华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金
2021年年度报告

2021年12月31日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2022年3月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 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。

本报告中的财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§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 基金投资顾问 6
2.5 信息披露方式 6
2.6 其他相关资料 6

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 8

§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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 16
4.10 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 16

§5 托管人报告 16

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16

§6 审计报告 16

6.1 审计报告基本信息 16
6.2 审计报告的基本内容 17

§7 年度财务报表 18

7.1 资产负债表 18
7.2 利润表 20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 21
7.4 报表附注 22

§8 投资组合报告 54

8.1 期末基金资产组合情况 54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 54
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 60
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 61
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 61
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 62
8.12 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例 62
8.13 投资组合报告附注 62

§9 基金份额持有人信息 64

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 64

§10 开放式基金份额变动 64

§11 重大事件揭示 65

11.1 基金份额持有人大会决议 65
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 65
11.4 基金投资策略的改变 65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 65
11.8 其他重大事件 66

§12 影响投资者决策的其他重要信息 68

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 69

§13 备查文件目录 69

13.1 备查文件目录 69
13.2 存放地点 69
13.3 查阅方式 69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华宝新起点混合
基金主代码	002111
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 19 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	685,119,887.31 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过大类资产间的灵活配置和多样的投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取积极的股票选择策略，将“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的股票精选策略相结合，根据对宏观经济和市场风险特征变化的判断，进行投资组合的动态优化，实现基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50% ＋上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、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		华宝基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷	罗菲菲
	联系电话	021-38505888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	95568
传真		021-38505777	010-57093382
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		XIAOYI HELEN HUANG	高迎欣

2.4 基金投资顾问

2.5 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	基金管理人	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	53,904,458.50	54,804,889.16	10,458,384.31
本期利润	43,456,694.16	70,032,733.25	17,200,421.86
加权平均基金份额本期利润	0.0703	0.1955	0.1394
本期加权平均净值利润率	5.46%	16.77%	12.93%
本期基金份额净值增长率	5.75%	15.87%	11.03%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	190,067,041.30	108,947,228.12	22,091,149.51
期末可供分配基金份额利润	0.2774	0.1857	0.0990
期末基金资产净值	902,450,878.04	730,560,244.34	250,526,884.41
期末基金	1.3172	1.2456	1.1230

份额净值			
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	43.77%	35.95%	17.33%

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4.期末可供分配利润采用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。

3.2 基金净值表现

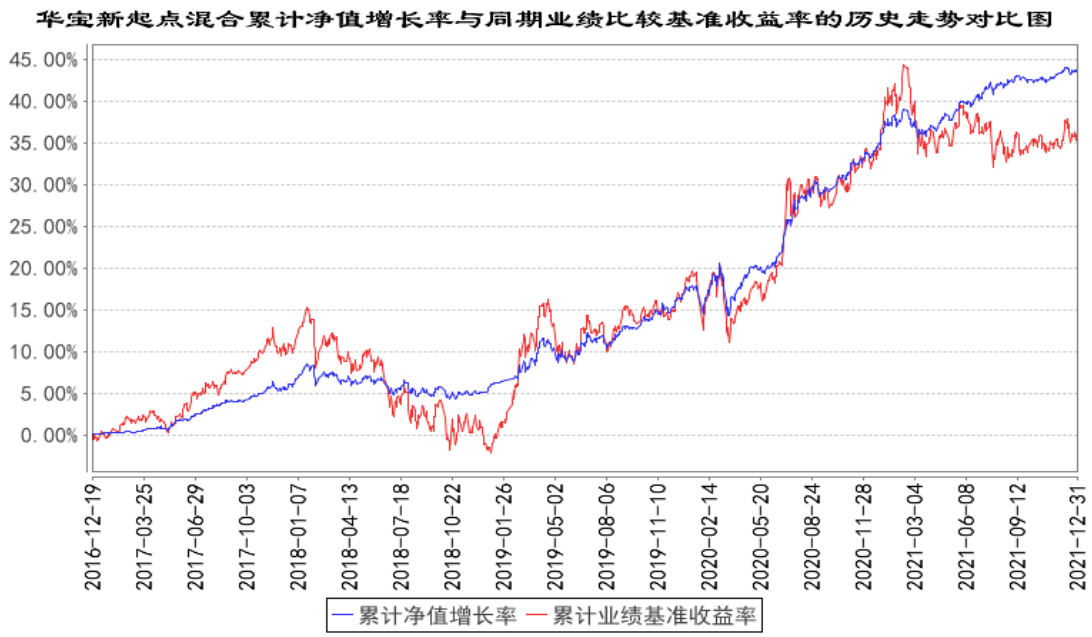
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.86%	0.10%	1.32%	0.40%	-0.46%	-0.30%
过去六个月	2.12%	0.15%	-1.38%	0.51%	3.50%	-0.36%
过去一年	5.75%	0.20%	-0.18%	0.59%	5.93%	-0.39%
过去三年	36.05%	0.29%	38.14%	0.64%	-2.09%	-0.35%
过去五年	43.58%	0.25%	36.78%	0.60%	6.80%	-0.35%
自基金合同生效起至今	43.77%	0.25%	36.13%	0.60%	7.64%	-0.35%

