# 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
# 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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，普华永道中天会计师事务所（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 ..... 6
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 ..... 8
3.3 其他指标 ..... 11
3.4 过去三年基金的利润分配情况 ..... 11

**§4 管理人报告 ..... 11**

4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 14
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 ..... 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 ..... 17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 18
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 ..... 18
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 ..... 18

**§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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 ..... 19

**§6 审计报告 ..... 19**

6.1 审计报告基本信息 ..... 19
6.2 审计报告的基本内容 ..... 19

**§7 年度财务报表 ..... 21**

7.1 资产负债表 ..... 21
7.2 利润表 ..... 22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 ..... 23

7.4 报表附注 25

**§8 投资组合报告 58**

8.1 期末基金资产组合情况 58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 58
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 59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 65
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 65
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 65
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 65
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 65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 66
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 66
8.13 投资组合报告附注 66

**§9 基金份额持有人信息 68**

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 68
9.2 期末上市基金前十名持有人 68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 69
9.4 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 69

**§10 开放式基金份额变动 69**

**§11 重大事件揭示 70**

11.1 基金份额持有人大会决议 70
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 70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 70
11.4 基金投资策略的改变 70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 70
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 70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 70
11.8 其他重大事件 74

**§12 影响投资者决策的其他重要信息 76**

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 76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 76

**§13 备查文件目录 76**

13.1 备查文件目录 76
13.2 存放地点 76
13.3 查阅方式 76

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF） | |
| 基金简称 | 华宝新机遇混合 | |
| 场内简称 | 新机遇 LOF | |
| 基金主代码 | 162414 | |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式（LOF） | |
| 基金合同生效日 | 2015 年 6 月 11 日 | |
| 基金管理人 | 华宝基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 551,017,751.35 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 | |
| 上市日期 | 2015 年 7 月 1 日 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 新机遇 | 华宝新机遇混合 C |
| 下属分级基金的场内简称 | 新机遇 LOF | - |
| 下属分级基金的交易代码 | 162414 | 003144 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 139,626,508.99 份 | 411,391,242.36 份 |

## 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，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大 |

| | |
|---|---|
| | 类资产配置比例。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 | 1 年期银行定期存款基准利率（税后）＋3% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金,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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周雷 | 李申 |
| | 联系电话 | 021-38505888 | 021-60637102 |
| | 电子邮箱 | xxpl@fsfund.com | lishen.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-5588、400-820-5050 | 021-60637111 |
| 传真 | | 021-38505777 | 021-60635778 |
| 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 | 北京市西城区金融大街 25 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 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | | XIAOYI HELEN HUANG | 田国立 |

## 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 | 上海证券报 |
| 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 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人 | 北京市西城区太平桥大街 17 号、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. | 2021 年 | 2020 年 | 2019 年 |
|---|---|---|---|

| 1 期间数据和指标 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 新机遇 | 华宝新机遇混合 C | 新机遇 | 华宝新机遇混合 C | 新机遇 | 华宝新机遇混合 C |
| 本期已实现收益 | 18,516,118.57 | 40,709,002.16 | 12,113,708.26 | 57,690,559.77 | 8,913,620.16 | 18,750,706.56 |
| 本期利润 | 14,152,444.52 | 33,344,625.47 | 15,881,913.16 | 68,785,442.82 | 13,738,189.52 | 26,915,321.77 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0947 | 0.0926 | 0.2387 | 0.2662 | 0.2078 | 0.1917 |
| 本期加权平均净值利润率 | 5.91% | 5.80% | 16.54% | 18.60% | 16.98% | 15.35% |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.24% | 6.13% | 18.30% | 18.18% | 17.75% | 17.63% |
| 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 | 84,190,955.08 | 244,489,244.06 | 63,295,576.36 | 157,127,075.22 | 14,768,211.04 | 41,728,805.92 |
| 期末可供分配基金份额 | 0.6030 | 0.5943 | 0.4810 | 0.4745 | 0.2690 | 0.2647 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 利润 | | | | | | |
| 期末基金资产净值 | 229,803,660.82 | 673,460,762.03 | 203,855,526.93 | 510,757,180.77 | 71,891,230.51 | 205,748,828.10 |
| 期末基金份额净值 | 1.6458 | 1.6370 | 1.5492 | 1.5424 | 1.3095 | 1.3051 |
| 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 | 64.58% | 54.71% | 54.92% | 45.77% | 30.95% | 23.34% |

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

新机遇

| 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 | 1.19% | 0.10% | 1.13% | 0.01% | 0.06% | 0.09% |
| 过去六个月 | 2.26% | 0.15% | 2.27% | 0.01% | -0.01% | 0.14% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一年 | 6.24% | 0.20% | 4.50% | 0.01% | 1.74% | 0.19% |
| 过去三年 | 47.99% | 0.32% | 13.50% | 0.01% | 34.49% | 0.31% |
| 过去五年 | 53.81% | 0.34% | 22.50% | 0.01% | 31.31% | 0.33% |
| 自基金合同生效起至今 | 64.58% | 0.30% | 29.68% | 0.01% | 34.90% | 0.29% |

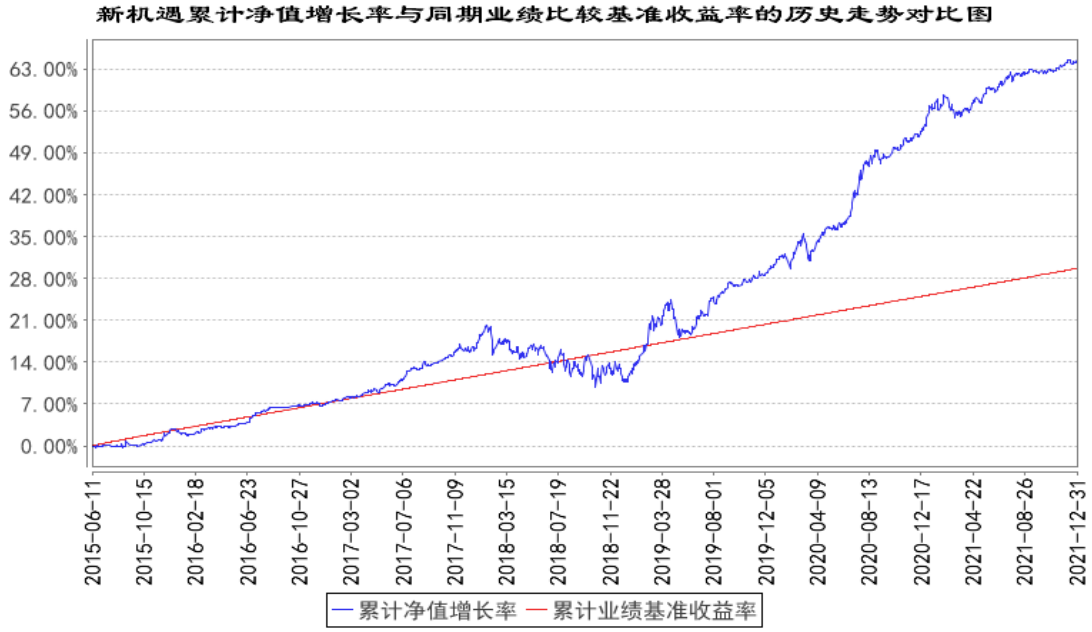
华宝新机遇混合 C

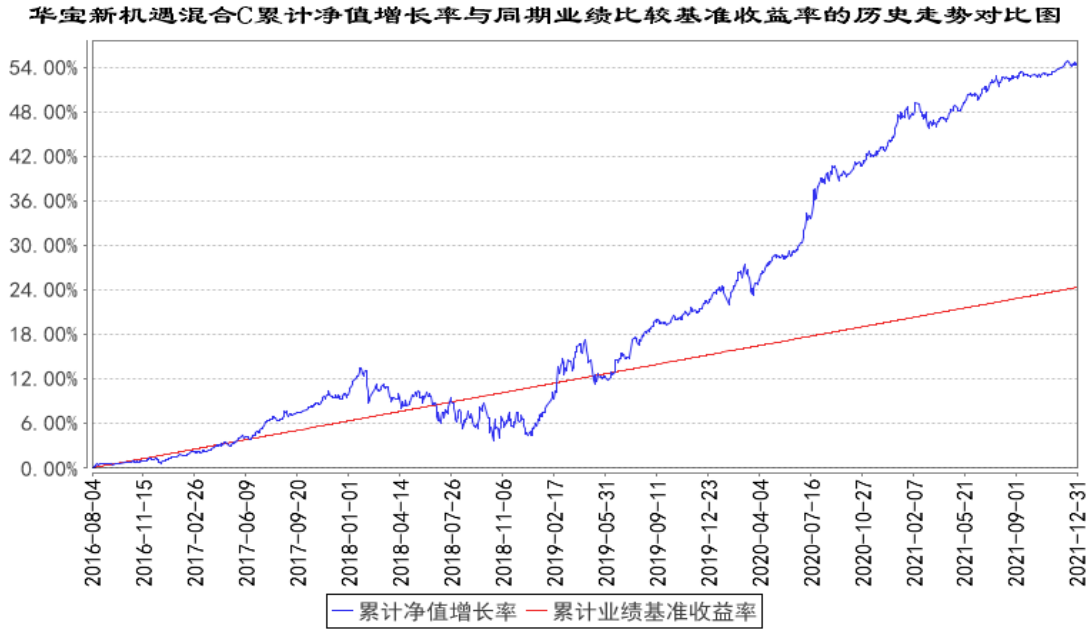
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.17% | 0.10% | 1.13% | 0.01% | 0.04% | 0.09% |
| 过去六个月 | 2.20% | 0.15% | 2.27% | 0.01% | -0.07% | 0.14% |
| 过去一年 | 6.13% | 0.20% | 4.50% | 0.01% | 1.63% | 0.19% |
| 过去三年 | 47.54% | 0.32% | 13.50% | 0.01% | 34.04% | 0.31% |
| 过去五年 | 53.05% | 0.34% | 22.50% | 0.01% | 30.55% | 0.33% |
| 自基金合同生效起至今 | 54.71% | 0.33% | 24.35% | 0.01% | 30.36% | 0.32% |

