

华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
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	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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的真实、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	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	49

8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	65
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	65
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	65
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	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.12 投资组合报告附注	65
§ 9 基金份额持有人信息	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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	67
§ 10 开放式基金份额变动	67
§ 11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
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	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	72
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 13 备查文件目录	75
13.1 备查文件目录	75
13.2 存放地点	75
13.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华富华鑫灵活配置混合	
基金主代码	002730	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月11日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
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	30,174,736.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	002730	002731
报告期末下属分级基金的份额总额	25,886,549.57份	4,288,186.86份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略的基本思想是在充分控制风险的前提下实现高收益。依据风险-收益-投资策略关系原理，本基金采用包括资产配置策略、行业配置策略和个股精选策略在内的多层次复合投资策略进行实际投资，高层策略作用是规避风险，低层策略用于提高收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等收益风险特征的基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华富基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘
	联系电话	021-68886996
	电子邮箱	manzh@hffund.com
客户服务电话	400-700-8001	95588
传真	021-68887997	(010) 66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200120	100140
法定代表人	赵万里	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号新湖商贸大厦 6 楼
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

§ 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	
	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C
本期已实现收益	11,262,210.63	2,009,277.58	39,213,461.39	3,670,471.70	15,577,841.16	8,116,247.24
本期利润	6,067,452.73	909,898.81	41,586,302.61	3,442,149.36	39,118,151.49	9,751,988.86
加权平均基金份额本期利润	0.1966	0.1999	0.4122	0.3336	0.3363	0.3749
本期加权平均净值	12.43%	12.68%	32.12%	25.64%	35.03%	38.56%

利润率						
本期基金份额净值增长率	13.14%	12.96%	37.52%	37.24%	42.11%	42.02%
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	18,013,230.27	2,923,085.51	26,339,701.62	2,036,965.16	482,299.58	-9,627.35
期末可供分配基金份额利润	0.6959	0.6817	0.4151	0.4060	0.0041	-0.0008
期末基金资产净值	43,899,779.84	7,211,272.37	95,118,247.32	7,472,150.58	129,594,924.11	13,072,077.41
期末基金份额净值	1.696	1.682	1.499	1.489	1.090	1.085
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	72.97%	71.55%	52.88%	51.86%	9.00%	8.50%

注：1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2) 以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3) 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数,表中的“期末”均指报告期最后一日,即 12 月 31 日。

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

华富华鑫灵活配置混合 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	3.16%	0.69%	1.32%	0.40%	1.84%	0.29%
过去六个月	5.60%	0.92%	-1.38%	0.51%	6.98%	0.41%
过去一年	13.14%	0.93%	-0.18%	0.59%	13.32%	0.34%
过去三年	121.12%	1.28%	38.14%	0.64%	82.98%	0.64%
过去五年	74.36%	1.16%	36.78%	0.60%	37.58%	0.56%
自基金合同生效起至今	72.97%	1.14%	34.75%	0.59%	38.22%	0.55%

华富华鑫灵活配置混合 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	3.13%	0.69%	1.32%	0.40%	1.81%	0.29%
过去六个月	5.45%	0.93%	-1.38%	0.51%	6.83%	0.42%

过去一年	12.96%	0.93%	-0.18%	0.59%	13.14%	0.34%
过去三年	120.16%	1.28%	38.14%	0.64%	82.02%	0.64%
过去五年	72.93%	1.16%	36.78%	0.60%	36.15%	0.56%
自基金合同生效起至今	71.55%	1.14%	34.75%	0.59%	36.80%	0.55%

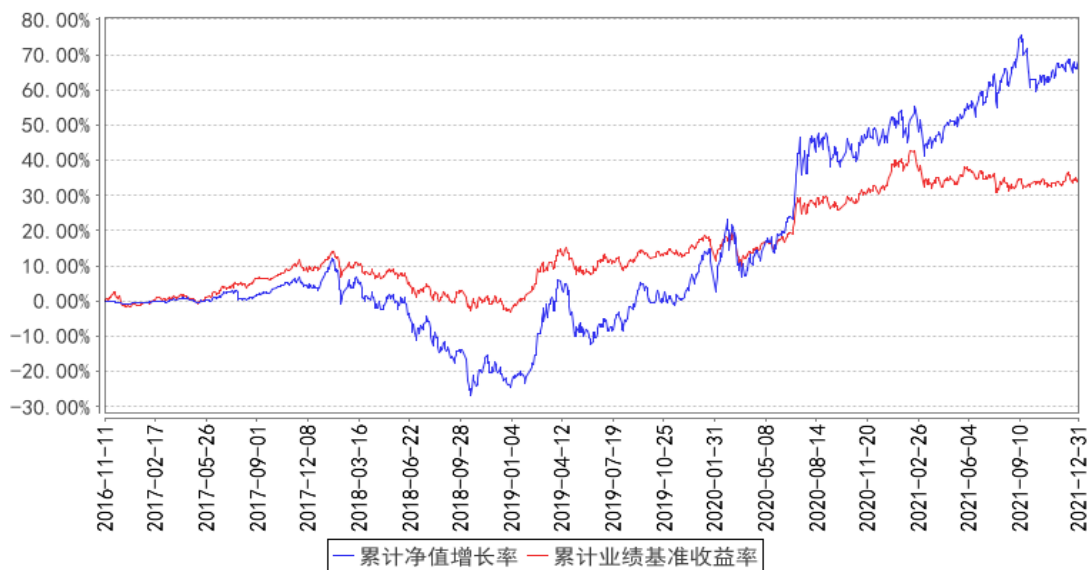
注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%。

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

华富华鑫灵活配置混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



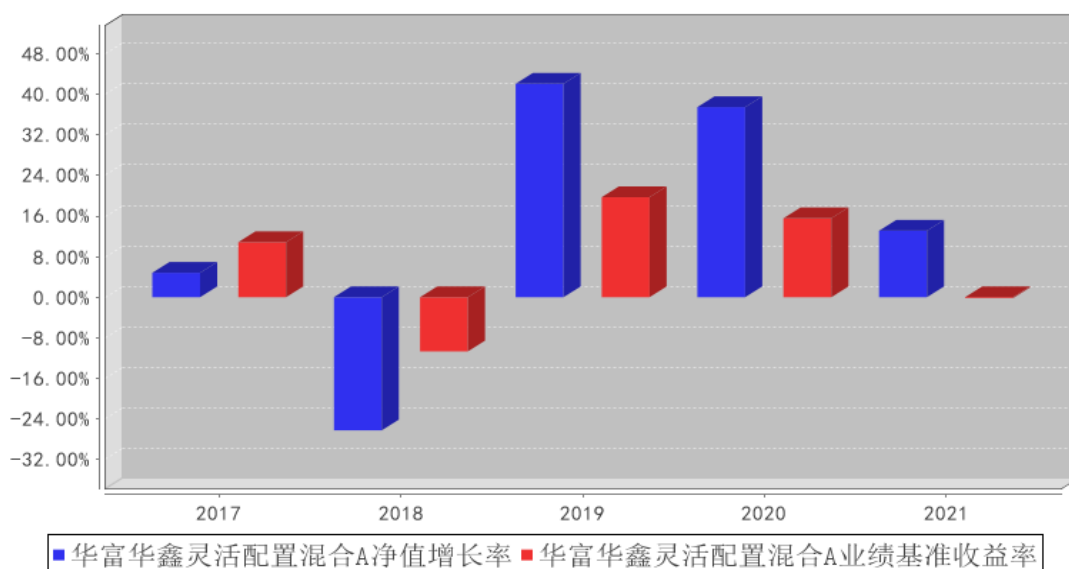
华富华鑫灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



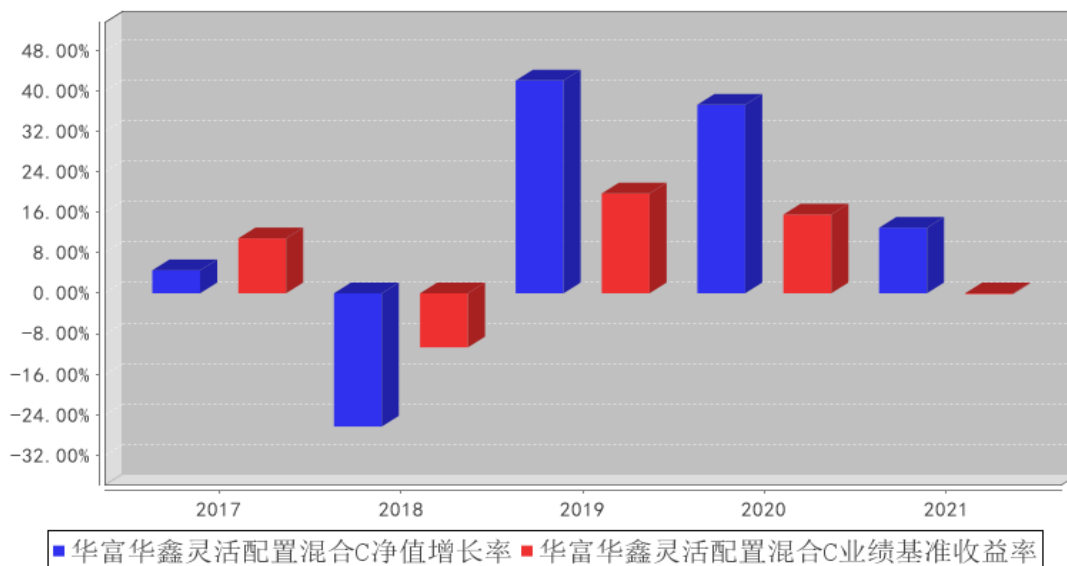
注：根据《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票资产占基金资产的 0%-95%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金建仓期为 2016 年 11 月 11 日到 2017 年 5 月 11 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

