

华富益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	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	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	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	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
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	19
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	20
§ 7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告	56

8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
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	74
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	74
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	74
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	74
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
8.12 投资组合报告附注	75
§ 9 基金份额持有人信息	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
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	77
§ 10 开放式基金份额变动	77
§ 11 重大事件揭示	78
11.1 基金份额持有人大会决议	78
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	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4 基金投资策略的改变	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
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	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
11.8 其他重大事件	82
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	84
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	84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	85
§ 13 备查文件目录	85
13.1 备查文件目录	85
13.2 存放地点	85
13.3 查阅方式	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华富益鑫灵活配置混合	
基金主代码	002728	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年9月7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	611,929,075.30份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	002728	002729
报告期末下属分级基金的份额总额	264,137,113.76份	347,791,961.54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	《上海证券报》
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	
	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C
本期已实现收益	33,163,374.25	25,220,813.48	28,812,769.46	23,027,928.89	11,564,965.95	14,279,274.04
本期利润	22,176,317.77	18,809,529.49	44,290,044.14	30,892,470.56	14,837,148.25	18,554,841.89
加权平均基金份额本期利润	0.0769	0.0717	0.2024	0.1667	0.1541	0.1468
本期加权平均净值利润	5.96%	5.77%	16.13%	13.76%	12.70%	12.37%

率						
本期基金份额净值增长率	6.24%	5.95%	14.28%	14.08%	10.80%	10.44%
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	65,861,467.13	70,921,786.09	81,406,897.29	48,861,800.43	29,839,898.42	35,700,140.83
期末可供分配基金份额利润	0.2493	0.2039	0.2506	0.2113	0.2176	0.1849
期末基金资产净值	336,916,110.11	427,555,664.47	424,933,260.54	293,012,341.61	170,165,828.69	233,082,058.34
期末基金份额净值	1.276	1.229	1.308	1.267	1.241	1.207
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	69.68%	64.78%	59.72%	55.52%	39.76%	36.32%

注：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

华富益鑫灵活配置混合 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	2.00%	0.14%	1.32%	0.40%	0.68%	-0.26%
过去六个月	3.70%	0.20%	-1.38%	0.51%	5.08%	-0.31%
过去一年	6.24%	0.22%	-0.18%	0.59%	6.42%	-0.37%
过去三年	34.51%	0.27%	38.14%	0.64%	-3.63%	-0.37%
过去五年	71.57%	0.25%	36.78%	0.60%	34.79%	-0.35%
自基金合同生效起至今	69.68%	0.26%	36.40%	0.59%	33.28%	-0.33%

华富益鑫灵活配置混合 C

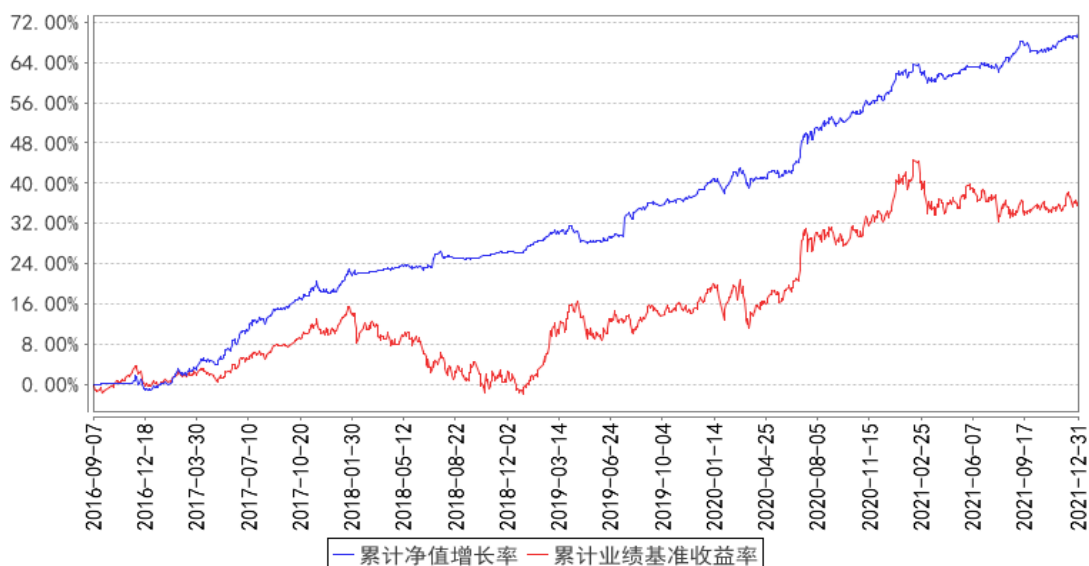
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.91%	0.14%	1.32%	0.40%	0.59%	-0.26%
过去六个月	3.58%	0.19%	-1.38%	0.51%	4.96%	-0.32%

过去一年	5.95%	0.22%	-0.18%	0.59%	6.13%	-0.37%
过去三年	33.49%	0.26%	38.14%	0.64%	-4.65%	-0.38%
过去五年	66.61%	0.25%	36.78%	0.60%	29.83%	-0.35%
自基金合同生效起 至今	64.78%	0.25%	36.40%	0.59%	28.38%	-0.34%

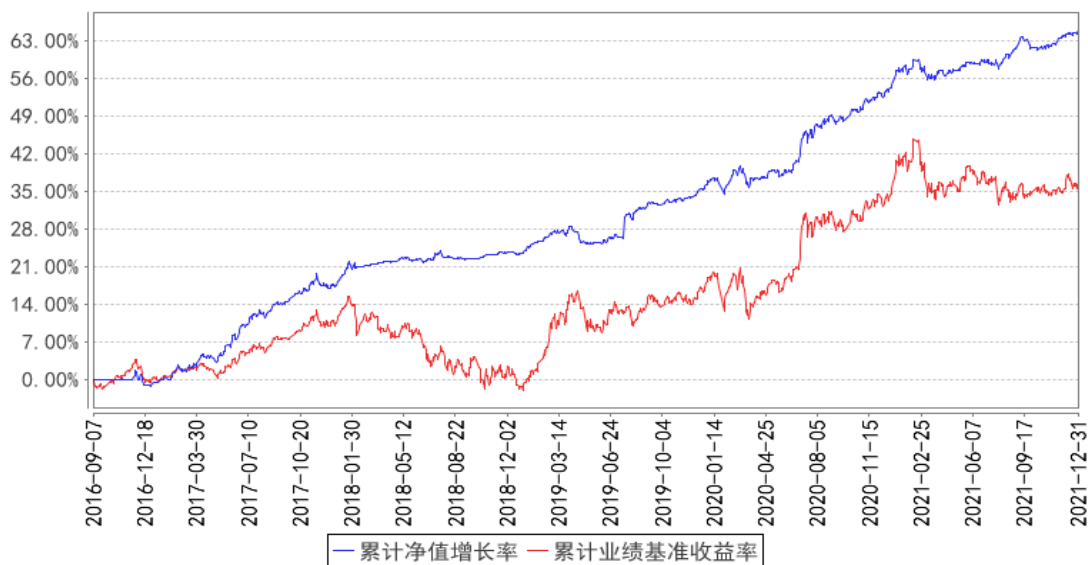
注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%。

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

华富益鑫灵活配置混合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



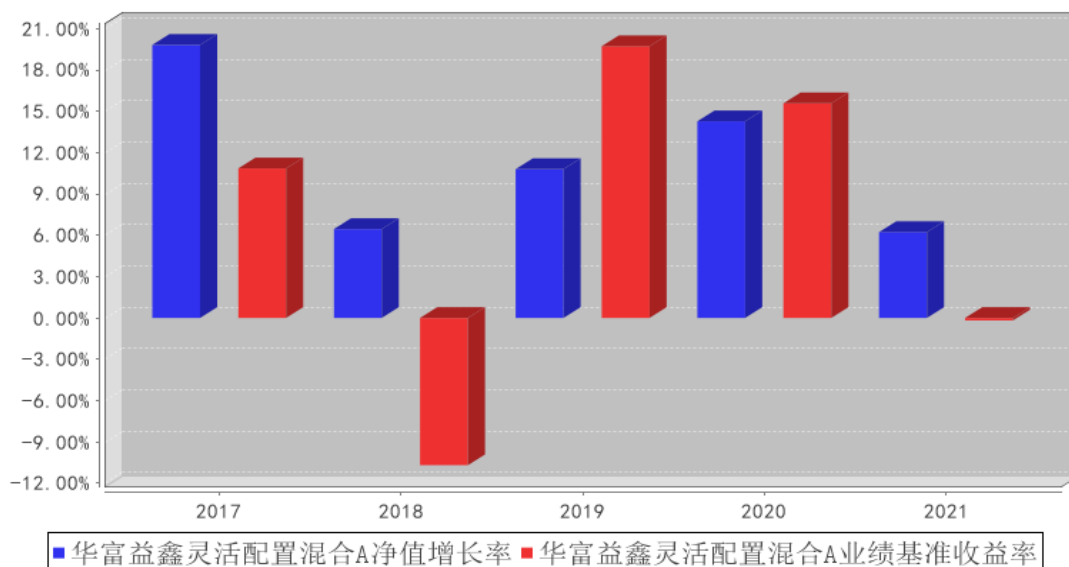
华富益鑫灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



