

# 华润元大价值优选混合型发起式证券投资 基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

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

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

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

本报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58

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 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
8.12 投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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的情况 .....	60
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品 情况 .....	61
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	61
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
11.4 基金投资策略的改变 .....	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</b>
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 .....	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>68</b>
13.1 备查文件目录 .....	68
13.2 存放地点 .....	68
13.3 查阅方式 .....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金	
基金简称	华润元大价值优选	
基金主代码	004930	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 7 月 24 日	
基金管理人	华润元大基金管理有限公司	
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	39,243,964.22 份	
下属分级基金的基金简称:	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C
下属分级基金的交易代码:	004930	004931
报告期末下属分级基金的份额总额	18,148,419.62 份	21,095,544.60 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行深入的个股/个券挖掘，积极优选具备利润创造能力并且估值水平具备竞争力的公司，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金具有前瞻性的宏观策略分析，自上而下分析与自下而上选股相结合，进行深入的个股/个券挖掘。本基金以价值投资理念为核心，根据中国股票市场的投资特点进行改良应用。首先根据不同的经济周期及市场趋势研判，决定本基金的大类资产配置以及行业偏离决策；其次在个股选择上，通过深入研究寻找优质企业，运用估值方法估算其内在投资价值，并根据国内市场的特殊性 & 波动性，综合考虑可能影响企业投资价值以及市场价格的所有因素，发现具备投资价值的个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中债总指数（全价）收益率×15%+恒生指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金。 本基金将通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华润元大基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘豫皓
	联系电话	0755-88399008
	电子邮箱	kf@cryuantafund.com
客户服务电话	4000-1000-89	95588
传真	0755-88399045	010-66105798
注册地址	深圳市前海深港合作区兴	北京市西城区复兴门内大街 55

	海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-05 单元	号
办公地址	深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-05 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518066	100140
法定代表人	李巍巍	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cryuantafund.com">http://www.cryuantafund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	华润元大基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-2105 单元

### § 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 7 月 24 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日		2019 年	
	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C
本期已实现收益	5,585,936.44	6,458,067.76	-4,902,207.75	-5,215,563.44	-	-
本期利润	2,978,532.81	2,015,391.38	-1,282,962.01	-979,186.57	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.1292	0.0770	-0.0290	-0.0229	-	-
本期加权平均净值利润率	12.35%	7.41%	-2.95%	-2.35%	-	-
本期基金份额净值增长率	5.29%	4.44%	-2.00%	-2.34%	-	-
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	577,182.52	421,804.47	-4,287,246.65	-5,088,351.68	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0318	0.0200	-0.1127	-0.1158	-	-
期末基金资产净值	18,725,602.14	21,517,349.07	37,294,046.55	42,925,665.28	-	-
期末基金份额净值	1.0318	1.0200	0.9800	0.9766	-	-
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	3.18%	2.00%	-2.00%	-2.34%	-	-

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、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、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金基金合同于 2020 年 7 月 24 日生效，2020 年实际报告期间为 2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 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

华润元大价值优选 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.97%	1.33%	0.80%	0.65%	3.17%	0.68%
过去六个月	-9.45%	1.71%	-5.67%	0.86%	-3.78%	0.85%
过去一年	5.29%	1.69%	-4.75%	0.96%	10.04%	0.73%
自基金合同生效起至今	3.18%	1.55%	3.59%	0.94%	-0.41%	0.61%

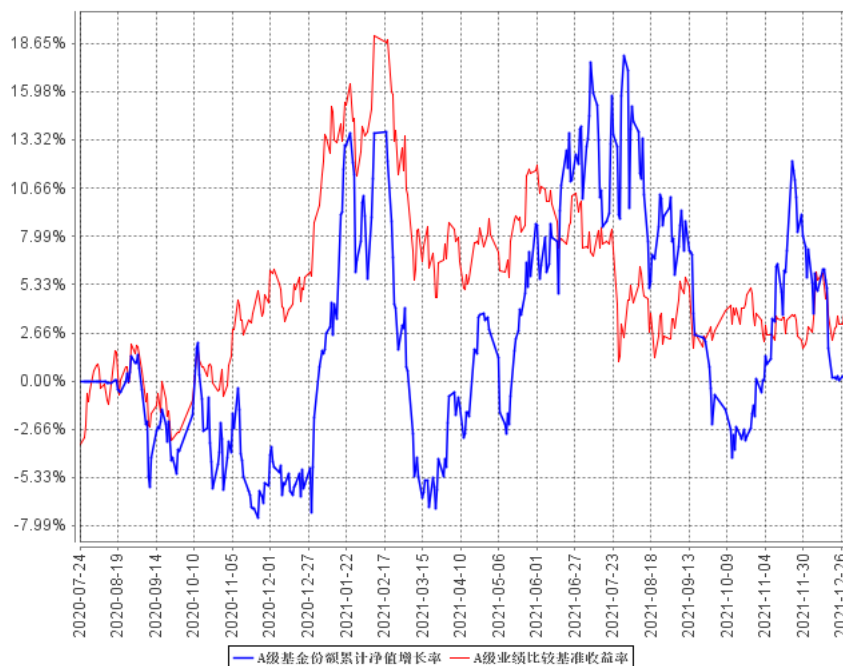
华润元大价值优选 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.75%	1.33%	0.80%	0.65%	2.95%	0.68%
过去六个月	-9.82%	1.71%	-5.67%	0.86%	-4.15%	0.85%
过去一年	4.44%	1.69%	-4.75%	0.96%	9.19%	0.73%
自基金合同生效起至今	2.00%	1.55%	3.59%	0.94%	-1.59%	0.61%

