

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

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：华夏银行股份有限公司

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。

基金托管人华夏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.....	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
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	52
10.1	基金份额持有人大会决议	52
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	53
11	影响投资者决策的其他重要信息	55
12	备查文件目录	55
12.1	备查文件目录	55
12.2	存放地点	55
12.3	查阅方式	56

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合	
基金主代码	012200	
交易代码	012200	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 5 月 26 日	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	223,370,286.42 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	012200	012201
报告期末下属分级基金的份额总额	165,638,452.32 份	57,731,834.10 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过合理的资产配置，精选科技主题的优质企业进行投资，在控制基金资产净值下行风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略等。
业绩比较基准	中证科技 100 指数收益率×60% + 中债综合指数（总财富）收益率×30%+ 恒生指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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		新华基金管理股份有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	郑鹏
	联系电话	010-68779688	010-85238667
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		4008198866	95577

传真	010-68779528	010-85238680
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22 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	北京市东城区建国门内大街22 号
邮政编码	400010	100005
法定代表人	翟晨曦	李民吉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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）	
	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C
本期已实现收益	-49,344,761.00	-16,685,554.42
本期利润	-46,196,194.05	-15,275,447.63
加权平均基金份额本期利润	-0.2679	-0.2608
本期加权平均净值利润率	-28.70%	-28.13%
本期基金份额净值增长率	-22.31%	-22.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C
期末可供分配利润	-16,418,783.13	-6,004,774.34
期末可供分配基金份额利润	-0.0991	-0.1040
期末基金资产净值	149,219,669.19	51,727,059.76
期末基金份额净值	0.9009	0.8960
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	

	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C
基金份额累计净值增长率	-9.91%	-10.40%

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

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.68%	2.13%	5.77%	0.88%	-1.09%	1.25%
过去三个月	0.26%	1.93%	2.13%	1.21%	-1.87%	0.72%
过去六个月	-22.31%	1.76%	-9.96%	1.17%	-12.35%	0.59%
过去一年	-18.28%	1.68%	-8.19%	0.97%	-10.09%	0.71%
自基金合同生效起至今	-9.91%	1.67%	-5.22%	0.94%	-4.69%	0.73%

注：1、本基金的业绩比较基准采用中证科技 100 指数收益率×60%+中债综合指数（总财富）收益率×30%+恒生指数收益率×10%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.64%	2.13%	5.77%	0.88%	-1.13%	1.25%
过去三个月	0.12%	1.93%	2.13%	1.21%	-2.01%	0.72%
过去六个月	-22.50%	1.77%	-9.96%	1.17%	-12.54%	0.60%
过去一年	-18.69%	1.68%	-8.19%	0.97%	-10.50%	0.71%
自基金合同生效起至今	-10.40%	1.67%	-5.22%	0.94%	-5.18%	0.73%

注：1、本基金的业绩比较基准采用中证科技 100 指数收益率×60%+中债综合指数（总财富）收益率×30%+恒生指数收益率×10%。

2、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

新华鑫科技 3 个月滚动持有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
(2021 年 5 月 26 日至 2022 年 6 月 30 日)

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A



注：1、本基金于 2021 年 5 月 26 日基金合同生效。

2、本报告期末本基金各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C



注：1、本基金于 2021 年 5 月 26 日基金合同生效。

2、本报告期末本基金各项资产配置比例符合本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		
王永明	本基金基金经理，新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华安康多元	2021-09-03	-	24	经济学博士，历任西南证券资产管理部研究员、恒泰证券研发中心经理、上海名禹资产管理有限公司研究总监、上海尚阳投资管理有限公司投资总监。

	收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理。				
--	-----------------------	--	--	--	--

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科技 3 个月滚动持有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》、《新华鑫科技 3 个月滚动持有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《证券投资基金管理有限责任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

上半年 A 股市场呈现触底回升、企稳向好的态势。一方面，随着国内经济的企稳回升，市场信心逐渐恢复，国内新基金发行回暖，以绝对收益为主或低风险偏好的资金开始增加权益资产的仓位。同时，海外经济滞胀的压力增大，相比之下，全球比较下的 A 股市场吸引力增强，外资回流迹象明显。经过 1-4 月的大跌后，A 股市场性价比优势凸显，尤其以新能源、新能源车、军工、半导体、医药等长期向好的高景气行业为甚。

本基金继续坚持以性价比为核心，通过宏观视野下的行业比较和赛道选择，重点增加了以半导体、通讯为主的科技、成长类资产的配置。虽然消费电子领域受需求下滑、预期回落等因素的影响处于行业下行周期，但市场对此已经相当程度地定价。此外，功率半导体、模拟电路、汽车电子细分领域景气度持续上行，半导体设备、材料和零部件的国产化替代方兴未艾。本基金强化在上述细分领域的资产配置，强化动态的跟踪和深度研究，通过组合管理和持续优化为持有人创造超额收益。

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 A 类份额净值为 0.9009 元，本报告期份额净值增长率为-22.31%，同期比较基准的增长率为-9.96%；本基金 C 类份额净值为 0.8960 元，本报告期份额净值增长率为-22.50%，同期比较基准的增长率为-9.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内疫情基本得到控制，经济逐渐步入正轨，从中长期看，科技创新是推动中国经济健康发展的最重要推力之一。科技领域细分行业众多，我们重点看好前沿科技相关领域的投资机会，包括 5G 应用、人工智能、自动驾驶、半导体、国产软件、光伏、电动汽车等。