3.2.3 过去五年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

华富华鑫灵活配置混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华富华鑫灵活配置混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：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

注：本基金未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、

华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富国潮优选混合型发起式证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金和华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金共五十二只基金。

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		
尹培俊	本基金基金经理、公司总经理助理、固定收益部总监、公司公募投资决策委员会委员	2016 年 11 月 11 日	2021 年 10 月 14 日	十五年	兰州大学工商管理硕士，研究生学历。曾任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、德邦证券有限责任公司固定收益部高级经理。2012 年 7 月加入华富基金管理有限公司，曾任信用研究员、固定收益部总监助理、固定收益部副总监，自 2014 年 3 月 6 日起任华富强化回报债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 1 月 30 日起任华富安享债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 8 月 28 日起任华富收益增强债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 8 月 28 日起任华富可转债债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 28 日起任华富安华债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 26 日起任华富安盈一年持有期债券型证券投资

					资基金基金经理，自 2021 年 11 月 8 日起任华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
姚 姣	本基金的基金经理	2021 年 10 月 14 日	-	九年	复旦大学金融学硕士，研究生学历。先后任职于广发银行股份有限公司、上海农商银行股份有限公司。2016 年 11 月加入华富基金管理有限公司，自 2017 年 1 月 25 日起任华富天益货币市场基金基金经理，自 2017 年 1 月 4 日起任华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 22 日起任华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2019 年 5 月 6 日起任华富恒欣纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 19 日起任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 10 月 14 日起任华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 13 日起任华富天盈货币市场基金基金经理，自 2021 年 12 月 13 日起任华富货币市场基金基金经理，具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵循行业协会《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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体控制措施如下：

在研究分析和投资决策环节，公司通过建立规范、完善的研究管理平台，为所有的投资组合经理

提供公平的研究服务和支 持。公司的各类投资组合，在保证其决策相对独立的同时，在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略，制定客观、完整的交易决策规则，并按照这些规则进行投资决策，保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节，公司设立独立的集中交易部门，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则：“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节，公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容，加强对投资交易行为的监察稽核力度，公司集中交易部、监察稽核部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后，集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记，逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果，由具体执行的交易员签字确认留档，并交监察稽核部备案。公司监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，根据纳入样本内的数据分析结果，未发现明显异常情况。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

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 年全球经济受益于欧美财政货币刺激，发达市场经历了罕见的高增长和高通胀。而疫情

反复、供给冲击使得全球经济复苏走走停停，供需错配直接引发了滞胀的担忧。全球供应链上中下游都暴露出脆弱的一面，减碳和复苏错位更是加剧了供应链瓶颈。国内经济基本面则表现出逐季放缓，外需强劲，内需偏弱的特征，PPI 高涨超预期，财政后置，货币政策逆周期发力。

资本市场表现上，对应美林时钟“类滞胀”阶段资产表现，商品>股票>债券>黄金。大宗商品在 2021 年涨势如虹，特别受攻击冲击影响，从化石能源、有色金属、化工原材料到农产品都暴力上涨，给全球经济带来了巨大的通胀压力。国内的权益市场则表现分化，行情围绕两大主题展开，一是新能源，包括电力设备、有色金属（锂电上游）、电力及公用事业、汽车等；二是通胀，主要包括基础化工、煤炭、钢铁、石油石化等。房地产及房地产产业链受地产高压政策影响没有取得正收益。猪周期前高后低，农林牧渔板块下跌。此外，食品饮料、餐饮旅游等板块受疫情拖累，表现为负收益。债券市场全年呈现出小牛市行情，在央行两次降准、一次降息以及全年流动性充裕的呵护下，债券收益率在震荡中下行，10y 国债收益率全年下行达 30-40bp。

本基金全年以权益策略为主，2021 年在结构和风格上偏向中小市值标的，向下挖掘，以博取全年权益市场中的结构性行情带来的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富华鑫 A 份额净值为 1.696 元，累计份额净值为 1.716 元。本报告期的基金份额净值增长率为 13.14%，同期业绩比较基准收益率为-0.18%。截止本期末，华富华鑫 C 份额净值为 1.682 元，累计份额净值为 1.702 元。本报告期的基金份额净值增长率为 12.96%，同期业绩比较基准收益率为-0.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，经济增长方面，滞胀风险将有所缓解，增长节奏前高后低。宏观政策方面，美联储进入加息周期，中国则已经进入逆周期稳增长调节周期，国内的政策环境相比国外更为友好。这一政策错位下，海外流动性收紧带来美元回流压力，使得股市整体估值承压，高估值板块将面临更大的压力，A 股可能面临高切低，蓝筹价值股估值回归的行情。债券则可能面临收益率上行压力，总体来看，股债在 2022 年均难言乐观，将给投资带来不小的压力。债券策略方面将相比 2021 年适当降低风险暴露，降低久期，偏向防御策略。权益策略方面则仓位相比 2021 年适当降低，继续挖掘结构性机会，在行业配置、风格选择上偏向低估值有安全边际的品种为主，弃高就低，做好防御。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021 年度，为加强公司内部控制，监察稽核工作从制度建设和内部监察稽核入手为公司持续发展奠定坚实的基础。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，独立、客观、公正地开展基金运作和公司管理的合规性监察，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1、逐步建立和完善架构清晰、控制有效的内部控制机制。2021 年修订制定了《华富基金管理有限公司基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理办法》，从保护基金份额持有人利益的角度出发，对兼任的基金经理任免与变更要求、考核机制、利益冲突与公平交易管理、信息披露管理等方面进行了规定；制定了《华富基金管理有限公司专户投资业务港股通投资管理实施细则》，明确了港股通相关投资管理的投资权限、投资决策流程及港股通投管人员管理，从各个方面提高了投资效率并保障了流程合规；制定了《华富基金管理有限公司股票交流会细则》，增强了公司投研部门间观点交流，激励了研究员提升服务质量和研究深度，促进了公司投研一体化的建设与发展；制定了《华富基金管理有限公司港股通投资管理办法》，规范了公司港股通标的股票的研究、投资、交易业务，以期保证港股通投资交易业务的系统性、稳定性和持久性，并将风险管理的思想贯穿于港股通投资决策的全过程；先后陆续修订了公司 ETF 产品相关的《华富基金管理有限公司 ETF 基金风险管理办法》、《华富基金管理有限公司 ETF 申购赎回清单操作管理办法》、《华富基金管理有限公司 ETF 运营业务流程》、《华富基金管理有限公司交易型开放式证券投资基金应急操作手册》，根据公司现行部门规范和业务情况进一步对 ETF 产品运营管理流程、应急事件处理、风险管理架构等方面进行了规范；修订了《华富基金管理有限公司公开募集证券投资信息披露管理细则》，根据法律法规进一步细化了信息披露的组织、审核和发布工作，明确了基金信息披露工作流程与相关部门责任；修订了《华富基金管理有限公司场外交易对手管理办法》，规范了公司在银行间债券市场、上海证券交易所固定收益平台以及深圳证券交易所大宗协议平台等非标准场外市场投资交易行为，控制了交易对手信用风险；制定了《华富基金管理有限公司洗钱和恐怖融资风险自评估制度》，建立了公司洗钱风险自评估工作机制，优化了反洗钱和反恐怖融资资源配置，全面提升了公司风险控制措施和反洗钱工作有效性，确保了公司各项反洗钱内控措施符合反洗钱法规和监管要求。

2、多方位开展监察稽核工作，不断提高稽核覆盖面和检查力度。通过定期和不定期监察稽核工作的开展，公司的各个部门、各项业务的规范性和完善性都得到了较大的提高，各部门及时发现和弥补了制度建设中的漏洞和缺陷，实际业务操作流程更加科学有效。

3、加强风险监控，严格控制投资风险，通过对各基金的运行状况、投资比例、相关指标进行监控和跟踪，及时报告异常情况，确保基金投资规范运作。

4、扩大风险控制工作的覆盖面。风险控制工作不再局限于投资管理，从公司运营整体规范要求，风险控制渗透在业务的各个环节和所有部门，每月定时向风险控制委员会报告，进行及时的风险揭示。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由天健会计师事务所（特殊普通合伙）进行审核并出具报告，由托管银行进行复核。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本报告期内未实施利润分配，本期利润为 6,977,351.54 元，期末可供分配利润为 20,936,315.78 元，滚存至下一期进行分配。

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

从 2021 年 9 月 24 日起至 2021 年 11 月 17 日，本基金基金资产净值存在连续二十个工作日低于五千万元的情形，至本报告期末（2021 年 12 月 31 日）基金资产净值已高于五千万元。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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，中国工商银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律

法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审（2022）6-75 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	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称华富华鑫灵活基金）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、持有人权益（基金净值）变动表，以及相关财务报表附注。 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的规定编制，公允反映了华富华鑫灵活基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况，以及 2021 年度的经营成果和持有人权益（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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华富华鑫灵活基金及其管理人华富基金管理有限公司（以下简称基金管理人），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层（以下简称管理层）负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行

审计报告日期	2022 年 3 月 29 日
--------	-----------------

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,748,575.87	837,778.55
结算备付金		2,875.00	77,402.57
存出保证金		2,455.16	51,880.94
交易性金融资产	7.4.7.2	46,544,259.15	101,885,114.15
其中：股票投资		43,052,454.05	96,763,224.15
基金投资		-	-
债券投资		3,491,805.10	5,121,890.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	98,529.62
应收利息	7.4.7.5	25,467.45	67,592.14
应收股利		-	-
应收申购款		279.83	499.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		51,323,912.46	103,018,797.22
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		124.79	174,865.07
应付管理人报酬		25,894.52	51,513.83
应付托管费		6,473.64	12,878.49
应付销售服务费		1,214.21	1,267.95
应付交易费用	7.4.7.7	129.12	8,814.44
应交税费		23.97	11.63

