

博道嘉瑞混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 31 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	65
8.1 期末基金资产组合情况	65
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	67
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	75
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	75
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	75
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	75
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	76

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	76
8.12 投资组合报告附注.....	76
§9 基金份额持有人信息.....	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	78
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.....	78
§10 开放式基金份额变动.....	78
§11 重大事件揭示.....	79
11.1 基金份额持有人大会决议.....	79
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.....	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
11.4 基金投资策略的改变.....	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
11.8 其他重大事件.....	80
§12 备查文件目录.....	83
12.1 备查文件目录.....	83
12.2 存放地点.....	84
12.3 查阅方式.....	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道嘉瑞混合型证券投资基金	
基金简称	博道嘉瑞混合	
基金主代码	008467	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年12月30日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,069,034,239.02份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道嘉瑞混合A	博道嘉瑞混合C
下属分级基金的交易代码	008467	008468
报告期末下属分级基金的份额总额	970,938,524.07份	98,095,714.95份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和投资管理，追求超越基金业绩比较基准的资本增值。
投资策略	充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，确定并动态调整大类资产的投资比例。通过宏观、中观和微观不同层面影响行业景气度和行业市场表现因素的综合分析，挑选出预期具有较好市场表现的行业，优选基本面因素良好、估值水平合理的上市公司构建股票组合。此外，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，本基金将优选基本面因素良好、估值水平合理的港股纳入本基金的股票投资组合。本基金债券投资策略主要包括久期管理策略、期限结构配置策略、类属配置策略、个券选择等积极的投资策略。本基金的可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货

	投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	沪深300指数收益率 $\times$ 55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 5%+中债综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

注：根据2021年10月27日发布的《博道基金管理有限公司关于博道嘉瑞混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》及2021年10月28日生效的《博道嘉瑞混合型证券投资基金基金合同》，本基金业绩比较基准由“沪深300指数收益率 $\times$ 60%+中债综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 40%”调整为“沪深300指数收益率 $\times$ 55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 5%+中债综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 40%”。

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		博道基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	张燕
	联系电话	021-80226288	0755-83199084
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-085-2888	95555
传真		021-80226289	0755-83195201
注册地址		上海市虹口区东大名路687号1幢262室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200122	518040
法定代表人		莫泰山	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
----------------	--------

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bdfund.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

2.5 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）	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
注册登记机构	博道基金管理有限公司	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

§ 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12月30日（基金合同生效日）-2019年12月31日	
	博道嘉瑞混合A	博道嘉瑞混合C	博道嘉瑞混合A	博道嘉瑞混合C	博道嘉瑞混合A	博道嘉瑞混合C
本期已实现收益	243,007,548.58	36,902,229.81	82,616,985.32	20,461,508.32	-24,912.39	-12,288.83
本期利润	174,686,236.88	36,373,222.82	254,975,167.48	52,892,787.73	-57,161.42	-25,548.47
加权平均基金份额本期利润	0.2331	0.3056	0.6445	0.5423	-0.0002	-0.0002
本期加权平均	12.05%	15.89%	49.02%	44.28%	-0.02%	-0.02%

净值利润率						
本期基金份额净值增长率	18.01%	17.42%	69.34%	68.48%	-0.02%	-0.02%
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	564,031,508.48	55,145,022.42	107,951,433.74	17,770,849.24	-57,161.42	-25,548.47
期末可供分配基金份额利润	0.5809	0.5622	0.2207	0.2138	-0.0002	-0.0002
期末基金资产净值	1,939,904,044.93	194,034,665.71	828,227,232.66	140,010,938.10	363,128,904.81	149,303,431.67
期末基金份额净值	1.9980	1.9780	1.6931	1.6845	0.9998	0.9998
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	99.80%	97.80%	69.31%	68.45%	-0.02%	-0.02%

注：

1、上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，计入费用后的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。

3.2 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

博道嘉瑞混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.12%	0.86%	0.77%	0.46%	-0.65%	0.40%
过去六个月	-0.01%	1.23%	-3.00%	0.60%	2.99%	0.63%
过去一年	18.01%	1.39%	-2.37%	0.69%	20.38%	0.70%
自基金合同 生效起至今	99.80%	1.42%	14.77%	0.77%	85.03%	0.65%

注：本基金的业绩比较基准请见“2.2 基金产品说明”，每日进行再平衡过程。

博道嘉瑞混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-0.01%	0.86%	0.77%	0.46%	-0.78%	0.40%
过去六个月	-0.27%	1.23%	-3.00%	0.60%	2.73%	0.63%
过去一年	17.42%	1.39%	-2.37%	0.69%	19.79%	0.70%
自基金合同 生效起至今	97.80%	1.42%	14.77%	0.77%	83.03%	0.65%

注：本基金的业绩比较基准请见“2.2 基金产品说明”，每日进行再平衡过程。

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

博道嘉瑞混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月30日-2021年12月31日)



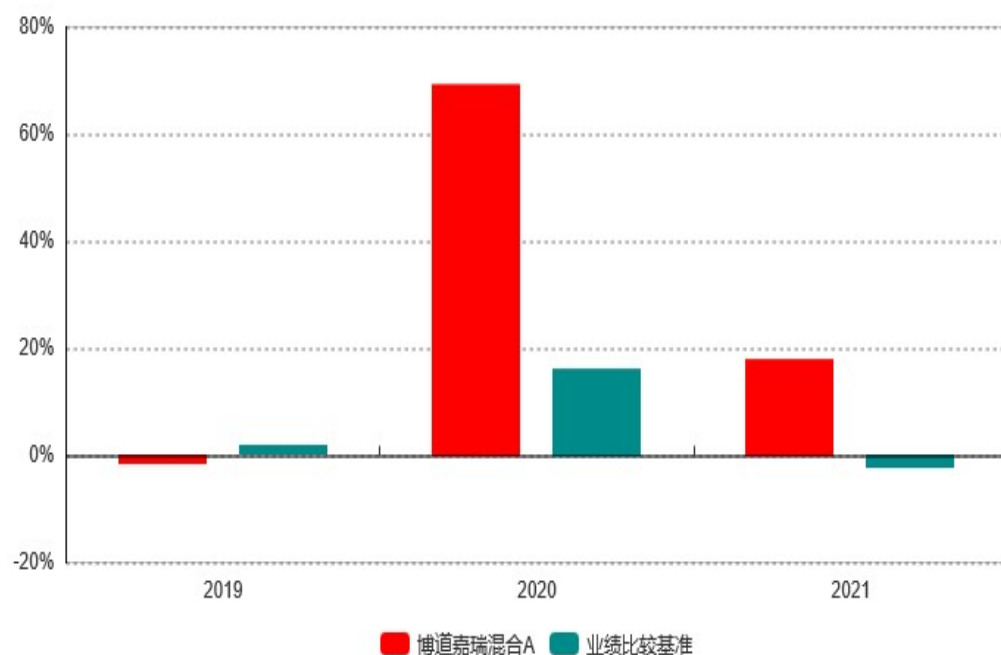
注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

博道嘉瑞混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月30日-2021年12月31日)