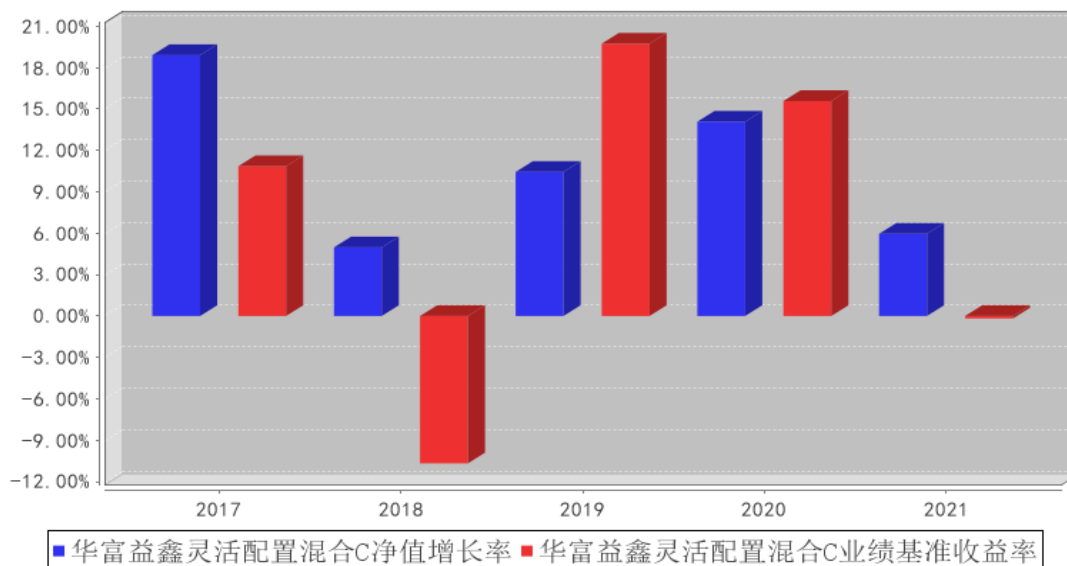
注：根据《华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票资产占基金资产的 0%-95%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为 2016 年 9 月 7 日到 2017 年 3 月 7 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

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

华富益鑫灵活配置混合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



华富益鑫灵活配置混合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

单位：人民币元

华富益鑫灵活配置混合 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	1.100	20,021,446.41	9,313,130.69	29,334,577.10	-
2020 年	1.000	17,278,660.54	1,024,603.29	18,303,263.83	-
2019 年	0.910	7,981,557.89	15,923.83	7,997,481.72	-
合计	3.010	45,281,664.84	10,353,657.81	55,635,322.65	-

华富益鑫灵活配置混合 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	1.100	25,404,621.07	3,099,328.73	28,503,949.80	-
2020 年	1.000	16,189,785.60	1,783,547.89	17,973,333.49	-
2019 年	0.910	9,881,962.07	2,114,631.88	11,996,593.95	-
合计	3.010	51,476,368.74	6,997,508.50	58,473,877.24	-

§ 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 日在上海正式注册成立。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		
张惠	本基金基金经理、固定收益部总监助理	2016年9月7日	-	十四年	合肥工业大学产业经济学硕士、研究生学历，2007年6月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部助理行业研究员、行业研究员，固定收益部固收研究员、基金经理助理，自2014年11月19日起任华富保本混合型证券投资基金基金经理，自2015年8月31日起任华富恒利债券型证券投资基金基金经理，自2016年9月7日起任华富益鑫灵活配置混合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日起任华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2019年4月2日起任华富安福债券型证券投资基金基金经理，自2019年4月15日起任华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2019年6月12日起任华富安鑫债券型证券投资基金基金经理，自2020年11月9日起任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2021年8月16日起任华富63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，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合规守信情况的说明

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，国内经济走势呈现“前高后低”，基本符合年初市场的主流预期。但下半年以来，经济在需求收缩、供给冲击、预期转弱的三重压力下快速降温，略超出了年初市场的预期。需求端方面来看，受制于“消费潜在增长率下降”、“动态清零式防疫政策”、“消费场景缺失”等因素，2021 年消费整体疲软，实际社会零售总额增速于年底下探至负区间。同时投资增速也出现下行，全年在严厉的房地产调控措施影响下，商品房销售增速逐步回落，并于下半年落入负区间。受此影响，不少民营房企爆发了信用危机，对应同期的房地产投资出现了明显的回落。供给侧方面来看，2021 年全球供应链仍然维持紧张，国际大宗商品价格出现明显回升，推动国内 PPI 同比增速攀升至 13.5%，创有数据以来的新高。但随着国内煤炭产能逐步释放，能源供给不足的问题在四季度有所缓解，PPI 同比增速随之见顶回落。2021 年以来，统计局 PMI 指数基本呈现单边回落的态势。特别是 9 月、10 月，在限电限产的影响下，PMI 指数一度下探至荣枯线以下，经济预期整体偏弱。四季度，宏观政策提出跨周期调节，PMI 指数于年底小幅回升，经济下行预期有所企稳。

宏观政策方面，2021 年上半年，政治局会议强调“经济处于稳增长压力比较小的窗口期”，货币政策与财政政策保持平稳。但进入下半年后，随着经济下行压力不断加大，央行超预期进行了两次降准及多次再贷款，财政政策也逐步发力，地方债发行出现提速。

海外方面，全年来看，虽然疫情随着病毒变异有所反复，但是随着疫苗覆盖、群体免疫等多样防疫政策，海外各国均不同程度地恢复生产。由于资源国与消费国疫后恢复节奏不同，资源品供给恢复速度显著慢于需求恢复速度同时叠加各国央行宽松的货币政策，全球范围内多种商品价格均创新高。由于通胀压力的加大，美联储政策出现预期中的边际转向。

从国内资本市场的表现来看，回顾 2021 年，债券市场呈现慢牛的特征，全年收益率有所下行。具体来说，春节前，资金面超预期紧张，资金利率创下 2013 年以来的新高，债券市场出现恐慌，收益率大幅上行。但好在春节后，央行持续释放资金面稳定的信号，市场情绪有所修复，收益率转为下行。特别是 7 月上旬央行超预期降准后，债券市场对经济下行的预期开始升温，收益率持续回落。年末由于国内对商品价格进行干预后通胀压力缓解，叠加流动性平稳充裕、海外变异毒株引发全球风险偏好收缩，收益率再次下行。股票市场全年出现巨大分化，维持了结构性行情。春节前抱团白马股行情演绎相对极致，春节后随着通胀高企、海外流动性预计改变、高估值资产出现波动，A 股抱团瓦解，此后行情进入分化阶段，热门赛道、资源股、专精特新小巨人均有表现，全年来看，21 年电力设备新能源指数涨逾 56%、煤炭、钢铁、有色金属、化工等周期板块也均涨幅逾 40%，而相对地，价值与消费板块非银金融、家电、消费者服务板块跌幅均超 20%。转债

市场则是全年表现最亮眼的资产。随着权益市场风格切换，龙头抱团瓦解、中小成长风格提高，以及债券市场走强、固收+基金发行热度上行等因素，可转债估值与正股双升，全年中证转债指数上行逾 18%，呈现了转债牛市行情。

回顾 2021 年，在流动性预期持续宽松的宏观环境下，考虑股债性价比相对均衡，本基金全年超配了风险资产，中性配置了债券资产。权益资产方面一方面配置了部分高景气度成长型行业一方面配置了部分低估值的稳定增长型行业，同时积极参与科创板和创业板新股以获取超额收益。债券资产方面继续配置高等级短久期的债券，以获取票息为主适度杠杆增厚为辅的策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富益鑫 A 份额净值为 1.276 元，累计份额净值为 1.632 元。本报告期的基金份额净值增长率为 6.24%，同期业绩比较基准收益率为-0.18 %。截止本期末，华富益鑫 C 份额净值为 1.229 元，累计份额净值为 1.585 元。本报告期的基金份额净值增长率为 5.95%，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 2022 年，地产投资短期仍将惯性回落、疫情对消费的制约缓慢恢复，海外经济景气度高位回落导致出口增速易下难上，全年来看经济下行压力依然较大。从年末年初的各项政策会议表述来看 2022 年宏观政策、产业政策将逐步转向稳增长，地产政策或回归中性，财政政策或前置发力，货币政策或更加积极，因此我们预计经济大概率不会单边回落。海外方面，随着新冠口服药的上市、Omicron 毒株的重症率下降、非发达国家疫苗接种跟上，全球各地疫情限制逐渐打开，同时由于通胀压力高企美联储加息预期显著提前，英国央行与欧央行边际收紧，海外多数发达国家货币政策均出现转向。此外，俄罗斯与乌克兰地缘政治危机升级、年末美国总统中期选举，国际政治也存在较多不确定性。

展望 2022 年，考虑到经济仍有较大的下行压力，预计货币政策将保持平稳偏松的状态，流动性将保持合理充裕，银行间利率仍将围绕政策利率上下波动，对应债券市场预计保持平稳偏强。权益市场则面临整体业绩增速逐步下行，但全 A 非金融、石油石化的估值依然低于历史均值，在国内经济下行压力大、稳增长动力强，以及海外流动性收紧的环境下，A 股不具备大幅上行的条件但系统性风险也有限，仍需把握业绩增长相对占优的板块，一方面在估值相对偏高的高景气赛道中审慎筛选，另一方面寻找稳增长、疫情压制反转、原材料价格压制边际缓解等板块。可转债市场在经过一年的上行之，整体转股溢价率、纯债溢价率以及隐含波动率均在高位，市场整体有一定风险。

在资产配置上，对于利率债，目前市场最大的支撑在于流动性合理充裕，同时稳增长背景下，市场预期货币政策将进一步宽松，可能推动债券市场维持强势。但考虑到收益率已经下行至历史偏低的水平，利率债整体性价比较前期有所弱化。在赔率走低、胜率犹在的环境下，对一季度利率债行情持偏中性的态度。对于风险资产，面临着海外宽松政策退出的压力与国内稳增长背景下双宽政策的预期相互的矛盾，整体风险与机会并存。在经济下行压力凸显国内稳增长预期升温，财政发力货币宽松的预期下，传统的顺周期行业有望阶段性占优。但是从中长期维度看，我们依然看好碳中和背景下新能源行业的中长线机会、制造业补短板、智能化推进、以及一些行业的政策纠偏带来的机会。

本基金短期仍将维持中性的风险资产配置思路，主要根据公司盈利和估值匹配程度来进行个股的选择，转债资产主要以低估值银行公用事业为主要配置方向；纯债部分将继续保持以获取票息收入为主的中短久期债券配置思路。中期而言，将考虑逐步增加偏债品种配置，股票仓位仍会坚持以基本面和业绩驱动为主的投资理念，寻找具有估值优势或拥有优势赛道具备长期成长性的企业。本基金仍将坚持在较低风险程度下，认真研究各个投资领域潜在的机会，相对积极地做好配置策略，均衡投资，降低业绩波动，力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021 年度，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《华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 40,985,847.26 元，期末可供分配利润为 136,783,253.22 元。本报告期内共进行两次利润分配，分配金额合计为 57,838,526.90 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国工商银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华富益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

