

华富弘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	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	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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	19
§ 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	23
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	56
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	73
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	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	74
§ 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	76
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	77
11.1 基金份额持有人大会决议	77
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	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4 基金投资策略的改变	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	80
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	84
§ 13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	84
13.2 存放地点	84
13.3 查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华富弘鑫灵活配置混合	
基金主代码	003182	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月28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	396,575,714.51份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华富弘鑫灵活配置混合 A	华富弘鑫灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	003182	003183
报告期末下属分级基金的份额总额	320,394,734.88份	76,180,979.63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	本基金通过合理灵活的资产配置策略，同时结合行业配置策略、个股精选策略、债券投资策略等投资策略，积极把握中国经济增长和资本市场发展机遇，在严格控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳健增值。
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	《中国证券报》
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	
	华富弘鑫灵活配置混合 A	华富弘鑫灵活配置混合 C	华富弘鑫灵活配置混合 A	华富弘鑫灵活配置混合 C	华富弘鑫灵活配置混合 A	华富弘鑫灵活配置混合 C
本期已实现收益	40,543,867.40	20,144,556.26	31,966,796.62	20,445,772.66	15,654,927.86	8,592,322.19
本期利润	25,841,207.68	12,660,193.41	43,919,861.32	30,379,095.55	21,401,857.32	12,038,424.45
加权平均基金份额本期利润	0.0759	0.0717	0.1656	0.1745	0.1427	0.1387
本期加权平均净值	5.92%	5.65%	14.22%	15.07%	13.13%	12.80%

利润率						
本期基金份额净值增长率	6.57%	6.35%	13.39%	13.16%	8.40%	8.03%
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	102,781,703.67	23,172,694.96	66,454,921.78	45,834,846.17	18,292,011.08	10,512,383.02
期末可供分配基金份额利润	0.3208	0.3042	0.2034	0.1907	0.0824	0.0732
期末基金资产净值	425,804,342.78	99,964,518.85	407,476,088.35	296,527,494.32	244,254,775.82	156,676,118.66
期末基金份额净值	1.3290	1.3122	1.2471	1.2338	1.0998	1.0903
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	38.44%	36.74%	29.91%	28.57%	14.57%	13.53%

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

华富弘鑫灵活配置混合 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	2.22%	0.16%	1.32%	0.40%	0.90%	-0.24%
过去六个月	3.96%	0.19%	-1.38%	0.51%	5.34%	-0.32%
过去一年	6.57%	0.22%	-0.18%	0.59%	6.75%	-0.37%
过去三年	30.99%	0.26%	38.14%	0.64%	-7.15%	-0.38%
过去五年	38.01%	0.21%	36.78%	0.60%	1.23%	-0.39%
自基金合同生效起至今	38.44%	0.21%	32.28%	0.60%	6.16%	-0.39%

华富弘鑫灵活配置混合 C

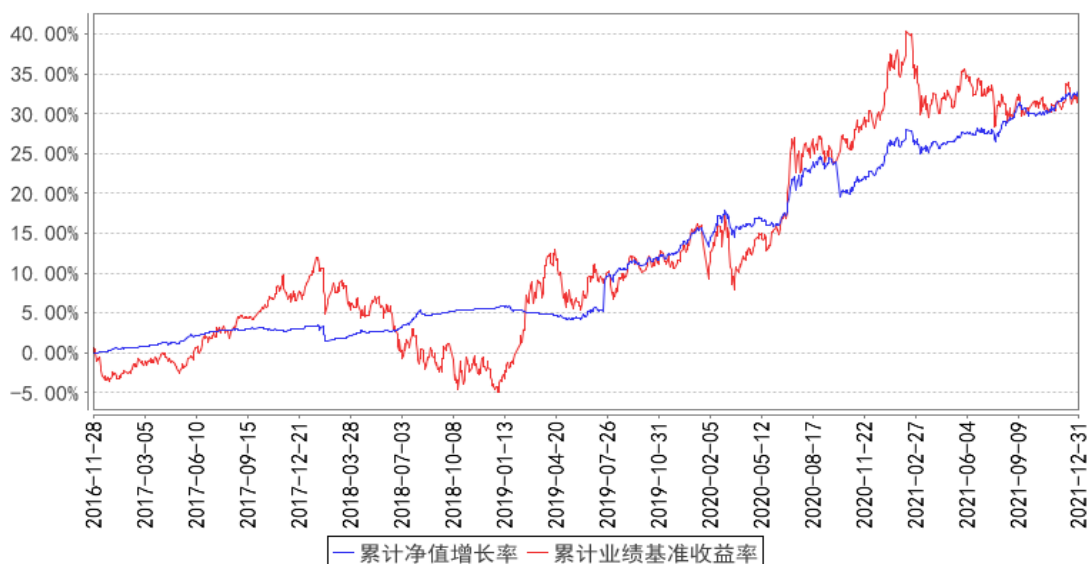
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.17%	0.16%	1.32%	0.40%	0.85%	-0.24%
过去六个月	3.85%	0.19%	-1.38%	0.51%	5.23%	-0.32%

过去一年	6.35%	0.22%	-0.18%	0.59%	6.53%	-0.37%
过去三年	30.11%	0.26%	38.14%	0.64%	-8.03%	-0.38%
过去五年	36.34%	0.21%	36.78%	0.60%	-0.44%	-0.39%
自基金合同生效起至今	36.74%	0.21%	32.28%	0.60%	4.46%	-0.39%

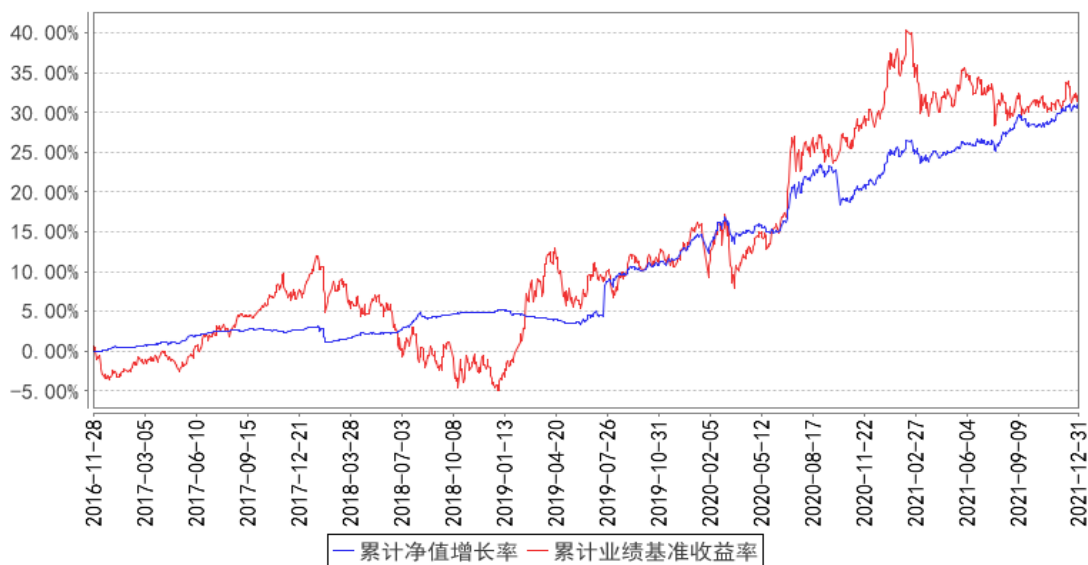
注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%。

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

华富弘鑫灵活配置混合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



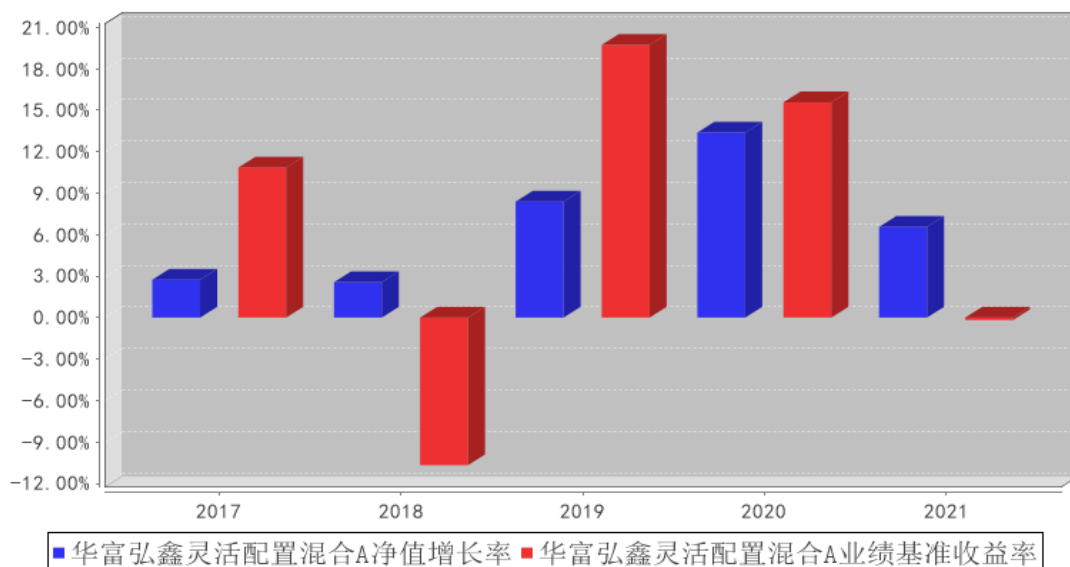
华富弘鑫灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