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	179,000.00	179,047.91
负债合计		212,860.25	428,399.32
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	30,174,736.43	68,472,321.07
未分配利润	7.4.7.10	20,936,315.78	34,118,076.83
所有者权益合计		51,111,052.21	102,590,397.90
负债和所有者权益总计		51,323,912.46	103,018,797.22

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，华富华鑫 A 基金份额净值 1.696 元，基金份额总额 25,886,549.57 份；华富永鑫 C 基金份额净值 1.682 元，基金份额总额 4,288,186.86 份。华富华鑫灵活配置混合基金份额总额合计为 30,174,736.43 份。

报表附注为财务报表的组成部分。

7.2 利润表

会计主体：华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		7,861,105.39	46,932,577.11
1. 利息收入		93,311.89	191,984.30
其中：存款利息收入	7.4.7.11	8,327.89	10,177.87
债券利息收入		84,984.00	181,806.43
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）		14,027,470.40	44,543,274.05
其中：股票投资收益	7.4.7.12	13,463,777.19	42,834,537.24
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-24,817.34	79,784.15
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-

股利收益	7.4.7.16	588,510.55	1,628,952.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-6,294,136.67	2,144,518.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	34,459.77	52,799.88
减：二、费用		883,753.85	1,904,125.14
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	334,587.82	852,510.22
2. 托管费	7.4.10.2.2	83,647.00	213,127.53
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	14,338.00	26,587.11
4. 交易费用	7.4.7.19	241,525.63	601,571.18
5. 利息支出		134.08	77.07
其中：卖出回购金融资产支出		134.08	77.07
6. 税金及附加		1.32	0.67
7. 其他费用	7.4.7.20	209,520.00	210,251.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,977,351.54	45,028,451.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,977,351.54	45,028,451.97

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	68,472,321.07	34,118,076.83	102,590,397.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,977,351.54	6,977,351.54
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）	-38,297,584.64	-20,159,112.59	-58,456,697.23

其中：1. 基金申购款	19,816,903.18	11,094,839.16	30,911,742.34
2. 基金赎回款	-58,114,487.82	-31,253,951.75	-89,368,439.57
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）	30,174,736.43	20,936,315.78	51,111,052.21
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	130,952,242.11	11,714,759.41	142,667,001.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	45,028,451.97	45,028,451.97
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）	-62,479,921.04	-22,625,134.55	-85,105,055.59
其中：1. 基金申购款	30,465,865.72	12,645,231.63	43,111,097.35
2. 基金赎回款	-92,945,786.76	-35,270,366.18	-128,216,152.94
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）	68,472,321.07	34,118,076.83	102,590,397.90

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：

赵万利

曹华玮

邵恒

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

华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（证监许可[2016] 851 号）核准，基金合同于 2016 年 11 月 11 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（天健验（2016）6-120 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券、中期票据、短期融资券、债券回购等）、资产支持证券、货币市场工具以及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）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

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，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产在初始确认时划分为以下四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项、可供出售金融资产。

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。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

(2) 金融负债在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（包括交易性金融负债和在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债）、其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

本基金按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用，但下列情况除外：(1) 持有至到期投资以及贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；(2) 在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

本基金采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；(2) 与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；(3) 不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：1) 按照《企业会计准则第 13 号——或有事项》确定的金额；2) 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，除与套期保值有关外，按照如下方法处理：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，计入公允价值变动收益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利，确认为投资收益；处置时，将实际收到的金额与初始入账金额之间的差额确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。(2) 可供出售金融资产的公允价值变动计入其他综合收益；持有期间按实际利率法计算的利息，计入投资收益；可供出售权益工具投资的现金股利，于被投资单位宣告发放股利时计入投资

收益；处置时，将实际收到的金额与账面价值扣除原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额之后的差额确认为投资收益。

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；当金融负债的现时义务全部或部分解除时，相应终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生金融工具，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相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

- 1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 2) 第二层次输入值是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，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；
- 3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据做出的财务预测等。

(2) 估值方法及关键假设

- 1) 根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告（2017）13号）规定，在下列情况下本基金采用的估值方法及关键假设如下：

① 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。

② 对不存在活跃市场的投资品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，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证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，对估值进行调整并确定公允价值。

2) 对于发行时明确一定期限限售期的股票（包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），根据中国证券投资基金业协会《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》（中基协发〔2017〕6号），估值处理如下：

① 流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值： $FV=S \times (1-LoMD)$

其中：FV：估值日该流通受限股票的价值；S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值；LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。

② 引入看跌期权计算该流通受限股票对应的流动性折扣。 $LoMD=P/S$ ，P 是估值日看跌期权的价格。

③ 证券投资基金持有的流通受限股票在估值日按平均价格亚式期权模型确定估值日看跌期权的价格。

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列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

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

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后最后一位的，则采用待摊或预提的方法。

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及红利再投资形式分配。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持有人权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

本报告期本基金会计政策无变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1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〔2012〕85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〕101号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36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〕46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〔2016〕140 号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2017〕56 号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70 号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90 号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(一) 自 2018 年 1 月 1 日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征税率缴纳增值税。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

(三) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

主要税种及税率列示如下:

税种	计税依据	税率
增值税	以按税法规定计算的金融服务销售额	3%
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	2%

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	4,748,575.87	837,778.55
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	4,748,575.87	837,778.55

注:其他存款所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

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	36,116,407.53	43,052,454.05	6,936,046.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,399,854.97	3,491,805.10
	银行间市场	-	-
	合计	3,399,854.97	3,491,805.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	39,516,262.50	46,544,259.15	7,027,996.65
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	83,424,371.98	96,763,224.15	13,338,852.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,138,608.85	5,121,890.00
	银行间市场	-	-
	合计	5,138,608.85	5,121,890.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	88,562,980.83	101,885,114.15	13,322,133.32

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末和上年度末无衍生金融资产/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

注：本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末和上年度末无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	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	486.99	64.37
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	1.43	38.28
应收债券利息	24,977.82	67,463.75
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	1.21	25.74
合计	25,467.45	67,592.14

注：本表列示的“应收其他存款利息”所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的应收银行存款利息；“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末和上年度末无其他资产。

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	129.12	8,814.44
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	129.12	8,814.44

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	-	47.91
应付证券出借违约金	-	-
上清账户维护费	4,500.00	4,500.00
应付审计费	50,000.00	50,000.00
中债账户维护费	4,500.00	4,500.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	179,000.00	179,047.91

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华富华鑫灵活配置混合 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,455,741.11	63,455,741.11
本期申购	19,160,327.29	19,160,327.29
本期赎回（以“-”号填列）	-56,729,518.83	-56,729,518.83
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	25,886,549.57	25,886,549.57

华富华鑫灵活配置混合 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,016,579.96	5,016,579.96
本期申购	656,575.89	656,575.89
本期赎回（以“-”号填列）	-1,384,968.99	-1,384,968.99
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,288,186.86	4,288,186.86

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华富华鑫灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,339,701.62	5,322,804.59	31,662,506.21
本期利润	11,262,210.63	-5,194,757.90	6,067,452.73
本期基金份额 交易产生的变 动数	-15,350,946.83	-4,365,781.84	-19,716,728.67
其中：基金申 购款	15,020,601.39	-4,328,355.18	10,692,246.21
基金赎 回款	-30,371,548.22	-37,426.66	-30,408,974.88
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	22,250,965.42	-4,237,735.15	18,013,230.27

华富华鑫灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	2,036,965.16	418,605.46	2,455,570.62
本期利润	2,009,277.58	-1,099,378.77	909,898.81
本期基金份额交易产生的变动数	-426,281.17	-16,102.75	-442,383.92
其中：基金申购款	487,586.16	-84,993.21	402,592.95
基金赎回款	-913,867.33	68,890.46	-844,976.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,619,961.57	-696,876.06	2,923,085.51

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	7,095.34	7,882.93
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	547.41	1,825.12
其他	685.14	469.82
合计	8,327.89	10,177.87

注：“其他存款利息收入”所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。本期“其他”为直销申购款利息收入 398.56 元及结算保证金利息收入 286.58 元；上年度可比期间“其他”为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	13,463,777.19	42,834,537.24
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券	-	-

出借差价收入		
合计	13,463,777.19	42,834,537.24

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	99,810,635.37	218,657,455.34
减：卖出股票成本总额	86,346,858.18	175,822,918.10
买卖股票差价收入	13,463,777.19	42,834,537.24

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-24,817.34	79,784.15
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	-24,817.34	79,784.15

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,141,572.27	20,780,874.48
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,940,940.46	20,283,612.43
减：应收利息总额	225,449.15	417,477.90

买卖债券差价收入	-24,817.34	79,784.15
----------	------------	-----------

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内和上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内和上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内和上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	588,510.55	1,628,952.66
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	588,510.55	1,628,952.66

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-6,294,136.67	2,144,518.88
股票投资	-6,402,805.65	2,168,597.39
债券投资	108,668.98	-24,078.51
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-6,294,136.67	2,144,518.88

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	4,149.77	52,799.88
基金转换费收入	30,310.00	-
合计	34,459.77	52,799.88

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	241,525.63	601,571.18
银行间市场交易费用	-	-
合计	241,525.63	601,571.18

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	2,320.00	3,051.36
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	209,520.00	210,251.36

注：其他所列金额为上清所查询费用。

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
华富基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
安徽省信用融资担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰金融控股（集团）有限公司	基金管理人的股东

上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司
----------------	-----------

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 (%)
华安证券	337,440.29	0.25	113,441,548.47	33.09

7.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
华安证券	151,110.00	1.31	6,315,023.74	29.13

7.4.10.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回购 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 (%)
华安证券	100,000.00	22.22	200,000.00	25.00