注：（1）基金业绩基准：1 年期银行定期存款基准利率（税后）＋3%；

（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）。

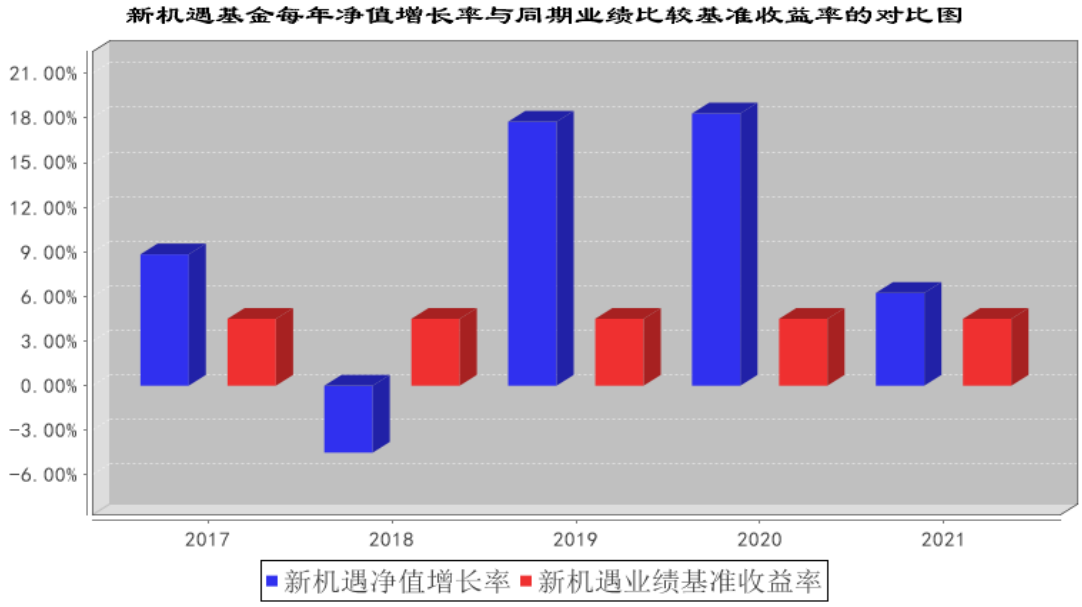
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

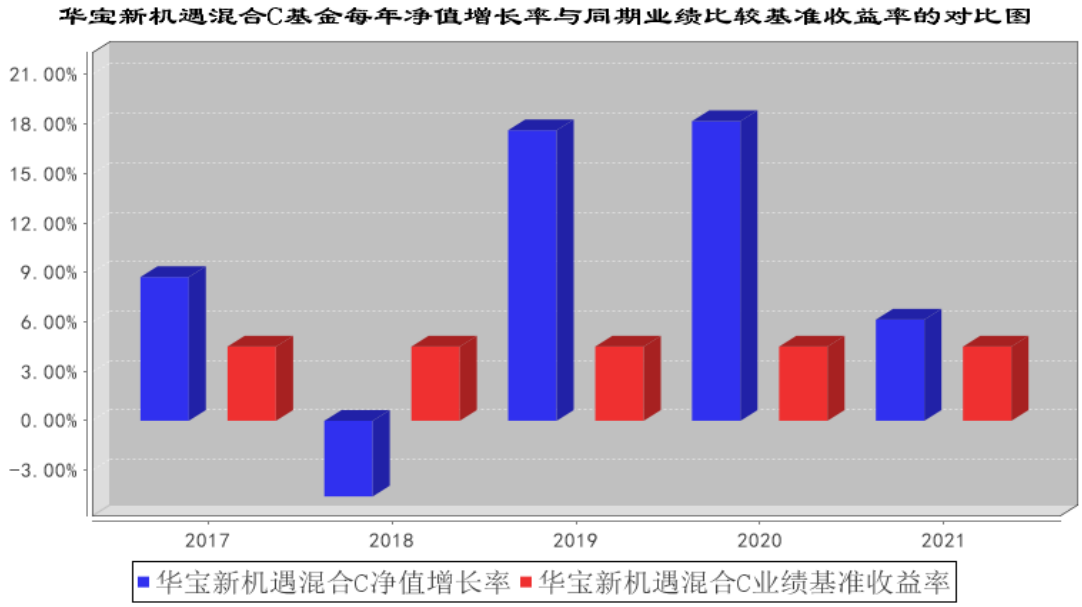



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2015 年 12 月 11 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

### 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 其他指标

## 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

# §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 | | |
| 林昊 | 本基金基金经理 | 2017-03-17 | - | 16 年 | 大学学士。2006 年 5 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任渠道经理、交易员、高级交易员、基金经理助理等职务。2017 年 3 月起任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新活力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)基金经理，2017 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 年 12 月至 2018 年 12 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 12 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 12 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，2018 年 8 月至 2021 年 3 月任华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 11 月起任华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起任华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 9 月起任华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月起任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理，2021 年 9 月起任华宝安益混合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、《华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 年国内宏观经济在疫情后展开复苏，但增速呈现逐季弱化的态势，具体表现为：一、二季度 GDP 同比增速分别为 18.3%和 7.9%，三、四季度单季同比增速降至 4.9%和 4.0%，全年累计实现增长 8.1%，较 2020 年提升了 5.8 个百分点。从支出法来看，固定资产投资 2021 年累计同比增长 4.9%，较上年加快 2 个百分点，其中制造业投资累计同比增长 13.5%，基建投资（不含电力等）同比增长 0.4%，房地产开发投资同比增长 4.4%；全年社会消费品零售总额累计同比增长 12.5%，但 12 月社会消费品零售总额单月同比增速回落至 1.7%，显示居民消费意愿仍弱；以美元计，全

年出口同比增长 29.9%，进口增长 30.1%，实现贸易顺差 6764 亿美元，续创 2016 年以来的新高。金融数据方面，由于超常规货币政策的退出叠加实体融资需求偏弱，使得新增社会融资规模以及社融存量增速较上一年均有回落，其中社融累计新增 31.35 万亿元，同比增速为 10.3%，全年人民币贷款增加 19.95 万亿元，广义货币 M2 余额同比增长 9.0%，增速比上年同期低 1.1 个百分点。物价水平有所分化，受猪肉价格下降与疫情零星反复影响，全年 CPI 累计同比增长 0.9%，较上年回落 1.6 个百分点，而 PPI 同比则由去年的-1.8%大幅上升至 8.1%，海外疫情扰动和供给端冲击，是生产资料价格上升的主要因素。

货币政策全年来看稳中有宽，央行分别于 7 月和 12 月实施降准各 0.5 个百分点，共释放 2.2 万亿元流动性，同时在年初增加了 2000 亿元再贷款额度，9 月增加 3000 亿元支小再贷款额度，11 月推出碳减排支持工具和 2000 亿元支持煤炭清洁高效利用专项再贷款。财政政策有所后置，表现为地方债发行呈现前慢后快的特征，2021 年全年合计发行地方债 7.48 万亿元，新增专项债实际发行 3.58 万亿元，下半年专项债发行进度加快，稳增长力度有所提升。债券市场收益率总体呈现先上后下的走势，年初在海外通胀预期上升背景下债市短期调整，但随着市场配置需求发力，叠加央行货币政策的宽松，市场收益率震荡下行，1 年期国债从年初 2.82%上行至 2 月初的 2.92%，随后一路降至年末的 2.24%，10 年期国开从 3.53%上行至 3.75%，随后下行至 3.08%附近。权益市场宽幅震荡、风格分化显著，年初在食品饮料、医药等行业带动下指数冲高回落，二季度伊始，在碳中和大背景下光伏、新能源车等行业受到市场资金青睐，估值出现大幅度提升，全年来看，中小市值风格领先大盘风格。

新机遇混合型基金全年维持了较高的债券投资比例和组合久期，权益仓位较去年末小幅下降，在市场波动中，实现了净值的增长。本基金将继续保持较高的债券投资比例，并且积极参与新股网下申购来提高收益，本基金始终坚持绝对收益的投资目标。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 净值增长率为 6.24%，本报告期基金份额 C 净值增长率为 6.13%;同期业绩比较基准收益率为 4.50%。

