

新华鑫回报混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

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。本中期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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	18
5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	19
6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	23
7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	46
7.7 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.....	47
7.8 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.....	47
7.9 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.....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 本报告期投资基金情况.....	47
7.13 投资组合报告附注.....	47
8 基金份额持有人信息	50

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.3 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	51
9 开放式基金份额变动	51
10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
10.2 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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	52
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.9 其他重大事件	55
11 影响投资者决策的其他重要信息	57
12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	58

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华鑫回报混合型证券投资基金
基金简称	新华鑫回报混合
基金主代码	001682
交易代码	001682
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 2 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	199,523,658.38 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	综合运用多种投资策略，在严格控制基金资产净值下行风险的基础上，力争为投资人提供长期稳定的回报。
投资策略	投资策略方面，本基金将以大类资产配置策略为基础，采取稳健的债券投资策略和股票投资策略。
业绩比较基准	45%×沪深 300 指数收益率+55%×中国债券总指数收益率
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预期风险中等预期收益品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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		新华基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	秦一楠
	联系电话	010-68779688	010-66060069
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599
传真		010-68779528	010-68121816
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市东城区建国门内大街69 号
办公地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街28 号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		400010	100031
法定代表人		翟晨曦	谷澍

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-24,622,339.18
本期利润	-14,707,516.77
加权平均基金份额本期利润	-0.0617
本期加权平均净值利润率	-4.40%
本期基金份额净值增长率	-3.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	82,020,880.51
期末可供分配基金份额利润	0.4111
期末基金资产净值	281,544,538.89
期末基金份额净值	1.4111
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	56.45%

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（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，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（为期末余额，不是当期发生数）。

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

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
过去一个月	2.29%	0.43%	4.09%	0.48%	-1.80%	-0.05%
过去三个月	1.75%	0.40%	2.91%	0.64%	-1.16%	-0.24%
过去六个月	-3.42%	0.43%	-4.12%	0.66%	0.70%	-0.23%
过去一年	0.56%	0.35%	-5.30%	0.56%	5.86%	-0.21%
过去三年	42.25%	0.71%	11.04%	0.56%	31.21%	0.15%
自基金合同生效起至今	56.45%	0.93%	21.33%	0.57%	35.12%	0.36%

注：1、本基金于 2015 年 9 月 2 日基金合同生效；

2、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数收益率，债券投资部分的业绩比较基准选择中国债券总指数收益率，复合业绩比较基准为 45%×沪深 300 指数收益率+55%×中国债券总指数收益率。

3、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华鑫回报混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 9 月 2 日至 2022 年 6 月 30 日)



注：本报告期，本基金各项资产配置比例符合合同约定。

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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2022 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十二只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头主题股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、

新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
王丹	本基金基金经理，新华双利债券型证券投资基金基金经理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理。	2021-12-30	-	12	金融学硕士，历任民生证券高级分析师，平安养老保险股份有限公司研究经理、研究总监、高级投资经理。
于航	本基金基金经理助理，新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资	2020-06-03	-	7	统计学硕士，历任新华基金股票交易员，固定收益与平衡投资部研究员，从事宏观研究、策略研究、信用研究、转债研究等多个方向研究工作。

	<p>资基金基金经 理助理、新华 纯债添利债券 型发起式证券 投资基金基金 经理助理、新 华增怡债券型 证券投资基金 基金经理助 理、新华安享 惠金定期开放 债券型证券投 资基金基金经 理助理、新华 丰盈回报债券 型证券投资基金 基金经理助理 、新华鼎利 债券型证券投资 基金基金经 理助理、新华 双利债券型证 券投资基金基 金经理助理、 新华丰利债券 型证券投资基金 基金经理助理 、新华壹诺 宝货币市场基 金基金经理助 理、新华活期 添利货币市场 基金基金经理 助理、新华安 康多元收益一 年持有期混合 型证券投资基金 基金经理助理 、新华安享 惠融 88 个月 定期开放债券 型证券投资基金 基金经理助理 、新华利率 债债券型证券</p>				
--	--	--	--	--	--

	投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。				
李晓然	本基金基金经理助理，新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证	2022-05-19	-	9	金融与投资硕士，历任大公国际资信评估有限公司分析师、行业组长、经理。

	<p>券投资基金基金经理助理、新华丰盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经</p>				
--	--	--	--	--	--

	理助理。				
裴铎	<p>本基金基金经理助理，新华活期添利货币市场基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投</p>	2022-05-19	-	6	国际经济学硕士，历任广发银行金融市场部交易员、投资经理。

	资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理。				
张乃先	本基金基金经理助理，新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华增盈	2020-06-03	2022-04-21	6	经济学硕士，历任新华基金固定收益信用研究员、宏观研究员、高级宏观研究员。

