

新华安康多元收益一年持有期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

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.....	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.....	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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）	20
6.1 资产负债表.....	20
6.2 利润表.....	21
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	22
6.4 报表附注.....	24
7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 本报告期投资基金情况.....	49
7.13 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	54
11 影响投资者决策的其他重要信息	55
12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	新华安康多元收益一年持有期混合	
基金主代码	010401	
交易代码	010401	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 月 16 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	214,224,827.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华安康多元收益一年持有期混合 A	新华安康多元收益一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	010401	010402
报告期末下属分级基金的份额总额	198,458,944.24 份	15,765,882.78 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间动态配置，在控制下行风险的前提下，力争实现长期稳健的投资回报。
投资策略	本基金将密切关注宏观经济运行状况，通过对国家财政和货币政策、资本市场资金环境、证券市场走势等因素的综合分析，判断未来一段时间各类资产的风险收益情况、相对收益率，主动调整股票、债券和现金类资产在给定区间内的动态配置比例，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15% + 中债综合指数（财富）收益率×80%+金融机构人民币活期存款利率（税后）×5%。
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。

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）	
	新华安康多元收益一年持有期混合 A	新华安康多元收益一年持有期混合 C
本期已实现收益	-10,889,947.01	-917,771.05
本期利润	-6,722,835.56	-538,388.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0224	-0.0236
本期加权平均净值利润率	-2.15%	-2.28%
本期基金份额净值增长率	-1.37%	-1.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	新华安康多元收益一年持有期混合 A	新华安康多元收益一年持有期混合 C
期末可供分配利润	4,336,221.47	245,100.44
期末可供分配基金份额利润	0.0218	0.0155
期末基金资产净值	206,962,775.02	16,340,019.08
期末基金份额净值	1.0428	1.0364
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	

	新华安康多元收益一年持有期混合 A	新华安康多元收益一年持有期混合 C
基金份额累计净值增长率	4.28%	3.64%

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

新华安康多元收益一年持有期混合 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	1.21%	0.24%	1.40%	0.16%	-0.19%	0.08%
过去三个月	0.63%	0.22%	1.84%	0.21%	-1.21%	0.01%
过去六个月	-1.37%	0.20%	0.17%	0.22%	-1.54%	-0.02%
过去一年	1.45%	0.17%	1.72%	0.19%	-0.27%	-0.02%
自基金合同生效起至今	4.28%	0.16%	4.93%	0.19%	-0.65%	-0.03%

新华安康多元收益一年持有期混合 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	1.18%	0.24%	1.40%	0.16%	-0.22%	0.08%
过去三个月	0.52%	0.22%	1.84%	0.21%	-1.32%	0.01%
过去六个月	-1.56%	0.20%	0.17%	0.22%	-1.73%	-0.02%
过去一年	1.04%	0.17%	1.72%	0.19%	-0.68%	-0.02%
自基金合同生效起至今	3.64%	0.16%	4.93%	0.19%	-1.29%	-0.03%

注：1、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15% + 中债综合指数（财富）收益率×80%+金融机构人民币活期存款利率（税后）×5%。