本报告期内华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华富基金管理有限公司在华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 2 次利润分配，分配金额合计为 57,838,526.90 元。

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）6-99 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	华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称华富益鑫灵活基金）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。</p> <p>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，公允反映了华富益鑫灵活基金 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华富益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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估华富益鑫灵活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，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层（以下简称治理层）负责监督华富益鑫灵活基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（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</p>

	<p>上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(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。</p> <p>(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华富益鑫灵活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华富益鑫灵活基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就基金的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	樊冬 朱慧
会计师事务所的地址	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号新湖商贸大厦 6 楼
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：华富益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	3,056,263.94	1,462,825.42
结算备付金		950,202.22	2,399,320.74
存出保证金		21,264.46	32,017.14
交易性金融资产	7.4.7.2	799,292,523.16	773,707,691.82
其中：股票投资		145,365,302.36	140,269,237.46
基金投资		-	-
债券投资		653,927,220.80	633,438,454.36
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		-	248,469.69
应收利息	7.4.7.5	8,695,169.20	9,842,945.87
应收股利		-	-
应收申购款		423,392.61	461,520.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		812,438,815.59	788,154,791.64
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		46,000,000.00	69,000,000.00
应付证券清算款		1,023,542.93	511,214.64
应付赎回款		117,448.22	3,701.34
应付管理人报酬		386,566.41	336,987.19
应付托管费		96,641.61	84,246.80
应付销售服务费		72,862.11	45,174.70
应付交易费用	7.4.7.7	47,702.87	18,575.07
应交税费		44,452.95	45,604.82
应付利息		-21,188.70	-25,315.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	199,012.61	189,000.00
负债合计		47,967,041.01	70,209,189.49
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	611,929,075.30	556,152,550.30
未分配利润	7.4.7.10	152,542,699.28	161,793,051.85
所有者权益合计		764,471,774.58	717,945,602.15
负债和所有者权益总计		812,438,815.59	788,154,791.64

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，华富益鑫灵活配置混合 A 基金份额净值 1.276 元，基金份额总额 264,137,113.76 份；华富益鑫灵活配置混合 C 基金份额净值 1.229 元，基金份额总额 347,791,961.54 份。华富益鑫灵活配置混合份额总额合计为 611,929,075.30 份。

报表附注为财务报表的组成部分。

7.2 利润表

会计主体：华富益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		49,491,574.34	80,778,188.08
1. 利息收入		21,671,981.42	14,103,361.72
其中：存款利息收入	7.4.7.11	131,431.60	93,860.54
债券利息收入		21,532,718.58	13,952,931.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,831.24	56,569.32
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		45,062,225.66	43,251,508.74
其中：股票投资收益	7.4.7.12	47,144,033.55	42,206,912.74
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-5,742,345.52	-1,722,665.92
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	3,660,537.63	2,767,261.92
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-17,398,340.47	23,341,816.35
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	155,707.73	81,501.27
减：二、费用		8,505,727.08	5,595,673.38
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,194,218.54	2,980,202.17
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,048,554.59	745,050.55
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	652,943.51	449,424.52
4. 交易费用	7.4.7.19	1,023,657.61	675,378.11
5. 利息支出		1,277,239.31	475,141.68
其中：卖出回购金融资产支出		1,277,239.31	475,141.68
6. 税金及附加		71,263.41	44,445.73
7. 其他费用	7.4.7.20	237,850.11	226,030.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,985,847.26	75,182,514.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		40,985,847.26	75,182,514.70

号填列)			
------	--	--	--

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：华富益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）	556,152,550.30	161,793,051.85	717,945,602.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,985,847.26	40,985,847.26
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）	55,776,525.00	7,602,327.07	63,378,852.07
其中：1. 基金申购款	366,436,654.89	94,966,097.11	461,402,752.00
2. 基金赎回款	-310,660,129.89	-87,363,770.04	-398,023,899.93
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）	-	-57,838,526.90	-57,838,526.90
五、期末所有者权益（基金净值）	611,929,075.30	152,542,699.28	764,471,774.58
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）	330,211,808.03	73,036,079.00	403,247,887.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	75,182,514.70	75,182,514.70

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）	225,940,742.27	49,851,055.47	275,791,797.74
其中：1. 基金申购款	582,457,394.41	130,110,261.04	712,567,655.45
2. 基金赎回款	-356,516,652.14	-80,259,205.57	-436,775,857.71
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）	-	-36,276,597.32	-36,276,597.32
五、期末所有者权益（基金净值）	556,152,550.30	161,793,051.85	717,945,602.15

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：

赵万里

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

华富益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]852号）核准，基金合同于2016年9月7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）6-134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《华富益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，包括国内依法公开发行上市股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票）、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、中小企业私募债等）、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

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

- 1) 对于特殊事项停牌股票，本基金根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告〔2008〕38号），参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》进行估值。
- 2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》（基金部通知〔2006〕37号），若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。
- 3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字〔2007〕21号）采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限公司独立提供。

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%的征收率缴纳增值税。

(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	3,056,263.94	1,462,825.42
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	3,056,263.94	1,462,825.42

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	134,930,400.26	145,365,302.36	10,434,902.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	188,629,550.02	189,342,220.80
	银行间市场	462,114,913.18	464,585,000.00
	合计	650,744,463.20	653,927,220.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	785,674,863.46	799,292,523.16	13,617,659.70
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	105,605,580.19	140,269,237.46	34,663,657.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	384,438,876.76	381,427,454.36
	银行间市场	252,647,234.70	252,011,000.00
	合计	637,086,111.46	633,438,454.36
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	742,691,691.65	773,707,691.82	31,016,000.17

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：本基金本报告期末和上年度末无买入返售金融资产余额。

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	291.06	1,605.29
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	470.36	1,187.67
应收债券利息	8,694,397.22	9,840,137.07
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	10.56	15.84
合计	8,695,169.20	9,842,945.87

注：本表列示的“应收其他存款利息”所列金额为应收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；“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	45,797.87	16,390.34
银行间市场应付交易费用	1,905.00	2,184.73
合计	47,702.87	18,575.07

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	12.61	-
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	70,000.00	60,000.00
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	199,012.61	189,000.00
----	------------	------------

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华富益鑫灵活配置混合 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	324,876,014.38	324,876,014.38
本期申购	103,943,095.92	103,943,095.92
本期赎回(以“-”号填列)	-164,681,996.54	-164,681,996.54
-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	264,137,113.76	264,137,113.76

华富益鑫灵活配置混合 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	231,276,535.92	231,276,535.92
本期申购	262,493,558.97	262,493,558.97
本期赎回(以“-”号填列)	-145,978,133.35	-145,978,133.35
-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	347,791,961.54	347,791,961.54

注：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

华富益鑫灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	81,406,897.29	18,650,348.87	100,057,246.16
本期利润	33,163,374.25	-10,987,056.48	22,176,317.77
本期基金份额 交易产生的变动数	-19,374,227.31	-745,763.17	-20,119,990.48
其中：基金申 购款	26,573,233.57	2,744,666.32	29,317,899.89
基金赎 回款	-45,947,460.88	-3,490,429.49	-49,437,890.37

本期已分配利润	-29,334,577.10	-	-29,334,577.10
本期末	65,861,467.13	6,917,529.22	72,778,996.35

华富益鑫灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	48,861,800.43	12,874,005.26	61,735,805.69
本期利润	25,220,813.48	-6,411,283.99	18,809,529.49
本期基金份额交易产生的变动数	25,343,121.98	2,379,195.57	27,722,317.55
其中：基金申购款	58,997,394.14	6,650,803.08	65,648,197.22
基金赎回款	-33,654,272.16	-4,271,607.51	-37,925,879.67
本期已分配利润	-28,503,949.80	-	-28,503,949.80
本期末	70,921,786.09	8,841,916.84	79,763,702.93

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	36,344.75	36,501.55
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	91,887.35	33,605.84
其他	3,199.50	23,753.15
合计	131,431.60	93,860.54

注：本期“其他”为直销申购款利息收入 2,706.11 元及结算保证金利息收入 493.39 元；上年度可比期间“其他”为直销申购款利息收入 23,363.43 元及结算保证金利息收入 389.72 元。

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	47,144,033.55	42,206,912.74
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	47,144,033.55	42,206,912.74

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	331,521,043.32	199,559,988.31
减：卖出股票成本总 额	284,377,009.77	157,353,075.57
买卖股票差价收入	47,144,033.55	42,206,912.74

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	-5,742,345.52	-1,722,665.92
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	-5,742,345.52	-1,722,665.92

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	662,442,894.51	522,897,718.80

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	648,840,905.02	514,244,235.07
减：应收利息总额	19,344,335.01	10,376,149.65
买卖债券差价收入	-5,742,345.52	-1,722,665.92

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	3,660,537.63	2,767,261.92
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,660,537.63	2,767,261.92

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	-17,398,340.47	23,341,816.35
股票投资	-24,228,755.17	28,750,469.63
债券投资	6,830,414.70	-5,408,653.28
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	-17,398,340.47	23,341,816.35

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	155,358.73	81,501.27
基金转换费收入	349.00	-
合计	155,707.73	81,501.27

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	1,018,707.61	669,353.11
银行间市场交易费用	4,950.00	6,025.00
合计	1,023,657.61	675,378.11

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	70,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	10,650.11	8,830.62
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	237,850.11	226,030.62

注：本基金本期与上年度可比期间其他所列金额为上清所查询服务费。

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

截至本报告批准报出日，无重大资产负债表日后事项中的非调整事项。

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	基金托管人

行”)	
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	19,307,862.45	3.14	122,259,223.51	34.18

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	-	-	823,570.40	0.18

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	-	-	459,200,000.00	8.40

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	17,595.24	3.11	-	-
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	113,745.19	34.33	-	-

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	4,194,218.54
其中：支付销售机构的客户维护费	206,466.97	29,900.78

注：注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.6%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	1,048,554.59

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方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C	合计
华安证券	-	267.77	267.77
华富基金管理有限公司	-	484,247.80	484,247.80
合计	-	484,515.57	484,515.57
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		
	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C	合计
华安证券	-	64.10	64.10
华富基金管理有限公司	-	432,744.55	432,744.55
合计	-	432,808.65	432,808.65