## 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，我国所面临的供给端冲击和需求端走弱的矛盾仍将在短期内影响经济复苏动能，但考虑到宏观政策边际宽松，稳增长力度加大，全年各季度经济增速将在基数背景下呈现前低后稳的态势。货币政策强调“以我为主”，灵活精准、合理适度，流动性保持合理充裕，财政政策前置、专项债项目加快落地有助于拉动国内投资反弹，结构性减税降费等政策也将促进市场活

跃度的提升。美联储加息和缩表的节奏，是影响外部流动性和风险偏好变化的主要因素，地缘政治矛盾也可能会对大宗商品的价格构成短期冲击。债券市场受国内外经济和宏观政策的影响，总体料将呈现宽幅震荡，中枢较 2021 年有所下行，当前位置的长端利率品大幅向上和向下的空间均较为有限。信用方面，仍需密切关注中低等级发行主体的财务状况，资质较差的主体仍有利差走扩的空间。权益市场波动加大，特别是过去三年估值得到大幅提升的行业和板块，受到外部环境变化的压力较大，但在人民币国际化、金融市场对外开放的背景下，股市仍有望吸引海外资金的关注。

## 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

无

## 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 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。

# §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 | 普华永道中天审字(2022)第 22824 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 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | （一）我们审计的内容<br>我们审计了华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“华宝新机遇混合基金”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。<br>（二）我们的意见<br>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 |

| | |
|---|---|
| | (以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了华宝新机遇混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 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。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。<br>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华宝新机遇混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。 |
| 强调事项 | 不适用 |
| 其他事项 | 不适用 |
| 其他信息 | 不适用 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 华宝新机遇混合基金的基金管理人华宝基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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。<br>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华宝新机遇混合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，除非基金管理人管理层计划清算华宝新机遇混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。<br>基金管理人治理层负责监督华宝新机遇混合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。<br>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：<br>(一) 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。<br>(二) 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。<br>(三) 评价基金管理人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。<br>(四) 对基金管理人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机遇混合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机遇混合基金不能持续经营。<br>(五) 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。<br>我们与基金管理人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 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | |
| 注册会计师的姓名 | 陈熹 | 林佳璐 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市 | |
| 审计报告日期 | 2022 年 3 月 25 日 | |

# §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 8,358,991.52 | 24,880,685.63 |
| 结算备付金 | | 5,220,072.68 | 2,376,566.53 |
| 存出保证金 | | 2,151,530.36 | 3,063,314.51 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 841,866,887.14 | 621,361,914.79 |
| 其中：股票投资 | | 124,722,717.14 | 134,877,375.39 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 717,144,170.00 | 486,484,539.40 |
| 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 | 37,000,000.00 | 80,700,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 542,829.95 | 249,276.45 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 8,926,550.27 | 5,689,911.42 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 419,620.76 | 759,120.58 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 904,486,482.68 | 739,080,789.91 |
| **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 | | - | 23,154,221.50 |
| 应付赎回款 | | 106,697.50 | 274,850.60 |
| 应付管理人报酬 | | 460,634.52 | 339,282.74 |
| 应付托管费 | | 191,931.04 | 141,367.81 |
| 应付销售服务费 | | 57,315.15 | 41,266.46 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 229,503.18 | 341,093.65 |
| 应交税费 | | 5,689.57 | 5,690.07 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 170,288.87 | 170,309.38 |
| 负债合计 | | 1,222,059.83 | 24,468,082.21 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 551,017,751.35 | 462,738,628.07 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 352,246,671.50 | 251,874,079.63 |
| 所有者权益合计 | | 903,264,422.85 | 714,612,707.70 |
| 负债和所有者权益总计 | | 904,486,482.68 | 739,080,789.91 |

注： 报告截止日 2021 年 12 月 31 日,基金份额总额 551,017,751.35 份，其中新机遇基金份额总额 139,626,508.99 份，基金份额净值 1.6458 元；华宝新机遇混合 C 基金份额总额 411,391,242.36 份，基金份额净值 1.6370 元。

## 7.2 利润表

会计主体：华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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 | | 56,628,654.82 | 90,812,356.67 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 1.利息收入 | | 19,863,103.20 | 10,724,946.68 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 249,462.55 | 174,064.06 |
| 债券利息收入 | | 18,830,220.05 | 9,619,077.86 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 783,420.60 | 931,804.76 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 48,212,432.92 | 65,186,463.94 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 44,801,658.35 | 74,416,467.77 |
| 基金投资收益 | - | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 3,665,231.86 | -4,288,551.73 |
| 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 | -1,673,460.00 | -6,354,933.20 |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 1,419,002.71 | 1,413,481.10 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | -11,728,050.74 | 14,863,087.95 |
| 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 | 281,169.44 | 37,858.10 |
| 减：二、费用 | | 9,131,584.83 | 6,145,000.69 |
| 1．管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 4,879,633.06 | 2,784,403.59 |
| 2．托管费 | 7.4.10.2.2 | 2,033,180.45 | 1,160,168.18 |
| 3．销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 573,818.80 | 367,816.23 |
| 4．交易费用 | 7.4.7.19 | 1,353,528.24 | 1,267,321.82 |
| 5．利息支出 | | 4,681.38 | 269,929.99 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 4,681.38 | 269,929.99 |
| 6．税金及附加 | | 8,972.07 | 16,129.46 |
| 7．其他费用 | 7.4.7.20 | 277,770.83 | 279,231.42 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 47,497,069.99 | 84,667,355.98 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 47,497,069.99 | 84,667,355.98 |

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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<br>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） | 462,738,628.07 | 251,874,079.63 | 714,612,707.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 47,497,069.99 | 47,497,069.99 |
| 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） | 88,279,123.28 | 52,875,521.88 | 141,154,645.16 |
| 其中：1.基金申购款 | 385,856,038.58 | 232,271,036.47 | 618,127,075.05 |
| 2.基金赎回款 | -297,576,915.30 | -179,395,514.59 | -476,972,429.89 |
| 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） | 551,017,751.35 | 352,246,671.50 | 903,264,422.85 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>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、期初所有者权益（基金净值） | 212,555,127.01 | 65,084,931.60 | 277,640,058.61 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 84,667,355.98 | 84,667,355.98 |
| 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） | 250,183,501.06 | 102,121,792.05 | 352,305,293.11 |
| 其中：1.基金申购款 | 367,848,106.69 | 149,367,836.13 | 517,215,942.82 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 2.基金赎回款 | -117,664,605.63 | -47,246,044.08 | -164,910,649.71 |
| 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） | 462,738,628.07 | 251,874,079.63 | 714,612,707.70 |

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

华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原名为华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)，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 801 号《关于准予华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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《华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,437,765,787.61 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2015)验字第 60737318_B27 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于 2015 年 6 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,438,056,502.93 份基金份额，其中认购资金利息折合 290,715.32 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《关于华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》及更新后的《华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》，自 2016 年 8 月 4 日起，本基金增设 C 类基金份额。本基金根据销售服务费及申购费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。A 类基金份额和 C

类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别。投资人可通过场内、场外两种渠道申购与赎回 A 类基金份额；可通过场外渠道申购与赎回 C 类基金份额。A 类基金份额参与上市交易，C 类基金份额不参与上市交易。

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》，华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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)、固定收益品种和货币市场工具(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(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款、大额存单等)、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。本基金的投资组合比例为：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：1 年期银行定期存款基准利率(税后)+3%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2022 年 3 月 25 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“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》、《华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

### 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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[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》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融　房地产开发　教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)　资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

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

## 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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 8,358,991.52 | 24,880,685.63 |
| 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 | 8,358,991.52 | 24,880,685.63 |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 115,488,283.06 | 124,722,717.14 | 9,234,434.08 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 854,460.00 | 901,170.00 | 46,710.00 |
| | 银行间市场 | 711,365,195.41 | 716,243,000.00 | 4,877,804.59 |
| | 合计 | 712,219,655.41 | 717,144,170.00 | 4,924,514.59 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 827,707,938.47 | 841,866,887.14 | 14,158,948.67 |
| 项目 | | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 | | |
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 108,934,839.87 | 134,877,375.39 | 25,942,535.52 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 2,618,240.21 | 2,626,739.40 | 8,499.19 |
| | 银行间市场 | 483,075,355.30 | 483,857,800.00 | 782,444.70 |
| | 合计 | 485,693,595.51 | 486,484,539.40 | 790,943.89 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 594,628,435.38 | 621,361,914.79 | 26,733,479.41 |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>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 | -17,680,560.00 | - | - | - |
| 其中：股指期货投资 | -17,680,560.00 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | -17,680,560.00 | - | - | - |

| 项目 | 上年度末<br>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 | -24,054,480.00 | - | - | - |
| 其中：股指期货投资 | -24,054,480.00 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | -24,054,480.00 | - | - | - |

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 0。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合约产生的持仓损益，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 0。于本报告期末，本基金持有 5 手 IF2201 空头持仓，合约市值为-7,421,100.00 元，公允价值变动 185,040.00 元，抵销相关期货暂收款-185,040.00 元后的净额为 0；本基金持有 7 手 IF2203 空头持仓，合约市值为-10,396,260.00 元，公允价值变动-321,840.00 元，抵销相关期货暂收款 321,840.00 元后的净额为 0。

### 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<br>2021 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 37,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 37,000,000.00 | - |
| 项目 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 80,700,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 80,700,000.00 | - |