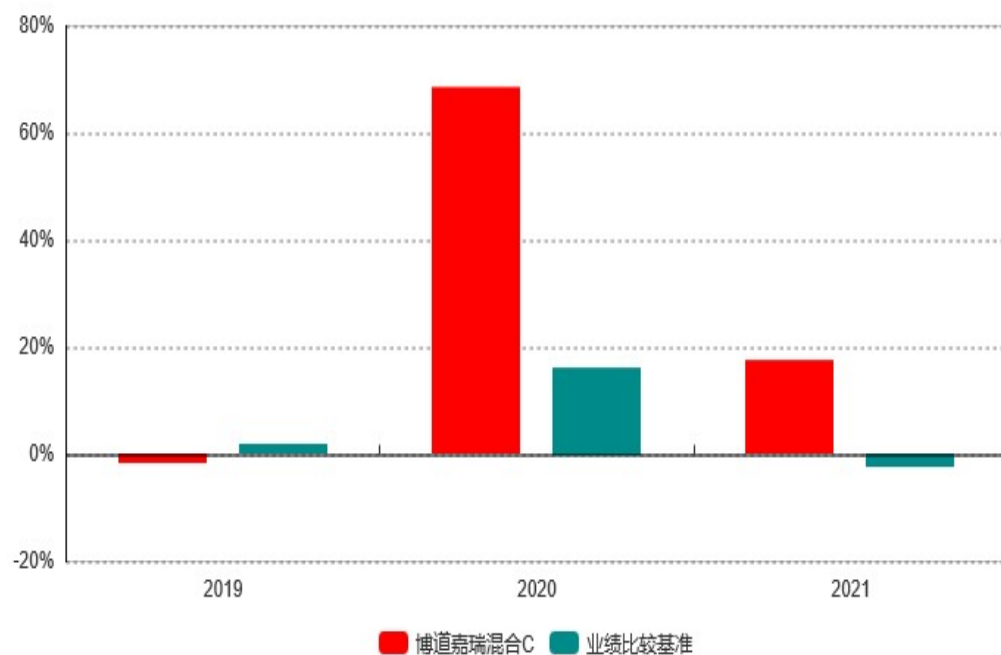


注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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



注：图示日期为 2019 年 12 月 30 日至 2021 年 12 月 31 日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。



注：图示日期为 2019 年 12 月 30 日至 2021 年 12 月 31 日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可[2017]822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了20只公募基金：博道启航混合型证券投资基金、博道卓远混合型证券投资基金、博道中证500指数增强型证券投资基金、博道沪深300指数增强型证券投资基金、博道远航混合型证券投资基金、博道叁佰智航股票型证券投资基金、博道志远混合型证券投资基金、博道伍佰智航股票型证券投资基金、博道嘉泰回报混合型证券投资基金、博道久航混合型证券投资基金、博道嘉瑞混合型证券投资基金、博道安远6个月定期开放混合型证券投资基金、博道嘉元混合型证券投资基金、博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金、博道睿见一年持有期混合型证券投资基金、博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉丰混合型证券投资基金、博道消费智航股票型证券投资基金、博道盛彦混合型证券投资基金和博道成长智航股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张迎军	博道嘉泰回报混合、博道嘉瑞混合、博道嘉元混合、博道嘉兴一年持有期混合、博道嘉丰混合的基金经理、研究总监兼基金投资部总经理	2019-12-30	-	21年	张迎军先生，中国籍，经济学硕士。2000年7月至2003年3月担任申银万国证券研究所市场研究部、策略研究部研究员，2003年4月至2006年11月担任中国

					太平洋保险（集团）股份有限公司资金运用管理中心投资经理，2006年12月至2008年5月担任太平洋资产管理有限公司组合管理部组合经理，2008年8月至2015年7月担任交银施罗德基金管理有限公司基金经理、固定收益部副总经理、权益部副总经理、投资副总监，2015年9月至2018年11月担任上海放山资产管理有限公司总经理。2019年5月加入博道基金管理有限公司，现任研究总监兼基金投资部总经理。具有基金从业资格。 自2019年12月19日起担任博道嘉泰回报混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年12月30日起担任博道嘉瑞混合型证券投资基金基金经理至今、自2020年3月4日起担任博道嘉元混合型证券投资基金基金经理至今、自2020年10月23日起担任博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金基金经理至今、自2021年2月1日起担任博道嘉丰混合型证券投资基金基金经理至今。
--	--	--	--	--	--

注：

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离职日期”分别指根

据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下所管理的所有资产组合投资运作的公平。旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。制度中包含的主要控制方法如下：

（1）公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

（2）公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

（3）公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益，保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

（4）公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

（5）公司交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各投资组合公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对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

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现违反公平交易制度的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生5次，经检查未发现异常；本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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，全球经济复苏叠加供应链约束，通胀受益资产整体表现较好，南华能化指数涨幅33.07%，股票中周期风格也显著跑赢，各大指数中，沪深300下跌5.20%，中证500上涨15.58%，创业板指上涨12.02%，恒生指数下跌14.08%。从行业板块来看，电力设备、新能源、基础化工、有色金属、煤炭、钢铁涨幅均超过40%，消费者服务、非银金融、家电跌幅较大。

本基金在构建组合的思路，坚持从长周期视角发现与判断社会经济发展过程中中长期趋势的确定性，从长周期视角选择业绩增长确定性相对较大的优质公司，自上而下根据行业的景气状况、竞争格局以及公司的综合竞争力来构建股票组合。2021年本基金维持超配的新能源汽车与光伏产业链、人工智能等相关公司获得了较高的超额收益，三季度阶段性减持医疗服务与CDMO/CRO等行业估值较高的相关公司也获得了较好的超额收益。四季度本基金股票组合中继续维持超配新能源汽车与光伏产业链相关公司，维持对人工智能、云计算、网络安全、CDMO/CRO、化工、造纸以及银行等相关行业配置比例，增持了造船、军工、半导体及部分涨价相关的上游资源品行业相关公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年，从经济基本面来看，2021年中国三季度GDP两年复合增速为4.9%，低于潜在增速水平。我们要相信经济增速的锚的作用，经济增长是围绕潜在经济增速波动

的。现阶段的经济实际增速低于潜在经济增速，未来某一个季度开始经济增速可能就会筑底回升，而股票市场会对这个趋势更为敏感。与此同时，货币政策和财政政策也有望逆周期调节，一定程度对冲经济下行，股票市场也将会对这种趋势变化做出积极反应。2021年下半年，部分民营房地产龙头公司爆发财务危机，意味着房地产行业高杠杆高周转的商业模式也将发生变化，房地产对中国经济增长贡献率预计会逐步降低。在疫情呈现长期化趋势的前提下，叠加收入预期及收入分配利益格局的调整，相较于过去十年，十四五期间消费对中国经济增长的贡献率可能难以再创新高。未来中国经济增长新的动力来自于哪里？我们认为，第一是出口，第二是企业自主的设备投资。2020、2021年出口屡超预期的背后支撑力是来自于中国制造在全球产业链中竞争力与地位的提升，而中国制造业全球竞争力的提升与企业自主的设备投资周期开启又相辅相成。因此，2021年开启的朱格拉周期受到政策扶持，在A股市场上所形成的制造业投资主线在2021年大放异彩，相信会继续会是未来的重要投资方向。展望未来A股市场的投资机会，有两个大的方向值得关注：一个是创新，美国的五大科技股（苹果、微软、亚马逊、谷歌、脸书）都是创新的代表，但是中国现阶段尚未达到完全依靠创新来推动经济；另一个是嫁接在传统产业上的绿色经济，它带有投资的属性，是现在看来能够成为拉动经济增长的重要抓手。现阶段来看，我们相信泛电力周期有望替代地产周期成为未来几年中国经济增长投资拉动的重要着力点，以绿色经济为特征的泛电力投资也将是未来股票投资的重要方向。