注：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 $H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$ （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

注：本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期和上年度可比期基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

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	3,056,263.94	36,344.75	1,462,825.42	36,501.55

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

单位：人民币元

华富益鑫灵活配置混合 A								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021年3月26日	-	2021年3月26日	0.500	10,933,690.01	4,947,314.53	15,881,004.54	-
2	2021年9月24日	-	2021年9月24日	0.600	9,087,756.40	4,365,816.16	13,453,572.56	-
合计	-	-	-	1.100	20,021,446.41	9,313,130.69	29,334,577.10	-

华富益鑫灵活配置混合 C								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 3 月 26 日	-	2021 年 3 月 26 日	0.500	9,094,479.97	869,977.09	9,964,457.06	-
2	2021 年 9 月 24 日	-	2021 年 9 月 24 日	0.600	16,310,141.10	2,229,351.64	18,539,492.74	-
合计	-	-	-	1.100	25,404,621.07	3,099,328.73	28,503,949.80	-

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 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 16 日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股流通受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客	2021	2022	新股流	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-

	文化	年 7 月 6 日	年 1 月 24 日	通受限						
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股流 通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 19 日	新股流 通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301035	润丰股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 1 月 28 日	新股流 通受限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 16 日	新股流 通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新股流 通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股流 通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	新股流 通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 11 日	新股流 通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股流 通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 28 日	新股流 通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股流 通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股流 通受限	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	新股流 通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021 年 8 月 26 日	2022 年 3 月 7 日	新股流 通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-

301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-

301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股流通受限	93.09	75.34	411	38,259.99	30,964.74	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股流通受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股流通受限	10.45	11.22	2,323	24,275.35	26,064.06	-
301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	新股流通受限	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股流通受限	79.60	78.53	184	14,646.40	14,449.52	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股流通受限	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股流通受限	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股流通受限	57.27	53.71	266	15,233.82	14,286.86	-
301111	粤万	2021	2022	新股流	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-

	年青	年 11 月 30 日	年 6 月 7 日	通受限							
301118	恒光股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-	
301126	达嘉维康	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股流通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-	
301133	金钟股份	2021 年 11 月 19 日	2022 年 5 月 26 日	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-	
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 7 月 11 日	新股流通受限	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-	
301155	海力风电	2021 年 11 月 17 日	2022 年 5 月 24 日	新股流通受限	60.66	96.75	515	31,239.90	49,826.25	-	
301166	优宁维	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股流通受限	86.06	94.50	236	20,310.16	22,302.00	-	
301168	通灵股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	新股流通受限	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-	
301177	迪阿股份	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股流通受限	116.88	116.08	317	37,050.96	36,797.36	-	
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-	
301180	万祥科技	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 16 日	新股流通受限	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-	
301182	凯旺科技	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 23 日	新股流通受限	27.12	30.58	290	7,864.80	8,868.20	-	
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月	2022 年 5 月	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-	

		月 11 日	19 日							
301189	奥尼电子	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股流通受限	66.18	56.62	334	22,104.12	18,911.08	-
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 9 日	新股流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301199	迈赫股份	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股流通受限	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301211	亨迪药业	2021 年 12 月 14 日	2022 年 6 月 22 日	新股流通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301221	光庭信息	2021 年 12 月 15 日	2022 年 6 月 22 日	新股流通受限	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
601728	中国电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	非公开发行流通受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688071	华依科技	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新股流通受限	13.73	62.31	1,101	15,116.73	68,603.31	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 10 日	新股流通受限	21.96	93.40	2,469	54,219.24	230,604.60	-
688112	鼎阳科技	2021 年 11 月 24 日	2022 年 6 月 1 日	新股流通受限	46.60	80.05	4,901	228,386.60	392,325.05	-
688187	时代电气	2021 年 8 月 30 日	2022 年 3 月 7 日	新股流通受限	31.38	76.65	11,344	355,974.72	869,517.60	-
688206	概伦电子	2021 年 12 月 20 日	2022 年 6 月 28 日	新股流通受限	28.28	33.01	6,000	169,680.00	198,060.00	-

		日								
688210	统联精密	2021年12月20日	2022年6月27日	新股流通受限	42.76	39.53	2,218	94,841.68	87,677.54	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股流通受限	41.98	41.98	5,767	242,098.66	242,098.66	-
688766	普冉股份	2021年8月12日	2022年2月23日	新股流通受限	148.90	342.73	704	104,825.60	241,281.92	-
688793	倍轻松	2021年7月7日	2022年1月17日	新股流通受限	27.40	101.73	1,454	39,839.60	147,915.42	-

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	7,490	749,000.00	749,000.00	-
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	80	8,000.00	8,000.00	-

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	9,000	244,800.84	271,080.00	-

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银行间市场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

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 46,000,000.00 元，于 2022 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	10,000,000.00	20,051,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	10,028,000.00
合计	10,000,000.00	30,079,000.00

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括短期融资券等债券基金可投资的短期信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。信用等级按期末评级结果列示。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	19,480,000.00	-
合计	19,480,000.00	-

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	407,008,081.12	593,023,767.80
AAA 以下	13,469,322.78	2,963,436.56
未评级	171,665,000.00	0.00
合计	592,142,403.90	595,987,204.36

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

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	19,480,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	19,480,000.00	-

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。

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	3,056,263.9	-	-	-	-	-	3,056,263.9

	4						94
结算备付金	950,202.22	-	-	-	-	-	950,202.22
存出保证金	21,264.46	-	-	-	-	-	21,264.46
交易性金融资产	50,914,794.50	789,616.24	23,654,839.24	578,567,970.82		145,365,302.36	799,292,523.16
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	8,695,169.20	8,695,169.20
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	423,392.61	423,392.61
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	54,942,525.12	789,616.24	23,654,839.24	578,567,970.82		154,483,864.17	812,438,815.59
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	117,448.22	117,448.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	386,566.41	386,566.41
应付托管费	-	-	-	-	-	96,641.61	96,641.61
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,023,542.93	1,023,542.93
卖出回购金融资产款	46,000,000.00	-	-	-	-	-	46,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	72,862.11	72,862.11
应付交易费用	-	-	-	-	-	47,702.87	47,702.87
应付利息	-	-	-	-	-	-21,188.70	-21,188.70
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	44,452.95	44,452.95
其他负债	-	-	-	-	-	199,012.61	199,012.61
负债总计	46,000,000.00	-	-	-	-	1,967,041.01	47,967,041.01
利率敏感度缺口	8,942,525.12	789,616.24	23,654,839.24	578,567,970.82		152,516,823.16	764,471,774.58
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	1,462,825.42	-	-	-	-	-	1,462,825.42
结算备付金	2,399,320.74	-	-	-	-	-	2,399,320.74
存出保证金	32,017.14	-	-	-	-	-	32,017.14
交易性金融资产	55,199,500.00	40,207,000.00	455,928,985.14	82,102,969.22	-	140,269,237.46	773,707,691.82
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	9,842,945.87	9,842,945.87
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	461,520.96	461,520.96
应收证券清算款	-	-	-	-	-	248,469.69	248,469.69
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	59,093,663.30	40,207,000.00	455,928,985.14	82,102,969.22	-	150,822,173.98	788,154,791.64
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,701.34	3,701.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	336,987.19	336,987.19
应付托管费	-	-	-	-	-	84,246.80	84,246.80
应付证券清算款	-	-	-	-	-	511,214.64	511,214.64
卖出回购金融资产款	69,000,000.00	-	-	-	-	-	69,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	45,174.70	45,174.70
应付交易费用	-	-	-	-	-	18,575.07	18,575.07
应付利息	-	-	-	-	-	-25,315.07	-25,315.07
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	45,604.82	45,604.82
其他负债	-	-	-	-	-	189,000.00	189,000.00
负债总计	69,000,000.00	-	-	-	-	1,209,189.49	70,209,189.49
利率敏感度缺口	-9,906,336.70	40,207,000.00	455,928,985.14	82,102,969.22	-	149,612,984.49	717,945,602.15

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	2,654,515.38	1,204,799.94
	市场利率上升 25 基点	-2,654,515.38	-1,202,266.19

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	145,365,302.36	19.02	140,269,237.46	19.54
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	653,927,220.80	85.54	633,438,454.36	88.23
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	799,292,523.16	104.55	773,707,691.82	107.77

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	758,996.83	1,574,142.96
	沪深 300 指数下降百分之五	-758,996.83	-1,574,142.96

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	45,134,681.39

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 145,658,611.28 元，第二层次的余额为 648,767,949.49 元，第三层次的余额为 4,865,962.39 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次：135,594,352.14 元，第二层次：

638,113,339.68 元，第三层次：无)。

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

于 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 4,865,962.39 元(2020 年 12 月 31 日：无)，购买第三层次的金融工具 3,440,262.37 元，计入当期损益的利得或损失(公允价值变动损益等项目)的金额为 1,425,700.02 元(2020 年 12 月 31 日：无)。上述第三层次金融工具均为股票投资，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(2020 年 12 月 31 日：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	145,365,302.36	17.89
	其中：股票	145,365,302.36	17.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	653,927,220.80	80.49
	其中：债券	653,927,220.80	80.49
	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	4,006,466.16	0.49
8	其他各项资产	9,139,826.27	1.12
9	合计	812,438,815.59	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	1,601,397.50	0.21
B	采矿业	5,307,186.00	0.69
C	制造业	89,240,555.10	11.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,121,668.13	0.93
E	建筑业	2,659,582.11	0.35
F	批发和零售业	4,753,372.32	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	2,510,415.82	0.33
H	住宿和餐饮业	736,053.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,925,977.12	1.82
J	金融业	6,953,984.27	0.91
K	房地产业	3,663,949.65	0.48
L	租赁和商务服务业	1,759,158.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	615,734.92	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	1,277,770.71	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	69,069.00	0.01
Q	卫生和社会工作	310,220.78	0.04
R	文化、体育和娱乐业	1,825,242.93	0.24
S	综合	1,033,965.00	0.14
	合计	145,365,302.36	19.02