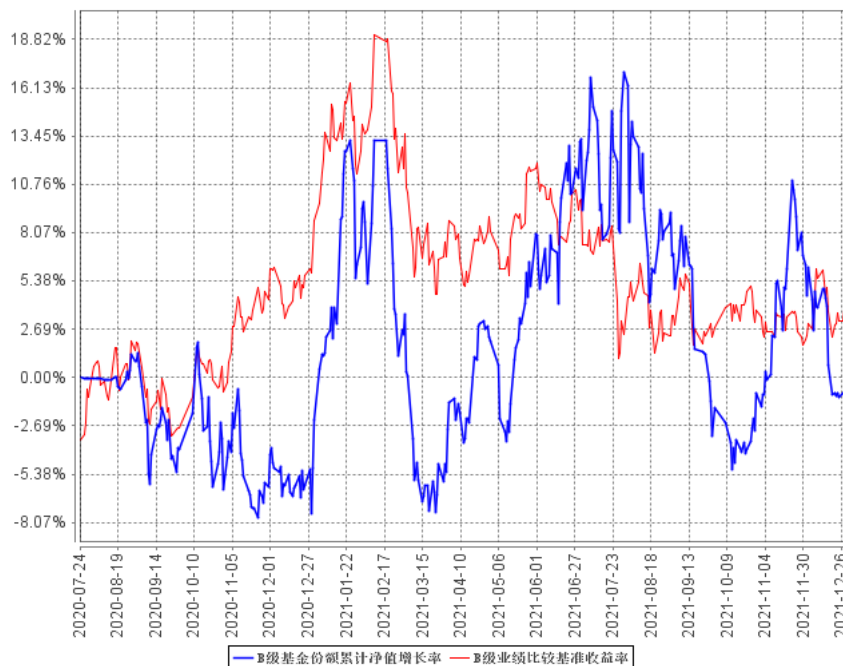


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额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

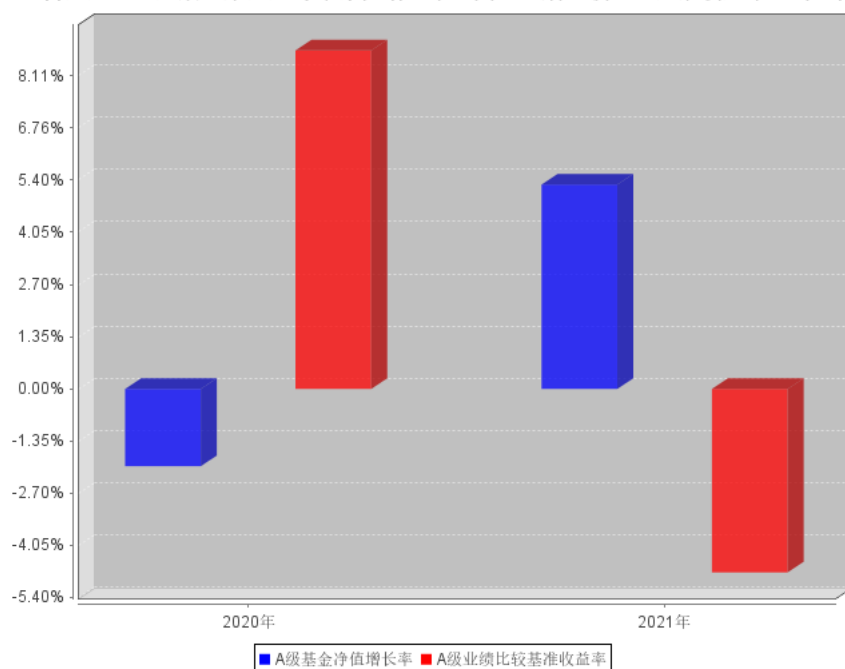


B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

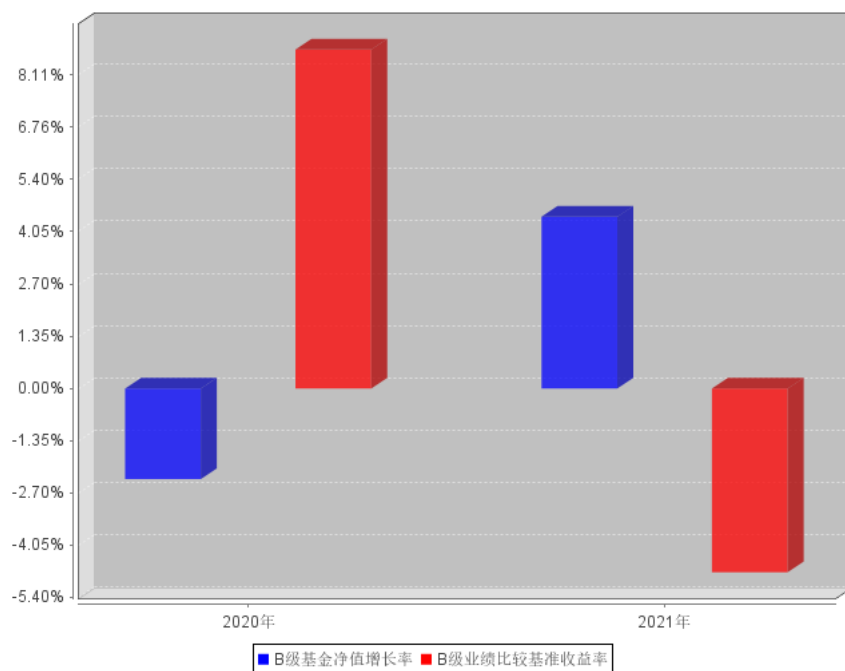


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



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



### 3.3 其他指标

#### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

截止本报告期末，本基金未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2012】1746 号文批准，于 2013 年 1 月 17 日完成工商登记注册，总部位于深圳，注册资本 6 亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司、华润金控投资有限公司、台湾元大证券投资信托股份有限公司共同发起设立，占股比例分别为 51%、24.5%、24.5%。

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理十六只基金产品：华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金、华润元大成长精选股票型发起式证券投资基金、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金、华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大景泰混合型证券投资基金、华润元大欣享混合型发起式证券投资基金、华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金、华润元大核心动力混合型证券投资基金、华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金货币市场基金、华润元大稳健收益债券型证券投资基金、华润元大润鑫债券型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金，华润元大润泽债券型证券投资基金、华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘宏毅	本基金基金经理，权益投资部负责人	2020 年 7 月 24 日	-	12 年	中国，复旦大学硕士，具有基金从业资格。曾任湘财证券有限责任公司研究员、信诚基金管理有限公司宏观分析师。2017 年 7 月 17 日加入华润元大基金管理有限公司，现任公司权益投资部负责人。2019 年 2 月 14 日起担任华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理；2020 年 3 月 18 日至 2021 年 11 月 3 日担任华润元