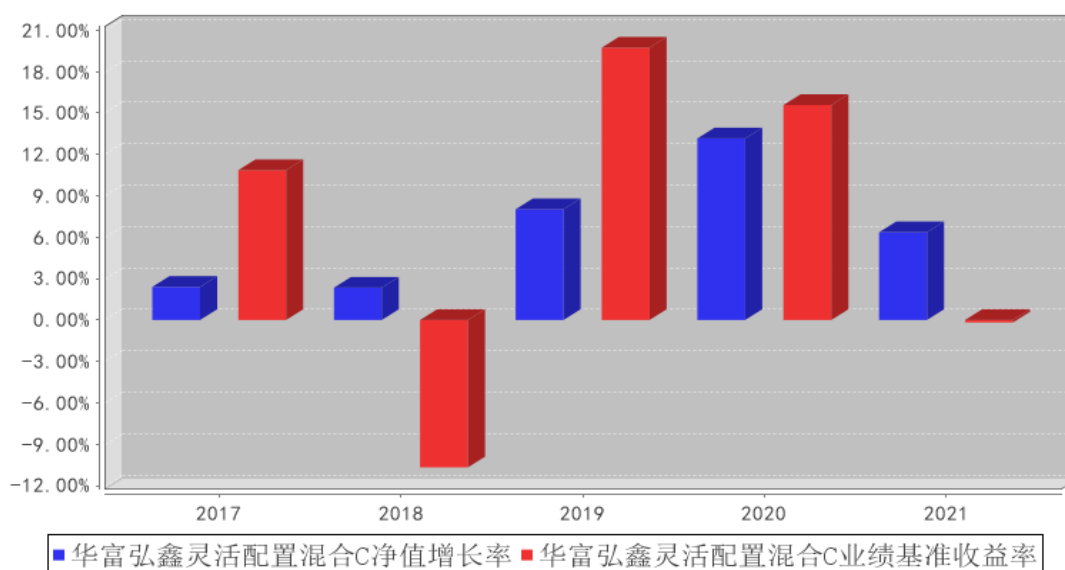
注：注：根据《华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资资产配置比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为 2016 年 11 月 28 日到 2017 年 5 月 28 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

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

华富弘鑫灵活配置混合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



华富弘鑫灵活配置混合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

华富弘鑫灵活配置混合 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	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
2019 年	0.4500	8,656,759.96	1,301,074.95	9,957,834.91	-
合计	0.4500	8,656,759.96	1,301,074.95	9,957,834.91	-

华富弘鑫灵活配置混合 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	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
2019 年	0.4500	6,242,090.40	217,366.84	6,459,457.24	-
合计	0.4500	6,242,090.40	217,366.84	6,459,457.24	-

§ 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	2019 年 4 月 15 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

	理				<p>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。</p>
--	---	--	--	--	---

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，华富弘鑫灵活配置混合 A 份额净值为 1.3290 元，累计份额净值为 1.3740 元。本报告期的基金份额净值增长率为 6.57%，同期业绩比较基准收益率为-0.18 %。截止本期末，华富弘鑫灵活配置混合 C 份额净值为 1.3122 元，累计份额净值为 1.3572 元。本报告期的基金份额净值增长率为 6.35%，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投资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《华富弘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 74,298,956.87 元，期末可供分配利润为 112,289,767.95 元。本

报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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”）在对华富弘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，对华富弘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〕6-74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	华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称华富弘鑫灵活基金）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

	<p>则的规定编制，公允反映了华富弘鑫灵活基金 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>
<p>形成审计意见的基础</p>	<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，我们独立于华富弘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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<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弘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）负责监督华富弘鑫灵活基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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，就可能导致对华富弘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</p>

	<p>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弘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：华富弘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	1,346,473.00	1,175,563.68
结算备付金		4,734,982.85	818,970.79
存出保证金		19,054.81	34,210.65
交易性金融资产	7.4.7.2	597,995,525.99	779,891,980.94
其中：股票投资		130,548,084.35	142,748,513.00
基金投资		-	-
债券投资		467,447,441.64	637,143,467.94
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		966,855.83	726,368.71
应收利息	7.4.7.5	5,417,151.74	10,046,856.89
应收股利		-	-
应收申购款		949.20	5,010,198.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		610,480,993.42	797,704,150.51
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2021 年 12 月 31 日	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		83,999,850.00	93,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		99.14	149.68
应付管理人报酬		291,664.13	346,883.68
应付托管费		72,916.01	86,720.93
应付销售服务费		24,431.45	48,894.42
应付交易费用	7.4.7.7	101,572.23	16,269.87
应交税费		35,004.31	46,282.14
应付利息		-12,405.48	-33,632.88
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	199,000.00	189,000.00
负债合计		84,712,131.79	93,700,567.84
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	396,575,714.51	567,072,235.72
未分配利润	7.4.7.10	129,193,147.12	136,931,346.95
所有者权益合计		525,768,861.63	704,003,582.67
负债和所有者权益总计		610,480,993.42	797,704,150.51

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，华富弘鑫灵活配置混合 A 基金份额净值 1.3290 元，基金份额总额 320,394,734.88 份；华富弘鑫灵活配置混合 C 基金份额净值 1.3122 元，基金份额总额 76,180,979.63 份。华富弘鑫灵活配置混合份额总额合计为 396,575,714.51 份。

报表附注为财务报表的组成部分。

7.2 利润表

会计主体：华富弘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		46,768,233.25	79,922,531.41
1. 利息收入		21,782,954.29	14,567,818.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	137,697.34	91,689.50
债券利息收入		21,645,256.95	14,467,517.52
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	8,611.23
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		47,016,826.82	43,430,116.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	49,071,664.46	44,819,852.85
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-5,705,170.86	-4,153,479.47
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	3,650,333.22	2,763,743.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-22,187,022.57	21,886,387.59
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	155,474.71	38,208.71
减：二、费用		8,266,832.16	5,623,574.54
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,987,481.48	3,045,917.72
2. 托管费	7.4.10.2.2	996,870.31	761,479.43
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	454,051.96	400,540.18
4. 交易费用	7.4.7.19	1,064,387.95	699,611.90
5. 利息支出		1,456,278.43	440,546.91
其中：卖出回购金融资产支出		1,456,278.43	440,546.91
6. 税金及附加		70,212.99	45,722.60
7. 其他费用	7.4.7.20	237,549.04	229,755.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,501,401.09	74,298,956.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,501,401.09	74,298,956.87

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：华富弘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)	567,072,235.72	136,931,346.95	704,003,582.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,501,401.09	38,501,401.09
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)	-170,496,521.21	-46,239,600.92	-216,736,122.13
其中：1. 基金申购款	376,036,963.48	106,447,108.96	482,484,072.44
2. 基金赎回款	-546,533,484.69	-152,686,709.88	-699,220,194.57
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)	396,575,714.51	129,193,147.12	525,768,861.63
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)	365,786,562.54	35,144,331.94	400,930,894.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	74,298,956.87	74,298,956.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	201,285,673.18	27,488,058.14	228,773,731.32
其中：1. 基金申购款	571,861,125.61	85,662,257.02	657,523,382.63
2. 基金赎回款	-370,575,452.43	-58,174,198.88	-428,749,651.31
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）	567,072,235.72	136,931,346.95	704,003,582.67

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

华富弘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] 1112 号）核准，基金合同于 2016 年 11 月 28 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）6-148 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《华富弘鑫灵活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	1,346,473.00	1,175,563.68
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	1,346,473.00	1,175,563.68

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	123,032,848.68	130,548,084.35	7,515,235.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	105,120,760.01	105,439,441.64
	银行间市场	360,866,970.56	362,008,000.00
	合计	465,987,730.57	467,447,441.64
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	589,020,579.25	597,995,525.99	8,974,946.74
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	107,227,913.49	142,748,513.00	35,520,599.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	401,440,977.52	397,511,667.94
	银行间市场	240,061,120.62	239,631,800.00
	合计	641,502,098.14	637,143,467.94
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	748,730,011.63	779,891,980.94	31,161,969.31