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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 (%)
华安证券	307.52	0.24	-	-
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 (%)
华安证券	103,981.99	32.99	-	-

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的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。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	334,587.82	852,510.22
其中：支付销售机构的客户维护费	38,439.22	45,054.24

注：注基金管理费按前一日基金资产净值 0.60%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	83,647.00	213,127.53

注：注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期
-------------	----

方名称	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C	合计
华富基金管理有限公司	-	-	-
工商银行银行股份有限公司	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	0.34	0.34
合计	-	0.34	0.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C	合计
华富基金管理有限公司	-	6,526.72	6,526.72
工商银行银行股份有限公司	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	5.91	5.91
合计	-	6,532.63	6,532.63

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。计算公式 $H = E \times \text{年销售服务费} \div \text{当年天数}$ （H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值）。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内和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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日
		华富华鑫灵活配置混合 A
基金合同生效日(2016年11月11日)持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	3,633,555.42	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	3,633,555.42	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.04%	0%
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
		华富华鑫灵活配置混合 A
基金合同生效日(2016年11月11日)持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
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	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0%	0%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求，申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

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

份额单位：份

华富华鑫灵活配置混合 A

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
上海华富利得资产管理有限公司	7,983,061.89	26.46	0.00	0

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

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
中国工商银行股份有限公司	4,748,575.87	7,095.34	837,778.55	7,882.93

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内和上年度可比期间未参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：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
001234	泰慕士	2021年	2022年	新股流	16.53	16.53	194	3,206.82	3,206.82	-

		12月31日	1月11日	通受限						
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021年12月29日	2022年1月14日	新债未上市	100.00	100.00	490	49,000.00	49,000.00	-
113634	珀莱转债	2021年12月9日	2022年1月4日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

注：实际可流通日以该证券公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002683	广东宏大	2021年12月20日	重大事项停牌	30.12	2022年1月4日	31.00	4,240	144,518.54	127,708.80	-

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

注：本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，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。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设

投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	63,109.60	1,000.00
AAA 以下	732,745.50	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	795,855.10	1,000.00

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括期末本基金所投资的所有信用产品，具体

包括短期融资券、公司债、企业债、可转债、公募可交换债、商业银行债、非银行金融债等债券基金可投资的信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。短期信用产品的长期信用评级指主体评级，长期信用产品的长期信用评级指债券评级。信用等级按期末评级结果列示。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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	4,748,575.87	-	-	-	-	-	4,748,575.87
结算备付金	2,875.00	-	-	-	-	-	2,875.00
存出保证金	2,455.16	-	-	-	-	-	2,455.16
交易性金融资产	-	-	3,491,805.10	-	-	43,052,454.05	46,544,259.15
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	25,467.45	25,467.45
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	279.83	279.83
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,753,906.03	-	3,491,805.10	-	-	43,078,201.33	51,323,912.46
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	124.79	124.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,894.52	25,894.52
应付托管费	-	-	-	-	-	6,473.64	6,473.64
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,214.21	1,214.21
应付交易费用	-	-	-	-	-	129.12	129.12
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	23.97	23.97
其他负债	-	-	-	-	-	179,000.00	179,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	212,860.25	212,860.25
利率敏感度缺口	4,753,906.03	-	3,491,805.10	-	-	42,865,341.08	51,111,052.21
上年度末 2020 年 12 月	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

31 日							
资产							
银行存款	837,778.55	-	-	-	-	-	837,778.55
结算备付金	77,402.57	-	-	-	-	-	77,402.57
存出保证金	51,880.94	-	-	-	-	-	51,880.94
交易性金融资产	-	-	5,121,890.00	-	-	96,763,224.15	101,885,114.15
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	67,592.14	67,592.14
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	499.25	499.25
应收证券清算款	-	-	-	-	-	98,529.62	98,529.62
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	967,062.06	-	5,121,890.00	-	-	96,929,845.16	103,018,797.22
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	174,865.07	174,865.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	51,513.83	51,513.83
应付托管费	-	-	-	-	-	12,878.49	12,878.49
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,267.95	1,267.95
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,814.44	8,814.44
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	11.63	11.63
其他负债	-	-	-	-	-	179,047.91	179,047.91
负债总计	-	-	-	-	-	428,399.32	428,399.32
利率敏感度缺口	967,062.06	-	5,121,890.00	-	-	96,501,445.84	102,590,397.90

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 除利率外其他市场变量保持不变		
	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）
分析	市场利率下降 25 基点	964.72	7,305.74
	市场利率上升 25 基点	-955.77	-7,291.65

7.4.13.4.2 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其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.2.1 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	43,052,454.05	84.23	96,763,224.15	94.32
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	3,491,805.10	6.83	5,121,890.00	4.99
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	46,544,259.15	91.06	101,885,114.15	99.31

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变		
	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）
分析	沪深 300 指数上升百分之五	285,835.52	4,129,175.46
	沪深 300 指数下降百分之五	-285,835.52	-4,129,175.46

7.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间（95%）		
	2. 观察期（1 年）		
	-		
分析	风险价值 （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）
		合计	8,781,562.35

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

(1) 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。

(2) 持续的以公允价值计量的金融工具

1) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 43,795,102.33 元，第二层次的余额为 2,749,156.82 元，第三层次的余额为 0 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 93,759,970.63 元，第二层次 8,125,143.52 元，无第三层次)。

2) 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(3) 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)。

(4) 不以公允价值计量的金融工具

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

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	43,052,454.05	83.88
	其中：股票	43,052,454.05	83.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,491,805.10	6.80
	其中：债券	3,491,805.10	6.80
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,751,450.87	9.26
8	其他各项资产	28,202.44	0.05
9	合计	51,323,912.46	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 8.12.3 其他各项资产构成。

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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	537,729.81	1.05
B	采矿业	1,578,443.13	3.09
C	制造业	28,850,375.76	56.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	977,404.22	1.91
E	建筑业	681,203.17	1.33
F	批发和零售业	1,271,860.68	2.49
G	交通运输、仓储和邮政业	748,044.03	1.46
H	住宿和餐饮业	196,216.89	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,177,986.45	6.22
J	金融业	1,814,644.03	3.55
K	房地产业	914,610.97	1.79
L	租赁和商务服务业	546,551.14	1.07
M	科学研究和技术服务业	213,528.25	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	434,419.02	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,450.36	0.02
Q	卫生和社会工作	238,780.11	0.47
R	文化、体育和娱乐业	484,716.56	0.95
S	综合	373,489.47	0.73
	合计	43,052,454.05	84.23

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300274	阳光电源	3,848	561,038.40	1.10
2	600089	特变电工	26,077	552,050.09	1.08
3	002709	天赐材料	4,492	515,007.80	1.01
4	002074	国轩高科	8,167	418,558.75	0.82
5	300207	欣旺达	8,830	372,272.80	0.73

6	300316	晶盛机电	5,193	360,913.50	0.71
7	002340	格林美	30,219	312,766.65	0.61
8	000009	中国宝安	20,697	298,657.71	0.58
9	002013	中航机电	15,542	282,553.56	0.55
10	002268	卫士通	4,725	264,316.50	0.52
11	300285	国瓷材料	6,189	263,465.73	0.52
12	300088	长信科技	19,577	259,982.56	0.51
13	002385	大北农	23,377	245,224.73	0.48
14	600765	中航重机	4,819	243,311.31	0.48
15	600460	士兰微	4,461	241,786.20	0.47
16	002028	思源电气	4,826	237,487.46	0.46
17	600392	盛和资源	11,929	234,046.98	0.46
18	002185	华天科技	17,595	223,632.45	0.44
19	002648	卫星化学	5,555	222,366.65	0.44
20	600885	宏发股份	2,925	218,322.00	0.43
21	300223	北京君正	1,574	210,916.00	0.41
22	600884	杉杉股份	6,396	209,596.92	0.41
23	000630	铜陵有色	59,016	205,375.68	0.40
24	002625	光启技术	8,514	204,421.14	0.40
25	603486	科沃斯	1,350	203,782.50	0.40
26	002138	顺络电子	5,205	198,726.90	0.39
27	300474	景嘉微	1,302	198,164.40	0.39
28	600418	江淮汽车	11,269	196,080.60	0.38
29	601233	桐昆股份	8,957	189,709.26	0.37
30	600219	南山铝业	39,789	187,406.19	0.37
31	002353	杰瑞股份	4,671	186,840.00	0.37
32	603806	福斯特	1,420	185,381.00	0.36
33	002223	鱼跃医疗	4,897	185,106.60	0.36
34	002080	中材科技	5,424	184,524.48	0.36
35	300699	光威复材	2,105	177,830.40	0.35
36	002273	水晶光电	10,169	176,838.91	0.35
37	000988	华工科技	6,344	176,743.84	0.35
38	600426	华鲁恒升	5,585	174,810.50	0.34
39	000547	航天发展	10,274	171,575.80	0.34
40	300058	蓝色光标	15,979	171,454.67	0.34
41	002797	第一创业	23,405	171,324.60	0.34
42	000636	风华高科	5,738	170,992.40	0.33
43	000739	普洛药业	4,840	169,835.60	0.33
44	000998	隆平高科	7,297	169,728.22	0.33
45	600563	法拉电子	729	169,419.60	0.33
46	300146	汤臣倍健	6,279	169,281.84	0.33
47	603444	吉比特	401	169,161.85	0.33