本基金将保持较高仓位，注意把握其中的结构性机会。个股选择上，重点布局调整充分，业绩稳健，估值处于较低水平，成长性良好的个股。

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况。

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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，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未进行利润分配。

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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2022 年中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

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：新华鑫科技 3 个月滚动持有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
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	6,758,886.84	52,314,846.69
结算备付金		12,861,822.69	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	181,644,272.96	234,049,617.75
其中：股票投资		181,644,272.96	234,049,617.75
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		-	-
应收股利		72.00	-
应收申购款		119,505.57	136,479.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	8,381.03
资产总计		201,384,560.06	286,509,325.34
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		-	-
应付清算款		-	-

应付赎回款		30,494.86	690,843.95
应付管理人报酬		242,390.65	376,377.07
应付托管费		40,398.43	62,729.50
应付销售服务费		20,821.53	30,345.41
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	6.4.7.6	103,725.64	153,596.25
负债合计		437,831.11	1,313,892.18
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	223,370,286.42	246,116,142.09
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-22,423,557.47	39,079,291.07
净资产合计		200,946,728.95	285,195,433.16
负债和净资产总计		201,384,560.06	286,509,325.34

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值 0.9009 元，基金份额 165,638,452.32 份；本基金 C 类份额净值 0.8960 元，基金份额 57,731,834.10 份。

6.2 利润表

会计主体：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

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 5 月 26 日（基 金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-59,346,395.51	82,455,695.89
1.利息收入		87,272.15	82,521.32
其中：存款利息收入	6.4.7.9	87,272.15	82,521.32
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）		-64,009,971.05	-2,172,131.90
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-64,478,552.44	-2,888,738.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.12	468,581.39	716,606.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	4,558,673.74	84,545,306.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	17,629.65	0.00
减：二、营业总支出		2,125,246.17	3,202,314.87
1. 管理人报酬		1,609,207.71	1,109,486.34
2. 托管费		268,201.28	184,914.37
3. 销售服务费		135,158.23	108,055.00
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.15	112,678.95	1,799,859.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-61,471,641.68	79,253,381.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-61,471,641.68	79,253,381.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-61,471,641.68	79,253,381.02

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	246,116,142.09	-	39,079,291.07	285,195,433.16
二、本期期初净资产（基金净值）	246,116,142.09	-	39,079,291.07	285,195,433.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-22,745,855.67	-	-61,502,848.54	-84,248,704.21
（一）、综合收益总额	-	-	-61,471,641.68	-61,471,641.68

(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)	-22,745,855.67	-	-31,206.86	-22,777,062.53
其中: 1.基金申购款	9,156,446.73	-	-562,345.31	8,594,101.42
2.基金赎回款	-31,902,302.40	-	531,138.45	-31,371,163.95
(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)	223,370,286.42	-	-22,423,557.47	200,946,728.95
项目	上年度可比期间 2021 年 5 月 26 日(基金合同生效日)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)	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	728,889,967.19	-	-	728,889,967.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	57,472,788.90	-	80,415,528.93	137,888,317.83
(一)、综合收益总额	-	-	79,253,381.02	79,253,381.02
(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)	57,472,788.90	-	1,162,147.91	58,634,936.81
其中: 1.基金申购款	57,472,788.90	-	1,162,147.91	58,634,936.81
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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）	786,362,756.09	-	80,415,528.93	866,778,285.02
-----------------	----------------	---	---------------	----------------

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

新华鑫科技 3 个月滚动持有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【2021】1587 号文《关于新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》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，存续期不限定。于 2021 年 5 月 10 日至 5 月 21 日向社会公开募集，首次募集资金总额 728,889,967.19 元，其中募集资金产生利息 76,968.34 元，并经致同会计师事务所致同验字(2021)第 110C000275 号验资报告予以验证。2021 年 5 月 26 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，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、股指期货、债券（国债、政府债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、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、同业存单、货币市场工具，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)。本基金可参与融资业务。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（含存托凭证）投资占基金资产的比例为 0-95%，科技主题股票的投资比例不低于非现金资产的 80%，港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的 50%；本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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变更投资品种的投资比例限制，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。本基金的业绩比较基准为：中证科技 100 指数收益率×60%+中债综合指数（总财富）收益率×30%+恒生指数收益率×10%。

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》、《新华鑫科技 3 个月滚动持有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有关信息。

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	6,758,886.84
等于：本金	6,758,272.58
加：应计利息	614.26
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	6,758,886.84

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	166,570,388.75	-	181,644,272.96	15,073,884.21
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	166,570,388.75	-	181,644,272.96	15,073,884.21

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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 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	29.19
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
账户维护费	4,500.00
证券时报	59,507.37
审计费	39,671.58
应付补差费	17.50
合计	103,725.64

6.4.7.7 实收基金

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A

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	账面金额
上年度末	186,576,126.34	186,576,126.34
本期申购	4,383,350.52	4,383,350.52
本期赎回（以“-”号填列）	-25,321,024.54	-25,321,024.54
本期末	165,638,452.32	165,638,452.32

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C

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	账面金额
上年度末	59,540,015.75	59,540,015.75
本期申购	4,773,096.21	4,773,096.21
本期赎回（以“-”号填列）	-6,581,277.86	-6,581,277.86
本期末	57,731,834.10	57,731,834.10