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	446.71	2,741.00
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,343.77	405.35
应收债券利息	5,414,351.80	10,043,693.60
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	9.46	16.94
合计	5,417,151.74	10,046,856.89

注：“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	100,797.12	14,974.74
银行间市场应付交易费用	775.11	1,295.13
合计	101,572.23	16,269.87

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	-	-

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	199,000.00	189,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华富弘鑫灵活配置混合 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	326,740,457.97	326,740,457.97
本期申购	237,781,868.14	237,781,868.14
本期赎回（以“-”号填列）	-244,127,591.23	-244,127,591.23
-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	320,394,734.88	320,394,734.88

华富弘鑫灵活配置混合 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	240,331,777.75	240,331,777.75
本期申购	138,255,095.34	138,255,095.34
本期赎回（以“-”号填列）	-302,405,893.46	-302,405,893.46
-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	76,180,979.63	76,180,979.63

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

华富弘鑫灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	66,454,921.78	14,280,708.60	80,735,630.38
本期利润	40,543,867.40	-14,702,659.72	25,841,207.68
本期基金份额交易产生的变	-4,217,085.51	3,049,855.35	-1,167,230.16

动数			
其中：基金申购款	64,977,271.36	4,090,947.63	69,068,218.99
基金赎回款	-69,194,356.87	-1,041,092.28	-70,235,449.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	102,781,703.67	2,627,904.23	105,409,607.90

华富弘鑫灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	45,834,846.17	10,360,870.40	56,195,716.57
本期利润	20,144,556.26	-7,484,362.85	12,660,193.41
本期基金份额交易产生的变动数	-42,806,707.47	-2,265,663.29	-45,072,370.76
其中：基金申购款	36,232,812.01	1,146,077.96	37,378,889.97
基金赎回款	-79,039,519.48	-3,411,741.25	-82,451,260.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,172,694.96	610,844.26	23,783,539.22

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	29,349.83	45,373.40
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	100,751.64	29,328.85
其他	7,595.87	16,987.25
合计	137,697.34	91,689.50

注：其他所列本期金额包括结算保证金利息收入 449.40 元、申购款停留管理公司清算账户产生的申购款利息收入 7,146.47 元；所列上年度可比期间金额包括结算保证金利息收入 431.57 元、申购款停留管理公司清算账户产生的申购款利息收入 16,555.68 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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	49,071,664.46	44,819,852.85
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	49,071,664.46	44,819,852.85

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	350,974,526.69	208,100,631.90
减：卖出股票成本总额	301,902,862.23	163,280,779.05
买卖股票差价收入	49,071,664.46	44,819,852.85

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	-5,705,170.86	-4,153,479.47
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	-5,705,170.86	-4,153,479.47

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	698,236,483.92	506,937,067.82
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	685,150,833.76	499,421,541.59
减：应收利息总额	18,790,821.02	11,669,005.70
买卖债券差价收入	-5,705,170.86	-4,153,479.47

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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,650,333.22	2,763,743.48
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	3,650,333.22	2,763,743.48

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-22,187,022.57	21,886,387.59
股票投资	-28,005,363.84	26,733,794.60
债券投资	5,818,341.27	-4,847,407.01
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	-22,187,022.57	21,886,387.59

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	143,030.30	38,208.71
基金转换费收入	12,444.41	-
合计	155,474.71	38,208.71

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	1,060,212.95	692,921.90
银行间市场交易费用	4,175.00	6,690.00
合计	1,064,387.95	699,611.90

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	10,349.04	8,055.80
账户维护费	36,000.00	40,500.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	237,549.04	229,755.80

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	19,661,193.54	3.08	141,722,155.26	38.13

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	-	-	16,275,424.40	3.37

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	-	-	321,800,000.00	6.83

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末和上年度无权证交易。

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	17,917.19	3.04	-	-
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	131,874.40	38.30	-	-

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	3,987,481.48	3,045,917.72
其中：支付销售机构的客户维护费	63,902.52	8,895.49

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	996,870.31	761,479.43

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		
	华富弘鑫灵活配置混合 A	华富弘鑫灵活配置混合 C	合计
华富基金管理有限公司	-	400,732.41	400,732.41
华安证券股份有限公司	-	1.73	1.73
合计	-	400,734.14	400,734.14
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		
	华富弘鑫灵活配置混合 A	华富弘鑫灵活配置混合 C	合计
华富基金管理有限公司	-	395,401.12	395,401.12
华安证券股份有限公司	-	29.04	29.04
合计	-	395,430.16	395,430.16

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	1,346,473.00	29,349.83	1,175,563.68	45,373.40

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

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02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	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
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01月19日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-

			日							
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
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02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02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	2022年3月	新股流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-

		27 日	7 日							
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	437	40,680.33	32,923.58	-
301088	戎美	2021	2022	新股流	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-

	股份	年 10 月 19 日	年 4 月 28 日	通受限							
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	2,554	26,689.30	28,655.88	-	
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	146	11,621.60	11,465.38	-	
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	528	14,683.68	16,441.92	-	
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	230	13,172.10	12,353.30	-	
301111	粤万年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-	
301118	恒光股份	2021 年 11 月	2022 年 5 月	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-	

		月 9 日	18 日							
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 07 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	527	31,967.82	50,987.25	-
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	190	16,351.40	17,955.00	-
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	251	29,336.88	29,136.08	-
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	241	10,601.59	12,235.57	-
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 11 日	2022 年 5 月 19 日	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
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	266	17,603.88	15,060.92	-

		日								
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	803	20,717.40	27,020.95	-
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	264	18,450.96	23,422.08	-
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	-
688032	禾迈股份	2021年12月13日	2022年6月20日	新股流通受限	557.80	650.66	482	268,859.60	313,618.12	-
688121	卓然股份	2021年8月30日	2022年3月7日	新股流通受限	18.16	36.42	3,681	66,846.96	134,062.02	-
688236	春立医疗	2021年12月23日	2022年6月30日	新股流通受限	29.81	26.43	4,052	120,790.12	107,094.36	-
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	4,285	179,884.30	179,884.30	-
688272	富吉瑞	2021年10月8日	2022年4月18日	新股流通受限	22.56	39.09	1,263	28,493.28	49,370.67	-
688509	正元地信	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	1.97	6.17	15,433	30,403.01	95,221.61	-

688553	汇宇制药	2021年10月14日	2022年4月26日	新股流通受限	38.87	32.11	7,767	301,903.29	249,398.37	-
688622	禾信仪器	2021年9月3日	2022年3月14日	新股流通受限	17.70	56.93	1,204	21,310.80	68,543.72	-
688799	华纳药厂	2021年7月5日	2022年1月13日	新股流通受限	30.82	40.73	1,917	59,081.94	78,079.41	-

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	5,520	552,000.00	552,000.00	-
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	70	7,000.00	7,000.00	-

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	8,100	220,719.42	243,972.00	-

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

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
210201	21 国开 01	2022年1月4日	100.03	211,000	21,106,330.00
合计				211,000	21,106,330.00

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 64,000,000.00 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	-	30,042,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	30,042,000.00

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

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投资。

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	285,906,399.64	582,770,098.90
AAA 以下	349,042.00	97,853.34
未评级	141,180,000.00	0.00
合计	427,435,441.64	582,867,952.24

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投资。

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	1,346,473.00	-	-	-	-	-	1,346,473.00
结算备付金	4,734,982.85	-	-	-	-	-	4,734,982.85
存出保证金	19,054.81	-	-	-	-	-	19,054.81
交易性金融资产	40,904,235.50	805,012.94	3,495,793.20	422,242,400.00	-	130,548,084.35	597,995,525.99
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	5,417,151	5,417,151

						.74	74
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	949.20	949.20
应收证券清算款	-	-	-	-	-	966,855.83	966,855.83
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	47,004,746.16	805,012.94	3,495,793.20	422,242,400.00	-	136,933,041.12	610,480,993.42
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	99.14	99.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	291,664.13	291,664.13
应付托管费	-	-	-	-	-	72,916.01	72,916.01
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	83,999,850.00	-	-	-	-	-	83,999,850.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	24,431.45	24,431.45
应付交易费用	-	-	-	-	-	101,572.23	101,572.23
应付利息	-	-	-	-	-	-12,405.48	-12,405.48
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	35,004.31	35,004.31
其他负债	-	-	-	-	-	199,000.00	199,000.00
负债总计	83,999,850.00	-	-	-	-	712,281.79	84,712,131.79
利率敏感度缺口	-36,995,103.84	805,012.94	3,495,793.20	422,242,400.00	-	136,220,759.33	525,768,861.63
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	1,175,563.68	-	-	-	-	-	1,175,563.68
结算备付金	818,970.79	-	-	-	-	-	818,970.79
存出保证金	34,210.65	-	-	-	-	-	34,210.65
交易性金融资产	46,125,800.00	20,010,000.00	472,797,562.84	98,210,105.10	-	142,748,513.00	779,891,980.94
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	10,046.85	10,046,856

