

**华夏新时代灵活配置混合型
证券投资基金（QDII）**

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年三月三十日

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	6
§4 管理人报告.....	7
§5 托管人报告.....	12
§6 审计报告.....	13
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告.....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	47
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	48
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	48
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	62
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	88
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	88
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	88
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	88
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	88
8.11 投资组合报告附注.....	88
§9 基金份额持有人信息.....	89
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	89
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	89
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	89
§10 开放式基金份额变动.....	89
§11 重大事件揭示.....	90
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	95
§13 备查文件目录.....	95

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）
基金简称	华夏新时代混合（QDII）
基金主代码	005534
交易代码	005534
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年5月30日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
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	166,880,103.27 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极资产配置和组合管理，追求在严格控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票精选策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略等。在股票投资策略上，本基金将精选境内外上市的具有良好成长潜力的新时代主题企业进行投资。本基金所指的新时代主题行业或企业为顺应时代发展趋势，在经济发展、转型升级过程中，中国经济发展的大趋势所带动辐射的行业及企业，包括：在加快建设制造强国过程中，在我国产业迈向全球价值链中高端、培育若干世界级先进制造业集群过程中，着力发展的先进制造业及相关行业领域；互联网、大数据、人工智能和实体经济深度融合的相关行业领域；中高端消费、绿色低碳、现代供应链、人力资本服务等领域；优化升级的传统产业以及现代服务业等。
业绩比较基准	30%*富时中国 A 股全股指数收益率+30%*富时中国（不含 B 股）全盘指数收益率+40%*上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合基金，0%-95%的基金资产投资于股票，其预期风险和预期收益低于股票基金，高于货币市场基金和普通债券基金，属于中等风险品种。本基金为全球证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

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		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	郭明
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588

传真	010-63136700	010-66105798
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	100033	100140
法定代表人	杨明辉	陈四清

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	纽约梅隆银行股份有限公司
注册地址		225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
办公地址		225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
邮政编码		-

2.5 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	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 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
本期已实现收益	-59,138,956.82	45,018,648.28	35,035,870.92
本期利润	-74,331,133.62	57,526,224.87	51,250,931.95
加权平均基金份额本期利润	-0.3853	1.0126	0.2110
本期加权平均净值利润率	-17.30%	68.46%	21.73%
本期基金份额净值增长率	-6.92%	97.95%	21.58%

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	115,988,974.29	56,490,512.42	7,132,469.02
期末可供分配基金份额利润	0.6950	0.8911	0.0695
期末基金资产净值	336,367,815.81	137,268,463.40	112,198,561.79
期末基金份额净值	2.0156	2.1654	1.0939
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	101.56%	116.54%	9.39%

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。

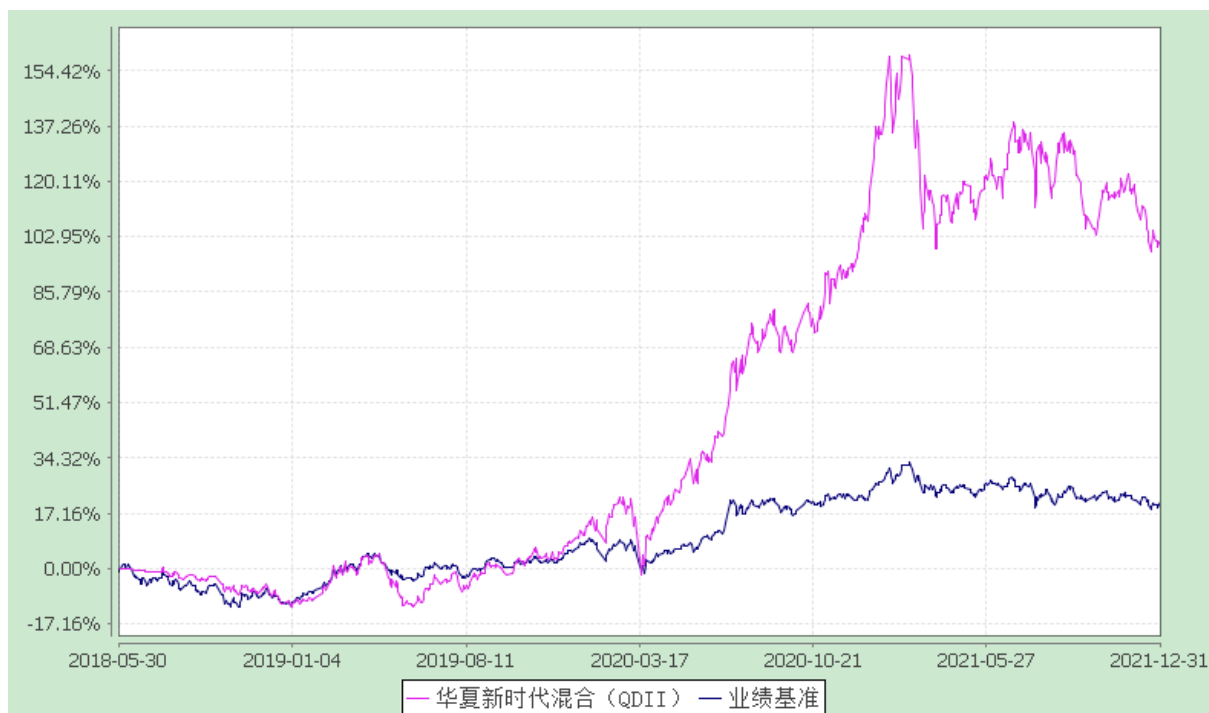
3.2 基金净值表现

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

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	-3.69%	0.98%	-0.55%	0.51%	-3.14%	0.47%
过去六个月	-15.47%	1.46%	-5.55%	0.69%	-9.92%	0.77%
过去一年	-6.92%	1.66%	-2.68%	0.69%	-4.24%	0.97%
过去三年	124.03%	1.56%	35.05%	0.74%	88.98%	0.82%
自基金合同生效起至今	101.56%	1.45%	20.55%	0.76%	81.01%	0.69%

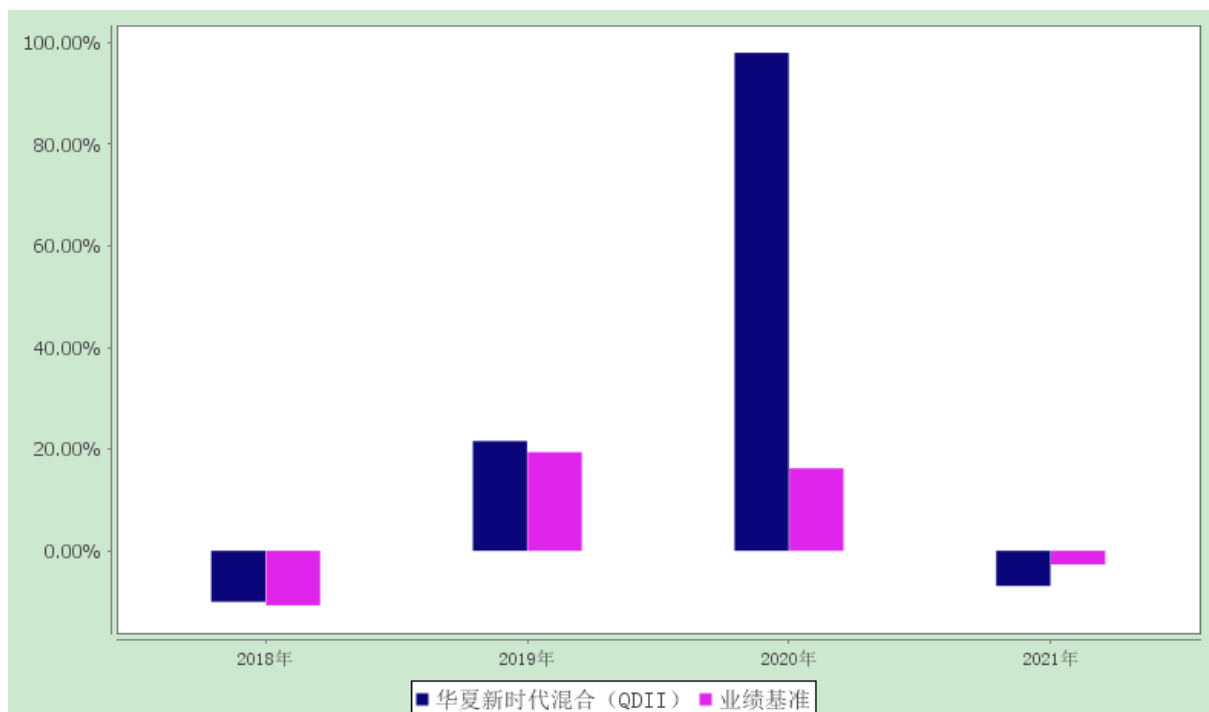
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）
 基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2018 年 5 月 30 日至 2021 年 12 月 31 日)



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

华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）
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：本基金合同于 2018 年 5 月 30 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，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

本基金过去三年无利润分配事项。

§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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，首批公募 MOM 基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2021 年 12 月 31 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在 QDII 混合基金（A 类）中华夏全球聚享（QDII）（A 类）排序第 1/35；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 1/176、华夏兴华混合（A 类）排序第 32/176；在定期开放式偏股型基金（A 类）中华夏磐利一年定开混合（A 类）排序第 1/63、华夏成长精选 6 个月定开混合（A 类）排序第 17/63；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏行业景气混合排序第 2/692、华夏盛世混合排序第 14/692；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票（A 类）排序第 6/33；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 10/132；在标准股票型基金（A 类）中华夏智胜价值成长股票（A 类）排序第 41/259；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+ 基准股票比例 30%-60%）（A 类）中华夏高端制造混合排序第 79/499。

指数与量化策略产品：在信用债指数债券型基金（A 类）中华夏亚债中国指数（A 类）排序第 2/18；

在策略指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏创成长 ETF 联接(A 类)排序第 3/14；在增强规模指数股票型基金（A 类）中华夏中证 500 指数增强(A 类)排序第 4/103；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 4/95、华夏中证四川国改 ETF 排序第 7/95、华夏国证半导体芯片 ETF 排序第 10/95；在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 5/23；在主题指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证四川国改 ETF 联接(A 类)排序第 5/55、华夏国证半导体芯片 ETF 联接(A 类)排序第 7/55；在定期开放式绝对收益目标基金（A 类）中华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排序第 5/24；在行业指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证全指房地产 ETF 联接(A 类)排序第 7/27、华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排序第 8/27；在利率债指数债券型基金（A 类）中华夏中债 3-5 年政金债指数(A 类)排序第 8/103；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 10/42、；在规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证 500ETF 联接(A 类)排序第 13/75；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 500ETF 排序第 16/113、华夏创业板 ETF 排序第 22/113。

主动权益产品：在 QDII 混合基金（A 类）中华夏新时代混合（QDII）排序第 1/36、华夏移动互联混合（QDII）排序第 4/36；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票排序第 2/36；在消费行业偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏新兴消费混合(A 类)排序第 2/21；在标准股票型基金（A 类）中华夏潜龙精选股票排序第 37/226；在绝对收益目标基金（A 类）中华夏回报混合(A 类)排序第 25/139、华夏回报二号混合排序第 27/139；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%60%）（A 类）中华夏军工安全混合排序第 39/491；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）中华夏高端制造混合排序第 15/491、华夏稳盛混合排序第 54/491；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏行业景气混合排序第 9/566、华夏行业龙头混合排序第 36/566；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 11/128；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 11/168、华夏兴华混合(A 类)排序第 32/168、华夏大盘精选混合(A 类)排序第 40/168；在偏债型基金（A 类）中华夏睿磐泰茂混合(A 类)排序第 44/149。FOF 类产品中，在养老目标风险 FOF（权益资产 0-30%）（A 类）中华夏稳健养老一年持有混合（FOF）排序第 4/20；在 QDII 混合基金（A 类）中华夏全球聚享（QDII）（A 类）排序第 10/36；

固收与固收+产品：在普通债券型基金（可投转债）（A 类）中华夏聚利债券排序第 1/196、华夏双债债券(A 类)排序第 3/196、华夏债券(A/B 类)排序第 12/196；在可转换债券型基金（A 类）中华夏可转债增强债券(A 类)排序第 3/34；在定期开放式纯债债券型基金（摊余成本法）（A 类）中华夏恒泰 64 个月定开债券排序第 12/73；在短期纯债债券型基金（A 类）中华夏短债债券(A 类)排序第 12/53；在偏债型基金（A 类）中华夏永康添福混合排序第 18/149；在普通债券型基金（二级）（A