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沪港通投资股票

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	600905	三峡能源	426,963	3,206,492.13	0.42
2	601728	中国电信	562,873	2,413,599.43	0.32
3	600089	特变电工	79,000	1,672,430.00	0.22
4	002709	天赐材料	11,500	1,318,475.00	0.17
5	002074	国轩高科	20,600	1,055,750.00	0.14
6	002340	格林美	96,100	994,635.00	0.13
7	000799	酒鬼酒	4,600	977,500.00	0.13
8	600460	士兰微	17,800	964,760.00	0.13
9	300316	晶盛机电	12,900	896,550.00	0.12
10	688187	时代电气	11,344	869,517.60	0.11
11	300207	欣旺达	19,700	830,552.00	0.11
12	600885	宏发股份	11,100	828,504.00	0.11
13	600884	杉杉股份	24,200	793,034.00	0.10
14	000009	中国宝安	51,900	748,917.00	0.10
15	603486	科沃斯	4,900	739,655.00	0.10
16	601233	桐昆股份	34,100	722,238.00	0.09
17	600219	南山铝业	152,600	718,746.00	0.09
18	002013	中航机电	39,000	709,020.00	0.09
19	002385	大北农	66,600	698,634.00	0.09
20	000723	美锦能源	43,000	697,890.00	0.09
21	300285	国瓷材料	16,200	689,634.00	0.09
22	600563	法拉电子	2,900	673,960.00	0.09
23	002268	卫士通	11,900	665,686.00	0.09
24	300088	长信科技	49,400	656,032.00	0.09
25	300037	新宙邦	5,800	655,400.00	0.09
26	002625	光启技术	26,000	624,260.00	0.08
27	601117	中国化学	52,000	624,000.00	0.08
28	002180	纳思达	13,000	620,880.00	0.08
29	002028	思源电气	12,200	600,362.00	0.08
30	601636	旗滨集团	34,300	586,530.00	0.08
31	300253	卫宁健康	34,300	574,868.00	0.08
32	600765	中航重机	11,200	565,488.00	0.07
33	600256	广汇能源	86,300	564,402.00	0.07
34	000988	华工科技	20,200	562,772.00	0.07
35	002185	华天科技	44,100	560,511.00	0.07
36	688099	晶晨股份	4,251	553,480.20	0.07
37	002648	卫星化学	13,800	552,414.00	0.07
38	601168	西部矿业	40,500	551,205.00	0.07
39	603589	口子窖	7,700	545,699.00	0.07
40	601615	明阳智能	20,800	542,880.00	0.07
41	600141	兴发集团	14,300	541,684.00	0.07

42	002223	鱼跃医疗	14,100	532,980.00	0.07
43	300699	光威复材	6,300	532,224.00	0.07
44	600862	中航高科	14,800	529,248.00	0.07
45	600516	方大炭素	48,600	525,852.00	0.07
46	600486	扬农化工	4,000	524,800.00	0.07
47	601127	小康股份	8,700	518,085.00	0.07
48	000630	铜陵有色	148,300	516,084.00	0.07
49	600392	盛和资源	26,100	512,082.00	0.07
50	300223	北京君正	3,800	509,200.00	0.07
51	600038	中直股份	6,300	505,890.00	0.07
52	600875	东方电气	23,600	505,512.00	0.07
53	600779	水井坊	4,200	503,958.00	0.07
54	601689	拓普集团	9,400	498,200.00	0.07
55	002138	顺络电子	13,000	496,340.00	0.06
56	002797	第一创业	67,600	494,832.00	0.06
57	000998	隆平高科	21,200	493,112.00	0.06
58	603893	瑞芯微	3,600	492,840.00	0.06
59	600418	江淮汽车	28,200	490,680.00	0.06
60	300308	中际旭创	11,500	488,750.00	0.06
61	601099	太平洋	145,200	476,256.00	0.06
62	300146	汤臣倍健	17,100	461,016.00	0.06
63	002353	杰瑞股份	11,500	460,000.00	0.06
64	002080	中材科技	13,500	459,270.00	0.06
65	600754	锦江酒店	7,800	457,080.00	0.06
66	600733	北汽蓝谷	45,600	456,912.00	0.06
67	002212	天融信	23,800	456,246.00	0.06
68	600487	亨通光电	30,100	455,112.00	0.06
69	688425	铁建重工	89,518	453,856.26	0.06
70	600188	兖矿能源	19,000	447,070.00	0.06
71	603737	三棵树	3,200	445,280.00	0.06
72	600739	辽宁成大	22,800	445,056.00	0.06
73	600529	山东药玻	10,100	443,390.00	0.06
74	603605	珀莱雅	2,100	437,451.00	0.06
75	002422	科伦药业	22,900	433,497.00	0.06
76	000547	航天发展	25,800	430,860.00	0.06
77	300058	蓝色光标	40,100	430,273.00	0.06
78	000636	风华高科	14,400	429,120.00	0.06
79	002439	启明星辰	15,000	427,950.00	0.06
80	603260	合盛硅业	3,200	422,304.00	0.06
81	000807	云铝股份	37,700	421,109.00	0.06
82	002444	巨星科技	13,800	421,038.00	0.06
83	300296	利亚德	40,900	419,225.00	0.05

84	601016	节能风电	64,000	416,640.00	0.05
85	000739	普洛药业	11,800	414,062.00	0.05
86	600637	东方明珠	43,600	412,020.00	0.05
87	600549	厦门钨业	18,100	409,603.00	0.05
88	002507	涪陵榨菜	10,800	408,240.00	0.05
89	600177	雅戈尔	59,100	407,199.00	0.05
90	002465	海格通信	37,100	405,132.00	0.05
91	600732	爱旭股份	17,300	404,128.00	0.05
92	002030	达安基因	19,800	397,188.00	0.05
93	000960	锡业股份	20,100	392,553.00	0.05
94	688112	鼎阳科技	4,901	392,325.05	0.05
95	600201	生物股份	23,900	390,765.00	0.05
96	002273	水晶光电	22,400	389,536.00	0.05
97	600642	申能股份	52,300	385,451.00	0.05
98	601128	常熟银行	58,300	385,363.00	0.05
99	603077	和邦生物	112,800	384,648.00	0.05
100	600704	物产中大	64,600	382,432.00	0.05
101	600879	航天电子	46,400	382,336.00	0.05
102	600699	均胜电子	17,400	382,278.00	0.05
103	300418	昆仑万维	16,500	381,975.00	0.05
104	603290	斯达半导	1,000	381,000.00	0.05
105	603444	吉比特	900	379,665.00	0.05
106	002557	洽洽食品	6,100	374,296.00	0.05
107	600369	西南证券	70,700	374,003.00	0.05
108	000519	中兵红箭	14,000	373,380.00	0.05
109	600160	巨化股份	28,700	370,517.00	0.05
110	600027	华电国际	69,200	370,220.00	0.05
111	600988	赤峰黄金	24,800	369,520.00	0.05
112	000039	中集集团	21,500	368,940.00	0.05
113	600372	中航电子	16,400	367,196.00	0.05
114	688002	睿创微纳	4,640	364,564.80	0.05
115	002078	太阳纸业	31,700	364,233.00	0.05
116	002299	圣农发展	15,000	362,550.00	0.05
117	600316	洪都航空	9,200	359,352.00	0.05
118	603198	迎驾贡酒	5,100	354,195.00	0.05
119	601997	贵阳银行	54,400	354,144.00	0.05
120	000830	鲁西化工	23,000	350,980.00	0.05
121	000738	航发控制	11,500	348,220.00	0.05
122	002092	中泰化学	36,300	346,302.00	0.05
123	000623	吉林敖东	18,700	345,389.00	0.05
124	300618	寒锐钴业	4,300	344,774.00	0.05
125	601198	东兴证券	29,400	341,922.00	0.04

126	600170	上海建工	94,800	341,280.00	0.04
127	000983	山西焦煤	41,200	340,724.00	0.04
128	000932	华菱钢铁	66,300	338,793.00	0.04
129	600166	福田汽车	97,900	336,776.00	0.04
130	000629	攀钢钒钛	86,300	335,707.00	0.04
131	002131	利欧股份	136,000	334,560.00	0.04
132	600867	通化东宝	30,300	332,088.00	0.04
133	600153	建发股份	36,500	331,055.00	0.04
134	002603	以岭药业	16,800	329,280.00	0.04
135	603707	健友股份	7,770	326,340.00	0.04
136	600497	驰宏锌锗	64,900	323,851.00	0.04
137	000825	太钢不锈	45,800	322,432.00	0.04
138	300383	光环新网	21,700	322,028.00	0.04
139	000050	深天马 A	24,700	321,594.00	0.04
140	600039	四川路桥	26,700	321,468.00	0.04
141	300070	碧水源	44,600	320,674.00	0.04
142	000887	中鼎股份	14,700	320,607.00	0.04
143	600380	健康元	24,900	319,716.00	0.04
144	600008	首创环保	93,700	319,517.00	0.04
145	600066	宇通客车	28,900	318,478.00	0.04
146	600271	航天信息	23,700	317,343.00	0.04
147	000400	许继电气	12,100	315,810.00	0.04
148	600536	中国软件	6,300	314,559.00	0.04
149	000750	国海证券	76,500	314,415.00	0.04
150	002191	劲嘉股份	20,600	311,678.00	0.04
151	002056	横店东磁	16,500	311,355.00	0.04
152	002372	伟星新材	12,800	311,296.00	0.04
153	002926	华西证券	31,600	311,260.00	0.04
154	300168	万达信息	23,900	311,178.00	0.04
155	300001	特锐德	12,500	310,875.00	0.04
156	600171	上海贝岭	12,100	310,486.00	0.04
157	603156	养元饮品	10,800	306,828.00	0.04
158	600535	天士力	19,300	305,905.00	0.04
159	600580	卧龙电驱	16,700	305,443.00	0.04
160	300357	我武生物	5,300	303,690.00	0.04
161	600348	华阳股份	25,600	303,360.00	0.04
162	300251	光线传媒	23,600	303,260.00	0.04
163	300009	安科生物	23,100	302,379.00	0.04
164	000513	丽珠集团	7,500	301,575.00	0.04
165	601005	重庆钢铁	142,900	298,661.00	0.04
166	000021	深科技	18,800	297,792.00	0.04
167	688639	华恒生物	2,302	297,533.50	0.04