						6.89	.89
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	5,010,198.85	5,010,198.85
应收证券清算款	-	-	-	-	-	726,368.71	726,368.71
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	48,154,545.12	20,010,000.00	472,797,562.84	98,210,105.10	-	158,531,937.45	797,704,150.51
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	149.68	149.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	346,883.68	346,883.68
应付托管费	-	-	-	-	-	86,720.93	86,720.93
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	93,000,000.00	-	-	-	-	-	93,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	48,894.42	48,894.42
应付交易费用	-	-	-	-	-	16,269.87	16,269.87
应付利息	-	-	-	-	-	-33,632.88	-33,632.88
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	46,282.14	46,282.14
其他负债	-	-	-	-	-	189,000.00	189,000.00
负债总计	93,000,000.00	-	-	-	-	700,567.84	93,700,567.84
利率敏感度缺口	-44,845,454.88	20,010,000.00	472,797,562.84	98,210,105.10	-	157,831,369.61	704,003,582.67

注：本表各期限按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早作为期限分类标准。

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	2,236,458.46	1,307,657.33

	市场利率上升 25 基点	-2, 227, 664. 61	-1, 304, 630. 89
--	--------------	------------------	------------------

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	130, 548, 084. 35	24. 83	142, 748, 513. 00	20. 28
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	467, 447, 441. 64	88. 91	637, 143, 467. 94	90. 50
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	597, 995, 525. 99	113. 74	779, 891, 980. 94	110. 78

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	737, 046. 21	1, 480, 004. 67
	沪深 300 指数下	-737, 046. 21	-1, 480, 004. 67

	降百分之五		
--	-------	--	--

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	32,939,707.55	792,513,545.80

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 131,098,556.51 元，第二层次的余额为 463,192,810.23 元，第三层次的余额为 3,704,159.25 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次：137,217,545.86 元，第二层次：642,674,435.08 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 3,704,159.25 元(2020 年 12 月 31 日:无),购买第三层次的金融工具 3,251,812.09 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-452,347.16 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	130,548,084.35	21.38
	其中:股票	130,548,084.35	21.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	467,447,441.64	76.57
	其中:债券	467,447,441.64	76.57
	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	6,081,455.85	1.00
8	其他各项资产	6,404,011.58	1.05
9	合计	610,480,993.42	100.00

注:本表列示的其他各项资产详见 8.12.3 期末其他各项资产构成。

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	1,445,712.50	0.27
B	采矿业	4,799,870.00	0.91
C	制造业	80,516,289.43	15.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,127,485.13	1.17
E	建筑业	2,343,266.83	0.45
F	批发和零售业	4,307,357.04	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	2,274,149.80	0.43
H	住宿和餐饮业	668,903.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,122,448.84	2.31
J	金融业	6,284,730.84	1.20
K	房地产业	3,312,785.75	0.63
L	租赁和商务服务业	1,586,364.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	667,729.39	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	1,158,763.71	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	62,790.00	0.01
Q	卫生和社会工作	283,364.78	0.05
R	文化、体育和娱乐业	1,654,672.31	0.31
S	综合	931,401.00	0.18
	合计	130,548,084.35	24.83

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	600905	三峡能源	350,563	2,632,728.13	0.50
2	601728	中国电信	510,073	2,184,975.43	0.42
3	600089	特变电工	71,600	1,515,772.00	0.29
4	002709	天赐材料	10,300	1,180,895.00	0.22
5	000932	华菱钢铁	206,049	1,052,910.39	0.20
6	600460	士兰微	17,800	964,760.00	0.18
7	002074	国轩高科	18,500	948,125.00	0.18
8	002340	格林美	86,500	895,275.00	0.17
9	300316	晶盛机电	12,700	882,650.00	0.17
10	000799	酒鬼酒	4,100	871,250.00	0.17
11	600885	宏发股份	10,100	753,864.00	0.14

12	600884	杉杉股份	21,900	717,663.00	0.14
13	000009	中国宝安	46,700	673,881.00	0.13
14	603486	科沃斯	4,400	664,180.00	0.13
15	601233	桐昆股份	30,900	654,462.00	0.12
16	600219	南山铝业	138,300	651,393.00	0.12
17	002013	中航机电	35,200	639,936.00	0.12
18	300207	欣旺达	15,000	632,400.00	0.12
19	002385	大北农	60,000	629,400.00	0.12
20	000723	美锦能源	38,700	628,101.00	0.12
21	300285	国瓷材料	14,500	617,265.00	0.12
22	600563	法拉电子	2,600	604,240.00	0.11
23	002268	卫士通	10,700	598,558.00	0.11
24	300088	长信科技	44,500	590,960.00	0.11
25	300037	新宙邦	5,200	587,600.00	0.11
26	601117	中国化学	47,100	565,200.00	0.11
27	002625	光启技术	23,400	561,834.00	0.11
28	002180	纳思达	11,700	558,792.00	0.11
29	002028	思源电气	11,000	541,310.00	0.10
30	601636	旗滨集团	31,100	531,810.00	0.10
31	300253	卫宁健康	30,900	517,884.00	0.10
32	600765	中航重机	10,200	514,998.00	0.10
33	600256	广汇能源	78,200	511,428.00	0.10
34	000988	华工科技	18,200	507,052.00	0.10
35	002185	华天科技	39,700	504,587.00	0.10
36	601168	西部矿业	36,700	499,487.00	0.10
37	002648	卫星化学	12,400	496,372.00	0.09
38	603589	口子窖	7,000	496,090.00	0.09
39	601615	明阳智能	18,900	493,290.00	0.09
40	600141	兴发集团	13,000	492,440.00	0.09
41	300699	光威复材	5,700	481,536.00	0.09
42	002223	鱼跃医疗	12,700	480,060.00	0.09
43	600862	中航高科	13,400	479,184.00	0.09
44	600516	方大炭素	44,000	476,080.00	0.09
45	600486	扬农化工	3,600	472,320.00	0.09
46	601127	小康股份	7,900	470,445.00	0.09
47	600392	盛和资源	23,700	464,994.00	0.09
48	000630	铜陵有色	133,600	464,928.00	0.09
49	600875	东方电气	21,400	458,388.00	0.09
50	600038	中直股份	5,700	457,710.00	0.09
51	600779	水井坊	3,800	455,962.00	0.09
52	300223	北京君正	3,400	455,600.00	0.09
53	603893	瑞芯微	3,300	451,770.00	0.09

54	601689	拓普集团	8,500	450,500.00	0.09
55	002138	顺络电子	11,700	446,706.00	0.08
56	002797	第一创业	60,900	445,788.00	0.08
57	600418	江淮汽车	25,600	445,440.00	0.08
58	000998	隆平高科	19,100	444,266.00	0.08
59	300308	中际旭创	10,300	437,750.00	0.08
60	601099	太平洋	131,600	431,648.00	0.08
61	600754	锦江酒店	7,100	416,060.00	0.08
62	002353	杰瑞股份	10,400	416,000.00	0.08
63	300146	汤臣倍健	15,400	415,184.00	0.08
64	002080	中材科技	12,200	415,044.00	0.08
65	600733	北汽蓝谷	41,300	413,826.00	0.08
66	600487	亨通光电	27,301	412,791.12	0.08
67	002212	天融信	21,500	412,155.00	0.08
68	600188	兖矿能源	17,200	404,716.00	0.08
69	600739	辽宁成大	20,700	404,064.00	0.08
70	600529	山东药玻	9,200	403,880.00	0.08
71	603737	三棵树	2,900	403,535.00	0.08
72	603605	珀莱雅	1,900	395,789.00	0.08
73	002422	科伦药业	20,700	391,851.00	0.07
74	000547	航天发展	23,200	387,440.00	0.07
75	000636	风华高科	13,000	387,400.00	0.07
76	300058	蓝色光标	36,100	387,353.00	0.07
77	002439	启明星辰	13,500	385,155.00	0.07
78	603260	合盛硅业	2,900	382,713.00	0.07
79	000807	云铝股份	34,000	379,780.00	0.07
80	002444	巨星科技	12,400	378,324.00	0.07
81	601016	节能风电	58,000	377,580.00	0.07
82	300296	利亚德	36,800	377,200.00	0.07
83	000739	普洛药业	10,700	375,463.00	0.07
84	600637	东方明珠	39,500	373,275.00	0.07
85	600549	厦门钨业	16,400	371,132.00	0.07
86	002507	涪陵榨菜	9,800	370,440.00	0.07
87	600177	雅戈尔	53,600	369,304.00	0.07
88	600732	爱旭股份	15,700	366,752.00	0.07
89	002465	海格通信	33,400	364,728.00	0.07
90	002030	达安基因	17,800	357,068.00	0.07
91	600201	生物股份	21,700	354,795.00	0.07
92	000960	锡业股份	18,100	353,493.00	0.07
93	002273	水晶光电	20,200	351,278.00	0.07
94	600642	申能股份	47,400	349,338.00	0.07
95	601128	常熟银行	52,800	349,008.00	0.07