中国证券市场正在经历深刻变化。在共同富裕的政策目标下，中国证券市场的估值体系正在从以上市公司经营利润为核心转变为注重社会可持续发展为核心的定价模式，环境、社会责任、公司治理（ESG）等要素也都将纳入估值体系。靠垄断扭曲供求关系获得超额利润、损害消费者福利的商业模式难以维持。只有通过提高效率给消费者与社会福利增加的商业模式，才会持续创造长期社会价值，也才会受到政策的鼓励和支持。面对不断变化的市场，基金管理人只有顺应社会发展的大趋势，不断自我进阶，才能为投资人创造价值。

本基金管理人将继续坚持以合理价格买入优秀公司的运作思路，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021年度，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》等有关法规，本基金管理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化监察稽核职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）持续完善公司内部控制制度和业务流程，推动制度流程的及时更新。

公司持续以提升制度和业务流程的指导性和执行力为强化内部控制的重要抓手，以内部管理制度的全面修订和公司主要业务流程的梳理为工作重点。结合本报告期新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，贯彻落实新法规及新的监管要求。公司着重关注于公司的核心增值流程，通过对流程的研究、梳理、再造等过程实现管理上风险和回报的平衡。

（二）深化事前事中合规及风险管理，提高合规管理及风险控制有效性。

强化事前事中合规审查，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料等，着力防范各类合规风险。在风险管理方面，夯实事前防范、事中控制和事后监督等各阶段工作，重点加强对信用风险、流动性风险等风险的管理。

（三）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

公司监察稽核部坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察。通过对基金投资、销售、运营等部门的内部控制关键点进行定期和不定期检查，促进公司内部控制制度规范、执行有效，风险管理水平不断提升。

（四）强化培训教育，持续提高全员风险合规意识。

公司积极推动各项新法规落实和风险合规教育工作。通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由营运分管领导、督察长、基金事务部负责人、投委会主席、研究部负责人、投资运营部负责人、监察稽核部负责人及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的投资研究相关人员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司估值委员会审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第25100号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	博道嘉瑞混合型证券投资基金全体基金份额持

	有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了博道嘉瑞混合型证券投资基金(以下简称“博道嘉瑞混合基金”)的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年度的利润表和所有者权益(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,公允反映了博道嘉瑞混合基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则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,我们独立于博道嘉瑞混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	博道嘉瑞混合基金的基金管理人博道基金管理有限公司(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博道嘉瑞混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算博道嘉瑞混合基金、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博道嘉瑞混合基金的财务报告过程。
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，就可能导致对博道嘉瑞混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大

	不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博道嘉瑞混合基金不能持续经营。 (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。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	沈兆杰、朱容莹
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
审计报告日期	2021-03-25

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博道嘉瑞混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	21,577,560.58	14,348,250.56
结算备付金		1,009.51	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	7.4.7.2	1,998,766,349.22	906,206,459.81
其中：股票投资		1,672,382,453.45	736,733,246.24
基金投资		—	—

债券投资		326,383,895.77	169,473,213.57
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	115,000,000.00	50,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	2,041,625.16	1,189,041.19
应收股利		-	-
应收申购款		-	3,044,819.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,137,386,544.47	974,788,570.57
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		-	-
应付赎回款		-	5,033,422.07
应付管理人报酬		2,758,196.68	1,121,595.20
应付托管费		367,759.58	149,546.03
应付销售服务费		100,462.11	47,835.28
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		1,415.46	764.90
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	220,000.00	197,236.33

负债合计		3,447,833.83	6,550,399.81
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,069,034,239.02	572,306,312.04
未分配利润	7.4.7.10	1,064,904,471.62	395,931,858.72
所有者权益合计		2,133,938,710.64	968,238,170.76
负债和所有者权益总计		2,137,386,544.47	974,788,570.57

注：报告截止日2021年12月31日，A类基金份额净值1.9980元，C类基金份额净值1.9780元；基金份额总额1,069,034,239.02份，其中A类基金份额970,938,524.07份，C类基金份额98,095,714.95份。

7.2 利润表

会计主体：博道嘉瑞混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
一、收入		246,175,123.68	323,028,820.02
1. 利息收入		5,945,352.99	2,295,519.44
其中：存款利息收入	7.4.7.11	188,862.54	101,615.99
债券利息收入		2,775,708.71	1,244,550.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,980,781.74	949,353.45
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		305,224,098.79	113,933,906.01
其中：股票投资收益	7.4.7.12	245,776,483.07	106,669,252.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13.	51,797,144.08	4,801,916.79

	2		
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	7,650,471.64	2,462,736.83
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.16	-68,850,318.69	204,789,461.57
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.17	3,855,990.59	2,009,933.00
减：二、费用		35,115,663.98	15,160,864.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	25,071,101.24	9,520,036.17
2. 托管费	7.4.10.2. 2	3,342,813.51	1,269,338.11
3. 销售服务费		1,137,454.01	598,358.64
4. 交易费用	7.4.7.18	5,294,389.62	3,576,286.17
5. 利息支出		-	8,643.39
其中：卖出回购金融资产 支出		-	8,643.39
6. 税金及附加		1,706.22	1,004.86
7. 其他费用	7.4.7.19	268,199.38	187,197.47
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		211,059,459.70	307,867,955.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		211,059,459.70	307,867,955.21

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博道嘉瑞混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	572,306,312.04	395,931,858.72	968,238,170.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	211,059,459.70	211,059,459.70
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)	496,727,926.98	457,913,153.20	954,641,080.18
其中：1. 基金申购款	1,334,228,860.10	1,240,133,699.61	2,574,362,559.71
2. 基金赎回款	-837,500,933.12	-782,220,546.41	-1,619,721,479.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,069,034,239.02	1,064,904,471.62	2,133,938,710.64
项 目	上年度可比期间 2020年01月01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)	512,515,046.37	-82,709.89	512,432,336.48
二、本期经营活动	-	307,867,955.21	307,867,955.21

产生的基金净值变动数(本期利润)			
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)	59,791,265.67	88,146,613.40	147,937,879.07
其中：1. 基金申购款	664,036,022.05	253,623,647.70	917,659,669.75
2. 基金赎回款	-604,244,756.38	-165,477,034.30	-769,721,790.68
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)	572,306,312.04	395,931,858.72	968,238,170.76

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：

莫泰山

张丽

严娅

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博道嘉瑞混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2402号《关于准予博道嘉瑞混合型证券投资基金注册的批复》注册,由博道基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道嘉瑞混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币512,389,745.37元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0749号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博道嘉瑞混合型证券投资基金基金合同》于

2019年12月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为512,515,046.37份基金份额，其中认购资金利息折合125,301.00份基金份额。本基金的基金管理人为博道基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《博道嘉瑞混合型证券投资基金基金合同》和《博道嘉瑞混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道嘉瑞混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分））、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、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（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为35%-80%（其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率 $\times$ 55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 5%+中债综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 40%。

本财务报表由本基金的基金管理人博道基金管理有限公司于2022年3月25日批准报出。

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于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投

资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博道嘉瑞混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

本基金2021年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2021年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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(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。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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，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；对于支付的价款中包含的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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 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。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。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/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率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；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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。

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，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) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(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。

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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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《财政部国家税务总局证监会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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关