168	002152	广电运通	25,000	297,500.00	0.04
169	000975	银泰黄金	33,500	294,130.00	0.04
170	688208	道通科技	3,699	293,700.60	0.04
171	002065	东华软件	37,600	293,280.00	0.04
172	600998	九州通	19,900	292,928.00	0.04
173	002249	大洋电机	33,300	292,707.00	0.04
174	603568	伟明环保	8,000	292,240.00	0.04
175	002221	东华能源	23,200	292,088.00	0.04
176	300244	迪安诊断	8,700	292,059.00	0.04
177	300630	普利制药	5,300	291,712.00	0.04
178	600315	上海家化	7,200	290,952.00	0.04
179	300115	长盈精密	14,500	287,680.00	0.04
180	601699	潞安环能	25,400	287,274.00	0.04
181	002572	索菲亚	12,900	286,380.00	0.04
182	603712	七一二	6,600	285,780.00	0.04
183	002373	千方科技	19,100	285,545.00	0.04
184	002500	山西证券	43,200	285,120.00	0.04
185	600673	东阳光	32,100	285,048.00	0.04
186	300026	红日药业	36,300	284,229.00	0.04
187	300212	易华录	8,000	282,800.00	0.04
188	600415	小商品城	58,300	282,755.00	0.04
189	300024	机器人	25,100	280,367.00	0.04
190	002002	鸿达兴业	46,200	279,972.00	0.04
191	600801	华新水泥	14,500	279,850.00	0.04
192	000970	中科三环	17,100	274,455.00	0.04
193	600258	首旅酒店	10,500	274,365.00	0.04
194	000878	云南铜业	20,500	274,085.00	0.04
195	601866	中远海发	84,300	273,975.00	0.04
196	000012	南玻 A	27,500	273,075.00	0.04
197	600208	新湖中宝	91,500	272,670.00	0.04
198	002127	南极电商	39,400	271,860.00	0.04
199	002683	广东宏大	9,000	271,080.00	0.04
200	000999	华润三九	7,900	270,496.00	0.04
201	000537	广宇发展	11,200	269,920.00	0.04
202	300315	掌趣科技	55,400	269,244.00	0.04
203	002195	二三四五	114,900	268,866.00	0.04
204	002506	协鑫集成	70,700	268,660.00	0.04
205	000997	新大陆	14,800	268,176.00	0.04
206	002250	联化科技	14,800	265,956.00	0.03
207	300017	网宿科技	39,400	263,586.00	0.03
208	002019	亿帆医药	14,900	262,538.00	0.03
209	300182	捷成股份	41,400	262,062.00	0.03

210	600498	烽火通信	14,500	260,710.00	0.03
211	002156	通富微电	13,400	260,362.00	0.03
212	600839	四川长虹	78,600	260,166.00	0.03
213	600155	华创阳安	25,900	257,964.00	0.03
214	601717	郑煤机	22,200	257,298.00	0.03
215	603858	步长制药	12,100	255,189.00	0.03
216	600390	五矿资本	47,900	254,828.00	0.03
217	600667	太极实业	31,400	253,712.00	0.03
218	002831	裕同科技	7,500	252,675.00	0.03
219	600970	中材国际	22,100	252,603.00	0.03
220	600511	国药股份	8,000	252,240.00	0.03
221	600500	中化国际	29,400	251,664.00	0.03
222	601992	金隅集团	88,500	251,340.00	0.03
223	600718	东软集团	18,500	250,860.00	0.03
224	300002	神州泰岳	39,500	250,035.00	0.03
225	600728	佳都科技	29,900	249,067.00	0.03
226	600895	张江高科	16,500	248,490.00	0.03
227	000686	东北证券	28,200	247,596.00	0.03
228	000060	中金岭南	50,200	246,482.00	0.03
229	600216	浙江医药	14,400	245,952.00	0.03
230	000930	中粮科技	22,600	245,662.00	0.03
231	002505	鹏都农牧	64,200	245,244.00	0.03
232	002203	海亮股份	19,700	244,871.00	0.03
233	002294	信立泰	8,900	243,148.00	0.03
234	601179	中国西电	43,700	242,535.00	0.03
235	600282	南钢股份	65,500	242,350.00	0.03
236	688262	国芯科技	5,767	242,098.66	0.03
237	603225	新凤鸣	16,300	242,055.00	0.03
238	688766	普冉股份	704	241,281.92	0.03
239	000729	燕京啤酒	28,300	239,701.00	0.03
240	000401	冀东水泥	19,900	238,004.00	0.03
241	002701	奥瑞金	33,900	237,300.00	0.03
242	600985	淮北矿业	21,100	235,898.00	0.03
243	000681	视觉中国	9,800	234,220.00	0.03
244	000027	深圳能源	28,700	232,470.00	0.03
245	600528	中铁工业	28,300	232,343.00	0.03
246	002004	华邦健康	31,900	230,956.00	0.03
247	002266	浙富控股	32,400	230,688.00	0.03
248	688087	英科再生	2,469	230,604.60	0.03
249	600297	广汇汽车	86,200	230,154.00	0.03
250	603866	桃李面包	8,100	230,040.00	0.03
251	603638	艾迪精密	7,200	229,824.00	0.03

252	600409	三友化工	26,300	228,810.00	0.03
253	002128	电投能源	15,400	228,690.00	0.03
254	000598	兴蓉环境	36,100	228,152.00	0.03
255	600827	百联股份	17,100	227,943.00	0.03
256	300463	迈克生物	7,800	227,682.00	0.03
257	002966	苏州银行	33,500	226,795.00	0.03
258	600567	山鹰国际	68,600	225,694.00	0.03
259	002745	木林森	14,900	225,437.00	0.03
260	002595	豪迈科技	8,100	224,856.00	0.03
261	002670	国盛金控	23,400	224,640.00	0.03
262	600060	海信视像	16,700	224,615.00	0.03
263	600881	亚泰集团	69,100	224,575.00	0.03
264	300072	三聚环保	28,300	224,419.00	0.03
265	600859	王府井	8,300	224,100.00	0.03
266	002174	游族网络	14,700	224,028.00	0.03
267	603885	吉祥航空	12,600	223,650.00	0.03
268	002368	太极股份	8,100	223,074.00	0.03
269	600131	国网信通	10,200	222,870.00	0.03
270	000540	中天金融	84,300	222,552.00	0.03
271	600803	新奥股份	12,100	222,156.00	0.03
272	002396	星网锐捷	9,400	221,558.00	0.03
273	002511	中顺洁柔	13,200	220,572.00	0.03
274	600598	北大荒	15,100	219,856.00	0.03
275	002048	宁波华翔	10,100	218,463.00	0.03
276	000581	威孚高科	10,100	217,554.00	0.03
277	600325	华发股份	36,100	217,322.00	0.03
278	600967	内蒙一机	18,100	216,295.00	0.03
279	600158	中体产业	14,300	216,216.00	0.03
280	002958	青农商行	55,982	216,090.52	0.03
281	600820	隧道股份	40,100	215,738.00	0.03
282	600021	上海电力	16,800	215,376.00	0.03
283	002010	传化智联	24,700	214,890.00	0.03
284	600737	中粮糖业	22,800	214,320.00	0.03
285	300482	万孚生物	5,400	212,652.00	0.03
286	603883	老百姓	4,300	212,334.00	0.03
287	300271	华宇软件	16,700	212,090.00	0.03
288	000709	河钢股份	85,300	209,838.00	0.03
289	000778	新兴铸管	48,300	209,139.00	0.03
290	600707	彩虹股份	30,600	208,692.00	0.03
291	600022	山东钢铁	116,500	208,535.00	0.03
292	603927	中科软	7,600	207,936.00	0.03
293	002183	怡亚通	31,300	207,206.00	0.03

294	000690	宝新能源	35,000	207,200.00	0.03
295	002075	沙钢股份	35,500	206,965.00	0.03
296	000883	湖北能源	39,300	205,932.00	0.03
297	002382	蓝帆医疗	12,600	205,254.00	0.03
298	600435	北方导航	19,100	203,988.00	0.03
299	600663	陆家嘴	18,700	203,082.00	0.03
300	601106	中国一重	58,300	202,884.00	0.03
301	002690	美亚光电	5,400	202,284.00	0.03
302	600645	中源协和	8,000	201,920.00	0.03
303	601577	长沙银行	25,687	200,615.47	0.03
304	000990	诚志股份	12,600	199,332.00	0.03
305	688206	概伦电子	6,000	198,060.00	0.03
306	600572	康恩贝	39,600	198,000.00	0.03
307	002434	万里扬	13,400	197,516.00	0.03
308	002281	光迅科技	8,400	195,636.00	0.03
309	600863	内蒙华电	49,400	194,636.00	0.03
310	000877	天山股份	12,600	192,906.00	0.03
311	601880	辽港股份	111,500	192,895.00	0.03
312	601118	海南橡胶	36,500	192,720.00	0.03
313	600259	广晟有色	3,900	192,036.00	0.03
314	688088	虹软科技	4,351	191,705.06	0.03
315	600329	中新药业	6,100	191,601.00	0.03
316	688029	南微医学	900	191,403.00	0.03
317	002146	荣盛发展	43,881	190,882.35	0.02
318	002124	天邦股份	29,600	190,624.00	0.02
319	600811	东方集团	63,100	189,931.00	0.02
320	600597	光明乳业	13,000	188,760.00	0.02
321	600804	鹏博士	30,400	188,480.00	0.02
322	600808	马钢股份	50,700	187,083.00	0.02
323	300376	易事特	18,600	186,930.00	0.02
324	603228	景旺电子	5,400	186,462.00	0.02
325	603650	彤程新材	3,700	186,184.00	0.02
326	600126	杭钢股份	35,800	183,654.00	0.02
327	600764	中国海防	4,500	182,970.00	0.02
328	688321	微芯生物	5,215	182,577.15	0.02
329	002390	信邦制药	24,500	181,790.00	0.02
330	000898	鞍钢股份	48,200	180,750.00	0.02
331	002985	北摩高科	1,500	180,690.00	0.02
332	601200	上海环境	14,300	180,037.00	0.02
333	600037	歌华有线	20,700	179,676.00	0.02
334	600507	方大特钢	23,000	179,400.00	0.02
335	600373	中文传媒	14,500	179,220.00	0.02