					大成长精选股票型发起式证券投资基金基金经理；2020年7月24日起担任华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金基金经理；2020年8月10日起担任华润元大欣享混合型发起式证券投资基金基金经理；2020年8月24日起担任华润元大核心动力混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无上述兼任情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

-

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，公司制订了《华润元大基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、研究的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易的实施效果评估与监察稽核、信息披露和报告等进行了规定，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。公司对所有投资品种实行集中交易制度，严格遵循时间优先、价格优先的公平交易原则，同时对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对不同投资组合间同向交易的交易价差进行分析，防止利益输送的发生。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规及公司内部制度关于公平交易的相关规定，在投

资产管理活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，未发生违反公平交易制度的行为。

本报告期内，基金管理人对旗下管理的不同投资组合间在连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易交易价差进行分析，分析结果表明旗下组合的同向交易情况正常，价差均在可合理解释范围之内。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

-

#### 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。基金管理人管理的所有投资组合未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，A 股整体估值维持高位，内部结构发生了较大变化，股价波动加大，同时轮动明显加快。

本基金风格和持仓相对稳定，聚焦于成长风格，主要在科技和先进制造产业链发掘投资机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华润元大价值优选 A 基金份额净值为 1.0318 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.29%；截至本报告期末华润元大价值优选 C 基金份额净值为 1.0200 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.44%；同期业绩比较基准收益率为-4.75%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年初，海外通胀压力上升，主要央行目标转向抑制通胀；疫情应对手段和理念差异，决定了全球增长复苏仍是局部而非全局性的。中期，发达经济体为应对疫情投放过多流动性，目前普遍已处于经济后周期，下半年更有可能进入滞涨，政策空间变小，经济更脆弱。

国内经济，从疫情中复苏领先于海外主要经济体，目前短期有一定下滑压力，但政策调整及时；相较于海外，国内社会相对稳定，远离地缘政治斗争。预计下半年，在海外发达经济体处于滞涨期脆弱期时，中国经济已经成功筑底。

根据以上宏观假设，2022 年 A 股市场在初期消化估值压力后，将重新找到新的成长板块，对应中国未来几年产业变革的引领方向。

中国已经具备优势的制造业相关的先进装备、先进材料、智能化等方向未来将继续获得长足发展。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

公司按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

公司采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强了对日常投资运作的管理和监控，保证投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，基金各项投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

本基金管理人承诺将坚持以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金的管理人——华润元大基金管理有限公司在华润元大价值优选混合型发起式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。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华润元大基金管理有限公司编制和披露的华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 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	安永华明（2022）审字第 61032987_H13 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	华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金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，公允反映了华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</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，我们独立于华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金，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>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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，管理层负责评估华润元大价值优选混合型发起</p>



	<p>式证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督华润元大价值优选混合型发起式证券投资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>（1）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>（2）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>（3）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>（4）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，就可能导致对华润元大价值优选混合型发起式证券投资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润元大价值优选混合型发起式证券投资基金不能持</p>

	<p>续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	昌华   黄拥璇
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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：华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	6,458,534.11	9,347,497.14
结算备付金		257,349.10	1,451,477.22
存出保证金		38,293.85	161,374.37
交易性金融资产	7.4.7.2	35,037,120.50	75,989,728.02
其中：股票投资		35,037,120.50	75,989,728.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,155.18	1,858.69
应收股利		-	-
应收申购款		24,269.75	62,771.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		41,816,722.49	87,014,706.50
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,267,180.41	4,834,158.66
应付赎回款		26,619.69	1,504,662.24
应付管理人报酬		51,465.12	102,932.72
应付托管费		8,577.49	17,155.46
应付销售服务费		14,662.45	29,211.85
应付交易费用	7.4.7.7	120,261.45	239,229.63
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	85,004.67	67,644.11
负债合计		1,573,771.28	6,794,994.67
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	39,243,964.22	82,009,568.66
未分配利润	7.4.7.10	998,986.99	-1,789,856.83
所有者权益合计		40,242,951.21	80,219,711.83
负债和所有者权益总计		41,816,722.49	87,014,706.50

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 39,243,964.22 份，其中华润元大价值优选 A 基金份额净值 1.0318 元，份额总额 18,148,419.62 份；华润元大价值优选 C 基金份额净值 1.0200 元，份额总额 21,095,544.60 份。

2、本基金财务报表上年度实际可比期间为 2020 年 7 月 24 日至 2020 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 7 月 24 日(基 金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		7,433,145.08	-722,009.32
1.利息收入		45,550.84	60,228.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	45,550.84	60,228.82
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,342,604.18	-8,729,245.23
其中：股票投资收益	7.4.7.12	14,236,038.93	-8,819,245.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
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	106,565.25	90,000.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-7,050,080.01	7,855,622.61
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	95,070.07	91,384.48
<b>减：二、费用</b>		2,439,220.89	1,540,139.26
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	775,126.38	559,846.66
2. 托管费	7.4.10.2.2	129,187.81	93,307.77
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	219,643.83	145,972.17
4. 交易费用	7.4.7.19	1,229,946.87	675,495.66
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	85,316.00	65,517.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,993,924.19	-2,262,148.58
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,993,924.19	-2,262,148.58

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金

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）	82,009,568.66	-1,789,856.83	80,219,711.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,993,924.19	4,993,924.19
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）	-42,765,604.44	-2,205,080.37	-44,970,684.81
其中：1. 基金申购款	27,365,604.01	1,594,094.81	28,959,698.82
2. 基金赎回款	-70,131,208.45	-3,799,175.18	-73,930,383.63
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	39,243,964.22	998,986.99	40,242,951.21