于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]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) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或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。基金通过沪港通或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。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通买卖、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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	2,149,343.67	3,462,557.33
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	19,428,216.91	10,885,693.23
合计	21,577,560.58	14,348,250.56

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		1,550,740,956.67	1,672,382,453.45	121,641,496.78
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	312,131,758.34	326,383,895.77	14,252,137.43
	银行间市场	-	-	-
	合计	312,131,758.34	326,383,895.77	14,252,137.43
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,862,872,715.01	1,998,766,349.22	135,893,634.21
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		560,036,931.04	736,733,246.24	176,696,315.20
贵金属投资-金交所黄		-	-	-

金合约				
债券	交易所市场	141,425,575.87	169,473,213.57	28,047,637.70
	银行间市场	-	-	-
	合计	141,425,575.87	169,473,213.57	28,047,637.70
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		701,462,506.91	906,206,459.81	204,743,952.90

注：如果本报告期末或上年度末本基金持有中国存托凭证，则股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	115,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	115,000,000.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	50,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	50,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	255.69	277.44
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	7,560.39	2,683.94
应收结算备付金利息	0.10	-
应收债券利息	2,089,741.78	1,193,999.81
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-55,932.80	-7,920.00
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	2,041,625.16	1,189,041.19

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

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	-	7,236.33
预提费用-审计费	90,000.00	60,000.00
预提费用-信息披露费	130,000.00	130,000.00
合计	220,000.00	197,236.33

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 博道嘉瑞混合A

金额单位：人民币元

项目 (博道嘉瑞混合A)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	489,190,896.52	489,190,896.52
本期申购	1,160,523,336.66	1,160,523,336.66
本期赎回（以“-”号填列）	-678,775,709.11	-678,775,709.11
本期末	970,938,524.07	970,938,524.07

7.4.7.9.2 博道嘉瑞混合C

金额单位：人民币元

项目 (博道嘉瑞混合C)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	83,115,415.52	83,115,415.52
本期申购	173,705,523.44	173,705,523.44
本期赎回（以“-”号填列）	-158,725,224.01	-158,725,224.01
本期末	98,095,714.95	98,095,714.95

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 博道嘉瑞混合A

单位：人民币元

项目 (博道嘉瑞混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	107,951,433.74	231,084,902.40	339,036,336.14
本期利润	243,007,548.58	-68,321,311.70	174,686,236.88

本期基金份额交易产生的变动数	213,072,526.16	242,170,421.68	455,242,947.84
其中：基金申购款	518,515,705.80	568,535,608.04	1,087,051,313.84
基金赎回款	-305,443,179.64	-326,365,186.36	-631,808,366.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	564,031,508.48	404,934,012.38	968,965,520.86

7.4.7.10.2 博道嘉瑞混合C

单位：人民币元

项目 (博道嘉瑞混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,770,849.24	39,124,673.34	56,895,522.58
本期利润	36,902,229.81	-529,006.99	36,373,222.82
本期基金份额交易产生的变动数	471,943.37	2,198,261.99	2,670,205.36
其中：基金申购款	75,378,817.60	77,703,568.17	153,082,385.77
基金赎回款	-74,906,874.23	-75,505,306.18	-150,412,180.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,145,022.42	40,793,928.34	95,938,950.76

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	12,126.19	15,120.69
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	176,728.74	86,495.30
结算备付金利息收入	7.61	-
其他	-	-
合计	188,862.54	101,615.99

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	1,739,990,740.49	1,229,525,737.07
减：卖出股票成本总额	1,494,214,257.42	1,122,856,484.68
买卖股票差价收入	245,776,483.07	106,669,252.39

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	51,797,144.08	4,801,916.79
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	51,797,144.08	4,801,916.79

7.4.7.13.2 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑 付)成交总额	482,094,462.10	359,308,809.57
减：卖出债券(、	426,469,131.68	352,880,294.25

债转股及债券到期 兑付) 成本总额		
减: 应收利息总额	3, 828, 186. 34	1, 626, 598. 53
买卖债券差价收入	51, 797, 144. 08	4, 801, 916. 79

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
股票投资产生的股利收益	7, 650, 471. 64	2, 462, 736. 83
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	7, 650, 471. 64	2, 462, 736. 83

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
1. 交易性金融资产	-68, 850, 318. 69	204, 789, 461. 57
——股票投资	-55, 054, 818. 42	176, 716, 304. 87
——债券投资	-13, 795, 500. 27	28, 073, 156. 70
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-

3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-68,850,318.69	204,789,461.57

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	3,845,497.83	2,009,776.85
转换费收入	10,492.76	156.15
合计	3,855,990.59	2,009,933.00

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中A类份额将不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类份额将赎回费收入全额归入基金资产；
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中，A类份额将不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产，C类份额将转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	5,294,389.62	3,576,286.17
银行间市场交易费用	-	-
合计	5,294,389.62	3,576,286.17

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年01月01日至2021年 12月31日	2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	90,000.00	59,728.26
信息披露费	120,000.00	120,000.00
汇划手续费	8,199.38	7,069.21
律师费及公证费	50,000.00	-
开户费	-	400.00
合计	268,199.38	187,197.47

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博道基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
上海博道投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海博道如思投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如见投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如舍投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如知投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
莫泰山	基金管理人的股东

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 经博道基金管理有限公司(以下简称“博道基金”)股东会决议，批准上海博道相形投资合伙企业(有限合伙)将持有的博道基金4.5%的股权转让给张迎军，并于2021年4月27日完成了工商变更登记手续。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**7.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	25,071,101.24	9,520,036.17
其中：支付销售机构的客户维护费	4,726,027.64	1,896,303.51

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,342,813.51	1,269,338.11

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道嘉瑞混合A	博道嘉瑞混合C	合计
博道基金 管理有限 公司	0.00	510,348.00	510,348.00
招商银行	0.00	14,831.55	14,831.55
合计	0.00	525,179.55	525,179.55
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道嘉瑞混合A	博道嘉瑞混合C	合计
招商银行	0.00	12,742.15	12,742.15
博道基金 管理有限 公司	0.00	148,547.60	148,547.60
合计	0.00	161,289.75	161,289.75

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日C类基金份额对应的基金资产净值×0.50%/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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

博道嘉瑞混合A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	2,000,200.18	2,000,200.18
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	2,000,200.18	2,000,200.18
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.21%	0.35%

博道嘉瑞混合C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	1,000,400.00	1,000,400.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	1,000,400.00	1,000,400.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.02%	0.17%

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；
 3、如果本报告期间发生认购、申购、转换入、红利再投、赎回、转换出等业务，本基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间大于100万份。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01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
招商银行	2,149,343.67	12,126.19	3,462,557.33	15,120.69

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	主板打新限售	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688779	长远锂科	2021-08-03	2022-02-11	科创板打新限售	5.65	22.86	43,086	243,435.90	984,945.96	-

688032	禾迈股份	2021-12-13	2022-06-20	科创板打新限售	557.80	650.66	1,388	774,226.40	903,116.08	-
688385	复旦微电	2021-07-27	2022-02-07	科创板打新限售	6.23	48.58	8,986	55,982.78	436,539.88	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-07-06	科创板打新限售	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688766	普冉股份	2021-08-12	2022-02-23	科创板打新限售	148.90	342.73	704	104,825.60	241,281.92	-
688711	宏微科技	2021-08-25	2022-03-01	科创板打新限售	27.51	116.52	1,865	51,306.15	217,309.80	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	创业板打新限售	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
688509	正元地信	2021-07-22	2022-02-07	科创板打新限售	1.97	6.17	15,433	30,403.01	95,221.61	-
688511	天微电子	2021-07-22	2022-02-07	科创板打新限售	28.09	54.52	1,490	41,854.10	81,234.80	-
301136	招标股份	2021-12-	2022-01-	新股未上	10.52	10.52	7,172	75,449.4	75,449.4	-