注：（1）基金业绩基准：沪深 300 指数收益率×50% ＋上证国债指数收益率×50%；

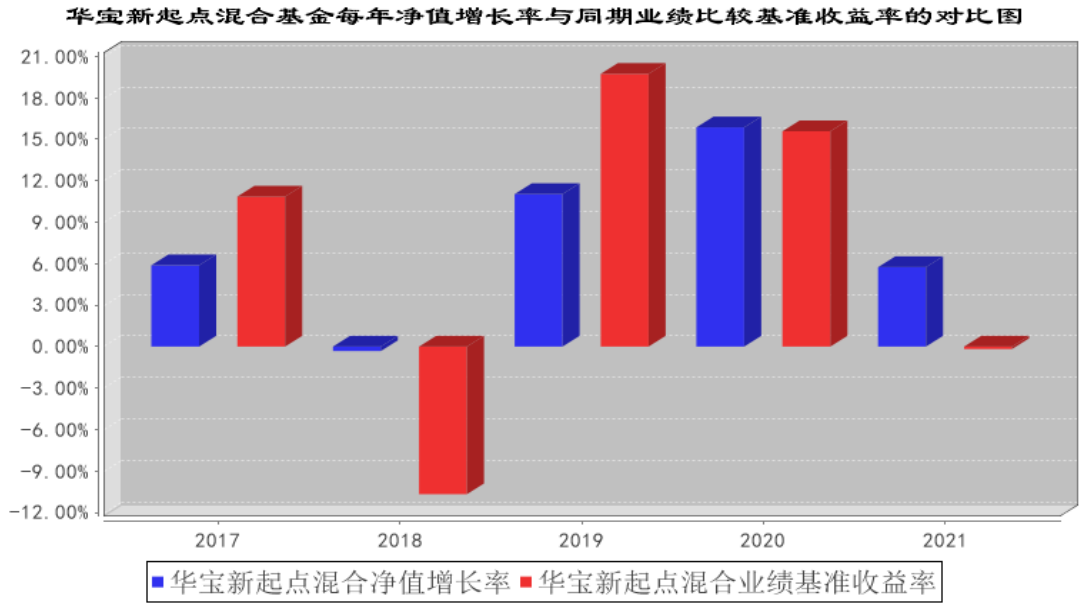
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2017 年 06 月 19 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	0.4800	10,693,872.76	22,086.70	10,715,959.46	-

2019 年	-	-	-	-	-
合计	0.4800	10,693,872.76	22,086.70	10,715,959.46	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为人民币 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司与美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management,L.P.），持有股权占比分别为 51%和 49%。公司在北京、深圳等地设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理(香港）有限公司。

截至本报告期末（2021 年 12 月 31 日），本公司正在管理运作的证券投资基金包括：华宝宝康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合混合型证券投资基金、华宝先进成长混合型证券投资基金、华宝行业精选混合型证券投资基金、华宝海外中国成长混合型证券投资基金、华宝大盘精选混合型证券投资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝中证 100 指数证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)、华宝资源优选混合型证券投资基金、华宝现金添益交易型货币市场基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金(LOF)、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝浮动净值型发起式货币市场基金、华宝致远混合型证券投资基金（QDII）、华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）等共 125 只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
高 文庆	本基金基金经理	2017-03-17	-	12 年	硕士。2010 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理风险分析师、助理产品经理、信用分析师、高级信用分析师、基金经理助理等职务。2017 年 3 月起任华宝现金宝货币市场基金、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 3 月起任华宝中短债债券型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 5 月起任华宝宝怡纯债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 7 月起任华宝现金添益交易型货币市场基金基金经理，2019 年 9 月起任华宝政策性金融债债券型证券投资基金基金经理。
李 栋梁	本基金基金经理、混合资产部副总经理	2016-12-19	2021-03-05	19 年	硕士。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的证券研究和投资管理工作。2010 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任债券分析师、基金经理助理、固定收益部副总经理等职务，现任混合资产部副总经理。2011 年 6 月起任华宝宝康债券投资基金基金经理，2014 年 10 月起任华宝增强收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 10 月至 2017 年 12 月任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月至 2019 年 6 月任华宝宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016 年 6 月起任华宝可转债债券型证券投资基金基金经理，2016 年 9 月至 2017 年 12 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2021 年 3 月任华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 2 月起任华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 8 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，2017 年 6 月至 2019 年 3 月任

					华宝新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 4 月起任华宝双债增强债券型证券投资基金基金经理。
唐　雪倩	本基金的基金经理助理	2018-01-23	-	7 年	硕士。2015 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任分析师、基金经理助理等职务。2018 年 1 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2018 年 8 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2019 年 2 月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理助理，2019 年 7 月起任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2021 年 8 月至 2021 年 10 月任华宝安享混合型证券投资基金基金经理助理，2021 年 9 月至 2021 年 10 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 10 月起任华宝安益混合型证券投资基金、华宝安享混合型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节

出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1)每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2)每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。

3)对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4)对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评

价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生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交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年国内经济在疫情后周期延续企稳修复，全年 GDP 同比增速为 8.1%，较上年显著回升 5.8 个百分点，两年平均增速恢复到 5%以上。全年来看，经济基本面呈现前高后低，各季度 GDP 同比增速分别为 18.3%、7.9%、4.9%、4.0%。具体来看，2021 年固定资产投资同比增长 4.9%，较上年增长 2 个百分点，投资依然保持了恢复态势，基建投资见底，制造业投资明显改善，但是地产链条下行压力在下半年逐渐显现，带动房地产开发投资回落。外贸方面，在海外疫情反复下，国内全年出口增速同比大幅攀升至 29.9%，两年平均增速 16.0%，成为经济最主要的拉动项。通胀方面，PPI 持续攀高，但是下游生产和居民需求依然偏弱，年末伴随行政控价措施的陆续出台，大宗涨价趋势有所缓解。2021 年市场流动性整体平稳宽松，下半年货币政策宽松力度加码，于 7 月和 12 月分别实施了两次全面降准。流动性和基本面预期变化成为了 2021 年债市行情的主要驱动因素，债券收益率整体呈现下行趋势，10 年国债和 10 年国开收益率分别较年初回落 40BP 和 49BP 至 2.78%和 3.08%。