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

新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金

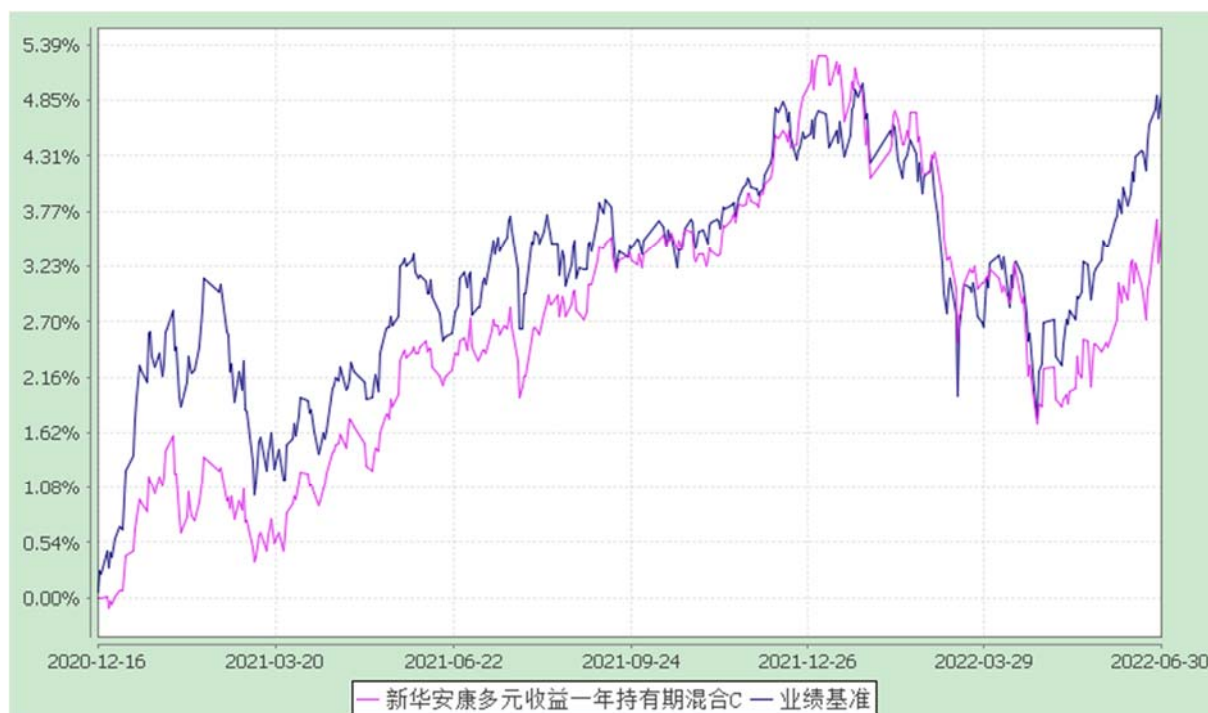
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 12 月 16 日至 2022 年 6 月 30 日)

新华安康多元收益一年持有期混合 A



新华安康多元收益一年持有期混合 C



注：1、本基金合同生效日为 2020 年 12 月 16 日。

2、本报告期末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		
郑毅	本基金基金经理，总经理助理兼固定收益投资部总监，新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理、新华利率债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、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理。	2021-12-30	-	11	学士。历任天风证券股份有限公司固定收益总部交易员、固收投资部副总经理、资管分公司策略投资一部总经理、资管分公司总经理助理。
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经理、新华中小市值优选混合型证券投资基	2021-12-30	-	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。

	金基金经理。				
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、新华鑫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	2020-12-24	-	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。

	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、	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>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</p>				
--	--	--	--	--	--

	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、新华鑫回报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理助理。				
裴铎	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、	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。

	<p>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、新华鑫回报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</p>				
--	---	--	--	--	--

	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。				
--	---	--	--	--	--

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安康多元一年持有期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》、《新华安康多元一年持有期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，从海外宏观层面来看，美债利率的大幅波动以及通胀的持续升温成为了影响市场的主线。影响美债定价的主要因素是美联储货币政策的预期，背后反映的是通胀和就业。从通胀来看，本轮通胀的原因主要有三点：（1）过去几年全球增长放缓，导致周期性的投资不足；（2）疫情期间财政货币扩张，需求短期过度释放；（3）逆全球化、地缘冲突，深化供需错配矛盾。通过对原油、耐用品、房租三个主要通胀项目的分析发现，如果地缘政治不出现新的变数影响能源价格，在持续加息的背景下，通胀环比趋势逐步回落是较大概率出现的。同比增速上，则是三季度向上，四季度大概率回落的趋势，绝对水平仍处于高位。经济方面，对加息敏感的行业数据走弱，但是服务消费、企业资本开支依然较强，劳动力市场偏紧，失业率处于历史低位。加息的影响扩散到整个经济系统，并最终体现在就业上，还需要时间。综合来看，考虑到通胀维持高位，失业率可容忍小幅上行，下半年主要矛盾还是控通胀，联储提高政策利率至 3%以上的概率还是比较高。

国内方面，国内利率的定价主要受到国内融资情况的影响，这是我国以投资为主导的经济结构决定的。2022 年虽然国内外经济环境跌宕起伏，但我国的社融融资规模增速上半年基本在 10-11% 的窄幅波动区间，整体的社融增速的波动是在降低的。融资增速决定利率定价，因此上半年十年国债利率的波动区间也是小于 2019 年 3%-3.4% 将近 40Bp 的振幅。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，新华安康多元 A 份额净值为 1.0428 元，本报告期份额净值增长率为 -1.37%，