	<p>回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金</p>				
--	---	--	--	--	--

	基金经理助理、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。				
--	---------------------------------------	--	--	--	--

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

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

本报告期末不存在基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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，新华基金管理股份有限公司作为新华鑫回报混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华鑫回报混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无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 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订），公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度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、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易，投资指令统一由交易部下达，并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度，严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中，对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易，交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议，由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部，再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要，可以召开风险管理委员会会议，对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易

所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令，交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况，未发现重大异常情况，且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

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

2022 年上半年，债市整体震荡，一季度降息带动下，10 年国债由 2.8%下行 12BP 至 2.68%，后受社融超预期及稳增长发力预期下，10 年国债调整至 2.8%左右，二季度上海和东北疫情爆发，疫情影响下 10 年国债大幅下行至 2.69%左右，6 月份后随着上海的解封和华东区域经济的恢复，叠加大量专项债的发行，利率出现调整，整体来看，利率上半年是区间震荡。权益市场来看，美联储加息、地缘事件、国内疫情等多重利空叠加影响下，权益市场先暴跌后反弹，1-4 月末，万得全 A、沪深 300 和创业板指数分别下跌-22%、-19%和-30%，5 月-6 月出现反弹，但是上半年整体来看，万得全 A、沪深 300 和创业板指数仍然下跌-9.5%、-9.2%和-15.4%，转债来看，在上半年熊市中体现一定防御属性，1-4 月仅下跌-9.6%，上半年整体来看，仅下跌 4.1%。

本产品报告期间债券部分以金融债和高等级信用债作为底仓，上半年在华东疫情尾声中随着债券的上涨逐步缩短了久期，权益和转债来看，3 月份降低了股票和转债仓位，5 月份后随着权益市场的回暖，逐步增加了权益和转债的仓位，股票结构仍然坚持以“景气行业+高股息”的哑铃组合为主，景气行业以半导体、军工、新能源为主，转债部分来看，以“低价转债+自下而上转债”为主，低价转债从中期来看能够稳健增厚产品收益，自下而上转债则为产品提供弹性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.4111 元，本报告期份额净值增长率为-3.42%，同期比较基准的增长率为-4.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，伴随地产大周期已过，基建只托难举，疫情频发，经济基本面弱，PPI 下行，央

行重心倾向于降低实体融资成本，流动性依旧宽裕，缺资产问题仍然比较突出，因此我们认为股票和债券均具备机会，其中权益资产机会更大，权益方向上仍然维持中期观点-看好科技，特别关注硬科技相关的半导体、军工、新能源等产业链，与此同时，下半年也关注两方面机会：一是 PPI 的下行，带来业绩修复的中游制造业；二是猪周期带来的农业股机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。本基金管理人设有估值小组，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 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

本报告期本基金未出现连续二十个工作日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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—新华基金管理股份有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，新华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，新华基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华鑫回报混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	5,091,084.86	7,329,997.10
结算备付金		2,838,589.58	-
存出保证金		69,480.99	11,670.18
交易性金融资产	6.4.7.2	303,018,564.98	443,421,130.07
其中：股票投资		69,991,134.79	133,851,964.77
基金投资		-	-
债券投资		233,027,430.19	309,569,165.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		2,110,450.02	52,941.83
应收股利		-	-
应收申购款		1,039.92	169.76

递延所得税资产		-	-
其他资产		-	5,453,611.21
资产总计		313,129,210.35	456,269,520.15
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		21,000,000.00	31,349,784.32
应付清算款		3,115.50	-
应付赎回款		9,784,626.21	1,500,004.89
应付管理人报酬		361,022.20	571,811.38
应付托管费		60,170.35	95,301.89
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,301.76	28,501.59
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	370,435.44	159,922.29
负债合计		31,584,671.46	33,705,326.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	199,523,658.38	289,228,016.19
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	82,020,880.51	133,336,177.60
净资产合计		281,544,538.89	422,564,193.79
负债和净资产总计		313,129,210.35	456,269,520.15

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4111 元，基金份额 199,523,658.38 份。

6.2 利润表

会计主体：新华鑫回报混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-11,626,280.01	18,623,901.73
1.利息收入		293,749.14	9,682,002.65
其中：存款利息收入	6.4.7.8	47,718.70	33,038.47
债券利息收入		-	9,602,158.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		246,030.44	46,805.19