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A

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	39,296,734.87	-9,516,587.47	29,780,147.40
本期利润	-49,344,761.00	3,148,566.95	-46,196,194.05
本期基金份额交易产生的变动数	-1,969,984.20	1,967,247.72	-2,736.48
其中：基金申购款	107,774.02	-453,886.55	-346,112.53
基金赎回款	-2,077,758.22	2,421,134.27	343,376.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,018,010.33	-4,400,772.80	-16,418,783.13

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C

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	12,319,729.90	-3,020,586.23	9,299,143.67
本期利润	-16,685,554.42	1,410,106.79	-15,275,447.63
本期基金份额交易产生的变动数	-106,204.71	77,734.33	-28,470.38
其中：基金申购款	309,510.85	-525,743.63	-216,232.78
基金赎回款	-415,715.56	603,477.96	187,762.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,472,029.23	-1,532,745.11	-6,004,774.34

6.4.7.9 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	15,361.15
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	71,911.00
其他	-
合计	87,272.15

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息。

6.4.7.10 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	673,825,545.31
减：卖出股票成本总额	736,473,216.45
减：交易费用	1,830,881.30
买卖股票差价收入	-64,478,552.44

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期末持有债券。

6.4.7.12 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	468,581.39

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	468,581.39

6.4.7.13 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	4,558,673.74
——股票投资	4,558,673.74
——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	4,558,673.74

6.4.7.14 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	17,006.86
补差费收入	622.79
合计	17,629.65

6.4.7.15 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	-
账户维护费	13,500.00
证券时报	59,507.37
合计	112,678.95

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
华夏银行股份有限公司	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5月26日（基金合同生效日） 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	1,345,306,216.69	100.00%	1,446,266,564.71	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金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，本基金无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

本报告期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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	976,516.79	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年5月26日（基金合同生效日）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	1,064,633.23	100.00%	0.00	0.00%

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5月26日（基金合同 生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,609,207.71	1,109,486.34
其中：支付销售机构的客户维护费	801,376.47	114,310.49

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。

2、本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额。

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5月26日（基金合同 生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	268,201.28	184,914.37

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。

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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华鑫科技3个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技3个月滚动持有灵活配置混合 C	合计
新华基金管理股份有限公司	-	517.26	517.26
恒泰证券股份有限公司	-	134,111.56	134,111.56
合计	-	134,628.82	134,628.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年5月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华鑫科技3个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技3个月滚动持有灵活配置混合 C	合计
新华基金管理股份有限公司	-	67.61	67.61
恒泰证券股份有限公司	-	106,750.78	106,750.78
合计	-	106,818.39	106,818.39

注：1、本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.50% 年费率计提。

其计算公式为：日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.50%/当年天数。

2、本报告期列示的应支付的销售服务费为当期支付金额。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生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固有资金投资本基金的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

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

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年5月26日（基金合同生效 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
华夏银行股份有限公司	6,758,272.58	15,361.15	25,066,857.42	82,521.32

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏银行股份有限公司保管，按银行同业利率计算。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无收益分配事项。

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

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
688262	国芯科技	2021-12-28	1-6个月(含)	新股锁定期内	41.98	47.75	2,723.00	114,311.54	130,023.25	-
688270	臻镭科技	2022-01-20	1-6个月(含)	新股锁定期内	61.88	59.87	1,807.00	111,817.16	108,185.09	-
688322	奥比中光	2022-06-30	1个月内(含)	新股未上市	30.99	30.99	3,280.00	101,647.20	101,647.20	-
301139	元道通信	2022-06-30	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	2,373.00	91,265.58	91,265.58	含10%限售6个

										月股票 含 10%限售 6 个月股票
30123 9	普瑞 眼科	2022-0 6-22	1 个月 内(含)	新股 未上 市	33.65	33.65	2,442. 00	82,173 .30	82,173 .30	含 10%限售 6 个月股票
30117 5	中科 环保	2022-0 6-30	1 个月 内(含)	新股 未上 市	3.82	3.82	21,390 .00	81,709 .80	81,709 .80	含 10%限售 6 个月股票
68823 7	超卓 航科	2022-0 6-24	1 个月 内(含)	新股 未上 市	41.27	41.27	1,957. 00	80,765 .39	80,765 .39	-
68840 0	凌云 光	2022-0 6-27	1 个月 内(含)	新股 未上 市	21.93	21.93	3,481. 00	76,338 .33	76,338 .33	-
68817 5	高凌 信息	2022-0 3-08	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	51.68	32.23	1,886. 00	97,468 .48	60,785 .78	-
30123 3	盛帮 股份	2022-0 6-24	1 个月 内(含)	新股 未上 市	41.52	41.52	1,379. 00	57,256 .08	57,256 .08	含 10%限售 6 个月股票
30121 5	中汽 股份	2022-0 2-28	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	3.80	6.39	2,783. 00	10,575 .40	17,783 .37	-
30112 0	新特 电气	2022-0 4-11	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	13.73	15.49	1,004. 00	13,784 .92	15,551 .96	-
30112 2	采纳 股份	2022-0 1-19	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	50.31	70.37	205.00	10,313 .55	14,425 .85	-
30123 5	华康 医疗	2022-0 1-21	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	39.30	37.93	343.00	13,479 .90	13,009 .99	-
30120 1	诚达 药业	2022-0 1-12	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	72.69	71.54	177.00	12,866 .13	12,662 .58	-
30126 3	泰恩 康	2022-0 3-22	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	19.93	31.38	390.00	7,772. 70	12,238 .20	-
301116	益客	2022-0	1-6 个	新股	11.40	20.46	577.00	6,577.	11,805	-