类）中华夏安康债券(A类)排序第 40/248、华夏鼎利债券(A类)排序第 41/248。在 QDII 债券型基金（非 A 类）中华夏收益债券（QDII）(A类)(美元)排序第 2/35、华夏大中华信用债券（QDII）(A类)（美元）排序第 4/35；

指数与量化产品：在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 1/22、华夏创蓝筹 ETF 排序第 6/22；在规模指数股票 ETF 基金中华夏创业板 ETF 排序第 1/90、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 排序第 26/90；在行业指数股票 ETF 基金中华夏消费 ETF 排序第 4/39、华夏医药 ETF 排序第 5/39；在增强规模指数股票型基金（A 类）中华夏中证 500 指数增强(A类)排序第 6/93；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 3/88、华夏中证四川国改 ETF 排序第 8/88、华夏战略新兴成指 ETF 排序第 11/88。

在《上海证券报》主办的第十八届“金基金”奖评选活动上，华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报，荣膺四大奖项：公司层面，华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏创新前沿股票荣获“金基金 股票型基金三年期奖”，华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”，华夏能源革新股票荣获“金基金 社会责任投资（ESG）基金奖”。

在客户服务方面，2021 年上半年度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金管家客户端上线理财小管家和微信登录等功能，方便客户及时了解市场观点、投资者教育等信息，也为客户提供了多样的登录方式；（2）华夏基金公众号上线选基助手微信小程序，包含花样选基、目标选基、我的实验田等 5 大功能模块，帮助客户进行产品筛选；（3）与民商基金销售、众惠基金等代销机构合作，提供更多便捷的理财渠道；（4）开展“都 2021 年了，你还要自己记么？”、“震荡市需要口服镇心丸”、“风往哪吹”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

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		
常亚桥	本基金的基金经理	2018-05-30	-	7 年	硕士。2014 年 2 月加入华夏基金管理有限公司。曾任国际投资部研究员、投资经理。

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

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 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在管私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

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

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的 5%的交易共有 73 次，其中 52 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 21 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据。

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，我们看到的是在率先走出疫情困扰的我国，开始剧烈调整经济结构，去地产化，同时在共同富裕和防止资本无序扩张的背景下，地产以及互联网行业遭遇了严重的政策打压，同时从老百姓身上赚大钱这套方法论受到了极大的挑战。所以，满足人民对更好的生活向往这条消费升级腿彻底被打断，同时，中美之间的求同存异变得愈发艰难，引发了中资海外股（中概股，香港）的股灾，MSCI CHINA 指数在去年下跌了 25%以上，我们的组合在内忧外患背景下受到了严重的冲击，虽然科技创新腿依然存在，但是依然无法承受组合另一半结构剧烈的下跌，全年组合虽然大幅度战胜指数，但未能取得正收益，愧对我的持有人。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.0156 元，本报告期份额净值增长率为-6.92%，同期业绩比较基准增长率为-2.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年，我们即将看到的世界前两大经济体处于经济周期的两端，美国面临着经济过热以及高企的通胀，货币政策财政政策在上半年都会呈现收紧的状态，但是经济增长韧劲仍存在，同时美国开始从全球新兴市场收水来回流美股；而我国处于经济增速的下滑期，对地产行业的打击使得经济周期走向衰退；但是高层已经将稳增长放在了很高的位置，无论信用端还是货币端都呈现放水的形态，我们认为经济周期的交错将会使得两个市场迎来倒挂，A 股、H 股、中概股处在底部震荡的状态，但随着刺激政策的传导，经济将会企稳，消费将会企稳，收入将会好转；与此同时，光靠地产行业已经无法托起经济的增长，各行各业都将迎来纠偏，如果不能有效的稳住增长，我国可能会出现十年里第一次经济增速慢于美国的情况。

我们的方法论依然不会有太大改变，因为人性不会改变，产业趋势也不会短期改变，变化的都是人们内心的贪婪和恐惧，我知道过去一年多基金遭受了不小的回撤，但我依然对本基金充满信心。

无论我的持有人继续持有还是赎回，我都感谢他们的信任和陪伴，也祝他们在投资之路上取得成功，健康快乐。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的

回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司着力加强合规制度建设，在投资、销售、员工行为合规管理等方面出台多项管理制度。同时，继续强化业务部门专兼合规管理职责，规范任免流程，提高工作质量，完善合规管理组织机制。公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。公司开展多种形式的法律法规和廉洁从业培训，提升员工的合规意识，促进廉洁从业。公司严格落实信息披露法规要求，依法合规开展信息披露工作。在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及离任审计工作，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、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。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、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 审计报告

普华永道中天审字（2022）第 24816 号

华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）（以下简称“华夏新时代混合（QDII）”）的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

（二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏新时代混合（QDII）2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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。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。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏新时代混合（QDII），并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏新时代混合（QDII）的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华夏新时代混合（QDII）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，除非基金管理人管理层计划清算华夏新时代混合（QDII）、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏新时代混合（QDII）的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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。

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：

(一) 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。

(二) 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。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏新时代混合（QDII）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华夏新时代混合（QDII）不能持续经营。

(五) 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。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

单峰 朱宏宇

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2022 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	53,797,428.74	13,458,496.72
结算备付金		2,989,065.22	443,212.10
存出保证金		319,805.86	1,070,443.77
交易性金融资产	7.4.7.2	298,083,528.91	124,030,374.28
其中：股票投资		298,083,528.91	124,030,374.28
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		122,621.80	-
应收利息	7.4.7.5	5,044.14	653.53
应收股利		3,956.57	2,686.51
应收申购款		546,887.63	4,440,572.12

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		355,868,338.87	143,446,439.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		14,771,345.70	4,454,783.15
应付赎回款		2,007,974.29	1,109,070.36
应付管理人报酬		531,260.50	174,170.08
应付托管费		88,543.42	29,028.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,907,356.59	229,553.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	194,042.56	181,370.70
负债合计		19,500,523.06	6,177,975.63
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	166,880,103.27	63,392,190.97
未分配利润	7.4.7.10	169,487,712.54	73,876,272.43
所有者权益合计		336,367,815.81	137,268,463.40
负债和所有者权益总计		355,868,338.87	143,446,439.03

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.0156 元，基金份额总额 166,880,103.27 份。

7.2 利润表

会计主体：华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）

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
一、收入		-44,338,642.82	61,160,322.23
1.利息收入		149,604.19	16,682.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	149,604.19	16,682.67
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）		-31,480,303.90	48,693,587.75
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-35,179,603.98	48,229,226.31
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.15	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	3,699,300.08	464,361.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-15,192,176.80	12,507,576.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-724,756.02	-236,465.06
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	2,908,989.71	178,940.28
减：二、费用		29,992,490.80	3,634,097.36
1.管理人报酬		7,776,471.94	1,505,117.30
2.托管费		1,296,078.69	250,852.88
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.20	20,705,172.97	1,663,796.81
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	7.4.7.21	214,767.20	214,330.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-74,331,133.62	57,526,224.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-74,331,133.62	57,526,224.87

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）

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）	63,392,190.97	73,876,272.43	137,268,463.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-74,331,133.62	-74,331,133.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	103,487,912.30	169,942,573.73	273,430,486.03

值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	565,055,325.91	543,949,220.62	1,109,004,546.53
2.基金赎回款	-461,567,413.61	-374,006,646.89	-835,574,060.50
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)	166,880,103.27	169,487,712.54	336,367,815.81
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
一、期初所有者权益（基金净值)	102,566,028.50	9,632,533.29	112,198,561.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润)	-	57,526,224.87	57,526,224.87
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)	-39,173,837.53	6,717,514.27	-32,456,323.26
其中：1.基金申购款	53,873,625.46	39,030,446.35	92,904,071.81
2.基金赎回款	-93,047,462.99	-32,312,932.08	-125,360,395.07
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)	63,392,190.97	73,876,272.43	137,268,463.40

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：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]2287 号《关于准予华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，

存续期限为不定期。本基金自 2018 年 5 月 7 日至 2018 年 5 月 25 日共募集 471,224,195.89 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2018）验字第 60739337_A13 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金合同》于 2018 年 5 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 471,400,177.64 份基金份额，其中认购资金利息折合 175,981.75 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外托管人为纽约梅隆银行股份有限公司。根据基金管理人 2021 年 11 月 4 日刊登的《华夏基金管理有限公司关于修订华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金合同的公告》及《华夏基金管理有限公司关于华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）增加美元销售币种的公告》，本基金自 2021 年 11 月 9 日起增加美元销售币种（即美元现钞和美元现汇）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金可投资于境内市场和境外市场依法发行的金融工具。境内市场投资工具包括依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具（含同业存单）、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。境外市场投资工具包括银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品。此外，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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示

的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

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

本基金目前持有的基金投资、股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

金额。

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。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认列。对于已开放转换业务的基金，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平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况参考《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

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

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

估值结果确定公允价值。

4、本基金作为境外投资者在各个国家和地区证券市场的投资所得的相关税负是基于其现行的税法法规。各个国家和地区的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致本基金在正常的经营活动中，部分交易和事项的最终税务处理存在不确定性。在计提和处理税收费用时，本基金需要作出相关会计估计。

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

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局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《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

（2）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。

- (3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- (4) 存款利息收入不征收增值税。
- (5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- (6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (7) 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、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。
- (9) 基金在境内卖出股票按 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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。
- (10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。
- (11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	53,797,428.74	13,458,496.72
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	53,797,428.74	13,458,496.72

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		289,436,837.79	298,083,528.91	8,646,691.12
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	OTC 市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		289,436,837.79	298,083,528.91	8,646,691.12
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		100,191,506.33	124,030,374.28	23,838,867.95
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	OTC 市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		100,191,506.33	124,030,374.28	23,838,867.95

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

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	2,793.19	409.20
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	2,115.32	235.53
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	135.63	8.80
合计	5,044.14	653.53

7.4.7.6 其他资产

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	1,907,356.59	229,553.00
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,907,356.59	229,553.00

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	4,042.56	1,370.70
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	190,000.00	180,000.00
合计	194,042.56	181,370.70

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,392,190.97	63,392,190.97
本期申购	565,055,325.91	565,055,325.91
本期赎回（以“-”号填列）	-461,567,413.61	-461,567,413.61
本期末	166,880,103.27	166,880,103.27

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	56,490,512.46	17,385,759.97	73,876,272.43
本期利润	-59,138,956.82	-15,192,176.80	-74,331,133.62
本期基金份额交易产生的变动数	118,637,418.65	51,305,155.08	169,942,573.73
其中：基金申购款	388,836,118.61	155,113,102.01	543,949,220.62
基金赎回款	-270,198,699.96	-103,807,946.93	-374,006,646.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	115,988,974.29	53,498,738.25	169,487,712.54

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	73,057.82	11,953.32
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	61,669.40	3,155.62
其他	14,876.97	1,573.73
合计	149,604.19	16,682.67

7.4.7.12 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 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	6,574,878,126.53	497,636,462.99
减：卖出股票成本总额	6,610,057,730.51	449,407,236.68
买卖股票差价收入	-35,179,603.98	48,229,226.31

7.4.7.13 基金投资收益

无。

7.4.7.14 债券投资收益

无。

7.4.7.15 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.17 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31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,699,300.08	464,361.44
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,699,300.08	464,361.44

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年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	-15,192,176.80	12,507,576.59
——股票投资	-15,192,176.80	12,507,576.59
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——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	-15,192,176.80	12,507,576.59

7.4.7.19 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	2,908,989.71	178,936.27
其他	-	4.01
合计	2,908,989.71	178,940.28

7.4.7.20 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	20,705,172.97	1,663,796.81
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	20,705,172.97	1,663,796.81

7.4.7.21 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	70,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	7,586.94	4,331.27
税务顾问费	16,276.64	17,173.72
其他	903.62	12,825.38
合计	214,767.20	214,330.37

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
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
纽约梅隆银行股份有限公司	基金境外资产托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
CLSA LIMITED（“中信里昂证券”）	基金管理人股东控股的公司

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	4,213,072,415.94	31.51%	124,970,648.99	13.16%
中信里昂证券	26,217,239.60	0.20%	10,509,951.96	1.11%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	3,162,200.63	31.38%	-	-
中信里昂证券	22,478.74	0.22%	-	-
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	93,724.97	10.88%	62,823.92	27.37%
中信里昂证券	33,791.17	3.92%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年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
当期发生的基金应支付的管理费	7,776,471.94	1,505,117.30
其中：支付销售机构的客户维护费	2,806,380.69	503,975.48

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.80%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	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托管费	1,296,078.69	250,852.88