项目	上年度可比期间		
	2020 年 7 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
金净值)			
一、期初所有者权益(基金净值)	81,642,582.59	-	81,642,582.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,262,148.58	-2,262,148.58
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)	366,986.07	472,291.75	839,277.82
其中：1. 基金申购款	28,833,568.22	-490,858.32	28,342,709.90
2. 基金赎回款	-28,466,582.15	963,150.07	-27,503,432.08
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)	82,009,568.66	-1,789,856.83	80,219,711.83

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：

李仆
  张彦军
  张彦军

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

华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系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[2017]1065 号文《关于准予华润元大润丰债券型证券投资基金注册的批复》及证监许可[2018]1102 号文《关于准予华润元大润丰债券型证券投资基金变更注册的批复》的核准,由华润元大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集期间为 2020 年 6 月 22 日至 2020 年 7 月 21 日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 81,610,555.89 元,经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2020)验字第 61032987\_H03 号验资报告。经向中国证监会备案,《华润元大价值优

选混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 81,642,582.59 份基金份额，其中认购资金利息折合 32,026.70 份基金份额。本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为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、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、股指期货、权证、国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转换债券、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括同业存款、定期存款、协议存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的 50%，持有全部权证的比例不得超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中债总指数（全价）收益率×15%+恒生指数收益率×10%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务

状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 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

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

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主要为股票、债券和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

###### （2）金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

###### 初始确认

本基金于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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。



#### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将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的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值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作为公允价值；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，应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，应对报价进行调整，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。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应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，应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，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入

“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资面值，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

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

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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

无。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金在本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

#### (1) 境内投资

##### (i) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

##### (ii) 增值税及附加、企业所得税

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问

题的通知》的规定，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（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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

### （iii）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### （2）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税

[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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	6,458,534.11	9,347,497.14
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：	6,458,534.11	9,347,497.14

#### 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	34,231,577.90	35,037,120.50	805,542.60
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	34,231,577.90	35,037,120.50	805,542.60
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	68,134,105.41	75,989,728.02	7,855,622.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	68,134,105.41	75,989,728.02	7,855,622.61

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

### 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

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均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	1,008.88	1,434.30
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	127.38	400.74
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	18.92	23.65
合计	1,155.18	1,858.69

注：其他为应收结算保证金利息。

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

### 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	120,261.45	239,229.63
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	120,261.45	239,229.63

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4.67	2,644.11
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费	35,000.00	30,000.00
预提信息披露费	50,000.00	35,000.00
合计	85,004.67	67,644.11

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华润元大价值优选 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	38,055,122.91	38,055,122.91
本期申购	12,324,458.35	12,324,458.35
本期赎回（以“-”号填列）	-32,231,161.64	-32,231,161.64
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	18,148,419.62	18,148,419.62

金额单位：人民币元

华润元大价值优选 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	43,954,445.75	43,954,445.75
本期申购	15,041,145.66	15,041,145.66
本期赎回（以“-”号填列）	-37,900,046.81	-37,900,046.81
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	21,095,544.60	21,095,544.60

注：申购包含基金转入及红利再投资的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元



华润元大价值优选 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,287,246.65	3,526,170.29	-761,076.36
本期利润	5,585,936.44	-2,607,403.63	2,978,532.81
本期基金份额交易产生的变动数	539,405.36	-2,179,679.29	-1,640,273.93
其中：基金申购款	307,289.03	458,754.45	766,043.48
基金赎回款	232,116.33	-2,638,433.74	-2,406,317.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,838,095.15	-1,260,912.63	577,182.52

单位：人民币元

华润元大价值优选 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,088,351.68	4,059,571.21	-1,028,780.47
本期利润	6,458,067.76	-4,442,676.38	2,015,391.38
本期基金份额交易产生的变动数	497,581.75	-1,062,388.19	-564,806.44
其中：基金申购款	223,577.14	604,474.19	828,051.33
基金赎回款	274,004.61	-1,666,862.38	-1,392,857.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,867,297.83	-1,445,493.36	421,804.47

#### 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7月24日(基金合同生效日)至2020年12月31日
活期存款利息收入	38,319.64	57,450.58
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	6,239.13	2,534.89
其他	992.07	243.35
合计	45,550.84	60,228.82

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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7月24日(基金合同生效日)至2020年12月31日

卖出股票成交总额	408,361,945.43	192,351,135.62
减：卖出股票成本总额	394,125,906.50	201,170,380.85
买卖股票差价收入	14,236,038.93	-8,819,245.23

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

-

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

-

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

-

##### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及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

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

-

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

-

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

-

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

-

#### 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7月24日(基金合同生效日)至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	106,565.25	90,000.00
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	106,565.25	90,000.00

#### 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7月24日(基金合同生效日)至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-7,050,080.01	7,855,622.61
——股票投资	-7,050,080.01	7,855,622.61
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-7,050,080.01	7,855,622.61

#### 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7月24日(基金合同生效日)至2020年12月31日
基金赎回费收入	93,994.42	91,382.04
基金转换费收入	1,075.65	2.44
合计	95,070.07	91,384.48

### 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 7 月 24 日(基金合同生 效日)至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,229,946.87	675,495.66
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,229,946.87	675,495.66

### 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 7 月 24 日(基金合同 生效日)至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	35,000.00	30,000.00
信息披露费	50,000.00	35,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	316.00	117.00
其他	-	400.00
合计	85,316.00	65,517.00

### 7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华润元大基金管理有限公司	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（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构

华润深国投信托有限公司	基金管理人的股东
元大证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
华润金控投资有限公司	基金管理人的股东
深圳华润元大资产管理有限公司	基金管理人的子公司
珠海华润银行股份有限公司	与基金管理人受同一实际控制的公司
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人控股股东的联营公司、基金销售机构

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、基金管理人控股股东的联营公司国信证券为本基金本期新增的关联方。

### 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7月24日(基金合同生效日)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
国信证券	360,484,267.46	46.90%	-	-

##### 7.4.10.1.2 债券交易

-

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

-

##### 7.4.10.1.4 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
国信证券	335,763.38	46.72%	63,249.85	52.59%

关联方名称	上年度可比期间 2020年7月24日(基金合同生效日)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
-	-	-	-	-