本基金在报告期内管理规模持续增长，资产配置上，随着基金规模的增长，本基金在权益资产的配置比重有所减少，在股票投资上始终采取稳健的策略，以沪深 300 中表现较好的股票为主，同时积极参与新股申购。综合来看，本基金在报告期内整体运行平稳，净值表现较为稳健。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 5.75%，业绩比较基准收益率为-0.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，国内基本面面临需求收缩、供给冲击、预期转弱等三重压力，经济增长面临一定的挑战。首先基建方面，受到隐性债务约束和土拍收入增速回落的双重限制，基建发力点将以“新基建为主、老基建为辅”，整体或呈现温和发力态势，对经济增长形成支撑。地产方面，近期房地产政策呈现边际放松，但当前侧重点仍以防风险和稳债务为主，在“房住不炒”背景下，地产行业虽然断崖式失速风险较小，但地产的金融属性将弱化、信用扩张受限，预计行业修复缓慢。消费方面，疫情阶段性反复、居民收入增速放缓、边际消费意愿不足仍将抑制消费的整体修复。通胀方面，2022 年猪周期见底，消费温和复苏指向 CPI 渐进回暖，PPI 方面，原材料价格进入下行通道，年内 PPI 预期逐季回落。政策方面，国内在上半年“宽货币+宽财政+稳信用/宽信用”的政策组合将逐步落地，而海外政策方面，随着疫情影响边际减弱，全球通胀水平高企，流动性收缩风险增加，美国在 3 月份可能提早进入加息周期，国内和美国在上半年货币政策或将出现反向。综合来看，2022 年初在宽货币先行、宽信用未至的时期，市场流动性有望维持平稳偏松，资金面和政策面仍利多债市。随着后续社融逐步企稳，债券市场和资金面波动或将有所加大。综上所述，我们将密切关注通胀、海外流动性和国内政策等因素对市场带来的扰动。本基金管理人将继续本着谨慎、稳健、安全的原则，积极关注经济和政策面的变化，根据市场变化灵活调整投资策略，为投资者谋取稳定回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展

不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。2021 年，合规审计部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计、依据各项监管规定对公司相关内部流程进行了评估、根据监管要求开展了涉及投研、运营、销售等方面的专项自查；并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

（1）日常估值流程

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

（2）特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13　号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》等有关规定及本公司的估值制度，对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况，量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就

估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

4.10 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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 61471289_B02 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则

	执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	许培菁	张亚旎
会计师事务所的地址	中国　　北京	
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			

银行存款	7.4.7.1	7,779,109.11	5,000,588.17
结算备付金		2,780,101.46	1,118,382.92
存出保证金		2,166,370.23	3,294,896.98
交易性金融资产	7.4.7.2	882,165,260.86	670,400,206.69
其中：股票投资		126,568,760.86	134,649,141.09
基金投资		-	-
债券投资		755,596,500.00	535,751,065.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	44,960,427.44
应收证券清算款		-	795,054.91
应收利息	7.4.7.5	8,737,191.92	6,152,152.43
应收股利		-	-
应收申购款		348,225.62	44,594.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		903,976,259.20	731,766,303.54
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 12 月 31 日**	**上年度末 2020 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		413,695.46	101,045.76
应付管理人报酬		457,181.86	333,886.35
应付托管费		114,295.49	83,471.61
应付销售服务费		190,492.42	139,119.33
应付交易费用	7.4.7.7	136,654.87	367,142.62
应交税费		13,061.06	1,393.53
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	200,000.00	180,000.00
负债合计		1,525,381.16	1,206,059.20
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	685,119,887.31	586,535,472.75
未分配利润	7.4.7.10	217,330,990.73	144,024,771.59
所有者权益合计		902,450,878.04	730,560,244.34
负债和所有者权益总计		903,976,259.20	731,766,303.54

注： 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3172 元，基金份额总额 685,119,887.31

份。

7.2 利润表

会计主体：华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		52,837,586.43	75,889,227.99
1.利息收入		22,035,359.26	11,349,114.69
其中：存款利息收入	7.4.7.11	95,174.73	139,927.69
债券利息收入		21,396,847.45	10,145,439.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		543,337.08	1,063,747.42
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		41,131,817.13	49,305,863.20
其中：股票投资收益	7.4.7.12	42,210,234.15	58,453,873.85
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-951,118.52	-2,558,821.40
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-1,659,540.00	-8,049,576.00
股利收益	7.4.7.16	1,532,241.50	1,460,386.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-10,447,764.34	15,227,844.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	118,174.38	6,406.01
减：二、费用		9,380,892.27	5,856,494.74
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	4,767,549.30	2,468,513.55
2．托管费	7.4.10.2.2	1,191,887.43	617,128.46
3．销售服务费	7.4.10.2.3	1,986,478.76	1,028,547.33
4．交易费用	7.4.7.19	1,162,233.12	1,331,331.67
5．利息支出		-	167,962.75
其中：卖出回购金融资产支出		-	167,962.75

6．税金及附加		12,573.65	6,837.39
7．其他费用	7.4.7.20	260,170.01	236,173.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		43,456,694.16	70,032,733.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		43,456,694.16	70,032,733.25

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	586,535,472.75	144,024,771.59	730,560,244.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	43,456,694.16	43,456,694.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	98,584,414.56	29,849,524.98	128,433,939.54
其中：1.基金申购款	532,689,261.38	156,849,211.70	689,538,473.08
2.基金赎回款	-434,104,846.82	-126,999,686.72	-561,104,533.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	685,119,887.31	217,330,990.73	902,450,878.04
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者	223,089,373.64	27,437,510.77	250,526,884.41

权益（基金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,032,733.25	70,032,733.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	363,446,099.11	57,270,487.03	420,716,586.14
其中：1.基金申购款	545,171,810.10	84,062,968.27	629,234,778.37
2.基金赎回款	-181,725,710.99	-26,792,481.24	-208,518,192.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-10,715,959.46	-10,715,959.46
五、期末所有者权益（基金净值）	586,535,472.75	144,024,771.59	730,560,244.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

黄小薏	向辉	张幸骏
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金(原名为华宝兴业新起点灵活配置混合型证券投资基金，以下简称“本基金”)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[2015]第 1996 号《关于准予华宝兴业新起点灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和证监许可[2016]2564 号《关于准予华宝兴业新起点灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》核准，由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司，已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,047,200.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1316 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业新起点灵

活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,056,202.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,002.54 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。 根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华宝兴业新起点灵活配置混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金。 根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券)、货币市场工具(质押及买断式回购、银行存款、同业存单等)、资产支持证券、股指期货、权证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。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 0-95%，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，本基金保留的现金（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不低于基金资产净值的 5%；股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。本财务报表已于 2022 年 3 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）和在财务报表附注 7.4.4 所列示依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。 本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。 (1) 金融资产分类 本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项； 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和债券投资等； (2) 金融负债分类 本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。 划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益； 在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益； 处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益； 当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认； 当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认； 本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。 在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。 每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。 本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值： （1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。 与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价； （2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值； （3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值； （4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。 未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示； (2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提； (3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提； (4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提； (5)转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入； (6)股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账； (7)债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账； (8)资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账； (9)股指/国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账； (10)权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账； (11)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账； (12)公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其