	食品	1-10	月(含)	锁定期内				80	.42	
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	1-6 个月(含)	新股锁定期内	17.27	14.83	749.00	12,935.23	11,107.67	-
301212	联盛化学	2022-04-07	1-6 个月(含)	新股锁定期内	29.67	33.28	319.00	9,464.73	10,616.32	-
301236	软通动力	2022-03-08	1-6 个月(含)	新股锁定期内	48.59	31.38	312.00	15,159.04	9,790.56	含转增 104 股
301268	铭利达	2022-03-29	1-6 个月(含)	新股锁定期内	28.50	34.87	280.00	7,980.00	9,763.60	-
301200	大族数控	2022-02-18	1-6 个月(含)	新股锁定期内	76.56	51.92	177.00	13,551.12	9,189.84	-
301130	西点药业	2022-02-16	1-6 个月(含)	新股锁定期内	22.55	37.70	237.00	5,344.35	8,934.90	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	1-6 个月(含)	新股锁定期内	15.37	15.99	558.00	8,576.46	8,922.42	-
301206	三元生物	2022-01-26	1-6 个月(含)	新股锁定期内	72.87	45.69	195.00	14,209.00	8,909.55	含转增 65 股
301109	军信股份	2022-04-06	1-6 个月(含)	新股锁定期内	23.21	16.14	552.00	12,810.08	8,909.28	含转增 184 股
301207	华兰疫苗	2022-02-10	1-6 个月(含)	新股锁定期内	56.88	56.42	147.00	8,361.36	8,293.74	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	1-6 个月(含)	新股锁定期内	32.71	32.02	256.00	8,372.50	8,197.12	含转增 59 股
301102	兆讯传媒	2022-03-15	1-6 个月(含)	新股锁定期内	39.88	31.09	257.00	10,249.16	7,990.13	-
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	-
301216	万凯新材	2022-03-21	1-6 个月(含)	新股锁定期内	35.68	29.84	252.00	8,991.36	7,519.68	-

30113 5	瑞德 智能	2022-0 4-01	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	31.98	26.26	275.00	8,794. 50	7,221. 50	-
30123 7	和顺 科技	2022-0 3-16	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	56.69	41.86	166.00	9,410. 54	6,948. 76	-
30112 3	奕东 电子	2022-0 1-14	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	37.23	25.39	270.00	10,052 .10	6,855. 30	-
30122 2	浙江 恒威	2022-0 3-02	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	33.98	28.96	231.00	7,849. 38	6,689. 76	-
30125 8	富士 莱	2022-0 3-21	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	48.30	41.68	151.00	7,293. 30	6,293. 68	-
30118 1	标榜 股份	2022-0 2-11	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	40.25	30.59	202.00	8,130. 50	6,179. 18	-
30127 9	金道 科技	2022-0 4-06	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	31.20	22.81	265.00	8,268. 00	6,044. 65	-
30115 1	冠龙 节能	2022-0 3-30	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	30.82	21.46	281.00	8,660. 42	6,030. 26	-
30121 9	腾远 钴业	2022-0 3-10	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	96.36	87.82	65.00	6,263. 28	5,708. 30	含转 增 29 股
30083 4	星辉 环材	2022-0 1-06	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	55.57	30.03	178.00	9,891. 46	5,345. 34	-
301110	青木 股份	2022-0 3-04	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	63.10	39.85	129.00	8,139. 90	5,140. 65	-
30119 6	唯科 科技	2022-0 1-04	1-6 个 月(含)	新股 锁定 期内	64.08	37.52	103.00	6,600. 24	3,864. 56	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截止报告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董事会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 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	6,758,886.84	-	-	-	6,758,886.84
结算备付金	12,861,822.69	-	-	-	12,861,822.69
存出保证金	0.00	-	-	-	0.00
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	181,644,272.96	181,644,272.96

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	-	-	-	72.00	72.00
应收申购款	-	-	-	119,505.57	119,505.57
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	19,620,709.53	0.00	0.00	181,763,850.53	201,384,560.06
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	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	30,494.86	30,494.86
应付管理人报酬	-	-	-	242,390.65	242,390.65
应付托管费	-	-	-	40,398.43	40,398.43
应付销售服务费	-	-	-	20,821.53	20,821.53
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	-	-	-	103,725.64	103,725.64
负债总计	0.00	0.00	0.00	437,831.11	437,831.11
利率敏感度缺口	19,620,709.53	0.00	0.00	181,326,019.42	200,946,728.95
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	52,314,846.69	-	-	-	52,314,846.69
结算备付金	0.00	-	-	-	0.00

存出保证金	0.00	-	-	-	0.00
交易性金融资产	-	-	-	234,049,617.75	234,049,617.75
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	8,381.03	8,381.03
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	136,479.87	136,479.87
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	52,314,846.69	0.00	0.00	234,194,478.65	286,509,325.34
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	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	690,843.95	690,843.95
应付管理人报酬	-	-	-	376,377.07	376,377.07
应付托管费	-	-	-	62,729.50	62,729.50
应付销售服务费	-	-	-	30,345.41	30,345.41
应付交易费用	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	153,596.25	153,596.25
负债总计	0.00	0.00	0.00	1,313,892.18	1,313,892.18
利率敏感度缺口	52,314,846.69	0.00	0.00	232,880,586.47	285,195,433.16