注：1、上述佣金费率由本基金的基金管理人参考市场佣金率在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的证券经纪服务协议进行约定，包含经手费、证管费和过户费。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。

2、基金管理人控股股东的联营公司国信证券为本基金本期新增的关联方。

## 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7月24日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	775,126.38	559,846.66
其中：支付销售机构的客户维护费	295,218.25	279,710.67

注：(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

(2) 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

### 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7月24日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	129,187.81	93,307.77

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 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		
	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C	合计
华润元大基金管理有限公司	-	83,204.78	83,204.78
中国工商银行	-	92,862.14	92,862.14
合计	-	176,066.92	176,066.92
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 7 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C	合计
华润元大基金管理有限公司	-	33,853.90	33,853.90
中国工商银行	-	73,379.35	73,379.35
合计	-	107,233.25	107,233.25

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日对应级别基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华润元大基金管理有限公司，再由华润元大基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.8%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日该级别基金资产净值 × 对应销售服务费年费率 / 当年天数。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

### 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

-

#### 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

-

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C
基金合同生效日（2020 年 7 月 24 日）持有的基金份额	-	0.00
报告期初持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	25.4816%

项目	上年度可比期间 2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C
基金合同生效日（2020 年 7 月 24 日）持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	12.1937%

注 1：关联方投资本基金适用基金合同的约定费率。

注 2：对于分级基金，比例的分母采用本基金的总份额。

注 3：申购/买入总份额含转换入份额；赎回/卖出总份额含转换出份额。

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金。

#### 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 7 月 24 日 (基金合同生效日) 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	6,458,534.11	38,319.64	9,347,497.14	57,450.58

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事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，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

-

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、董事会下设风险控制委员会，督察长、管理层下设风险管理委员会，合规管理部、风险管理部和各业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 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。

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

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

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（上年度末：同）。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末及上年度末均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

本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末及上年度末均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

本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

-

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值、份额持有人集中度以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），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资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 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	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	6,458,534.11	-	-	-	-	6,458,534.11
结算备付金	257,349.10	-	-	-	-	257,349.10
存出保证金	38,293.85	-	-	-	-	38,293.85
交易性金融资产	-	-	-	-	35,037,120.50	35,037,120.50
应收利息	-	-	-	-	1,155.18	1,155.18
应收申购款	-	-	-	-	24,269.75	24,269.75
资产总计	6,754,177.06	-	-	-	35,062,545.43	41,816,722.49
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	1,267,180.41	1,267,180.41
应付赎回款	-	-	-	-	26,619.69	26,619.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	51,465.12	51,465.12
应付托管费	-	-	-	-	8,577.49	8,577.49
应付销售服务费	-	-	-	-	14,662.45	14,662.45
应付交易费用	-	-	-	-	120,261.45	120,261.45
其他负债	-	-	-	-	85,004.67	85,004.67
负债总计	-	-	-	-	1,573,771.28	1,573,771.28
利率敏感度缺口	6,754,177.06	-	-	-	33,488,774.15	40,242,951.21
上年度末 2020 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	9,347,497.14	-	-	-	-	9,347,497.14
结算备付金	1,451,477.22	-	-	-	-	1,451,477.22
存出保证金	161,374.37	-	-	-	-	161,374.37
交易性金融资产	-	-	-	-	75,989,728.02	75,989,728.02
应收利息	-	-	-	-	1,858.69	1,858.69
应收申购款	-	-	-	-	62,771.06	62,771.06
资产总计	10,960,348.73	-	-	-	76,054,357.77	87,014,706.50

负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	4,834,158.66	4,834,158.66
应付赎回款	-	-	-	-	1,504,662.24	1,504,662.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	102,932.72	102,932.72
应付托管费	-	-	-	-	17,155.46	17,155.46
应付销售服务费	-	-	-	-	29,211.85	29,211.85
应付交易费用	-	-	-	-	239,229.63	239,229.63
其他负债	-	-	-	-	67,644.11	67,644.11
负债总计	-	-	-	-	6,794,994.67	6,794,994.67
利率敏感度缺口	10,960,348.73	-	-	-	-	-

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元 折合 人民币	港币 折合人民币	其他币 种 折合 人民币	合计
以外 币计 价的 资产				
交易 性金 融资 产	-	207,670.40	-	207,670.40

资产合计	-	207,670.40	-	207,670.40
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外外汇风险敞口净额	-	207,670.40	-	207,670.40
	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
项目	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	13,644,331.02	-	13,644,331.02
资产	-	13,644,331.02	-	13,644,331.02

合计				
以外 币计 价的 负债				
负债 合计	-	-	-	-
资产 负债 表外 汇风 险敞 口净 额	-	13,644,331.02	-	13,644,331.02

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	所有外币相对人民币 升值 5%	10,383.52	682,216.55
	所有外币相对人民币 贬值 5%	-10,383.52	-682,216.55

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大其他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其他价格风险，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。

本基金的投资范围主要为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、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、股指期货、权证、国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转换债券、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括同业存款、定期存款、协议存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、国债期货等以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	35,037,120.50	87.06	75,989,728.02	94.73
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	35,037,120.50	87.06	75,989,728.02	94.73

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
分析	相关风险变量的变动	本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
		沪深 300 指数上升 5%	1,549,400.00
	沪深 300 指数下降 5%	-1,549,400.00	-1,939,600.00

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

-

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。



#### 7.4.14.2 其他事项

##### (1) 公允价值

基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、存出保证金、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 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划分为第一层次的余额为人民币 35,037,120.50 元，无划分为第二层次和第三层次的余额（于 2020 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划分为第一层次的余额为人民币 75,989,728.02 元，无划分为第二层次和第三层次的余额）。

##### 公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、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或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本期末未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金本期末未发生第三层次公允价值转入（转出）的情况。

(2) 根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7 号）、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》（财会〔2017〕8 号）、《企业会计准则第 24 号—套期会计》（财会〔2017〕9 号）、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（财会〔2017〕14 号）（以上统称新金融工具相关会计准则），以及《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22 号），自 2022 年 1 月 1 日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