变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；(13)其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。 其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配；(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(4)每一基金份额享有同等分配权；(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。 本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

（1）印花税 经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰； 经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变； 根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。 （2）增值税 根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定。经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入； 根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入； 根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。 （3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加 根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。 （4）企业所得税根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税； 根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非

流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税； 根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。 （5）个人所得税 根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税； 根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税； 根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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； 根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	7,779,109.11	5,000,588.17
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	7,779,109.11	5,000,588.17

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		116,581,068.48	126,568,760.86	9,987,692.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	15,652,714.28	15,592,500.00	-60,214.28
	银行间市场	738,088,990.80	740,004,000.00	1,915,009.20
	合计	753,741,705.08	755,596,500.00	1,854,794.92
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		870,322,773.56	882,165,260.86	11,842,487.30
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		110,435,760.50	134,649,141.09	24,213,380.59
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	17,519,520.68	17,241,065.60	-278,455.08
	银行间市场	519,140,913.87	518,510,000.00	-630,913.87
	合计	536,660,434.55	535,751,065.60	-909,368.95
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		647,096,195.05	670,400,206.69	23,304,011.64

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-17,730,720.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-17,730,720.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-17,730,720.00	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			

	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-25,500,300.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-25,500,300.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-25,500,300.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为人民币 0.00 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为人民币 0.00 元。于本报告期末，本基金持有

3.00 手 IF2201 空头持仓，合约市值为人民币-4,452,660.00 元，公允价值变动为人民币 112,080 元;9.00 手 IF2203 空头持仓，合约市值为人民币-13,366,620.00 元，公允价值变动为人民币-20,0640 元。上述股指期货投资合约市值合计人民币-17,819,280 元，公允价值变动合计人民币-88,560 元，抵销相关期货暂收款人民币 88,560 元后的净额为人民币 0.00 元。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	44,960,427.44	-
合计	44,960,427.44	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	627.97	378.11
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,829.33	5,862.48
应收债券利息	8,734,720.76	6,122,631.19
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	23,229.83
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	13.86	50.82
合计	8,737,191.92	6,152,152.43

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	123,471.22	356,844.61
银行间市场应付交易费用	13,183.65	10,298.01
合计	136,654.87	367,142.62

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	200,000.00	180,000.00
合计	200,000.00	180,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	586,535,472.75	586,535,472.75
本期申购	532,689,261.38	532,689,261.38

本期赎回（以“-”号填列）	-434,104,846.82	-434,104,846.82
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	685,119,887.31	685,119,887.31

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	108,947,228.12	35,077,543.47	144,024,771.59
本期利润	53,904,458.50	-10,447,764.34	43,456,694.16
本期基金份额交易产生的变动数	27,215,354.68	2,634,170.30	29,849,524.98
其中：基金申购款	133,335,552.51	23,513,659.19	156,849,211.70
基金赎回款	-106,120,197.83	-20,879,488.89	-126,999,686.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	190,067,041.30	27,263,949.43	217,330,990.73

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	17,468.13	26,077.46
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	76,753.56	96,364.39
其他	953.04	17,485.84
合计	95,174.73	139,927.69

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	42,210,234.15	58,453,873.85
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购	-	-

差价收入		
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	42,210,234.15	58,453,873.85

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	375,058,886.39	416,731,396.75
减：卖出股票成本总额	332,848,652.24	358,277,522.90
买卖股票差价收入	42,210,234.15	58,453,873.85

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-951,118.52	-2,558,821.40
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	-951,118.52	-2,558,821.40

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,410,755,968.87	494,771,665.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,393,336,582.32	488,998,463.90

减：应收利息总额	18,370,505.07	8,332,023.00
买卖债券差价收入	-951,118.52	-2,558,821.40

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-1,659,540.00	-8,049,576.00

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,532,241.50	1,460,386.75
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	1,532,241.50	1,460,386.75

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-11,461,524.34	16,330,164.09
股票投资	-14,225,688.21	17,278,045.11
债券投资	2,764,163.87	-947,881.02
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2.衍生工具	1,013,760.00	-1,102,320.00
权证投资	-	-
期货投资	1,013,760.00	-1,102,320.00
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	-10,447,764.34	15,227,844.09

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	117,909.25	5,047.63
基金转换费收入	265.13	1,229.43
其他	-	128.95
合计	118,174.38	6,406.01

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 100%归入基金资产。2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,132,660.09	1,319,181.67
银行间市场交易费用	22,325.00	12,150.00
期货交易费用	7,248.03	-
合计	1,162,233.12	1,331,331.67

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	22,970.01	18,973.59
账户维护费	36,000.00	36,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	1,200.00	1,200.00
合计	260,170.01	236,173.59

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司("华宝基金")	基金管理人,注册登记机构,基金销售机构
中国民生银行股份有限公司("中国民生银行")	基金托管人
华宝信托有限责任公司("华宝信托")	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management.L.P.)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司("宝武集团")	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司("华宝证券")	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司("华宝投资")	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司("宝武财务")	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.1.2 债券交易

7.4.10.1.3 债券回购交易

7.4.10.1.4 权证交易

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,767,549.30	2,468,513.55
其中：支付销售机构的客户维护费	134,234.08	6,274.25

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.60%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

7.4.10.2.1.1 基金投资顾问费

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,191,887.43	617,128.46

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.15%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	华宝新起点混合
华宝基金	1,827,465.39

合计	1,827,465.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	华宝新起点混合
华宝基金	1,019,493.08
合计	1,019,493.08

注：销售服务费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

其计算公式为：日销售服务费＝前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2016 年 12 月 19 日）持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	0.00	-
报告期间申购/买入总份额	7,886,435.33	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	7,886,435.33	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.15%	-

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
交通银行股份有限公司－华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	867,126.72	0.13	-	-

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	7,779,109.11	17,468.13	5,000,588.17	26,077.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年01月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰	2021	2022	新股锁	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-