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。

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的 资产			
交易性金融资产	-	3,309.59	3,309.59
资产合计	-	3,309.59	3,309.59
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	-	3,309.59	3,309.59

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，所面临的重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	上年度末
----	-----	------

	2022 年 6 月 30 日		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	181,644,272. 96	90.39	234,049,617.7 5	82.07
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	181,644,272. 96	90.39	234,049,617.7 5	82.07

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 1%或者下降 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%	2,105,694.06	2,255,646.67
	沪深 300 指数下降 1%	-2,105,694.06	-2,255,646.67

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	180,478,455.02
第二层次	571,155.68
第三层次	594,662.26
合计	181,644,272.96

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	181,644,272.96	90.20
	其中：股票	181,644,272.96	90.20

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	19,620,709.53	9.74
8	其他各项资产	119,577.57	0.06
9	合计	201,384,560.06	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	-	-
B	采矿业	17,325.22	0.01
C	制造业	168,993,173.72	84.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,393.44	0.01
F	批发和零售业	347,310.38	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	13,518.40	0.01
H	住宿和餐饮业	14,977.44	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,957,674.86	5.45
J	金融业	37,496.03	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	105,447.50	0.05
M	科学研究和技术服务业	709,527.07	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	229,458.96	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	168,776.54	0.08
R	文化、体育和娱乐业	27,883.81	0.01
S	综合	-	-
	合计	181,640,963.37	90.39

7.2.2 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（%）
工业	3,309.59	0.00
合计	3,309.59	0.00

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	002371	北方华创	44,800	12,414,976.00	6.18
2	603501	韦尔股份	69,400	12,008,282.00	5.98
3	605111	新洁能	92,955	11,694,668.55	5.82
4	300666	江丰电子	174,697	10,656,517.00	5.30
5	603078	江化微	352,937	10,083,410.09	5.02
6	603290	斯达半导	25,800	9,956,220.00	4.95
7	688200	华峰测控	27,112	9,662,716.80	4.81
8	002463	沪电股份	615,780	9,088,912.80	4.52
9	688012	中微公司	70,420	8,221,535.00	4.09
10	688037	芯源微	56,243	8,153,547.71	4.06
11	688082	盛美上海	83,717	7,933,860.09	3.95
12	688008	澜起科技	125,300	7,590,674.00	3.78
13	000977	浪潮信息	262,800	6,958,944.00	3.46
14	688349	三一重能	135,728	5,530,916.00	2.75
15	600522	中天科技	227,321	5,251,115.10	2.61
16	688778	厦钨新能	42,887	4,780,613.89	2.38
17	688120	华海清科	16,047	3,986,074.80	1.98
18	002384	东山精密	168,700	3,868,291.00	1.93
19	300438	鹏辉能源	62,400	3,834,480.00	1.91
20	688259	创耀科技	46,424	3,740,381.68	1.86
21	688052	纳芯微	9,717	3,682,354.32	1.83
22	603197	保隆科技	51,800	2,548,042.00	1.27
23	688209	英集芯	70,569	2,159,411.40	1.07
24	301221	光庭信息	33,014	2,140,297.62	1.07

25	301191	菲菱科思	21,300	1,716,567.00	0.85
26	300223	北京君正	9,900	1,051,875.00	0.52
27	300709	精研科技	10,180	301,226.20	0.15
28	688170	德龙激光	5,104	262,753.92	0.13
29	301069	凯盛新材	5,386	248,348.46	0.12
30	688261	东微半导	1,005	243,169.80	0.12
31	688281	华秦科技	876	230,388.00	0.11
32	688320	禾川科技	3,996	206,193.60	0.10
33	688110	东芯股份	5,337	202,379.04	0.10
34	688246	嘉和美康	7,245	193,151.70	0.10
35	688238	和元生物	6,969	189,974.94	0.09
36	688331	荣昌生物	4,024	188,162.24	0.09
37	688048	长光华芯	1,476	179,599.68	0.09
38	688388	嘉元科技	2,111	179,160.57	0.09
39	301120	新特电气	10,036	177,586.04	0.09
40	688326	经纬恒润	1,138	167,354.28	0.08
41	688046	药康生物	5,680	166,424.00	0.08
42	301122	采纳股份	2,042	148,563.59	0.07
43	688047	龙芯中科	1,607	148,085.05	0.07
44	301168	通灵股份	3,281	147,907.48	0.07
45	301136	招标股份	7,172	143,081.40	0.07
46	688279	峰岬科技	1,927	142,443.84	0.07
47	688668	鼎通科技	2,024	142,368.16	0.07
48	688290	景业智能	2,736	139,262.40	0.07
49	688176	亚虹医药	10,854	136,868.94	0.07
50	301118	恒光股份	3,142	135,200.26	0.07
51	301263	泰恩康	3,893	134,002.48	0.07
52	301235	华康医疗	3,428	133,263.29	0.07
53	688295	中复神鹰	3,550	133,089.50	0.07
54	688167	炬光科技	892	132,685.00	0.07
55	688230	芯导科技	1,889	131,644.41	0.07
56	688262	国芯科技	2,723	130,023.25	0.06
57	301201	诚达药业	1,762	128,684.58	0.06
58	301116	益客食品	5,764	119,695.02	0.06
59	301212	联盛化学	3,187	119,141.44	0.06
60	301188	力诺特玻	6,470	115,166.00	0.06
61	688206	概伦电子	3,760	114,304.00	0.06
62	301217	铜冠铜箔	7,481	113,501.39	0.06
63	688337	普源精电	1,903	110,526.24	0.06
64	688270	臻镭科技	1,807	108,185.09	0.05
65	688207	格灵深瞳	3,795	107,778.00	0.05
66	301185	鸥玛软件	5,776	106,798.24	0.05
67	301268	铭利达	2,791	106,186.00	0.05
68	688220	翱捷科技	1,523	105,924.65	0.05