(3) 除上述事项外，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	35,037,120.50	83.79
	其中：股票	35,037,120.50	83.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	6,715,883.21	16.06
8	其他各项资产	63,718.78	0.15
9	合计	41,816,722.49	100.00

### 8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,652,758.10	71.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,892.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,479,900.00	11.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,689,900.00	4.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	34,829,450.10	86.55

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	207,670.40	0.52
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	207,670.40	0.52

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	603893	瑞芯微	22,949	3,141,718.10	7.81
2	605358	立昂微	22,000	2,640,220.00	6.56
3	300181	佐力药业	220,000	2,565,200.00	6.37
4	688037	芯源微	15,000	2,532,000.00	6.29
5	603936	博敏电子	120,000	2,064,000.00	5.13
6	300776	帝尔激光	8,000	2,047,200.00	5.09
7	300223	北京君正	15,000	2,010,000.00	4.99
8	688608	恒玄科技	6,000	1,830,000.00	4.55
9	688519	南亚新材	35,000	1,764,350.00	4.38
10	605168	三人行	10,000	1,689,900.00	4.20
11	300782	卓胜微	5,000	1,634,000.00	4.06
12	688682	霍莱沃	10,000	1,629,800.00	4.05
13	688536	思瑞浦	1,700	1,305,600.00	3.24
14	688639	华恒生物	10,000	1,292,500.00	3.21
15	688012	中微公司	10,000	1,266,000.00	3.15
16	300634	彩讯股份	50,000	866,500.00	2.15
17	300831	派瑞股份	40,000	790,000.00	1.96

18	600718	东软集团	50,000	678,000.00	1.68
19	601865	福莱特	10,000	579,400.00	1.44
20	603799	华友钴业	5,000	551,550.00	1.37
21	002241	歌尔股份	10,000	541,000.00	1.34
22	002384	东山精密	15,000	406,500.00	1.01
23	000810	创维数字	40,000	394,000.00	0.98
24	300474	景嘉微	2,000	304,400.00	0.76
25	01385	上海复旦	10,000	207,670.40	0.52
26	688093	世华科技	5,000	186,500.00	0.46
27	002916	深南电路	500	60,910.00	0.15
28	688779	长远锂科	1,000	23,440.00	0.06
29	002920	德赛西威	100	14,151.00	0.04
30	300073	当升科技	100	8,687.00	0.02
31	002352	顺丰控股	100	6,892.00	0.02
32	603650	彤程新材	100	5,032.00	0.01

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603799	华友钴业	11,896,776.00	14.83
2	002241	歌尔股份	10,627,950.01	13.25
3	300236	上海新阳	6,860,380.00	8.55
4	601888	中国中免	6,024,404.00	7.51
5	688019	安集科技	5,927,961.24	7.39
6	605499	东鹏饮料	5,875,967.00	7.32
7	603893	瑞芯微	5,733,083.01	7.15
8	002460	赣锋锂业	5,332,597.15	6.65
9	600718	东软集团	5,071,466.00	6.32
10	000301	东方盛虹	4,740,632.04	5.91
11	002192	融捷股份	4,687,212.00	5.84
12	01347	华虹半导体	4,327,108.73	5.39
13	688012	中微公司	4,305,012.57	5.37
14	603236	移远通信	4,271,548.00	5.32
15	002291	星期六	4,211,514.00	5.25
16	600699	均胜电子	3,772,789.00	4.70
17	002475	立讯精密	3,753,745.40	4.68

18	603005	晶方科技	3,738,957.00	4.66
19	601012	隆基股份	3,731,111.00	4.65
20	603986	兆易创新	3,711,521.18	4.63
21	00522	ASM PACIFIC	3,598,292.47	4.49
22	300601	康泰生物	3,591,401.00	4.48
23	01478	丘钛科技	3,584,964.84	4.47
24	603113	金能科技	3,551,686.38	4.43
25	300474	景嘉微	3,495,239.00	4.36
26	300073	当升科技	3,486,897.00	4.35
27	002920	德赛西威	3,446,947.00	4.30
28	688037	芯源微	3,436,108.96	4.28
29	00700	腾讯控股	3,238,885.88	4.04
30	601336	新华保险	3,236,212.00	4.03
31	601233	桐昆股份	3,209,455.00	4.00
32	601319	中国人保	3,109,424.00	3.88
33	002648	卫星化学	3,099,023.00	3.86
34	002738	中矿资源	3,025,683.00	3.77
35	605006	山东玻纤	3,002,059.00	3.74
36	688111	金山办公	2,897,351.50	3.61
37	300223	北京君正	2,895,109.00	3.61
38	002709	天赐材料	2,860,000.00	3.57
39	600584	长电科技	2,851,654.00	3.55
40	002352	顺丰控股	2,846,900.00	3.55
41	002414	高德红外	2,798,025.00	3.49
42	688608	恒玄科技	2,794,396.41	3.48
43	300496	中科创达	2,763,272.00	3.44
44	002129	中环股份	2,722,473.00	3.39
45	002384	东山精密	2,680,847.00	3.34
46	605358	立昂微	2,648,797.00	3.30
47	603260	合盛硅业	2,520,702.56	3.14
48	000703	恒逸石化	2,510,126.48	3.13
49	688093	世华科技	2,484,132.94	3.10
50	000636	风华高科	2,447,108.00	3.05
51	300679	电连技术	2,438,976.00	3.04
52	600438	通威股份	2,432,351.00	3.03
53	300363	博腾股份	2,416,571.00	3.01

