

# 新华鑫泰灵活配置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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	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遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
<b>5 托管人报告</b> .....	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	10
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.....	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	10
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
<b>7 投资组合报告</b> .....	57
7.1 期末基金资产组合情况.....	57
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	59
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.....	65
7.4 期末指数投资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.....	65
7.5 期末积极投资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.....	66
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	69
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	69
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	70
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	70
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
7.13 投资组合报告附注.....	72
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	74
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74

8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	76
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	77
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	78
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>80</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>81</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	81
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 .....	81
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	81
10.4 基金投资策略的改变 .....	81
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	81
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	81
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	81
10.8 其他重大事件 .....	82
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>84</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>84</b>
12.1 备查文件目录 .....	84
12.2 存放地点 .....	84
12.3 查阅方式 .....	85

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	新华鑫泰灵活配置混合
基金主代码	004573
交易代码	004573
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年8月9日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	46,194,436.08 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追求基金资产净值的持续、稳定增长，力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	投资策略方面，本基金将兼顾下行风险控制和收益获取。在资产配置策略方面，主要采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在股票投资策略方面，主要采用趋势跟随策略、定向增发策略、事件驱动策略、大宗交易策略等。在债券投资策略方面，本基金将综合运用久期策略、收益率曲线策略、信用策略、杠杆策略、中小企业私募债券投资策略及可转债投资策略，在获取稳定收益的同时，降低基金资产净值整体的波动性。本基金在股指期货的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率 ×40%
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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	张燕
	联系电话	010-68779688	0755-83199084
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话	4008198866	95555
传真	010-68779528	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	400010	518040
法定代表人	翟晨曦	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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	-18,140,695.30
本期利润	-13,681,965.48
加权平均基金份额本期利润	-0.2765
本期加权平均净值利润率	-17.69%
本期基金份额净值增长率	-13.82%
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	27,573,377.07
期末可供分配基金份额利润	0.5969
期末基金资产净值	73,767,813.15
期末基金份额净值	1.5969
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	59.69%

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。

### 3.2 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	8.56%	1.58%	5.58%	0.64%	2.98%	0.94%
过去三个月	7.12%	1.40%	3.84%	0.86%	3.28%	0.54%
过去六个月	-13.82%	1.39%	-5.46%	0.87%	-8.36%	0.52%
过去一年	-12.84%	1.61%	-7.69%	0.75%	-5.15%	0.86%
过去三年	77.73%	1.64%	13.11%	0.75%	64.62%	0.89%
自基金成立起至今	59.69%	1.43%	17.86%	0.76%	41.83%	0.67%

#### 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

新华鑫泰灵活配置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

(2017年8月9日至2022年6月30日)



注：本基金于 2017 年 8 月 9 日基金合同生效，报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

## 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		
栾超	本基金基金经理，联席权益投资总监、权益投资部副总监，新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理、新华景气行业混合型证券投资基金基金经理。	2021-11-11	-	10	经济学硕士，历任中邮创业基金管理股份有限公司研究员、基金经理助理、基金经理。
甄茂生	本基金基金经理助理，新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理助理、新华泛资源优势灵活配置混合型证券	2021-11-12	2022-05-06	5	上海财经大学经济学博士，历任华创证券研究所助理研究员、研究员。

	投资基金基金经理助理、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理助理、新华景气行业混合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的基金经理助理。				
--	--	--	--	--	--

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泰灵活配置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》、《新华鑫泰灵活配置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，A 股市场先抑后扬，一季度在内外不确定性冲击下出现较大幅度回撤，但二季度随着疫情的缓解，市场出现 V 型反转。本基金坚持自上而下选择景气度高的行业，同时自下而上在上述行业中精选个股的投资框架，以科技制造业为主线进行配置。投资中从我国经济发展阶段出发，把握产业转型升级和全球化的发展趋势，重点投资了高端制造业中具备全球比较优势的产业和公司。与此同时，我们也沿着稳增长相关的政策出发，投资了经济企稳复苏后受益的产业链。