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

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

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

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

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固有资金投资本基金的情况

无。

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

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
中国工商银行活期存款	19,693,490.68	69,696.93	3,922,919.25	10,404.53
纽约梅隆银行股份有限公司活期存款	34,103,938.06	3,360.89	9,535,577.47	1,548.79

注：本基金的活期银行存款分别由基金托管人中国工商银行和基金境外资产托管人纽约梅隆银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	688187	时代电气	新股发行	7,337	230,235.06
中信证券	601825	沪农商行	新股发行	15,480	137,772.00
中信证券	601728	中国电信	新股发行	29,000	131,370.00
中信证券	600905	三峡能源	新股发行	33,000	87,450.00
中信证券	688776	国光电气	新股发行	1,447	74,433.68
中信证券	600955	维远股份	新股发行	1,694	50,074.64
中信证券	301028	东亚机械	新股发行	7,329	38,916.99
中信证券	301049	超越科技	新股发行	1,954	37,790.36
中信证券	603529	爱玛科技	新股发行	1,019	28,389.34
中信证券	603071	物产环能	新股发行	1,627	25,088.34
中信证券	605555	德昌股份	新股发行	655	21,189.25
中信证券	301059	金三江	新股发行	2,581	20,880.29
中信证券	600935	华塑股份	新股发行	4,811	18,955.34
中信证券	301053	远信工业	新股发行	1,544	18,327.28
中信证券	301062	上海艾录	新股发行	5,225	17,294.75
中信证券	600916	中国黄金	新股发行	3,371	16,821.29
中信证券	605566	福莱茵特	新股发行	435	14,011.35
中信证券	605060	联德股份	新股发行	883	13,765.97
中信证券	605599	菜百股份	新股发行	980	9,800.00
中信证券	605488	福莱新材	新股发行	416	8,498.88
中信证券	605138	盛泰集团	新股发行	723	7,208.31

中信证券	001208	华菱线缆	新股发行	1,754	6,437.18
中信证券	605020	永和股份	新股发行	850	5,890.50
中信证券	003040	楚天龙	新股发行	1,101	5,086.62
中信证券	001219	青岛食品	新股发行	272	4,678.40
中信证券	601279	英利汽车	新股发行	2,004	4,148.28
中信证券	688425	铁建重工	新股发行	500	1,435.00
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信里昂证 券	06969	思摩尔国际	新股发行	171,000	1,923,669.29
中信里昂证 券	03347	泰格医药	新股发行	6,300	567,006.30
中信里昂证 券	06618	京东健康	新股发行	2,300	137,188.46
中信里昂证 券	09992	泡泡玛特	新股发行	3,000	97,317.99

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

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
000063	中兴通讯	2020-02-03	2022-02-07	非公开发行流	30.21	32.99	33,102	1,000,011.42	1,092,034.98	-

				通受限						
688707	振华新材	2021-09-06	2022-03-14	新发流通受限	11.75	47.16	8,130	95,527.50	383,410.80	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新发流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新发流通受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301099	雅创电子	2021-11-10	2022-05-23	新发流通受限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	新发流通受限	12.03	17.12	1,372	16,505.16	23,488.64	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新发流通受限	25.80	33.65	619	15,970.20	20,829.35	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新发流通受	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-

				限						
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新发流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新发流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新发流通受限	43.99	50.77	253	11,129.47	12,844.81	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新发流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新发流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	新发流通受限	79.60	78.53	133	10,586.80	10,444.49	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新发流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301045	天	2021-08-06	2022-02-17	新	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-

	禄科技			发流通受限						
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新发流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新发流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新发流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	新发流通受限	57.27	53.71	157	8,991.39	8,432.47	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新发流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	新发流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
300814	中富电	2021-08-04	2022-02-14	新发流	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-

	路			通受限						
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	新发流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新发流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新发流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新发流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新发流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新发流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新发流通受	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-

				限						
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新发流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新发流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新发流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新发流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新发流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新发流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新发流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华	2021-07-08	2022-01-19	新	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-

	蓝集团			发 流 通 受 限						
301037	保 立 佳	2021-07-21	2022-02-07	新 发 流 通 受 限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君 亭 酒 店	2021-09-22	2022-03-30	新 发 流 通 受 限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远 信 工 业	2021-08-25	2022-03-01	新 发 流 通 受 限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇 隆 新 材	2021-08-31	2022-03-09	新 发 流 通 受 限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大 地 海 洋	2021-09-16	2022-03-28	新 发 流 通 受 限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵 阳 液 压	2021-10-11	2022-04-19	新 发 流 通 受 限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日

前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

⑤基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

⑥以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的全球证券市场中具有良好流动性的金融工具。本基金投资海外国家/地区的资本市场规模较大、金融市场发展程度高，投资的证券品种成交活跃。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

截至本期末，综合考虑利率债、信用债、同业存单、资产支持证券等资产占基金资产净值的比例，利率变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计

以外币计价的资产				
银行存款	33,664,973.37	3.58	438,964.63	34,103,941.58
交易性金融资产	71,228,472.88	78,239,600.82	-	149,468,073.70
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	122,621.80	-	-	122,621.80
应收利息	3.57	-	-	3.57
应收股利	3,956.57	-	-	3,956.57
应收申购款	-	-	-	-
应收在途资金	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	105,020,028.19	78,239,604.40	438,964.63	183,698,597.22
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	-	13,917,061.22	-	13,917,061.22
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	11,582.80	-	-	11,582.80
应付赎回费	14.54	-	-	14.54
其他负债	-	-	-	-
负债合计	11,597.34	13,917,061.22	-	13,928,658.56
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	9,093,692.06	3.63	442,462.21	9,536,157.90
交易性金融资产	23,348,940.59	56,959,443.02	-	80,308,383.61
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	2,686.51	-	2,686.51
应收在途资金	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	32,442,632.65	56,962,133.16	442,462.21	89,847,228.02
以外币计价的				

负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	1,738,269.77	1,132,906.66	-	2,871,176.43
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	1,738,269.77	1,132,906.66	-	2,871,176.43

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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
	所有外币相对人民币升值 5%	8,488,496.93	4,348,802.58
	所有外币相对人民币贬值 5%	-8,488,496.93	-4,348,802.58

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 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	298,083,528.91	88.62	124,030,374.28	90.36
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
合计	298,083,528.91	88.62	124,030,374.28	90.36

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除富时中国(不含 B 股)全盘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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	-5%	-11,357,374.29	-6,225,281.29
	+5%	11,357,374.29	6,225,281.29

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

（2）各层次金融工具公允价值

截至 2021 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 296,185,357.40 元，第二层次的余额为 1,898,171.51 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2020 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 121,953,587.56 元，第二层次的余额为 2,076,786.72 元，第三层次的余额为 0 元。）

（3）公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

（4）第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

（5）新金融工具准则

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。

除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	298,083,528.91	83.76
	其中：普通股	281,436,447.55	79.08
	存托凭证	16,647,081.36	4.68
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	56,786,493.96	15.96
8	其他各项资产	998,316.00	0.28
9	合计	355,868,338.87	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 24,391,518.04 元，占基金资产净值比例为 7.25%。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国内地	148,615,455.21	44.18
中国香港	78,239,600.82	23.26
美国	71,228,472.88	21.18
合计	298,083,528.91	88.62

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	98,117,843.71	29.17
材料	60,398,587.88	17.96
工业	43,292,288.39	12.87
非必需消费品	30,807,922.06	9.16
通信服务	25,987,713.52	7.73
必需消费品	14,432,958.31	4.29
房地产	12,988,883.36	3.86
金融	12,005,679.36	3.57
保健	51,652.32	0.02
公用事业	-	-
能源	-	-
合计	298,083,528.91	88.62

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	LUXSHA RE PRECISI ON INDUST RY CO LTD	立讯精密	002475	深圳	中国内地	305,900.00	15,050,280.00	4.47
2	APPLE INC	-	AAPL	纳斯达 克	美国	11,558.00	13,085,193.78	3.89
3	TENCEN T HOLDIN GS LTD	腾讯控 股有 限公 司	00700	香港	中国香港	32,200.00	12,026,045.70	3.58

4	MICROSOFT CORP	-	MSFT	纳斯达克	美国	5,319.00	11,405,400.98	3.39
5	SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	上海复旦微电子集团股份有限公司	01385	香港	中国香港	522,000.00	10,840,394.88	3.22
6	NVIDIA CORP	-	NVDA	纳斯达克	美国	5,673.00	10,637,766.38	3.16
7	TESLA INC	-	TSLA	纳斯达克	美国	1,482.00	9,985,289.55	2.97
8	CONTEMPORARY AMPERE X TECHNOLOGY CO LTD	宁德时代	300750	深圳	中国内地	15,500.00	9,114,000.00	2.71
9	YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	恩捷股份	002812	深圳	中国内地	36,100.00	9,039,440.00	2.69
10	LUOYANG GLASS CO LTD	洛阳玻璃股份有限公司	01108	香港	中国香港	628,000.00	9,005,962.11	2.68
11	JIANGSUTOLAND ALLOY CO LTD	图南股份	300855	深圳	中国内地	108,000.00	7,612,920.00	2.26
12	AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	鹏鼎控股	002938	深圳	中国内地	176,717.00	7,498,102.31	2.23
13	FUSHUN SPECIAL	抚顺特钢	600399	上海	中国内地	297,600.00	7,371,552.00	2.19

	STEEL CO LTD							
14	GIGADE VICE SEMI DUCTO R BEIJING INC	兆易创新	603986	上海	中国内地	41,500.00	7,297,775.00	2.17
15	XPENG INC	小鹏汽车 有限公司	09868	香港	中国香港	28,200.00	4,295,392.42	1.28
			XPEV	纽约	美国	7,858.00	2,521,545.61	0.75
16	ALPHAB ET INC	-	GOOGL	纳斯达 克	美国	369.00	6,815,672.78	2.03
17	GF SECURIT IES CO LTD	广发证券 股份有限 公司	01776	香港	中国香港	346,400.00	4,208,599.27	1.25
			000776	深圳	中国内地	94,500.00	2,323,755.00	0.69
18	POLY PROPER TY SERVIC ES CO LTD	保利物业 服务股份 有限公司	06049	香港	中国香港	119,600.00	5,994,218.05	1.78
19	YONGXI NG SPECIAL MATERI ALS TECHNO LOGY CO LTD	永兴材料	002756	深圳	中国内地	39,800.00	5,891,196.00	1.75
20	BEIJING DABEIN ONG TECHNO LOGY GROUP CO LTD	大北农	002385	深圳	中国内地	556,600.00	5,838,734.00	1.74
21	ANHUI XINBO ALUMIN UM CO LTD	鑫铂股份	003038	深圳	中国内地	77,200.00	5,710,484.00	1.70
22	HONG	香港交易	00388	香港	中国香港	14,700.00	5,473,325.09	1.63

	KONG EXCHAN GES & CLEARI NG LTD	及结算所 有限公司						
23	ASML HOLDIN G NV	-	ASML	纳斯达 克	美国	1,066.00	5,410,962.48	1.61
24	MEITUA N	美团	03690	香港	中国香港	27,500.00	5,067,893.60	1.51
25	CHINA NATION AL BUILDIN G MATERI AL CO LTD	中国建材 股份有限 公司	03323	香港	中国香港	616,000.00	4,814,813.70	1.43
26	TIANJIN 712 COMMU NICATIO N & BROADC ASTING CO LTD	七一二	603712	上海	中国内地	109,700.00	4,750,010.00	1.41
27	ZHEJIAN G SOUTHE AST SPACE FRAME CO LTD	东南网架	002135	深圳	中国内地	405,100.00	4,682,956.00	1.39
28	AECC AERO-E NGINE CONTRO L CO LTD	航发控制	000738	深圳	中国内地	154,200.00	4,669,176.00	1.39
29	BEIJING ROBORO CK TECHNO LOGY	石头科技	688169	上海	中国内地	5,508.00	4,478,004.00	1.33

	CO LTD							
30	ANHUI HONGLU STEEL CONSTR UCTION GROUP CO LTD	鸿路钢构	002541	深圳	中国内地	81,800.00	4,379,572.00	1.30
31	LUZHOU LAOJIAO CO LTD	泸州老窖	000568	深圳	中国内地	17,200.00	4,366,564.00	1.30
32	JINKOSO LAR HOLDIN G CO LTD	-	JKS	纽约	美国	14,594.00	4,276,438.55	1.27
33	FUJIAN AONON G BIOLOGI CAL TECHNO LOGY GROUP INC LTD	傲农生物	603363	上海	中国内地	331,500.00	4,210,050.00	1.25
34	WINGTE CH TECHNO LOGY CO LTD	闻泰科技	600745	上海	中国内地	29,400.00	3,801,420.00	1.13
35	COUNTR Y GARDEN SERVICE S HOLDIN GS CO LTD	碧桂园服 务控股有 限公司	06098	香港	中国香港	97,000.00	3,703,646.24	1.10
36	NETEAS E INC	网易公司	NTES	纳斯达 克	美国	2,864.00	1,858,503.29	0.55
			09999	香港	中国香港	14,300.00	1,841,439.60	0.55
37	JIANGSU EASTER N	东方盛虹	000301	深圳	中国内地	172,900.00	3,343,886.00	0.99