同期比较基准的增长率为 0.17%；新华安康多元 C 份额净值为 1.0364 元，本报告期份额净值增长率为-1.56%，同期比较基准的增长率为 0.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年国内宏观的基本线索依然是稳增长和稳预期，宏观环境研判可讨论的点主要有：稳增长的措施的推动力度，最终制定的增速目标，后续增量政策等等，都是市场关注的焦点。对于国内利率的展望，在当前复杂的宏观环境及低利率的背景下，应对比判断更加重要：如果看下半年经济趋势向好，那么按照过去几年社融与利率的波动关系，下半年社融增速是否会上行至少 2%以上，即从当前的 10%左右，上行到 12%附近。如果社融出现这种变化的情况概率比较大，那么宏观无风险利率大概率要出现类似 2020 年的一段时间趋势性的上行，且具备单边熊市的特征。如果下半年社融增速，最多也就到至 11%附近，那么可以大概率推断，宏观无风险利率还不具备能走出一个趋势性方向的基础，很可能重现类似 2019 年或 2022 年上半年的情景。趋势上行和区间震荡这两种情景，对于策略的安排是截然不同的。核心的关注点在于基建的持续力度以及地产整体的修复斜率，这些需要做好更细致的数据追踪和观察。总体来看，政府、居民、房地产企业这几个主要的融资部门均不具备将社融增速推上新台阶的能力和意愿。在经济修复期间，货币政策也将维持合理充裕。无风险利率总体没有太大的上行风险，维持区间震荡的可能性比较高。

上半年转债市场先抑后扬，一季度可转债市场跟随权益市场调整，转股溢价率相较年初有所压缩，二季度在权益的带动下开启反弹，偏股型转债的相对表现更好。但总体来看，转债的表现相对权益而言要弱，其中一个重要的原因仍是高估值制约了转债跟涨的弹性，反弹初期相较正股而言转债的性价比偏弱。权益市场的反弹消化了一部分转债的高估值，转债性价比较前期有了一定程度的回升，同时，正股处于高景气行业的转债或在未来一段时间仍有不错的表现。

二季度 A 股市场呈现触底回升、企稳向好的态势。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、半导体等长期向好的高景气行业为甚。随着国内经济的企稳回升，全球比较下的 A 股市场吸引力增强，市场信心逐渐恢复。本基金权益部分在二季度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，重点增加了成长性行业的配置，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。

本基金债券投资以中短久期高评级信用债加中长久期利率债的哑铃型组合为底仓，上半年组合久期维持在中低水平，以获取高安全度的票息收益为主，回避有潜在信用风险的个券。二季度股票仓位有所提升，坚持性价比为核心的行业均衡配置策略，对于过度风格暴露保持谨慎。

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

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：新华安康多元收益一年持有期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	8,954,521.41	37,849,685.69
结算备付金		14,170,810.91	285,736.65
存出保证金		58,665.50	6,478.57
交易性金融资产	6.4.7.2	262,575,161.04	688,370,360.51
其中：股票投资		40,354,701.51	121,443,131.31
基金投资		-	-
债券投资		222,220,459.53	566,927,229.20
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		1,251,274.30	75,393.22
应收股利		-	-
应收申购款		2,668.97	998,109.92
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	9,873,902.54
资产总计		287,013,102.13	737,459,667.10
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		60,027,452.05	43,988,858.01
应付清算款		228.34	-
应付赎回款		2,928,711.15	32,796,689.27
应付管理人报酬		134,229.13	622,076.80
应付托管费		28,763.38	133,302.18

应付销售服务费		5,505.32	31,406.55
应付投资顾问费		-	-
应交税费		17,255.88	79,384.31
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	568,162.78	205,566.40
负债合计		63,710,308.03	77,857,283.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	214,224,827.02	624,041,241.69
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	9,077,967.08	35,561,141.89
净资产合计		223,302,794.10	659,602,383.58
负债和净资产总计		287,013,102.13	737,459,667.10

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金 A 类份额净值 1.0428 元，基金 A 类份额 198,458,944.24 份；基金 C 类份额净值 1.0364 元，基金 C 类份额 15,765,882.78 份。

6.2 利润表

会计主体：新华安康多元收益一年持有期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		-5,029,688.10	31,364,942.39
1.利息收入		168,819.57	18,079,158.55
其中：存款利息收入	6.4.7.8	55,487.45	83,126.32
债券利息收入		-	17,678,088.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		113,332.12	317,943.86
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,745,002.14	17,591,901.40
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-19,257,590.28	16,220,296.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	9,233,532.01	483,929.14
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	-19,965.00	-
股利收益	6.4.7.12	299,021.13	887,675.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	4,546,494.47	-4,306,117.56

