

国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:国新国证基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2023 年 03 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。本年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年03月06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经审计，中兴华会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2022年01月01日起至2022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 信息披露方式	6
2.5 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	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.....	58
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.....	58
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.....	58
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
8.12 投资组合报告附注.....	59
§ 9 基金份额持有人信息.....	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	60
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	60
§ 10 开放式基金份额变动.....	60
§ 11 重大事件揭示.....	60
11.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
11.4 基金投资策略的改变.....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
11.8 其他重大事件.....	63
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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.....	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§ 13 备查文件目录.....	66
13.1 备查文件目录.....	66
13.2 存放地点.....	66
13.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国新国证新利混合
基金主代码	001797
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 09 月 02 日
基金管理人	国新国证基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,948,261.68 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活运用多种投资策略,把握市场机会,分享中国经济转型和增长的红利,在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采取积极主动的资产配置策略,注重风险与收益的平衡,选择适应经济转型升级、能够为股东持续创造价值的优质标的,运用多样化的投资策略实行组合管理,实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*30%+1 年期人民币定期存款基准利率*70%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。

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		国新国证基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢超	秦一楠
	联系电话	010-59315649	010-66060069
	电子邮箱	xiechao@crsfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-819-0789	95599
传真		010-59315600	010-68121816
注册地址		中国(河北)自由贸易试验区 雄安片区容城县雄安市民服务中心企业办公区 A 栋一层 108 单元	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 11 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	100020	100031
法定代表人	杨铭海	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.crsfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	中兴华会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市丰台区丽泽路 20 号丽泽 SOHO B 座 20 层
注册登记机构	国新国证基金管理有限公司	北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 11 层

§ 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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-491,874.76	323,895.84	139,120.92
本期利润	-522,676.12	233,605.59	91,268.37
加权平均基金份额本期利润	-0.1691	0.0969	0.0186
本期加权平均净值利润率	-18.19%	9.41%	1.94%
本期基金份额净值增长率	-16.19%	9.41%	2.81%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	-183,148.62	168,292.57	-79,594.62
期末可供分配基金份额利润	-0.0940	0.0806	-0.0201
期末基金资产净值	1,765,113.06	2,257,452.32	3,905,800.63
期末基金份额净值	0.906	1.081	0.988
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增	-9.40%	8.10%	-1.20%

长率			
----	--	--	--

注：（1）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。

（2）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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（3）期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数。

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	0.11%	0.80%	0.90%	0.39%	-0.79%	0.41%
过去六个月	-4.73%	0.71%	-3.64%	0.33%	-1.09%	0.38%
过去一年	-16.19%	0.74%	-5.66%	0.38%	-10.53%	0.36%
过去三年	-5.72%	0.78%	2.84%	0.39%	-8.56%	0.39%
过去五年	-10.83%	0.84%	6.49%	0.39%	-17.32%	0.45%
自基金合同生效起至今	-9.40%	0.73%	16.34%	0.38%	-25.74%	0.35%

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

国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年09月02日-2022年12月31日)



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



注：本基金的基金合同自 2015 年 9 月 2 日起生效。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立至今未进行利润分配。

§ 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

国新国证基金管理有限公司（原华融基金管理有限公司，以下简称“国新国证基金”）成立于 2019 年 3 月 1 日，是经中国证监会批准设立的首家及目前唯一一家落户雄安新区的公募基金管理公司及全国性证券类法人机构。国新国证基金股东为国新证券股份有限公司（原华融证券股份有限公司），持股比例 100%。国新国证基金注册资本人民币 2 亿元。自成立以来，国新国证基金秉承“诚信、尽责、专业、奋进”的企业精神，积极创新产品设计开发，创设国内首只雄安主题的公募基金，引导社会资源参与雄安新区运营建设，助力创新科技和京津冀协同发展。融入国新后，国新国证基金秉承国新“国之脉、传承责任之脉，新致远、坚持创新发展”核心价值理念，积极融入国家战略和国有资本运营全局，以“服务央企、服务国家战略”为己任，通过开展央企资本市场深度研究与投资，创设央企主题等创新产品，打造“央企投资特色资管机构”，努力为投资者提供长期稳健的投资回报，共享央企改革增长的红利。

截至报告期末，国新国证基金旗下管理 10 只公募基金产品，为国新国证现金增利货币市场基金、

国新国证新锐灵活配置混合型证券投资基金、国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金、国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金、国新国证荣赢 63 个月定期开放债券型证券投资基金，国新国证融泽 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金，国新国证融兴 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金，国新国证优选配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF），国新国证鑫颐中短债债券型证券投资基金，国新国证鑫裕央企债六个月定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
毕子男	本基金的基金经理、首席投资官	2021-03-03	2022-07-07	25 年	毕子男，吉林大学经济学博士、高级经济师，25 年证券从业经验。2020 年 3 月加入国新国证基金管理有限公司（原华融基金管理有限公司），现任国新国证基金管理有限公司首席投资官。2021 年 3 月 3 日至 2022 年 7 月 7 日担任国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 12 月 15 日至 2022 年 12 月 27 日担任国新国证融兴 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。历任东北证券公司创新业务部总经理、金融与产业研究所常务副所长，国新证券股份有限公司（原华融证券股份有限公司）市场研究部副总经理、资产管理二部总经理。
蒋晓锋	本基金的基金经理、权益投资部负责人	2022-02-21	-	14 年	蒋晓锋，中国农业大学工商管理硕士，14 年证券从业经验。2021 年 8 月加入国新国证基金管理有限公司（原华融基金管理有限公司），现任权益投资部负责人。2022 年 2 月 21 日起担任国新国证新利灵活配置混合型证券投资

					基金的基金经理。曾就职于财富证券有限责任公司北京总部，曾任中邮证券有限责任公司投资经理。
--	--	--	--	--	--

注:1. 对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》及行业协会关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截止本报告期末,本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规规定及《国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

本报告期内,受基金赎回、市场波动及疫情防控等多方面因素影响,本基金管理人通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金占本基金管理人当年所有基金买卖证券交易佣金的比例为 33.52%。该情况不影响基金份额持有人利益。

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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《国新国证基金管理有限公司公平交易管理制度》,并建立了健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

本基金管理人从工作制度、工作流程和技术手段等方面来保证公平交易的实现,并通过监察稽核、事后分析和信息披露等手段来加强对于公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,建立了健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节,本基金管理人构建了统一的研究平台,为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时,在投资决策过程中,各基金经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授

权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对证券交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，发生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% 的情形 2 次，为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年第一季度，国内疫情反复，尤其是深圳、上海等重要城市超预期的疫情，令一些制造业供应链受到考验，部分消费环节承压；与此同时，国外环境也不安稳，美国加息、俄乌冲突等黑天鹅事件，都对全球贸易和资本市场造成了重大影响。在此诸多不利背景下，A 股市场整体情绪是比较悲观的，指数出现了比较大的回撤，上证指数从 3639 点下跌至 2863 点。由于担忧业绩不及预期，多数成长板块先后开始深度调整，整体投资逻辑转向稳增长链条，以地产为代表的困境反转型板块以及相关周期类产业链获得资金青睐，逆势上涨。

二季度，A 股经历了 V 型反弹。原因是在超预期的国内外利空打击后，很多个股跌到了很具性价比的位置，随着对利空的消化，以及 A 股以国内为主的特征愈加明显，在京沪疫情转好之后，股市开启了系统性反弹。上证指数从 2863 点反弹至 3424 点。新能源汽车相关板块和光伏相关板块大幅反弹。整车、汽车零部件、比亚迪产业链、宁德时代产业链、异质结等持续拉升，煤炭板块持续上涨。