48	002507	涪陵榨菜	4,469	168,928.20	0.33
49	002444	巨星科技	5,532	168,781.32	0.33
50	300012	华测检测	6,239	167,641.93	0.33
51	002465	海格通信	14,981	163,592.52	0.32
52	300496	中科创达	1,178	163,058.76	0.32
53	002030	达安基因	8,077	162,024.62	0.32
54	000960	锡业股份	8,262	161,356.86	0.32
55	000301	东方盛虹	8,199	158,568.66	0.31
56	000519	中兵红箭	5,928	158,099.76	0.31
57	002557	洽洽食品	2,515	154,320.40	0.30
58	603260	合盛硅业	1,155	152,425.35	0.30
59	300418	昆仑万维	6,513	150,775.95	0.29
60	600256	广汇能源	22,788	149,033.52	0.29
61	000807	云铝股份	13,268	148,203.56	0.29
62	000039	中集集团	8,574	147,129.84	0.29
63	603589	口子窖	2,075	147,055.25	0.29
64	688099	晶晨股份	1,129	146,995.80	0.29
65	300357	我武生物	2,561	146,745.30	0.29
66	300296	利亚德	14,196	145,509.00	0.28
67	601168	西部矿业	10,667	145,177.87	0.28
68	600316	洪都航空	3,707	144,795.42	0.28
69	002078	太阳纸业	12,559	144,302.91	0.28
70	600141	兴发集团	3,808	144,247.04	0.28
71	000738	航发控制	4,759	144,102.52	0.28
72	002212	天融信	7,462	143,046.54	0.28
73	600039	四川路桥	11,879	143,023.16	0.28
74	600739	辽宁成大	7,294	142,378.88	0.28
75	600862	中航高科	3,936	140,751.36	0.28
76	600132	重庆啤酒	925	139,971.00	0.27
77	600486	扬农化工	1,066	139,859.20	0.27
78	000830	鲁西化工	9,134	139,384.84	0.27
79	000623	吉林敖东	7,531	139,097.57	0.27
80	600516	方大炭素	12,840	138,928.80	0.27
81	000825	太钢不锈	19,300	135,872.00	0.27
82	000983	山西焦煤	16,319	134,958.13	0.26
83	600875	东方电气	6,276	134,431.92	0.26
84	600038	中直股份	1,674	134,422.20	0.26
85	000629	攀钢钒钛	34,246	133,216.94	0.26
86	600779	水井坊	1,109	133,068.91	0.26
87	002131	利欧股份	54,079	133,034.34	0.26
88	002603	以岭药业	6,738	132,064.80	0.26
89	002092	中泰化学	13,783	131,489.82	0.26

90	002831	裕同科技	3,865	130,211.85	0.25
91	000887	中鼎股份	5,915	129,006.15	0.25
92	000750	国海证券	31,357	128,877.27	0.25
93	002683	宏大爆破	4,240	127,708.80	0.25
94	603077	和邦生物	37,309	127,223.69	0.25
95	300070	碧水源	17,691	127,198.29	0.25
96	002056	横店东磁	6,719	126,787.53	0.25
97	000400	许继电气	4,812	125,593.20	0.25
98	601689	拓普集团	2,360	125,080.00	0.24
99	601099	太平洋	38,006	124,659.68	0.24
100	600754	锦江酒店	2,103	123,235.80	0.24
101	603290	斯达半导	323	123,063.00	0.24
102	002372	伟星新材	5,028	122,280.96	0.24
103	300009	安科生物	9,335	122,195.15	0.24
104	000513	丽珠集团	3,027	121,715.67	0.24
105	600348	华阳股份	10,211	121,000.35	0.24
106	002299	圣农发展	4,998	120,801.66	0.24
107	603882	金域医学	1,083	120,613.71	0.24
108	603737	三棵树	861	119,808.15	0.23
109	600529	山东药玻	2,718	119,320.20	0.23
110	300001	特锐德	4,783	118,953.21	0.23
111	600188	兖矿能源	5,025	118,238.25	0.23
112	300244	迪安诊断	3,520	118,166.40	0.23
113	000975	银泰黄金	13,354	117,248.12	0.23
114	002572	索菲亚	5,272	117,038.40	0.23
115	002221	东华能源	9,274	116,759.66	0.23
116	300630	普利制药	2,118	116,574.72	0.23
117	600733	北汽蓝谷	11,560	115,831.20	0.23
118	300115	长盈精密	5,806	115,191.04	0.23
119	002152	广电运通	9,600	114,240.00	0.22
120	300212	易华录	3,220	113,827.00	0.22
121	002500	山西证券	17,213	113,605.80	0.22
122	300026	红日药业	14,400	112,752.00	0.22
123	000021	深科技	7,112	112,654.08	0.22
124	300024	机器人	10,003	111,733.51	0.22
125	000537	广宇发展	4,615	111,221.50	0.22
126	601799	星宇股份	542	110,703.50	0.22
127	000999	华润三九	3,223	110,355.52	0.22
128	002506	协鑫集成	29,017	110,264.60	0.22
129	000012	南玻A	11,100	110,223.00	0.22
130	000970	中科三环	6,862	110,135.10	0.22
131	601866	中远海发	33,627	109,287.75	0.21

132	000878	云南铜业	8,155	109,032.35	0.21
133	300315	掌趣科技	22,126	107,532.36	0.21
134	000997	新大陆	5,917	107,216.04	0.21
135	002195	二三四五	45,749	107,052.66	0.21
136	600549	厦门钨业	4,727	106,972.01	0.21
137	002250	联化科技	5,937	106,687.89	0.21
138	002019	亿帆医药	6,045	106,512.90	0.21
139	002191	劲嘉股份	6,993	105,804.09	0.21
140	002249	大洋电机	11,992	105,409.68	0.21
141	601128	常熟银行	15,941	105,370.01	0.21
142	300017	网宿科技	15,725	105,200.25	0.21
143	002156	通富微电	5,397	104,863.71	0.21
144	300182	捷成股份	16,475	104,286.75	0.20
145	600201	生物股份	6,344	103,724.40	0.20
146	002926	华西证券	10,411	102,548.35	0.20
147	600699	均胜电子	4,613	101,347.61	0.20
148	000050	深天马A	7,769	101,152.38	0.20
149	600273	嘉化能源	8,668	100,288.76	0.20
150	600879	航天电子	12,122	99,885.28	0.20
151	300002	神州泰岳	15,713	99,463.29	0.19
152	600642	申能股份	13,436	99,023.32	0.19
153	603198	迎驾贡酒	1,420	98,619.00	0.19
154	000686	东北证券	11,219	98,502.82	0.19
155	000060	中金岭南	20,032	98,357.12	0.19
156	600372	中航电子	4,383	98,135.37	0.19
157	000930	中粮科技	9,018	98,025.66	0.19
158	600160	巨化股份	7,585	97,922.35	0.19
159	002266	浙富控股	13,712	97,629.44	0.19
160	002203	海亮股份	7,840	97,451.20	0.19
161	300618	寒锐钴业	1,204	96,536.72	0.19
162	002002	鸿达兴业	15,863	96,129.78	0.19
163	000729	燕京啤酒	11,263	95,397.61	0.19
164	002701	奥瑞金	13,561	94,927.00	0.19
165	601966	玲珑轮胎	2,597	94,920.35	0.19
166	002920	德赛西威	668	94,528.68	0.18
167	603345	安井食品	551	94,099.78	0.18
168	002373	千方科技	6,287	93,990.65	0.18
169	300463	迈克生物	3,215	93,845.85	0.18
170	601615	明阳智能	3,589	93,672.90	0.18
171	002966	苏州银行	13,757	93,134.89	0.18
172	601997	贵阳银行	14,294	93,053.94	0.18
173	000027	深圳能源	11,443	92,688.30	0.18

174	002004	华邦健康	12,772	92,469.28	0.18
175	002294	信立泰	3,348	91,467.36	0.18
176	002010	传化智联	10,452	90,932.40	0.18
177	000401	冀东水泥	7,596	90,848.16	0.18
178	000598	兴蓉环境	14,348	90,679.36	0.18
179	300595	欧普康视	1,580	90,644.60	0.18
180	002368	太极股份	3,290	90,606.60	0.18
181	002595	豪迈科技	3,261	90,525.36	0.18
182	002791	坚朗五金	498	90,431.82	0.18
183	603816	顾家家居	1,172	90,431.52	0.18
184	002128	电投能源	6,076	90,228.60	0.18
185	002745	木林森	5,959	90,159.67	0.18
186	002174	游族网络	5,904	89,976.96	0.18
187	300072	三聚环保	11,273	89,394.89	0.17
188	600170	上海建工	24,797	89,269.20	0.17
189	600859	王府井	3,306	89,262.00	0.17
190	002670	国盛金控	9,294	89,222.40	0.17
191	002396	星网锐捷	3,769	88,835.33	0.17
192	000540	中天金融	33,640	88,809.60	0.17
193	600166	福田汽车	25,707	88,432.08	0.17
194	600867	通化东宝	8,033	88,041.68	0.17
195	002511	中顺洁柔	5,250	87,727.50	0.17
196	002048	宁波华翔	4,032	87,212.16	0.17
197	600143	金发科技	6,921	87,066.18	0.17
198	000581	威孚高科	4,041	87,043.14	0.17
199	002568	百润股份	1,444	86,394.52	0.17
200	300168	万达信息	6,562	85,437.24	0.17
201	002690	美亚光电	2,261	84,697.06	0.17
202	600079	人福医药	3,758	84,630.16	0.17
203	300482	万孚生物	2,143	84,391.34	0.17
204	600153	建发股份	9,296	84,314.72	0.16
205	600021	上海电力	6,572	84,253.04	0.16
206	002434	万里扬	5,709	84,150.66	0.16
207	600380	健康元	6,550	84,102.00	0.16
208	600008	首创环保	24,580	83,817.80	0.16
209	002075	沙钢股份	14,324	83,508.92	0.16
210	000709	河钢股份	33,855	83,283.30	0.16
211	000778	新兴铸管	19,142	82,884.86	0.16
212	000690	宝新能源	13,987	82,803.04	0.16
213	600171	上海贝岭	3,225	82,753.50	0.16
214	688029	南微医学	386	82,090.62	0.16
215	000883	湖北能源	15,566	81,565.84	0.16