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
减：二、营业总支出		2,231,535.49	5,520,052.39
1. 管理人报酬		1,186,157.14	3,943,228.08
2. 托管费		254,176.51	844,977.44
3. 销售服务费		47,457.72	248,488.42
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		587,521.66	163,707.20
其中：卖出回购金融资产支出		587,521.66	163,707.20
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		17,372.82	54,334.31
8. 其他费用	6.4.7.14	138,849.64	265,316.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,261,223.59	25,844,890.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,261,223.59	25,844,890.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,261,223.59	25,844,890.00

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新华安康多元收益一年持有期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）	624,041,241.69	-	35,561,141.89	659,602,383.58
二、本期期初净资产（基金净值）	624,041,241.69	-	35,561,141.89	659,602,383.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-409,816,414.67	-	-26,483,174.81	-436,299,589.48
（一）、综合收益总额	-	-	-7,261,223.59	-7,261,223.59
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”	-409,816,414.67	-	-19,221,951.22	-429,038,365.89

号填列)				
其中：1.基金申购款	22,603,129.93	-	1,140,450.57	23,743,580.50
2.基金赎回款	-432,419,544.60	-	-20,362,401.79	-452,781,946.39
(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)	214,224,827.02	-	9,077,967.08	223,302,794.10
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)	973,145,341.85	-	4,116,061.00	977,261,402.85
二、本期期初净资产(基金净值)	973,145,341.85	-	4,116,061.00	977,261,402.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	202,834,145.82	-	28,379,902.56	231,214,048.38
(一)、综合收益总额	-	-	25,844,890.00	25,844,890.00
(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)	202,834,145.82	-	2,535,012.56	205,369,158.38
其中：1.基金申购款	202,844,060.41	-	2,535,110.71	205,379,171.12
2.基金赎回款	-9,914.59	-	-98.15	-10,012.74
(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)	1,175,979,487.67	-	32,495,963.56	1,208,475,451.23

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

新华安康多元收益一年持有期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【2020】2398 号文《关于准予新华安康多元收益一年持有期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，存续期不限定。于 2020 年 11 月 5 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：2020 年 11 月 5 日至 2020 年 12 月 11 日。首次募集资金总额 972,434,382.13 元，其中募集资金产生利息 463,126.33 元。基金募集的基金份额为 972,434,382.13 份，其中净认购 A 类份额为 849,283,456.20 份和 C 类基金份额为 122,687,799.60 份，募集期银行利息折算 A 类基金份额为 434,123.31 份和 C 类基金份额为 29,003.02 份，并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2020]第 36010011 号验资报告予以验证。2020 年 12 月 16 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《新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》及《新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、政府机构债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中国证监会允许本基金投资的永续债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债、政府支持机构债、政府支持债券等各类债券）、货币市场工具、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单和银行存款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）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。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。本基金投资于股票的比例为基金资产的 0-40%；每个交易日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15% + 中债综合指数（财富）收益率×80%+ 金融机构人民币活期存款利率（税后）×5%。

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》、《新华安康多元收益一年持有期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本报告期末的财务状况以及本报告期间的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

本基金本报告期内无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无会计差错更正。

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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括债券的差价收入，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。

(4) 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	8,954,521.41
等于：本金	8,953,742.46
加：应计利息	778.95
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	8,954,521.41

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	38,452,643.60	-	40,354,701.51	1,902,057.91
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	93,037.46		
	市场	14,868,729.94	15,325,719.24	363,951.84
	银行间		4,914,740.29	
	市场	202,838,642.27	206,894,740.29	-858,642.27
合计	217,707,372.21	5,007,777.75	222,220,459.53	-494,690.43
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	256,160,015.81	5,007,777.75	262,575,161.04	1,407,367.48

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	459,983.83
其中：交易所市场	444,118.19
银行间市场	15,865.64
应付利息	-
账户维护费	9,000.00
证券时报	59,507.37
审计费	39,671.58
合计	568,162.78

6.4.7.6 实收基金

新华安康多元收益一年持有期混合 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	586,308,743.88	586,308,743.88
本期申购	22,299,149.84	22,299,149.84
本期赎回（以“-”号填列）	-410,148,949.48	-410,148,949.48
本期末	198,458,944.24	198,458,944.24

新华安康多元收益一年持有期混合 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	37,732,497.81	37,732,497.81

本期申购	303,980.09	303,980.09
本期赎回（以“-”号填列）	-22,270,595.12	-22,270,595.12
本期末	15,765,882.78	15,765,882.78