三季度，市场出现较大幅度下跌，创业板指数下跌 18.56%、科创 50 指数下跌 15.04%，上证 50 指数下跌 14.66%，沪深 300 下跌 15.16%。具体行业而言，煤炭（中信一级行业指数，以下均同）上涨 4.34%，是三季度唯一正收益的行业。此外，电力及公用事业下跌 3.08%，石油石化下跌 3.36%，房地产下跌 5.68%，交通运输下跌 6.21%，表现相对较好。

四季度，特别是年末时间点，随着疫情防控政策的全面放开，市场各主要指数均触底反弹。四季度创业板指数上涨 2.53%、科创 50 上涨 2.18%、上证 50 上涨 0.96%、沪深 300 上涨 1.75%，风格相对较为均衡。

在基金运作上，上半年，本基金在仓位上维持较低水平，一季度重点配置低估值、低价位、低股价的价值股，二季度适量加配了计算机软件等成长股。而对于二季度表现较好的新能源相关板块，虽然十分看好，但为避免基金净值出现大幅波动，为持有人带来较为负面的投资体验，因此适度控制了相关仓位。从三季度开始至年末，仓位逐步增加，个股选择上主要以低位成长龙头股为主，积极寻找预期差，注重自下而上的寻找优质个股机会，主要把握有 α 的可长期持有的个股机会，规避

一致预期过高且没有明显回调的高景气个股。

本基金始终坚持持有人利益优先的原则，坚持价值投资理念。2022 年，本基金根据国内外宏观环境、行业公司以及市场变化积极调整仓位和持仓结构，整体仓位和配置保持稳健，阶段性参与了计算机、国防军工、食品饮料、房地产和医药等板块的投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国新国证新利混合基金份额净值为 0.906 元，本报告期内，基金份额净值增长率为-16.19%，同期业绩比较基准收益率为-5.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年是国内外经济形势错综复杂的一年。面对贯穿全年的俄乌冲突与新冠疫情反复，国内资本市场遭遇了较大冲击。海外而言，俄乌冲突爆发之后，全球能源商品价格暴涨，海外发达国家面临罕见的通胀考验，大规模加息进程陆续开启，全球市场流动性受到重创。国内而言，疫情的不断反复以及不得已而为之的隔离封控政策对国内经济复苏造成了较大阻碍，大部分企业盈利出现明显下滑。反应到 A 股市场上，便是历史三连阳遭到终结，全年受事件带动呈现出一波三折、不断走低的状态。至去年末，经过中央对国内疫情的充分考量，疫情管制全面放开，同时各项内需刺激政策开始陆续出台，经济回升预期不断走强。海外发达国家面临经济衰退风险，加息步伐不断放缓，全球流动性持续改善。

总体而言，在宏观经济上，我们认为弱复苏与宽流动性是全年大背景。经济复苏上，一方面海外衰退预期压制国内出口，另一方面政策刺激与市场预期改善下，内需延续修复态势。流动性上，海外加息步伐放缓，同时国内稳增长目标明确，亦需相对宽松的货币环境予以配合。

对于市场未来走势，经济弱复苏下，预计成长股表现将相对较好。板块上重点看好科创板，从 2018 年贸易战始，全球范围单边主义、保护主义快速升温，2022 年俄乌冲突更将逆全球化格局进一步深化。在此背景下，中国加强科技自主、维护国家安全重要性与日俱增。科创板作为定位于“服务于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业”，在产业分布上硬科技属性鲜明，是科技创新的领头羊，同时板块前期已经历充分调整，后期上升空间较为充足。行业上重点看好与数字经济、人工智能等概念联系密切的行业，数字经济等新兴科技行业是现代化产业的典型代表，是加快构建新发展格局的重要手段，也是 2023 年各地方政府稳经济的重要发力方向，相关行业板块无论从政策扶持还是业绩修复上都将获得明显改善。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人高度重视监察稽核工作，持续推进内部控制体系建设，按照法律法规、监管政策及公司章程要求，完善各项监察稽核及内部控制制度，并实施有效的合规管理、监察稽核、内控审计措施。

在合规管理方面，本基金管理人以严格遵守法律法规、监管政策及内部制度为基本要求，形成守法经营、规范运作的经营思想和理念，重视合规文化建设，并将防范合规风险作为合规管理工作

的重要目标。本报告期内，本基金管理人切实落实各项合规管理职责，实现合规审查、合规检查、合规咨询、合规培训等合规管理措施常态化、规范化运作，合规管理覆盖投资、研究、交易、销售、宣传推介、信息披露等业务条线。此外，本基金管理人推进完善合规考核及问责机制，加强员工合规行为管理。本报告期内，本基金管理人有效落实各项合规管理要求，合规管理情况良好。

在监察稽核方面，本基金管理人每季度开展定期内部稽核工作，不定期开展专项稽核工作，按照稽核工作计划，对各业务条线进行监督、检查，排查业务风险隐患。本报告期内，本基金管理人监察稽核工作有序进行，对业务运作情况实现有效监督。

在内控审计方面，本基金管理人由指定部门开展内部控制检查，完善内部控制机制。此外，本基金管理人按照法律法规规定，聘任具备相应业务资格的会计师事务所对内部控制情况进行审计、评价。本报告期内，本基金管理人内控审计工作开展情况良好。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（主任委员由分管基金运营部的公司领导担任，副主任由公司主管基金运营部的部门领导担任，委员由投资、研究、风控、运营等部门负责人或业务骨干组成），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。基金运营部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内依据基金合同的约定和基金运作情况，未进行利润分配。

4.9 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

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数量不满二百人的情形。

本基金自 2017 年 9 月 5 日起存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。依据《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会报备。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国新国证基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，国新国证基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、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问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，国新国证基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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	中兴华审字（2023）第 010839 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	国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金全体份额持有人
审计意见	我们审计了国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的国新国证新利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，公允反映了国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 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，我们独立于国新国证新利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	无。
其他事项	无。
其他信息	国新国证新利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，管理层负责评估国新国证新利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，并运用持续经营假设，除非管理层计划清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督国新国证新利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，就可能导致对国新国证新利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国新国证新利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、结构和内容（包括披露），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	中兴华会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	乔迪	赵志刚
会计师事务所的地址	北京市丰台区丽泽路 20 号丽泽 SOHO B 座 20 层	
审计报告日期	2023-03-30	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	271,912.49	213,016.98
结算备付金		68,612.32	19,339.34
存出保证金		6,056.42	2,601.99
交易性金融资产	7.4.7.2	1,436,321.00	1,538,145.00
其中：股票投资		1,436,321.00	1,538,145.00
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	500,000.00
债权投资		—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资		—	—

其他权益工具投资		-	-
应收清算款		26,025.66	31,095.43
应收股利		-	-
应收申购款		-	99.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-93.10
资产总计		1,808,927.89	2,304,205.52
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	64.72
应付管理人报酬		902.23	1,145.87
应付托管费		225.54	286.46
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	42,687.06	45,256.15
负债合计		43,814.83	46,753.20
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	1,948,261.68	2,089,159.75
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-183,148.62	168,292.57
净资产合计		1,765,113.06	2,257,452.32
负债和净资产总计		1,808,927.89	2,304,205.52

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.906 元，基金份额总额 1,948,261.68 份。

7.2 利润表

会计主体：国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-459,736.76	370,919.95
1. 利息收入		19,337.72	12,885.62