#### 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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应收活期存款利息 | 559.42 | 1,005.23 |
| 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 | 30,604.60 | 1,623.79 |
| 应收债券利息 | 8,892,502.52 | 5,666,565.47 |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | 2,877.09 | 19,563.01 |
| 应收申购款利息 | 0.04 | 1,124.88 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 应收出借证券利息 | - | - |
| 其他 | 6.60 | 29.04 |
| 合计 | 8,926,550.27 | 5,689,911.42 |

### 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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 221,357.69 | 336,806.36 |

| | | |
|---|---|---|
| 银行间市场应付交易费用 | 8,145.49 | 4,287.29 |
| 合计 | 229,503.18 | 341,093.65 |

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 288.87 | 309.38 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 预提费用 | 170,000.00 | 170,000.00 |
| 合计 | 170,288.87 | 170,309.38 |

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

新机遇

| 项目 | 本期<br>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 | 131,591,841.76 | 131,591,841.76 |
| 本期申购 | 77,271,988.24 | 77,271,988.24 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -69,237,321.01 | -69,237,321.01 |
| -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 | 139,626,508.99 | 139,626,508.99 |

华宝新机遇混合 C

| 项目 | 本期<br>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 | 331,146,786.31 | 331,146,786.31 |
| 本期申购 | 308,584,050.34 | 308,584,050.34 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -228,339,594.29 | -228,339,594.29 |
| -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 | 411,391,242.36 | 411,391,242.36 |

注：截至 2021 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的 A 类基金份额为 1,450,654.00 份(2020 年 12 月 31 日：1,023,453.00 份)，托管在场外未上市交易的 A 类基金份额为 138,175,854.99 份(2020 年 12 月 31 日：130,568,388.76 份)，托管在场外未上市交易的 C 类基金份额为 411,391,242.36 份(2020 年 12 月 31 日：331,146,786.31 份)。上市的基金份额登记在证券登记

结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

新机遇

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 63,295,576.36 | 8,968,108.81 | 72,263,685.17 |
| 本期利润 | 18,516,118.57 | -4,363,674.05 | 14,152,444.52 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,379,260.15 | 1,381,761.99 | 3,761,022.14 |
| 其中：基金申购款 | 41,192,996.31 | 4,642,090.50 | 45,835,086.81 |
| 基金赎回款 | -38,813,736.16 | -3,260,328.51 | -42,074,064.67 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 84,190,955.08 | 5,986,196.75 | 90,177,151.83 |

华宝新机遇混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 157,127,075.22 | 22,483,319.24 | 179,610,394.46 |
| 本期利润 | 40,709,002.16 | -7,364,376.69 | 33,344,625.47 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 46,653,166.68 | 2,461,333.06 | 49,114,499.74 |
| 其中：基金申购款 | 173,658,614.94 | 12,777,334.72 | 186,435,949.66 |
| 基金赎回款 | -127,005,448.26 | -10,316,001.66 | -137,321,449.92 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 244,489,244.06 | 17,580,275.61 | 262,069,519.67 |

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 37,847.73 | 54,490.16 |
| 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 | 189,881.37 | 85,137.70 |
| 其他 | 21,733.45 | 34,436.20 |
| 合计 | 249,462.55 | 174,064.06 |

### 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<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>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 | 44,801,658.35 | 74,416,467.77 |
| 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 | 44,801,658.35 | 74,416,467.77 |

#### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 442,100,676.83 | 397,975,591.35 |
| 减：卖出股票成本总额 | 397,299,018.48 | 323,559,123.58 |
| 买卖股票差价收入 | 44,801,658.35 | 74,416,467.77 |

#### 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<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>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 | 3,665,231.86 | -4,288,551.73 |
| 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 | 3,665,231.86 | -4,288,551.73 |

### 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<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>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 | 974,116,750.96 | 850,924,024.77 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 954,945,363.78 | 835,688,306.83 |
| 减：应收利息总额 | 15,506,155.32 | 19,524,269.67 |
| 买卖债券差价收入 | 3,665,231.86 | -4,288,551.73 |

### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>收益金额<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 股指期货投资收益 | -1,673,460.00 | -6,354,933.20 |

### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,419,002.71 | 1,413,481.10 |
| 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 | 1,419,002.71 | 1,413,481.10 |

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -12,574,530.74 | 15,528,847.95 |
| 股票投资 | -16,708,101.44 | 14,731,620.37 |
| 债券投资 | 4,133,570.70 | 797,227.58 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 2.衍生工具 | 846,480.00 | -665,760.00 |
| 权证投资 | - | - |
| 期货投资 | 846,480.00 | -665,760.00 |
| 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 | -11,728,050.74 | 14,863,087.95 |

### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | 281,169.44 | 37,718.15 |
| 其他 | - | 139.95 |
| 合计 | 281,169.44 | 37,858.10 |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 1,332,849.99 | 1,248,420.96 |
| 银行间市场交易费用 | 13,625.00 | 10,165.00 |
| 期货交易费用 | 7,053.25 | 8,735.86 |
| 合计 | 1,353,528.24 | 1,267,321.82 |

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 审计费用 | 50,000.00 | 50,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行费用 | 10,570.83 | 12,031.42 |
| 账户维护费 | 36,000.00 | 36,000.00 |
| 上市费用 | 60,000.00 | 60,000.00 |
| 上清所 CFCA 证书服务费 | 1,200.00 | 1,200.00 |
| 合计 | 277,770.83 | 279,231.42 |

### 7.4.7.21 分部报告

无。

## 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,基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司("中国建设银行") | 基金托管人,基金销售机构 |
| 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,基金销售机构 |
| 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) |
| 华宝证券 | - | - | 2,762,998.04 | 0.38 |

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例（%） |
| 华宝证券 | - | - | 1,179,000.00 | 3.66 |

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例（%） |
| 华宝证券 | - | - | 6,400,000.00 | 0.21 |

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| - | - | - | - | - |

| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期<br>佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 华宝证券 | 2,573.32 | 0.38 | - | - |

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>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 | 4,879,633.06 | 2,784,403.59 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 316,684.12 | 275,088.09 |

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，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 ×0.60% / 当年天数。

##### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>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 | 2,033,180.45 | 1,160,168.18 |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 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<br>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 |

| | 新机遇 | 华宝新机遇混合 C | 合计 |
|---|---|---|---|
| 华宝基金 | - | 530,971.25 | 530,971.25 |
| 合计 | 0.00 | 530,971.25 | 530,971.25 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>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 | | |
| | 新机遇 | 华宝新机遇混合 C | 合计 |
| 华宝基金 | - | 359,094.04 | 359,094.04 |
| 合计 | - | 359,094.04 | 359,094.04 |

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.10%年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：H=E×0.10%÷当年天数，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| | 新机遇 | 华宝新机遇混合 C |
| 基金合同生效日（ 2015 年 6 月 11 日）持有的基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 8,640,432.68 | 7,273,785.27 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 | 0.00 |

| | | |
|---|---|---|
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 6,437,076.73 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 2,203,355.95 | 7,273,785.27 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 1.58% | 1.77% |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
| | 新机遇 | 华宝新机遇混合 C |
| 基金合同生效日（ 2015 年 6 月 11 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 2,117,076.73 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 6,523,355.95 | 7,273,785.27 |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 8,640,432.68 | 7,273,785.27 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 6.57% | 2.20% |

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

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>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 |
| 中国建设银行 | 8,358,991.52 | 37,847.73 | 24,880,685.63 | 54,490.16 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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 1 月 11 日 | 新股流通受限 | 16.53 | 16.53 | 333 | 5,504.49 | 5,504.49 | - |
| 300774 | 倍杰特 | 2021 年 7 月 26 日 | 2022 年 02 月 16 日 | 新股锁定 | 4.57 | 21.08 | 444 | 2,029.08 | 9,359.52 | - |
| 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 3 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 | 2021 | 2022 | 新股锁 | 18.03 | 62.73 | 203 | 3,660.09 | 12,734.19 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 科技 | 年 7 月 8 日 | 年 1 月 17 日 | 定 | | | | | | |
| 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 | 仕净科技 | 2021 年 7 月 15 日 | 2022 年 1 月 24 日 | 新股锁定 | 6.10 | 31.52 | 242 | 1,476.20 | 7,627.84 | - |
| 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 | 2021 | 2022 | 新股锁 | 13.57 | 38.51 | 241 | 3,270.37 | 9,280.91 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 海陆 | 年 7 月 26 日 | 年 2 月 7 日 | 定 | | | | | | |
| 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 | 金鹰重工 | 2021 年 8 月 11 日 | 2022 年 02 月 28 日 | 新股锁定 | 4.13 | 12.96 | 843 | 3,481.59 | 10,925.28 | - |
| 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 | 2021 | 2022 | 新股锁 | 8.09 | 19.30 | 259 | 2,095.31 | 4,998.70 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 江 | 年 9 月 3 日 | 年 3 月 14 日 | 定 | | | | | | |
| 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 | 海锅股份 | 2021 年 9 月 9 日 | 2022 年 3 月 24 日 | 新股锁定 | 17.40 | 36.11 | 153 | 2,662.20 | 5,524.83 | - |
| 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 | - |
| 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 | 2021 | 2022 | 新股锁 | 15.48 | 21.53 | 915 | 14,164.20 | 19,699.95 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 电气 | 年 10 月 14 日 | 年 4 月 27 日 | 定 | | | | | | |
| 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 | 可孚医疗 | 2021 年 10 月 15 日 | 2022 年 4 月 25 日 | 新股锁定 | 93.09 | 75.34 | 346 | 32,209.14 | 26,067.64 | - |
| 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 | - |
| 688190 | 云路 | 2021 | 2022 | 新股锁 | 46.63 | 92.51 | 3,026 | 141,102.38 | 279,935.26 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 股份 | 年 11 月 18 日 | 年 5 月 26 日 | 定 | | | | | | |