		31	11	市				4	4	
688787	海天瑞声	2021-08-05	2022-02-14	科创板打新限售	36.94	87.35	817	30,179.98	71,364.95	-
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	创业板打新限售	93.09	75.34	848	78,940.32	63,888.32	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2022-01-07	科创板打新限售	6.42	15.76	2,693	17,289.06	42,441.68	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	创业板打新限售	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
688038	中科通达	2021-07-05	2022-01-13	科创板打新限售	8.60	18.72	2,132	18,335.20	39,911.04	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	创业板打新限售	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	创业板打新限售	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
3010	中集	2021	2022	创业	6.96	12.5	2,064	14,3	25,8	-

39	车辆	-07-01	-01-10	板打 新限售		1		65.4 4	20.6 4	
3010 58	中粮 工科	2021 -09-01	2022 -03-09	创业 板打 新限售	3.55	18.2 4	1,386	4,92 0.30	25,2 80.6 4	-
3010 99	雅创 电子	2021 -11-10	2022 -05-23	创业 板打 新限售	21.9 9	71.3 6	351	7,71 8.49	25,0 47.3 6	-
3012 21	光庭 信息	2021 -12-15	2022 -06-22	创业 板打 新限售	69.8 9	88.7 2	280	19,5 69.2 0	24,8 41.6 0	-
3011 89	奥尼 电子	2021 -12-21	2022 -06-28	创业 板打 新限售	66.1 8	56.6 2	435	28,7 88.3 0	24,6 29.7 0	-
3011 66	优宁 维	2021 -12-21	2022 -06-28	创业 板打 新限售	86.0 6	94.5 0	253	21,7 73.1 8	23,9 08.5 0	-
3010 69	凯盛 新材	2021 -09-16	2022 -03-28	创业 板打 新限售	5.17	44.2 1	539	2,78 6.63	23,8 29.1 9	-
3010 96	百诚 医药	2021 -12-13	2022 -06-20	创业 板打 新限售	79.6 0	78.5 3	272	21,6 51.2 0	21,3 60.1 6	-
3010 93	华兰 股份	2021 -10-21	2022 -05-05	创业 板打 新限售	58.0 8	49.8 5	409	23,7 54.7 2	20,3 88.6 5	-

				售						
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	创业板打新限售	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	创业板打新限售	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	创业板打新限售	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	创业板打新限售	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	创业板打新限售	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	创业板打新限售	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	创业板打新限售	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	创业板打新限售	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
3011	洁雅	2021	2022	创业	57.2	53.7	280	16,0	15,0	-

08	股份	-11- 25	-06- 06	板打 新限 售	7	1		35.6 0	38.8 0	
3011 79	泽宇 智能	2021 -12- 01	2022 -06- 08	创业 板打 新限 售	43.9 9	50.7 7	295	12,9 77.0 5	14,9 77.1 5	-
3010 89	拓新 药业	2021 -10- 20	2022 -04- 27	创业 板打 新限 售	19.1 1	67.9 3	220	4,20 4.20	14,9 44.6 0	-
3011 80	万祥 科技	2021 -11- 09	2022 -05- 16	创业 板打 新限 售	12.2 0	22.7 2	654	7,97 8.80	14,8 58.8 8	-
3010 46	能辉 科技	2021 -08- 10	2022 -02- 17	创业 板打 新限 售	8.34	48.9 9	290	2,41 8.60	14,2 07.1 0	-
3011 11	粤万 年青	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限 售	10.4 8	36.6 8	379	3,97 1.92	13,9 01.7 2	-
3011 88	力诺 特玻	2021 -11- 04	2022 -05- 11	创业 板打 新限 售	13.0 0	20.4 8	647	8,41 1.00	13,2 50.5 6	-
3011 99	迈赫 股份	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限 售	29.2 8	32.0 0	402	11,7 70.5 6	12,8 64.0 0	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板打 新限	10.6 4	30.4 4	421	4,47 9.44	12,8 15.2 4	-

				售						
3010 26	浩通 科技	2021 -07- 08	2022 -01- 17	创业 板打 新限 售	18.0 3	62.7 3	203	3,66 0.09	12,7 34.1 9	-
3011 26	达嘉 维康	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限 售	12.3 7	19.2 3	662	8,18 8.94	12,7 30.2 6	-
3010 92	争光 股份	2021 -10- 21	2022 -05- 05	创业 板打 新限 售	36.3 1	35.5 2	323	11,7 28.1 3	11,4 72.9 6	-
3010 48	金鹰 重工	2021 -08- 11	2022 -02- 28	创业 板打 新限 售	4.13	12.9 6	843	3,48 1.59	10,9 25.2 8	-
3010 28	东亚 机械	2021 -07- 12	2022 -01- 20	创业 板打 新限 售	5.31	13.5 0	733	3,89 2.23	9,89 5.50	-
3007 74	倍杰 特	2021 -07- 26	2022 -02- 16	创业 板打 新限 售	4.57	21.0 8	444	2,02 9.08	9,35 9.52	-
3011 82	凯旺 科技	2021 -12- 16	2022 -06- 23	创业 板打 新限 售	27.1 2	30.5 8	294	7,97 3.28	8,99 0.52	-
3010 62	上海 艾录	2021 -09- 07	2022 -03- 14	创业 板打 新限 售	3.31	17.0 1	523	1,73 1.13	8,89 6.23	-
3011	家联	2021	2022	创业	30.7	29.1	297	9,12	8,65	-

93	科技	-12-02	-06-09	板打 新限售	3	4		6.81	4.58	
3010 52	果麦 文化	2021 -08- 23	2022 -02- 28	创业 板打 新限售	8.11	33.6 4	252	2,04 3.72	8,47 7.28	-
3010 25	读客 文化	2021 -07- 06	2022 -01- 24	创业 板打 新限售	1.55	20.8 8	403	624. 65	8,41 4.64	-
3010 66	万事 利	2021 -09- 13	2022 -03- 22	创业 板打 新限售	5.24	22.8 4	344	1,80 2.56	7,85 6.96	-
3008 14	中富 电路	2021 -08- 04	2022 -02- 14	创业 板打 新限售	8.40	23.8 8	328	2,75 5.20	7,83 2.64	-
3011 33	金钟 股份	2021 -11- 19	2022 -05- 26	创业 板打 新限售	14.3 3	26.9 5	286	4,09 8.38	7,70 7.70	-
3011 98	喜悦 智行	2021 -11- 25	2022 -06- 02	创业 板打 新限售	21.7 6	29.2 0	262	5,70 1.12	7,65 0.40	-
3010 30	仕净 科技	2021 -07- 15	2022 -01- 24	创业 板打 新限售	6.10	31.5 2	242	1,47 6.20	7,62 7.84	-
3010 81	严牌 股份	2021 -10- 13	2022 -04- 20	创业 板打 新限售	12.9 5	17.4 4	403	5,21 8.85	7,02 8.32	-