336	600908	无锡银行	31,600	179,172.00	0.02
337	002387	维信诺	19,300	179,104.00	0.02
338	600782	新钢股份	33,900	178,992.00	0.02
339	600755	厦门国贸	24,800	178,808.00	0.02
340	000488	晨鸣纸业	24,600	178,104.00	0.02
341	600517	国网英大	24,400	177,876.00	0.02
342	002429	兆驰股份	36,400	176,904.00	0.02
343	600398	海澜之家	27,500	176,275.00	0.02
344	600167	联美控股	19,500	175,695.00	0.02
345	002155	湖南黄金	16,900	175,084.00	0.02
346	300166	东方国信	16,200	174,960.00	0.02
347	600026	中远海能	29,500	174,640.00	0.02
348	601000	唐山港	63,300	174,075.00	0.02
349	001914	招商积余	8,500	172,210.00	0.02
350	600064	南京高科	18,400	171,856.00	0.02
351	600446	金证股份	12,000	171,840.00	0.02
352	601456	国联证券	12,300	171,831.00	0.02
353	601991	大唐发电	52,800	171,072.00	0.02
354	603000	人民网	11,800	170,156.00	0.02
355	600195	中牧股份	13,000	169,910.00	0.02
356	601611	中国核建	17,000	169,490.00	0.02
357	002085	万丰奥威	30,800	169,092.00	0.02
358	000559	万向钱潮	26,500	168,805.00	0.02
359	601718	际华集团	56,200	167,476.00	0.02
360	002110	三钢闽光	24,600	167,280.00	0.02
361	002705	新宝股份	6,700	165,490.00	0.02
362	601608	中信重工	36,900	164,574.00	0.02
363	002081	金螳螂	26,976	164,014.08	0.02
364	600120	浙江东方	37,100	163,982.00	0.02
365	601333	广深铁路	72,000	161,280.00	0.02
366	000528	柳工	20,800	160,368.00	0.02
367	002925	盈趣科技	4,700	159,941.00	0.02
368	300113	顺网科技	9,800	159,838.00	0.02
369	600566	济川药业	5,600	158,704.00	0.02
370	600410	华胜天成	23,400	158,418.00	0.02
371	002317	众生药业	13,100	158,379.00	0.02
372	000685	中山公用	17,800	157,530.00	0.02
373	000961	中南建设	37,900	156,906.00	0.02
374	002867	周大生	8,800	156,464.00	0.02
375	002440	闰土股份	16,200	155,358.00	0.02
376	600376	首开股份	27,400	155,084.00	0.02
377	300133	华策影视	22,900	155,033.00	0.02

378	600582	天地科技	35,300	154,614.00	0.02
379	000090	天健集团	26,200	153,794.00	0.02
380	000089	深圳机场	20,700	151,524.00	0.02
381	002233	塔牌集团	14,300	151,294.00	0.02
382	000758	中色股份	27,600	150,696.00	0.02
383	601778	晶科科技	17,600	150,128.00	0.02
384	000959	首钢股份	26,200	150,126.00	0.02
385	601598	中国外运	33,500	150,080.00	0.02
386	600062	华润双鹤	11,100	148,407.00	0.02
387	688793	倍轻松	1,454	147,915.42	0.02
388	601975	招商南油	73,500	147,735.00	0.02
389	600633	浙数文化	16,700	147,127.00	0.02
390	002839	张家港行	25,400	146,304.00	0.02
391	600307	酒钢宏兴	66,500	146,300.00	0.02
392	601098	中南传媒	15,266	146,095.62	0.02
393	301046	能辉科技	2,891	146,077.80	0.02
394	003022	联泓新科	4,000	145,760.00	0.02
395	000718	苏宁环球	30,600	144,126.00	0.02
396	000415	渤海租赁	49,500	144,045.00	0.02
397	002242	九阳股份	6,200	143,840.00	0.02
398	600556	天下秀	11,500	142,025.00	0.02
399	601958	金钼股份	20,700	141,795.00	0.02
400	002416	爱施德	12,400	141,112.00	0.02
401	000967	盈峰环境	19,100	140,003.00	0.02
402	600643	爱建集团	20,700	139,932.00	0.02
403	600959	江苏有线	42,400	139,496.00	0.02
404	600546	山煤国际	16,900	138,749.00	0.02
405	600388	龙净环保	15,900	137,058.00	0.02
406	000402	金融街	24,005	135,868.30	0.02
407	002458	益生股份	12,000	135,720.00	0.02
408	600056	中国医药	11,400	134,634.00	0.02
409	002038	双鹭药业	12,400	134,044.00	0.02
410	600312	平高电气	14,700	133,623.00	0.02
411	601928	凤凰传媒	16,200	131,058.00	0.02
412	601860	紫金银行	38,900	130,315.00	0.02
413	600901	江苏租赁	25,400	129,286.00	0.02
414	600266	城建发展	28,700	129,150.00	0.02
415	600717	天津港	30,800	129,052.00	0.02
416	000563	陕国投 A	39,800	128,554.00	0.02
417	002399	海普瑞	7,500	128,250.00	0.02
418	300257	开山股份	8,000	127,040.00	0.02
419	600968	海油发展	43,300	126,869.00	0.02

420	003035	南网能源	15,200	126,008.00	0.02
421	002563	森马服饰	16,200	125,226.00	0.02
422	000671	阳光城	41,400	125,028.00	0.02
423	300180	华峰超纤	24,700	124,241.00	0.02
424	002936	郑州银行	38,610	122,007.60	0.02
425	600928	西安银行	28,300	121,690.00	0.02
426	600094	大名城	34,000	120,360.00	0.02
427	300741	华宝股份	2,500	119,625.00	0.02
428	002815	崇达技术	7,000	117,950.00	0.02
429	600776	东方通信	10,200	117,402.00	0.02
430	000937	冀中能源	21,300	117,363.00	0.02
431	000078	海王生物	33,200	117,196.00	0.02
432	600787	中储股份	18,700	116,688.00	0.02
433	002244	滨江集团	24,900	116,034.00	0.02
434	600006	东风汽车	17,000	115,770.00	0.02
435	000717	韶钢松山	24,200	114,950.00	0.02
436	301048	金鹰重工	8,424	114,557.55	0.01
437	600729	重庆百货	4,300	111,886.00	0.01
438	002468	申通快递	12,300	111,807.00	0.01
439	000028	国药一致	3,000	110,940.00	0.01
440	600649	城投控股	26,900	110,559.00	0.01
441	600623	华谊集团	12,100	110,110.00	0.01
442	600835	上海机电	6,900	109,848.00	0.01
443	002424	贵州百灵	14,300	108,680.00	0.01
444	000062	深圳华强	6,300	108,549.00	0.01
445	605358	立昂微	900	108,009.00	0.01
446	601139	深圳燃气	12,200	107,726.00	0.01
447	603888	新华网	4,400	104,544.00	0.01
448	600648	外高桥	7,900	104,517.00	0.01
449	600640	新国脉	6,800	103,700.00	0.01
450	002583	海能达	18,400	101,568.00	0.01
451	002375	亚厦股份	13,500	101,115.00	0.01
452	601969	海南矿业	8,300	99,683.00	0.01
453	000501	鄂武商 A	9,300	97,743.00	0.01
454	600095	湘财股份	9,600	97,152.00	0.01
455	000031	大悦城	25,900	96,607.00	0.01
456	002635	安洁科技	5,600	95,368.00	0.01
457	000156	华数传媒	11,200	94,752.00	0.01
458	600639	浦东金桥	7,200	91,944.00	0.01
459	600377	宁沪高速	10,511	90,604.82	0.01
460	603379	三美股份	3,900	88,842.00	0.01
461	601228	广州港	26,500	88,245.00	0.01

462	688597	煜邦电力	3,907	87,868.43	0.01
463	688210	统联精密	2,218	87,677.54	0.01
464	000061	农产品	13,600	86,904.00	0.01
465	603708	家家悦	5,200	86,528.00	0.01
466	600871	石化油服	40,400	86,456.00	0.01
467	000869	张裕 A	2,700	86,022.00	0.01
468	603317	天味食品	3,200	85,792.00	0.01
469	601298	青岛港	15,000	85,350.00	0.01
470	601869	长飞光纤	2,600	85,124.00	0.01
471	002532	天山铝业	10,300	83,945.00	0.01
472	601828	美凯龙	9,500	83,695.00	0.01
473	002302	西部建设	10,100	81,103.00	0.01
474	600823	世茂股份	23,900	78,392.00	0.01
475	001872	招商港口	4,600	77,970.00	0.01
476	002948	青岛银行	16,700	77,321.00	0.01
477	000826	启迪环境	17,300	76,985.00	0.01
478	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
479	000553	安道麦 A	8,800	74,272.00	0.01
480	300979	华利集团	828	73,733.40	0.01
481	603355	莱克电气	2,500	73,300.00	0.01
482	000813	德展健康	18,000	73,260.00	0.01
483	603786	科博达	900	72,270.00	0.01
484	301083	百胜智能	4,160	70,270.72	0.01
485	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.01
486	603377	东方时尚	7,700	69,069.00	0.01
487	600350	山东高速	13,300	68,628.00	0.01
488	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.01
489	601568	北元集团	8,400	68,292.00	0.01
490	600657	信达地产	18,300	68,259.00	0.01
491	603056	德邦股份	6,500	66,495.00	0.01
492	603515	欧普照明	3,200	66,432.00	0.01
493	600466	蓝光发展	32,400	66,096.00	0.01
494	601801	皖新传媒	12,600	65,394.00	0.01
495	002653	海思科	3,200	65,280.00	0.01
496	002419	天虹股份	9,700	60,916.00	0.01
497	000046	泛海控股	31,600	59,408.00	0.01
498	300010	豆神教育	14,000	58,660.00	0.01
499	601512	中新集团	6,300	57,015.00	0.01
500	601003	柳钢股份	10,800	56,376.00	0.01
501	600917	重庆燃气	6,700	56,213.00	0.01
502	002946	新乳业	3,500	55,790.00	0.01
503	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01