其中：存款利息收入	7.4.7.9	13,051.03	4,233.72
债券利息收入		-	1,068.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,286.69	7,583.33
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-491,878.90	446,829.14
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-495,548.48	419,798.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	521.80	4,202.06
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	3,147.78	22,828.99
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-30,801.36	-90,290.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	43,605.78	1,495.44
减：二、营业总支出		62,939.36	137,314.36
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	17,275.55	14,879.63
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,319.00	3,719.87
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	1.84
8. 其他费用	7.4.7.18	41,344.81	118,713.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-522,676.12	233,605.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-522,676.12	233,605.59
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-522,676.12	233,605.59

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	2,089,159.75	-	168,292.57	2,257,452.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,089,159.75	-	168,292.57	2,257,452.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-140,898.07	-	-351,441.19	-492,339.26
（一）、综合收益总额	-	-	-522,676.12	-522,676.12
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-140,898.07	-	171,234.93	30,336.86
其中：1. 基金申购款	11,339,393.68	-	-1,058,866.49	10,280,527.19
2. 基金赎回款	-11,480,291.75	-	1,230,101.42	-10,250,190.33
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,948,261.68	-	-183,148.62	1,765,113.06
项 目	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	3,954,546.23	-	-48,745.60	3,905,800.63
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	3,954,546.23	-	-48,745.60	3,905,800.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,865,386.48	-	217,038.17	-1,648,348.31
（一）、综合收益总额	-	-	233,605.59	233,605.59
（二）、本期基金份额交易产	-1,865,386.48	-	-16,567.42	-1,881,953.90

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	536,204.24	-	8,443.07	544,647.31
2. 基金赎回款	-2,401,590.72	-	-25,010.49	-2,426,601.21
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,089,159.75	-	168,292.57	2,257,452.32

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：

丁卓	赵天智	单国巍
-----	-----	-----
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

国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金（原华融新利灵活配置混合型证券投资基金，以下简称“本基金”）于 2015 年 8 月 5 日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]1907 号文）核准，由国新证券股份有限公司（原华融证券股份有限公司）依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2015 年 9 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 263,756,837.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 11,080.92 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金原基金管理人为国新证券股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金于 2019 年 8 月 20 日在中国证监会变更注册（证监许可[2019]1524 号文），于 2019 年 11 月 13 日公告基金份额持有人大会决议生效，于 2020 年 4 月 27 日公告变更基金管理人为国新国证基金管理有限公司（原华融基金管理有限公司）。本基金管理人于 2022 年 12 月 7 日发布基金名称变更公告，本基金名称由华融新利灵活配置混合型证券投资基金变更为国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、债券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金将基金资产的 0%-95% 投资于股票，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*30%+1 年期人民币定期存款基准利率*70%。

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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 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

本基金 2022 年度财务报表所载财务信息根据企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定所制定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

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和金融负债，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，

采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

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。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（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；

(6) 公允价值变动收益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；

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息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利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入

额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，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) 投资人的现金红利保留到小数点后第 2 位，由此产生的损益由基金资产承担。

(5) 本基金每份基金份额享有同等分配权。

(6) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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

执行新金融工具准则及《资产管理产品相关会计处理规定》：

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规

的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 213,016.98 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 94.47 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 213,111.45 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 19,339.34 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 8.70 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 19,348.04 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,601.99 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1.20 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,603.19 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 500,000.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币-197.47 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 499,802.53 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 99.88 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 99.88 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币-93.10 元，转出至

银行存款的重分类金额为人民币 94.47 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 8.70 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 1.20 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币-197.47 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

本基金自 2022 年 7 月 1 日起施行《资产管理产品相关会计处理规定》，并按相关衔接规定进行了处理。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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，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（以下简称“资管产品运营业务”），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。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 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[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。

7.4.6.4 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	271,912.49	213,016.98
等于：本金	271,842.44	213,016.98
加：应计利息	70.05	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	271,912.49	213,016.98

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,445,231.34	-	1,436,321.00	-8,910.34
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,445,231.34	-	1,436,321.00	-8,910.34
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,516,253.98	-	1,538,145.00	21,891.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,516,253.98	-	1,538,145.00	21,891.02

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期及上年度可比期间，本基金未持有衍生金融资产/负债。

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	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	500,000.00	-

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。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	-93.10
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	-93.10

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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	-	-
应付交易费用	22,687.06	5,256.15
其中：交易所市场	22,687.06	5,256.15

银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	20,000.00	40,000.00
合计	42,687.06	45,256.15

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,089,159.75	2,089,159.75
本期申购	11,339,393.68	11,339,393.68
本期赎回（以“-”号填列）	-11,480,291.75	-11,480,291.75
本期末	1,948,261.68	1,948,261.68

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 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
本期期初	229,168.17	-60,875.60	168,292.57
本期利润	-491,874.76	-30,801.36	-522,676.12
本期基金份额交易产生的变动数	136,943.93	34,291.00	171,234.93
其中：基金申购款	-553,208.31	-505,658.18	-1,058,866.49
基金赎回款	690,152.24	539,949.18	1,230,101.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-125,762.66	-57,385.96	-183,148.62

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	12,279.75	3,418.72
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	701.13	770.93

其他	70.15	44.07
合计	13,051.03	4,233.72

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	44,306,476.93	22,220,435.68
减：卖出股票成本总额	44,685,872.68	21,800,637.59
减：交易费用	116,152.73	—
买卖股票差价收入	-495,548.48	419,798.09

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	0.39	—
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	521.41	4,202.06
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	521.80	4,202.06

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,521.80	389,979.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,000.00	382,436.41
减：应计利息总额	0.39	3,341.51
减：交易费用	—	—
买卖债券差价收入	521.41	4,202.06

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,147.78	22,828.99
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	3,147.78	22,828.99

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-30,801.36	-90,290.25
——股票投资	-30,801.36	-86,959.96
——债券投资	-	-3,330.29
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-30,801.36	-90,290.25

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	43,604.29	1,495.44
转换费收入	1.49	-
合计	43,605.78	1,495.44

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	20,000.00	40,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
其他费用	-	-
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费	3,344.81	2,905.00
交易费用	-	57,808.02
合计	41,344.81	118,713.02

7.4.7.19 分部报告

本基金本报告期无分部报告。

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

截至本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
国新国证基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国新证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构、原基金管理人

国新资本有限公司	基金管理人股东的控股股东（2022 年 6 月 22 日之后）
中国国新控股有限责任公司	基金管理人的实际控制人（2022 年 6 月 22 日之后）
国新国证投资管理有限公司	基金管理人股东控股的公司
国新国证期货有限责任公司	基金管理人股东控股的公司
中国华融资产管理股份有限公司	基金管理人股东的控股股东（2022 年 6 月 22 日之前）

注：（1）根据 2022 年 6 月 22 日中国证监会作出的《关于核准华融证券股份有限公司变更主要股东、实际控制人及华融基金管理有限公司变更实际控制人的批复》（证监许可〔2022〕1324 号），本基金管理人的股东华融证券股份有限公司的主要股东，由中国华融资产管理股份有限公司变更为国新资本有限公司，中国国新控股有限责任公司成为本基金管理人的实际控制人。本基金管理人的股东华融证券股份有限公司的名称，已于 2022 年 7 月 29 日变更为国新证券股份有限公司。为便于披露，本基金与中国华融资产管理股份有限公司相关单位的关联交易，统计期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日，2022 年 12 月 31 日与其往来余额不再披露。

（2）以下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

本基金报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金报告期及上年度可比期间，无应支付的关联方佣金。

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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	17,275.55	14,879.63
其中：支付销售机构的客户维护费	5,704.32	6,055.95

注：①支付基金管理人的基金管理费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。

②基金管理费计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,319.00	3,719.87

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/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