##### 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 1.5969 元，本报告期份额净值增长率为-13.82%，比较基准的增长率为-5.46%。

#### 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 年下半年，我们认为货币政策和财政政策都将维持较为宽松的状态，我们投资中将会沿着盈利增长的确定性出发寻找投资机会。我们看好这一轮的能源革命，看好中国制造业的全球竞争力，我们从微观入手，寻找细分高景气产业链中盈利高增长的企业。同时，稳增长政策仍在持续发力中，下半年将成果显现期，投资链条有望率先受益于积极的财政政策，展现出业绩弹性。当前疫情对经济的冲击已经出现了明显的拐点，后续经济复苏确定性强。我们将会沿着“高成长+稳增长”的思路，

突出中长期成长性，同时继续注重自下而上寻找长期竞争力突出的优质公司。

#### 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 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：新华鑫泰灵活配置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
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	14,180,591.91	7,315,879.15
结算备付金		350,673.56	179,546.78
存出保证金		67,656.88	29,111.12
交易性金融资产	6.4.7.2	62,282,113.80	90,959,833.86
其中：股票投资	6.4.7.2	62,282,113.80	90,959,833.86
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	1,905,909.87
应收股利		-	-
应收申购款		68,735.90	79,183.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	3,297.12
资产总计		76,949,772.05	100,472,760.97
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,726,703.33	1,441,431.41

应付赎回款		509,414.86	796,924.95
应付管理人报酬		89,473.88	101,589.26
应付托管费		14,912.32	16,931.52
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	841,454.51	427,531.05
负债合计		3,181,958.90	2,784,408.19
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	46,194,436.08	52,721,145.19
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	27,573,377.07	44,967,207.59
净资产合计		73,767,813.15	97,688,352.78
负债和净资产总计		76,949,772.05	100,472,760.97

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5969 元，基金份额总额 46,194,436.08 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新华鑫泰灵活配置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
<b>一、营业总收入</b>		<b>-12,923,638.90</b>	<b>-292,373.09</b>
1.利息收入		37,965.33	57,677.32
其中：存款利息收入	6.4.7.13	37,033.82	52,421.87
债券利息收入		-	23.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		931.51	5,231.83
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,466,178.81	3,049,122.38
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-17,764,143.95	2,878,546.56
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	64,220.15
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-

股利收益	6.4.7.19	297,965.14	106,355.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	4,458,729.82	-3,819,176.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	45,844.76	420,003.81
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>758,326.58</b>	<b>812,133.76</b>
1. 管理人报酬		<b>578,144.13</b>	<b>361,271.54</b>
2. 托管费		96,357.27	60,211.90
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	0.08
8. 其他费用	6.4.7.22	83,825.18	390,650.24
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-13,681,965.48</b>	<b>-1,104,506.85</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-13,681,965.48</b>	<b>-1,104,506.85</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-13,681,965.48</b>	<b>-1,104,506.85</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新华鑫泰灵活配置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（基金净值）	52,721,145.19	-	44,967,207.59	97,688,352.78
二、本期期初净资产（基金净值）	52,721,145.19	-	44,967,207.59	97,688,352.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,526,709.11	-	-17,393,830.52	-23,920,539.63
（一）、综合收益总额	-	-	-13,681,965.48	-13,681,965.48
（二）、本期基金	-6,526,709.11	-	-3,711,865.04	-10,238,574.15

份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				5
其中：1.基金申购款	3,363,021.15	-	1,852,036.77	5,215,057.92
2.基金赎回款	-9,889,730.26	-	-5,563,901.81	-15,453,632.07
（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）	46,194,436.08	-	27,573,377.07	73,767,813.15
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）	15,576,574.40	-	11,497,466.43	27,074,040.83
二、本期期初净资产（基金净值）	15,576,574.40	-	11,497,466.43	27,074,040.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,871,167.06	-	3,854,486.07	6,725,653.13
（一）、综合收益总额	-	-	-1,104,506.85	-1,104,506.85
（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）	2,871,167.06	-	4,958,992.92	7,830,159.98
其中：1.基金申购款	46,781,256.37	-	37,638,226.80	84,419,483.17
2.基金赎回款	-43,910,089.31	-	-32,679,233.88	-76,589,323.19
（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）	18,447,741.46	-	15,351,952.50	33,799,693.96