216	600580	卧龙电驱	4,448	81,353.92	0.16
217	600535	天士力	5,119	81,136.15	0.16
218	002382	蓝帆医疗	4,944	80,537.76	0.16
219	000681	视觉中国	3,353	80,136.70	0.16
220	000877	天山股份	5,230	80,071.30	0.16
221	600315	上海家化	1,976	79,850.16	0.16
222	002081	金螳螂	13,103	79,666.24	0.16
223	300376	易事特	7,923	79,626.15	0.16
224	000990	诚志股份	5,016	79,353.12	0.16
225	002985	北摩高科	657	79,142.22	0.15
226	002183	怡亚通	11,935	79,009.70	0.15
227	002281	光迅科技	3,353	78,091.37	0.15
228	002505	鹏都农牧	20,122	76,866.04	0.15
229	601699	潞安环能	6,769	76,557.39	0.15
230	000932	华菱钢铁	14,776	75,505.36	0.15
231	600409	三友化工	8,659	75,333.30	0.15
232	000488	晨鸣纸业	10,394	75,252.56	0.15
233	603568	伟明环保	2,050	74,886.50	0.15
234	600673	东阳光	8,427	74,831.76	0.15
235	600801	华新水泥	3,872	74,729.60	0.15
236	600704	物产中大	12,574	74,438.08	0.15
237	000959	首钢股份	12,890	73,859.70	0.14
238	600415	小商品城	15,158	73,516.30	0.14
239	601865	福莱特	1,264	73,236.16	0.14
240	600258	首旅酒店	2,793	72,981.09	0.14
241	300166	东方国信	6,720	72,576.00	0.14
242	000898	鞍钢股份	19,269	72,258.75	0.14
243	600398	海澜之家	11,033	70,721.53	0.14
244	002429	兆驰股份	14,408	70,022.88	0.14
245	002155	湖南黄金	6,710	69,515.60	0.14
246	002124	天邦股份	10,784	69,448.96	0.14
247	600282	南钢股份	18,759	69,408.30	0.14
248	002390	信邦制药	9,324	69,184.08	0.14
249	600839	四川长虹	20,733	68,626.23	0.13
250	603858	步长制药	3,251	68,563.59	0.13
251	600155	华创阳安	6,865	68,375.40	0.13
252	001914	招商积余	3,368	68,235.68	0.13
253	600511	国药股份	2,159	68,073.27	0.13
254	600435	北方导航	6,347	67,785.96	0.13
255	601717	郑煤机	5,847	67,766.73	0.13
256	002085	万丰奥威	12,336	67,724.64	0.13
257	600667	太极实业	8,363	67,573.04	0.13

258	300133	华策影视	9,933	67,246.41	0.13
259	000559	万向钱潮	10,529	67,069.73	0.13
260	600970	中材国际	5,838	66,728.34	0.13
261	002110	三钢闽光	9,793	66,592.40	0.13
262	600728	佳都科技	7,961	66,315.13	0.13
263	600895	张江高科	4,398	66,233.88	0.13
264	600500	中化国际	7,735	66,211.60	0.13
265	600718	东软集团	4,847	65,725.32	0.13
266	601992	金隅集团	23,073	65,527.32	0.13
267	600338	西藏珠峰	1,735	65,340.10	0.13
268	300271	华宇软件	5,139	65,265.30	0.13
269	600497	驰宏锌锗	12,870	64,221.30	0.13
270	002925	盈趣科技	1,887	64,214.61	0.13
271	000528	柳工	8,311	64,077.81	0.13
272	002705	新宝股份	2,589	63,948.30	0.13
273	600216	浙江医药	3,744	63,947.52	0.13
274	601127	小康股份	1,072	63,837.60	0.12
275	601005	重庆钢铁	30,367	63,467.03	0.12
276	601179	中国西电	11,427	63,419.85	0.12
277	002317	众生药业	5,218	63,085.62	0.12
278	000685	中山公用	7,115	62,967.75	0.12
279	603866	桃李面包	2,212	62,820.80	0.12
280	002867	周大生	3,491	62,069.98	0.12
281	600528	中铁工业	7,515	61,698.15	0.12
282	603883	老百姓	1,249	61,675.62	0.12
283	000090	天健集团	10,504	61,658.48	0.12
284	600598	北大荒	4,207	61,253.92	0.12
285	000758	中色股份	11,142	60,835.32	0.12
286	002233	塔牌集团	5,728	60,602.24	0.12
287	002387	维信诺	6,520	60,505.60	0.12
288	600827	百联股份	4,531	60,398.23	0.12
289	000089	深圳机场	8,175	59,841.00	0.12
290	603885	吉祥航空	3,350	59,462.50	0.12
291	002416	爱施德	5,177	58,914.26	0.12
292	002244	滨江集团	12,630	58,855.80	0.12
293	600881	亚泰集团	18,096	58,812.00	0.12
294	600060	海信视像	4,358	58,615.10	0.11
295	002242	九阳股份	2,524	58,556.80	0.11
296	600567	山鹰国际	17,755	58,413.95	0.11
297	603605	珀莱雅	280	58,326.80	0.11
298	002839	张家港行	10,078	58,049.28	0.11
299	600158	中体产业	3,833	57,954.96	0.11

300	000415	渤海租赁	19,821	57,679.11	0.11
301	000718	苏宁环球	12,151	57,231.21	0.11
302	688088	虹软科技	1,294	57,013.64	0.11
303	603338	浙江鼎力	705	56,583.30	0.11
304	600967	内蒙一机	4,731	56,535.45	0.11
305	603927	中科软	2,056	56,252.16	0.11
306	600737	中粮糖业	5,967	56,089.80	0.11
307	000967	盈峰环境	7,621	55,861.93	0.11
308	600820	隧道股份	10,296	55,392.48	0.11
309	600325	华发股份	9,181	55,269.62	0.11
310	002458	益生股份	4,872	55,102.32	0.11
311	300113	顺网科技	3,348	54,605.88	0.11
312	601016	节能风电	8,364	54,449.64	0.11
313	600022	山东钢铁	30,409	54,432.11	0.11
314	000402	金融街	9,575	54,194.50	0.11
315	600755	厦门国贸	7,484	53,959.64	0.11
316	002064	华峰化学	5,163	53,901.72	0.11
317	002038	双鹭药业	4,960	53,617.60	0.10
318	601106	中国一重	15,364	53,466.72	0.10
319	300257	开山股份	3,289	52,229.32	0.10
320	002399	海普瑞	3,037	51,932.70	0.10
321	600572	康恩贝	10,367	51,835.00	0.10
322	002440	闰土股份	5,402	51,805.18	0.10
323	603228	景旺电子	1,500	51,795.00	0.10
324	002563	森马服饰	6,676	51,605.48	0.10
325	600597	光明乳业	3,550	51,546.00	0.10
326	600259	广晟有色	1,046	51,505.04	0.10
327	000563	陕国投A	15,911	51,392.53	0.10
328	600863	内蒙华电	13,032	51,346.08	0.10
329	600329	中新药业	1,632	51,261.12	0.10
330	603650	彤程新材	1,016	51,125.12	0.10
331	601118	海南橡胶	9,681	51,115.68	0.10
332	601000	唐山港	18,500	50,875.00	0.10
333	601880	辽港股份	29,158	50,443.34	0.10
334	600804	鹏博士	8,060	49,972.00	0.10
335	600811	东方集团	16,599	49,962.99	0.10
336	300180	华峰超纤	9,856	49,575.68	0.10
337	002815	崇达技术	2,934	49,437.90	0.10
338	600808	马钢股份	13,285	49,021.65	0.10
339	002936	郑州银行	15,460	48,853.60	0.10
340	601200	上海环境	3,844	48,395.96	0.09
341	000028	国药一致	1,292	47,778.16	0.09

342	600373	中文传媒	3,852	47,610.72	0.09
343	600782	新钢股份	8,934	47,171.52	0.09
344	600037	歌华有线	5,421	47,054.28	0.09
345	600507	方大特钢	6,002	46,815.60	0.09
346	603712	七一二	1,077	46,634.10	0.09
347	000078	海王生物	13,144	46,398.32	0.09
348	600566	济川药业	1,637	46,392.58	0.09
349	600167	联美控股	5,145	46,356.45	0.09
350	000937	冀中能源	8,405	46,311.55	0.09
351	600446	金证股份	3,230	46,253.60	0.09
352	601456	国联证券	3,303	46,142.91	0.09
353	600645	中源协和	1,818	45,886.32	0.09
354	000717	韶钢松山	9,638	45,780.50	0.09
355	600908	无锡银行	8,059	45,694.53	0.09
356	600026	中远海能	7,668	45,394.56	0.09
357	600064	南京高科	4,833	45,140.22	0.09
358	600195	中牧股份	3,436	44,908.52	0.09
359	603000	人民网	3,075	44,341.50	0.09
360	000062	深圳华强	2,568	44,246.64	0.09
361	002468	申通快递	4,835	43,950.15	0.09
362	601611	中国核建	4,398	43,848.06	0.09
363	600927	永安期货	1,161	43,560.72	0.09
364	601608	中信重工	9,662	43,092.52	0.08
365	600120	浙江东方	9,746	43,077.32	0.08
366	002424	贵州百灵	5,668	43,076.80	0.08
367	601333	广深铁路	19,028	42,622.72	0.08
368	600312	平高电气	4,569	41,532.21	0.08
369	002583	海能达	7,504	41,422.08	0.08
370	600410	华胜天成	6,110	41,364.70	0.08
371	600582	天地科技	9,429	41,299.02	0.08
372	600707	彩虹股份	6,028	41,110.96	0.08
373	002375	亚厦股份	5,417	40,573.33	0.08
374	601598	中国外运	8,958	40,131.84	0.08
375	603638	艾迪精密	1,252	39,963.84	0.08
376	601778	晶科科技	4,642	39,596.26	0.08
377	002635	安洁科技	2,313	39,390.39	0.08
378	000501	鄂武商A	3,745	39,359.95	0.08
379	605499	东鹏饮料	216	39,277.44	0.08
380	600633	浙数文化	4,445	39,160.45	0.08
381	600062	华润双鹤	2,928	39,147.36	0.08
382	600376	首开股份	6,892	39,008.72	0.08
383	601975	招商南油	19,401	38,996.01	0.08