	SHENGHONG CO LTD							
38	JIANGYIN HENGRUN HEAVY INDUSTRIES CO LTD	恒润股份	603985	上海	中国内地	58,900.00	3,146,438.00	0.94
39	XINTE ENERGY CO LTD	新特能源股份有限公司	01799	香港	中国香港	253,600.00	2,994,038.12	0.89
40	NANTONG JIANGHAI CAPACITOR CO LTD	江海股份	002484	深圳	中国内地	108,400.00	2,961,488.00	0.88
41	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源控股有限公司	03800	香港	中国香港	1,258,000.00	2,910,770.46	0.87
42	HUBEI DINGLONG CO LTD	鼎龙股份	300054	深圳	中国内地	116,800.00	2,842,912.00	0.85
43	ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	世纪华通	002602	深圳	中国内地	319,500.00	2,680,605.00	0.80
44	BEIJING SANLIAN HOPE SHIN-GO SEN TECHNICAL	三联虹普	300384	深圳	中国内地	92,300.00	2,219,815.00	0.66

	CAL SERVICE CO LTD							
45	AVIC SHENYA NG AIRCRA FT CO LTD	中航沈飞	600760	上海	中国内地	31,900.00	2,170,476.00	0.65
46	LITHIUM AMERIC AS CORP	-	LAC	纽约	美国	10,207.00	1,895,035.54	0.56
47	CHINA OVERSE AS PROPER TY HOLDIN GS LTD	中海物业 集团有限 公司	02669	香港	中国香港	275,000.00	1,859,426.80	0.55
48	NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	东方电缆	603606	上海	中国内地	35,600.00	1,821,296.00	0.54
49	PINDUO DUO INC	-	PDD	纳斯达 克	美国	4,810.00	1,787,892.92	0.53
50	CHINA NONFER ROUS MINING CORP LTD	中国有色 矿业有限 公司	01258	香港	中国香港	656,000.00	1,662,671.36	0.49
51	NINGBO SOLART RON TECHNO LOGY CO LTD	长阳科技	688299	上海	中国内地	46,613.00	1,524,245.10	0.45
52	HAINAN JINPAN SMART TECHNO LOGY CO LTD	金盘科技	688676	上海	中国内地	41,880.00	1,367,382.00	0.41

53	LUOYANG XINQIANG SLEWING BEARING CO LTD	新强联	300850	深圳	中国内地	7,600.00	1,356,676.00	0.40
54	CHONGQING SOKON INDUSTRIY GROUP CO LTD	小康股份	601127	上海	中国内地	19,700.00	1,173,135.00	0.35
55	TIANQI LITHIUM CORP	天齐锂业	002466	深圳	中国内地	10,400.00	1,112,800.00	0.33
56	ZTE CORP	中兴通讯	000063	深圳	中国内地	33,102.00	1,092,034.98	0.32
57	QINGDAO SENTURY TIRE CO LTD	森麒麟	002984	深圳	中国内地	25,300.00	899,921.00	0.27
58	KE HOLDINGS INC	-	BEKE	纽约	美国	6,172.00	791,738.51	0.24
59	ROBLOX CORP	-	RBLX	纽约	美国	1,151.00	757,032.51	0.23
60	S-ENJOY SERVICE GROUP CO LTD	新城悦服务集团有限公司	01755	香港	中国香港	70,000.00	639,853.76	0.19
61	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育用品有限公司	02020	香港	中国香港	5,600.00	535,233.66	0.16
62	GUIZHOU ZHENHUA E-CHEM	振华新材	688707	上海	中国内地	8,130.00	383,410.80	0.11

	INC							
63	MORIMATSU INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	森松国际控股有限公司	02155	香港	中国香港	50,000.00	365,876.00	0.11
64	DONGGUAN YIHEDA AUTOMATION CO LTD	怡合达	301029	深圳	中国内地	462.00	41,519.94	0.01
65	CIMC VEHICLES GROUP CO LTD	中集车辆	301039	深圳	中国内地	2,064.00	25,820.64	0.01
66	SHANGHAI YCT ELECTRONICS GROUP CO LTD	雅创电子	301099	深圳	中国内地	351.00	25,047.36	0.01
67	WUHAN TIANYUAN ENVIRONMENTAL PROTECTION CO LTD	天源环保	301127	深圳	中国内地	1,372.00	23,488.64	0.01
68	HUBEI BIOCAUSE HEILEN PHARMACEUTICAL CO LTD	亨迪药业	301211	深圳	中国内地	619.00	20,829.35	0.01
69	JOY KIE	久祺股份	300994	深圳	中国内地	420.00	19,089.00	0.01

	CORP LTD							
70	SHANGHAI NENGHUAI TECHNOLOGY CO LTD	能辉科技	301046	深圳	中国内地	290.00	14,207.10	0.00
71	GUANGDONG LIFESTRONG PHARMACY CO LTD	粤万年青	301111	深圳	中国内地	379.00	13,901.72	0.00
72	JIANGSU ZEYU INTELLIGENT ELECTRIC POWER CO LTD	泽宇智能	301179	深圳	中国内地	253.00	12,844.81	0.00
73	HOOTECH INC	浩通科技	301026	深圳	中国内地	203.00	12,734.19	0.00
74	GEMAC ENGINEERING MACHINERY CO LTD	金鹰重工	301048	深圳	中国内地	843.00	10,925.28	0.00
75	HANGZHOU BIO-SINCERITY PHARMA-TECH CO LTD	百诚医药	301096	深圳	中国内地	133.00	10,444.49	0.00
76	XIAMEN EAST ASIA MACHINERY	东亚机械	301028	深圳	中国内地	733.00	9,895.50	0.00

	INDUSTRIAL CO LTD							
77	TALANT OPTRONICS SUZHOU CO LTD	天禄科技	301045	深圳	中国内地	335.00	9,503.95	0.00
78	KIDSWANT CHILDREN PRODUCTS CO LTD	孩子王	301078	深圳	中国内地	756.00	9,177.84	0.00
79	SHANGHAI AILU PACKAGING CO LTD	上海艾录	301062	深圳	中国内地	523.00	8,896.23	0.00
80	NINGBO HOMELINK ECO-ITECH CO LTD	家联科技	301193	深圳	中国内地	297.00	8,654.58	0.00
81	TONGLING JIEYA BIOLOGICAL TECHNOLOGY CO LTD	洁雅股份	301108	深圳	中国内地	157.00	8,432.47	0.00
82	DOOK MEDIA GROUP LTD	读客文化	301025	深圳	中国内地	403.00	8,414.64	0.00
83	HANGZHOU WENSLI SILK CULTURE CO	万事利	301066	深圳	中国内地	344.00	7,856.96	0.00

	LTD							
84	SHENZHEN JOVEN ENTERPRISE LTD	中富电路	300814	深圳	中国内地	328.00	7,832.64	0.00
85	GUANGZHOU JINZHONG AUTOPARTS MANUFACTURING CO LTD	金钟股份	301133	深圳	中国内地	286.00	7,707.70	0.00
86	NINGBO JOY INTELLIGENT LOGISTICS TECHNOLOGY CO LTD	喜悦智行	301198	深圳	中国内地	262.00	7,650.40	0.00
87	SUZHOU SHIJING ENVIRONMENTAL TECHNOLOGY CO LTD	仕净科技	301030	深圳	中国内地	242.00	7,627.84	0.00
88	MEDPRIN REGENERATIVE MEDICAL TECHNOLOGIES CO LTD	迈普医学	301033	深圳	中国内地	108.00	6,476.76	0.00
89	ANHUI CHAOYUE	超越科技	301049	深圳	中国内地	196.00	6,452.32	0.00

	ENVIRO NMENTA L PROTEC TION TECHNO LOGY CO LTD							
90	ZHEJIAN G XINCHAI CO LTD	新柴股份	301032	深圳	中国内地	513.00	6,417.63	0.00
91	SICHER ELEVAT OR CO LTD	森赫股份	301056	深圳	中国内地	572.00	6,343.48	0.00
92	SUNLOU R PIGMEN T CO LTD	双乐股份	301036	深圳	中国内地	205.00	6,135.65	0.00
93	SHENZH EN KING BROTHER R ELECTR ONICS TECHNO LOGY CO LTD	金百泽	301041	深圳	中国内地	215.00	6,065.15	0.00
94	ZHONGJI E JIANGSU TECHNO LOGY CO LTD	中捷精工	301072	深圳	中国内地	181.00	6,047.21	0.00
95	GAD ENVIRO NMENTA L TECHNO LOGY CO LTD	中兰环保	300854	深圳	中国内地	203.00	5,539.87	0.00
96	ZHANGJI	海锅股份	301063	深圳	中国内地	153.00	5,524.83	0.00

	AGANG HAIGUO NEW ENERGY EQUIPM ENT MANUFA CTURIN G CO LTD							
97	JIANGSU TIMES TEXTILE TECHNO LOGY CO LTD	泰慕士	001234	深圳	中国内地	333.00	5,504.49	0.00
98	JINSANJI ANG ZHAOQI NG SILICON MATERI AL CO LTD	金三江	301059	深圳	中国内地	259.00	4,998.70	0.00
99	HUALAN GROUP CO LTD	华蓝集团	301027	深圳	中国内地	286.00	4,761.90	0.00
100	HUITON G CONSTR UCTION GROUP CO LTD	汇通集团	603176	上海	中国内地	1,924.00	4,713.80	0.00
101	SHANGH AI BAOLIJ A CHEMIC AL CO LTD	保立佳	301037	深圳	中国内地	193.00	4,682.18	0.00
102	ZHEJIAN G S SAW BOUTIQ UE	君亭酒店	301073	深圳	中国内地	144.00	4,608.00	0.00

	HOTELS CO LTD							
103	YOANTI ON INDUST RIAL INC LTD	远信工业	301053	深圳	中国内地	155.00	4,460.90	0.00
104	ZHEJIAN G HUILON G NEW MATERI AL CO LTD	汇隆新材	301057	深圳	中国内地	218.00	4,146.36	0.00
105	HANGZH OU DADI HAIYAN G ENVIRO NMENTA L PROTEC TION CO LTD	大地海洋	301068	深圳	中国内地	144.00	4,086.72	0.00
106	SHAOYA NG VICTOR HYDRA ULICS CO LTD	邵阳液压	301079	深圳	中国内地	140.00	3,474.80	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	300750	186,819,208.88	136.10
2	GANFENG LITHIUM CO LTD	01772	115,470,802.69	84.12
		002460	62,394,998.64	45.45

3	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	176,674,599.76	128.71
4	MEITUAN	03690	148,613,104.81	108.26
5	BYD CO LTD	01211	91,760,269.20	66.85
		002594	20,406,749.00	14.87
6	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	02899	68,603,604.95	49.98
		601899	38,014,901.00	27.69
7	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	603799	90,810,749.96	66.16
8	XIAOMI CORP	01810	88,240,083.97	64.28
9	JIANGSU CNANO TECHNOLOGY CO LTD	688116	75,124,155.30	54.73
10	LUOYANG GLASS CO LTD	01108	46,164,024.96	33.63
		600876	25,017,808.46	18.23
11	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	02196	55,115,390.92	40.15
		600196	15,227,946.26	11.09
12	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	02382	68,002,653.02	49.54
13	TIANQI LITHIUM CORP	002466	66,422,533.00	48.39
14	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	06098	65,339,770.31	47.60
15	WEIMOB INC	02013	65,236,600.99	47.52
16	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	00388	64,436,053.47	46.94
17	JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	000301	62,354,574.90	45.43
18	XINTE ENERGY CO LTD	01799	61,641,200.03	44.91
19	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	02020	59,855,483.11	43.60
20	WUXI APTEC CO LTD	02359	43,809,502.77	31.92
		603259	13,898,385.00	10.12
21	PINDUODUO INC	PDD	56,876,795.14	41.43
22	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONAL CORP	00981	34,194,886.60	24.91
		688981	22,525,576.06	16.41
23	BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	00285	55,263,918.57	40.26
24	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE	01209	54,596,419.01	39.77