本报告期及上年度可比期间，本基金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

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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，除基金管理人之外的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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日 至 2021 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
中国农业银行股份 有限公司	271,912.49	12,279.75	213,016.98	3,418.72

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联方交易事项。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2022 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

本报告期末，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以合规与风险控制委员会为核心，由合规与风险控制委员会、督察长、风险管理部、法律合规/监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

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同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合法律法规的要求、监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系，对发行人及债券进行内部评级，控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在托管行。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并设定交易额度，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持的全部证券在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

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岗位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期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%。

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。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。

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办法：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；在开展逆回购交易时，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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月 以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	271,912.49	-	-	-	-	-	271,912.49
结算备付金	68,612.32	-	-	-	-	-	68,612.32
存出保证金	6,056.42	-	-	-	-	-	6,056.42
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	1,436,321.00	1,436,321.00
应收清算款	-	-	-	-	-	26,025.66	26,025.66
资产总计	346,581.23	-	-	-	-	1,462,346.66	1,808,927.89
负债							
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	902.23	902.23
应付托管费	-	-	-	-	-	225.54	225.54

其他负债	-	-	-	-	-	42,687.06	42,687.06
负债总计	-	-	-	-	-	43,814.83	43,814.83
利率敏感度缺口	346,581.23	-	-	-	-	1,418,531.83	1,765,113.06
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月 以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	213,016.98	-	-	-	-	-	213,016.98
结算备付金	19,339.34	-	-	-	-	-	19,339.34
存出保证金	2,601.99	-	-	-	-	-	2,601.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,538,145.00	1,538,145.00
买入返售金融资产	500,000.00	-	-	-	-	-	500,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-	31,095.43	31,095.43
应收申购款	-	-	-	-	-	99.88	99.88
其他资产	-	-	-	-	-	-93.10	-93.10
资产总计	734,958.31	-	-	-	-	1,569,247.21	2,304,205.52
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	64.72	64.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,145.87	1,145.87
应付托管费	-	-	-	-	-	286.46	286.46
其他负债	-	-	-	-	-	45,256.15	45,256.15
负债总计	-	-	-	-	-	46,753.20	46,753.20
利率敏感度缺口	734,958.31	-	-	-	-	1,522,494.01	2,257,452.32

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票

价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,436,321.00	81.37	1,538,145.00	68.14
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	1,436,321.00	81.37	1,538,145.00	68.14

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	34,419.70	53,050.13
	沪深 300 指数下降 5%	-34,419.70	-53,050.13

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,436,321.00	1,538,145.00
第二层次	—	—
第三层次	—	—
合计	1,436,321.00	1,538,145.00

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无有助于理解和分析报表需要说明的其他事项。

§ 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	1,436,321.00	79.40
	其中：股票	1,436,321.00	79.40
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	340,524.81	18.82
8	其他各项资产	32,082.08	1.78
9	合计	1,808,927.89	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	454,511.00	25.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	45,800.00	2.59
F	批发和零售业	36,500.00	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	784,870.00	44.47
J	金融业	-	-
K	房地产业	31,300.00	1.77
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	83,340.00	4.72
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,436,321.00	81.37

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	占基金资产净值比例（%）
1	688095	福昕软件	2,200	136,796.00	7.75
2	688375	国博电子	1,400	134,106.00	7.60
3	688793	倍轻松	2,000	98,060.00	5.56
4	002607	中公教育	18,000	83,340.00	4.72
5	688207	格灵深瞳	3,000	69,000.00	3.91
6	688088	虹软科技	3,000	67,530.00	3.83
7	688109	品茗科技	2,000	56,600.00	3.21
8	688118	普元信息	3,000	53,070.00	3.01
9	688175	高凌信息	1,500	52,665.00	2.98
10	688296	和达科技	2,000	51,740.00	2.93
11	300288	朗玛信息	4,600	51,014.00	2.89
12	000066	中国长城	5,000	51,000.00	2.89
13	688225	亚信安全	3,000	50,730.00	2.87

14	688252	天德钰	3,000	50,310.00	2.85
15	688256	寒武纪	900	49,104.00	2.78
16	688228	开普云	1,500	47,400.00	2.69
17	603516	淳中科技	3,500	45,850.00	2.60
18	601868	中国能建	20,000	45,800.00	2.59
19	688362	甬矽电子	2,000	43,580.00	2.47
20	688391	钜泉科技	400	40,236.00	2.28
21	688227	品高股份	2,000	39,260.00	2.22
22	601933	永辉超市	10,000	36,500.00	2.07
23	600094	大名城	10,000	31,300.00	1.77
24	600851	海欣股份	5,000	29,250.00	1.66
25	603918	金桥信息	3,000	22,080.00	1.25

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	688095	福昕软件	3,004,714.67	133.10
2	688111	金山办公	1,799,319.99	79.71
3	000002	万科 A	1,312,319.00	58.13
4	688083	中望软件	976,526.05	43.26
5	688798	艾为电子	758,837.60	33.61
6	688375	国博电子	619,178.32	27.43
7	601155	新城控股	613,832.00	27.19
8	603000	人民网	581,255.00	25.75
9	000858	五粮液	513,237.00	22.74
10	601868	中国能建	473,740.00	20.99
11	601236	红塔证券	463,386.00	20.53
12	002371	北方华创	428,208.00	18.97
13	603260	合盛硅业	425,742.00	18.86
14	688608	恒玄科技	384,578.00	17.04
15	000888	峨眉山 A	346,483.00	15.35
16	688793	倍轻松	345,248.66	15.29
17	601318	中国平安	341,720.00	15.14
18	688228	开普云	337,102.00	14.93
19	688787	海天瑞声	330,848.00	14.66
20	688318	财富趋势	325,753.59	14.43
21	002044	美年健康	321,577.00	14.25
22	688311	盟升电子	303,423.00	13.44
23	002128	电投能源	291,600.00	12.92
24	600702	舍得酒业	285,618.00	12.65
25	688682	霍莱沃	277,164.00	12.28

26	601888	中国中免	274,513.00	12.16
27	600118	中国卫星	273,650.00	12.12
28	603688	石英股份	259,867.00	11.51
29	600863	内蒙华电	256,460.00	11.36
30	688256	寒武纪	255,547.00	11.32
31	688088	虹软科技	255,474.00	11.32
32	002607	中公教育	247,260.00	10.95
33	688168	安博通	236,918.27	10.49
34	001201	东瑞股份	236,447.00	10.47
35	603259	药明康德	234,164.00	10.37
36	002241	歌尔股份	224,020.00	9.92
37	601766	中国中车	218,360.00	9.67
38	688109	品茗科技	210,445.00	9.32
39	688561	奇安信	207,377.00	9.19
40	002352	顺丰控股	207,049.00	9.17
41	688271	联影医疗	204,908.00	9.08
42	688227	品高股份	196,733.00	8.71
43	002926	华西证券	196,450.00	8.70
44	605339	南侨食品	192,571.00	8.53
45	000651	格力电器	175,680.00	7.78
46	688207	格灵深瞳	174,563.51	7.73
47	688225	亚信安全	174,352.74	7.72
48	600872	中炬高新	168,886.00	7.48
49	600837	海通证券	165,270.00	7.32
50	601633	长城汽车	164,410.00	7.28
51	600150	中国船舶	163,955.00	7.26
52	603888	新华网	162,139.00	7.18
53	000776	广发证券	158,600.00	7.03
54	600383	金地集团	156,719.00	6.94
55	300498	温氏股份	153,385.00	6.79
56	300027	华谊兄弟	150,260.00	6.66
57	002515	金字火腿	149,200.00	6.61
58	603336	宏辉果蔬	147,380.00	6.53
59	688258	卓易信息	146,815.00	6.50
60	601012	隆基绿能	146,175.00	6.48
61	688622	禾信仪器	145,097.00	6.43
62	600095	湘财股份	144,700.00	6.41
63	603212	赛伍技术	143,050.00	6.34
64	300338	开元教育	141,376.00	6.26
65	300347	泰格医药	141,022.00	6.25
66	688012	中微公司	140,118.00	6.21
67	002330	得利斯	139,100.00	6.16
68	603019	中科曙光	138,296.00	6.13