报表附注为财务报表的组成部分。

本报告至本报告 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

新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金（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]500 号文件《关于核准新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》批准，新华基金管理股份有限公司于 2017 年 6 月 12 日至 2017 年 7 月 28 日向社会公开募集，首次募集资金总额 275,893,870.93 元，其中募集资金产生利息 62,387.85 元，并经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2017] 01360026 号验资报告予以验证。2017 年 8 月 9 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，存续期不限定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫泰灵活配置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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、股指期货、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金等，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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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。

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。

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，按照财政部颁布的企业会计准则及其应用指南、解释及其他有关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协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

本基金报告期内未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

#### 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权激励有关企业所得税问题的通知》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	14,180,591.91
等于：本金	14,178,964.87
加：应计利息	1,627.04
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	14,180,591.91

#### 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	57,788,463.69	-	62,282,113.80	4,493,650.11
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	57,788,463.69	-	62,282,113.80	4,493,650.11

#### 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

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.9 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	381.26
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	761,730.09
其中：交易所市场	761,730.09
银行间市场	-
应付利息	-
中国证券报	39,671.58
审计费	39,671.58
合计	841,454.51

### 6.4.7.10 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	52,721,145.19	52,721,145.19
本期申购	3,363,021.15	3,363,021.15

本期赎回（以“-”号填列）	-9,889,730.26	-9,889,730.26
本期末	46,194,436.08	46,194,436.08

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 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	69,171,273.92	-24,204,066.33	44,967,207.59
本期利润	-18,140,695.30	4,458,729.82	-13,681,965.48
本期基金份额交易产生的变动数	-7,068,092.68	3,356,227.64	-3,711,865.04
其中：基金申购款	3,677,043.36	-1,825,006.59	1,852,036.77
基金赎回款	-10,745,136.04	5,181,234.23	-5,563,901.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,962,485.94	-16,389,108.87	27,573,377.07

#### 6.4.7.13 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	32,672.15
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	4,361.67
其他	-
合计	37,033.82

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息。

#### 6.4.7.14 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	292,026,151.74
减：卖出股票成本总额	309,034,445.66
减：交易费用	755,850.03
买卖股票差价收入	-17,764,143.95

**6.4.7.15 基金投资收益**

本报告期，本基金无基金投资收益。

**6.4.7.16 债券投资收益**

本报告期，本基金无债券投资收益。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

本报告期，本基金无衍生工具收益。

**6.4.7.19 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	297,965.14
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	297,965.14

**6.4.7.20 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	4,458,729.82
——股票投资	4,458,729.82
——债券投资	-
——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	4,458,729.82

**6.4.7.21 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	45,844.30
补差费收入	0.46
合计	45,844.76

**6.4.7.22 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	4,482.02
中国证券报	39,671.58
合计	83,825.18

**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 2022 年 6 月 30 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**

本报告期内本基金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
招商银行股份有限公司	基金托管人

**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**



本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金均无应支付关联方的佣金。

### 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	578,144.13	361,271.54
其中：支付销售机构的客户维护费	278,657.93	56,871.34

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，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	96,357.27	60,211.90

注：1、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，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无销售服务费。

**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**

本基金本报告期末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 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****6.4.10.4.1 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**