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-21,858,800.80	18,297,003.41
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-21,569,386.52	16,721,504.85
基金投资收益	6.4.7.10	-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-206,093.09	444,555.25
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.13	-83,321.19	1,130,943.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	9,914,822.41	-9,820,267.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	23,949.24	465,163.58
减：二、营业总支出		3,081,236.76	7,352,731.43
1. 管理人报酬		2,500,519.04	5,829,919.69
2. 托管费		416,753.21	971,653.23
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		29,289.05	143,255.73
其中：卖出回购金融资产支出		29,289.05	143,255.73
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		4,155.42	29,997.28
8. 其他费用	6.4.7.16	130,520.04	377,905.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,707,516.77	11,271,170.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,707,516.77	11,271,170.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-14,707,516.77	11,271,170.30

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新华鑫回报混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	289,228,016.19	-	133,336,177.60	422,564,193.7

产（基金净值）				9
二、本期期初净资产（基金净值）	289,228,016.19	-	133,336,177.60	422,564,193.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-89,704,357.81	-	-51,315,297.09	-141,019,654.90
（一）、综合收益总额	-	-	-14,707,516.77	-14,707,516.77
（二）、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）	-89,704,357.81	-	-36,607,780.32	-126,312,138.13
其中：1.基金申购款	344,165.34	-	144,020.53	488,185.87
2.基金赎回款	-90,048,523.15	-	-36,751,800.85	-126,800,324.00
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	199,523,658.38	-	82,020,880.51	281,544,538.89
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	6,765,249.04	-	2,532,713.13	9,297,962.17
二、本期期初净资产（基金净值）	6,765,249.04	-	2,532,713.13	9,297,962.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	610,861,907.99	-	246,518,587.61	857,380,495.60
（一）、综合收益总额	-	-	11,271,170.30	11,271,170.30
（二）、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）	610,861,907.99	-	235,247,417.31	846,109,325.30
其中：1.基金申购款	709,586,715.42	-	273,750,449.07	983,337,164.49

2.基金赎回款	-98,724,807.43	-	-38,503,031.76	-137,227,839.19
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	617,627,157.03	-	249,051,300.74	866,678,457.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：翟晨曦，主管会计工作负责人：于春玲，会计机构负责人：徐端骞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华鑫回报混合型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会证监许可【2015】1550 号文《关于准予新华鑫回报混合型证券投资基金注册的批复》注册募集，由新华基金管理股份有限公司发起募集的契约型开放式混合型证券投资基金，存续期不设定。于 2015 年 8 月 10 日通过新华基金管理股份有限公司的直销中心和取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议代为办理基金销售业务的代销机构公开发售，发行期限：2015 年 8 月 10 日至 2015 年 8 月 28 日。首次募集资金总额 541,513,303.71 元，其中募集资金产生利息 33,820.87 元，并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2015]第 01360020 号验资报告予以验证。2015 年 9 月 2 日办理基金备案手续，基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期不设定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新华鑫回报混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。本基金股票的投资比例为 10-90%，中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 20%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，现金或期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 2022 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制，根据实际发生的交易和事项，按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 41 项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华鑫回报混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的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的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则外，本基金本报告期采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。新金融工具准则的执行对本基金的财务状况和经营成果未产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期末未发生差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、

财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	5,091,084.86
等于：本金	5,089,948.50
加：应计利息	1,136.36
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	5,091,084.86

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	69,701,211.32	-	69,991,134.79	289,923.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	1,353,888.72		
	市场	149,874,265.70	151,355,308.55	127,154.13
	银行间		1,310,121.64	
	市场	80,301,580.00	81,672,121.64	60,420.00
合计	230,175,845.70	2,664,010.36	233,027,430.19	187,574.13
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	299,877,057.02	2,664,010.36	303,018,564.98	477,497.60

6.4.7.3 衍生金融资产/负债**6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,671.07
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	258,585.42
其中：交易所市场	257,475.55
银行间市场	1,109.87
应付利息	-
账户维护费	9,000.00
审计费	39,671.58
证券日报	59,507.37
合计	370,435.44

6.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	289,228,016.19	289,228,016.19
本期申购	344,165.34	344,165.34
本期赎回（以“-”号填列）	-90,048,523.15	-90,048,523.15
本期末	199,523,658.38	199,523,658.38

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	182,318,111.26	-48,981,933.66	133,336,177.60
本期利润	-24,622,339.18	9,914,822.41	-14,707,516.77

本期基金份额交易产生的变动数	-50,785,788.57	14,178,008.25	-36,607,780.32
其中：基金申购款	199,035.36	-55,014.83	144,020.53
基金赎回款	-50,984,823.93	14,233,023.08	-36,751,800.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	106,909,983.51	-24,889,103.00	82,020,880.51

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		31,254.49
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		16,464.21
其他		-
合计		47,718.70

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息。

6.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额		199,267,375.70
减：卖出股票成本总额		220,325,363.74
减：交易费用		511,398.48
买卖股票差价收入		-21,569,386.52