96	603077	和邦生物	102,200	348,502.00	0.07
97	600699	均胜电子	15,800	347,126.00	0.07
98	600879	航天电子	42,100	346,904.00	0.07
99	600704	物产中大	58,500	346,320.00	0.07
100	300418	昆仑万维	14,900	344,935.00	0.07
101	603290	斯达半导	900	342,900.00	0.07
102	688002	睿创微纳	4,355	342,172.35	0.07
103	600369	西南证券	64,100	339,089.00	0.06
104	002557	洽洽食品	5,500	337,480.00	0.06
105	603444	吉比特	800	337,480.00	0.06
106	000519	中兵红箭	12,600	336,042.00	0.06
107	600160	巨化股份	26,000	335,660.00	0.06
108	600027	华电国际	62,700	335,445.00	0.06
109	600988	赤峰黄金	22,500	335,250.00	0.06
110	600372	中航电子	14,900	333,611.00	0.06
111	000039	中集集团	19,400	332,904.00	0.06
112	002078	太阳纸业	28,500	327,465.00	0.06
113	002299	圣农发展	13,500	326,295.00	0.06
114	600316	洪都航空	8,300	324,198.00	0.06
115	601997	贵阳银行	49,300	320,943.00	0.06
116	603198	迎驾贡酒	4,600	319,470.00	0.06
117	688099	晶晨股份	2,450	318,990.00	0.06
118	000830	鲁西化工	20,700	315,882.00	0.06
119	688032	禾迈股份	482	313,618.12	0.06
120	300618	寒锐钴业	3,900	312,702.00	0.06
121	000738	航发控制	10,300	311,884.00	0.06
122	002092	中泰化学	32,600	311,004.00	0.06
123	000623	吉林敖东	16,800	310,296.00	0.06
124	601198	东兴证券	26,600	309,358.00	0.06
125	600170	上海建工	85,900	309,240.00	0.06
126	000983	山西焦煤	37,100	306,817.00	0.06
127	600166	福田汽车	88,700	305,128.00	0.06
128	000629	攀钢钒钛	77,800	302,642.00	0.06
129	600867	通化东宝	27,500	301,400.00	0.06
130	002131	利欧股份	122,500	301,350.00	0.06
131	600153	建发股份	33,100	300,217.00	0.06
132	603707	健友股份	7,100	298,200.00	0.06
133	002603	以岭药业	15,200	297,920.00	0.06
134	600497	驰宏锌锗	58,800	293,412.00	0.06
135	300383	光环新网	19,600	290,864.00	0.06
136	600380	健康元	22,600	290,184.00	0.06
137	000825	太钢不锈	41,200	290,048.00	0.06

138	600008	首创环保	84,900	289,509.00	0.06
139	000050	深天马 A	22,200	289,044.00	0.05
140	300070	碧水源	40,200	289,038.00	0.05
141	600066	宇通客车	26,200	288,724.00	0.05
142	000887	中鼎股份	13,200	287,892.00	0.05
143	600271	航天信息	21,500	287,885.00	0.05
144	000400	许继电气	11,000	287,100.00	0.05
145	600536	中国软件	5,700	284,601.00	0.05
146	000750	国海证券	68,900	283,179.00	0.05
147	600171	上海贝岭	11,000	282,260.00	0.05
148	300168	万达信息	21,600	281,232.00	0.05
149	300001	特锐德	11,300	281,031.00	0.05
150	002926	华西证券	28,500	280,725.00	0.05
151	002191	劲嘉股份	18,500	279,905.00	0.05
152	002372	伟星新材	11,500	279,680.00	0.05
153	002056	横店东磁	14,800	279,276.00	0.05
154	603156	养元饮品	9,800	278,418.00	0.05
155	600535	天士力	17,500	277,375.00	0.05
156	600580	卧龙电驱	15,100	276,179.00	0.05
157	688208	道通科技	3,477	276,073.80	0.05
158	300357	我武生物	4,800	275,040.00	0.05
159	600348	华阳股份	23,200	274,920.00	0.05
160	300251	光线传媒	21,300	273,705.00	0.05
161	000513	丽珠集团	6,800	273,428.00	0.05
162	300009	安科生物	20,700	270,963.00	0.05
163	601005	重庆钢铁	129,400	270,446.00	0.05
164	002152	广电运通	22,500	267,750.00	0.05
165	000021	深科技	16,900	267,696.00	0.05
166	603568	伟明环保	7,300	266,669.00	0.05
167	300244	迪安诊断	7,900	265,203.00	0.05
168	000975	银泰黄金	30,200	265,156.00	0.05
169	600998	九州通	18,000	264,960.00	0.05
170	300630	普利制药	4,800	264,192.00	0.05
171	002249	大洋电机	30,000	263,700.00	0.05
172	002065	东华软件	33,800	263,640.00	0.05
173	002221	东华能源	20,900	263,131.00	0.05
174	600315	上海家化	6,500	262,665.00	0.05
175	601699	潞安环能	23,000	260,130.00	0.05
176	603712	七一二	6,000	259,800.00	0.05
177	300115	长盈精密	13,000	257,920.00	0.05
178	002572	索菲亚	11,600	257,520.00	0.05
179	600673	东阳光	29,000	257,520.00	0.05

180	002373	千方科技	17,200	257,140.00	0.05
181	002500	山西证券	38,900	256,740.00	0.05
182	600415	小商品城	52,800	256,080.00	0.05
183	300026	红日药业	32,700	256,041.00	0.05
184	300212	易华录	7,200	254,520.00	0.05
185	600801	华新水泥	13,100	252,830.00	0.05
186	300024	机器人	22,600	252,442.00	0.05
187	002002	鸿达兴业	41,600	252,096.00	0.05
188	688553	汇宇制药	7,767	249,398.37	0.05
189	601866	中远海发	76,400	248,300.00	0.05
190	600258	首旅酒店	9,500	248,235.00	0.05
191	000878	云南铜业	18,500	247,345.00	0.05
192	000970	中科三环	15,400	247,170.00	0.05
193	600208	新湖中宝	82,900	247,042.00	0.05
194	000012	南玻 A	24,800	246,264.00	0.05
195	002127	南极电商	35,500	244,950.00	0.05
196	002683	广东宏大	8,100	243,972.00	0.05
197	000537	广宇发展	10,100	243,410.00	0.05
198	000999	华润三九	7,100	243,104.00	0.05
199	300315	掌趣科技	49,900	242,514.00	0.05
200	002506	协鑫集成	63,700	242,060.00	0.05
201	002195	二三四五	103,400	241,956.00	0.05
202	000997	新大陆	13,200	239,184.00	0.05
203	688276	百克生物	3,486	239,139.60	0.05
204	002250	联化科技	13,300	239,001.00	0.05
205	300017	网宿科技	35,500	237,495.00	0.05
206	300182	捷成股份	37,300	236,109.00	0.04
207	002019	亿帆医药	13,400	236,108.00	0.04
208	600839	四川长虹	71,200	235,672.00	0.04
209	600498	烽火通信	13,100	235,538.00	0.04
210	002156	通富微电	12,100	235,103.00	0.04
211	600155	华创阳安	23,500	234,060.00	0.04
212	601717	郑煤机	20,100	232,959.00	0.04
213	603858	步长制药	11,000	231,990.00	0.04
214	600390	五矿资本	43,400	230,888.00	0.04
215	600667	太极实业	28,500	230,280.00	0.04
216	600511	国药股份	7,300	230,169.00	0.04
217	002831	裕同科技	6,800	229,092.00	0.04
218	600970	中材国际	20,000	228,600.00	0.04
219	600718	东软集团	16,800	227,808.00	0.04
220	601992	金隅集团	80,200	227,768.00	0.04
221	600500	中化国际	26,600	227,696.00	0.04