69	688246	嘉和美康	138,233.80	6.12
70	600823	世茂股份	137,400.00	6.09
71	688296	和达科技	135,940.00	6.02
72	002507	涪陵榨菜	132,866.00	5.89
73	688286	敏芯股份	132,840.00	5.88
74	600094	大名城	132,120.00	5.85
75	000796	凯撒旅业	130,160.00	5.77
76	002821	凯莱英	129,958.00	5.76
77	601319	中国人保	126,340.00	5.60
78	300454	深信服	124,532.00	5.52
79	000978	桂林旅游	124,094.00	5.50
80	300908	仲景食品	123,955.00	5.49
81	603712	七一二	123,690.00	5.48
82	001979	招商蛇口	121,828.00	5.40
83	000799	酒鬼酒	121,610.00	5.39
84	600546	山煤国际	119,811.00	5.31
85	600011	华能国际	119,490.00	5.29
86	000630	铜陵有色	119,150.00	5.28
87	601995	中金公司	118,690.00	5.26
88	601010	文峰股份	117,400.00	5.20
89	603858	步长制药	117,150.00	5.19
90	002959	小熊电器	117,055.00	5.19
91	301367	怡和嘉业	116,520.00	5.16
92	688680	海优新材	115,072.00	5.10
93	000863	三湘印象	113,480.00	5.03
94	301129	瑞纳智能	113,451.00	5.03
95	300288	朗玛信息	112,670.00	4.99
96	601111	中国国航	110,880.00	4.91
97	601601	中国太保	110,670.00	4.90
98	000807	云铝股份	110,660.00	4.90
99	603501	韦尔股份	110,652.00	4.90
100	002939	长城证券	109,880.00	4.87
101	600362	江西铜业	108,770.00	4.82
102	688208	道通科技	106,773.92	4.73
103	601933	永辉超市	106,350.00	4.71
104	002858	力盛体育	105,000.00	4.65
105	601528	瑞丰银行	103,372.00	4.58
106	600266	城建发展	103,350.00	4.58
107	688056	莱伯泰科	103,240.00	4.57
108	000739	普洛药业	102,690.00	4.55
109	688023	安恒信息	102,622.00	4.55
110	300673	佩蒂股份	101,788.00	4.51
111	600027	华电国际	100,986.00	4.47

112	300383	光环新网	100,970.00	4.47
113	603707	健友股份	100,605.00	4.46
114	688136	科兴制药	99,510.00	4.41
115	002444	巨星科技	98,099.00	4.35
116	688432	有研硅	97,590.00	4.32
117	300017	网宿科技	97,550.00	4.32
118	601007	金陵饭店	97,419.00	4.32
119	603536	惠发食品	97,260.00	4.31
120	688180	君实生物	96,917.00	4.29
121	300568	星源材质	96,800.00	4.29
122	002343	慈文传媒	96,700.00	4.28
123	300719	安达维尔	95,970.00	4.25
124	600716	凤凰股份	95,600.00	4.23
125	603160	汇顶科技	95,306.00	4.22
126	601212	白银有色	95,200.00	4.22
127	600456	宝钛股份	94,000.00	4.16
128	601688	华泰证券	93,140.00	4.13
129	002566	益盛药业	92,900.00	4.12
130	000961	中南建设	92,100.00	4.08
131	300175	朗源股份	91,758.00	4.06
132	688383	新益昌	91,108.00	4.04
133	688315	诺禾致源	90,812.00	4.02
134	601336	新华保险	89,725.00	3.97
135	605155	西大门	89,000.00	3.94
136	000975	银泰黄金	88,400.00	3.92
137	688213	思特威	88,310.00	3.91
138	688118	普元信息	87,830.00	3.89
139	688006	杭可科技	86,674.96	3.84
140	688628	优利德	86,210.00	3.82
141	300171	东富龙	85,930.00	3.81
142	000166	申万宏源	85,630.00	3.79
143	688222	成都先导	84,800.00	3.76
144	600138	中青旅	83,520.00	3.70
145	688137	近岸蛋白	82,195.00	3.64
146	688126	沪硅产业	81,510.00	3.61
147	600009	上海机场	80,400.00	3.56
148	688050	爱博医疗	80,000.00	3.54
149	600588	用友网络	79,900.00	3.54
150	600048	保利发展	78,725.00	3.49
151	000031	大悦城	78,500.00	3.48
152	600906	财达证券	77,900.00	3.45
153	688323	瑞华泰	77,774.96	3.45
154	002970	锐明技术	77,566.00	3.44

155	600585	海螺水泥	76,340.00	3.38
156	601099	太平洋	75,950.00	3.36
157	603629	利通电子	75,300.00	3.34
158	688133	泰坦科技	75,251.32	3.33
159	300433	蓝思科技	74,530.00	3.30
160	600466	蓝光发展	74,300.00	3.29
161	688185	康希诺	73,546.00	3.26
162	600429	三元股份	73,450.00	3.25
163	688728	格科微	72,850.00	3.23
164	000430	张家界	72,270.00	3.20
165	688036	传音控股	71,655.36	3.17
166	688789	宏华数科	71,061.95	3.15
167	300894	火星人	70,070.00	3.10
168	601857	中国石油	69,390.00	3.07
169	601066	中信建投	69,050.00	3.06
170	600763	通策医疗	69,039.00	3.06
171	688029	南微医学	68,740.00	3.05
172	605507	国邦医药	67,465.00	2.99
173	300595	欧普康视	67,435.00	2.99
174	300496	中科创达	67,328.00	2.98
175	605208	永茂泰	66,560.00	2.95
176	600745	闻泰科技	65,166.00	2.89
177	688599	天合光能	65,010.00	2.88
178	002431	棕榈股份	64,600.00	2.86
179	688526	科前生物	63,634.72	2.82
180	600926	杭州银行	63,255.00	2.80
181	300467	迅游科技	62,605.00	2.77
182	603506	南都物业	61,478.00	2.72
183	603658	安图生物	61,150.00	2.71
184	688578	艾力斯	61,100.00	2.71
185	600425	青松建化	60,650.00	2.69
186	000501	武商集团	59,960.00	2.66
187	605318	法狮龙	59,762.00	2.65
188	601156	东航物流	59,260.00	2.63
189	688232	新点软件	58,785.00	2.60
190	605338	巴比食品	58,597.00	2.60
191	600779	水井坊	58,579.00	2.59
192	688116	天奈科技	58,510.00	2.59
193	000793	华闻集团	58,150.00	2.58
194	002492	恒基达鑫	58,000.00	2.57
195	601899	紫金矿业	57,750.00	2.56
196	300133	华策影视	56,600.00	2.51
197	002348	高乐股份	56,598.00	2.51