6.4.7.10 基金投资收益

报告期末，本基金无基金投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
债券投资收益——利息收入		3,265,832.23
债券投资收益——买卖债券（债转股及		-3,471,925.32

债券到期兑付) 差价收入	
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	-206,093.09

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	431,950,931.00
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	428,525,625.86
减: 应计利息总额	6,891,063.87
减: 交易费用	6,166.59
买卖债券差价收入	-3,471,925.32

6.4.7.12 贵金属投资收益

报告期末, 本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	-83,321.19
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	-83,321.19

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	9,914,822.41
——股票投资	9,807,279.42
——债券投资	107,542.99
——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	9,914,822.41

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	21,404.78
补差费收入	2,544.46
合计	23,949.24

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	12,741.09
中国证券报	2,958.93
账户维护费	18,000.00
查询费	300.00
其他费用	300.00
证券日报	56,548.44
合计	130,520.04

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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
恒泰证券股份有限公司	7,914,807.59	2.34%	28,772,843.80	11.85%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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
恒泰证券股份有限公司	20,633,753.50	8.70%	-	-

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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
恒泰证券股份有限公司	377,100,000.00	15.44%	15,100,000.00	14.34%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30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
恒泰证券股份有限公司	7,370.84	2.71%	1,193.84	0.46%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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
恒泰证券股份有限公司	26,796.19	13.68%	27,115.24	21.47%

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2、上述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,500,519.04	5,829,919.69
其中：支付销售机构的客户维护费	1,247,581.89	2,911,229.42

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提确认。计算公式为：每日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × (1.5% ÷ 当年天数)

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的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，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	416,753.21	971,653.23

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提确认。计算公式为：每日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × (0.25% ÷ 当年天数)

6.4.10.3 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的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	5,091,084.86	31,254.49	10,709,475.90	29,179.30

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

6.4.10.6.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
688238	和元生物	2022-03-15	1-6个月(含)	新股锁定期内	13.23	25.32	11,003.00	145,569.69	278,595.96	-
688262	国芯科技	2021-12-28	1-6个月(含)	新股锁定期内	41.98	47.75	4,165.00	174,846.70	198,878.75	-
688220	翱捷科技	2022-01-06	1-6个月(含)	新股锁定期内	164.54	68.59	2,379.00	391,440.66	163,175.61	-
301122	采纳股份	2022-01-19	1-6个月(含)	新股锁定期内	50.31	70.37	301.00	15,143.31	21,181.37	-
301201	诚达药业	2022-01-12	1-6个月(含)	新股锁定期内	72.69	71.54	282.00	20,498.58	20,174.28	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	1-6个月(含)	新股锁定期内	17.27	14.83	1,154.00	19,929.58	17,113.82	-
301116	益客食品	2022-01-10	1-6个月(含)	新股锁定期内	11.40	20.46	577.00	6,577.80	11,805.42	-
301123	奕东电子	2022-01-14	1-6个月(含)	新股锁定期内	37.23	25.39	401.00	14,929.23	10,181.39	-
300834	星辉环材	2022-01-06	1-6个月(含)	新股锁定期内	55.57	30.03	280.00	15,559.60	8,408.40	-
301158	德石股份	2022-01-07	1-6个月(含)	新股锁定期内	15.64	20.38	379.00	5,927.56	7,724.02	-
301196	唯科科技	2022-01-04	1-6个月(含)	新股锁定期内	64.08	37.52	160.00	10,252.80	6,003.20	-

6.4.12.2 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股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止 2022 年 6 月 30 日, 本基金从事交易所市场正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 21,000,000.00 元, 于 2022 年 7 月 1 日全部到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 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。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。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; 在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 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 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日

A-1	0.00	20,134,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	16,061,777.53	110,189,000.00
合计	16,061,777.53	130,323,000.00

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	148,565,116.58	-
AAA 以下	27,287,226.49	-
未评级	41,113,309.59	-
合计	216,965,652.66	-

注：上年度末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.3 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。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。

除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,091,084.86	-	-	-	5,091,084.86
结算备付金	2,838,589.58	-	-	-	2,838,589.58
存出保证金	69,480.99	-	-	-	69,480.99
交易性金融资产	16,061,777.53	181,820,143.31	35,145,509.35	69,991,134.79	303,018,564.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他权益工具投资	-	-	-	0.00	0.00
应收清算款	-	-	-	2,110,450.02	2,110,450.02
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	1,039.92	1,039.92
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00