	SERVICES LTD			
25	CHINA MOLYBDENUM CO LTD	03993	33,223,546.62	24.20
		603993	20,191,801.09	14.71
26	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	01919	42,951,697.81	31.29
		601919	10,220,445.23	7.45
27	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	01378	51,548,639.13	37.55
28	SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	06969	50,493,704.68	36.78
29	APPLE INC	AAPL	50,062,085.71	36.47
30	TESLA INC	TSLA	49,900,577.42	36.35
31	SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	01516	45,495,714.33	33.14
32	CNOOC LTD	00883	44,769,317.40	32.61
33	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	06078	44,632,860.86	32.52
34	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	002475	44,500,822.70	32.42
35	FUTU HOLDINGS LTD	FUTU	44,385,514.47	32.33
36	SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	01385	44,150,609.13	32.16
37	BILIBILI INC	BILI	42,039,366.21	30.63
		09626	1,917,998.23	1.40
38	SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	300724	42,997,179.95	31.32
39	NIO INC	NIO	41,200,173.01	30.01
40	SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TECHNOLOGY CO LTD	300390	41,064,227.86	29.92
41	KWEICHOW MOUTAI CO LTD	600519	40,561,705.03	29.55
42	FUSHUN SPECIAL STEEL CO LTD	600399	38,475,553.61	28.03
43	POLY PROPERTY SERVICES CO LTD	06049	38,174,507.10	27.81
44	WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	603185	37,478,995.58	27.30
45	LECRON INDUSTRIAL DEVELOPMENT GROUP CO LTD	300343	36,881,096.89	26.87
46	AECC AVIATION POWER	600893	36,473,978.94	26.57

	CO LTD			
47	WULIANGYE YIBIN CO LTD	000858	35,894,366.29	26.15
48	NVIDIA CORP	NVDA	34,631,534.77	25.23
49	JINKE SMART SERVICES GROUP CO LTD	09666	34,443,818.84	25.09
50	NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	605117	34,439,028.98	25.09
51	YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	002756	33,990,309.07	24.76
52	LI NING CO LTD	02331	33,895,695.85	24.69
53	QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	000792	33,742,082.00	24.58
54	TONGWEI CO LTD	600438	33,281,086.16	24.25
55	CHINA MOBILE LTD	00941	33,036,763.38	24.07
56	BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	688169	32,762,534.60	23.87
57	S-ENJOY SERVICE GROUP CO LTD	01755	32,337,009.78	23.56
58	KUAISHOU TECHNOLOGY	01024	32,220,467.41	23.47
59	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	00175	32,149,079.51	23.42
60	ANHUI XINBO ALUMINUM CO LTD	003038	31,407,711.84	22.88
61	AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD	600760	31,342,115.00	22.83
62	CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	00291	31,216,004.20	22.74
63	RONGSHENG PETROCHEMICAL CO LTD	002493	31,086,978.34	22.65
64	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	03323	30,658,736.14	22.33
65	SHANGHAI HIUV NEW MATERIALS CO LTD	688680	30,640,654.61	22.32
66	FLAT GLASS GROUP CO LTD	06865	26,933,037.90	19.62
		601865	3,451,265.83	2.51
67	CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	01995	30,358,537.74	22.12

68	JD.COM INC	JD	17,499,506.17	12.75
		09618	12,674,655.19	9.23
69	JINKOSOLAR HOLDING CO LTD	JKS	30,061,359.44	21.90
70	GF SECURITIES CO LTD	01776	18,203,561.60	13.26
		000776	11,655,841.60	8.49
71	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	00316	29,817,910.96	21.72
72	NINGBO BOWAY ALLOY MATERIAL CO LTD	601137	29,761,796.66	21.68
73	RLX TECHNOLOGY INC	RLX	29,627,274.22	21.58
74	MICROSOFT CORP	MSFT	29,541,254.07	21.52
75	MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	300782	29,339,105.49	21.37
76	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	BABA	26,839,593.66	19.55
		09988	2,450,464.56	1.79
77	YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	300957	28,559,893.00	20.81
78	CHENGDU RML TECHNOLOGY CO LTD	301050	28,345,627.35	20.65
79	KINTOR PHARMACEUTICAL LTD	09939	28,217,295.99	20.56
80	LUZHOU LAOJIAO CO LTD	000568	27,934,367.40	20.35
81	HUAZHU GROUP LTD	HTHT	26,939,597.70	19.63
82	NETEASE INC	09999	22,038,572.64	16.06
		NTES	4,792,804.67	3.49
83	IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	300896	26,506,361.53	19.31
84	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	00354	26,472,644.80	19.29
85	GOERTEK INC	002241	26,417,069.24	19.24
86	ALBEMARLE CORP	ALB	26,189,861.17	19.08
87	KINGBOARD LAMINATES HOLDINGS LTD	01888	25,787,223.97	18.79
88	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	02313	25,736,933.54	18.75
89	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	01478	25,648,340.68	18.68

90	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	002240	25,102,546.00	18.29
91	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	603806	25,030,347.45	18.23
92	LI AUTO INC	LI	24,870,498.05	18.12
93	AOYUAN BEAUTY VALLEY TECHNOLOGY CO LTD	000615	24,828,503.00	18.09
94	KINGSOFT CORP LTD	03888	24,755,062.83	18.03
95	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	02601	21,311,264.37	15.53
		601601	3,320,350.70	2.42
96	AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	002938	24,621,586.87	17.94
97	JIUGUI LIQUOR CO LTD	000799	24,583,935.95	17.91
98	MIANYANG FULIN PRECISION CO LTD	300432	24,028,597.00	17.50
99	GREAT WALL MOTOR CO LTD	02333	22,134,517.84	16.12
		601633	1,672,079.00	1.22
100	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	01171	21,438,721.65	15.62
		600188	1,684,798.00	1.23
101	ZHEJIANG YONGTAI TECHNOLOGY CO LTD	002326	22,843,915.76	16.64
102	FUJIAN YONGFU POWER ENGINEERING CO LTD	300712	22,788,202.40	16.60
103	NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	600989	22,595,984.44	16.46
104	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	01951	22,495,207.78	16.39
105	WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	300450	22,193,395.20	16.17
106	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	02600	16,969,072.89	12.36
		601600	5,144,260.00	3.75
107	REMEGEN CO LTD	09995	21,402,363.30	15.59
108	KE HOLDINGS INC	BEKE	20,894,458.02	15.22
109	EAST MONEY INFORMATION CO LTD	300059	20,889,457.53	15.22
110	NATIONS TECHNOLOGIES INC	300077	20,724,179.00	15.10
111	HAIER SMART HOME	06690	20,538,688.88	14.96

	CO LTD			
112	LONG YUAN CONSTRUCTION GROUP CO LTD	600491	20,318,546.53	14.80
113	CATHAY MEDIA AND EDUCATION GROUP INC	01981	19,978,193.83	14.55
114	SHANDONG CHENMING PAPER HOLDINGS LTD	01812	19,955,285.53	14.54
115	ZHEJIANG SHUANGHUAN DRIVELINE CO LTD	002472	19,484,291.06	14.19
116	RED AVENUE NEW MATERIALS GROUP CO LTD	603650	19,313,281.94	14.07
117	EDVANTAGE GROUP HOLDINGS LTD	00382	18,591,187.79	13.54
118	NAYUKI HOLDINGS LTD	02150	18,320,063.37	13.35
119	WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	600745	18,181,753.67	13.25
120	EVE ENERGY CO LTD	300014	18,001,373.00	13.11
121	HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	600346	17,982,425.16	13.10
122	ZHUSHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	03898	17,605,386.79	12.83
		688187	230,235.06	0.17
123	FRONTAGE HOLDINGS CORP	01521	17,811,284.88	12.98
124	CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	000625	17,715,328.70	12.91
125	CHINA RESOURCES LAND LTD	01109	17,519,216.21	12.76
126	BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	002385	17,317,622.09	12.62
127	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	01347	17,165,804.61	12.51
128	SHENZHEN FINE MADE ELECTRONICS GROUP CO LTD	300671	16,920,973.00	12.33
129	CHENGTUN MINING GROUP CO LTD	600711	16,891,639.00	12.31

130	META PLATFORMS INC	FB	16,720,102.24	12.18
131	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	02269	16,697,543.97	12.16
132	FUJIAN TORCH ELECTRON TECHNOLOGY CO LTD	603678	16,478,745.80	12.00
133	AGRIFY CORP	AGFY	16,345,517.17	11.91
134	CHINA NONFERROUS MINING CORP LTD	01258	15,882,378.99	11.57
135	DONGYUE GROUP LTD	00189	15,802,507.79	11.51
136	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	00939	15,786,496.89	11.50
137	BEIJING TIANYISHANGJIA NEW MATERIAL CORP LTD	688033	15,271,520.68	11.13
138	XI'AN TRIANGLE DEFENSE CO LTD	300775	15,190,677.00	11.07
139	SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	002497	15,055,573.00	10.97
140	SHANXI COKING COAL ENERGY GROUP CO LTD	000983	14,887,173.00	10.85
141	HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	000933	14,803,060.00	10.78
142	MICROPORT CARDIOFLOW MEDTECH CORP	02160	14,659,886.12	10.68
143	TAL EDUCATION GROUP	TAL	14,618,710.29	10.65
144	BEIJING HEZONG SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	300477	14,541,746.50	10.59
145	QINGDAO SENTURY TIRE CO LTD	002984	14,446,969.00	10.52
146	SANGFOR TECHNOLOGIES INC	300454	14,287,599.75	10.41
147	XPENG INC	XPEV	7,072,808.20	5.15
		09868	6,862,280.43	5.00
148	GOLDEN SOLAR NEW ENERGY TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	01121	13,868,294.33	10.10
149	PING AN BANK CO LTD	000001	13,821,242.00	10.07
150	MOON ENVIRONMENT	000811	13,815,969.15	10.06

	TECHNOLOGY CO LTD			
151	LITHIUM AMERICAS CORP	LAC	13,787,572.98	10.04
152	SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	300601	13,716,191.10	9.99
153	SHANDONG SHIDA SHENGHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	603026	13,609,184.75	9.91
154	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	603986	13,399,757.00	9.76
155	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	00762	13,280,031.06	9.67
156	SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	603659	13,273,456.96	9.67
157	YOUZU INTERACTIVE CO LTD	002174	13,121,249.42	9.56
158	BEIJING YUANLIU HONGYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	603267	13,066,435.00	9.52
159	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	TSM	13,057,045.27	9.51
160	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	00268	12,286,712.94	8.95
161	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	03968	7,308,776.46	5.32
		600036	4,960,788.00	3.61
162	JIANGSU AKCOME SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	002610	12,267,927.00	8.94
163	DAQO NEW ENERGY CORP	DQ	12,206,965.48	8.89
164	WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	688122	12,006,341.01	8.75
165	EC HEALTHCARE	02138	12,001,776.55	8.74
166	NIU TECHNOLOGIES	NIU	11,907,938.21	8.67

167	NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	688005	11,628,205.06	8.47
168	AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUSTRY GROUP CO LTD	000768	11,233,534.07	8.18
169	YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	002812	11,108,632.00	8.09
170	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	00914	11,038,499.74	8.04
171	ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	601636	10,986,731.00	8.00
172	SHANGHAI RUNDA MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	603108	10,950,809.34	7.98
173	SISRAM MEDICAL LTD	01696	10,814,397.54	7.88
174	YINGKOU JINCHEN MACHINERY CO LTD	603396	10,770,197.00	7.85
175	SHENZHEN MINKAVE TECHNOLOGY CO LTD	300506	10,726,238.50	7.81
176	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	02318	7,319,099.40	5.33
		601318	3,323,994.00	2.42
177	BANK OF NINGBO CO LTD	002142	10,554,466.00	7.69
178	ROBLOX CORP	RBLX	10,437,126.26	7.60
179	WILL SEMICONDUCTOR CO LTD SHANGHAI	603501	10,425,473.11	7.59
180	SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	601225	10,363,306.00	7.55
181	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	00960	10,351,136.53	7.54
182	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	01093	10,211,887.09	7.44
183	TONGLING JINGDA SPECIAL MAGNET WIRE CO LTD	600577	10,188,408.00	7.42
184	SHEDE SPIRITS CO LTD	600702	10,130,750.00	7.38
185	BEIJING BEI MO GAO KE FRICTION MATERIAL CO LTD	002985	10,126,146.50	7.38
186	MAOYAN	01896	10,091,936.23	7.35