	特	年 7 月 26 日	年 02 月 16 日	定						
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 03 月 16 日	新股锁定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	新股锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股锁定	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股锁定	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 01 月 24 日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 01 月 19 日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股锁定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301030	仕净	2021	2022	新股锁	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-

	科技	年 7 月 15 日	年 1 月 24 日	定						
301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 1 月 28 日	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 02 月 16 日	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	新股锁定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 11 日	新股锁定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰	2021	2022	新股锁	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-

	重工	年 8 月 11 日	年 02 月 28 日	定						
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股锁定	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021 年 8 月 26 日	2022 年 3 月 7 日	新股锁定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021 年 8 月 27 日	2022 年 3 月 7 日	新股锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股锁定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	新股锁定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021 年 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅	2021	2022	新股锁	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-

	股份	年 9 月 9 日	年 3 月 24 日	定						
301066	万事利	2021 年 9 月 13 日	2022 年 3 月 22 日	新股锁定	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股锁定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股锁定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 29 日	新股锁定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	新股锁定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 14 日	新股锁定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 20 日	新股锁定	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛电气	2021 年 10 月 14 日	2022 年 4 月 27 日	新股锁定	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 21 日	新股锁定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚	2021	2022	新股锁	93.09	75.34	352	32,767.68	26,519.68	-

	医疗	年 10 月 15 日	年 4 月 25 日	定						
301089	拓新药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	新股锁定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 26 日	新股锁定	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301098	金埔园林	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 12 日	新股锁定	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301149	隆华新材	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 10 日	新股锁定	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301166	优宁维	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股锁定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301188	力诺特玻	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 11 日	新股锁定	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301189	奥尼电子	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股锁定	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
601728	中国电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	新股锁定	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688280	精进电动	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 27 日	新股锁定	13.78	13.63	21,211	292,287.58	289,105.93	-
688296	和达科技	2021 年 7 月 19 日	2022 年 1 月 27 日	新股锁定	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
688722	同益	2021	2022	新股锁	4.51	10.19	3,687	16,628.37	37,570.53	-

	中	年 10 月 8 日	年 4 月 19 日	定						
688786	悦安新材	2021 年 8 月 18 日	2022 年 2 月 28 日	新股锁定	11.76	54.01	1,513	17,792.88	81,717.13	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票.

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型的证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管行中国民生银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	21,510,300.00	29,998,000.00
合计	21,510,300.00	29,998,000.00

注：未评级债券为国债和政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	175,332,000.00	126,588,000.00
合计	175,332,000.00	126,588,000.00

7.4.13.2.4 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	150,227,000.00	93,756,441.80
AAA 以下	40,168,000.00	-
未评级	368,359,200.00	285,408,623.80
合计	558,754,200.00	379,165,065.60

注：未评级债券为国债、政策性金融债和中期票据。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,779,109.11	-	-	-	7,779,109.11
结算备付金	2,780,101.46	-	-	-	2,780,101.46
存出保证金	28,056.63	-	-	2,138,313.60	2,166,370.23
交易性金融资产	331,406,500.00	383,088,000.00	41,102,000.00	126,568,760.86	882,165,260.86
应收利息	-	-	-	8,737,191.92	8,737,191.92
应收申购款	-	-	-	348,225.62	348,225.62
资产总计	341,993,767.20	383,088,000.00	41,102,000.00	137,792,492.00	903,976,259.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	413,695.46	413,695.46
应付管理人报酬	-	-	-	457,181.86	457,181.86
应付托管费	-	-	-	114,295.49	114,295.49
应付销售服务费	-	-	-	190,492.42	190,492.42
应付交易费用	-	-	-	136,654.87	136,654.87
应交税费	-	-	-	13,061.06	13,061.06
其他负债	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	-	-	-	1,525,381.16	1,525,381.16
利率敏感度缺口	341,993,767.20	383,088,000.00	41,102,000.00	136,267,110.84	902,450,878.04
上年度末 2020 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	5,000,588.17	-	-	-	5,000,588.17
结算备付金	1,118,382.92	-	-	-	1,118,382.92
存出保证金	102,582.58	-	-	3,192,314.40	3,294,896.98
交易性金融资产	270,442,465.60	4,067,600.00	261,241,000.00	134,649,141.09	670,400,206.69
买入返售金融资产	44,960,427.44	-	-	-	44,960,427.44
应收利息	-	-	-	6,152,152.43	6,152,152.43
应收申购款	-	-	-	44,594.00	44,594.00
应收证券清算款	-	-	-	795,054.91	795,054.91
资产总计	321,624,446.71	4,067,600.00	261,241,000.00	144,833,256.83	731,766,303.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	101,045.76	101,045.76
应付管理人报酬	-	-	-	333,886.35	333,886.35
应付托管费	-	-	-	83,471.61	83,471.61
应付销售服务费	-	-	-	139,119.33	139,119.33
应付交易费用	-	-	-	367,142.62	367,142.62
应交税费	-	-	-	1,393.53	1,393.53
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	1,206,059.20	1,206,059.20
利率敏感度缺口	321,624,446.71	4,067,600.00	261,241,000.00	143,627,197.63	730,560,244.34

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末 （2020 年 12 月 31 日 ）
分析	1.市场利率上升 25 个基点	-4,117,300.49	-4,187,512.46
	2.市场利率下降 25 个基点	4,192,438.26	4,256,283.60

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下和自下而上相结合”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及投资组合构建的策略；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0%-95%，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，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临

的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	126,568,760.86	14.03	134,649,141.09	18.43
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	126,568,760.86	14.03	134,649,141.09	18.43

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末 （2020 年 12 月 31 日 ）
分析	1.业绩比较基准上升 5%	14,417,211.98	17,445,033.46
	2.业绩比较基准下降 5%	-14,417,211.98	-17,445,033.46

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（a）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证

券清算款、买入返售金融资产、应收利息、应收申购款以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

（b）以公允价值计量的金融工具

（i）各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 123,702,178.52 元，属于第二层次的余额为人民币 755,602,004.49 元，属于第三层次的余额为人民币 2,861,077.85 元（于上年度末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 130,827,245.94 元，属于第二层次的余额为人民币 539,572,960.75 元，无划分为第三层次的余额）。