198	000561	烽火电子	56,000.00	2.48
199	002228	合兴包装	55,980.00	2.48
200	000061	农产品	55,900.00	2.48
201	600050	中国联通	54,950.00	2.43
202	601628	中国人寿	54,825.00	2.43
203	688520	神州细胞	54,575.00	2.42
204	300616	尚品宅配	54,540.00	2.42
205	002304	洋河股份	54,472.00	2.41
206	300427	红相股份	53,946.00	2.39
207	002737	葵花药业	53,885.00	2.39
208	601869	长飞光纤	53,843.00	2.39
209	688039	当虹科技	53,715.00	2.38
210	002718	友邦吊顶	52,920.00	2.34
211	688510	航亚科技	52,830.00	2.34
212	002928	华夏航空	52,368.00	2.32
213	600219	南山铝业	52,300.00	2.32
214	002385	大北农	52,290.00	2.32
215	002861	瀛通通讯	52,250.00	2.31
216	603587	地素时尚	52,230.00	2.31
217	000008	神州高铁	51,800.00	2.29
218	002075	沙钢股份	51,700.00	2.29
219	000596	古井贡酒	51,698.00	2.29
220	000677	恒天海龙	51,640.00	2.29
221	600497	驰宏锌锗	51,300.00	2.27
222	002275	桂林三金	50,883.00	2.25
223	601696	中银证券	50,865.00	2.25
224	000066	中国长城	50,860.00	2.25
225	688252	天德钰	50,790.00	2.25
226	300676	华大基因	50,583.00	2.24
227	002468	申通快递	50,500.00	2.24
228	301117	佳缘科技	50,351.00	2.23
229	003042	中农联合	50,335.00	2.23
230	600712	南宁百货	50,281.00	2.23
231	301234	五洲医疗	50,160.00	2.22
232	300743	天地数码	49,920.00	2.21
233	688175	高凌信息	49,718.70	2.20
234	600036	招商银行	49,660.00	2.20
235	002376	新北洋	49,500.00	2.19
236	600958	东方证券	49,440.00	2.19
237	002277	友阿股份	49,200.00	2.18
238	600882	妙可蓝多	49,180.00	2.18
239	000558	莱茵体育	49,150.00	2.18
240	688577	浙海德曼	49,140.00	2.18

241	688303	大全能源	49,092.00	2.17
242	300164	通源石油	48,800.00	2.16
243	688779	长远锂科	48,700.00	2.16
244	300369	绿盟科技	48,600.00	2.15
245	002087	新野纺织	48,290.00	2.14
246	600570	恒生电子	48,215.00	2.14
247	688321	微芯生物	48,195.00	2.13
248	600855	航天长峰	48,180.00	2.13
249	688105	诺唯赞	48,062.00	2.13
250	603533	掌阅科技	48,060.00	2.13
251	601600	中国铝业	48,000.00	2.13
252	000989	九芝堂	47,942.00	2.12
253	688799	华纳药厂	47,805.00	2.12
254	603345	安井食品	47,794.00	2.12
255	600566	济川药业	47,365.00	2.10
256	300832	新产业	47,280.00	2.09
257	688237	超卓航科	47,112.00	2.09
258	000697	炼石航空	47,039.00	2.08
259	603583	捷昌驱动	46,750.00	2.07
260	603516	淳中科技	46,725.00	2.07
261	688521	芯原股份	46,680.00	2.07
262	601211	国泰君安	46,600.00	2.06
263	688098	申联生物	46,530.00	2.06
264	000876	新希望	46,440.00	2.06
265	600685	中船防务	46,400.00	2.06
266	601089	福元医药	46,350.00	2.05
267	002297	博云新材	45,840.00	2.03
268	002315	焦点科技	45,758.00	2.03
269	688362	甬矽电子	45,740.00	2.03
270	688013	天臣医疗	45,570.00	2.02
271	300996	普联软件	45,500.00	2.02
272	300291	百纳千成	45,450.00	2.01
273	001206	依依股份	45,375.00	2.01

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	688095	福昕软件	2,843,854.01	125.98
2	688111	金山办公	1,831,873.54	81.15
3	000002	万科 A	1,382,154.00	61.23
4	688083	中望软件	954,979.14	42.30
5	688798	艾为电子	754,480.00	33.42

6	601155	新城控股	606,750.00	26.88
7	603000	人民网	574,260.00	25.44
8	000858	五粮液	513,622.00	22.75
9	688375	国博电子	491,987.08	21.79
10	601236	红塔证券	460,290.00	20.39
11	601868	中国能建	433,100.00	19.19
12	002371	北方华创	422,788.00	18.73
13	603260	合盛硅业	418,474.00	18.54
14	688608	恒玄科技	368,436.00	16.32
15	601318	中国平安	344,110.00	15.24
16	000888	峨眉山 A	340,188.00	15.07
17	002044	美年健康	339,719.21	15.05
18	688787	海天瑞声	324,357.70	14.37
19	688318	财富趋势	322,338.00	14.28
20	688311	盟升电子	312,035.00	13.82
21	688228	开普云	289,688.43	12.83
22	002128	电投能源	280,100.00	12.41
23	688682	霍莱沃	274,507.00	12.16
24	600118	中国卫星	274,058.00	12.14
25	601888	中国中免	270,758.00	11.99
26	600702	舍得酒业	269,752.00	11.95
27	603688	石英股份	261,456.00	11.58
28	688793	倍轻松	256,237.91	11.35
29	002241	歌尔股份	252,264.00	11.17
30	600863	内蒙华电	251,180.00	11.13
31	001201	东瑞股份	246,772.00	10.93
32	688168	安博通	238,172.98	10.55
33	603259	药明康德	233,981.00	10.36
34	601012	隆基绿能	228,098.00	10.10
35	601766	中国中车	216,720.00	9.60
36	002352	顺丰控股	210,514.00	9.33
37	688271	联影医疗	206,128.47	9.13
38	688561	奇安信	205,390.33	9.10
39	688256	寒武纪	203,294.00	9.01
40	002926	华西证券	193,200.00	8.56
41	605339	南侨食品	192,960.00	8.55
42	000651	格力电器	182,460.00	8.08
43	688088	虹软科技	181,672.02	8.05
44	002607	中公教育	177,800.00	7.88
45	600872	中炬高新	173,840.00	7.70
46	603501	韦尔股份	164,824.00	7.30
47	600837	海通证券	164,030.00	7.27
48	600383	金地集团	162,140.00	7.18

49	688227	品高股份	159,142.65	7.05
50	300027	华谊兄弟	158,800.00	7.03
51	600150	中国船舶	158,705.00	7.03
52	600048	保利发展	157,925.00	7.00
53	601633	长城汽车	156,640.00	6.94
54	300498	温氏股份	155,760.00	6.90
55	688622	禾信仪器	152,114.46	6.74
56	000776	广发证券	151,800.00	6.72
57	603888	新华网	151,670.00	6.72
58	688109	品茗科技	149,775.00	6.63
59	002515	金字火腿	149,650.00	6.63
60	688246	嘉和美康	148,069.00	6.56
61	600095	湘财股份	146,600.00	6.49
62	688258	卓易信息	145,949.56	6.47
63	603336	宏辉果蔬	145,070.00	6.43
64	688006	杭可科技	144,776.00	6.41
65	600823	世茂股份	144,300.00	6.39
66	300347	泰格医药	142,560.00	6.32
67	002330	得利斯	141,600.00	6.27
68	600219	南山铝业	138,580.00	6.14
69	688012	中微公司	137,270.00	6.08
70	603212	赛伍技术	136,410.00	6.04
71	603019	中科曙光	134,404.00	5.95
72	002507	涪陵榨菜	133,444.00	5.91
73	002821	凯莱英	132,332.00	5.86
74	300338	开元教育	130,343.00	5.77
75	603712	七一二	129,768.00	5.75
76	688286	敏芯股份	127,215.00	5.64
77	300908	仲景食品	126,811.00	5.62
78	601319	中国人保	126,280.00	5.59
79	300454	深信服	125,882.00	5.58
80	000796	凯撒旅业	125,240.00	5.55
81	000978	桂林旅游	123,400.00	5.47
82	001979	招商蛇口	122,659.00	5.43
83	600011	华能国际	121,730.00	5.39
84	601995	中金公司	120,470.00	5.34
85	688225	亚信安全	119,061.90	5.27
86	600546	山煤国际	118,400.00	5.24
87	601010	文峰股份	118,050.00	5.23
88	000799	酒鬼酒	117,379.00	5.20
89	000630	铜陵有色	117,150.00	5.19
90	603858	步长制药	116,580.00	5.16
91	002858	力盛体育	114,500.00	5.07