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

**6.4.10.4.2 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**

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

**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
招商银行股份有限公司	14,180,591.91	32,672.15	3,509,641.50	50,287.05

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金在报告期内无收益分配事项。

**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**

截止报告期期末，本基金未持有因认购新发/增发证券流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

截至报告期期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

**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**

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

#### 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

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

##### 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

本报告期末及上年度末，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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2022 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	14,180,591.91	-	-	-	14,180,591.91
结算备付金	350,673.56	-	-	-	350,673.56
存出保证金	67,656.88	-	-	-	67,656.88
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	62,282,113.80	62,282,113.80
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	-	-	-	0.00	0.00
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	68,735.90	68,735.90
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	14,598,922.35	0.00	0.00	62,350,849.70	76,949,772.05
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	0.00	-	-	-	0.00
应付清算款	-	-	-	1,726,703.33	1,726,703.33
应付赎回款	-	-	-	509,414.86	509,414.86
应付管理人报酬	-	-	-	89,473.88	89,473.88
应付托管费	-	-	-	14,912.32	14,912.32
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	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	841,454.51	841,454.51
负债总计	0.00	0.00	0.00	3,181,958.90	3,181,958.90
利率敏感度缺口	14,598,922.35	0.00	0.00	59,168,890.80	73,767,813.15
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	7,315,879.15	-	-	-	7,315,879.15
结算备付金	179,546.78	-	-	-	179,546.78
存出保证金	29,111.12	-	-	-	29,111.12
交易性金融资产	-	0.00	0.00	90,959,833.86	90,959,833.86
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,905,909.87	1,905,909.87
应收利息	-	-	-	3,297.12	3,297.12
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	79,183.07	79,183.07
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,524,537.05	0.00	0.00	92,948,223.92	100,472,760.97
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,441,431.41	1,441,431.41
应付赎回款	-	-	-	796,924.95	796,924.95
应付管理人报酬	-	-	-	101,589.26	101,589.26
应付托管费	-	-	-	16,931.52	16,931.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	346,538.72	346,538.72
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	80,992.33	80,992.33
负债总计	0.00	0.00	0.00	2,784,408.19	2,784,408.19
利率敏感度缺口	7,524,537.05	0.00	0.00	90,163,815.73	97,688,352.78

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

本报告期末及上年度末，本基金无债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产与负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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	62,282,113.80	84.43	90,959,833.86	93.11
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	62,282,113.80	84.43	90,959,833.86	93.11

##### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
沪深 300 指数上升 1%	806,104.16	1,014,358.84
沪深 300 指数下降 1%	-806,104.16	-1,014,358.84

#### 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	62,282,113.80
第二层次	-
第三层次	-
合计	62,282,113.80

###### 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

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）（统称“新金融工具准则”）和《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）等相关规定，自 2022 年 1 月 1 日起，本基金开始执行新金融工具准则，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

## 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	62,282,113.80	80.94
	其中：股票	62,282,113.80	80.94
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	14,531,265.47	18.88
8	其他各项资产	136,392.78	0.18
9	合计	76,949,772.05	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	1,050,486.00	1.42
C	制造业	59,429,152.75	80.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	422,688.00	0.57
E	建筑业	835,654.00	1.13
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	544,133.05	0.74
J	金融业	-	-
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	-	-
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	62,282,113.80	84.43

## 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	300750	宁德时代	7,700	4,111,800.00	5.57
2	600519	贵州茅台	1,900	3,885,500.00	5.27
3	603799	华友钴业	36,920	3,530,290.40	4.79
4	601012	隆基绿能	42,900	2,858,427.00	3.87
5	002594	比亚迪	7,900	2,634,571.00	3.57
6	600690	海尔智家	81,600	2,240,736.00	3.04
7	600522	中天科技	94,500	2,182,950.00	2.96