69	301236	软通动力	3,111	102,017.61	0.05
70	688322	奥比中光	3,280	101,647.20	0.05
71	301137	哈焊华通	5,573	96,835.37	0.05
72	301200	大族数控	1,770	95,211.84	0.05
73	301130	西点药业	2,370	94,254.90	0.05
74	301092	争光股份	2,995	94,222.70	0.05
75	301109	军信股份	5,512	93,874.08	0.05
76	688234	天岳先进	1,400	93,800.00	0.05
77	301206	三元生物	1,938	91,580.04	0.05
78	301139	元道通信	2,373	91,265.58	0.05
79	301100	风光股份	4,226	91,197.08	0.05
80	688153	唯捷创芯	1,770	90,270.00	0.04
81	688325	赛微微电	1,469	89,902.80	0.04
82	688121	卓然股份	3,681	89,485.11	0.04
83	688193	仁度生物	1,635	88,453.50	0.04
84	301138	华研精机	2,849	87,606.75	0.04
85	301103	何氏眼科	2,558	86,603.24	0.04
86	301207	华兰疫苗	1,463	86,477.30	0.04
87	301088	戎美股份	4,573	85,332.18	0.04
88	688306	均普智能	15,384	85,073.52	0.04
89	301179	泽宇智能	2,079	84,843.99	0.04
90	301102	兆讯传媒	2,565	84,708.05	0.04
91	301239	普瑞眼科	2,442	82,173.30	0.04
92	301175	中科环保	21,390	81,709.80	0.04
93	688103	国力股份	1,595	81,536.40	0.04
94	688237	超卓航科	1,957	80,765.39	0.04
95	301193	家联科技	2,970	80,635.50	0.04
96	301093	华兰股份	2,371	80,353.19	0.04
97	688282	理工导航	1,666	79,918.02	0.04
98	301133	金钟股份	2,860	79,422.20	0.04
99	301190	善水科技	3,343	79,329.39	0.04
100	301216	万凯新材	2,518	79,011.98	0.04
101	301158	德石股份	3,783	78,697.42	0.04
102	301135	瑞德智能	2,743	78,053.10	0.04
103	688102	斯瑞新材	6,030	77,847.30	0.04
104	301198	喜悦智行	3,397	76,602.35	0.04
105	688400	凌云光	3,481	76,338.33	0.04
106	688173	希荻微	2,250	75,487.50	0.04
107	301237	和顺科技	1,653	73,566.36	0.04
108	688283	坤恒顺维	1,542	73,507.14	0.04
109	301166	优宁维	1,221	71,868.06	0.04
110	301222	浙江恒威	2,301	70,404.36	0.04
111	301123	奕东电子	2,693	70,216.75	0.03
112	301182	凯旺科技	2,932	69,664.32	0.03

113	301258	富士莱	1,507	67,896.76	0.03
114	688210	统联精密	3,105	67,285.35	0.03
115	688211	中科微至	1,650	67,204.50	0.03
116	301279	金道科技	2,641	65,991.13	0.03
117	301189	奥尼电子	1,979	65,920.49	0.03
118	301151	冠龙节能	2,810	64,753.64	0.03
119	301181	标榜股份	2,014	64,362.50	0.03
120	688236	春立医疗	3,234	64,033.20	0.03
121	688722	同益中	3,687	61,720.38	0.03
122	301062	上海艾录	5,225	60,975.75	0.03
123	688175	高凌信息	1,886	60,785.78	0.03
124	301081	严牌股份	4,024	60,681.92	0.03
125	301219	腾远钴业	648	59,624.14	0.03
126	688115	思林杰	1,464	58,911.36	0.03
127	301083	百胜智能	4,160	58,073.60	0.03
128	301072	中捷精工	1,802	57,718.06	0.03
129	301233	盛帮股份	1,379	57,256.08	0.03
130	301110	青木股份	1,281	55,022.25	0.03
131	300834	星辉环材	1,777	53,731.08	0.03
132	301035	润丰股份	644	53,097.80	0.03
133	688255	凯尔达	1,648	50,923.20	0.03
134	688267	中触媒	1,486	49,676.98	0.02
135	301056	森赫股份	5,716	49,500.56	0.02
136	600955	维远股份	1,694	48,854.96	0.02
137	688225	亚信安全	2,156	48,337.52	0.02
138	301050	雷电微力	419	42,553.64	0.02
139	301063	海锅股份	1,524	42,458.64	0.02
140	300854	中兰环保	2,026	40,276.88	0.02
141	301196	唯科科技	1,027	38,847.20	0.02
142	600927	永安期货	1,859	37,496.03	0.02
143	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
144	301079	邵阳液压	1,396	34,620.80	0.02
145	688272	富吉瑞	1,263	33,545.28	0.02
146	688038	中科通达	2,132	29,911.96	0.01
147	301089	拓新药业	220	27,636.40	0.01
148	603122	合富中国	2,198	27,365.10	0.01
149	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.01
150	600935	华塑股份	4,811	25,209.64	0.01
151	301058	中粮工科	1,386	24,102.54	0.01
152	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.01
153	301039	中集车辆	2,064	22,353.12	0.01
154	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.01
155	001228	永泰运	383	20,739.45	0.01
156	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.01