504	600956	新天绿能	3,000	51,630.00	0.01
505	603719	良品铺子	1,200	50,964.00	0.01
506	301155	海力风电	515	49,826.25	0.01
507	301037	保立佳	1,923	48,157.08	0.01
508	600903	贵州燃气	4,900	47,432.00	0.01
509	002901	大博医疗	900	45,558.00	0.01
510	000732	泰禾集团	19,700	43,537.00	0.01
511	603868	飞科电器	1,000	43,420.00	0.01
512	601187	厦门银行	6,200	42,780.00	0.01
513	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.01
514	601068	中铝国际	6,400	39,040.00	0.01
515	688681	科汇股份	1,899	38,245.86	0.01
516	002818	富森美	3,000	37,530.00	0.00
517	301177	迪阿股份	317	36,797.36	0.00
518	600935	华塑股份	4,812	36,763.68	0.00
519	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
520	603983	丸美股份	1,100	35,057.00	0.00
521	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
522	603256	宏和科技	3,800	32,528.00	0.00
523	301087	可孚医疗	411	30,964.74	0.00
524	002423	中粮资本	3,800	30,780.00	0.00
525	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
526	605555	德昌股份	655	26,724.00	0.00
527	301090	华润材料	2,323	26,064.06	0.00
528	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00
529	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
530	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
531	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
532	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.00
533	301166	优宁维	236	22,302.00	0.00
534	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
535	001216	华瓷股份	1,177	19,667.67	0.00
536	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.00
537	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
538	301189	奥尼电子	334	18,911.08	0.00
539	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
540	603213	镇洋发展	799	18,504.84	0.00
541	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
542	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
543	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
544	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
545	300986	志特新材	264	16,898.64	0.00

546	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
547	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
548	300997	欢乐家	928	16,082.24	0.00
549	300614	百川畅银	329	15,792.00	0.00
550	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
551	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
552	001218	丽臣实业	350	15,267.00	0.00
553	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
554	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
555	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
556	301009	可靠股份	801	14,778.45	0.00
557	300985	致远新能	295	14,460.90	0.00
558	301096	百诚医药	184	14,449.52	0.00
559	301108	洁雅股份	266	14,286.86	0.00
560	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
561	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
562	603048	浙江黎明	464	13,456.00	0.00
563	605566	福莱茵特	435	13,350.15	0.00
564	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
565	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
566	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
567	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
568	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
569	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
570	300996	普联软件	386	12,193.74	0.00
571	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
572	300987	川网传媒	301	11,678.80	0.00
573	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
574	300978	东箭科技	593	10,709.58	0.00
575	301011	华立科技	175	10,535.00	0.00
576	603219	富佳股份	528	10,449.12	0.00
577	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
578	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
579	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
580	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
581	301182	凯旺科技	290	8,868.20	0.00
582	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
583	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
584	300975	商络电子	492	8,575.56	0.00
585	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
586	300991	创益通	254	8,359.14	0.00
587	001219	青岛食品	272	8,323.20	0.00

588	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
589	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
590	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
591	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
592	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
593	300972	万辰生物	430	6,815.50	0.00
594	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
595	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
596	301004	嘉益股份	312	6,389.76	0.00
597	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
598	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
599	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
600	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
601	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
602	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
603	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
604	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
605	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
606	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
607	300992	泰福泵业	200	4,950.00	0.00
608	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
609	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
610	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
611	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
612	301068	大地海洋	144	4,086.72	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	000001	平安银行	25,676,351.50	3.58
2	002142	宁波银行	16,993,996.00	2.37
3	601988	中国银行	14,999,480.00	2.09
4	000002	万科 A	14,120,208.00	1.97
5	600028	中国石化	5,228,954.00	0.73
6	601006	大秦铁路	4,999,816.00	0.70
7	000651	格力电器	4,663,262.00	0.65
8	601288	农业银行	4,537,558.00	0.63
9	601601	中国太保	3,705,797.00	0.52
10	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.48
11	002146	荣盛发展	3,021,430.28	0.42
12	000402	金融街	3,008,882.68	0.42

13	601668	中国建筑	2,999,934.00	0.42
14	600919	江苏银行	2,999,222.00	0.42
15	601728	中国电信	2,549,814.69	0.36
16	000895	双汇发展	2,494,491.00	0.35
17	000661	长春高新	2,435,214.55	0.34
18	600745	闻泰科技	2,326,050.00	0.32
19	000063	中兴通讯	2,245,082.00	0.31
20	000656	金科股份	2,029,341.00	0.28

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	000001	平安银行	26,549,347.75	3.70
2	002142	宁波银行	16,732,458.08	2.33
3	601988	中国银行	14,288,434.72	1.99
4	000002	万科 A	13,674,051.00	1.90
5	600519	贵州茅台	6,442,727.41	0.90
6	000858	五粮液	5,341,291.08	0.74
7	600028	中国石化	5,308,950.52	0.74
8	000651	格力电器	5,204,461.58	0.72
9	600905	三峡能源	4,981,856.00	0.69
10	601288	农业银行	4,564,966.64	0.64
11	601006	大秦铁路	4,558,722.04	0.63
12	601318	中国平安	4,111,886.96	0.57
13	601601	中国太保	3,998,628.30	0.56
14	000661	长春高新	3,525,970.11	0.49
15	600919	江苏银行	3,384,511.01	0.47
16	601668	中国建筑	3,278,889.03	0.46
17	600036	招商银行	3,262,735.94	0.45
18	000063	中兴通讯	3,177,397.38	0.44
19	000402	金融街	2,875,307.85	0.40
20	000333	美的集团	2,866,083.03	0.40

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	313,701,829.84
卖出股票收入（成交）总额	331,521,043.32

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	央行票据	-	-
3	金融债券	42,304,816.90	5.53
	其中：政策性金融债	42,304,816.90	5.53
4	企业债券	200,833,000.00	26.27
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	384,799,000.00	50.34
7	可转债（可交换债）	6,510,403.90	0.85
8	同业存单	19,480,000.00	2.55
9	其他	-	-
10	合计	653,927,220.80	85.54

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	102100703	21 招商局港 MTN001	400,000	40,600,000.00	5.31
2	210201	21 国开 01	400,000	40,012,000.00	5.23
3	102100672	21 广核电力 MTN001	300,000	30,573,000.00	4.00
4	102102061	21 蜀道投资 MTN001	300,000	30,435,000.00	3.98
5	102101895	21 深圳特发 MTN001	300,000	30,330,000.00	3.97

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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	21,264.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,695,169.20
5	应收申购款	423,392.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,139,826.27

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	120002	18 中原 EB	2,935,970.82	0.38
2	113042	上银转债	902,794.50	0.12
3	110079	杭银转债	561,675.40	0.07
4	113044	大秦转债	473,875.20	0.06
5	113050	南银转债	314,731.20	0.04
6	123107	温氏转债	217,182.82	0.03
7	123111	东财转 3	95,526.24	0.01
8	113043	财通转债	19,438.40	0.00
9	123108	乐普转 2	10,758.02	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601728	中国电信	1,682,426.97	0.22	新股流通受限
2	688187	时代电气	869,517.60	0.11	新股流通受限

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 (%)
华富益鑫灵活配置混合 A	2,729	96,788.98	223,424,933.36	84.59	40,712,180.40	15.41
华富益鑫灵活配置混合 C	3,183	109,265.46	326,935,254.91	94.00	20,856,706.63	6.00
合计	5,912	103,506.27	550,360,188.27	89.94	61,568,887.03	10.06

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

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	华富益鑫灵活配置混合 A	11,084.90	0.0042
	华富益鑫灵活配置混合 C	135.09	0.00004
	合计	11,219.99	0.0018

注：本表列示“占基金总份额比例”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。

9.3 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	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2016年9月7日) 基金份额总额	11,977.43	200,370,614.22
本报告期期初基金份额总额	324,876,014.38	231,276,535.92
本报告期基金总申购份额	103,943,095.92	262,493,558.97
减：本报告期基金总赎回份额	164,681,996.54	145,978,133.35
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	264,137,113.76	347,791,961.54

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 7 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	
安信证券	1	275,332,261.97	44.78%	250,910.46	44.29%	-
华西证券	1	245,135,598.37	39.87%	228,294.09	40.30%	-
西南证券	2	51,564,677.61	8.39%	48,022.22	8.48%	-
华安证券	2	19,307,862.45	3.14%	17,595.24	3.11%	-
德邦证券	1	11,414,152.43	1.86%	10,630.04	1.88%	-
招商证券	2	4,639,835.65	0.75%	4,237.66	0.75%	-
申万宏源	1	3,462,167.69	0.56%	3,155.12	0.56%	-
天风证券	1	2,046,889.32	0.33%	1,906.27	0.34%	-
海通证券	1	1,908,293.03	0.31%	1,739.05	0.31%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

中银国际	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：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），我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，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几家券商租用了基金专用交易单元。

2) 本报告期本基金新增西南证券、德邦证券、中银证券各 1 个席位，退租甬兴证券 1 个席位。

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
安信证券	63,798.60	0.04%	-	-	-	-
华西证券	105,097.00	0.07%	7,191,900,000.00	56.75%	-	-
西南证券	-	-	4,654,400,000.00	36.73%	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	140,123,150.00	98.27%	505,000,000.00	3.99%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	2,294,414.40	1.61%	260,800,000.00	2.06%	-	-
海通证券	-	-	60,000,000.00	0.47%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
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	华富益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	华富益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	华富益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	华富益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
10	华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金2021年第二次分红公告	中国证监会指定媒介	2021年9月23日
11	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
12	华富益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
13	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
14	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与招商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7月31日
15	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
16	华富益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
17	华富基金管理有限公司旗下全部基金2021年第二季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021年7月21日
18	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
19	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
20	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
21	华富益鑫灵活配置混合型证券投资基	中国证监会指定媒介	2021年4月22日

	金 2021 年第 1 季度报告		
22	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与天风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 4 月 16 日
23	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
24	华富益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
25	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
26	华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年分红公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 25 日
27	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
28	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
29	华富益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
30	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
31	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 (%)
产品特有风险							
无							

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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、《华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富益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