222	600895	张江高科	15,000	225,900.00	0.04
223	600728	佳都科技	27,100	225,743.00	0.04
224	600039	四川路桥	18,700	225,148.00	0.04
225	300002	神州泰岳	35,500	224,715.00	0.04
226	600216	浙江医药	13,100	223,748.00	0.04
227	000686	东北证券	25,400	223,012.00	0.04
228	000060	中金岭南	45,200	221,932.00	0.04
229	002505	鹏都农牧	57,700	220,414.00	0.04
230	002203	海亮股份	17,700	220,011.00	0.04
231	601179	中国西电	39,600	219,780.00	0.04
232	603225	新凤鸣	14,800	219,780.00	0.04
233	600282	南钢股份	59,300	219,410.00	0.04
234	002294	信立泰	8,000	218,560.00	0.04
235	000729	燕京啤酒	25,500	215,985.00	0.04
236	000401	冀东水泥	17,900	214,084.00	0.04
237	600985	淮北矿业	19,100	213,538.00	0.04
238	002701	奥瑞金	30,500	213,500.00	0.04
239	000681	视觉中国	8,900	212,710.00	0.04
240	600528	中铁工业	25,600	210,176.00	0.04
241	000027	深圳能源	25,900	209,790.00	0.04
242	600297	广汇汽车	78,100	208,527.00	0.04
243	002004	华邦健康	28,800	208,512.00	0.04
244	603638	艾迪精密	6,500	207,480.00	0.04
245	603866	桃李面包	7,300	207,320.00	0.04
246	002266	浙富控股	29,100	207,192.00	0.04
247	600409	三友化工	23,800	207,060.00	0.04
248	600827	百联股份	15,500	206,615.00	0.04
249	002128	电投能源	13,900	206,415.00	0.04
250	000598	兴蓉环境	32,500	205,400.00	0.04
251	600567	山鹰国际	62,200	204,638.00	0.04
252	002966	苏州银行	30,200	204,454.00	0.04
253	300463	迈克生物	7,000	204,330.00	0.04
254	600881	亚泰集团	62,600	203,450.00	0.04
255	600060	海信视像	15,100	203,095.00	0.04
256	002745	木林森	13,400	202,742.00	0.04
257	600859	王府井	7,500	202,500.00	0.04
258	603885	吉祥航空	11,400	202,350.00	0.04
259	300072	三聚环保	25,500	202,215.00	0.04
260	600803	新奥股份	11,000	201,960.00	0.04
261	002670	国盛金控	21,000	201,600.00	0.04
262	002368	太极股份	7,300	201,042.00	0.04
263	600131	国网信通	9,200	201,020.00	0.04

264	000540	中天金融	75,900	200,376.00	0.04
265	002595	豪迈科技	7,200	199,872.00	0.04
266	600598	北大荒	13,700	199,472.00	0.04
267	002511	中顺洁柔	11,900	198,849.00	0.04
268	002396	星网锐捷	8,400	197,988.00	0.04
269	600325	华发股份	32,700	196,854.00	0.04
270	600158	中体产业	13,000	196,560.00	0.04
271	600967	内蒙一机	16,400	195,980.00	0.04
272	600820	隧道股份	36,300	195,294.00	0.04
273	600021	上海电力	15,200	194,864.00	0.04
274	002048	宁波华翔	9,000	194,670.00	0.04
275	002958	青农商行	50,418	194,613.48	0.04
276	600737	中粮糖业	20,700	194,580.00	0.04
277	002010	传化智联	22,300	194,010.00	0.04
278	000581	威孚高科	9,000	193,860.00	0.04
279	603883	老百姓	3,900	192,582.00	0.04
280	300271	华宇软件	15,100	191,770.00	0.04
281	688029	南微医学	900	191,403.00	0.04
282	300482	万孚生物	4,800	189,024.00	0.04
283	600022	山东钢铁	105,600	189,024.00	0.04
284	000709	河钢股份	76,800	188,928.00	0.04
285	600707	彩虹股份	27,700	188,914.00	0.04
286	603927	中科软	6,900	188,784.00	0.04
287	000778	新兴铸管	43,500	188,355.00	0.04
288	002183	怡亚通	28,200	186,684.00	0.04
289	002075	沙钢股份	32,000	186,560.00	0.04
290	000690	宝新能源	31,500	186,480.00	0.04
291	000883	湖北能源	35,400	185,496.00	0.04
292	600435	北方导航	17,300	184,764.00	0.04
293	600645	中源协和	7,300	184,252.00	0.04
294	002382	蓝帆医疗	11,300	184,077.00	0.04
295	601106	中国一重	52,800	183,744.00	0.03
296	600663	陆家嘴	16,900	183,534.00	0.03
297	601577	长沙银行	23,268	181,723.08	0.03
298	688262	国芯科技	4,285	179,884.30	0.03
299	002434	万里扬	12,200	179,828.00	0.03
300	002690	美亚光电	4,800	179,808.00	0.03
301	600572	康恩贝	35,900	179,500.00	0.03
302	000990	诚志股份	11,300	178,766.00	0.03
303	002281	光迅科技	7,600	177,004.00	0.03
304	600863	内蒙华电	44,800	176,512.00	0.03
305	601118	海南橡胶	33,100	174,768.00	0.03

306	601880	辽港股份	101,000	174,730.00	0.03
307	000877	天山股份	11,400	174,534.00	0.03
308	600329	中新药业	5,500	172,755.00	0.03
309	600259	广晟有色	3,500	172,340.00	0.03
310	600811	东方集团	57,200	172,172.00	0.03
311	002124	天邦股份	26,700	171,948.00	0.03
312	002146	荣盛发展	39,507	171,855.45	0.03
313	600597	光明乳业	11,800	171,336.00	0.03
314	600804	鹏博士	27,600	171,120.00	0.03
315	603650	彤程新材	3,400	171,088.00	0.03
316	688321	微芯生物	4,856	170,008.56	0.03
317	600808	马钢股份	45,900	169,371.00	0.03
318	603228	景旺电子	4,900	169,197.00	0.03
319	002985	北摩高科	1,400	168,644.00	0.03
320	688088	虹软科技	3,824	168,485.44	0.03
321	300376	易事特	16,700	167,835.00	0.03
322	600764	中国海防	4,100	166,706.00	0.03
323	000930	中粮科技	15,300	166,311.00	0.03
324	600126	杭钢股份	32,400	166,212.00	0.03
325	002390	信邦制药	22,100	163,982.00	0.03
326	601200	上海环境	13,000	163,670.00	0.03
327	600037	歌华有线	18,800	163,184.00	0.03
328	000898	鞍钢股份	43,400	162,750.00	0.03
329	600507	方大特钢	20,800	162,240.00	0.03
330	600755	厦门国贸	22,500	162,225.00	0.03
331	600908	无锡银行	28,600	162,162.00	0.03
332	600782	新钢股份	30,700	162,096.00	0.03
333	600373	中文传媒	13,100	161,916.00	0.03
334	002387	维信诺	17,400	161,472.00	0.03
335	600517	国网英大	22,100	161,109.00	0.03
336	000488	晨鸣纸业	22,100	160,004.00	0.03
337	600398	海澜之家	24,900	159,609.00	0.03
338	600167	联美控股	17,700	159,477.00	0.03
339	002429	兆驰股份	32,800	159,408.00	0.03
340	002155	湖南黄金	15,300	158,508.00	0.03
341	688323	瑞华泰	4,113	158,473.89	0.03
342	600026	中远海能	26,700	158,064.00	0.03
343	601000	唐山港	57,400	157,850.00	0.03
344	300166	东方国信	14,600	157,680.00	0.03
345	600446	金证股份	10,900	156,088.00	0.03
346	001914	招商积余	7,700	156,002.00	0.03
347	600064	南京高科	16,700	155,978.00	0.03

348	601991	大唐发电	47,900	155,196.00	0.03
349	601456	国联证券	11,100	155,067.00	0.03
350	603000	人民网	10,700	154,294.00	0.03
351	600195	中牧股份	11,800	154,226.00	0.03
352	002174	游族网络	10,100	153,924.00	0.03
353	601611	中国核建	15,400	153,538.00	0.03
354	000559	万向钱潮	23,900	152,243.00	0.03
355	002085	万丰奥威	27,700	152,073.00	0.03
356	601718	际华集团	50,900	151,682.00	0.03
357	002110	三钢闽光	22,200	150,960.00	0.03
358	601608	中信重工	33,400	148,964.00	0.03
359	600120	浙江东方	33,600	148,512.00	0.03
360	002705	新宝股份	6,000	148,200.00	0.03
361	002081	金螳螂	24,235	147,348.80	0.03
362	601333	广深铁路	65,300	146,272.00	0.03
363	600566	济川药业	5,100	144,534.00	0.03
364	000528	柳工	18,700	144,177.00	0.03
365	300113	顺网科技	8,800	143,528.00	0.03
366	600410	华胜天成	21,200	143,524.00	0.03
367	002925	盈趣科技	4,200	142,926.00	0.03
368	600312	平高电气	15,700	142,713.00	0.03
369	002317	众生药业	11,800	142,662.00	0.03
370	000685	中山公用	16,000	141,600.00	0.03
371	000961	中南建设	34,200	141,588.00	0.03
372	002867	周大生	7,900	140,462.00	0.03
373	600376	首开股份	24,800	140,368.00	0.03
374	600582	天地科技	32,000	140,160.00	0.03
375	300133	华策影视	20,700	140,139.00	0.03
376	002440	闰土股份	14,600	140,014.00	0.03
377	000090	天健集团	23,600	138,532.00	0.03
378	002233	塔牌集团	12,900	136,482.00	0.03
379	601598	中国外运	30,400	136,192.00	0.03
380	000089	深圳机场	18,600	136,152.00	0.03
381	000758	中色股份	24,900	135,954.00	0.03
382	301046	能辉科技	2,691	135,937.80	0.03
383	000959	首钢股份	23,700	135,801.00	0.03
384	600062	华润双鹤	10,100	135,037.00	0.03
385	003022	联泓新科	3,700	134,828.00	0.03
386	688121	卓然股份	3,681	134,062.02	0.03
387	601975	招商南油	66,600	133,866.00	0.03
388	600633	浙数文化	15,100	133,031.00	0.03
389	600307	酒钢宏兴	60,300	132,660.00	0.03