157	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.01
158	301149	隆华新材	1,214	18,586.34	0.01
159	603176	汇通集团	1,924	18,393.44	0.01
160	301215	中汽股份	2,783	17,783.37	0.01
161	301177	迪阿股份	238	17,659.60	0.01
162	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.01
163	301090	华润材料	1,556	16,975.96	0.01
164	603070	万控智造	775	16,197.50	0.01
165	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.01
166	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.01
167	301073	君亭酒店	216	14,977.44	0.01
168	301087	可孚医疗	339	14,454.96	0.01
169	603230	内蒙新华	1,141	14,273.91	0.01
170	300994	久祺股份	420	13,780.20	0.01
171	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.01
172	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.01
173	301211	亨迪药业	580	12,574.40	0.01
174	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.01
175	603215	比依股份	575	12,115.25	0.01
176	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
177	301078	孩子王	756	11,082.96	0.01
178	301096	百诚医药	136	10,744.00	0.01
179	603219	富佳股份	528	10,517.76	0.01
180	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.01
181	301046	能辉科技	290	10,036.90	0.00
182	605566	福莱蒾特	435	9,926.70	0.00
183	605567	春雪食品	629	9,850.14	0.00
184	605033	美邦股份	423	9,809.37	0.00
185	301020	密封科技	421	9,472.50	0.00
186	301048	金鹰重工	843	9,281.43	0.00
187	603048	浙江黎明	464	9,224.32	0.00
188	605138	盛泰集团	723	9,023.04	0.00
189	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
190	300774	倍杰特	444	8,951.04	0.00
191	301021	英诺激光	290	8,758.00	0.00
192	301013	利和兴	706	8,464.94	0.00
193	001288	运机集团	537	8,382.57	0.00
194	301052	果麦文化	252	8,298.36	0.00
195	001219	青岛食品	353	8,066.05	0.00
196	301028	东亚机械	733	7,931.06	0.00
197	301045	天禄科技	335	7,728.45	0.00
198	301026	浩通科技	203	7,486.64	0.00
199	603150	万朗磁塑	250	7,442.50	0.00
200	301004	嘉益股份	312	7,381.92	0.00

201	301040	中环海陆	241	7,357.73	0.00
202	301038	深水规院	345	7,172.55	0.00
203	301027	华蓝集团	286	6,944.08	0.00
204	301055	张小泉	355	6,311.90	0.00
205	300814	中富电路	328	6,002.40	0.00
206	301030	仕净科技	242	5,643.44	0.00
207	301025	读客文化	403	5,311.54	0.00
208	301016	雷尔伟	275	5,128.75	0.00
209	301032	新柴股份	513	4,770.90	0.00
210	301049	超越科技	196	4,647.16	0.00
211	301036	双乐股份	205	4,608.40	0.00
212	301033	迈普医学	108	4,547.88	0.00
213	301059	金三江	259	4,351.20	0.00
214	301041	金百泽	215	4,237.65	0.00
215	301037	保立佳	193	4,215.12	0.00
216	301068	大地海洋	144	3,477.60	0.00
217	03898	时代电气	100	3,309.59	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	300750	宁德时代	31,005,863.98	10.87
2	603501	韦尔股份	29,972,602.28	10.51
3	002371	北方华创	28,313,442.00	9.93
4	688200	华峰测控	23,392,696.89	8.20
5	688082	盛美上海	22,891,741.85	8.03
6	688233	神工股份	19,735,021.72	6.92
7	002241	歌尔股份	18,915,346.00	6.63
8	688126	沪硅产业	17,161,022.27	6.02
9	300073	当升科技	17,040,720.66	5.98
10	688012	中微公司	15,640,423.18	5.48
11	300223	北京君正	15,429,352.00	5.41
12	603290	斯达半导	14,858,032.00	5.21
13	600038	中直股份	14,750,000.00	5.17
14	600460	士兰微	14,452,640.35	5.07
15	600522	中天科技	14,395,447.84	5.05
16	688187	时代电气	12,756,883.78	4.47
17	300014	亿纬锂能	12,009,562.00	4.21
18	688388	嘉元科技	10,248,287.85	3.59