资产总计	24,060,932.96	181,820,143.31	35,145,509.35	72,102,624.73	313,129,210.35
负债					
短期借款	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融负债	-	-	-	0.00	0.00
衍生金融负债	-	-	-	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	21,000,000.00	-	-	-	21,000,000.00
应付清算款	-	-	-	3,115.50	3,115.50
应付赎回款	-	-	-	9,784,626.21	9,784,626.21
应付管理人报酬	-	-	-	361,022.20	361,022.20
应付托管费	-	-	-	60,170.35	60,170.35
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	5,301.76	5,301.76
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	370,435.44	370,435.44
负债总计	21,000,000.00	0.00	0.00	10,584,671.46	31,584,671.46
利率敏感度缺口	3,060,932.96	181,820,143.31	35,145,509.35	61,517,953.27	281,544,538.89
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,329,997.10	-	-	-	7,329,997.10
结算备付金	0.00	-	-	-	0.00
存出保证金	11,670.18	-	-	-	11,670.18
交易性金融资产	284,260,251.20	18,357,942.90	6,950,971.20	133,851,964.77	443,421,130.07
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	52,941.83	52,941.83
应收利息	-	-	-	5,453,611.21	5,453,611.21
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	169.76	169.76

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	291,601,918.48	18,357,942.90	6,950,971.20	139,358,687.57	456,269,520.15
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	31,349,784.32	-	-	-	31,349,784.32
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	1,500,004.89	1,500,004.89
应付管理人报酬	-	-	-	571,811.38	571,811.38
应付托管费	-	-	-	95,301.89	95,301.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	95,018.33	95,018.33
应交税费	-	-	-	28,501.59	28,501.59
应付利息	-	-	-	4,777.89	4,777.89
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	60,126.07	60,126.07
负债总计	31,349,784.32	0.00	0.00	2,355,542.04	33,705,326.36
利率敏感度缺口	260,252,134.16	18,357,942.90	6,950,971.20	137,003,145.53	422,564,193.79

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点		
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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	-1,731,746.81	-375,853.78
	市场利率下降 25.00 bp	1,753,857.73	378,463.62

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的资产与负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场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股票和债券，所面临的最大市场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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	69,991,134.79	24.86	133,851,964.77	31.68
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	233,027,430.19	82.77	309,569,165.30	73.26
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	303,018,564.98	107.63	443,421,130.07	104.94

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升或下降 1%		
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	上年度末

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
沪深 300 指数上升 1%	802,662.43	1,383,800.86
沪深 300 指数下降 1%	-802,662.43	-1,383,800.86

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末
	2022 年 6 月 30 日
第一层次	122,681,199.49
第二层次	179,594,123.27
第三层次	743,242.22
合计	303,018,564.98

6.4.14.2.2 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，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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 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	69,991,134.79	22.35
	其中：股票	69,991,134.79	22.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	233,027,430.19	74.42
	其中：债券	233,027,430.19	74.42
	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	7,929,674.44	2.53
8	其他各项资产	2,180,970.93	0.70
9	合计	313,129,210.35	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,129,000.00	0.76

B	采矿业	-	-
C	制造业	56,596,498.24	20.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,618,561.84	0.57
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	198,878.75	0.07
J	金融业	9,169,600.00	3.26
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	278,595.96	0.10
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	69,991,134.79	24.86

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 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	603486	科沃斯	40,000	4,875,600.00	1.73
2	000333	美的集团	80,000	4,831,200.00	1.72
3	600958	东方证券	450,000	4,594,500.00	1.63
4	603986	兆易创新	31,000	4,408,510.00	1.57
5	688037	芯源微	30,000	4,349,100.00	1.54
6	603501	韦尔股份	24,000	4,152,720.00	1.47
7	688082	盛美上海	40,000	3,790,800.00	1.35
8	002409	雅克科技	60,000	3,330,600.00	1.18

9	601601	中国太保	130,000	3,058,900.00	1.09
10	603650	彤程新材	90,000	2,932,200.00	1.04
11	300777	中简科技	60,000	2,892,000.00	1.03
12	688981	中芯国际	60,000	2,710,200.00	0.96
13	002049	紫光国微	14,000	2,656,080.00	0.94
14	688008	澜起科技	40,000	2,423,200.00	0.86
15	300498	温氏股份	100,000	2,129,000.00	0.76
16	688233	神工股份	35,000	1,967,000.00	0.70
17	002371	北方华创	7,000	1,939,840.00	0.69
18	600760	中航沈飞	30,000	1,813,500.00	0.64
19	688388	嘉元科技	20,000	1,697,400.00	0.60
20	600900	长江电力	70,007	1,618,561.84	0.57
21	600030	中信证券	70,000	1,516,200.00	0.54
22	300775	三角防务	30,000	1,444,500.00	0.51
23	600438	通威股份	20,000	1,197,200.00	0.43
24	688012	中微公司	10,000	1,167,500.00	0.41
25	688167	炬光科技	6,000	892,500.00	0.32
26	300750	宁德时代	1,500	801,000.00	0.28
27	688238	和元生物	11,003	278,595.96	0.10
28	688262	国芯科技	4,165	198,878.75	0.07
29	688220	翱捷科技	2,379	163,175.61	0.06
30	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
31	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.01
32	301201	诚达药业	282	20,174.28	0.01
33	301217	铜冠铜箔	1,154	17,113.82	0.01
34	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
35	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
36	301123	奕东电子	401	10,181.39	0.00
37	301100	风光股份	460	9,926.80	0.00
38	300834	星辉环材	280	8,408.40	0.00
39	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
40	301196	唯科科技	160	6,003.20	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	603501	韦尔股份	10,785,861.00	2.55
2	688082	盛美上海	10,210,519.99	2.42
3	603986	兆易创新	9,028,561.80	2.14