	ENTERTAINMENT			
187	SHANGHAI KINDLY ENTERPRISE DEVELOPMENT GROUP CO LTD	603987	10,024,331.00	7.30
188	COFCO JOYCOME FOODS LTD	01610	9,911,488.81	7.22
189	LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	601012	9,852,126.00	7.18
190	WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	300142	9,839,868.00	7.17
191	JIANGSU TOLAND ALLOY CO LTD	300855	9,814,508.00	7.15
192	SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	300769	9,717,463.00	7.08
193	ASML HOLDING NV	ASML	9,256,031.18	6.74
194	SHENZHEN ENVICOOL TECHNOLOGY CO LTD	002837	8,915,196.50	6.49
195	HONGLI ZHIHUI GROUP CO LTD	300219	8,850,466.00	6.45
196	SINOCARE INC	300298	8,567,047.00	6.24
197	JIANGXI HONGDU AVIATION INDUSTRY CO LTD	600316	8,566,020.24	6.24
198	CHENGDU XGIMI TECHNOLOGY CO LTD	688696	8,352,517.15	6.08
199	CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	601888	8,214,721.86	5.98
200	MAN WAH HOLDINGS LTD	01999	8,171,961.53	5.95
201	LIANCHUANG ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	002036	8,094,970.00	5.90
202	JCHX MINING MANAGEMENT CO LTD	603979	8,036,325.00	5.85
203	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	01316	8,031,463.75	5.85
204	SHENZHEN SUNMOON MICROELECTRONICS CO LTD	688699	8,020,006.13	5.84
205	IAT AUTOMOBILE	300825	7,910,587.00	5.76

	TECHNOLOGY CO LTD			
206	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	601877	7,906,543.00	5.76
207	JUNEYAO AIRLINES CO LTD	603885	7,854,844.14	5.72
208	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	002129	7,829,780.00	5.70
209	SHANGHAI NENGHUI TECHNOLOGY CO LTD	301046	7,754,227.62	5.65
210	NINGBO LEHUI INTERNATIONAL ENGINEERING EQUIPMENT CO LTD	603076	7,710,713.00	5.62
211	ALPHAMAB ONCOLOGY	09966	7,704,302.57	5.61
212	JS GLOBAL LIFESTYLE CO LTD	01691	7,696,534.84	5.61
213	PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD	601666	7,605,716.00	5.54
214	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	600029	4,326,779.00	3.15
		01055	3,204,094.94	2.33
215	ZHEJIANG JIULI HI-TECH METALS CO LTD	002318	7,482,826.00	5.45
216	XINJIANG XINTAI NATURAL GAS CO LTD	603393	7,372,775.60	5.37
217	TIBET MINERAL DEVELOPMENT CO	000762	7,286,818.00	5.31
218	ANHUI HONGLU STEEL CONSTRUCTION GROUP CO LTD	002541	7,266,439.00	5.29
219	SHENZHEN LIANDE AUTOMATIC EQUIPMENT CO LTD	300545	7,155,497.00	5.21
220	NONGFU SPRING CO LTD	09633	7,038,811.51	5.13
221	JIZHONG ENERGY RESOURCES CO LTD	000937	6,907,590.64	5.03
222	ALPHABET INC	GOOGL	6,814,562.11	4.96
223	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	01918	6,797,518.23	4.95
224	HAIDILAO	06862	6,693,563.52	4.88

	INTERNATIONAL HOLDING LTD			
225	WALT DISNEY CO/THE	DIS	6,666,200.50	4.86
226	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	00909	6,601,192.07	4.81
227	NINGBO SOLARTRON TECHNOLOGY CO LTD	688299	6,573,559.89	4.79
228	CNNC HUA YUAN TITANIUM DIOXIDE CO LTD	002145	6,560,258.00	4.78
229	JIANGSU GOODWE POWER SUPPLY TECHNOLOGY CO LTD	688390	6,559,753.75	4.78
230	ARCTECH SOLAR HOLDING CO LTD	688408	6,493,105.28	4.73
231	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	002459	6,430,368.52	4.68
232	KUNSHAN GUOLI ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	688103	6,409,231.23	4.67
233	ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	600418	6,363,895.00	4.64
234	NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	601689	6,276,672.00	4.57
235	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	00968	6,193,808.65	4.51
236	CHONGQING SOKON INDUSTRY GROUP CO LTD	601127	6,058,669.00	4.41
237	AAG ENERGY HOLDINGS LTD	02686	6,018,409.14	4.38
238	LEVIMA ADVANCED MATERIALS CORP	003022	5,959,269.21	4.34
239	SHENZHEN LONGLI TECHNOLOGY CO LTD	300752	5,933,400.60	4.32
240	HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	603260	5,779,910.00	4.21
241	SICHUAN SWELLFUN CO LTD	600779	5,750,058.00	4.19
242	SHENZHEN HONOR ELECTRONIC CO LTD	300870	5,746,119.00	4.19
243	GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	002311	5,723,299.44	4.17

244	TIBET URBAN DEVELOPMENT AND INVESTMENT CO LTD	600773	5,660,139.00	4.12
245	RISEN ENERGY CO LTD	300118	5,617,678.80	4.09
246	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	002078	5,613,578.80	4.09
247	JIANGXI JOVO ENERGY CO LTD	605090	5,548,516.02	4.04
248	CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	601117	5,522,499.00	4.02
249	HUBEI DINGLONG CO LTD	300054	5,518,721.00	4.02
250	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	600660	3,916,525.00	2.85
		03606	1,572,310.90	1.15
251	CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	06169	5,450,398.35	3.97
252	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	300015	5,426,519.05	3.95
253	CHINA MERCHANTS PROPERTY OPERATION & SERVICE CO LTD	001914	5,323,299.75	3.88
254	SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	300274	5,280,673.00	3.85
255	CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	300122	5,216,462.00	3.80
256	JIANGSU SIDIKE NEW MATERIAL SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	300806	5,145,990.00	3.75
257	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	03800	5,033,415.61	3.67
258	BAIDU INC	BIDU	4,997,986.29	3.64
259	JIANGSU YUXING FILM TECHNOLOGY CO LTD	300305	4,940,165.00	3.60
260	CHENGDU WINTRUE HOLDING CO LTD	002539	4,864,688.00	3.54
261	CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	601799	4,823,603.13	3.51
262	HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY	002415	4,739,960.00	3.45

	CO LTD			
263	POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	01658	4,670,093.89	3.40
264	TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	603712	4,626,910.00	3.37
265	GUANGHUI ENERGY CO LTD	600256	4,560,032.00	3.32
266	JIANGSU ASIA-PACIFIC LIGHT ALLOY TECHNOLOGY CO LTD	002540	4,549,562.73	3.31
267	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	600352	4,542,793.00	3.31
268	POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	09992	4,522,660.67	3.29
269	SHENZHEN TONGYI INDUSTRY CO LTD	300538	4,464,379.00	3.25
270	ZHEJIANG SOUTHEAST SPACE FRAME CO LTD	002135	4,430,804.00	3.23
271	AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	000738	4,424,077.15	3.22
272	VOBILE GROUP LTD	03738	4,422,426.81	3.22
273	TRIP.COM GROUP LTD	TCOM	4,410,126.18	3.21
274	GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	000651	4,314,014.00	3.14
275	NANJING VISHEE MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	688580	4,291,576.56	3.13
276	ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	002602	4,210,059.08	3.07
277	ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS CORP LTD	300726	4,186,179.00	3.05
278	BEIJING YUPONT ELECTRIC POWER TECHNOLOGY CO LTD	688597	4,149,058.15	3.02
279	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	00881	4,144,074.95	3.02
280	FUJIAN AONONG BIOLOGICAL	603363	4,128,001.20	3.01

	TECHNOLOGY GROUP INC LTD			
281	XIANHE CO LTD	603733	4,123,294.94	3.00
282	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	000725	4,059,145.00	2.96
283	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	03908	4,049,015.18	2.95
284	NETFLIX INC	NFLX	3,861,930.17	2.81
285	SHANYING INTERNATIONAL HOLDING CO LTD	600567	3,648,815.00	2.66
286	NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	603606	3,528,641.00	2.57
287	TRINA SOLAR CO LTD	688599	3,511,859.96	2.56
288	XINYANGFENG AGRICULTURAL TECHNOLOGY CO LTD	000902	3,503,228.00	2.55
289	YGSOFT INC	002063	3,458,888.08	2.52
290	HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	600027	2,786,864.00	2.03
		01071	618,830.90	0.45
291	MINISO GROUP HOLDING LTD	MNSO	3,329,753.39	2.43
292	CHINA GLASS HOLDINGS LTD	03300	3,315,134.48	2.42
293	CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT LTD	02380	3,303,578.90	2.41
294	SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	300751	3,274,563.60	2.39
295	CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	02039	3,222,589.60	2.35
296	CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	01088	3,194,639.98	2.33
297	BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	688111	3,113,916.80	2.27
298	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	00817	3,086,985.93	2.25
299	JIANGYIN HENGRUN HEAVY INDUSTRIES CO	603985	3,035,905.00	2.21

	LTD			
300	BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	600019	3,009,523.00	2.19
301	NANTONG JIANGHAI CAPACITOR CO LTD	002484	2,969,107.00	2.16
302	JIANGXI HONGCHENG ENVIRONMENT CO LTD	600461	2,968,906.00	2.16
303	SUZHOU RECODEAL INTERCONNECT SYSTEM CO LTD	688800	2,963,704.16	2.16
304	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	300207	2,961,001.00	2.16
305	CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	600111	2,853,335.00	2.08
306	CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	01268	2,836,991.16	2.07
307	SUNRESIN NEW MATERIALS CO LTD	300487	2,835,846.00	2.07
308	XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL CO LTD	002092	2,831,928.00	2.06
309	JOYY INC	YY	2,812,540.07	2.05
310	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	603288	2,789,779.40	2.03
311	HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	605358	2,758,312.00	2.01
312	EXCELLENCE COMMERCIAL PROPERTY & FACILITIES MANAGEMENT GROUP LTD	06989	2,750,397.68	2.00

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。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	300750	195,956,058.04	142.75
2	GANFENG LITHIUM CO LTD	01772	112,991,256.00	82.31

		002460	65,527,948.79	47.74
3	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	165,194,764.72	120.34
4	MEITUAN	03690	144,771,218.03	105.47
5	BYD CO LTD	01211	95,166,255.75	69.33
		002594	20,164,249.37	14.69
6	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	02899	68,388,958.47	49.82
		601899	36,944,882.00	26.91
7	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	603799	92,418,893.66	67.33
8	XIAOMI CORP	01810	91,460,855.63	66.63
9	JIANGSU CNANO TECHNOLOGY CO LTD	688116	77,381,897.24	56.37
10	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	02382	74,337,755.91	54.16
11	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	02196	59,043,308.02	43.01
		600196	15,289,530.00	11.14
12	LUOYANG GLASS CO LTD	01108	40,208,933.66	29.29
		600876	25,651,853.38	18.69
13	WEIMOB INC	02013	65,508,784.72	47.72
14	TIANQI LITHIUM CORP	002466	64,339,889.00	46.87
15	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	06098	63,462,322.45	46.23
16	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	02020	61,386,010.94	44.72
17	JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	000301	59,409,711.65	43.28
18	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	00388	57,689,609.33	42.03
19	XINTE ENERGY CO LTD	01799	56,460,606.37	41.13
20	WUXI APTEC CO LTD	02359	40,992,170.07	29.86
		603259	15,030,032.71	10.95
21	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONAL CORP	00981	32,063,488.15	23.36
		688981	22,861,723.04	16.65
22	BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	00285	52,498,546.68	38.25
23	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	01209	51,808,579.84	37.74
24	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	01919	41,725,227.11	30.40
		601919	10,067,866.00	7.33
25	FUTU HOLDINGS LTD	FUTU	50,593,276.99	36.86
26	PINDUODUO INC	PDD	49,770,504.74	36.26
27	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	01378	49,584,774.30	36.12
28	BILIBILI INC	BILI	45,415,126.39	33.08
		09626	1,750,084.91	1.27
29	SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	06969	46,901,128.67	34.17
30	CHINA MOLYBDENUM CO LTD	03993	28,441,777.38	20.72
		603993	18,375,693.00	13.39
31	TESLA INC	TSLA	46,346,116.92	33.76
32	SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	01516	46,096,886.84	33.58