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和债券等。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。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 49,920,000.00 | 136,087,800.00 |
| 合计 | 49,920,000.00 | 136,087,800.00 |

注：未评级债券为政策性金融债。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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 19,608,000.00 | 68,047,000.00 |
| 合计 | 19,608,000.00 | 68,047,000.00 |

### 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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| AAA | 313,316,000.00 | 140,146,804.70 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 334,300,170.00 | 142,202,934.70 |
| 合计 | 647,616,170.00 | 282,349,739.40 |

注：未评级债券为国债及政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

### 7.4.13.2.5 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，除附注 7.4.12 中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》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 7.4.12。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；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，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未来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、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，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<br>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 | 8,358,991.52 | - | - | - | 8,358,991.52 |
| 结算备付金 | 5,220,072.68 | - | - | - | 5,220,072.68 |
| 存出保证金 | 13,447.16 | - | - | 2,138,083.20 | 2,151,530.36 |
| 交易性金融资产 | 150,136,000.00 | 444,645,000.00 | 122,363,170.00 | 124,722,717.14 | 841,866,887.14 |
| 买入返售金融资产 | 37,000,000.00 | - | - | - | 37,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 8,926,550.27 | 8,926,550.27 |
| 应收申购款 | - | - | - | 419,620.76 | 419,620.76 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 542,829.95 | 542,829.95 |
| 资产总计 | 200,728,511.36 | 444,645,000.00 | 122,363,170.00 | 136,749,801.32 | 904,486,482.68 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 106,697.50 | 106,697.50 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 460,634.52 | 460,634.52 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 应付托管费 | - | - | - | 191,931.04 | 191,931.04 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 57,315.15 | 57,315.15 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 229,503.18 | 229,503.18 |
| 应交税费 | - | - | - | 5,689.57 | 5,689.57 |
| 其他负债 | - | - | - | 170,288.87 | 170,288.87 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,222,059.83 | 1,222,059.83 |
| 利率敏感度缺口 | 200,728,511.36 | 444,645,000.00 | 122,363,170.00 | 135,527,741.49 | 903,264,422.85 |
| 上年度末<br>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 | 24,880,685.63 | - | - | - | 24,880,685.63 |
| 结算备付金 | 2,376,566.53 | - | - | - | 2,376,566.53 |
| 存出保证金 | 58,783.31 | - | - | 3,004,531.20 | 3,063,314.51 |
| 交易性金融资产 | 205,849,274.70 | 240,911,000.00 | 39,724,264.70 | 134,877,375.39 | 621,361,914.79 |
| 买入返售金融资产 | 80,700,000.00 | - | - | - | 80,700,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 5,689,911.42 | 5,689,911.42 |
| 应收申购款 | - | - | - | 759,120.58 | 759,120.58 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 249,276.45 | 249,276.45 |
| 资产总计 | 313,865,310.17 | 240,911,000.00 | 39,724,264.70 | 144,580,215.04 | 739,080,789.91 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 274,850.60 | 274,850.60 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 339,282.74 | 339,282.74 |
| 应付托管费 | - | - | - | 141,367.81 | 141,367.81 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 23,154,221.50 | 23,154,221.50 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 41,266.46 | 41,266.46 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 341,093.65 | 341,093.65 |
| 应交税费 | - | - | - | 5,690.07 | 5,690.07 |
| 其他负债 | - | - | - | 170,309.38 | 170,309.38 |
| 负债总计 | - | - | - | 24,468,082.21 | 24,468,082.21 |
| 利率敏感度缺口 | 313,865,310.17 | 240,911,000.00 | 39,724,264.70 | 120,112,132.83 | 714,612,707.70 |

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.市场利率下降 25 个基点 | 5,474,983.19 | 2,209,837.24 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 2.市场利率上升 25 个基点 | -5,399,991.48 | -2,186,404.63 |

### 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%。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 | 124,722,717.14 | 13.81 | 134,877,375.39 | 18.87 |
| 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 | 124,722,717.14 | 13.81 | 134,877,375.39 | 18.87 |

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 13.81%(2020 年 12 月 31 日：18.87%)，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

## 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) 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。

(b) 持续的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 122,096,452.88 元，属于第二层次的余额为 717,149,674.49 元，属于第三层次的余额为 2,620,759.77 元(上年度末：第一层次 130,197,645.56 元，第二层次 491,164,269.23 元，无第三层次)。

(ii) 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和债券，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和债券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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具 2,620,759.77 元(2020 年 12 月 31 日：未持有公允价值归属于第三层次的金融工具)。其中，于本会计期间购买第三层次金融工具的金额为 2,235,354.94 元，计入损益的利得或损失金额为 385,404.83 元，均为 2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入未实现利得或损失的变动(公允价值变动损益)(2020 年度：无)。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为该流通受限股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

(d) 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。

(2) 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》，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。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，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。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值外，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 | 124,722,717.14 | 13.79 |
| | 其中：股票 | 124,722,717.14 | 13.79 |
| 2 | 基金投资 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3 | 固定收益投资 | 717,144,170.00 | 79.29 |
| | 其中：债券 | 717,144,170.00 | 79.29 |
| | 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 | 37,000,000.00 | 4.09 |
| | 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 | 13,579,064.20 | 1.50 |
| 8 | 其他各项资产 | 12,040,531.34 | 1.33 |
| 9 | 合计 | 904,486,482.68 | 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 | 1,099,746.00 | 0.12 |
| B | 采矿业 | 1,644,379.00 | 0.18 |
| C | 制造业 | 77,620,678.61 | 8.59 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,334,192.00 | 0.37 |
| E | 建筑业 | 2,746,522.19 | 0.30 |
| F | 批发和零售业 | 400,055.34 | 0.04 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,102,695.00 | 0.34 |
| 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 | 4,330,532.97 | 0.48 |
| J | 金融业 | 25,618,822.68 | 2.84 |
| K | 房地产业 | 2,753,125.00 | 0.30 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,366,242.42 | 0.15 |
| 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 | 18,161.78 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 661,604.44 | 0.07 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 124,722,717.14 | 13.81 |