54	300614	百川畅银	2,394,532.40	2.98
55	300568	星源材质	2,346,895.00	2.93
56	688127	蓝特光学	2,324,518.25	2.90
57	601865	福莱特	2,298,968.00	2.87
58	300456	赛微电子	2,249,352.00	2.80
59	00981	中芯国际	2,238,008.98	2.79
60	601899	紫金矿业	2,212,000.00	2.76
61	300822	贝仕达克	2,207,921.50	2.75
62	688065	凯赛生物	2,188,778.33	2.73
63	002415	海康威视	2,186,330.00	2.73
64	605376	博迁新材	2,167,736.00	2.70
65	600338	西藏珠峰	2,150,379.00	2.68
66	300390	天华超净	2,099,690.80	2.62
67	300776	帝尔激光	2,079,069.00	2.59
68	688677	海泰新光	2,075,509.76	2.59
69	300831	派瑞股份	2,058,643.00	2.57
70	600882	妙可蓝多	2,056,434.00	2.56
71	02269	药明生物	2,012,691.46	2.51
72	688578	艾力斯	1,990,944.01	2.48
73	688779	长远锂科	1,982,971.46	2.47
74	00189	东岳集团	1,981,332.92	2.47
75	300672	国科微	1,953,660.00	2.44
76	300181	佐力药业	1,946,839.00	2.43
77	300655	晶瑞电材	1,939,422.00	2.42
78	300782	卓胜微	1,875,872.80	2.34
79	600546	山煤国际	1,867,360.00	2.33
80	688385	复旦微电	1,856,332.05	2.31
81	603936	博敏电子	1,824,687.00	2.27
82	300480	光力科技	1,782,423.50	2.22
83	688682	霍莱沃	1,773,187.44	2.21
84	688519	南亚新材	1,767,281.02	2.20
85	300666	江丰电子	1,757,020.00	2.19
86	01119	创梦天地	1,738,613.94	2.17
87	02096	先声药业	1,727,227.07	2.15
88	688148	芳源股份	1,697,264.45	2.12
89	688665	四方光电	1,684,677.75	2.10

90	688601	力芯微	1,676,424.23	2.09
91	688630	芯碁微装	1,672,132.76	2.08
92	002049	紫光国微	1,671,892.00	2.08
93	300953	震裕科技	1,636,595.00	2.04
94	603068	博通集成	1,626,662.00	2.03
95	01385	上海复旦	1,618,503.73	2.02
96	300763	锦浪科技	1,613,567.00	2.01

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	603799	华友钴业	13,499,850.40	16.83
2	002241	歌尔股份	11,505,791.67	14.34
3	01347	华虹半导体	9,095,178.08	11.34
4	688536	思瑞浦	8,200,922.24	10.22
5	300454	深信服	7,444,988.00	9.28
6	300496	中科创达	6,970,855.00	8.69
7	300236	上海新阳	6,919,694.00	8.63
8	601888	中国中免	6,726,292.00	8.38
9	688012	中微公司	6,284,332.85	7.83
10	02382	舜宇光学科技	6,210,525.26	7.74
11	002192	融捷股份	5,935,382.00	7.40
12	605499	东鹏饮料	5,679,741.00	7.08
13	00175	吉利汽车	5,505,379.96	6.86
14	002920	德赛西威	5,361,259.00	6.68
15	688019	安集科技	5,026,704.19	6.27
16	000301	东方盛虹	4,982,712.70	6.21
17	002460	赣锋锂业	4,611,815.00	5.75
18	002291	星期六	4,461,335.00	5.56
19	600718	东软集团	4,422,254.00	5.51
20	688127	蓝特光学	4,365,607.75	5.44
21	603236	移远通信	4,150,994.00	5.17
22	605006	山东玻纤	4,143,709.00	5.17
23	300073	当升科技	4,074,991.00	5.08
24	603005	晶方科技	4,051,962.00	5.05
25	300474	景嘉微	4,009,635.00	5.00

26	601012	隆基股份	3,690,124.32	4.60
27	300601	康泰生物	3,663,620.00	4.57
28	603993	洛阳钼业	3,596,700.00	4.48
29	603113	金能科技	3,585,023.01	4.47
30	00522	ASM PACIFIC	3,495,273.84	4.36
31	002475	立讯精密	3,485,234.70	4.34
32	00700	腾讯控股	3,458,349.03	4.31
33	01478	丘钛科技	3,443,020.07	4.29
34	600699	均胜电子	3,391,745.00	4.23
35	688002	睿创微纳	3,361,840.18	4.19
36	688023	安恒信息	3,349,780.66	4.18
37	603986	兆易创新	3,315,361.00	4.13
38	688200	华峰测控	3,034,000.00	3.78
39	601319	中国人保	3,030,487.02	3.78
40	300776	帝尔激光	3,014,023.00	3.76
41	300207	欣旺达	3,006,592.00	3.75
42	603260	合盛硅业	2,962,078.00	3.69
43	601336	新华保险	2,953,813.00	3.68
44	002738	中矿资源	2,947,709.00	3.67
45	000703	恒逸石化	2,944,281.64	3.67
46	002709	天赐材料	2,931,013.00	3.65
47	601233	桐昆股份	2,909,663.60	3.63
48	002414	高德红外	2,905,913.61	3.62
49	002352	顺丰控股	2,880,254.00	3.59
50	600741	华域汽车	2,846,806.00	3.55
51	688063	派能科技	2,842,960.00	3.54
52	002648	卫星化学	2,822,678.00	3.52
53	002129	中环股份	2,810,267.00	3.50
54	300655	晶瑞电材	2,775,658.00	3.46
55	601908	京运通	2,739,509.00	3.42
56	600584	长电科技	2,710,371.00	3.38
57	00981	中芯国际	2,668,641.26	3.33
58	688111	金山办公	2,563,599.26	3.20
59	688008	澜起科技	2,554,584.40	3.18
60	002415	海康威视	2,493,869.20	3.11
61	300679	电连技术	2,477,956.56	3.09
62	300363	博腾股份	2,433,723.00	3.03
63	603893	瑞芯微	2,385,710.00	2.97