390	601098	中南传媒	13,800	132,066.00	0.03
391	002839	张家港行	22,800	131,328.00	0.02
392	000718	苏宁环球	27,600	129,996.00	0.02
393	002242	九阳股份	5,600	129,920.00	0.02
394	000415	渤海租赁	44,600	129,786.00	0.02
395	601958	金钼股份	18,800	128,780.00	0.02
396	600556	天下秀	10,400	128,440.00	0.02
397	600643	爱建集团	18,800	127,088.00	0.02
398	600959	江苏有线	38,400	126,336.00	0.02
399	002416	爱施德	11,100	126,318.00	0.02
400	000967	盈峰环境	17,200	126,076.00	0.02
401	600546	山煤国际	15,300	125,613.00	0.02
402	600388	龙净环保	14,400	124,128.00	0.02
403	000402	金融街	21,705	122,850.30	0.02
404	688319	欧林生物	3,412	122,183.72	0.02
405	002458	益生股份	10,800	122,148.00	0.02
406	600056	中国医药	10,300	121,643.00	0.02
407	002038	双鹭药业	11,100	119,991.00	0.02
408	601928	凤凰传媒	14,700	118,923.00	0.02
409	601860	紫金银行	35,300	118,255.00	0.02
410	600901	江苏租赁	23,000	117,070.00	0.02
411	600266	城建发展	26,000	117,000.00	0.02
412	600717	天津港	27,900	116,901.00	0.02
413	002399	海普瑞	6,800	116,280.00	0.02
414	000563	陕国投 A	35,800	115,634.00	0.02
415	600968	海油发展	39,200	114,856.00	0.02
416	300257	开山股份	7,200	114,336.00	0.02
417	003035	南网能源	13,700	113,573.00	0.02
418	002563	森马服饰	14,600	112,858.00	0.02
419	000671	阳光城	37,300	112,646.00	0.02
420	300180	华峰超纤	22,300	112,169.00	0.02
421	600928	西安银行	25,600	110,080.00	0.02
422	002936	郑州银行	34,760	109,841.60	0.02
423	600094	大名城	30,800	109,032.00	0.02
424	688236	春立医疗	4,052	107,094.36	0.02
425	002815	崇达技术	6,300	106,155.00	0.02
426	600776	东方通信	9,200	105,892.00	0.02
427	000937	冀中能源	19,200	105,792.00	0.02
428	000078	海王生物	29,900	105,547.00	0.02
429	600787	中储股份	16,900	105,456.00	0.02
430	300741	华宝股份	2,200	105,270.00	0.02
431	301048	金鹰重工	7,724	104,988.55	0.02

432	600006	东风汽车	15,400	104,874.00	0.02
433	002244	滨江集团	22,400	104,384.00	0.02
434	000717	韶钢松山	21,800	103,550.00	0.02
435	600729	重庆百货	3,900	101,478.00	0.02
436	002468	申通快递	11,100	100,899.00	0.02
437	600835	上海机电	6,300	100,296.00	0.02
438	600649	城投控股	24,400	100,284.00	0.02
439	600623	华谊集团	11,000	100,100.00	0.02
440	000028	国药一致	2,700	99,846.00	0.02
441	000062	深圳华强	5,700	98,211.00	0.02
442	002424	贵州百灵	12,900	98,040.00	0.02
443	601139	深圳燃气	11,100	98,013.00	0.02
444	605358	立昂微	800	96,008.00	0.02
445	600648	外高桥	7,200	95,256.00	0.02
446	688509	正元地信	15,433	95,221.61	0.02
447	603888	新华网	4,000	95,040.00	0.02
448	600640	新国脉	6,200	94,550.00	0.02
449	002583	海能达	16,600	91,632.00	0.02
450	002375	亚厦股份	12,200	91,378.00	0.02
451	601969	海南矿业	7,500	90,075.00	0.02
452	000501	鄂武商 A	8,400	88,284.00	0.02
453	601778	晶科科技	10,300	87,859.00	0.02
454	000031	大悦城	23,300	86,909.00	0.02
455	000156	华数传媒	10,100	85,446.00	0.02
456	002635	安洁科技	5,000	85,150.00	0.02
457	600639	浦东金桥	6,500	83,005.00	0.02
458	600095	湘财股份	8,200	82,984.00	0.02
459	600377	宁沪高速	9,490	81,803.80	0.02
460	601228	广州港	24,000	79,920.00	0.02
461	603379	三美股份	3,500	79,730.00	0.02
462	000869	张裕 A	2,500	79,650.00	0.02
463	601869	长飞光纤	2,400	78,576.00	0.01
464	600871	石化油服	36,600	78,324.00	0.01
465	603708	家家悦	4,700	78,208.00	0.01
466	688799	华纳药厂	1,917	78,079.41	0.01
467	000061	农产品	12,200	77,958.00	0.01
468	603317	天味食品	2,900	77,749.00	0.01
469	601298	青岛港	13,600	77,384.00	0.01
470	601828	美凯龙	8,600	75,766.00	0.01
471	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
472	002532	天山铝业	9,200	74,980.00	0.01
473	002302	西部建设	9,000	72,270.00	0.01

474	688685	迈信林	2,612	71,307.60	0.01
475	600823	世茂股份	21,700	71,176.00	0.01
476	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.01
477	001872	招商港口	4,100	69,495.00	0.01
478	002948	青岛银行	15,000	69,450.00	0.01
479	000826	启迪环境	15,500	68,975.00	0.01
480	688622	禾信仪器	1,204	68,543.72	0.01
481	603355	莱克电气	2,300	67,436.00	0.01
482	000553	安道麦 A	7,900	66,676.00	0.01
483	000813	德展健康	16,200	65,934.00	0.01
484	603786	科博达	800	64,240.00	0.01
485	300979	华利集团	714	63,581.70	0.01
486	301083	百胜智能	3,760	63,394.72	0.01
487	603377	东方时尚	7,000	62,790.00	0.01
488	600350	山东高速	12,100	62,436.00	0.01
489	600657	信达地产	16,600	61,918.00	0.01
490	601568	北元集团	7,600	61,788.00	0.01
491	603056	德邦股份	5,900	60,357.00	0.01
492	603515	欧普照明	2,900	60,204.00	0.01
493	600466	蓝光发展	29,400	59,976.00	0.01
494	601801	皖新传媒	11,400	59,166.00	0.01
495	002653	海思科	2,900	59,160.00	0.01
496	002419	天虹股份	8,800	55,264.00	0.01
497	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
498	000046	泛海控股	28,400	53,392.00	0.01
499	300010	豆神教育	12,600	52,794.00	0.01
500	601512	中新集团	5,700	51,585.00	0.01
501	600917	重庆燃气	6,100	51,179.00	0.01
502	601003	柳钢股份	9,800	51,156.00	0.01
503	301155	海力风电	527	50,987.25	0.01
504	688655	迅捷兴	2,783	50,873.24	0.01
505	002946	新乳业	3,100	49,414.00	0.01
506	688272	富吉瑞	1,263	49,370.67	0.01
507	603719	良品铺子	1,100	46,717.00	0.01
508	600956	新天绿能	2,700	46,467.00	0.01
509	301037	保立佳	1,723	43,131.08	0.01
510	600903	贵州燃气	4,400	42,592.00	0.01
511	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.01
512	002901	大博医疗	800	40,496.00	0.01
513	000732	泰禾集团	17,700	39,117.00	0.01
514	603868	飞科电器	900	39,078.00	0.01
515	601187	厦门银行	5,600	38,640.00	0.01

