.06
373	600872	中炬高新	2,400	91,128.00	0.06
374	002192	融捷股份	700	91,105.00	0.06
375	600170	上海建工	25,200	90,720.00	0.06

376	000998	隆平高科	3,900	90,714.00	0.06
377	300357	我武生物	1,579	90,476.70	0.06
378	002463	沪电股份	5,420	89,863.60	0.05
379	601577	长沙银行	11,500	89,815.00	0.05
380	300850	新强联	500	89,255.00	0.05
381	002044	美年健康	11,300	88,705.00	0.05
382	002157	正邦科技	9,100	87,906.00	0.05
383	600699	均胜电子	4,000	87,880.00	0.05
384	002797	第一创业	12,000	87,840.00	0.05
385	002138	顺络电子	2,300	87,814.00	0.05
386	002294	信立泰	3,200	87,424.00	0.05
387	002078	太阳纸业	7,600	87,324.00	0.05
388	600704	物产中大	14,720	87,142.40	0.05
389	002299	圣农发展	3,600	87,012.00	0.05
390	000027	深圳能源	10,740	86,994.00	0.05
391	002153	石基信息	3,000	86,220.00	0.05
392	002152	广电运通	7,200	85,680.00	0.05
393	300725	药石科技	600	85,302.00	0.05
394	603444	吉比特	200	84,370.00	0.05
395	002603	以岭药业	4,300	84,280.00	0.05
396	002430	杭氧股份	2,800	84,028.00	0.05
397	002408	齐翔腾达	8,000	84,000.00	0.05
398	000860	顺鑫农业	2,200	83,996.00	0.05
399	300832	新产业	1,900	83,695.00	0.05
400	600315	上海家化	2,000	80,820.00	0.05
401	300568	星源材质	2,200	80,806.00	0.05
402	000988	华工科技	2,900	80,794.00	0.05
403	603866	桃李面包	2,780	78,952.00	0.05
404	600998	九州通	5,300	78,016.00	0.05
405	002541	鸿路钢构	1,454	77,847.16	0.05
406	002422	科伦药业	4,100	77,613.00	0.05
407	688188	柏楚电子	200	77,092.00	0.05
408	000547	航天发展	4,600	76,820.00	0.05
409	000683	远兴能源	10,500	76,650.00	0.05
410	603638	艾迪精密	2,400	76,608.00	0.05
411	600415	小商品城	15,700	76,145.00	0.05
412	002010	传化智联	8,700	75,690.00	0.05
413	600153	建发股份	8,316	75,426.12	0.05
414	600801	华新水泥	3,900	75,270.00	0.05

415	002690	美亚光电	2,000	74,920.00	0.05
416	600598	北大荒	5,100	74,256.00	0.05
417	002926	华西证券	7,500	73,875.00	0.05
418	002156	通富微电	3,800	73,834.00	0.05
419	300296	利亚德	7,200	73,800.00	0.05
420	601866	中远海发	22,700	73,775.00	0.05
421	600688	上海石化	17,600	73,392.00	0.04
422	000709	河钢股份	29,700	73,062.00	0.04
423	301136	招标股份	6,945	73,061.40	0.04
424	000513	丽珠集团	1,800	72,378.00	0.04
425	002465	海格通信	6,600	72,072.00	0.04
426	600380	健康元	5,612	72,058.08	0.04
427	688265	南模生物	1,108	72,053.24	0.04
428	000681	视觉中国	3,000	71,700.00	0.04
429	600988	赤峰黄金	4,800	71,520.00	0.04
430	601696	中银证券	5,300	71,285.00	0.04
431	300136	信维通信	2,800	70,896.00	0.04
432	002558	巨人网络	5,900	70,623.00	0.04
433	000975	银泰黄金	8,020	70,415.60	0.04
434	002373	千方科技	4,700	70,265.00	0.04
435	603858	步长制药	3,300	69,597.00	0.04
436	002065	东华软件	8,900	69,420.00	0.04
437	600511	国药股份	2,200	69,366.00	0.04
438	601231	环旭电子	4,300	69,058.00	0.04
439	600848	上海临港	4,600	68,402.00	0.04
440	000656	金科股份	15,100	67,648.00	0.04
441	601992	金隅集团	23,700	67,308.00	0.04
442	002500	山西证券	10,150	66,990.00	0.04
443	300383	光环新网	4,500	66,780.00	0.04
444	002212	天融信	3,400	65,178.00	0.04
445	300070	碧水源	9,000	64,710.00	0.04
446	000750	国海证券	15,500	63,705.00	0.04
447	002511	中顺洁柔	3,800	63,498.00	0.04
448	002506	协鑫集成	16,600	63,080.00	0.04
449	002429	兆驰股份	12,900	62,694.00	0.04
450	300432	富临精工	2,100	61,740.00	0.04
451	002958	青农商行	15,900	61,374.00	0.04
452	002563	森马服饰	7,800	60,294.00	0.04
453	603883	老百姓	1,220	60,243.60	0.04