33	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	06078	45,576,497.74	33.20
34	SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	300724	43,872,061.58	31.96
35	CNOOC LTD	00883	42,877,461.74	31.24
36	APPLE INC	AAPL	42,817,984.82	31.19
37	NIO INC	NIO	41,794,056.60	30.45
38	KWEICHOW MOUTAI CO LTD	600519	40,045,615.53	29.17
39	SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TECHNOLOGY CO LTD	300390	40,026,163.48	29.16
40	WULIANGYE YIBIN CO LTD	000858	39,184,357.78	28.55
41	LECRON INDUSTRIAL DEVELOPMENT GROUP CO LTD	300343	38,516,123.40	28.06
42	WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	603185	37,882,437.80	27.60
43	AECC AVIATION POWER CO LTD	600893	37,207,146.48	27.11
44	LI NING CO LTD	02331	35,526,237.15	25.88
45	SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	01385	34,896,124.91	25.42
46	TONGWEI CO LTD	600438	34,869,096.00	25.40
47	JINKE SMART SERVICES GROUP CO LTD	09666	34,840,405.41	25.38
48	NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	605117	34,147,230.00	24.88
49	CHINA MOBILE LTD	00941	33,797,914.35	24.62
50	QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	000792	33,788,035.50	24.61
51	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	002475	33,722,559.70	24.57
52	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	00175	33,589,950.66	24.47
53	NINGBO BOWAY ALLOY MATERIAL CO LTD	601137	33,090,504.63	24.11
54	S-ENJOY SERVICE GROUP CO LTD	01755	32,992,492.41	24.04
55	POLY PROPERTY SERVICES CO LTD	06049	32,849,271.26	23.93
56	KUAISHOU TECHNOLOGY	01024	32,577,654.31	23.73
57	RONGSHENG PETROCHEMICAL CO LTD	002493	32,376,792.22	23.59
58	FUSHUN SPECIAL STEEL CO LTD	600399	32,017,402.48	23.32
59	AOYUAN BEAUTY VALLEY TECHNOLOGY CO LTD	000615	31,595,110.96	23.02
60	AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD	600760	31,477,795.83	22.93
61	CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	00291	31,105,761.23	22.66
62	CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	01995	30,701,803.74	22.37
63	JD.COM INC	JD	18,741,539.32	13.65
		09618	11,841,415.77	8.63
64	YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	002756	29,621,054.72	21.58
65	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	01478	29,442,616.05	21.45
66	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	BABA	26,825,864.63	19.54
		09988	2,349,676.27	1.71
67	FLAT GLASS GROUP CO LTD	06865	25,740,465.59	18.75

		601865	3,305,675.08	2.41
68	BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	688169	28,945,739.43	21.09
69	MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	300782	28,822,690.57	21.00
70	YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	300957	28,732,945.22	20.93
71	RLX TECHNOLOGY INC	RLX	28,002,336.36	20.40
72	SHANGHAI HIUV NEW MATERIALS CO LTD	688680	27,956,317.76	20.37
73	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	00316	27,797,928.37	20.25
74	ZHEJIANG YONGTAI TECHNOLOGY CO LTD	002326	27,463,597.86	20.01
75	KINTOR PHARMACEUTICAL LTD	09939	27,369,948.05	19.94
76	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	00354	27,280,419.77	19.87
77	CHENGDU RML TECHNOLOGY CO LTD	301050	26,856,987.51	19.57
78	ALBEMARLE CORP	ALB	26,815,817.22	19.54
79	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	603806	26,787,066.80	19.51
80	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	03323	26,711,641.64	19.46
81	KINGSOFT CORP LTD	03888	26,594,285.93	19.37
82	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	02313	26,573,271.24	19.36
83	HUAZHU GROUP LTD	HTHT	26,448,196.73	19.27
84	KINGBOARD LAMINATES HOLDINGS LTD	01888	25,998,619.77	18.94
85	GOERTEK INC	002241	25,467,537.35	18.55
86	JINKOSOLAR HOLDING CO LTD	JKS	25,439,254.51	18.53
87	ANHUI XINBO ALUMINUM CO LTD	003038	25,278,744.19	18.42
88	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	02601	22,030,157.31	16.05
		601601	3,226,065.00	2.35
89	NVIDIA CORP	NVDA	25,210,575.11	18.37
90	LI AUTO INC	LI	25,000,066.17	18.21
91	IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	300896	24,934,949.54	18.17
92	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	002240	24,770,389.00	18.05
93	JIUGUI LIQUOR CO LTD	000799	23,976,423.00	17.47
94	MIANYANG FULIN PRECISION CO LTD	300432	23,724,112.38	17.28
95	FUJIAN YONGFU POWER ENGINEERING CO LTD	300712	23,531,437.00	17.14
96	GREAT WALL MOTOR CO LTD	02333	20,409,919.67	14.87
		601633	3,106,774.00	2.26
97	GF SECURITIES CO LTD	01776	13,749,161.70	10.02
		000776	9,483,551.65	6.91
98	NETEASE INC	09999	20,095,643.77	14.64
		NTES	3,032,127.52	2.21
99	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	01171	21,153,425.46	15.41
		600188	1,604,089.00	1.17

100	NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	600989	22,471,080.95	16.37
101	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	02600	17,265,345.36	12.58
		601600	4,990,037.32	3.64
102	LUZHOU LAOJIAO CO LTD	000568	22,115,525.66	16.11
103	CATHAY MEDIA AND EDUCATION GROUP INC	01981	21,457,114.07	15.63
104	WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	300450	21,449,581.66	15.63
105	MICROSOFT CORP	MSFT	21,236,250.65	15.47
106	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	01951	21,128,385.01	15.39
107	NATIONS TECHNOLOGIES INC	300077	20,800,128.00	15.15
108	REMEGEN CO LTD	09995	20,525,881.35	14.95
109	EAST MONEY INFORMATION CO LTD	300059	20,226,646.00	14.74
110	HAIER SMART HOME CO LTD	06690	20,212,765.63	14.72
111	ZHEJIANG SHUANGHUAN DRIVELINE CO LTD	002472	20,076,127.94	14.63
112	LONG YUAN CONSTRUCTION GROUP CO LTD	600491	19,852,786.24	14.46
113	KE HOLDINGS INC	BEKE	19,634,952.99	14.30
114	SHANDONG CHENMING PAPER HOLDINGS LTD	01812	19,404,584.05	14.14
115	HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	600346	19,290,998.40	14.05
116	SHENZHEN FINE MADE ELECTRONICS GROUP CO LTD	300671	19,256,282.00	14.03
117	NAYUKI HOLDINGS LTD	02150	19,083,714.99	13.90
118	AGRIFY CORP	AGFY	18,423,357.71	13.42
119	AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	002938	18,259,110.00	13.30
120	EDVANTAGE GROUP HOLDINGS LTD	00382	18,245,895.20	13.29
121	CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	000625	18,019,596.00	13.13
122	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	03898	17,481,108.70	12.73
		688187	410,241.04	0.30
123	CHINA RESOURCES LAND LTD	01109	17,788,985.67	12.96
124	RED AVENUE NEW MATERIALS GROUP CO LTD	603650	17,776,880.05	12.95
125	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	01347	17,679,596.52	12.88
126	META PLATFORMS INC	FB	17,115,463.53	12.47
127	FRONTAGE HOLDINGS CORP	01521	16,939,902.54	12.34
128	EVE ENERGY CO LTD	300014	16,937,468.84	12.34
129	CHENGTUN MINING GROUP CO LTD	600711	16,831,224.00	12.26
130	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	02269	16,826,861.22	12.26
131	FUJIAN TORCH ELECTRON TECHNOLOGY CO LTD	603678	16,269,889.87	11.85
132	SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	002497	15,938,304.78	11.61
133	XI'AN TRIANGLE DEFENSE CO LTD	300775	15,634,087.50	11.39
134	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	00939	15,571,909.83	11.34

135	TAL EDUCATION GROUP	TAL	15,356,664.78	11.19
136	JIANGSU AKCOME SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	002610	15,294,774.00	11.14
137	BEIJING TIANYISHANGJIA NEW MATERIAL CORP LTD	688033	15,198,880.44	11.07
138	BEIJING HEZONG SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	300477	15,185,172.00	11.06
139	DONGYUE GROUP LTD	00189	15,108,648.89	11.01
140	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	00268	14,320,542.15	10.43
141	CHINA NONFERROUS MINING CORP LTD	01258	14,229,661.74	10.37
142	SHANXI COKING COAL ENERGY GROUP CO LTD	000983	14,212,857.48	10.35
143	MICROPORT CARDIOFLOW MEDTECH CORP	02160	14,031,926.13	10.22
144	SANGFOR TECHNOLOGIES INC	300454	14,019,491.00	10.21
145	WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	600745	13,537,720.00	9.86
146	HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	000933	13,491,312.00	9.83
147	YOUZU INTERACTIVE CO LTD	002174	13,470,523.59	9.81
148	SISRAM MEDICAL LTD	01696	13,386,681.19	9.75
149	SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	603659	13,334,878.40	9.71
150	SHANDONG SHIDA SHENGHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	603026	13,316,572.00	9.70
151	QINGDAO SENTURY TIRE CO LTD	002984	13,298,607.28	9.69
152	GOLDEN SOLAR NEW ENERGY TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	01121	13,270,901.34	9.67
153	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	03968	8,161,187.60	5.95
		600036	4,934,550.00	3.59
154	PING AN BANK CO LTD	000001	13,089,331.00	9.54
155	MOON ENVIRONMENT TECHNOLOGY CO LTD	000811	13,024,340.83	9.49
156	SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	300601	12,795,114.00	9.32
157	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	00762	12,741,122.19	9.28
158	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	TSM	12,586,374.34	9.17
159	BEIJING YUANLIU HONGYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	603267	12,454,523.60	9.07
160	DAQO NEW ENERGY CORP	DQ	12,366,156.97	9.01
161	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	02318	7,629,728.50	5.56
		601318	4,230,906.00	3.08
162	LITHIUM AMERICAS CORP	LAC	11,845,844.37	8.63
163	WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	688122	11,670,571.88	8.50

164	EC HEALTHCARE	02138	11,617,952.85	8.46
165	CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	601888	11,532,135.00	8.40
166	BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	002385	11,472,060.00	8.36
167	NIU TECHNOLOGIES	NIU	11,438,622.36	8.33
168	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	00914	11,431,370.46	8.33
169	NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	688005	11,408,570.50	8.31
170	YINGKOU JINCHEN MACHINERY CO LTD	603396	11,062,739.00	8.06
171	SHANGHAI RUNDA MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	603108	10,973,263.00	7.99
172	ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	601636	10,848,649.00	7.90
173	WILL SEMICONDUCTOR CO LTD SHANGHAI	603501	10,794,298.48	7.86
174	SHEDE SPIRITS CO LTD	600702	10,663,782.00	7.77
175	AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUSTRY GROUP CO LTD	000768	10,611,845.36	7.73
176	SHENZHEN MINKAVE TECHNOLOGY CO LTD	300506	10,302,277.94	7.51
177	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	00960	10,229,640.75	7.45
178	TONGLING JINGDA SPECIAL MAGNET WIRE CO LTD	600577	10,126,351.00	7.38
179	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	01093	10,111,161.58	7.37
180	CHENGDU XGIMI TECHNOLOGY CO LTD	688696	10,062,159.95	7.33
181	BEIJING BEI MO GAO KE FRICTION MATERIAL CO LTD	002985	10,036,363.60	7.31
182	SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	601225	9,885,639.00	7.20
183	BANK OF NINGBO CO LTD	002142	9,797,635.94	7.14
184	ROBLOX CORP	RBLX	9,711,428.13	7.07
185	HONGLI ZHIHUI GROUP CO LTD	300219	9,300,620.00	6.78
186	WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	300142	9,122,875.00	6.65
187	MAOYAN ENTERTAINMENT	01896	8,834,041.70	6.44
188	NONGFU SPRING CO LTD	09633	8,777,858.39	6.39
189	SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	300769	8,771,234.60	6.39
190	SHENZHEN ENVICOOL TECHNOLOGY CO LTD	002837	8,761,410.00	6.38
191	SHENZHEN SUNMOON MICROELECTRONICS CO LTD	688699	8,739,932.62	6.37
192	SHANGHAI KINDLY ENTERPRISE DEVELOPMENT GROUP CO LTD	603987	8,684,423.00	6.33
193	LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	601012	8,575,850.00	6.25
194	LIANCHUANG ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	002036	8,368,611.25	6.10
195	PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD	601666	8,228,080.00	5.99