4	600941	中国移动	7,505,500.00	1.78
5	600958	东方证券	6,947,908.16	1.64
6	002409	雅克科技	6,517,837.96	1.54
7	600038	中直股份	5,847,915.00	1.38
8	600760	中航沈飞	5,292,527.00	1.25
9	300782	卓胜微	5,143,451.82	1.22
10	603486	科沃斯	4,736,540.60	1.12
11	300059	东方财富	4,614,797.63	1.09
12	000333	美的集团	4,582,572.00	1.08
13	688037	芯源微	4,530,234.70	1.07
14	603859	能科科技	4,274,380.00	1.01
15	002371	北方华创	3,817,483.00	0.90
16	300498	温氏股份	3,775,607.00	0.89
17	002013	中航机电	3,700,659.00	0.88
18	601688	华泰证券	3,618,697.00	0.86
19	603650	彤程新材	3,157,781.00	0.75
20	300777	中简科技	3,024,420.00	0.72

注：本项“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

7.4.2 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	300059	东方财富	8,851,356.02	2.09
2	603986	兆易创新	8,243,137.00	1.95
3	600941	中国移动	7,985,686.00	1.89
4	000002	万科A	5,686,474.00	1.35
5	688082	盛美上海	5,515,727.14	1.31
6	600887	伊利股份	5,202,717.00	1.23
7	600048	保利发展	5,201,372.00	1.23
8	603501	韦尔股份	4,898,577.00	1.16
9	300782	卓胜微	4,867,101.00	1.15
10	600750	江中药业	4,844,371.44	1.15
11	000651	格力电器	4,780,690.36	1.13
12	600038	中直股份	4,522,474.90	1.07
13	000333	美的集团	4,455,395.00	1.05
14	002643	万润股份	4,313,517.00	1.02
15	300251	光线传媒	4,199,307.00	0.99
16	600570	恒生电子	4,064,935.80	0.96
17	002001	新和成	3,926,515.20	0.93
18	002475	立讯精密	3,886,183.00	0.92

19	600690	海尔智家	3,772,586.00	0.89
20	600760	中航沈飞	3,709,218.40	0.88

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	146,657,254.34
卖出股票的收入（成交）总额	199,267,375.70

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

7.5 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	16,061,777.53	5.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,366,050.41	21.80
	其中：政策性金融债	41,113,309.59	14.60
4	企业债券	102,166,295.33	36.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	53,433,306.92	18.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	233,027,430.19	82.77

7.6 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	210316	21 进出 16	200,000	20,946,876.71	7.44

2	175707	21 鲁高 01	200,000	20,594,890.96	7.31
3	185219	22 海通 C1	200,000	20,332,975.34	7.22
4	2228003	22 兴业银行二级 01	200,000	20,306,071.23	7.21
5	2228001	22 邮储银行永续债 01	200,000	20,252,740.82	7.19

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同尚无股指期货投资政策。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同尚无国债期货投资政策。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1(一)“韦尔股份”发行人上海韦尔半导体股份有限公司，因资产质押情况未及时在临时公告中披露，上海监管局对其采取出具警示函的监管措施。（《关于上海韦尔半导体股份有限公司采取出具警示函措施的决定》，沪证监决〔2021〕67号，2021年4月28日）

(二)“21 进出 16”发行人中国进出口银行：

(1) 因漏报不良贷款余额 EAST 数据等 17 项违规，被罚款 420 万元。（【银保监罚决字（2022）9 号】，2022 年 3 月 21 日）

(2) 因违规投资企业股权、租金保理业务基础交易不真实、反国家压降地方债务的政策要求，变相支持地方政府举债等 24 项违法违规行为，银保监会依法对其罚没 7345.6 万元。（银保监罚决字（2021）31 号，2021 年 7 月 31 日）