516	600935	华塑股份	4,812	36,763.68	0.01
517	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.01
518	601068	中铝国际	5,800	35,380.00	0.01
519	688067	爱威科技	1,259	35,012.79	0.01
520	002818	富森美	2,700	33,777.00	0.01
521	301087	可孚医疗	437	32,923.58	0.01
522	603983	丸美股份	1,000	31,870.00	0.01
523	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.01
524	301177	迪阿股份	251	29,136.08	0.01
525	603256	宏和科技	3,400	29,104.00	0.01
526	301090	华润材料	2,554	28,655.88	0.01
527	002423	中粮资本	3,400	27,540.00	0.01
528	301211	亨迪药业	803	27,020.95	0.01
529	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00
530	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
531	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
532	301221	光庭信息	264	23,422.08	0.00
533	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.00
534	605555	德昌股份	555	22,644.00	0.00
535	301093	华兰股份	409	20,388.65	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	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
539	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
540	001216	华瓷股份	1,077	17,996.67	0.00
541	301166	优宁维	190	17,955.00	0.00
542	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
543	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
544	300986	志特新材	264	16,898.64	0.00
545	301100	风光股份	528	16,441.92	0.00
546	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
547	603213	镇洋发展	699	16,188.84	0.00
548	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
549	300997	欢乐家	928	16,082.24	0.00
550	300614	百川畅银	329	15,792.00	0.00
551	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
552	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
553	001218	丽臣实业	350	15,267.00	0.00
554	301189	奥尼电子	266	15,060.92	0.00
555	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
556	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
557	301009	可靠股份	801	14,778.45	0.00

558	300985	致远新能	295	14,460.90	0.00
559	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
560	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
561	603048	浙江黎明	464	13,456.00	0.00
562	605566	福莱茵特	435	13,350.15	0.00
563	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
564	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
565	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
566	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
567	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
568	301108	洁雅股份	230	12,353.30	0.00
569	301179	泽宇智能	241	12,235.57	0.00
570	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
571	300996	普联软件	386	12,193.74	0.00
572	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
573	300987	川网传媒	301	11,678.80	0.00
574	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
575	301096	百诚医药	146	11,465.38	0.00
576	301002	崧盛股份	201	10,813.80	0.00
577	301011	华立科技	175	10,535.00	0.00
578	603219	富佳股份	528	10,449.12	0.00
579	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
580	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
581	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
582	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
583	300978	东箭科技	493	8,903.58	0.00
584	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
585	301182	凯旺科技	290	8,868.20	0.00
586	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
587	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
588	300975	商络电子	492	8,575.56	0.00
589	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
590	300991	创益通	254	8,359.14	0.00
591	001219	青岛食品	272	8,323.20	0.00
592	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
593	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
594	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
595	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
596	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
597	300972	万辰生物	430	6,815.50	0.00
598	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
599	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00

600	301004	嘉益股份	312	6,389.76	0.00
601	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
602	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
603	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
604	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
605	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
606	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
607	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
608	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
609	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
610	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
611	300992	泰福泵业	200	4,950.00	0.00
612	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
613	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
614	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
615	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	22,454,027.00	3.19
2	601988	中国银行	21,999,462.00	3.12
3	000002	万科 A	16,058,296.00	2.28
4	002142	宁波银行	10,993,374.00	1.56
5	601006	大秦铁路	9,038,714.74	1.28
6	600028	中国石化	5,475,173.00	0.78
7	000651	格力电器	4,674,641.00	0.66
8	601288	农业银行	4,658,421.00	0.66
9	000063	中兴通讯	4,247,899.42	0.60
10	601601	中国太保	3,686,549.00	0.52
11	000661	长春高新	3,455,734.00	0.49
12	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.49
13	000402	金融街	3,029,361.00	0.43
14	601658	邮储银行	3,001,683.00	0.43
15	601668	中国建筑	2,999,934.00	0.43
16	600919	江苏银行	2,999,601.00	0.43
17	300003	乐普医疗	2,999,245.00	0.43
18	601728	中国电信	2,549,814.69	0.36
19	600745	闻泰科技	2,513,505.00	0.36
20	000895	双汇发展	2,493,568.41	0.35

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	23,472,091.33	3.33
2	601988	中国银行	21,566,931.86	3.06
3	000002	万科 A	15,714,336.28	2.23
4	002142	宁波银行	11,503,638.26	1.63
5	601006	大秦铁路	8,224,431.22	1.17
6	600519	贵州茅台	6,446,916.10	0.92
7	600028	中国石化	5,517,647.26	0.78
8	600905	三峡能源	5,501,194.00	0.78
9	000858	五粮液	5,355,758.77	0.76
10	000063	中兴通讯	5,174,970.09	0.74
11	000651	格力电器	5,131,429.41	0.73
12	601288	农业银行	4,621,344.20	0.66
13	000661	长春高新	4,516,819.20	0.64
14	601318	中国平安	4,202,010.24	0.60
15	601601	中国太保	4,002,574.63	0.57
16	300003	乐普医疗	3,367,277.97	0.48
17	601668	中国建筑	3,293,538.93	0.47
18	600036	招商银行	3,201,835.47	0.45
19	600919	江苏银行	3,131,285.65	0.44
20	601658	邮储银行	2,831,443.06	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	317,707,797.42
卖出股票收入（成交）总额	350,974,526.69

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、配股、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	40,012,000.00	7.61
	其中：政策性金融债	40,012,000.00	7.61
4	企业债券	138,662,000.00	26.37
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	283,455,000.00	53.91
7	可转债（可交换债）	5,318,441.64	1.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	467,447,441.64	88.91

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	101801234	18 新盛建设 MTN004	400,000	41,536,000.00	7.90
2	102101323	21 萧山国资 MTN001	400,000	40,340,000.00	7.67
3	210201	21 国开 01	400,000	40,012,000.00	7.61
4	2080351	20 沪国盛债 02	300,000	30,441,000.00	5.79
5	102101635	21 浦东开发 MTN003	300,000	30,171,000.00	5.74
6	102101852	21 紫金矿业 MTN001	300,000	30,171,000.00	5.74

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

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：本基金本报告期内未投资国债期货。

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	19,054.81
2	应收证券清算款	966,855.83
3	应收股利	-
4	应收利息	5,417,151.74
5	应收申购款	949.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,404,011.58

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	110059	浦发转债	1,275,195.50	0.24
2	113042	上银转债	892,235.50	0.17
3	110079	杭银转债	545,485.20	0.10
4	132021	19 中电 EB	501,400.00	0.10
5	113044	大秦转债	499,046.40	0.09
6	113050	南银转债	298,166.40	0.06
7	123107	温氏转债	211,648.64	0.04
8	132022	20 广版 EB	125,400.00	0.02
9	123111	东财转 3	95,021.70	0.02
10	123108	乐普转 2	47,879.10	0.01
11	113030	东风转债	42,548.80	0.01
12	113043	财通转债	19,438.40	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	0.32	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（%）
华富弘鑫灵活配置混合 A	202	1,586,112.55	319,419,630.40	99.7	975,104.48	0.3
华富弘鑫灵活配置混合 C	373	204,238.55	74,993,207.70	98.44	1,187,771.93	1.56
合计	575	689,696.89	394,412,838.10	99.45	2,162,876.41	0.55

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	华富弘鑫灵活配置混合 A	2,137.07	0.0007
	华富弘鑫灵活配置混合 C	382.44	0.0005

	合计	2,519.51	0.0006
--	----	----------	--------

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、本基金的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	华富弘鑫灵活配置混合 A	华富弘鑫灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2016 年 11 月 28 日) 基金份额总额	86,313,689.24	120,620,799.55
本报告期期初基金份 额总额	326,740,457.97	240,331,777.75
本报告期基金总申购 份额	237,781,868.14	138,255,095.34
减：本报告期基金总 赎回份额	244,127,591.23	302,405,893.46
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	320,394,734.88	76,180,979.63

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, 增聘部哲先生为华富中债 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, 郦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	246,781,303.99	38.69%	224,891.57	38.21%	-
华西证券	1	227,289,246.76	35.63%	211,675.09	35.96%	-
西南证券	2	104,078,647.00	16.32%	96,928.59	16.47%	-
德邦证券	1	30,666,149.23	4.81%	28,559.13	4.85%	-
华安证券	2	19,661,193.54	3.08%	17,917.19	3.04%	-
招商证券	2	3,242,882.57	0.51%	2,974.71	0.51%	-
申万宏源	1	2,599,191.38	0.41%	2,368.59	0.40%	-
海通证券	1	1,909,053.67	0.30%	1,739.76	0.30%	-
天风证券	1	1,690,599.03	0.27%	1,574.46	0.27%	-
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	63,877.17	0.06%	-	-	-	-
华西证券	14,359,338.50	14.41%	8,804,800,000.00	60.75%	-	-
西南证券	-	-	4,778,500,000.00	32.97%	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	69,914,500.00	70.16%	385,000,000.00	2.66%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	15,310,500.00	15.36%	526,000,000.00	3.63%	-	-
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	华富弘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	华富弘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	华富弘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	华富弘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
11	华富弘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
12	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
13	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
14	华富弘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
15	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
16	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
17	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
18	华富弘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
19	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
20	华富弘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
21	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
22	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
23	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
24	华富弘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
25	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

26	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	51,965,419.74	38,391,450.88	0.00	90,356,870.62	22.78
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、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富弘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