454	002151	北斗星通	1,500	58,875.00	0.04
455	000686	东北证券	6,700	58,826.00	0.04
456	600026	中远海能	9,900	58,608.00	0.04
457	600583	海油工程	12,700	58,547.00	0.04
458	601012	隆基股份	660	56,892.00	0.03
459	601598	中国外运	12,478	55,901.44	0.03
460	002146	荣盛发展	12,300	53,505.00	0.03
461	000401	冀东水泥	4,000	47,840.00	0.03
462	301029	怡合达	462	41,519.94	0.03
463	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.03
464	688501	青达环保	1,759	37,132.49	0.02
465	301050	雷电微力	150	35,211.00	0.02
466	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.02
467	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.02
468	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
469	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.01
470	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.01
471	301155	海力风电	194	18,769.50	0.01
472	301035	润丰股份	331	18,628.68	0.01
473	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
474	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
475	301127	天源环保	1,045	17,890.40	0.01
476	301149	隆华新材	929	15,570.04	0.01
477	301211	亨迪药业	450	15,142.50	0.01
478	301039	中集车辆	1,204	15,062.04	0.01
479	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.01
480	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.01
481	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
482	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
483	301177	迪阿股份	119	13,813.52	0.01
484	301118	恒光股份	266	13,039.32	0.01
485	301020	密封科技	421	12,815.24	0.01
486	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
487	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.01
488	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.01
489	301101	明月镜片	282	12,227.52	0.01
490	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
491	301138	华研精机	263	11,798.18	0.01
492	301221	光庭信息	124	11,001.28	0.01

493	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.01
494	301166	优宁维	106	10,017.00	0.01
495	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.01
496	301090	华润材料	847	9,503.34	0.01
497	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.01
498	301087	可孚医疗	124	9,342.16	0.01
499	301168	通灵股份	178	9,279.14	0.01
500	301078	孩子王	756	9,177.84	0.01
501	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.01
502	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.01
503	301100	风光股份	281	8,750.34	0.01
504	301025	读客文化	403	8,414.64	0.01
505	301199	迈赫股份	256	8,192.00	0.00
506	301189	奥尼电子	140	7,926.80	0.00
507	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
508	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
509	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
510	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
511	301190	善水科技	264	7,249.44	0.00
512	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
513	301179	泽宇智能	134	6,803.18	0.00
514	301193	家联科技	231	6,731.34	0.00
515	301093	华兰股份	135	6,729.75	0.00
516	301096	百诚医药	85	6,675.05	0.00
517	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
518	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
519	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
520	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
521	301092	争光股份	177	6,287.04	0.00
522	301088	戎美股份	251	6,192.17	0.00
523	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
524	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
525	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
526	301108	洁雅股份	112	6,015.52	0.00
527	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
528	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
529	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
530	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
531	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00



532	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
533	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
534	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
535	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
536	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
537	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
538	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
539	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
540	301055	张小泉	59	1,285.02	0.00
541	301053	远信工业	26	748.28	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600905	三峡能源	3,436,527.95	1.25
2	601728	中国电信	2,549,814.69	0.93
3	300750	宁德时代	2,054,264.00	0.75
4	000568	泸州老窖	1,426,800.00	0.52
5	300274	阳光电源	1,419,930.00	0.52
6	002142	宁波银行	1,289,578.70	0.47
7	300059	东方财富	1,126,800.00	0.41
8	300896	爱美客	1,125,620.00	0.41
9	000776	广发证券	894,440.00	0.33
10	000001	平安银行	776,160.00	0.28
11	600036	招商银行	627,423.00	0.23
12	002049	紫光国微	611,508.00	0.22
13	300014	亿纬锂能	563,500.00	0.21
14	601816	京沪高铁	542,173.00	0.20
15	002241	歌尔股份	504,200.00	0.18
16	601318	中国平安	491,111.00	0.18
17	002352	顺丰控股	478,940.00	0.17
18	002459	晶澳科技	421,444.00	0.15
19	601658	邮储银行	407,135.00	0.15
20	603806	福斯特	359,401.00	0.13