### 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 | 4,100 | 8,405,000.00 | 0.93 |
| 2 | 300059 | 东方财富 | 117,760 | 4,370,073.60 | 0.48 |
| 3 | 002142 | 宁波银行 | 106,430 | 4,074,140.40 | 0.45 |
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 5,800 | 3,410,400.00 | 0.38 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 69,700 | 3,395,087.00 | 0.38 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 12,000 | 3,046,440.00 | 0.34 |
| 7 | 600690 | 海尔智家 | 79,300 | 2,370,277.00 | 0.26 |
| 8 | 601328 | 交通银行 | 480,100 | 2,213,261.00 | 0.25 |
| 9 | 000776 | 广发证券 | 86,000 | 2,114,740.00 | 0.23 |
| 10 | 601012 | 隆基股份 | 23,020 | 1,984,324.00 | 0.22 |
| 11 | 002594 | 比亚迪 | 7,100 | 1,903,652.00 | 0.21 |
| 12 | 002241 | 歌尔股份 | 33,700 | 1,823,170.00 | 0.20 |
| 13 | 601668 | 中国建筑 | 352,600 | 1,763,000.00 | 0.20 |
| 14 | 600438 | 通威股份 | 37,900 | 1,703,984.00 | 0.19 |
| 15 | 600030 | 中信证券 | 64,100 | 1,692,881.00 | 0.19 |
| 16 | 601728 | 中国电信 | 394,011 | 1,682,426.97 | 0.19 |
| 17 | 600741 | 华域汽车 | 54,900 | 1,553,670.00 | 0.17 |
| 18 | 002821 | 凯莱英 | 3,500 | 1,522,500.00 | 0.17 |
| 19 | 600900 | 长江电力 | 66,700 | 1,514,090.00 | 0.17 |
| 20 | 600028 | 中国石化 | 349,300 | 1,477,539.00 | 0.16 |
| 21 | 002008 | 大族激光 | 27,100 | 1,463,400.00 | 0.16 |
| 22 | 000333 | 美的集团 | 19,700 | 1,454,057.00 | 0.16 |
| 23 | 002475 | 立讯精密 | 29,529 | 1,452,826.80 | 0.16 |
| 24 | 600176 | 中国巨石 | 78,600 | 1,430,520.00 | 0.16 |
| 25 | 300760 | 迈瑞医疗 | 3,700 | 1,408,960.00 | 0.16 |
| 26 | 600436 | 片仔癀 | 3,200 | 1,398,880.00 | 0.15 |
| 27 | 601877 | 正泰电器 | 25,700 | 1,384,973.00 | 0.15 |
| 28 | 600809 | 山西汾酒 | 4,240 | 1,338,907.20 | 0.15 |
| 29 | 002049 | 紫光国微 | 5,900 | 1,327,500.00 | 0.15 |
| 30 | 000063 | 中兴通讯 | 38,100 | 1,276,350.00 | 0.14 |
| 31 | 000977 | 浪潮信息 | 35,600 | 1,275,548.00 | 0.14 |
| 32 | 000858 | 五 粮 液 | 5,600 | 1,246,896.00 | 0.14 |
| 33 | 600048 | 保利发展 | 79,200 | 1,237,896.00 | 0.14 |
| 34 | 601211 | 国泰君安 | 65,900 | 1,178,951.00 | 0.13 |
| 35 | 600887 | 伊利股份 | 27,700 | 1,148,442.00 | 0.13 |
| 36 | 300498 | 温氏股份 | 57,100 | 1,099,746.00 | 0.12 |
| 37 | 002555 | 三七互娱 | 40,500 | 1,094,310.00 | 0.12 |
| 38 | 300274 | 阳光电源 | 7,500 | 1,093,500.00 | 0.12 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 39 | 002202 | 金风科技 | 62,100 | 1,022,787.00 | 0.11 |
| 40 | 002179 | 中航光电 | 10,100 | 1,015,656.00 | 0.11 |
| 41 | 601985 | 中国核电 | 118,300 | 981,890.00 | 0.11 |
| 42 | 300347 | 泰格医药 | 7,500 | 958,500.00 | 0.11 |
| 43 | 601628 | 中国人寿 | 31,400 | 944,826.00 | 0.10 |
| 44 | 600570 | 恒生电子 | 15,200 | 944,680.00 | 0.10 |
| 45 | 000538 | 云南白药 | 8,900 | 931,385.00 | 0.10 |
| 46 | 000069 | 华侨城 A | 130,300 | 917,312.00 | 0.10 |
| 47 | 002460 | 赣锋锂业 | 6,400 | 914,240.00 | 0.10 |
| 48 | 601166 | 兴业银行 | 46,300 | 881,552.00 | 0.10 |
| 49 | 603501 | 韦尔股份 | 2,800 | 870,156.00 | 0.10 |
| 50 | 300327 | 中颖电子 | 12,140 | 824,306.00 | 0.09 |
| 51 | 601838 | 成都银行 | 64,700 | 776,400.00 | 0.09 |
| 52 | 603986 | 兆易创新 | 4,400 | 773,740.00 | 0.09 |
| 53 | 002013 | 中航机电 | 42,100 | 765,378.00 | 0.08 |
| 54 | 600104 | 上汽集团 | 36,800 | 759,184.00 | 0.08 |
| 55 | 600085 | 同仁堂 | 16,800 | 755,664.00 | 0.08 |
| 56 | 300033 | 同花顺 | 5,200 | 751,816.00 | 0.08 |
| 57 | 601919 | 中远海控 | 40,200 | 751,338.00 | 0.08 |
| 58 | 002756 | 永兴材料 | 5,000 | 740,100.00 | 0.08 |
| 59 | 600276 | 恒瑞医药 | 14,300 | 725,153.00 | 0.08 |
| 60 | 002415 | 海康威视 | 13,700 | 716,784.00 | 0.08 |
| 61 | 001965 | 招商公路 | 92,100 | 706,407.00 | 0.08 |
| 62 | 601006 | 大秦铁路 | 109,600 | 701,440.00 | 0.08 |
| 63 | 600332 | 白云山 | 20,500 | 701,100.00 | 0.08 |
| 64 | 002841 | 视源股份 | 8,500 | 691,900.00 | 0.08 |
| 65 | 002791 | 坚朗五金 | 3,700 | 671,883.00 | 0.07 |
| 66 | 000789 | 万年青 | 54,600 | 667,212.00 | 0.07 |
| 67 | 002311 | 海大集团 | 9,100 | 667,030.00 | 0.07 |
| 68 | 002352 | 顺丰控股 | 9,500 | 654,740.00 | 0.07 |
| 69 | 002332 | 仙琚制药 | 48,000 | 633,600.00 | 0.07 |
| 70 | 300413 | 芒果超媒 | 10,900 | 623,698.00 | 0.07 |
| 71 | 002230 | 科大讯飞 | 11,600 | 609,116.00 | 0.07 |
| 72 | 600380 | 健康元 | 47,400 | 608,616.00 | 0.07 |
| 73 | 300502 | 新易盛 | 15,500 | 607,290.00 | 0.07 |
| 74 | 603605 | 珀莱雅 | 2,900 | 604,099.00 | 0.07 |
| 75 | 002812 | 恩捷股份 | 2,400 | 600,960.00 | 0.07 |
| 76 | 600383 | 金地集团 | 46,100 | 597,917.00 | 0.07 |
| 77 | 601009 | 南京银行 | 66,600 | 596,736.00 | 0.07 |
| 78 | 002493 | 荣盛石化 | 32,800 | 595,648.00 | 0.07 |
| 79 | 603517 | 绝味食品 | 8,700 | 594,471.00 | 0.07 |
| 80 | 688036 | 传音控股 | 3,780 | 593,082.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 81 | 002048 | 宁波华翔 | 27,100 | 586,173.00 | 0.06 |
| 82 | 603659 | 璞泰来 | 3,600 | 578,196.00 | 0.06 |
| 83 | 002916 | 深南电路 | 4,600 | 560,372.00 | 0.06 |
| 84 | 000001 | 平安银行 | 33,900 | 558,672.00 | 0.06 |
| 85 | 002088 | 鲁阳节能 | 21,420 | 556,920.00 | 0.06 |
| 86 | 300316 | 晶盛机电 | 8,000 | 556,000.00 | 0.06 |
| 87 | 601318 | 中国平安 | 11,000 | 554,510.00 | 0.06 |
| 88 | 600456 | 宝钛股份 | 7,700 | 552,706.00 | 0.06 |
| 89 | 000733 | 振华科技 | 4,400 | 546,832.00 | 0.06 |
| 90 | 601800 | 中国交建 | 63,200 | 542,256.00 | 0.06 |
| 91 | 601677 | 明泰铝业 | 11,500 | 507,035.00 | 0.06 |
| 92 | 601600 | 中国铝业 | 80,300 | 489,027.00 | 0.05 |
| 93 | 603833 | 欧派家居 | 3,300 | 486,750.00 | 0.05 |
| 94 | 002648 | 卫星化学 | 12,100 | 484,363.00 | 0.05 |
| 95 | 002459 | 晶澳科技 | 5,100 | 472,770.00 | 0.05 |
| 96 | 600483 | 福能股份 | 28,900 | 470,492.00 | 0.05 |
| 97 | 601688 | 华泰证券 | 25,400 | 451,104.00 | 0.05 |
| 98 | 600329 | 中新药业 | 14,300 | 449,163.00 | 0.05 |
| 99 | 601186 | 中国铁建 | 55,700 | 434,460.00 | 0.05 |
| 100 | 600183 | 生益科技 | 17,700 | 416,835.00 | 0.05 |
| 101 | 002531 | 天顺风能 | 21,300 | 413,007.00 | 0.05 |
| 102 | 600958 | 东方证券 | 25,600 | 377,344.00 | 0.04 |
| 103 | 601229 | 上海银行 | 51,700 | 368,621.00 | 0.04 |
| 104 | 600795 | 国电电力 | 116,000 | 367,720.00 | 0.04 |
| 105 | 603259 | 药明康德 | 3,020 | 358,111.60 | 0.04 |
| 106 | 000963 | 华东医药 | 8,800 | 353,760.00 | 0.04 |
| 107 | 002402 | 和而泰 | 11,500 | 315,445.00 | 0.03 |
| 108 | 600195 | 中牧股份 | 23,900 | 312,373.00 | 0.03 |
| 109 | 603260 | 合盛硅业 | 2,300 | 303,531.00 | 0.03 |
| 110 | 603995 | 甬金股份 | 5,200 | 300,872.00 | 0.03 |
| 111 | 600377 | 宁沪高速 | 33,500 | 288,770.00 | 0.03 |
| 112 | 688190 | 云路股份 | 3,026 | 279,935.26 | 0.03 |
| 113 | 603195 | 公牛集团 | 1,500 | 250,950.00 | 0.03 |
| 114 | 600919 | 江苏银行 | 42,600 | 248,358.00 | 0.03 |
| 115 | 300260 | 新莱应材 | 5,200 | 245,284.00 | 0.03 |
| 116 | 000739 | 普洛药业 | 6,900 | 242,121.00 | 0.03 |
| 117 | 002645 | 华宏科技 | 9,900 | 241,560.00 | 0.03 |
| 118 | 000999 | 华润三九 | 6,800 | 232,832.00 | 0.03 |
| 119 | 002009 | 天奇股份 | 9,600 | 231,936.00 | 0.03 |
| 120 | 000425 | 徐工机械 | 37,500 | 224,625.00 | 0.02 |
| 121 | 002353 | 杰瑞股份 | 5,600 | 224,000.00 | 0.02 |
| 122 | 300124 | 汇川技术 | 3,200 | 219,520.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 123 | 601899 | 紫金矿业 | 17,200 | 166,840.00 | 0.02 |
| 124 | 688005 | 容百科技 | 1,150 | 132,917.00 | 0.01 |
| 125 | 603799 | 华友钴业 | 1,200 | 132,372.00 | 0.01 |
| 126 | 605369 | 拱东医疗 | 500 | 71,645.00 | 0.01 |
| 127 | 600927 | 永安期货 | 1,859 | 69,749.68 | 0.01 |
| 128 | 301050 | 雷电微力 | 233 | 54,694.42 | 0.01 |
| 129 | 301035 | 润丰股份 | 644 | 36,244.32 | 0.00 |
| 130 | 301090 | 华润材料 | 2,764 | 31,012.08 | 0.00 |
| 131 | 603230 | 内蒙新华 | 1,140 | 29,491.80 | 0.00 |
| 132 | 301087 | 可孚医疗 | 346 | 26,067.64 | 0.00 |
| 133 | 301039 | 中集车辆 | 2,064 | 25,820.64 | 0.00 |
| 134 | 301058 | 中粮工科 | 1,386 | 25,280.64 | 0.00 |
| 135 | 301189 | 奥尼电子 | 435 | 24,629.70 | 0.00 |
| 136 | 301166 | 优宁维 | 253 | 23,908.50 | 0.00 |
| 137 | 301069 | 凯盛新材 | 539 | 23,829.19 | 0.00 |
| 138 | 301018 | 申菱环境 | 782 | 20,378.92 | 0.00 |
| 139 | 301149 | 隆华新材 | 1,214 | 20,346.64 | 0.00 |
| 140 | 301082 | 久盛电气 | 915 | 19,699.95 | 0.00 |
| 141 | 300994 | 久祺股份 | 420 | 19,089.00 | 0.00 |
| 142 | 001296 | 长江材料 | 310 | 18,376.80 | 0.00 |
| 143 | 301060 | 兰卫医学 | 587 | 18,161.78 | 0.00 |
| 144 | 301089 | 拓新药业 | 220 | 14,944.60 | 0.00 |
| 145 | 301046 | 能辉科技 | 290 | 14,207.10 | 0.00 |
| 146 | 301188 | 力诺特玻 | 647 | 13,250.56 | 0.00 |
| 147 | 301017 | 漱玉平民 | 555 | 13,209.00 | 0.00 |
| 148 | 301026 | 浩通科技 | 203 | 12,734.19 | 0.00 |
| 149 | 301021 | 英诺激光 | 290 | 12,014.70 | 0.00 |
| 150 | 301048 | 金鹰重工 | 843 | 10,925.28 | 0.00 |
| 151 | 301028 | 东亚机械 | 733 | 9,895.50 | 0.00 |
| 152 | 300774 | 倍杰特 | 444 | 9,359.52 | 0.00 |
| 153 | 301040 | 中环海陆 | 241 | 9,280.91 | 0.00 |
| 154 | 301078 | 孩子王 | 756 | 9,177.84 | 0.00 |
| 155 | 301062 | 上海艾录 | 523 | 8,896.23 | 0.00 |
| 156 | 301025 | 读客文化 | 403 | 8,414.64 | 0.00 |
| 157 | 301066 | 万事利 | 344 | 7,856.96 | 0.00 |
| 158 | 300814 | 中富电路 | 328 | 7,832.64 | 0.00 |
| 159 | 301055 | 张小泉 | 355 | 7,731.90 | 0.00 |
| 160 | 301030 | 仕净科技 | 242 | 7,627.84 | 0.00 |
| 161 | 301081 | 严牌股份 | 403 | 7,028.32 | 0.00 |
| 162 | 301098 | 金埔园林 | 307 | 6,806.19 | 0.00 |
| 163 | 301033 | 迈普医学 | 108 | 6,476.76 | 0.00 |
| 164 | 301049 | 超越科技 | 196 | 6,452.32 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 165 | 301032 | 新柴股份 | 513 | 6,417.63 | 0.00 |
| 166 | 301056 | 森赫股份 | 572 | 6,343.48 | 0.00 |
| 167 | 301036 | 双乐股份 | 205 | 6,135.65 | 0.00 |
| 168 | 301041 | 金百泽 | 215 | 6,065.15 | 0.00 |
| 169 | 301072 | 中捷精工 | 181 | 6,047.21 | 0.00 |
| 170 | 301083 | 百胜智能 | 416 | 5,911.36 | 0.00 |
| 171 | 300854 | 中兰环保 | 203 | 5,539.87 | 0.00 |
| 172 | 301063 | 海锅股份 | 153 | 5,524.83 | 0.00 |
| 173 | 001234 | 泰慕士 | 333 | 5,504.49 | 0.00 |
| 174 | 301038 | 深水规院 | 266 | 5,381.18 | 0.00 |
| 175 | 301059 | 金三江 | 259 | 4,998.70 | 0.00 |
| 176 | 301027 | 华蓝集团 | 286 | 4,761.90 | 0.00 |
| 177 | 301037 | 保立佳 | 193 | 4,682.18 | 0.00 |
| 178 | 301073 | 君亭酒店 | 144 | 4,608.00 | 0.00 |
| 179 | 301053 | 远信工业 | 155 | 4,460.90 | 0.00 |
| 180 | 301057 | 汇隆新材 | 218 | 4,146.36 | 0.00 |
| 181 | 301068 | 大地海洋 | 144 | 4,086.72 | 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 | 8,519,014.00 | 1.19 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 6,426,927.00 | 0.90 |
| 3 | 000568 | 泸州老窖 | 5,277,919.00 | 0.74 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 5,171,503.00 | 0.72 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 4,883,486.00 | 0.68 |
| 6 | 601012 | 隆基股份 | 4,699,934.80 | 0.66 |
| 7 | 000002 | 万 科 A | 4,650,910.00 | 0.65 |
| 8 | 600690 | 海尔智家 | 4,638,403.40 | 0.65 |
| 9 | 600048 | 保利发展 | 4,546,350.00 | 0.64 |
| 10 | 601838 | 成都银行 | 4,188,692.00 | 0.59 |
| 11 | 300059 | 东方财富 | 4,103,264.20 | 0.57 |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 3,976,679.00 | 0.56 |
| 13 | 601328 | 交通银行 | 3,914,848.00 | 0.55 |
| 14 | 300750 | 宁德时代 | 3,721,649.00 | 0.52 |
| 15 | 603259 | 药明康德 | 3,423,826.00 | 0.48 |
| 16 | 002714 | 牧原股份 | 3,416,829.15 | 0.48 |
| 17 | 002493 | 荣盛石化 | 3,404,362.00 | 0.48 |
| 18 | 000858 | 五粮液 | 3,331,651.00 | 0.47 |
| 19 | 002415 | 海康威视 | 3,200,371.56 | 0.45 |
| 20 | 601009 | 南京银行 | 3,144,515.80 | 0.44 |