8	002049	紫光国微	11,500	2,181,780.00	2.96
9	002812	恩捷股份	8,200	2,053,690.00	2.78
10	300699	光威复材	33,700	1,983,919.00	2.69
11	603218	日月股份	75,700	1,922,780.00	2.61
12	000858	五粮液	9,200	1,857,756.00	2.52
13	600765	中航重机	47,920	1,542,065.60	2.09
14	300118	东方日升	49,000	1,437,170.00	1.95
15	300068	南都电源	92,900	1,425,086.00	1.93
16	300850	新强联	15,600	1,388,868.00	1.88
17	603876	鼎胜新材	27,300	1,233,960.00	1.67
18	600487	亨通光电	82,400	1,198,096.00	1.62
19	603063	禾望电气	29,600	1,138,120.00	1.54
20	300185	通裕重工	371,100	1,065,057.00	1.44
21	600884	杉杉股份	33,600	998,592.00	1.35
22	300207	欣旺达	31,100	982,760.00	1.33
23	688186	广大特材	30,335	967,686.50	1.31
24	002483	润邦股份	147,200	950,912.00	1.29
25	300894	火星人	24,900	931,011.00	1.26
26	688033	天宜上佳	42,132	894,883.68	1.21
27	601390	中国中铁	136,100	835,654.00	1.13
28	002132	恒星科技	115,000	834,900.00	1.13
29	600330	天通股份	65,100	775,341.00	1.05
30	603806	福斯特	11,400	746,928.00	1.01
31	603786	科博达	11,700	720,369.00	0.98
32	600348	华阳股份	42,100	650,866.00	0.88
33	600031	三一重工	33,900	646,134.00	0.88
34	002371	北方华创	2,200	609,664.00	0.83
35	603501	韦尔股份	3,500	605,605.00	0.82
36	600973	宝胜股份	103,600	599,844.00	0.81
37	002895	川恒股份	16,800	568,008.00	0.77
38	688349	三一重能	13,498	550,043.50	0.75
39	600406	国电南瑞	20,040	541,080.00	0.73
40	603801	志邦家居	19,400	523,412.00	0.71
41	002645	华宏科技	22,500	490,950.00	0.67
42	600111	北方稀土	13,000	457,080.00	0.62
43	002074	国轩高科	9,400	428,640.00	0.58
44	600905	三峡能源	67,200	422,688.00	0.57
45	002192	融捷股份	2,600	399,620.00	0.54
46	600809	山西汾酒	1,200	389,760.00	0.53
47	300274	阳光电源	3,700	363,525.00	0.49
48	000657	中钨高新	22,500	337,500.00	0.46
49	601717	郑煤机	23,300	335,753.00	0.46
50	600399	抚顺特钢	17,600	315,040.00	0.43
51	002831	裕同科技	7,700	227,535.00	0.31

52	605117	德业股份	800	223,912.00	0.30
53	300443	金雷股份	4,900	223,342.00	0.30
54	300014	亿纬锂能	2,200	214,500.00	0.29
55	601966	玲珑轮胎	7,500	190,275.00	0.26
56	301031	中熔电气	1,300	186,394.00	0.25
57	688800	瑞可达	1,174	148,287.94	0.20
58	603678	火炬电子	1,200	56,172.00	0.08
59	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.05
60	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.02
61	001268	联合精密	409	11,337.48	0.02
62	688173	希荻微	91	3,053.05	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	601012	隆基绿能	8,108,073.02	8.30
2	600522	中天科技	7,964,311.08	8.15
3	300750	宁德时代	5,991,743.00	6.13
4	002594	比亚迪	5,720,976.59	5.86
5	300850	新强联	4,722,475.70	4.83
6	002812	恩捷股份	4,427,768.00	4.53
7	000983	山西焦煤	4,280,747.40	4.38
8	002920	德赛西威	4,186,852.36	4.29
9	601865	福莱特	4,070,272.70	4.17
10	002049	紫光国微	4,068,170.00	4.16
11	000858	五粮液	2,979,615.00	3.05
12	600519	贵州茅台	2,959,995.00	3.03
13	000923	河钢资源	2,940,230.75	3.01
14	601686	友发集团	2,893,196.00	2.96
15	603218	日月股份	2,852,044.84	2.92
16	603005	晶方科技	2,822,224.60	2.89
17	002043	兔宝宝	2,759,120.00	2.82
18	600438	通威股份	2,721,186.00	2.79
19	603799	华友钴业	2,708,077.42	2.77
20	600406	国电南瑞	2,559,607.00	2.62
21	688408	中信博	2,437,953.05	2.50
22	300118	东方日升	2,426,531.00	2.48
23	600111	北方稀土	2,303,371.00	2.36
24	300014	亿纬锂能	2,210,874.00	2.26