(3) 2021 年 11 月，中国进出口银行因执行内部收费减免要求不到位，被银保监会消费者权益保护局列为典型案例并进行通报。

(三)“22 海通 C1”发行人海通证券股份有限公司：

(1) 因下属机构的设立未按规定履行或者履行完毕备案程序等行为，证监会对其责令改正。（《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》，证监会行政监管措施（2022）25 号，2022 年 6 月 2 日）

(2) 2021 年 12 月 27 日，海通证券被全国股转公司通报批评，因海通证券未按照《全国中小企业股份转让系统主办券商持续督导工作指引》及相关业务规则的规定，建立健全并有效执行持续督导工作制度，缺乏有效的内控机制。

(3) 2021 年 10 月 14 日，海通证券公告收到重庆证监局《行政处罚决定书》，海通证券因在奥瑞德重大资产重组并募集配套资金项目中，未对奥瑞德违规对外担保事项保持充分关注等行为，中国证券监督管理委员会重庆监管局对公司责令改正，没收财务顾问业务收入 100 万元，并处以 300 万元罚款。

(四)“22 兴业银行二级 01”发行人兴业银行股份有限公司：

(1) 因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送 14 项违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会对其处以罚款 350 万元。（银保监罚决字（2022）22 号，2022 年 3 月 21 日）

(2) 因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，中国人民银行对其罚款 5 万元。（银罚字（2021）26 号，2021 年 8 月 20 日）

(3) 因未按规定履行客户身份识别义务，中国人民银行福州中心对其罚款 43 万元。（福银罚字（2021）29 号，2021 年 7 月 14 日）

(4) 因适当性管理落实不到位、向个人住房按揭贷款客户搭售人身意外险以及代销保险业务中欺骗投保人等行为被银保监会通报。(银保监会消费者权益保护局 2021 年第 12 号通报《关于兴业银行侵害消费者权益情况的通报》，2021 年 7 月 7 日)。

(五) “22 邮储银行永续债 01”的发行人邮政储蓄银行：

(1) 因监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及数据报送存在十三项违法违规行为，被银保监会罚款 370 万元。【银保监罚决字 (2022) 16 号】

(2) 邮储银行利用市场优势地位转嫁抵押评估费，因违规及不当收费问题被点名。

(3) 邮储银行在相关债务融资工具的簿记建档过程中，未按照《发行方案》及《申购说明》约定时间接受申购定单，开展相关簿记工作；其次，是成为非金融企业债务融资工具 A 类主承销商以来，未及时合规配备、使用簿记场所和设备，未能妥善保管簿记建档期间相关工作底稿。

(4) 银保监会因邮政储蓄银行违反相关审慎经营原则，如：向监管机构报送材料内容不实等，作出罚款 449 万的决定，【银保监罚决字 (2021) 23 号】

(5) 邮储银行因违反规定办理资本项目资金收付等被处以警告，被国家外汇管理局北京外汇管理部没收违法所得 673625.55 元，处 444 万元罚款。

(6) 邮储银行因违反账户管理相关规定，警告并处罚 600 万元。【银罚字 (2021) 16 号】

本公司对以上证券的投资决策符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期末本基金投资的其他前十名证券没有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。

7.13.2 本报告期，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	69,480.99
2	应收清算款	2,110,450.02
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,039.92
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,180,970.93

7.13.4 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	110081	闻泰转债	7,144,676.77	2.54
2	127018	本钢转债	7,079,794.52	2.51
3	110059	浦发转债	5,935,930.96	2.11
4	113013	国君转债	5,527,597.36	1.96
5	113042	上银转债	5,043,613.81	1.79
6	113046	金田转债	3,647,174.93	1.30
7	127040	国泰转债	2,579,173.41	0.92
8	128035	大族转债	2,256,369.86	0.80
9	128136	立讯转债	2,174,996.04	0.77
10	123123	江丰转债	2,082,553.26	0.74
11	123077	汉得转债	1,892,389.73	0.67
12	118001	金博转债	1,375,258.90	0.49
13	110076	华海转债	1,139,141.10	0.40
14	127024	盈峰转债	754,543.42	0.27
15	127026	超声转债	583,173.29	0.21

7.13.5 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。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的	持有人结构
----------	-------	-------

	基金份额	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
1,589	125,565.55	0.00	0.00%	199,523,658.38	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	73,789.76	0.04%

8.3 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0~10 万份。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 9 月 2 日）基金份额总额	541,547,124.58
本报告期期初基金份额总额	289,228,016.19
本报告期基金总申购份额	344,165.34
减：本报告期基金总赎回份额	90,048,523.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	199,523,658.38