6.4.7.7 未分配利润

新华安康多元收益一年持有期混合 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	33,269,815.25	297,876.84	33,567,692.09
本期利润	-10,889,947.01	4,167,111.45	-6,722,835.56
本期基金份额交易产生的变动数	-18,043,646.77	-297,378.98	-18,341,025.75
其中：基金申购款	1,204,553.89	-77,337.51	1,127,216.38
基金赎回款	-19,248,200.66	-220,041.47	-19,468,242.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,336,221.47	4,167,609.31	8,503,830.78

新华安康多元收益一年持有期混合 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	1,974,656.71	18,793.09	1,993,449.80
本期利润	-917,771.05	379,383.02	-538,388.03
本期基金份额交易产生的变动数	-811,785.22	-69,140.25	-880,925.47
其中：基金申购款	12,654.31	579.88	13,234.19
基金赎回款	-824,439.53	-69,720.13	-894,159.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	245,100.44	329,035.86	574,136.30

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	21,072.53
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	34,414.92
其他	-
合计	55,487.45

注：结算备付金利息收入包括存出保证金利息收入。

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	275,609,666.77
减：卖出股票成本总额	294,192,051.57
减：交易费用	675,205.48
买卖股票差价收入	-19,257,590.28

6.4.7.10 债券投资收益**6.4.7.10.1 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	6,306,557.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,926,974.10
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	9,233,532.01

6.4.7.10.2 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	631,839,323.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	616,001,755.97
减：应计利息总额	12,903,436.27
减：交易费用	7,157.57
买卖债券差价收入	2,926,974.10

6.4.7.11 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
国债期货投资收益	-19,965.00

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	299,021.13
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	299,021.13

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	4,546,494.47
——股票投资	9,001,046.01
——债券投资	-4,454,551.54
——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	4,546,494.47

6.4.7.14 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	21,070.69
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
证券时报	59,507.37
合计	138,849.64

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，本基金并无需要作披露的或有事项。

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
招商银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
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

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的股票交易。

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的权证交易。

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的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 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	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管理费	1,186,157.14	3,943,228.08
其中：支付销售机构的客户维护费	493,907.35	1,679,148.37

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%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×0.70%/当年天数

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	254,176.51	844,977.44

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.15%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×0.15%/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		
	新华安康多元收益一年持有期混合 A	新华安康多元收益一年持有期混合 C	合计
新华基金管理股份有限公司	-	2.49	2.49
恒泰证券股份有限公司	-	479.50	479.50
合计	-	481.99	481.99
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华安康多元收益一年持有期混合 A	新华安康多元收益一年持有期混合 C	合计
新华基金管理股份有限公司	-	3.71	3.71

恒泰证券股份有限公司	-	1,970.58	1,970.58
合计	-	1,974.29	1,974.29

注：本基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

其计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/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

本报告期及上年度可比期间，本基金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固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未发生运用固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

报告期末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
招商银行股份有限公司	8,954,521.41	21,072.53	15,270,615.21	26,294.48

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

本报告期及上年度可比期间，本基金均未参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配情况。

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
301136	招标股份	2021-12-30	1-6个月(含)	新股锁定期内	10.52	19.74	7,172.00	75,449.44	141,575.28	-
301201	诚达药业	2022-01-12	1-6个月(含)	新股锁定期内	72.69	71.54	353.00	25,659.57	25,253.62	-
300834	星辉环材	2022-01-06	1-6个月(含)	新股锁定期内	55.57	30.03	529.00	29,396.53	15,885.87	-
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	-
301196	唯科科技	2022-01-04	1-6个月(含)	新股锁定期内	64.08	37.52	271.00	17,365.68	10,167.92	-
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	-

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

截止 2022 年 6 月 30 日, 本基金从事银行间市场债券正回购形成的卖出回购金融资产款余额为 60,027,452.05 元, 是以如下债券作为质押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
210408	21 农发 08	2022-07-01	103.26	300,000.00	30,979,241.10
101769014	17 首旅 MTN001B	2022-07-01	104.65	200,000.00	20,929,471.78
102000281	20 海淀国资 MTN001	2022-07-01	101.35	100,000.00	10,135,495.89
012280922	22 厦国贸控 SCP001	2022-07-01	100.96	75,000.00	7,571,710.69
合计				675,000.00	69,615,919.46

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至 2022 年 06 月 30 日, 本基金无交易所市场债券正回购。

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

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。

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	10,067,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	12,716,458.91	71,065,300.00
合计	12,716,458.91	81,132,300.00

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	152,657,581.95	384,143,929.20
AAA 以下	4,795,051.54	0.00
未评级	52,051,367.13	101,651,000.00
合计	209,504,000.62	485,794,929.20