64	600438	通威股份	2,382,380.00	2.97
65	605376	博迁新材	2,339,890.00	2.92
66	002876	三利谱	2,329,734.00	2.90
67	002384	东山精密	2,292,484.00	2.86
68	000636	风华高科	2,283,633.00	2.85
69	688677	海泰新光	2,256,137.62	2.81
70	300614	百川畅银	2,250,335.00	2.81
71	600338	西藏珠峰	2,249,837.00	2.80
72	603068	博通集成	2,220,195.00	2.77
73	300822	贝仕达克	2,183,123.12	2.72
74	601899	紫金矿业	2,154,000.00	2.69
75	688578	艾力斯	2,109,887.55	2.63
76	00189	东岳集团	2,107,484.65	2.63
77	300115	长盈精密	2,076,975.00	2.59
78	688779	长远锂科	2,075,894.20	2.59
79	300763	锦浪科技	2,048,702.00	2.55
80	688630	芯碁微装	2,027,463.95	2.53
81	300663	科蓝软件	2,018,064.00	2.52
82	688065	凯赛生物	2,002,459.32	2.50
83	688093	世华科技	1,994,718.70	2.49
84	300666	江丰电子	1,991,627.00	2.48
85	601865	福莱特	1,982,221.47	2.47
86	300672	国科微	1,959,860.00	2.44
87	600546	山煤国际	1,926,400.00	2.40
88	600882	妙可蓝多	1,832,853.00	2.28
89	300568	星源材质	1,824,858.00	2.27
90	688665	四方光电	1,816,845.60	2.26
91	688601	力芯微	1,795,148.63	2.24
92	02269	药明生物	1,787,907.05	2.23
93	300953	震裕科技	1,779,317.00	2.22
94	300390	天华超净	1,771,509.20	2.21
95	688148	芳源股份	1,697,589.86	2.12
96	300660	江苏雷利	1,671,212.00	2.08
97	300456	赛微电子	1,631,762.00	2.03

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

### 8.4.3 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	360,223,378.99
卖出股票收入（成交）总额	408,361,945.43

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

报告期内，本基金未持有国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循基金投资管理相关制度要求，前十大证券发行主体未出现

违法违规行为，投资决策程序符合法律法规和公司制度的规定。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 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	38,293.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,155.18
5	应收申购款	24,269.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,718.78

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字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
华润元大价值优选 A	1,333	13,614.72	0.00	0.00%	18,148,419.62	100.00%
华润元大价值优选 C	1,058	19,939.08	10,000,009.43	47.40%	11,095,535.17	52.60%
合计	2,391	16,413.20	10,000,009.43	25.48%	29,243,954.79	74.52%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	华润元大价值优选 A	9.07	0.0000%
	华润元大价值优选 C	0.00	0.0000%
	合计	9.07	0.0000%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

### 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华润元大价值优选 A	0
	华润元大价值优选 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	华润元大价值优选 A	0

开放式基金	华润元大价值优选 C	0
	合计	0

**9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况**

-

**9.5 发起式基金发起资金持有份额情况**

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	25.48	10,000,000.00	25.48	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	25.48	10,000,000.00	25.48	3 年

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C
基金合同生效日（2020年7月24日）基金份额总额	46,720,178.03	34,922,404.56
本报告期期初基金份额总额	38,055,122.91	43,954,445.75
本报告期基金总申购份额	12,324,458.35	15,041,145.66
减:本报告期基金总赎回份额	32,231,161.64	37,900,046.81
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	18,148,419.62	21,095,544.60

注：本基金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

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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

本报告期内，本基金管理人发生重大人事变动如下：自 2021 年 3 月 3 日起，黄昭棠先生不再担任华润元大基金管理有限公司第三届监事会监事职务；2021 年 3 月 29 日，改选林瑞源为华润元大基金管理有限公司第三届监事会监事。自 2021 年 9 月 18 日起，卢伦女士不再担任华润元大基金管理有限公司第三届监事会监事职务，选举肖震宇先生为华润元大基金管理有限公司第三届监事会监事。自 2021 年 9 月 18 日起，郭庆卫先生不再担任华润元大基金管理有限公司第三届董事会董事职务，选举卢伦女士担任华润元大基金管理有限公司第三届董事会董事。上述变更已按照规定报相关监管机构备案，并进行公告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门变动如下：中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）任命刘彤女士担任资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本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

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为第 2 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 35,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人，托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	408,101,056.96	53.10%	382,873.99	53.28%	-
国信证券	1	360,484,267.46	46.90%	335,763.38	46.72%	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本基金本报告期内租用的基金专用交易单元未发生变化。

### 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
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华润元大基金管理有限公司	证券时报、中证报、	2021 年 1 月 8 日



	关于终止深圳前海汇联基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	上证报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	
2	华润元大基金管理有限公司季度报告提示性公告（2020年第4季度）	证券时报、中证报、上证报、证券日报	2021年1月22日
3	华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021年1月22日
4	关于警惕冒用华润元大基金管理有限公司产品销售机构名义进行诈骗活动的特别提示公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021年3月2日
5	关于华润元大基金管理有限公司监事辞职的公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021年3月4日
6	华润元大基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021年3月6日
7	华润元大基金管理有限公司年度报告提示性公告（2020年度）	证券时报、中证报、上证报、证券日报	2021年3月31日
8	华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021年3月31日
9	关于华润元大基金管理有限公司监事变更的公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021年4月1日
10	华润元大基金管理有限公司季度报告提示性公告（2021年第1季度）	证券时报、中证报、上证报、证券日报	2021年4月22日
11	华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021年4月22日
12	华润元大基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、	2021年6月4日

		基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	
13	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金根据侧袋机制指引修订基金合同的公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 22 日
14	华润元大基金管理有限公司季度报告提示性公告（2021 年第 2 季度）	证券时报、中证报、上证报、证券日报	2021 年 7 月 21 日
15	华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 7 月 21 日
16	华润元大基金管理有限公司中期报告提示性公告（2021 年）	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 8 月 31 日
17	华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金 2021 年中期报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 8 月 31 日
18	关于华润元大基金管理有限公司董事变更的公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 18 日
19	关于华润元大基金管理有限公司监事变更的公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 18 日
20	华润元大基金管理有限公司第三季度报告提示性公告（2021 年）	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 10 月 27 日
21	华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金 2021 年第三季度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 10 月 27 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 年 5 月 26 日至 2021 年 12 月 31 日	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	25.48%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

### 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、中国证监会关于核准本基金募集的批复；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日