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期基金管理人无重大人事变动。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期未有基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 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会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金不存在管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.8.1 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	
银河证券	1	43,818,349.22	12.96%	32,044.53	11.78%	-
中信证券	2	41,899,583.18	12.39%	39,021.65	14.35%	-
信达证券	1	36,884,966.89	10.91%	26,974.27	9.92%	-
华创证券	2	30,682,286.86	9.07%	22,437.47	8.25%	-
东方财富	2	29,512,571.33	8.73%	21,582.58	7.93%	-
中泰证券	2	26,579,529.11	7.86%	19,437.55	7.15%	-
中金公司	1	24,658,990.75	7.29%	22,965.19	8.44%	-
招商证券	1	18,890,702.72	5.59%	17,592.98	6.47%	-
光大证券	1	17,602,715.08	5.21%	16,393.54	6.03%	-
浙商证券	1	16,365,138.84	4.84%	11,967.70	4.40%	-
国盛证券	2	14,902,414.47	4.41%	10,897.66	4.01%	-
申万宏源	1	9,244,376.68	2.73%	8,609.19	3.16%	-
恒泰证券	2	7,914,807.59	2.34%	7,370.84	2.71%	-
民生证券	2	6,763,169.27	2.00%	4,945.58	1.82%	-
华泰证券	1	4,811,925.44	1.42%	3,518.38	1.29%	-

东吴证券	1	4,056,857.56	1.20%	2,966.66	1.09%	-
华西证券	1	3,538,524.93	1.05%	3,295.45	1.21%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字[1998]29号）以及《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）的有关规定，本基金共租用42个交易席位，其中报告期内新增0个交易席位，退租0个交易席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

10.8.2 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		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
银河证券	25,617,774.21	10.80%	154,900,000.00	6.34%	-	-
中信证券	40,452,669.80	17.06%	236,400,000.00	9.68%	-	-
信达证券	7,437,453.77	3.14%	6,000,000.00	0.25%	-	-
华创证券	14,809,582.91	6.25%	366,500,000.00	15.01%	-	-
东方财富	6,132,707.16	2.59%	156,400,000.00	6.41%	-	-
中泰证券	2,324,130.11	0.98%	3,500,000.00	0.14%	-	-
中金公司	9,184,366.30	3.87%	212,500,000.00	8.70%	-	-
招商证券	14,134,577.01	5.96%	15,000,000.00	0.61%	-	-
光大证券	1,350,256.81	0.57%	-	-	-	-
浙商证券	29,583,206.78	12.48%	-	-	-	-
国盛证券	11,004,576.91	4.64%	277,000,000.00	11.35%	-	-
申万宏源	1,719,065.40	0.72%	102,900,000.00	4.21%	-	-
恒泰证券	20,633,753.50	8.70%	377,100,000.00	15.44%	-	-
民生证券	1,531,872.60	0.65%	387,300,000.00	15.86%	-	-
华泰证券	5,001,000.00	2.11%	146,100,000.00	5.98%	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	5,551,666.79	2.34%	-	-	-	-
国泰君安	40,661,156.16	17.15%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

10.9 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	新华基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-01-04
2	新华鑫回报混合型证券投资基金招募说明书（更新）	公司网站、电子信披网站	2022-01-05
3	新华鑫回报混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2022-01-05
4	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海万得基金销售有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-01-11
5	新华基金管理股份有限公司关于北京分公司营业场所变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2022-01-13
6	新华基金管理股份有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2022-01-13
7	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2021 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-01-21
8	新华鑫回报混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-01-21

9	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-02-15
10	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-02-24
11	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-02-25
12	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-03-07
13	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中信百信银行股份有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-03-16
14	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券股份有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-03-18
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-03-28
17	新华鑫回报混合型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2022-03-30
16	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-03-30
18	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在上海利得基金销售有限公司开展费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-15
19	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加五矿证券有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-20
21	新华鑫回报混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-04-21
20	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-21
22	新华基金管理股份有限公司关于部分基金增	中国证券报、上海证券	2022-05-09

	加博时财富基金销售有限公司作为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	
23	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海攀赢基金销售有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-06-09
24	新华基金管理股份有限公司关于部分基金增加英大证券有限责任公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-06-22

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准新华鑫回报混合型证券投资基金募集的文件
- (二)关于申请募集新华鑫回报混合型证券投资基金之法律意见书
- (三)新华鑫回报混合型证券投资基金基金合同
- (四)新华鑫回报混合型证券投资基金托管协议
- (五)新华鑫回报混合型证券投资基金登记结算服务协议
- (六)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (七)《新华鑫回报混合型证券投资基金招募说明书》(更新)
- (八)《新华鑫回报混合型证券投资基金产品资料概要》(更新)
- (九)基金管理人业务资格批件、营业执照及公司章程
- (十)基金托管人业务资格批件和营业执照
- (十一)重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (十二)中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二二年八月三十日