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600905	三峡能源	8,398,278.31	3.06
2	300750	宁德时代	4,317,998.00	1.57
3	000661	长春高新	3,975,114.08	1.45
4	000858	五粮液	3,964,517.70	1.45
5	600519	贵州茅台	3,708,740.00	1.35
6	002415	海康威视	3,451,149.82	1.26
7	601318	中国平安	2,637,992.00	0.96
8	002475	立讯精密	2,277,796.00	0.83
9	601012	隆基股份	1,991,625.00	0.73
10	600309	万华化学	1,853,975.00	0.68
11	603259	药明康德	1,806,398.00	0.66
12	000568	泸州老窖	1,656,205.00	0.60
13	002821	凯莱英	1,643,704.00	0.60
14	002594	比亚迪	1,449,828.00	0.53
15	002371	北方华创	1,416,010.74	0.52
16	603444	吉比特	1,379,225.00	0.50
17	000001	平安银行	1,324,445.00	0.48
18	300760	迈瑞医疗	1,258,112.00	0.46
19	300015	爱尔眼科	1,258,085.00	0.46
20	002304	洋河股份	1,257,581.00	0.46

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	57,690,846.98
卖出股票收入（成交）总额	190,962,956.03

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	61,021,800.20	37.24
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	323,000.00	0.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	61,344,800.20	37.43

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019664	21 国债 16	270,000	27,010,800.00	16.48
2	019628	20 国债 02	250,020	25,004,500.20	15.26
3	019641	20 国债 11	50,000	5,012,500.00	3.06
4	019658	21 国债 10	40,000	3,994,000.00	2.44
5	113052	兴业转债	3,230	323,000.00	0.20

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					0.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					0.00

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末投资国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

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

本报告期内基金投资的前十名证券中的发行主体包括招商银行股份有限公司。中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 5 月 17 日对招商银行股份有限公司作出了处罚决定。但本基金投资相关证券的投资决策程序符合相关法律、法规的规定。

本报告期内基金投资的前十名证券的其余发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,353.40
2	应收证券清算款	747,273.33
3	应收股利	-
4	应收利息	681,614.60
5	应收申购款	3,073.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,459,315.30

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601728	中国电信	1,682,426.97	1.03	流通受限

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
鑫元鑫趋势 A	309	245,064.58	72,954,700.35	96.34%	2,770,254.23	3.66%
鑫元鑫趋势 C	750	31,006.81	22,014,043.32	94.66%	1,241,066.45	5.34%
合计	1,059	93,465.59	94,968,743.67	95.95%	4,011,320.68	4.05%

### 9.2 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	鑫元鑫趋势 A	223,323.09	0.2949%
	鑫元鑫趋势 C	2,688.50	0.0116%
	合计	226,011.59	0.2283%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	鑫元鑫趋势 A	0~10
	鑫元鑫趋势 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鑫元鑫趋势 A	10~50
	鑫元鑫趋势 C	0
	合计	10~50

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

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C
基金合同生效日（2017 年 8 月 24 日）基金份额总额	23,254,535.06	192,872,503.96
本报告期期初基金份额总额	167,340,702.11	21,334,758.54
本报告期基金总申购份额	8,711,911.88	13,614,959.64
减:本报告期基金总赎回份额	100,327,659.41	11,694,608.41
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	75,724,954.58	23,255,109.77

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：本报告期内，基金管理人于 2021 年 4 月 29 日发布《鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》，自 2021 年 4 月 28 日起，龙艺女士担任鑫元基金总经理，同时张乐赛先生不再担任上述职务；于 2021 年 8 月 27 日发布《鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》，自 2021 年 8 月 26 日起，陈宇先生不再担任鑫元基金副总经理兼首席信息官；于 2021 年 9 月 24 日发布《鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》，自 2021 年 9 月 23 日起，徐小锋先生担任鑫元基金副总经理兼首席信息官、赵程先生担任鑫元基金副总经理；于 2021 年 10 月 18 日发布《鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》，自 2021 年 10 月 18 日起，罗杰先生担任鑫元基金副总经理；于 2021 年 12 月 22 日发布《鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》，自 2021 年 12 月 22 日起，吴菊女士担任鑫元基金副总经理。

2、本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为本基金进行审计的会计师事务所为：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），未发生改聘。本报告期内应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 60,000.00 元。目前的会计师事务所为本基金提供审计服务的年限为 4 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

- 1、本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。
- 2、本报告期托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。



## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	2	143,560,089.28	63.53%	144,881.31	54.91%	-
安信证券	2	50,209,194.53	22.22%	83,530.57	31.66%	-
东方财富证券	2	32,201,746.11	14.25%	35,432.26	13.43%	-