25	002415	海康威视	2,210,077.00	2.26
26	300207	欣旺达	2,157,080.38	2.21
27	000910	大亚圣象	2,142,273.00	2.19
28	300525	博思软件	2,073,452.00	2.12
29	603806	福斯特	2,073,261.00	2.12
30	688186	广大特材	2,052,654.22	2.10
31	300568	星源材质	2,018,203.00	2.07
32	605305	中际联合	2,003,372.00	2.05
33	603606	东方电缆	2,001,171.00	2.05
34	600809	山西汾酒	1,954,858.00	2.00

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	601012	隆基绿能	8,708,448.30	8.91
2	600522	中天科技	6,782,345.00	6.94
3	002594	比亚迪	6,644,964.00	6.80
4	601865	福莱特	6,559,273.00	6.71
5	300750	宁德时代	5,563,107.00	5.69
6	002920	德赛西威	5,282,986.00	5.41
7	002508	老板电器	5,052,777.00	5.17
8	002043	兔宝宝	4,915,899.96	5.03
9	000983	山西焦煤	4,815,066.00	4.93
10	000651	格力电器	4,403,513.00	4.51
11	603801	志邦家居	4,331,380.00	4.43
12	603218	日月股份	4,125,980.00	4.22
13	600690	海尔智家	3,932,604.00	4.03
14	603005	晶方科技	3,905,446.56	4.00
15	300850	新强联	3,732,166.00	3.82
16	300059	东方财富	3,624,854.00	3.71
17	688408	中信博	3,471,137.20	3.55
18	000858	五粮液	3,461,147.51	3.54
19	600438	通威股份	3,107,458.00	3.18
20	000333	美的集团	3,102,550.00	3.18
21	603259	药明康德	2,945,158.00	3.01
22	000923	河钢资源	2,813,996.00	2.88
23	601686	友发集团	2,748,911.32	2.81
24	600600	青岛啤酒	2,628,659.00	2.69
25	002572	索菲亚	2,506,197.00	2.57

26	603606	东方电缆	2,337,749.00	2.39
27	600519	贵州茅台	2,261,716.00	2.32
28	000807	云铝股份	2,246,332.00	2.30
29	002918	蒙娜丽莎	2,187,363.80	2.24
30	000786	北新建材	2,161,400.00	2.21
31	603816	顾家家居	2,139,474.00	2.19
32	002812	恩捷股份	2,139,031.00	2.19
33	002027	分众传媒	2,137,550.00	2.19
34	002531	天顺风能	2,132,596.80	2.18
35	600111	北方稀土	2,119,935.00	2.17
36	600406	国电南瑞	1,972,615.00	2.02
37	002056	横店东磁	1,955,334.00	2.00
38	002415	海康威视	1,953,827.00	2.00
39	300525	博思软件	1,951,826.00	2.00

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	275,897,995.78
卖出股票的收入（成交）总额	292,026,151.74

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金在股指期货的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金合同尚无国债期货政策。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.11、“比亚迪”发行人比亚迪股份有限公司于 2022 年 6 月 7 日，被江苏省消费者权益保护委员会就“新能源汽车行业不公平格式条款”的最新情况及后续整改落实问题进行约谈。

2、“中天科技”的发行人江苏中天科技股份有限公司：

(1) 2022 年 1 月 11 日收到上交所监管警示函（上证公监函〔2021〕0168 号），上市公司的业务订单量和预测性数据属于投资者高度关注的重要经营性信息，对上市公司股票交易价格和投资者决策可能产生较大影响。上述相关信息应当根据规则由公司在符合中国证监会规定的指定媒体上真实、准确、完整地披露。

(2) 2022 年 6 月 30 日收到上交所监管警示函（上证公监函〔2022〕0078 号）：经查明，2022 年 4 月 30 日，江苏中天科技股份有限公司（以下简称中天科技或公司）披露会计差错更正公告称，公司于 2019 年新增高端通信业务，主要产品为多网融合通信基站用设备，鉴于高端通信业务经营过程中，公司未能就原材料采购和产品销售拥有足够的定价权，高端通信业务收入确认由“总额法”变更为“净额法”，并采用追溯重述法对 2019 年度、2020 年度的财务数据进行追溯调整、对 2021 年 1 至 9 月数据进行更正。