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。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	8,954,521.41	-	-	-	8,954,521.41
结算备付金	14,170,810.91	-	-	-	14,170,810.91
存出保证金	58,665.50	-	-	-	58,665.50
交易性金融资产	157,390,996.45	64,829,463.08	0.00	40,354,701.51	262,575,161.04
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	-	-	-	1,251,274.30	1,251,274.30
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	2,668.97	2,668.97
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	180,574,994.27	64,829,463.08	0.00	41,608,644.78	287,013,102.13
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	60,027,452.05	-	-	-	60,027,452.05
应付清算款	-	-	-	228.34	228.34
应付赎回款	-	-	-	2,928,711.15	2,928,711.15
应付管理人报酬	-	-	-	134,229.13	134,229.13
应付托管费	-	-	-	28,763.38	28,763.38
应付销售服务费	-	-	-	5,505.32	5,505.32
应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00

应交税费	-	-	-	17,255.88	17,255.88
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	568,162.78	568,162.78
负债总计	60,027,452.05	0.00	0.00	3,682,855.98	63,710,308.03
利率敏感度缺口	120,547,542.22	64,829,463.08	0.00	37,925,788.80	223,302,794.10
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	37,849,685.69	-	-	-	37,849,685.69
结算备付金	285,736.65	-	-	-	285,736.65
存出保证金	6,478.57	-	-	-	6,478.57
交易性金融资产	445,233,300.00	11,397,522.00	110,296,407.20	121,443,131.31	688,370,360.51
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	-	-	-	75,393.22	75,393.22
应收利息	-	-	-	9,873,902.54	9,873,902.54
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	998,109.92	998,109.92
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	483,375,200.91	11,397,522.00	110,296,407.20	132,390,536.99	737,459,667.10
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	43,988,858.01	-	-	-	43,988,858.01
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	32,796,689.27	32,796,689.27
应付管理人报酬	-	-	-	622,076.80	622,076.80
应付托管费	-	-	-	133,302.18	133,302.18

应付销售服务费	-	-	-	31,406.55	31,406.55
应付交易费用	-	-	-	109,902.42	109,902.42
应交税费	-	-	-	79,384.31	79,384.31
应付利息	-	-	-	6,663.98	6,663.98
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	89,000.00	89,000.00
负债总计	43,988,858.01	0.00	0.00	33,868,425.51	77,857,283.52
利率敏感度缺口	439,386,342.90	11,397,522.00	110,296,407.20	98,522,111.48	659,602,383.58

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	-612,435.84	-2,704,646.88
	市场利率下降 25.00 bp	618,165.74	2,768,717.61

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，所面临的最大的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	40,354,701.5 1	18.07	121,443,131.3 1	18.41
交易性金融资产—基金投资	0.00	0.00	-	-
交易性金融资产—债券投资	222,220,459. 53	99.52	566,927,229.2 0	85.95
交易性金融资产—贵金属投资	0.00	0.00	-	-
衍生金融资产—权证投资	0.00	0.00	-	-
其他	-	-	-	-
合计	262,575,161. 04	117.59	688,370,360.5 1	104.36

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%	477,809.93	1,155,970.15
	沪深 300 指数下降 1%	-477,809.93	-1,155,970.15

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	52,645,871.22
第二层次	209,716,877.69
第三层次	212,412.13
合计	262,575,161.04

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	40,354,701.51	14.06
	其中：股票	40,354,701.51	14.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	222,220,459.53	77.43
	其中：债券	222,220,459.53	77.43
	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	23,125,332.32	8.06
8	其他各项资产	1,312,608.77	0.46
9	合计	287,013,102.13	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	9,409,632.00	4.21
C	制造业	27,425,559.03	12.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,358,667.00	0.61
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	2,160,843.48	0.97
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	40,354,701.51	18.07

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	601001	晋控煤业	209,100	3,711,525.00	1.66
2	600395	盘江股份	366,900	3,217,713.00	1.44
3	603583	捷昌驱动	68,600	2,290,554.00	1.03
4	688349	三一重能	47,187	1,922,870.25	0.86
5	600887	伊利股份	40,400	1,573,580.00	0.70
6	300759	康龙化成	16,050	1,528,281.00	0.68
7	300274	阳光电源	15,500	1,522,875.00	0.68
8	002304	洋河股份	7,700	1,410,255.00	0.63
9	601238	广汽集团	90,200	1,374,648.00	0.62
10	300750	宁德时代	2,400	1,281,600.00	0.57
11	601633	长城汽车	34,300	1,270,472.00	0.57
12	688390	固德威	4,028	1,260,804.28	0.56
13	600933	爱柯迪	75,800	1,241,604.00	0.56
14	600985	淮北矿业	84,100	1,224,496.00	0.55
15	603997	继峰股份	86,700	943,296.00	0.42
16	600809	山西汾酒	2,700	876,960.00	0.39