384	000031	大悦城	10,420	38,866.60	0.08
385	600131	国网信通	1,775	38,783.75	0.08
386	601098	中南传媒	4,033	38,595.81	0.08
387	600307	酒钢宏兴	17,438	38,363.60	0.08
388	000156	华数传媒	4,475	37,858.50	0.07
389	601958	金钼股份	5,405	37,024.25	0.07
390	600901	江苏租赁	7,263	36,968.67	0.07
391	600935	华塑股份	4,812	36,763.68	0.07
392	300459	汤姆猫	6,606	36,663.30	0.07
393	600959	江苏有线	11,075	36,436.75	0.07
394	688321	微芯生物	1,036	36,270.36	0.07
395	600546	山煤国际	4,389	36,033.69	0.07
396	000869	张裕A	1,131	36,033.66	0.07
397	600388	龙净环保	4,176	35,997.12	0.07
398	603225	新凤鸣	2,403	35,684.55	0.07
399	600277	亿利洁能	6,710	35,361.70	0.07
400	600056	中国医药	2,987	35,276.47	0.07
401	000061	农产品	5,455	34,857.45	0.07
402	601860	紫金银行	10,187	34,126.45	0.07
403	600126	杭钢股份	6,591	33,811.83	0.07
404	600717	天津港	8,064	33,788.16	0.07
405	600266	城建发展	7,478	33,651.00	0.07
406	601928	凤凰传媒	4,139	33,484.51	0.07
407	002302	西部建设	4,134	33,196.02	0.06
408	600968	海油发展	11,283	33,059.19	0.06
409	601718	际华集团	10,967	32,681.66	0.06
410	002807	江阴银行	8,470	32,609.50	0.06
411	600729	重庆百货	1,249	32,498.98	0.06
412	600928	西安银行	7,388	31,768.40	0.06
413	600094	大名城	8,902	31,513.08	0.06
414	600776	东方通信	2,723	31,341.73	0.06
415	600006	东风汽车	4,526	30,822.06	0.06
416	002544	杰赛科技	1,294	30,719.56	0.06
417	600787	中储股份	4,895	30,544.80	0.06
418	000826	启迪环境	6,842	30,446.90	0.06
419	002948	青岛银行	6,513	30,155.19	0.06
420	000553	安道麦A	3,526	29,759.44	0.06
421	000813	德展健康	7,294	29,686.58	0.06
422	600643	爱建集团	4,390	29,676.40	0.06
423	600649	城投控股	7,200	29,592.00	0.06
424	601139	深圳燃气	3,280	28,962.40	0.06
425	600869	远东股份	4,198	28,882.24	0.06

426	600835	上海机电	1,802	28,687.84	0.06
427	600648	外高桥	2,139	28,298.97	0.06
428	600623	华谊集团	3,107	28,273.70	0.06
429	002653	海思科	1,351	27,560.40	0.05
430	603888	新华网	1,159	27,537.84	0.05
431	600640	新国脉	1,793	27,343.25	0.05
432	601969	海南矿业	2,201	26,434.01	0.05
433	001317	三羊马	300	25,722.00	0.05
434	601869	长飞光纤	763	24,980.62	0.05
435	002217	合力泰	7,041	24,573.09	0.05
436	603786	科博达	305	24,491.50	0.05
437	600764	中国海防	600	24,396.00	0.05
438	603317	天味食品	902	24,182.62	0.05
439	002419	天虹股份	3,846	24,152.88	0.05
440	603379	三美股份	1,056	24,055.68	0.05
441	600639	浦东金桥	1,877	23,969.29	0.05
442	000543	皖能电力	4,303	23,924.68	0.05
443	002946	新乳业	1,499	23,894.06	0.05
444	688590	新致软件	1,292	23,746.96	0.05
445	300010	豆神教育	5,648	23,665.12	0.05
446	000046	泛海控股	12,410	23,330.80	0.05
447	601228	广州港	6,960	23,176.80	0.05
448	601298	青岛港	3,962	22,543.78	0.04
449	601828	美凯龙	2,554	22,500.74	0.04
450	600871	石化油服	10,494	22,457.16	0.04
451	603708	家家悦	1,336	22,231.04	0.04
452	600985	淮北矿业	1,931	21,588.58	0.04
453	601825	沪农商行	3,198	21,586.50	0.04
454	000008	神州高铁	7,291	21,435.54	0.04
455	002901	大博医疗	407	20,602.34	0.04
456	600675	中华企业	6,818	20,522.18	0.04
457	600955	维远股份	447	20,396.61	0.04
458	600664	哈药股份	5,682	20,171.10	0.04
459	600823	世茂股份	6,144	20,152.32	0.04
460	600073	上海梅林	2,450	19,820.50	0.04
461	600556	天下秀	1,585	19,574.75	0.04
462	603355	莱克电气	656	19,233.92	0.04
463	603515	欧普照明	904	18,767.04	0.04
464	300134	大富科技	1,476	18,656.64	0.04
465	600350	山东高速	3,509	18,106.44	0.04
466	600657	信达地产	4,786	17,851.78	0.03
467	000732	泰禾集团	8,074	17,843.54	0.03

468	300324	旋极信息	4,605	17,683.20	0.03
469	603056	德邦股份	1,728	17,677.44	0.03
470	601801	皖新传媒	3,380	17,542.20	0.03
471	600466	蓝光发展	8,495	17,329.80	0.03
472	002818	富森美	1,327	16,600.77	0.03
473	002589	瑞康医药	3,989	15,676.77	0.03
474	601003	柳钢股份	2,982	15,566.04	0.03
475	001218	丽臣实业	350	15,267.00	0.03
476	600517	国网英大	2,033	14,820.57	0.03
477	600748	上实发展	3,476	14,077.80	0.03
478	600575	淮河能源	5,828	13,987.20	0.03
479	000600	建投能源	2,743	13,961.87	0.03
480	603868	飞科电器	320	13,894.40	0.03
481	600956	新天绿能	800	13,768.00	0.03
482	002051	中工国际	1,921	13,735.15	0.03
483	001872	招商港口	800	13,560.00	0.03
484	605567	春雪食品	629	13,397.70	0.03
485	600903	贵州燃气	1,354	13,106.72	0.03
486	600545	卓郎智能	4,324	13,015.24	0.03
487	002093	国脉科技	1,958	12,903.22	0.03
488	603719	良品铺子	303	12,868.41	0.03
489	603328	依顿电子	1,577	12,616.00	0.02
490	603377	东方时尚	1,388	12,450.36	0.02
491	002423	中粮资本	1,500	12,150.00	0.02
492	688557	兰剑智能	437	12,017.50	0.02
493	601068	中铝国际	1,846	11,260.60	0.02
494	001296	长江材料	188	11,144.64	0.02
495	603213	镇洋发展	479	11,093.64	0.02
496	002503	搜于特	6,959	10,995.22	0.02
497	603983	丸美股份	345	10,995.15	0.02
498	605296	神农集团	255	10,279.05	0.02
499	002957	科瑞技术	400	10,172.00	0.02
500	603048	浙江黎明	309	8,961.00	0.02
501	603256	宏和科技	1,020	8,731.20	0.02
502	605507	国邦医药	301	8,677.83	0.02
503	002941	新疆交建	701	8,475.09	0.02
504	001213	中铁特货	1,309	7,932.54	0.02
505	600053	九鼎投资	506	7,898.66	0.02
506	605020	永和股份	257	7,889.90	0.02
507	601665	齐鲁银行	1,390	7,756.20	0.02
508	001219	青岛食品	245	7,497.00	0.01
509	001208	华菱线缆	447	6,629.01	0.01

510	601528	瑞丰银行	563	6,350.64	0.01
511	603171	税友股份	180	6,336.00	0.01
512	603511	爱慕股份	254	6,024.88	0.01
513	600917	重庆燃气	677	5,680.03	0.01
514	001217	华尔泰	294	5,677.14	0.01
515	001288	运机集团	314	5,592.34	0.01
516	001210	金房节能	148	5,252.52	0.01
517	605138	盛泰集团	434	5,242.72	0.01
518	603216	梦天家居	203	5,133.87	0.01
519	601512	中新集团	557	5,040.85	0.01
520	605566	福莱茵特	152	4,664.88	0.01
521	001234	泰慕士	194	3,206.82	0.01
522	605011	杭州热电	152	3,201.12	0.01

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	600089	特变电工	1,097,220.00	1.07
2	600219	南山铝业	723,485.00	0.71
3	603589	口子窖	675,286.00	0.66
4	603345	安井食品	634,849.00	0.62
5	688002	睿创微纳	628,490.68	0.61
6	601997	贵阳银行	556,384.00	0.54
7	600038	中直股份	500,555.00	0.49
8	600867	通化东宝	489,999.00	0.48
9	603737	三棵树	465,797.84	0.45
10	600516	方大炭素	456,284.00	0.44
11	688099	晶晨股份	439,229.23	0.43
12	600372	中航电子	425,661.00	0.41
13	002568	百润股份	408,895.00	0.40
14	603638	艾迪精密	378,367.00	0.37
15	600170	上海建工	370,700.00	0.36
16	300274	阳光电源	357,923.00	0.35
17	688088	虹软科技	353,940.00	0.35
18	601992	金隅集团	338,394.00	0.33
19	603290	斯达半导	320,427.00	0.31
20	002791	坚朗五金	319,201.00	0.31