（ii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关证券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

（iii）第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值期末余额为人民币 2,861,077.85 元，期初余额为人民币 0.00 元，本期增加人民币 2,861,077.85 元。

（2）承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

（3）其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号-金融工具确认计量》、《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、银保监会于 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》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

除上述事项外，截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	126,568,760.86	14.00
	其中：股票	126,568,760.86	14.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	755,596,500.00	83.59
	其中：债券	755,596,500.00	83.59
	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	10,559,210.57	1.17
8	其他各项资产	11,251,787.77	1.24
9	合计	903,976,259.20	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,373,238.00	0.15
B	采矿业	1,881,823.00	0.21
C	制造业	71,893,130.38	7.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,999,993.00	0.22
E	建筑业	1,635,992.19	0.18
F	批发和零售业	46,295.34	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,683,072.00	0.41
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,495,029.88	0.61
J	金融业	29,681,511.28	3.29
K	房地产业	2,572,350.00	0.29
L	租赁和商务服务业	3,035,500.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	2,825,485.82	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	381,473.82	0.04
R	文化、体育和娱乐业	37,906.44	0.00
S	综合	-	-
	合计	126,568,760.86	14.03

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%
1	600519	贵州茅台	3,100	6,355,000.00	0.70
2	300059	东方财富	137,360	5,097,429.60	0.56
3	600036	招商银行	92,800	4,520,288.00	0.50
4	000333	美的集团	59,300	4,376,933.00	0.49
5	002142	宁波银行	88,550	3,389,694.00	0.38
6	000568	泸州老窖	10,900	2,767,183.00	0.31
7	002415	海康威视	52,600	2,752,032.00	0.30
8	600809	山西汾酒	7,760	2,450,452.80	0.27
9	600887	伊利股份	54,500	2,259,570.00	0.25
10	601318	中国平安	38,100	1,920,621.00	0.21
11	000858	五 粮 液	8,600	1,914,876.00	0.21
12	002241	歌尔股份	35,300	1,909,730.00	0.21
13	601006	大秦铁路	284,500	1,820,800.00	0.20
14	600436	片仔癀	4,100	1,792,315.00	0.20
15	000739	普洛药业	50,600	1,775,554.00	0.20
16	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.19
17	603259	药明康德	14,100	1,671,978.00	0.19
18	000776	广发证券	66,600	1,637,694.00	0.18
19	601628	中国人寿	54,400	1,636,896.00	0.18
20	002027	分众传媒	196,500	1,609,335.00	0.18
21	601838	成都银行	133,200	1,598,400.00	0.18
22	600741	华域汽车	56,300	1,593,290.00	0.18
23	300750	宁德时代	2,600	1,528,800.00	0.17
24	601009	南京银行	168,200	1,507,072.00	0.17
25	601633	长城汽车	30,600	1,485,324.00	0.16
26	002049	紫光国微	6,400	1,440,000.00	0.16
27	601888	中国中免	6,500	1,426,165.00	0.16
28	300274	阳光电源	9,700	1,414,260.00	0.16
29	300450	先导智能	18,700	1,390,719.00	0.15
30	000063	中兴通讯	41,500	1,390,250.00	0.15
31	300498	温氏股份	71,300	1,373,238.00	0.15

32	600332	白云山	39,300	1,344,060.00	0.15
33	300373	扬杰科技	19,900	1,336,882.00	0.15
34	001965	招商公路	168,400	1,291,628.00	0.14
35	600030	中信证券	47,800	1,262,398.00	0.14
36	600111	北方稀土	26,700	1,222,860.00	0.14
37	601328	交通银行	259,700	1,197,217.00	0.13
38	600570	恒生电子	18,800	1,168,420.00	0.13
39	002475	立讯精密	22,899	1,126,630.80	0.12
40	601229	上海银行	155,200	1,106,576.00	0.12
41	002230	科大讯飞	20,600	1,081,706.00	0.12
42	600406	国电南瑞	27,000	1,080,810.00	0.12
43	002594	比亚迪	4,000	1,072,480.00	0.12
44	002236	大华股份	45,400	1,065,992.00	0.12
45	300363	博腾股份	11,900	1,064,455.00	0.12
46	600900	长江电力	46,800	1,062,360.00	0.12
47	600383	金地集团	75,800	983,126.00	0.11
48	002129	中环股份	21,800	910,150.00	0.10
49	300014	亿纬锂能	7,700	909,986.00	0.10
50	000001	平安银行	54,000	889,920.00	0.10
51	601688	华泰证券	49,400	877,344.00	0.10
52	002304	洋河股份	5,200	856,596.00	0.09
53	600884	杉杉股份	25,800	845,466.00	0.09
54	601800	中国交建	96,700	829,686.00	0.09
55	002821	凯莱英	1,900	826,500.00	0.09
56	601186	中国铁建	102,500	799,500.00	0.09
57	603678	火炬电子	10,000	756,500.00	0.08
58	002407	多氟多	16,600	746,834.00	0.08
59	000733	振华科技	6,000	745,680.00	0.08
60	000002	万 科A	36,800	727,168.00	0.08
61	300759	康龙化成	5,100	720,477.00	0.08
62	002179	中航光电	6,800	683,808.00	0.08
63	002202	金风科技	40,200	662,094.00	0.07
64	000338	潍柴动力	36,600	654,774.00	0.07
65	601211	国泰君安	35,700	638,673.00	0.07
66	300327	中颖电子	9,400	638,260.00	0.07
67	600483	福能股份	38,600	628,408.00	0.07
68	603799	华友钴业	5,600	617,736.00	0.07
69	600438	通威股份	13,600	611,456.00	0.07
70	002756	永兴材料	4,100	606,882.00	0.07
71	601377	兴业证券	61,200	604,656.00	0.07
72	603986	兆易创新	3,300	580,305.00	0.06
73	600919	江苏银行	99,300	578,919.00	0.06