17	002032	苏泊尔	15,000	845,100.00	0.38
18	300595	欧普康视	14,700	840,693.00	0.38
19	603369	今世缘	16,000	816,000.00	0.37
20	603198	迎驾贡酒	12,400	807,736.00	0.36
21	002271	东方雨虹	14,900	766,903.00	0.34
22	002821	凯莱英	2,600	751,400.00	0.34
23	000568	泸州老窖	3,000	739,620.00	0.33
24	688050	爱博医疗	3,173	711,386.60	0.32
25	002807	江阴银行	151,900	688,107.00	0.31
26	600188	兖矿能源	17,100	675,108.00	0.30
27	603501	韦尔股份	3,900	674,817.00	0.30
28	300059	东方财富	26,400	670,560.00	0.30
29	000860	顺鑫农业	24,800	665,136.00	0.30
30	301191	菲菱科思	8,000	644,720.00	0.29
31	300014	亿纬锂能	6,200	604,500.00	0.27
32	688621	阳光诺和	4,488	490,987.20	0.22
33	605117	德业股份	1,600	447,824.00	0.20
34	300763	锦浪科技	2,100	447,300.00	0.20
35	601666	平煤股份	31,000	421,290.00	0.19
36	000625	长安汽车	22,990	398,186.80	0.18
37	600988	赤峰黄金	10,000	159,500.00	0.07
38	301136	招标股份	7,172	141,575.28	0.06
39	688257	新锐股份	2,899	114,858.38	0.05
40	000807	云铝股份	6,000	59,280.00	0.03
41	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
42	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.01
43	300834	星辉环材	529	15,885.87	0.01
44	301100	风光股份	599	12,926.42	0.01
45	301116	益客食品	577	11,805.42	0.01
46	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
47	301158	德石股份	379	7,724.02	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	7,176,468.96	1.09
2	000001	平安银行	6,578,069.00	1.00
3	603613	国联股份	4,355,346.00	0.66
4	601166	兴业银行	4,126,474.00	0.63

5	300122	智飞生物	3,979,894.00	0.60
6	600809	山西汾酒	3,952,982.00	0.60
7	000933	神火股份	3,857,380.00	0.58
8	002821	凯莱英	3,740,382.00	0.57
9	601857	中国石油	3,623,820.00	0.55
10	600985	淮北矿业	3,602,460.20	0.55
11	600690	海尔智家	3,093,543.00	0.47
12	000625	长安汽车	3,061,162.00	0.46
13	603799	华友钴业	3,058,997.00	0.46
14	603583	捷昌驱动	2,992,533.00	0.45
15	600702	舍得酒业	2,979,835.00	0.45
16	600395	盘江股份	2,966,506.00	0.45
17	000825	太钢不锈	2,890,103.00	0.44
18	603650	彤程新材	2,871,664.00	0.44
19	002110	三钢闽光	2,819,131.00	0.43
20	601001	晋控煤业	2,733,823.00	0.41

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

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	600690	海尔智家	7,192,276.00	1.09
2	000001	平安银行	6,682,245.00	1.01
3	300750	宁德时代	4,977,800.81	0.75
4	603589	口子窖	4,885,586.00	0.74
5	601225	陕西煤业	4,781,642.00	0.72
6	600048	保利发展	4,749,814.06	0.72
7	600887	伊利股份	4,494,467.00	0.68
8	000933	神火股份	4,475,245.00	0.68
9	603613	国联股份	4,304,039.55	0.65
10	000002	万科 A	4,208,934.00	0.64
11	601799	星宇股份	4,162,730.00	0.63
12	601006	大秦铁路	4,036,318.00	0.61
13	601166	兴业银行	4,025,303.00	0.61
14	300059	东方财富	3,999,165.00	0.61
15	000333	美的集团	3,891,215.00	0.59
16	601857	中国石油	3,873,256.00	0.59
17	001979	招商蛇口	3,776,368.00	0.57
18	601318	中国平安	3,675,528.27	0.56
19	300416	苏试试验	3,647,562.00	0.55

20	600519	贵州茅台	3,600,000.00	0.55
----	--------	------	--------------	------

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

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	204,102,575.76
卖出股票的收入（成交）总额	275,609,666.77