				售						
3010 33	迈普 医学	2021 -07- 15	2022 -01- 26	创业 板打 新限 售	15.1 4	59.9 7	108	1,63 5.12	6,47 6.76	-
3010 49	超越 科技	2021 -08- 17	2022 -02- 24	创业 板打 新限 售	19.3 4	32.9 2	196	3,79 0.64	6,45 2.32	-
3010 32	新柴 股份	2021 -07- 15	2022 -01- 24	创业 板打 新限 售	4.97	12.5 1	513	2,54 9.61	6,41 7.63	-
3010 56	森赫 股份	2021 -08- 27	2022 -03- 07	创业 板打 新限 售	3.93	11.0 9	572	2,24 7.96	6,34 3.48	-
3010 36	双乐 股份	2021 -07- 21	2022 -02- 16	创业 板打 新限 售	23.3 8	29.9 3	205	4,79 2.90	6,13 5.65	-
3010 72	中捷 精工	2021 -09- 22	2022 -03- 29	创业 板打 新限 售	7.46	33.4 1	181	1,35 0.26	6,04 7.21	-
3010 83	百胜 智能	2021 -10- 13	2022 -04- 21	创业 板打 新限 售	9.08	14.2 1	416	3,77 7.28	5,91 1.36	-
3010 63	海锅 股份	2021 -09- 09	2022 -03- 24	创业 板打 新限 售	17.4 0	36.1 1	153	2,66 2.20	5,52 4.83	-
0012	泰慕	2021	2022	新股	16.5	16.5	333	5,50	5,50	-

34	士	-12-31	-01-11	未上市	3	3		4.49	4.49	
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	创业板打新限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	创业板打新限售	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	创业板打新限售	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	创业板打新限售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	创业板打新限售	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	创业板打新限售	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	创业板打新限售	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注

1130 52	兴业 转债	2021 -12- 27	2022 -01- 14	配债 未上 市	100. 00	100. 00	42, 530	4, 25 2, 98 1. 36	4, 25 2, 98 1. 36	-
------------	----------	--------------------	--------------------	---------------	------------	------------	---------	-------------------------	-------------------------	---

注：

1. 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。
2. 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。
3. 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系，并明确了相应风险管理职能。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于2021年12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为9.74%(2020年12月31日：12.40%)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于2021年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年12月31日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.49%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2021年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为2,126,974,242.93元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	21,577,560.58	-	-	-	-	-	21,577,560.58
结算备付金	1,009.51	-	-	-	-	-	1,009.51
交易性金融资产	-	-	118,554,926.10	134,257,624.48	73,571,345.19	1,672,382,453.45	1,998,766,349.22
买入返售金融资产	115,000,000.00	-	-	-	-	-	115,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,041,625.16	2,041,625.16
资产总计	136,578,570.09	0.00	118,554,926.10	134,257,624.48	73,571,345.19	1,674,424,078.61	2,137,386,544.47
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,758,196.68	2,758,196.68
应付托管费	-	-	-	-	-	367,759.58	367,759.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	100,462.11	100,462.11
应交税费	-	-	-	-	-	1,415.46	1,415.46
其他负债	-	-	-	-	-	220,000.00	220,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,447,833.83	3,447,833.83
利率敏感度缺口	136,578,570.09	0.00	118,554,926.10	134,257,624.48	73,571,345.19	1,670,976,244.78	2,133,938,710.64
上年度末 2020年	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

12月31日							
资产							
银行存款	14,348,250.56	-	-	-	-	-	14,348,250.56
交易性金融资产	47,560,243.50	-	1,831,615.80	8,945,987.74	111,135,366.53	736,733,246.24	906,206,459.81
买入返售金融资产	50,000,000.00	-	-	-	-	-	50,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,189,041.19	1,189,041.19
应收申购款	-	-	-	-	-	3,044,819.01	3,044,819.01
资产总计	111,908,494.06	-	1,831,615.80	8,945,987.74	111,135,366.53	740,967,106.44	974,788,570.57
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,033,422.07	5,033,422.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,121,595.20	1,121,595.20
应付托管费	-	-	-	-	-	149,546.03	149,546.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	47,835.28	47,835.28
应交税费	-	-	-	-	-	764.90	764.90
其他负债	-	-	-	-	-	197,236.33	197,236.33
负债总计	-	-	-	-	-	6,550,399.81	6,550,399.81
利率敏感度缺口	111,908,494.06	-	1,831,615.80	8,945,987.74	111,135,366.53	734,416,706.63	968,238,170.76

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为15.29%(2020年12月31日：17.50%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020年12月31日：同)。

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

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				
交易性金融资产	-	31,741,194.2 4	-	31,741,194.2 4
资产合计	-	31,741,194.2 4	-	31,741,194.2 4
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	31,741,194.2 4	-	31,741,194.2 4
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				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

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
	1. 所有外币相对人民币升值5%	1, 587, 059. 71	-
	2. 所有外币相对人民币贬值5%	-1, 587, 059. 71	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的35%-80%（其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的保证金以后，保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日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对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地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	1,672,382,453.45	78.37	736,733,246.24	76.09
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,672,382,453.45	78.37	736,733,246.24	76.09

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准收益率上升5%	98,072,165.03	42,804,397.09
	2. 业绩比较基准收益率下降5%	-98,072,165.03	-42,804,397.09

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) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为1,869,734,083.68元，属于第二层次的余额为123,188,136.81元，属于第三层次的余额为5,844,128.73(2020年12月31日：第一层次851,772,861.30元，第二层次54,433,598.51元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

2021年12月31日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具5,844,128.73元(2020年12月31日：无)。本基金本年度购买或转入第三层次的金融工具3,787,658.27元(2020年度：无)，计入损益的利得或损失金额为2,056,470.46元(2020年度：无)，均为2021年12月31日仍持有的资产计入未实现利得或损失的变动(公允价值变动损益)(2020年度：无)。

于2021年12月31日，本基金持有的第三层次交易性金融资产均为股票投资，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 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。截至2021年12月

31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3) 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	1,672,382,453.45	78.24
	其中：股票	1,672,382,453.45	78.24
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	326,383,895.77	15.27
	其中：债券	326,383,895.77	15.27
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	115,000,000.00	5.38
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	21,578,570.09	1.01
8	其他各项资产	2,041,625.16	0.10
9	合计	2,137,386,544.47	100.00

注：1、银行存款和结算备付金合计余额包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金；

2、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及占基金资产净值比例请见“8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合”部分披露。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,230,911,990.75	57.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,765,686.00	1.11
E	建筑业	12,731,479.53	0.60
F	批发和零售业	79,053.80	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	12,922,500.00	0.61
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	138,262,749.57	6.48
J	金融业	79,841,019.08	3.74
K	房地产业	39,951,394.00	1.87
L	租赁和商务服务业	9,899,009.10	0.46
M	科学研究和技术服务业	92,209,573.82	4.32
N	水利、环境和公共设施管理业	15,811.84	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	46,383.72	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,640,641,259.21	76.88

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例（%）
主要消费	31,741,194.24	1.49
合计	31,741,194.24	1.49