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

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	300274	阳光电源	1,253,158.12	1.22
2	600426	华鲁恒升	1,236,735.16	1.21
3	600143	金发科技	1,092,327.72	1.06
4	601995	中金公司	1,051,473.10	1.02
5	600089	特变电工	1,006,542.37	0.98
6	603882	金域医学	918,343.04	0.90
7	600739	辽宁成大	891,707.77	0.87
8	600132	重庆啤酒	884,505.78	0.86
9	603806	福斯特	767,212.57	0.75
10	601233	桐昆股份	753,665.75	0.73
11	600298	安琪酵母	744,989.20	0.73
12	603486	科沃斯	721,987.77	0.70
13	601799	星宇股份	717,020.22	0.70
14	600161	天坛生物	699,884.04	0.68
15	603517	绝味食品	698,533.28	0.68
16	600079	人福医药	694,420.78	0.68
17	601966	玲珑轮胎	677,448.56	0.66
18	600885	宏发股份	639,058.64	0.62
19	601168	西部矿业	638,493.62	0.62
20	603345	安井食品	635,223.04	0.62

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

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	39,038,893.73
卖出股票收入（成交）总额	99,810,635.37

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、债转股及行权等获得的股票。

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	2,695,950.00	5.27
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）	795,855.10	1.56
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,491,805.10	6.83

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	019658	21 国债 10	27,000	2,695,950.00	5.27
2	113602	景 20 转债	5,000	716,750.00	1.40
3	113052	兴业转债	490	49,000.00	0.10
4	110083	苏租转债	120	14,109.60	0.03
5	110082	宏发转债	80	11,107.20	0.02

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：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

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定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	2,455.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,467.45
5	应收申购款	279.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,202.44

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	113602	景 20 转债	716,750.00	1.40

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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

由于计算中四舍五入的原因，本报告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 (%)
华富华鑫灵活配置混合 A	206	125,662.86	21,747,316.40	84.01	4,139,233.17	15.99
华	199	21,548.68	0.00	0	4,288,186.86	100

富 华 鑫 灵 活 配 置 混 合 C						
合 计	405	74,505.52	21,747,316.40	72.07	8,427,420.03	27.93

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

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

注：本报告期末基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2016年11月11日)基金份额总额	408,167,084.54	179,267,613.14
本报告期期初基金份额总额	63,455,741.11	5,016,579.96
本报告期基金总申购份额	19,160,327.29	656,575.89
减：本报告期基金总赎回份额	56,729,518.83	1,384,968.99
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	25,886,549.57	4,288,186.86

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 2021 年 1 月 28 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘尹培俊先生为华富安华债券型证券投资基金基金经理。
2. 2021 年 3 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陈奇先生为华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
3. 2021 年 3 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣女士为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
4. 2021 年 3 月 26 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，张亮先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
5. 2021 年 3 月 26 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，张亮先生不再担任华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
6. 2021 年 5 月 7 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘李孝华先生为华富中证 100 指数证券投资基金基金经理。
7. 2021 年 6 月 15 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘郜哲先生为华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
8. 2021 年 6 月 28 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘李孝华先生为华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
9. 2021 年 6 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘张娅女士为华富新能源股票型发起式证券投资基金基金经理。
10. 2021 年 6 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘郜哲先生为华富新能源股票型发起式证券投资基金基金经理。
11. 2021 年 8 月 11 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘郜哲先生为华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
12. 2021 年 8 月 11 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘李孝华先生为华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
13. 2021 年 8 月 16 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘

张惠女士为华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

14. 2021 年 8 月 16 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘倪莉莎女士为华富天盈货币市场基金基金经理。

15. 2021 年 8 月 20 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，陶祺先生不再担任华富货币市场基金基金经理的职务。

16. 2021 年 8 月 20 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，陶祺先生不再担任华富天盈货币市场基金基金经理的职务。

17. 2021 年 8 月 20 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，陶祺先生不再担任华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理的职务。

18. 2021 年 8 月 20 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，陶祺先生不再担任华富恒盛纯债债券型证券投资基金基金经理的职务。

19. 2021 年 8 月 20 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，陶祺先生不再担任华富恒欣纯债债券型证券投资基金基金经理的职务。

20. 2021 年 8 月 20 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，陶祺先生不再担任华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理的职务。

21. 2021 年 8 月 20 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，陶祺先生不再担任华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理的职务。

22. 2021 年 8 月 26 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘尹培俊先生为华富安盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理。

23. 2021 年 9 月 14 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陈奇先生为华富新能源股票型发起式证券投资基金基金经理。

24. 2021 年 9 月 15 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘尤之奇先生为华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。

25. 2021 年 9 月 15 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘郜哲先生为华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。

26. 2021 年 9 月 23 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘龚炜先生为华富国潮优选混合型发起式证券投资基金基金经理。

27. 2021 年 10 月 14 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，尹培俊先生不再担任华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

28. 2021 年 10 月 14 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增

聘姚姣女士为华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

29. 2021 年 10 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘王羿伟先生为华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理。

30. 2021 年 11 月 8 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘尹培俊先生为华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理。

31. 2021 年 11 月 8 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘倪莉莎女士为华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理。

32. 2021 年 11 月 10 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，郇彬先生不再担任华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理的职务。

33. 2021 年 11 月 10 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘廖庆阳先生为华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

34. 2021 年 11 月 17 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘李孝华先生为华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金基金经理。

35. 2021 年 11 月 17 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，高靖瑜女士不再担任华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

36. 2021 年 11 月 18 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，郜哲先生不再担任华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金基金经理的职务。

37. 2021 年 12 月 1 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘倪莉莎女士为华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

38. 2021 年 12 月 13 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣女士为华富天盈货币市场基金基金经理。

39. 2021 年 12 月 13 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣女士为华富货币市场基金基金经理。

40. 2021 年 12 月 20 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘尤之奇先生为华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。

41. 2021 年 12 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘倪莉莎女士为华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。

42. 2021 年 12 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘沈成先生为华富新能源股票型发起式证券投资基金基金经理。

43. 本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。本基金本年度需支付给审计机构天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 5 万元人民币。天健会计师事务所（特殊普通合伙）从 2012 年起为本公司提供审计服务。

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

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

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	
华西证券	1	88,643,896.85	65.96%	82,554.28	66.35%	-
海通证券	1	22,667,781.54	16.87%	20,657.34	16.60%	-
申万宏源	1	13,007,535.79	9.68%	11,853.81	9.53%	-
西南证券	2	9,170,729.27	6.82%	8,540.65	6.86%	-
安信证券	1	523,015.48	0.39%	476.63	0.38%	-
华安证券	2	337,440.29	0.25%	307.52	0.25%	-
招商证券	2	24,691.52	0.02%	23.00	0.02%	-
天风证券	1	7,021.50	0.01%	6.54	0.01%	-
德邦证券	1	3,116,099.07	2.27%	2,901.97	2.28%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-

太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1)根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）， 我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的券商租用了基金专用交易单元。

2)本基金本报告期新增德邦证券、西南证券各一个交易单元，退租华信证券一个交易单元。

3)此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华西证券	33,527.00	0.29%	-	-	-	-
海通证券	2,063,291.31	17.94%	350,000.00	77.78%	-	-
申万宏源	2,721,294.68	23.66%	-	-	-	-
西南证券	1,634,002.90	14.21%	-	-	-	-
安信证券	1,803,574.00	15.68%	-	-	-	-
华安证券	151,110.00	1.31%	100,000.00	22.22%	-	-
招商证券	3,094,095.00	26.90%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：债券交易的成交金额按净价统计，其中交易所上市实行全价交易的债券成交金额按全价统计。

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	华富基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 12 月 10 日
2	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2021 年 11 月 30 日
3	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2021 年 11 月 30 日
4	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会指定媒介	2021 年 11 月 30 日
5	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与国信证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 11 月 4 日
6	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与新时代证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 11 月 4 日
7	华富基金管理有限公司旗下基金 2021 年第三季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 10 月 26 日
8	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第三季度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 10 月 26 日
9	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2021 年 10 月 16 日更新)	中国证监会指定媒介	2021 年 10 月 18 日
10	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2021 年 10 月 18 日
11	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2021 年 10 月 18 日
12	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2021 年 10 月 18 日
13	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2021 年 10 月 16 日
14	华富基金管理有限公司澄清公告	中国证监会指定媒介	2021 年 10 月 9 日
15	华富基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 9 月 1 日
16	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会指定媒介	2021 年 8 月 31 日
17	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与中信证券股份有限公司等代销机构费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 8 月 25 日
18	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 7 月 22 日
19	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 7 月 21 日
20	华富基金管理有限公司旗下全部基金	中国证监会指定媒介	2021 年 7 月 21 日

	2021 年第二季度报告提示性公告		
21	华富基金管理有限公司关于开通机构版网上交易的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 7 月 19 日
22	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 6 月 30 日
23	华富基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第一季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 23 日
24	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 22 日
25	华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 1 日
26	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 31 日
27	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与国金证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 26 日
28	华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 2 月 23 日
29	华富基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 26 日
30	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 22 日
31	华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 22 日
32	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2021 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 4 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2021. 1. 1-2021. 12. 31	10, 130, 699. 09	0. 00	0. 00	10, 130, 699. 09	33. 57

	2	2021.5.25-20 21.12.31	0.00	14,983,061.8 9	7,000,000.00	7,983,061.89	26.46
产品特有风险							
无							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2022年3月31日