92	002959	小熊电器	113,266.00	5.02
93	301367	怡和嘉业	111,741.00	4.95
94	601601	中国太保	110,800.00	4.91
95	000863	三湘印象	109,920.00	4.87
96	600362	江西铜业	109,787.00	4.86
97	601111	中国国航	109,400.00	4.85
98	688680	海优新材	109,155.00	4.84
99	300673	佩蒂股份	107,966.00	4.78
100	688056	莱伯泰科	107,663.00	4.77
101	002444	巨星科技	107,320.00	4.75
102	688023	安恒信息	107,172.00	4.75
103	301129	瑞纳智能	106,305.00	4.71
104	688207	格灵深瞳	106,213.60	4.71
105	600094	大名城	103,830.00	4.60
106	000807	云铝股份	103,810.00	4.60
107	002939	长城证券	103,450.00	4.58
108	688208	道通科技	103,172.00	4.57
109	000739	普洛药业	103,148.00	4.57
110	603707	健友股份	102,695.00	4.55
111	600266	城建发展	102,050.00	4.52
112	002343	慈文传媒	101,690.00	4.50
113	603536	惠发食品	100,240.00	4.44
114	688180	君实生物	100,015.38	4.43
115	600027	华电国际	99,400.00	4.40
116	300383	光环新网	99,390.00	4.40
117	601528	瑞丰银行	99,180.00	4.39
118	688050	爱博医疗	98,000.00	4.34
119	688315	诺禾致源	97,963.46	4.34
120	688136	科兴制药	96,540.00	4.28
121	603160	汇顶科技	96,390.00	4.27
122	600926	杭州银行	95,315.00	4.22
123	601007	金陵饭店	93,674.00	4.15
124	605155	西大门	93,167.00	4.13
125	601336	新华保险	92,835.00	4.11
126	300568	星源材质	92,828.00	4.11
127	601688	华泰证券	92,541.00	4.10
128	600716	凤凰股份	92,181.00	4.08
129	601212	白银有色	90,662.00	4.02
130	688296	和达科技	90,460.00	4.01
131	688432	有研硅	90,300.00	4.00
132	600456	宝钛股份	89,800.00	3.98
133	002566	益盛药业	89,750.00	3.98
134	000961	中南建设	89,000.00	3.94

135	000975	银泰黄金	87,820.00	3.89
136	300719	安达维尔	87,270.00	3.87
137	688213	思特威	86,730.00	3.84
138	000166	申万宏源	86,600.00	3.84
139	688222	成都先导	85,480.00	3.79
140	688383	新益昌	85,295.00	3.78
141	300175	朗源股份	84,703.00	3.75
142	300017	网宿科技	84,600.00	3.75
143	300726	宏达电子	84,170.00	3.73
144	300171	东富龙	83,280.00	3.69
145	688628	优利德	82,570.00	3.66
146	600138	中青旅	82,220.00	3.64
147	688126	沪硅产业	81,840.00	3.63
148	688137	近岸蛋白	80,545.00	3.57
149	600466	蓝光发展	80,500.00	3.57
150	600009	上海机场	80,405.00	3.56
151	000031	大悦城	80,200.00	3.55
152	600906	财达证券	78,550.00	3.48
153	600588	用友网络	78,320.00	3.47
154	000430	张家界	78,090.00	3.46
155	300433	蓝思科技	76,490.00	3.39
156	600585	海螺水泥	76,200.00	3.38
157	688323	瑞华泰	76,140.00	3.37
158	603629	利通电子	75,920.00	3.36
159	002970	锐明技术	73,454.00	3.25
160	002532	天山铝业	73,205.00	3.24
161	600429	三元股份	73,100.00	3.24
162	601099	太平洋	72,700.00	3.22
163	300894	火星号	72,181.00	3.20
164	688185	康希诺	72,020.00	3.19
165	688728	格科微	70,890.00	3.14
166	002966	苏州银行	70,681.00	3.13
167	605507	国邦医药	70,625.00	3.13
168	688133	泰坦科技	70,403.00	3.12
169	688036	传音控股	70,237.70	3.11
170	601066	中信建投	70,230.00	3.11
171	688580	伟思医疗	69,224.00	3.07
172	601857	中国石油	69,050.00	3.06
173	688789	宏华数科	68,612.00	3.04
174	600763	通策医疗	68,347.00	3.03
175	605208	永茂泰	67,460.00	2.99
176	600348	华阳股份	67,036.00	2.97
177	002431	棕榈股份	66,100.00	2.93

178	300595	欧普康视	65,805.00	2.92
179	600426	华鲁恒升	65,731.00	2.91
180	688599	天合光能	65,600.00	2.91
181	601933	永辉超市	65,360.00	2.90
182	600745	闻泰科技	65,278.00	2.89
183	300450	先导智能	64,698.00	2.87
184	688029	南微医学	64,084.00	2.84
185	002245	蔚蓝锂芯	63,809.00	2.83
186	605318	法狮龙	63,618.00	2.82
187	300724	捷佳伟创	63,215.00	2.80
188	300496	中科创达	63,053.00	2.79
189	300467	迅游科技	62,720.00	2.78
190	688232	新点软件	60,330.00	2.67
191	603658	安图生物	59,600.00	2.64
192	688578	艾力斯	59,408.00	2.63
193	605338	巴比食品	58,940.00	2.61
194	600425	青松建化	58,600.00	2.60
195	688116	天奈科技	58,572.00	2.59
196	002228	合兴包装	58,560.00	2.59
197	300288	朗玛信息	58,466.00	2.59
198	301117	佳缘科技	58,440.00	2.59
199	000501	武商集团	58,372.00	2.59
200	002049	紫光国微	58,151.00	2.58
201	603506	南都物业	57,280.00	2.54
202	601156	东航物流	57,140.00	2.53
203	600050	中国联通	56,750.00	2.51
204	000561	烽火电子	56,310.00	2.49
205	000061	农产品	56,000.00	2.48
206	300616	尚品宅配	55,762.00	2.47
207	300427	红相股份	55,740.00	2.47
208	000793	华闻集团	54,600.00	2.42
209	600779	水井坊	54,040.00	2.39
210	000683	远兴能源	53,880.00	2.39
211	688039	当虹科技	53,845.00	2.39
212	688520	神州细胞	53,816.00	2.38
213	300743	天地数码	53,600.00	2.37
214	002718	友邦吊顶	53,200.00	2.36
215	002304	洋河股份	53,059.00	2.35
216	601899	紫金矿业	52,950.00	2.35
217	300133	华策影视	52,900.00	2.34
218	300751	迈为股份	52,700.00	2.33
219	600497	驰宏锌锗	52,700.00	2.33
220	688510	航亚科技	52,620.00	2.33