74	603659	璞泰来	3,600	578,196.00	0.06
75	600309	万华化学	5,700	575,700.00	0.06
76	600958	东方证券	39,000	574,860.00	0.06
77	000069	华侨城 A	81,600	574,464.00	0.06
78	600456	宝钛股份	8,000	574,240.00	0.06
79	601166	兴业银行	30,100	573,104.00	0.06
80	600377	宁沪高速	66,200	570,644.00	0.06
81	002531	天顺风能	28,900	560,371.00	0.06
82	601012	隆基股份	6,460	556,852.00	0.06
83	600110	诺德股份	34,700	553,465.00	0.06
84	601899	紫金矿业	55,700	540,290.00	0.06
85	002080	中材科技	15,800	537,516.00	0.06
86	600660	福耀玻璃	10,700	504,398.00	0.06
87	000930	中粮科技	45,400	493,498.00	0.05
88	002088	鲁阳节能	18,740	487,240.00	0.05
89	600600	青岛啤酒	4,700	465,300.00	0.05
90	601636	旗滨集团	26,100	446,310.00	0.05
91	601677	明泰铝业	9,400	414,446.00	0.05
92	600010	包钢股份	146,600	409,014.00	0.05
93	002709	天赐材料	3,500	401,275.00	0.04
94	300685	艾德生物	5,300	400,203.00	0.04
95	600585	海螺水泥	9,800	394,940.00	0.04
96	300347	泰格医药	3,000	383,400.00	0.04
97	300496	中科创达	2,700	373,734.00	0.04
98	002048	宁波华翔	17,200	372,036.00	0.04
99	601857	中国石油	75,000	368,250.00	0.04
100	300015	爱尔眼科	8,593	363,312.04	0.04
101	002460	赣锋锂业	2,500	357,125.00	0.04
102	600028	中国石化	81,800	346,014.00	0.04
103	600703	三安光电	9,200	345,552.00	0.04
104	601225	陕西煤业	28,100	342,820.00	0.04
105	603185	上机数控	2,000	333,960.00	0.04
106	603019	中科曙光	11,800	325,326.00	0.04
107	002497	雅化集团	11,200	320,992.00	0.04
108	601016	节能风电	47,500	309,225.00	0.03
109	688280	精进电动	21,211	289,105.93	0.03
110	600048	保利发展	18,400	287,592.00	0.03
111	601168	西部矿业	20,900	284,449.00	0.03
112	002158	汉钟精机	10,300	274,289.00	0.03
113	002601	龙佰集团	9,200	263,028.00	0.03
114	300035	中科电气	8,200	248,050.00	0.03
115	000425	徐工机械	40,600	243,194.00	0.03

116	000708	中信特钢	11,700	239,616.00	0.03
117	002648	卫星化学	5,800	232,174.00	0.03
118	002812	恩捷股份	900	225,360.00	0.02
119	600582	天地科技	51,100	223,818.00	0.02
120	600141	兴发集团	3,000	113,640.00	0.01
121	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.01
122	688786	悦安新材	1,513	81,717.13	0.01
123	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.01
124	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
125	688722	同益中	3,687	37,570.53	0.00
126	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
127	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
128	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
129	301087	可孚医疗	352	26,519.68	0.00
130	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
131	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
132	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
133	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
134	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
135	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
136	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
137	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
138	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
139	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
140	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
141	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
142	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
143	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
144	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
145	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
146	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
147	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
148	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
149	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
150	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
151	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
152	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
153	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
154	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
155	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
156	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
157	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00

158	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
159	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
160	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
161	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
162	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
163	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
164	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
165	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
166	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
167	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
168	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
169	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
170	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
171	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
172	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
173	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
174	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
175	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
176	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
177	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
178	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
179	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002142	宁波银行	7,555,888.97	1.03
2	600519	贵州茅台	5,566,084.00	0.76
3	000002	万 科 A	5,083,694.90	0.70
4	000333	美的集团	3,984,493.00	0.55
5	600030	中信证券	3,903,384.00	0.53
6	600048	保利发展	3,891,669.00	0.53
7	603259	药明康德	3,884,960.81	0.53
8	000858	五粮液	3,873,459.00	0.53
9	000568	泸州老窖	3,870,605.00	0.53
10	300059	东方财富	3,696,529.40	0.51
11	002714	牧原股份	3,604,685.00	0.49
12	601318	中国平安	3,600,392.00	0.49
13	000001	平安银行	3,379,504.40	0.46
14	002415	海康威视	3,161,984.00	0.43
15	600036	招商银行	3,105,160.00	0.43

16	600809	山西汾酒	3,091,310.00	0.42
17	002049	紫光国微	3,064,139.00	0.42
18	601006	大秦铁路	3,016,848.00	0.41
19	601009	南京银行	2,994,354.00	0.41
20	601328	交通银行	2,881,713.00	0.39

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 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	601318	中国平安	6,692,352.00	0.92
2	000002	万 科 A	6,575,317.13	0.90
3	600519	贵州茅台	6,226,272.00	0.85
4	000001	平安银行	4,818,846.70	0.66
5	601012	隆基股份	4,682,231.00	0.64
6	000858	五粮液	4,646,339.00	0.64
7	601166	兴业银行	4,104,996.00	0.56
8	002142	宁波银行	4,078,057.00	0.56
9	300059	东方财富	4,053,890.98	0.55
10	000725	京东方 A	3,863,234.00	0.53
11	600030	中信证券	3,826,574.00	0.52
12	601328	交通银行	3,533,945.00	0.48
13	601398	工商银行	3,489,571.94	0.48
14	002594	比亚迪	3,465,558.57	0.47
15	600048	保利发展	3,449,741.00	0.47
16	000661	长春高新	3,391,376.00	0.46
17	601377	兴业证券	3,320,475.04	0.45
18	002049	紫光国微	3,268,859.00	0.45
19	600000	浦发银行	3,194,701.00	0.44
20	600031	三一重工	3,099,159.00	0.42

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	338,993,960.22
卖出股票收入（成交）总额	375,058,886.39

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 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	42,602,300.00	4.72

2	央行票据	-	-
3	金融债券	357,270,200.00	39.59
	其中：政策性金融债	327,159,200.00	36.25
4	企业债券	10,075,000.00	1.12
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	170,317,000.00	18.87
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	175,332,000.00	19.43
9	其他	-	-
10	合计	755,596,500.00	83.73