注：以上分类采用中证CICS一级分类标准编制。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300274	阳光电源	1,020,900	148,847,220.00	6.98
2	300750	宁德时代	200,008	117,604,704.00	5.51
3	002791	坚朗五金	460,872	83,689,746.48	3.92
4	600150	中国船舶	3,128,100	77,545,599.00	3.63
5	002230	科大讯飞	1,460,748	76,703,877.48	3.59
6	603259	药明康德	615,380	72,971,760.40	3.42
7	600966	博汇纸业	5,342,500	55,241,450.00	2.59
8	300751	迈为股份	81,240	52,180,452.00	2.45
9	002414	高德红外	2,089,543	50,587,836.03	2.37
10	600926	杭州银行	3,602,794	46,187,819.08	2.16
11	600745	闻泰科技	325,900	42,138,870.00	1.97
12	600346	恒力石化	1,660,281	38,136,654.57	1.79
13	002493	荣盛石化	2,052,695	37,276,941.20	1.75
14	688023	安恒信息	147,862	37,074,917.88	1.74
15	000333	美的集团	458,800	33,864,028.00	1.59
16	601166	兴业银行	1,767,500	33,653,200.00	1.58
17	603987	康德莱	1,534,400	33,342,512.00	1.56
18	603185	上机数控	196,082	32,741,772.36	1.53
19	00336	华宝国际	2,696,000	31,741,194.24	1.49
20	688408	中信博	177,021	31,245,976.71	1.46
21	300763	锦浪科技	129,900	30,078,345.00	1.41
22	300709	精研科技	497,295	29,812,835.25	1.40
23	301050	雷电微力	118,529	28,896,442.18	1.35
24	300014	亿纬锂能	241,801	28,576,042.18	1.34

25	688390	固德威	60,857	27,968,660.06	1.31
26	600309	万华化学	261,000	26,361,000.00	1.24
27	300601	康泰生物	242,300	23,876,242.00	1.12
28	600863	内蒙华电	6,031,900	23,765,686.00	1.11
29	300919	中伟股份	149,810	22,697,713.10	1.06
30	002410	广联达	349,346	22,351,157.08	1.05
31	002812	恩捷股份	87,900	22,010,160.00	1.03
32	000036	华联控股	5,045,900	21,899,206.00	1.03
33	300343	联创股份	1,270,300	21,620,506.00	1.01
34	603260	合盛硅业	154,700	20,415,759.00	0.96
35	300759	康龙化成	133,100	18,803,037.00	0.88
36	000615	奥园美谷	1,674,600	18,052,188.00	0.85
37	688185	康希诺	58,146	17,417,634.30	0.82
38	603396	金辰股份	141,200	17,367,600.00	0.81
39	002821	凯莱英	34,000	14,790,000.00	0.69
40	688063	派能科技	72,776	14,336,872.00	0.67
41	300726	宏达电子	130,400	13,047,824.00	0.61
42	002352	顺丰控股	187,500	12,922,500.00	0.61
43	002375	亚厦股份	1,699,797	12,731,479.53	0.60
44	002312	川发龙蟒	796,100	10,412,988.00	0.49
45	002127	南极电商	1,434,639	9,899,009.10	0.46
46	300395	菲利华	144,308	9,486,807.92	0.44
47	300725	药石科技	52,100	7,407,057.00	0.35
48	688235	百济神州	19,217	2,777,048.67	0.13
49	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.08
50	301155	海力风电	10,533	1,269,787.30	0.06
51	300699	光威复材	14,100	1,191,168.00	0.06
52	688779	长远锂科	43,086	984,945.96	0.05
53	688032	禾迈股份	1,388	903,116.08	0.04
54	688798	艾为电子	3,592	775,872.00	0.04
55	688385	复旦微电	8,986	436,539.88	0.02

56	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
57	600600	青岛啤酒	3,000	297,000.00	0.01
58	688766	普冉股份	704	241,281.92	0.01
59	688711	宏微科技	1,865	217,309.80	0.01
60	603127	昭衍新药	1,673	193,114.39	0.01
61	688509	正元地信	15,433	95,221.61	0.00
62	688511	天微电子	1,490	81,234.80	0.00
63	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
64	688787	海天瑞声	817	71,364.95	0.00
65	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.00
66	688226	威腾电气	2,693	42,441.68	0.00
67	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
68	688038	中科通达	2,132	39,911.04	0.00
69	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
70	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
71	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
72	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
73	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
74	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
75	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
76	301189	C奥尼	435	24,629.70	0.00
77	301166	C优宁维	253	23,908.50	0.00
78	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
79	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
80	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
81	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
82	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
83	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
84	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
85	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
86	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00

87	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
88	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
89	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
90	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
91	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
92	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
93	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
94	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
95	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
96	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
97	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
98	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
99	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
100	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
101	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
102	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
103	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
104	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
105	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
106	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
107	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
108	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
109	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
110	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
111	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
112	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
113	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
114	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
115	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
116	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
117	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00

118	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
119	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
120	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
121	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
122	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
123	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
124	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
125	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
126	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
127	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
128	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
129	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
130	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603259	药明康德	85,819,870.30	8.86
2	603185	上机数控	83,321,806.84	8.61
3	600150	中国船舶	81,282,692.00	8.39
4	002791	坚朗五金	72,155,473.20	7.45
5	300601	康泰生物	68,948,976.40	7.12
6	600966	博汇纸业	63,932,022.00	6.60
7	300343	联创股份	62,580,774.18	6.46
8	300919	中伟股份	58,317,218.45	6.02
9	600519	贵州茅台	58,095,742.00	6.00
10	300274	阳光电源	56,151,866.45	5.80
11	002414	高德红外	53,891,842.61	5.57
12	600926	杭州银行	52,590,288.88	5.43

13	000333	美的集团	52,076,732.11	5.38
14	000615	奥园美谷	44,581,906.00	4.60
15	002821	凯莱英	44,415,049.63	4.59
16	300014	亿纬锂能	43,487,474.73	4.49
17	601166	兴业银行	43,277,884.52	4.47
18	688185	康希诺	42,212,628.27	4.36
19	H00336	华宝国际	41,968,545.43	4.33
20	002375	亚厦股份	41,513,261.49	4.29
21	600863	内蒙华电	41,363,368.00	4.27
22	000001	平安银行	40,873,494.06	4.22
23	002493	荣盛石化	40,834,842.16	4.22
24	688063	派能科技	40,192,430.49	4.15
25	600745	闻泰科技	39,289,222.59	4.06
26	603260	合盛硅业	38,788,379.00	4.01
27	600346	恒力石化	37,329,177.73	3.86
28	603987	康德莱	36,788,366.00	3.80
29	002601	龙佰集团	36,702,685.62	3.79
30	002192	融捷股份	35,523,929.40	3.67
31	300751	迈为股份	35,238,977.94	3.64
32	600309	万华化学	34,508,473.04	3.56
33	600031	三一重工	33,633,401.95	3.47
34	301050	雷电微力	33,568,507.88	3.47
35	002230	科大讯飞	33,312,393.80	3.44
36	688023	安恒信息	31,779,539.09	3.28
37	300750	宁德时代	31,548,389.00	3.26
38	300347	泰格医药	30,973,950.00	3.20
39	300395	菲利华	30,790,094.44	3.18
40	300015	爱尔眼科	28,924,789.51	2.99
41	603939	益丰药房	27,986,364.83	2.89
42	300476	胜宏科技	27,731,078.47	2.86
43	600600	青岛啤酒	27,670,395.39	2.86