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 | 000333 | 美的集团 | 6,946,769.33 | 0.97 |
| 2 | 601012 | 隆基股份 | 6,811,130.97 | 0.95 |
| 3 | 000002 | 万 科 A | 6,763,666.79 | 0.95 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 6,732,135.22 | 0.94 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 5,802,085.00 | 0.81 |
| 6 | 600519 | 贵州茅台 | 5,299,490.00 | 0.74 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 5,110,737.00 | 0.72 |
| 8 | 002142 | 宁波银行 | 4,679,868.00 | 0.65 |
| 9 | 000858 | 五粮液 | 4,672,301.00 | 0.65 |
| 10 | 002415 | 海康威视 | 4,501,159.00 | 0.63 |
| 11 | 000001 | 平安银行 | 4,444,897.00 | 0.62 |
| 12 | 002594 | 比亚迪 | 4,098,562.00 | 0.57 |
| 13 | 601166 | 兴业银行 | 4,067,224.00 | 0.57 |
| 14 | 601377 | 兴业证券 | 4,019,917.00 | 0.56 |
| 15 | 000568 | 泸州老窖 | 4,013,575.00 | 0.56 |
| 16 | 603259 | 药明康德 | 3,768,504.80 | 0.53 |
| 17 | 000725 | 京东方 A | 3,733,369.00 | 0.52 |
| 18 | 601328 | 交通银行 | 3,593,100.00 | 0.50 |
| 19 | 601398 | 工商银行 | 3,539,845.00 | 0.50 |
| 20 | 000661 | 长春高新 | 3,532,152.94 | 0.49 |

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 | 403,852,461.67 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 442,100,676.83 |

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 | 901,170.00 | 0.10 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 626,094,000.00 | 69.31 |
| | 其中：政策性金融债 | 383,319,000.00 | 42.44 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 6 | 中期票据 | 70,541,000.00 | 7.81 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 19,608,000.00 | 2.17 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 717,144,170.00 | 79.39 |

## 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 | 210310 | 21 进出 10 | 700,000 | 71,302,000.00 | 7.89 |
| 2 | 092118003 | 21 农发清发 03 | 600,000 | 60,042,000.00 | 6.65 |
| 3 | 210403 | 21 农发 03 | 500,000 | 51,050,000.00 | 5.65 |
| 4 | 200313 | 20 进出 13 | 500,000 | 50,710,000.00 | 5.61 |
| 5 | 210215 | 21 国开 15 | 500,000 | 50,160,000.00 | 5.55 |