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	112105246	21 建设银行 CD246	1,000,000	97,420,000.00	10.80
2	092118003	21 农发清发 03	800,000	80,056,000.00	8.87
3	112110436	21 兴业银行 CD436	800,000	77,912,000.00	8.63
4	210213	21 国开 13	600,000	60,414,000.00	6.69
5	210312	21 进出 12	500,000	50,385,000.00	5.58

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代　码	名　称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2201	IF2201	-3	-4,452,660.00	112,080.00	-
IF2203	IF2203	-9	-13,366,620.00	-200,640.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-88,560.00
股指期货投资本期收益（元）					-1,659,540.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					1,013,760.00

注：注：持仓量和合约市值的负数代表产品投资的期货为空头。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要利用股指期货进行套期保值或仓位调节操作。当进行空头套期保值时，基金持有的卖出股指期货合约价值，不超过基金持有的股票总市值的 20%，基金通过空头套期保值，一定程度上可以规避市场的系统性风险。当进行多头仓位调节时，基金持有的买入股指期货合约价值，不超过基金资产净值的 10%，基金通过持有股指期货多头合约对股票资产进行替代，可以提高投资效率，赚取或有的基差收益和实现更好的头寸管理。截止报告期末，本基金对股指期货的投资符合基金合同的约定，符合既定的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.12 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

新起点灵活配置基金截至 2021 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的 21 建设银行 CD246(112105246)的发行人中国建设银行股份有限公司因存在以下行为：1.占压财政存款或者资金；2.违反账户管理规定，于 2021 年 8 月 13 日收到中国人民银行警告并处罚款 388 万元的行政处罚措施。

新起点灵活配置基金截至 2021 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的 21 兴业银行 CD436(112110436)的发行人兴业银行股份有限公司因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，于 2021 年 8 月 13 日收到中国人民银行处罚款 5 万元的行政处罚措施。

新起点灵活配置基金截至 2021 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的 21 招商银行小微债 03(2128027)的发行人发行人招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 21 日公告，因公司存在以下违规行为：一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品

准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息；于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 7170 万元的处罚。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.13.3 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	2,166,370.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,737,191.92
5	应收申购款	348,225.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,251,787.77

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 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。

8.13.6 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，合计数可能不等于分项之和。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
42,503	16,119.33	624,531,721.99	91.16	60,588,165.32	8.84

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	145,730.42	0.0213

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 12 月 19 日）基金份额总额	200,056,202.54
本报告期期初基金份额总额	586,535,472.75
本报告期基金总申购份额	532,689,261.38
减：本报告期基金总赎回份额	434,104,846.82
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	685,119,887.31

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

2021 年 8 月 25 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，李慧勇不再担任公司副总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2021 年 11 月 19 日公告，根据工作需要，任命崔岩女士担任本公司资产托管部总经理，负责资产托管部相关工作。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 80,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：2019 年 11 月 20 日起至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期内，本基金管理人及相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

2、本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	349,693,383.69	50.51%	325,670.33	51.05%	-

中信证券	2	291,776,406.20	42.15%	265,895.67	41.68%	-
东方证券	1	50,843,074.95	7.34%	46,333.20	7.26%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：1.基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准： 资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2.本期交易单元未发生变化。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	28,755,575.67	98.58%	400,300,000.00	100.00%	-	-
中信证券	413,108.39	1.42%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2021-1-22
2	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	基金管理人网站,中国证券报	2021-1-23
3	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	基金管理人网站,中国证券报	2021-2-2
4	华宝基金关于华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金新增中国人寿为代	基金管理人网站,中国证券报	2021-2-8

	销机构并参加中国人寿费率优惠活动的公告		
5	华宝现金添益交易型货币市场基金 B 类基金份额开放转换业务的公告	基金管理人网站,上海证券报,证券日报,证券时报,中国证券报	2021-2-26
6	华宝基金管理有限公司华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	基金管理人网站,中国证券报	2021-3-5
7	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-3-9
8	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2021-3-9
9	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	基金管理人网站,中国证券报	2021-3-12
10	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站	2021-3-31
11	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2021-4-22
12	华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回及转换业务的公告	基金管理人网站,上海证券报,证券日报,证券时报,中国证券报	2021-5-18
13	华宝资源优选混合型证券投资基金 C 类基金份额开放转换业务及开通定期定额投资业务的公告	基金管理人网站,上海证券报,证券日报,证券时报,中国证券报	2021-5-18
14	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金在上海万得投资顾问有限公司恢复大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	基金管理人网站,中国证券报	2021-6-1
15	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金在诺亚正行基金销售有限公司恢复大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	基金管理人网站,中国证券报	2021-6-8
16	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金在直销机构恢复大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	基金管理人网站,中国证券报	2021-6-17
17	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	基金管理人网站,上海证券报,证券日报,证券时报,中国证券报	2021-6-23
18	华宝基金关于旗下部分基金增加招商银行招赢通为销售平台并参加招商银行招赢通平台费率优惠活动的公告	基金管理人网站,上海证券报,证券日报,证券时报,中国证券报	2021-7-16
19	华宝新起点灵活配置混合型证券投资	基金管理人网站	2021-7-21

	基金 2021 年第 2 季度报告		
20	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增招商银行为代销机构的公告	基金管理人网站,上海证券报,证券日报,证券时报,中国证券报	2021-7-22
21	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加利得基金为代销机构及费率优惠的公告	基金管理人网站,上海证券报,证券日报,证券时报,中国证券报	2021-8-18
22	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告	基金管理人网站	2021-8-27
23	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金在直销机构、上海万得投资顾问有限公司、诺亚正行基金销售有限公司暂停大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	基金管理人网站,中国证券报	2021-9-9
24	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	基金管理人网站,中国证券报	2021-10-22
25	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2021-10-27
26	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	基金管理人网站,中国证券报	2021-11-16
27	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-12-7
28	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2021-12-7

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20210113~20210127,20210225~20210316,20210319~20210511	108,019,560.65	-	108,019,560.65	-	-
产品特有风险							

报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。
在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同；

华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金招募说明书；

华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

13.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

13.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日