196	MAN WAH HOLDINGS LTD	01999	8,097,330.41	5.90
197	JIANGXI HONGDU AVIATION INDUSTRY CO LTD	600316	8,073,418.00	5.88
198	JUNEYAO AIRLINES CO LTD	603885	7,907,881.40	5.76
199	SINOCARE INC	300298	7,904,120.94	5.76
200	COFCO JOYCOME FOODS LTD	01610	7,873,912.27	5.74
201	IAT AUTOMOBILE TECHNOLOGY CO LTD	300825	7,825,501.00	5.70
202	JCHX MINING MANAGEMENT CO LTD	603979	7,822,187.23	5.70
203	ZHEJIANG JIULI HI-TECH METALS CO LTD	002318	7,373,728.00	5.37
204	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	002129	7,304,012.00	5.32
205	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	01316	7,302,299.14	5.32
206	TIBET MINERAL DEVELOPMENT CO	000762	7,281,167.00	5.30
207	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	601877	7,257,364.00	5.29
208	XPENG INC	XPEV	4,543,984.81	3.31
		09868	2,707,636.32	1.97
209	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	600029	4,130,924.00	3.01
		01055	3,099,629.73	2.26
210	NINGBO LEHUI INTERNATIONAL ENGINEERING EQUIPMENT CO LTD	603076	7,192,076.00	5.24
211	ALPHAMAB ONCOLOGY	09966	7,174,790.21	5.23
212	JS GLOBAL LIFESTYLE CO LTD	01691	6,906,745.75	5.03
213	SHANGHAI NENGHUI TECHNOLOGY CO LTD	301046	6,760,873.22	4.93
214	SHENZHEN LIANDE AUTOMATIC EQUIPMENT CO LTD	300545	6,720,566.00	4.90
215	LEVIMA ADVANCED MATERIALS CORP	003022	6,705,816.50	4.89
216	CNNC HUA YUAN TITANIUM DIOXIDE CO LTD	002145	6,637,093.00	4.84
217	XINJIANG XINTAI NATURAL GAS CO LTD	603393	6,498,509.71	4.73
218	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	01918	6,492,332.99	4.73
219	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	00909	6,472,960.95	4.72
220	JIANGSU GOODWE POWER SUPPLY TECHNOLOGY CO LTD	688390	6,443,502.35	4.69
221	POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	09992	6,418,389.98	4.68
222	WALT DISNEY CO/THE	DIS	6,367,656.62	4.64
223	KUNSHAN GUOLI ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	688103	6,343,947.00	4.62
224	JIZHONG ENERGY RESOURCES CO LTD	000937	6,330,098.00	4.61
225	ARCTECH SOLAR HOLDING CO LTD	688408	6,271,610.53	4.57
226	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	002459	6,259,578.16	4.56
227	HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	06862	6,212,529.52	4.53
228	NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	601689	6,116,530.00	4.46
229	ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	600418	6,071,393.00	4.42

230	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	603986	5,894,970.05	4.29
231	SHENZHEN LONGLI TECHNOLOGY CO LTD	300752	5,854,051.98	4.26
232	JIANGSU YUXING FILM TECHNOLOGY CO LTD	300305	5,731,798.00	4.18
233	HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	603260	5,662,335.00	4.13
234	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	00968	5,616,211.27	4.09
235	CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	06169	5,612,766.54	4.09
236	AAG ENERGY HOLDINGS LTD	02686	5,601,489.24	4.08
237	GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	002311	5,589,244.44	4.07
238	SHENZHEN HONOR ELECTRONIC CO LTD	300870	5,498,966.00	4.01
239	TIBET URBAN DEVELOPMENT AND INVESTMENT CO LTD	600773	5,410,048.45	3.94
240	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	002078	5,378,345.00	3.92
241	JIANGXI JOVO ENERGY CO LTD	605090	5,338,385.82	3.89
242	RISEN ENERGY CO LTD	300118	5,306,697.00	3.87
243	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	600660	3,740,605.00	2.73
		03606	1,539,974.12	1.12
244	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	300015	5,233,393.02	3.81
245	CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	300122	5,110,254.00	3.72
246	BAIDU INC	BIDU	5,066,345.62	3.69
247	SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	300274	4,990,347.00	3.64
248	SICHUAN SWELLFUN CO LTD	600779	4,948,762.00	3.61
249	CHINA MERCHANTS PROPERTY OPERATION & SERVICE CO LTD	001914	4,774,306.00	3.48
250	CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	601799	4,755,655.00	3.46
251	NINGBO SOLARTRON TECHNOLOGY CO LTD	688299	4,754,237.48	3.46
252	HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	002415	4,721,547.00	3.44
253	JIANGSU SIDIKE NEW MATERIAL SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	300806	4,654,416.00	3.39
254	POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	01658	4,571,187.02	3.33
255	SHENZHEN TONGYI INDUSTRY CO LTD	300538	4,458,569.00	3.25
256	CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	601117	4,424,331.00	3.22
257	VOBILE GROUP LTD	03738	4,365,133.85	3.18
258	JIANGSU ASIA-PACIFIC LIGHT ALLOY TECHNOLOGY CO LTD	002540	4,350,606.00	3.17
259	ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS CORP LTD	300726	4,296,729.00	3.13
260	TRIP.COM GROUP LTD	TCOM	4,217,847.57	3.07
261	NANJING VISHEE MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	688580	4,192,148.54	3.05
262	CHENGDU WINTRUE HOLDING CO LTD	002539	4,150,813.64	3.02

263	GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	000651	4,140,708.00	3.02
264	CHONGQING SOKON INDUSTRY GROUP CO LTD	601127	4,131,900.00	3.01
265	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	600352	4,120,559.00	3.00
266	GUANGHUI ENERGY CO LTD	600256	4,050,084.00	2.95
267	SHANYING INTERNATIONAL HOLDING CO LTD	600567	4,004,335.00	2.92
268	BEIJING YUPONT ELECTRIC POWER TECHNOLOGY CO LTD	688597	3,985,429.55	2.90
269	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	00881	3,981,999.27	2.90
270	XIANHE CO LTD	603733	3,954,701.44	2.88
271	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	000725	3,854,771.86	2.81
272	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	03908	3,824,439.69	2.79
273	NETFLIX INC	NFLX	3,615,753.88	2.63
274	TRINA SOLAR CO LTD	688599	3,608,166.29	2.63
275	ZTE CORP	000063	3,491,580.91	2.54
276	ASML HOLDING NV	ASML	3,484,161.46	2.54
277	JOYY INC	YY	3,444,242.55	2.51
278	HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	600027	2,781,073.00	2.03
		01071	574,313.24	0.42
279	CHINA JUSHI CO LTD	600176	3,317,862.00	2.42
280	YGSOFT INC	002063	3,301,962.72	2.41
281	SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	300751	3,289,818.00	2.40
282	BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	688111	3,266,452.51	2.38
283	MINISO GROUP HOLDING LTD	MNSO	3,222,201.19	2.35
284	CHINA GLASS HOLDINGS LTD	03300	3,216,592.92	2.34
285	XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL CO LTD	002092	3,189,321.00	2.32
286	CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT LTD	02380	3,161,058.01	2.30
287	CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	01088	3,098,465.45	2.26
288	XINYANGFENG AGRICULTURAL TECHNOLOGY CO LTD	000902	3,073,772.00	2.24
289	CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	02039	2,996,511.43	2.18
290	HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	605358	2,955,164.00	2.15
291	SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	300760	2,918,694.78	2.13
292	JIANGXI HONGCHENG ENVIRONMENT CO LTD	600461	2,893,346.00	2.11
293	BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	600019	2,861,287.00	2.08
294	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	00817	2,806,095.00	2.04
295	CHINA FEIHE LTD	06186	2,802,943.68	2.04
296	ANHUI HONGLU STEEL CONSTRUCTION	002541	2,787,865.00	2.03

	GROUP CO LTD			
--	--------------	--	--	--

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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	6,799,303,061.94
卖出收入（成交）总额	6,574,878,126.53

注：“买入成本”、“卖出收入”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。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

8.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 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	319,805.86
2	应收证券清算款	122,621.80
3	应收股利	3,956.57
4	应收利息	5,044.14
5	应收申购款	546,887.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	998,316.00
---	----	------------

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
61,170	2,728.14	4,277,219.55	2.56%	162,602,883.72	97.44%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	903,943.46	0.54%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 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	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年5月30日)基金份额总额	471,400,177.64
本报告期期初基金份额总额	63,392,190.97
本报告期基金总申购份额	565,055,325.91
减：本报告期基金总赎回份额	461,567,413.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	166,880,103.27

§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，本基金无基金份额持有人大会决议。

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

本基金管理人于 2021 年 4 月 9 日发布公告，郑煜女士、孙彬先生担任华夏基金管理有限公司副总经理，蔡向阳先生担任华夏基金管理有限公司高级管理人员。

本基金管理人于 2021 年 11 月 2 日发布公告，蔡向阳先生不再担任华夏基金管理有限公司高级管理人员。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）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公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 70,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 4 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无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	
BOCI SECURITIES	-	11,035,283.49	0.08%	16,552.94	0.16%	-
CHINA	-	205,955,035.11	1.54%	162,539.07	1.61%	-

MERCHANTS SECURITIES						
CHINA RENAISSANC E	-	201,460,041.90	1.51%	158,896.08	1.58%	-
CICC	-	1,260,054,360.18	9.43%	928,659.11	9.22%	-
CLSA LIMITED	-	26,217,239.60	0.20%	22,478.74	0.22%	-
CMB INTERNATIO NAL CAPITAL	-	704,521,990.37	5.27%	845,426.41	8.39%	-
CREDIT SUISSE	-	393,828,275.14	2.95%	173,851.58	1.73%	-
FIRST SHANGHAI SECURITIES	-	61,803,245.32	0.46%	74,163.92	0.74%	-
GOLDMAN SACHS	-	171,665,089.89	1.28%	108,209.89	1.07%	-
HAITONG INTERNATIO NAL SECURITIES	-	341,721,534.78	2.56%	283,019.96	2.81%	-
J.P.MORGAN	-	925,863,599.11	6.93%	651,041.66	6.46%	-
JEFFERIES	-	420,705,489.77	3.15%	156,949.24	1.56%	-
MIZUHO	-	248,570,064.80	1.86%	194,715.34	1.93%	-
长江证券	1	169,194,091.75	1.27%	123,731.00	1.23%	-
东北证券	1	86,644,993.54	0.65%	63,362.27	0.63%	-
国金证券	4	1,553,214,761.15	11.62%	1,160,161.46	11.51%	-
国泰君安证券	2	105,805,213.60	0.79%	77,375.36	0.77%	-
华安证券	1	192,229,188.09	1.44%	140,577.14	1.40%	-
新时代证券	1	283,672,683.53	2.12%	217,398.66	2.16%	-
兴业证券	1	127,243,662.54	0.95%	93,053.40	0.92%	-
中泰证券	2	1,326,226,218.23	9.92%	1,006,626.28	9.99%	-
中信建投证券	4	338,322,405.55	2.53%	254,583.90	2.53%	-
中信证券	12	4,213,072,415.94	31.51%	3,162,200.63	31.38%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究

报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了东方证券、方正证券、广发证券、国盛证券、上海证券、信达证券、粤开证券、招商证券、中国银河证券、中金公司、中投证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，国泰君安证券、中信证券的部分交易单元、广发证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，国金证券的部分交易单元为本期剔除的交易单元。

⑤此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易，佣金指基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。

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		回购交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
BOCI SECURITIES	-	-	-	-	-	-
CHINA MERCHANTS SECURITIES	-	-	-	-	-	-
CHINA RENAISSANCE	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-
CLSA LIMITED	-	-	-	-	-	-
CMB INTERNATIONAL CAPITAL	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-
FIRST	-	-	-	-	-	-

SHANGHAI SECURITIES						
GOLDMAN SACHS	-	-	-	-	-	-
HAITONG INTERNATIONAL SECURITIES	-	-	-	-	-	-
J.P.MORGAN	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES	-	-	-	-	-	-
MIZUHO	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-09
2	华夏基金管理有限公司关于华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）在境外主要投资场所 2021 年节假日暂停申购、赎回、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-13
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
4	华夏基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-20
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-27
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-01
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-24
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会指定报刊及	2021-04-07

	关联方承销证券的公告	网站	
11	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
13	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21
14	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-08
15	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
16	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-13
17	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-19
18	华夏基金管理有限公司关于深圳分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-25
19	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28
20	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
21	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-05
22	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-09
23	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-17
24	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-03
25	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-14
26	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-07
27	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-14
28	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-13
29	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-15
30	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-22
31	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-02
32	华夏基金管理有限公司关于华夏新时代灵活	中国证监会指定报刊及	2021-11-04

	配置混合型证券投资基金（QDII）增加美元销售币种的公告	网站	
33	华夏基金管理有限公司关于修订华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-04
34	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-22
35	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-10

§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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 3、《华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日