## 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 | -5 | -7,421,100.00 | 185,040.00 | - |
| IF2203 | IF2203 | -7 | -10,396,260.00 | -321,840.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | -136,800.00 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -1,673,460.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 846,480.00 |

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

新机遇混合基金截至 2021 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的 21 招商银行小微债 02(2128020)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。

新机遇混合基金截至 2021 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的 20 兴业银行小微债 05(2028030)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。

新机遇混合基金截至 2021 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的 21 兴业银行二级 02(2128042)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。

新机遇混合基金截至 2021 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的 21 中信银行小微债(2128023)的发行人中信银行股份有限公司于 2021 年 02 月 05 日公告，因公司存在以下违规行为：1.未按规定履行客户身份识别义务；2.未按规定保存客户身份资料和交易记录；3.未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；4.与身份不明的客户进行交易；于 2021 年 02 月 05 日收到中国人民银行罚款 2890 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六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 | 2,151,530.36 |
| 2 | 应收证券清算款 | 542,829.95 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 8,926,550.27 |
| 5 | 应收申购款 | 419,620.76 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,040,531.34 |

### 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

| 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（%） |
| 新机遇 | 8,780 | 15,902.79 | 71,693,954.74 | 51.35 | 67,932,554.25 | 48.65 |
| 华宝新机遇混合 C | 25 | 16,455,649.69 | 411,391,242.36 | 100.00 | - | - |
| 合计 | 8,805 | 62,580.10 | 483,085,197.10 | 87.67 | 67,932,554.25 | 12.33 |

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

新机遇

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 黄惠芳 | 325,678.00 | 22.45 |
| 2 | 王逸峰 | 156,567.00 | 10.79 |
| 3 | 黄海明 | 111,105.00 | 7.66 |
| 4 | 张玉春 | 72,500.00 | 5.00 |
| 5 | 陈敏 | 56,900.00 | 3.92 |
| 6 | 万志明 | 50,003.00 | 3.45 |
| 7 | 陈治飞 | 50,000.00 | 3.45 |
| 8 | 邵建忠 | 40,326.00 | 2.78 |
| 9 | 于志明 | 40,002.00 | 2.76 |
| 10 | 彭博 | 37,000.00 | 2.55 |

### 9.3 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 | 新机遇 | 417,726.03 | 0.2992 |
| | 华宝新机遇混合 C | 0.00 | 0.0000 |
| | 合计 | 417,726.03 | 0.0758 |

### 9.4 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 | 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 | 新机遇 | 0 |
| | 华宝新机遇混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 新机遇 | 10~50 |
| | 华宝新机遇混合 C | 0 |
| | 合计 | 10~50 |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 新机遇 | 华宝新机遇混合 C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2015 年 6 月 11 日）基金份额总额 | 1,438,056,502.93 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 131,591,841.76 | 331,146,786.31 |
| 本报告期基金总申购份额 | 77,271,988.24 | 308,584,050.34 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 69,237,321.01 | 228,339,594.29 |
| 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 | 139,626,508.99 | 411,391,242.36 |

## §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

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

## 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 50,000.00 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：本基金合同生效之日起至本报告期末。

## 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

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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 | |
| 中信证券 | 2 | 115,946,545.88 | 14.07% | 107,981.13 | 14.23% | - |
| 华安证券 | 1 | 95,077,172.56 | 11.54% | 88,544.89 | 11.67% | - |
| 东吴证券 | 1 | 86,880,127.09 | 10.54% | 80,911.15 | 10.66% | - |
| 招商证券 | 2 | 76,319,857.07 | 9.26% | 69,550.37 | 9.16% | - |
| 国泰君安 | 2 | 73,332,970.03 | 8.90% | 67,086.62 | 8.84% | - |
| 光大证券 | 1 | 59,618,663.52 | 7.23% | 55,523.52 | 7.32% | - |
| 太平洋证券 | 2 | 48,933,977.67 | 5.94% | 45,485.81 | 5.99% | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 信达证券 | 1 | 47,453,194.79 | 5.76% | 44,193.43 | 5.82% | - |
| 申万宏源 | 3 | 37,056,641.41 | 4.50% | 34,510.95 | 4.55% | - |
| 长江证券 | 1 | 35,075,527.15 | 4.26% | 32,665.26 | 4.30% | - |
| 天风证券 | 2 | 28,612,747.82 | 3.47% | 26,647.21 | 3.51% | - |
| 国信证券 | 1 | 24,993,637.16 | 3.03% | 23,276.75 | 3.07% | - |
| 西部证券 | 1 | 23,328,563.42 | 2.83% | 16,593.58 | 2.19% | - |
| 开源证券 | 1 | 15,084,923.92 | 1.83% | 13,746.93 | 1.81% | - |
| 川财证券 | 1 | 13,555,580.69 | 1.64% | 12,624.27 | 1.66% | - |
| 中银国际 | 1 | 13,219,999.74 | 1.60% | 12,311.72 | 1.62% | - |
| 中金财富 | 1 | 12,988,380.66 | 1.58% | 12,096.04 | 1.59% | - |
| 兴业证券 | 2 | 6,582,000.71 | 0.80% | 5,998.23 | 0.79% | - |
| 东莞证券 | 1 | 4,245,667.61 | 0.52% | 3,869.04 | 0.51% | - |
| 安信证券 | 1 | 2,535,163.10 | 0.31% | 2,360.99 | 0.31% | - |
| 瑞银证券 | 1 | 1,870,447.60 | 0.23% | 1,741.86 | 0.23% | - |
| 方正证券 | 2 | 1,083,588.64 | 0.13% | 1,009.13 | 0.13% | - |
| 广发证券 | 2 | 271,022.57 | 0.03% | 252.40 | 0.03% | - |
| 湘财证券 | 2 | 52,618.73 | 0.01% | 47.94 | 0.01% | - |
| 长城证券 | 1 | 6,408.45 | 0.00% | 5.97 | 0.00% | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 日信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申港证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源西部 | 1 | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 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、本报告期租用的证券公司交易单元新增的有：宏信证券、东莞证券、申港证券、湘财证券。

## 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 |
| 中信证券 | 203,403.00 | 8.98% | 798,700,000.00 | 19.68% | - | - |
| 华安证券 | - | - | 357,700,000.00 | 8.81% | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 45,018.29 | 1.99% | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 263,424.78 | 11.63% | 442,100,000.00 | 10.89% | - | - |
| 光大证券 | - | - | 73,800,000.00 | 1.82% | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | 189,700,000.00 | 4.67% | - | - |
| 信达证券 | - | - | 147,700,000.00 | 3.64% | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | 37,800,000.00 | 0.93% | - | - |
| 天风证券 | - | - | 612,500,000.00 | 15.09% | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | 8,700,000.00 | 0.21% | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 中金财富 | - | - | 674,000,000.00 | 16.61% | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 14,000.00 | 0.62% | 464,800,000.00 | 11.45% | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | 133,700,000.00 | 3.29% | - | - |
| 方正证券 | - | - | 116,700,000.00 | 2.88% | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 广州证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 日信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申港证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源西部 | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金国际 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1,740,018.05 | 76.79% | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |

## 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 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2020 年第 4 季度报告 | 基金管理人网站 | 2021-1-22 |
| 2 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2020 年年度报告 | 基金管理人网站 | 2021-3-31 |
| 3 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2021 年第 1 季度报告 | 基金管理人网站 | 2021-4-22 |
| 4 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)（C 类份额）基金产品资料概要（更新） | 基金管理人网站 | 2021-5-13 |
| 5 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新） | 基金管理人网站 | 2021-5-13 |
| 6 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资 | 基金管理人网站,上海 | 2021-6-8 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 基金（LOF）C 类份额在直销机构恢复大额申购（含定投）业务的公告 | 证券报 | |
| 7 | 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 |
| 8 | 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 | 2021-6-25 |
| 9 | 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 |
| 10 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2021 年第 2 季度报告 | 基金管理人网站 | 2021-7-21 |
| 11 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）C 类份额在直销机构暂停大额申购（含定投）业务的公告 | 基金管理人网站,上海证券报 | 2021-8-12 |
| 12 | 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 |
| 13 | 华宝基金关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告 | 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 | 2021-8-21 |
| 14 | 华宝基金关于华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）C 类新增华泰证券为代销机构的公告 | 基金管理人网站,上海证券报 | 2021-8-24 |
| 15 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2021 年中期报告 | 基金管理人网站 | 2021-8-27 |
| 16 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)C 类份额调整大额申购（含定投）业务的公告 | 基金管理人网站,上海证券报 | 2021-10-22 |
| 17 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2021 年第 3 季度报告 | 基金管理人网站 | 2021-10-27 |
| 18 | 华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）恢复大额申购（含定投）业务的公告 | 基金管理人网站,上海证券报 | 2021-11-16 |
| 19 | 华宝基金关于旗下部分基金新增国泰君安证券股份有限公司为代销机构的公告 | 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 | 2021-12-1 |
| 20 | 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 | 2021-12-13 |
| 21 | 华宝基金关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为代销机构的公告 | 基金管理人网站,上海证券报,证券日报,证券 | 2021-12-23 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | 时报,中国证券报 | |

# §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

无

## 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；

华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同；

华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书；

华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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**