注：（1）交易单元的主要选择标准：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范；
- 2) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，具备投资运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要；
- 3) 具备研究实力，能及时提供高质量的研究服务；
- 4) 收取的交易佣金费率合理。

（2）交易单元的选择程序：

- 1) 市场研究部根据选择标准选取合作券商，发起签署研究服务协议；
- 2) 交易部发起与合作券商签订交易单元租用协议，办理交易单元的相关开通手续，调整相关系统参数，基金运营部及时通知托管人。

（3）报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：无。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
天风证券	179,437,789.40	53.27%	3,810,100,000.00	44.73%	-	-
安信证券	52,353,334.55	15.54%	3,624,700,000.00	42.55%	-	-
东方财富证券	105,079,206.10	31.19%	1,083,200,000.00	12.72%	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站	2021 年 1 月 22 日
2	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 1 月 22 日
3	鑫元基金管理有限公司关于修订旗下 7 只公募基金基金合同等相关法律文件的公告	公司官网、证券时报、上海证券报、中国证券报	2021 年 2 月 3 日
4	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同	公司网站	2021 年 2 月 3 日
5	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2021 年 2 月 3 日
6	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 1 号）	公司网站	2021 年 2 月 5 日
7	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金（鑫元鑫趋势 A 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 2 月 5 日
8	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金（鑫元鑫趋势 C 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 2 月 5 日
9	鑫元基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 2 月 6 日
10	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站	2021 年 3 月 31 日
11	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 3 月 31 日
12	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站	2021 年 4 月 22 日
13	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 4 月 22 日
14	鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 4 月 29 日

15	鑫元基金管理有限公司关于修订旗下 10 只公募基金基金合同等相关法律文件的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 5 月 26 日
16	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同	公司网站	2021 年 5 月 26 日
17	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2021 年 5 月 26 日
18	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 2 号）	公司网站	2021 年 5 月 31 日
19	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金（鑫元鑫趋势 A 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 5 月 31 日
20	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金（鑫元鑫趋势 C 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 5 月 31 日
21	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购、定期定额投资费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 6 月 30 日
22	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 3 号）	公司网站	2021 年 7 月 9 日
23	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金（鑫元鑫趋势 A 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 7 月 9 日
24	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金（鑫元鑫趋势 C 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 7 月 9 日
25	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	公司网站	2021 年 7 月 21 日
26	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 7 月 21 日
27	鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 8 月 27 日
28	鑫元鑫趋势灵活配置混合型	公司网站	2021 年 8 月 31 日

	证券投资基金 2021 年中期报告		
29	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年中期报告提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 8 月 31 日
30	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金申购、定期定额投资业务调整的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 9 月 22 日
31	鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 9 月 24 日
32	鑫元基金管理有限公司关于鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	公司网站、上海证券报	2021 年 9 月 28 日
33	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 4 号）	公司网站	2021 年 9 月 30 日
34	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金（鑫元鑫趋势 A 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 9 月 30 日
35	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金（鑫元鑫趋势 C 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 9 月 30 日
36	鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 10 月 18 日
37	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	公司网站	2021 年 10 月 27 日
38	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 10 月 27 日
39	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分公募基金参与北京证券交易所股票投资及相关风险提示的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报	2021 年 12 月 13 日
40	鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 12 月 22 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20211216-20211231	20,000,000.00	0.00	0.00	20,000,000.00	20.21%
	2	20210101-20211231	70,559,360.89	0.00	12,800,000.00	57,759,360.89	58.35%
	3	20210702-20211215	29,510,150.18	0.00	29,510,150.18	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金已有单一投资者所持基金份额达到或超过本基金总份额的 20%，中小投资者在投资本基金时可能面临以下风险：

#### （一）赎回申请延期办理或暂停赎回的风险

单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件，因此当发生巨额赎回时，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要按同比例部分延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。

#### （二）基金净值大幅波动的风险

单一投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产大量变现，会对基金资产净值产生影响；且如遇大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，都可能会造成基金资产净值的较大波动。

#### （三）基金投资目标偏离的风险

单一投资者大额赎回后，很可能导致基金规模骤然缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。

#### （四）基金合同提前终止或其它相关风险

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情况的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情况的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。因此，在极端情况下，当单一投资者大量赎回本基金后，可能造成基金资产净值大幅缩减，对本基金的继续存续产生决定性影响。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批复、营业执照。

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

鑫元基金管理有限公司

2022年3月25日