44	688408	中信博	26,220,587.03	2.71
45	002352	顺丰控股	25,792,049.00	2.66
46	603737	三棵树	25,438,978.80	2.63
47	300709	精研科技	24,852,497.91	2.57
48	000157	中联重科	24,215,079.11	2.50
49	688390	固德威	24,212,188.12	2.50
50	603396	金辰股份	23,945,770.00	2.47
51	300759	康龙化成	23,422,655.07	2.42
52	000036	华联控股	22,695,277.54	2.34
53	002812	恩捷股份	21,897,891.00	2.26
54	002410	广联达	21,397,422.92	2.21
55	688696	极米科技	20,483,583.06	2.12

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	82,923,940.00	8.56
2	300015	爱尔眼科	69,203,994.20	7.15
3	300347	泰格医药	68,116,273.08	7.04
4	600600	青岛啤酒	64,318,674.80	6.64
5	600438	通威股份	52,647,352.21	5.44
6	002601	龙佰集团	52,069,497.78	5.38
7	603185	上机数控	50,385,613.16	5.20
8	300601	康泰生物	49,968,504.80	5.16
9	300343	联创股份	47,419,399.94	4.90
10	603737	三棵树	45,587,087.74	4.71
11	002821	凯莱英	43,377,672.15	4.48
12	002192	融捷股份	43,144,302.00	4.46

13	000001	平安银行	42,115,055.02	4.35
14	600031	三一重工	40,696,534.73	4.20
15	603259	药明康德	40,014,631.46	4.13
16	300919	中伟股份	38,183,461.76	3.94
17	688023	安恒信息	35,906,510.09	3.71
18	300476	胜宏科技	34,482,968.24	3.56
19	002375	亚厦股份	30,035,658.86	3.10
20	603939	益丰药房	28,189,694.26	2.91
21	300014	亿纬锂能	27,646,957.00	2.86
22	002410	广联达	27,277,824.50	2.82
23	688063	派能科技	25,881,795.02	2.67
24	688680	海优新材	25,439,383.10	2.63
25	600309	万华化学	24,953,847.39	2.58
26	300759	康龙化成	24,110,779.00	2.49
27	300395	菲利华	23,932,738.00	2.47
28	000977	浪潮信息	22,904,101.33	2.37
29	688696	极米科技	22,171,839.54	2.29
30	600863	内蒙华电	20,090,204.54	2.07

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,484,918,283.05
卖出股票收入（成交）总额	1,739,990,740.49

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	118,554,926.10	5.56

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	207,828,969.67	9.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	326,383,895.77	15.29

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019654	21国债06	698,100	69,830,943.00	3.27
2	019641	20国债11	370,800	37,172,700.00	1.74
3	128095	恩捷转债	69,070	32,087,849.90	1.50
4	113616	韦尔转债	165,390	27,922,793.70	1.31
5	110043	无锡转债	188,400	22,564,668.00	1.06

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,041,625.16
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,041,625.16

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128095	恩捷转债	32,087,849.90	1.50

2	113616	韦尔转债	27,922,793.70	1.31
3	110043	无锡转债	22,564,668.00	1.06
4	123044	红相转债	19,503,472.30	0.91
5	127022	恒逸转债	19,082,317.42	0.89
6	127038	国微转债	15,653,287.77	0.73
7	127036	三花转债	9,126,099.00	0.43
8	113548	石英转债	9,047,103.00	0.42
9	128049	华源转债	4,049,420.16	0.19

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博道嘉瑞混合A	39,925	24,319.06	575,089,900.99	59.23%	395,848,623.08	40.77%
博道嘉瑞混合C	5,863	16,731.32	58,822,232.85	59.96%	39,273,482.10	40.04%
合计	45,277	23,610.98	633,912,133.84	59.30%	435,122,105.18	40.70%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博道嘉瑞混合A	3,352,236.28	0.35%
	博道嘉瑞混合C	9,603.55	0.01%
	合计	3,361,839.83	0.31%

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博道嘉瑞混合A	>100
	博道嘉瑞混合C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博道嘉瑞混合A	>100
	博道嘉瑞混合C	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	博道嘉瑞混合A	博道嘉瑞混合C
基金合同生效日(2019年12月30日)基金份额总额	363,186,066.23	149,328,980.14
本报告期期初基金份额总额	489,190,896.52	83,115,415.52
本报告期基金总申购份额	1,160,523,336.66	173,705,523.44
减：本报告期基金总赎回份额	678,775,709.11	158,725,224.01
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	970,938,524.07	98,095,714.95

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

博道嘉瑞混合型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，基金份额持有人大会于2021年10月26日表决通过了《关于博道嘉瑞混合型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，在本基金的投资范围中增加港股通标的股票相关条款，相应调整投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、风险收益特征、基金资产估值以及基金的信息披露等事项，修订后的《基金合同》、《托管协议》等法律文件自2021年10月28日起生效，详见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

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

基金管理人的重大人事变动：无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：自2021年10月27日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内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

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本期审计费用请见“7.4.7.19其他费用”。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

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

本报告期内，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没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

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	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	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	注
方正证券	2	4,122,195,255.63	100.00%	3,340,808.57	100.00%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
方正证券	859,049,659.19	100.00%	30,917,402,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：

- 1、本基金交易单元未发生变化；
- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：
 - 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
 - 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
 - 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；
 - 4) 具有较强的为投资人提供资产配置及服务的能力，包括但不限于：产品筛选及评审流程完整，具有较为完善的资产配置，客户服务及陪伴体系等。
- 3、基金交易单元的选择程序如下：
 - 1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
 - 2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

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	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-01-22
2	博道嘉瑞混合型证券投资基金2020年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-22
3	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-18
4	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-03-31
5	博道嘉瑞混合型证券投资基金2020年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-31
6	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-04-22
7	博道嘉瑞混合型证券投资基金2021年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-22
8	博道基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-18
9	博道基金管理有限公司关于增加方正中期期货有限公司为博道嘉瑞混合型证券投资基金销售机构的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-21
10	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-07-05
11	博道基金管理有限公司旗下	中国证券报、上海证券报、	2021-07-21

	部分基金季度报告提示性公告	证券时报、证券日报	
12	博道嘉瑞混合型证券投资基金2021年第二季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-07-21
13	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-08-10
14	博道基金管理有限公司旗下部分基金中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-08-31
15	博道嘉瑞混合型证券投资基金2021年中期报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-08-31
16	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-07
17	博道基金管理有限公司关于以通讯方式召开博道嘉瑞混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-24
18	博道基金管理有限公司关于以通讯方式召开博道嘉瑞混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-27
19	博道基金管理有限公司关于以通讯方式召开博道嘉瑞混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-28
20	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为销售机构的	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子	2021-10-14

	公告	披露网站	
21	博道基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-10-27
22	博道嘉瑞混合型证券投资基金2021年第三季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-10-27
23	博道基金管理有限公司关于博道嘉瑞混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-10-27
24	博道嘉瑞混合型证券投资基金基金合同、托管协议、招募说明书及产品资料概要	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-10-28
25	博道嘉瑞混合型证券投资基金招募说明书及产品资料概要	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-11-12
26	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日（香港圣诞节）暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-12-21
27	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金2021年底及2022年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-12-24

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道嘉瑞混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道嘉瑞混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道嘉瑞混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道嘉瑞混合型证券投资基金托管协议》；

- 5、关于申请募集注册博道嘉瑞混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道嘉瑞混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站（www.bdfund.cn）查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博道基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-085-2888（免长途话费）。

博道基金管理有限公司
二〇二二年三月三十一日