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

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	2,547,623.29	1.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	62,220,202.75	27.86
	其中：政策性金融债	62,220,202.75	27.86
4	企业债券	21,088,463.56	9.44
5	企业短期融资券	40,370,806.04	18.08
6	中期票据	83,215,267.94	37.27
7	可转债（可交换债）	12,778,095.95	5.72
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	222,220,459.53	99.52

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	210408	21 农发 08	300,000	30,979,241.10	13.87
2	1280405	12 豫铁投	200,000	21,088,463.56	9.44

		债			
3	190208	19 国开 08	200,000	21,072,126.03	9.44
4	101769015	17 鲁国资 MTN001	200,000	20,968,919.45	9.39
5	101769014	17 首旅 MTN001B	200,000	20,929,471.78	9.37

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以套期保值为目的，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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。若本基金投资国债期货，本基金在国债期货的投资中以套期保值为目的，综合利用对冲策略和套利策略，实现降低组合波动和增加组合收益的目标。对冲策略主要包括套期保值和久期调整，国债期货具有高杠杆、高流动性、可做空等优势，通过运用国债期货对冲可以降低债券持仓风险从而降低业绩波动，另外通过国债期货也可以来调节组合久期实现低成本调仓的目标。套利策略则通过利用国债期货与基差的交易性机会来拓宽组合盈利模式从而提高组合投资业绩。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金合同尚无投资基金的投资政策。

7.12.2 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

本基金本报告期末无基金投资。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1(一)“21 农发 08”的发行人中国农业发展银行：

中国农业发展银行因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送 17 项违法违规行为被罚款 480 万元。【银保监罚决字（2022）10 号】

（二）“19 国开 08”发行人国家开发银行：因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送 17 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 440 万元。（银保监罚决字（2022）8 号，2022 年 3 月 21 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	58,665.50
2	应收清算款	1,251,274.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,668.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	1,312,608.77

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	110053	苏银转债	5,885,761.28	2.64
2	128048	张行转债	2,507,147.43	1.12
3	128136	立讯转债	2,287,904.11	1.02
4	110075	南航转债	1,258,533.62	0.56
5	127025	冀东转债	564,235.40	0.25

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

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
新华安康多元收益一年持有期混合 A	14,716	13,485.93	0.00	0.00%	198,458,944.24	100.00%
新华安康多元收益一年持有期混	555	28,407.00	0.00	0.00%	15,765,882.78	100.00%

合 C						
合计	15,271	14,028.21	0.00	0.00%	214,224,827.02	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	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	新华安康多元收益一年持有期混合 A	195.19	0.00%
	新华安康多元收益一年持有期混合 C	0.00	0.00%
	合计	195.19	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	新华安康多元收益一年持有期混合 A	0
	新华安康多元收益一年持有期混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华安康多元收益一年持有期混合 A	0
	新华安康多元收益一年持有期混合 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华安康多元收益一年持有期混合 A	新华安康多元收益一年持有期混合 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 16 日）基金份额总额	849,717,579.51	122,716,802.62
本报告期期初基金份额总额	586,308,743.88	37,732,497.81
本报告期基金总申购份额	22,299,149.84	303,980.09
减：本报告期基金总赎回份额	410,148,949.48	22,270,595.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	198,458,944.24	15,765,882.78

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、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

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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	
长江证券	1	265,804,370.55	55.75%	194,381.10	55.75%	-
广发证券	1	210,957,087.61	44.25%	154,272.98	44.25%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	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
长江证券	51,132,984.40	80.14%	1,243,500,000.00	100.00%	-	-
广发证券	12,671,437.42	19.86%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

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	新华安康多元收益一年持有期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	新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金（新华安康多元收益一年持有期混合 A 类）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2022-01-05
4	新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金（新华安康多元收益一年持有期混合 C 类）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2022-01-05
5	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
6	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
7	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
8	新华基金管理股份有限公司关于新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金在重庆农村商业银行股份有限公司开展费率优惠活动的公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2022-01-14
9	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
10	新华安康多元收益一年持有期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
11	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
12	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
13	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

14	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
15	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
16	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
17	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	新华安康多元收益一年持有期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
19	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
20	新华安康多元收益一年持有期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
21	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	2022-04-30
22	新华基金管理股份有限公司关于部分基金增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	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	2022-05-09
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安康多元一年持有期混合型证券投资基金募集的文件
- (二)关于申请募集新华安康多元一年持有期混合型证券投资基金之法律意见书
- (三)新华安康多元一年持有期混合型证券投资基金基金合同
- (四)新华安康多元一年持有期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)《新华安康多元一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》(更新)
- (七)《新华安康多元一年持有期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