19	002463	沪电股份	10,170,083.20	3.57
20	300666	江丰电子	9,933,534.42	3.48
21	600760	中航沈飞	9,913,472.00	3.48
22	03898	时代电气	9,487,805.97	3.33
23	300390	天华超净	9,285,832.00	3.26
24	688008	澜起科技	9,248,389.38	3.24
25	01347	华虹半导体	9,052,877.05	3.17
26	002938	鹏鼎控股	8,841,471.63	3.10
27	605111	新洁能	8,606,554.55	3.02
28	002756	永兴材料	8,386,515.00	2.94
29	603986	兆易创新	8,190,427.30	2.87
30	603078	江化微	7,899,671.00	2.77
31	688601	力芯微	7,720,892.69	2.71
32	603613	国联股份	7,588,948.00	2.66
33	000938	紫光股份	7,542,674.46	2.64
34	002812	恩捷股份	7,504,746.00	2.63
35	688037	芯源微	7,451,498.17	2.61
36	603650	彤程新材	7,359,340.30	2.58
37	688259	创耀科技	7,343,554.91	2.57
38	300661	圣邦股份	7,069,775.00	2.48
39	300421	力星股份	6,701,135.00	2.35
40	688385	复旦微电	6,554,579.33	2.30
41	000977	浪潮信息	6,152,114.00	2.16
42	01385	上海复旦	5,930,477.28	2.08

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	603501	韦尔股份	34,137,434.88	11.97
2	002371	北方华创	31,396,313.00	11.01
3	002241	歌尔股份	31,336,570.00	10.99
4	300750	宁德时代	27,151,498.00	9.52
5	603986	兆易创新	24,511,835.00	8.59
6	688082	盛美上海	23,856,980.15	8.37
7	300661	圣邦股份	19,803,214.00	6.94
8	300073	当升科技	16,128,905.44	5.66
9	688126	沪硅产业	15,965,287.49	5.60
10	688187	时代电气	15,871,228.19	5.57
11	688233	神工股份	15,668,773.54	5.49
12	300223	北京君正	14,447,433.60	5.07
13	600460	士兰微	14,123,591.60	4.95

14	603290	斯达半导	13,664,114.00	4.79
15	03898	时代电气	13,610,934.70	4.77
16	600038	中直股份	12,616,886.00	4.42
17	688200	华峰测控	12,302,367.12	4.31
18	002179	中航光电	11,919,210.00	4.18
19	300014	亿纬锂能	11,171,331.00	3.92
20	000938	紫光股份	10,916,009.00	3.83
21	000100	TCL 科技	10,603,026.00	3.72
22	000725	京东方 A	10,342,422.00	3.63
23	600760	中航沈飞	10,027,787.43	3.52
24	600522	中天科技	9,881,459.00	3.46
25	688388	嘉元科技	9,664,877.53	3.39
26	600703	三安光电	9,510,471.92	3.33
27	002049	紫光国微	8,759,241.00	3.07
28	002938	鹏鼎控股	8,572,861.00	3.01
29	002756	永兴材料	8,570,379.00	3.01
30	300390	天华超净	8,510,658.00	2.98
31	688385	复旦微电	7,894,206.94	2.77
32	01347	华虹半导体	7,744,508.88	2.72
33	603613	国联股份	7,677,190.00	2.69
34	688668	鼎通科技	7,129,378.14	2.50
35	300308	中际旭创	6,988,260.00	2.45
36	688012	中微公司	6,889,304.26	2.42
37	002812	恩捷股份	6,778,545.00	2.38
38	300726	宏达电子	6,702,715.00	2.35
39	688601	力芯微	6,632,220.28	2.33
40	603650	彤程新材	6,610,877.00	2.32
41	01385	上海复旦	6,188,781.88	2.17
42	000977	浪潮信息	6,106,660.24	2.14

7.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	679,509,197.92
卖出股票的收入（成交）总额	673,825,545.31

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，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

本基金基金合同无国债期货投资策略。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同无国债期货投资策略。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1“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）

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 本报告期内，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之外的股票。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	72.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	119,505.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,577.57

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不存在流通受限的情况。

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

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
新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	3,844	43,090.13	990,100.11	0.60%	164,648,352.21	99.40%
新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C	1,644	35,116.69	0.00	0.00%	57,731,834.10	100.00%
合计	5,488	40,701.58	990,100.11	0.44%	222,380,186.31	99.56%

8.2 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	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	1.77	0.00%
	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C	87.76	0.00%
	合计	89.53	0.00%

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	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	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	0
	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	0
	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C
基金合同生效日（2021 年 5 月 26 日）基金份额总额	512,573,928.99	216,316,038.20

本报告期期初基金份额总额	186,576,126.34	59,540,015.75
本报告期基金总申购份额	4,383,350.52	4,773,096.21
减：本报告期基金总赎回份额	25,321,024.54	6,581,277.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	165,638,452.32	57,731,834.10

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

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

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	
恒泰证券	2	1,345,306,216.69	100.00%	976,516.79	100.00%	-

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2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
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

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
3	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
4	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
5	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 2021 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-01-21
6	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
7	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京肯特瑞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	上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-03-01
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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 2021 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2022-03-30
13	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
14	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 2022 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-04-21
15	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型	公司网站、电子信披网站	2022-05-05

	证券投资基金招募说明书（更新）		
16	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（新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2022-05-05
17	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（新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2022-05-05
18	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海联泰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	2022-06-10

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

本报告期末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科技 3 个月滚动持有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科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三)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基金合同
- (四)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托管协议
- (五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (六)《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（更新）
- (七)《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产品资料概要》（更新）
- (八)基金管理人业务资格批件、营业执照及公司章程
- (九)基金托管人业务资格批件和营业执照
- (十)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
- (十一)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