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。

7.12.2 本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

## 7.12.3 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	67,656.88
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	68,735.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	136,392.78

## 7.12.4 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。

## 7.12.5 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。

## 7.12.6 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，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 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



1,348	34,268.87	5,122.62	0.01%	46,189,313.46	99.99%
-------	-----------	----------	-------	---------------	--------

## 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	1,038,193.42	2.25%

## 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年8月9日）基金份额总额	275,893,870.93
本报告期期初基金份额总额	52,721,145.19
本报告期基金总申购份额	3,363,021.15
减：本报告期基金总赎回份额	9,889,730.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	46,194,436.08

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期末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	
广发证券	1	273,128,260.78	48.11%	199,738.64	48.11%	-
长江证券	1	294,616,337.37	51.89%	215,452.73	51.89%	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

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5个交易席位，其中报告期内新增2个交易席位。新增席位为：天风证券上海席位、天风证券深圳席位。

##### 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
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	20,000,000.00	100.00%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

### 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
3	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
4	新华基金管理股份有限公司关于设立上海分	中国证券报、公司网站、	2022-01-13

	公司的公告	电子信披网站	
5	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
6	新华鑫泰灵活配置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
7	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分证券投资基金增加中国中金财富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参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站、电子信披网站	2022-01-28
8	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
9	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
10	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
11	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中植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	2022-03-02
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
14	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
15	新华鑫泰灵活配置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
17	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	2022-04-21

18	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
19	新华鑫泰灵活配置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

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20220101 - 20220630	10,642,294.59	0.00	0.00	10,642,294.59	23.04%
产品特有风险							
<p>本基金投资于可转换债券，可转换债券的条款相对于普通债券和股票而言更为复杂，对这些条款研究不足导致的事件可能为本基金带来损失。例如，当可转换债券的价格明显高于其赎回价格时，若本基金未能在可转换债券被赎回前转股或卖出，则可能产生不必要的损失。</p> <p>本基金投资于中小企业私募债券所面临的信用风险及流动性风险。信用风险主要是由目前国内中小企业的发展状况所导致的发行人违约、不按时偿付本金或利息的风险；流动性风险主要是由债券非公开发行和转让所导致的无法按照合理的价格及时变现的风险。由于中小企业私募债券的特殊性，本基金的总体风险将有所提高。</p> <p>本基金在选择投资标的时，将充分考虑上述风险给投资者带来的不利影响，在投资比例和标的选择上进行严格的风险控制，最大程度降低投资中小企业私募债券对本基金整体运作的影响。</p> <p>本基金投资于资产支持证券，可能面临信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。基金管理人将通过内部研究分析和投资决策授权等方法对资产支持证券投资进行有效的风险评估和控制。同时，基金管理人将对资产支持证券投资进行全程合规监控，通过事前控制、事中监督和事后检查等方式，加强资产支持证券投资合法合规性管理。</p> <p>本基金投资于股指期货的风险：</p> <p>1、基差风险 在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。</p> <p>2、系统性风险 组合现货的<math>\beta</math>可能不足或者过高，组合风险敞口过大，股指期货空头头寸不能完全对冲现货的风险，组合存在系统性暴露的风险。</p> <p>3、保证金风险 产品的期货头寸，如果未预留足够现金，在市场出现极端情况时，可能遭遇保证金不足而被强制平仓的风险。</p> <p>4、合约展期风险 组合持有的主力合约交割日临近，需要更换合约进行展期，如果合约的基差不利或流动性不足，展期会面临风险。</p> <p>本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本</p>							

基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

## 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泰灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (四) 新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (五) 《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (六) 《新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》(更新)
- (七) 《新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要》(更新)
- (八) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (九) 基金托管人业务资格批件及营业执照

### 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