221	601628	中国人寿	52,275.00	2.32
222	002348	高乐股份	51,800.00	2.29
223	600036	招商银行	51,720.00	2.29
224	688526	科前生物	51,240.00	2.27
225	002492	恒基达鑫	51,100.00	2.26
226	002861	瀛通通讯	51,100.00	2.26
227	002275	桂林三金	50,760.00	2.25
228	601869	长飞光纤	50,582.00	2.24
229	000677	恒天海龙	50,560.00	2.24
230	002468	申通快递	50,500.00	2.24
231	601696	中银证券	50,445.00	2.23
232	002928	华夏航空	50,370.00	2.23
233	600958	东方证券	49,980.00	2.21
234	301234	五洲医疗	49,845.00	2.21
235	300369	绿盟科技	49,750.00	2.20
236	600570	恒生电子	49,700.00	2.20
237	002737	葵花药业	49,584.00	2.20
238	688577	浙海德曼	49,450.00	2.19
239	000008	神州高铁	49,400.00	2.19
240	600855	航天长峰	49,320.00	2.18
241	600640	国脉文化	49,150.00	2.18
242	000596	古井贡酒	49,140.00	2.18
243	688237	超卓航科	48,976.00	2.17
244	002376	新北洋	48,660.00	2.16
245	300041	回天新材	48,626.00	2.15
246	002385	大北农	48,420.00	2.14
247	603587	地素时尚	48,379.00	2.14
248	300676	华大基因	48,378.00	2.14
249	688098	申联生物	48,360.00	2.14
250	688321	微芯生物	48,260.00	2.14
251	002075	沙钢股份	48,210.00	2.14
252	000558	莱茵体育	48,150.00	2.13
253	601600	中国铝业	48,100.00	2.13
254	002277	友阿股份	47,850.00	2.12
255	688799	华纳药厂	47,790.00	2.12
256	600712	南宁百货	47,760.00	2.12
257	000697	炼石航空	47,700.00	2.11
258	603533	掌阅科技	47,460.00	2.10
259	300832	新产业	47,348.00	2.10
260	300164	通源石油	47,200.00	2.09
261	600111	北方稀土	47,040.00	2.08
262	600882	妙可蓝多	46,944.00	2.08
263	688303	大全能源	46,880.00	2.08

264	688120	华海清科	46,400.00	2.06
265	000876	新希望	46,380.00	2.05
266	000929	兰州黄河	46,250.00	2.05
267	688013	天臣医疗	46,200.00	2.05
268	688779	长远锂科	45,975.00	2.04
269	601089	福元医药	45,924.00	2.03
270	001206	依依股份	45,897.00	2.03
271	688521	芯原股份	45,835.00	2.03
272	000989	九芝堂	45,750.00	2.03
273	601211	国泰君安	45,630.00	2.02
274	600685	中船防务	45,540.00	2.02
275	688132	邦彦技术	45,240.00	2.00
276	600216	浙江医药	45,150.00	2.00

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	44,614,850.04
卖出股票收入（成交）总额	44,306,476.93

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金投资范围不包括贵金属投资。

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 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未投资股指期货。

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

本报告期内，本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

中公教育为国新国证新利前十大持仓证券。中公教育因未及时披露公司重大事项，中国证券监督管理委员会安徽监管局于 2022 年 4 月 27 日责令其改正，给予警告，并处以 400 万元罚款，深圳证券交易所于 2022 年 8 月 24 日对其给予公开谴责的处分。本基金投资中公教育的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,056.42
2	应收清算款	26,025.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,082.08

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能有尾差。

§ 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
310	6,284.72	544.01	0.03%	1,947,717.67	99.97%

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	0	0%

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

截止本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 09 月 02 日）基金份额总额	263,756,837.54
本报告期期初基金份额总额	2,089,159.75
本报告期基金总申购份额	11,339,393.68
减：本报告期基金总赎回份额	11,480,291.75
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	1,948,261.68

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

本报告期内，本基金管理人根据工作需要，于 2022 年 12 月 29 日任命张勋民先生担任本基金管理人的常务副总经理。

本报告期内，本基金管理人根据工作需要，于 2022 年 9 月 22 日任命梅军胜先生担任本基金管理人的副总经理，2022 年 12 月 19 日免去梅军胜副总经理职务，另有任用。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

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、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

经公司董事会审议通过，公司已于 2023 年 1 月 11 日发布《国新国证基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告》。本报告期内本基金应向中兴华会计师事务所（特殊普通合伙）支付审计费用为 20,000.00 元。截至本报告期末，中兴华会计师事务所（特殊普通合伙）为首年向本基金提供审计服务。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 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，基金托管人及其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	佣金	占当期佣金	

			成交总额的 比例		总量的比例	
中信建投	2	37,759,304.96	42.46%	27,506.90	42.56%	-
中泰证券	2	22,831,169.40	25.68%	16,654.07	25.77%	-
华福证券	2	21,160,285.61	23.80%	15,309.36	23.68%	-
国泰君安	2	7,170,567.00	8.06%	5,167.66	7.99%	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司交易单元的选择标准：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 10 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证券监督管理委员会和中国人民银行处罚；
- (4) 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；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场投资策略、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求提供专门研究报告；
- (7) 收取的佣金率符合市场平均水平。

2、交易单元选择程序：我司根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：新增租用中信建投交易单元 2 个。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：停止租用财达证券交易单元 2 个。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的

								比 例
中信建 投	-	-	13,600,000.00	27.56%	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	14,900,000.00	30.19%	-	-	-	-
华福证 券	-	-	19,750,000.00	40.02%	-	-	-	-
国泰君 安	2,521.80	100.00%	1,100,000.00	2.23%	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 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	关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	基金管理人网站	2022-01-05
2	华融基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-14
3	华融基金管理有限公司旗下基金 2021 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2022-01-21
4	华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
5	华融新利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、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-22
6	华融新利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、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-22
7	华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-22
8	华融基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2022-03-31
9	华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-31
10	华融基金管理有限公司旗下基金 2022 年 1 季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2022-04-22

11	华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第一季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22
12	华融新利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、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-27
13	华融新利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、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-27
14	华融基金管理有限公司关于公司实际控制人变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-29
15	华融新利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、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-08
16	华融新利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、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-08
17	华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-08
18	华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第二季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-21
19	华融基金管理有限公司旗下基金 2022 年 2 季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2022-07-21
20	华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-08-31
21	华融基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2022-08-31
22	关于防范不法分子假冒华融基金名义进行非法活动的风险提示	基金管理人网站	2022-09-02
23	华融基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-24
24	华融基金管理有限公司关于提请投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	基金管理人网站	2022-09-27
25	华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第三季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-26
26	华融基金管理有限公司旗下基金 2022 年 3 季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2022-10-26
27	关于公司法定名称变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理	2022-11-05

		人网站、中国证监会基金电子披露网站	
28	华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2022 年基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-08
29	华融新利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、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-08
30	国新国证基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-07
31	国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-09
32	国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金托管协议	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-09
33	国新国证新利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、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-09
34	国新国证新利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、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-09
35	国新国证基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-20

§ 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

报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

2022 年 6 月 29 日，本基金管理人发布《关于公司实际控制人变更的公告》，本基金管理人实际控制人变更为中国国新控股有限责任公司。

2022 年 11 月 5 日，本基金管理人发布《关于公司法定名称变更的公告》，本基金管理人名称由华融基金管理有限公司变更为国新国证基金管理有限公司。

2022 年 12 月 2 日、12 月 7 日，本基金管理人发布《国新国证基金管理有限公司关于旗下部分基金更名事宜的公告》《国新国证基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，按照本基金管理人更名情况，统一变更旗下基金名称。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件
- 2、《国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 4、《国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 存放地点

上述备查文件存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.crsfund.com.cn）查阅。

国新国证基金管理有限公司

二〇二三年三月三十一日