

泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 30 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3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。

本年度报告财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2021年1月1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 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
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	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
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	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66
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	66
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	67

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
8.12 投资组合报告附注.....	67
§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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
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.....	69
§10 开放式基金份额变动.....	69
§11 重大事件揭示.....	69
11.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
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.....	72
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
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.....	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
§13 备查文件目录.....	75
13.1 备查文件目录.....	75
13.2 存放地点.....	75
13.3 查阅方式.....	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金
基金简称	泓德瑞兴三年持有期混合
基金主代码	009264
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年07月14日
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,364,935,743.10份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。 在股票投资方面，本基金在深入研究的基础上优选行业和个股，对处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置；通过定性分析和定量分析相结合的办法，对上市公司的增长前景进行分析，挑选具备较大竞争优势和长期投资价值的上市公司；在对A、H股溢价水平进行重点分析和趋势预测的前提下，本基金将优选香港市场与国内A股在部分行业形成有效互补的行业和上市公司。 本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，主要采取久

	期配置策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、资产支持证券投资策略。 本基金本着谨慎原则，从风险管理角度出发，适度参与股指期货、国债期货投资。
业绩比较基准	中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+中国债券综合全价指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期预期风险与预期收益特征低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泓德基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	张燕
	联系电话	010-59850177	0755-83199084
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4009-100-888	95555
传真		010-59322130	0755-83195201
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100088	518040
法定代表人		王德晓	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露	《中国证券报》
------------	---------

露报纸名称	
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金年度报告备置地点	北京市西城区德胜门外大街125号

2.5 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	泓德基金管理有限公司	北京市西城区德胜门外大街125号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年	2020年07月14日（基金合同生效日）-2020年12月31日
本期已实现收益	797,290,751.08	204,381,544.05
本期利润	112,115,282.73	1,264,645,457.64
加权平均基金份额本期利润	0.0155	0.2114
本期加权平均净值利润率	1.24%	19.74%
本期基金份额净值增长率	2.37%	21.05%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	1,092,715,421.07	208,617,465.58
期末可供分配基金份额利润	0.1484	0.0342
期末基金资产净值	9,126,787,648.21	7,385,677,326.97
期末基金份额净值	1.2392	1.2105
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末

基金份额累计净值增长率	23.92%	21.05%
-------------	--------	--------

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，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.34%	0.78%	0.87%	0.57%	2.47%	0.21%
过去六个月	-4.42%	0.99%	-3.38%	0.75%	-1.04%	0.24%
过去一年	2.37%	1.11%	-1.39%	0.85%	3.76%	0.26%
自基金合同生效起至今	23.92%	1.08%	1.65%	0.88%	22.27%	0.20%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+中国债券综合全价指数收益率×20%

基准指数的构建原则如下：

（1）中证800指数是由中证指数有限公司编制的，其成份股是由沪深300指数和中证500指数成份股一起构成，中证800指数综合反映沪深股票市场内大中小市值公司的整体状况，较好地反映了A股市场的总体趋势。

（2）中证港股通综合指数是由中证指数有限公司编制，选取符合港股通资格的普通股作为样本股，采用自由流通市值加权计算，是反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势的具有代表性的一种股价指数。

（3）中国债券综合全价指数是由中债金融估值中心有限公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。

（4）由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照70%、10%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

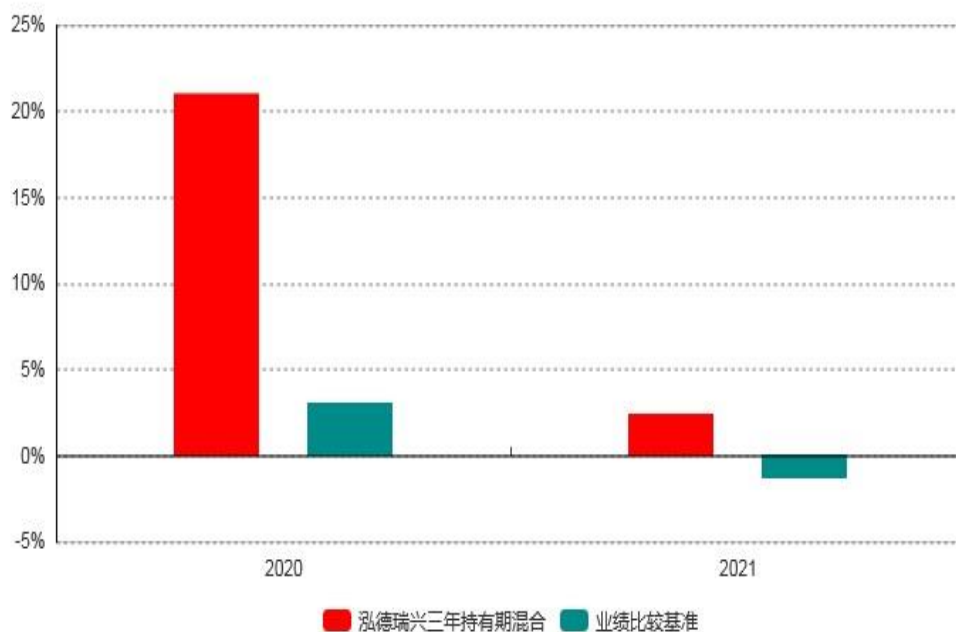
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泓德瑞兴三年持有期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
(2020年07月14日-2021年12月31日)



注：根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

3.2.3 自基金合同生效以来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：本基金合同自2020年7月14日生效，生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2020年7月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日止会计期间未进行利润分配。

§ 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

本基金基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于2015年3月3日，是经中国证监会证监许可[2015]258号文批准设立的我国第一家由专业人士发起设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币14300万元，公司注册地拉萨市。目前，公司股东及其出资比例为：王德晓先生25.91%，阳光资产管理股份有限公司20.98%，泓德基业控股股份有限公司20.00%，珠海市基业长青股权投资基金（有限合伙）11.26%，南京民生租赁股份有限公司9.38%，江苏岛村实业发展有限公司9.38%，上海捷朔信息技术有限公司3.10%。

2021年，公司新发行5只公募基金产品，均为混合型基金。自成立起至2021年12月31日，公司累计发行了36只公募基金产品：其中混合型基金24只，具体包括泓德优选成长混合、泓德泓富混合、泓德远见回报混合、泓德泓业混合、泓德泓益量化混合、泓德泓信混合、泓德泓汇混合、泓德泓华混合、泓德优势领航混合、泓德致远混合、泓德臻远回报混合、泓德三年封闭丰泽混合、泓德研究优选混合、泓德量化精选混合、泓德丰润三年持有期混合、泓德睿泽混合、泓德睿享一年持有期混合、泓德瑞兴三年持有期混合、泓德卓远混合、泓德优质治理混合、泓德睿源三年持有期混合、泓德瑞嘉三年持有期混合、泓德睿诚混合、泓德慧享混合；股票型基金1只，具体为泓德战略转型股票；债券型基金9只，具体包括泓德裕泰债券、泓德裕康债券、泓德裕荣纯债、泓德裕和纯债、泓德裕祥债券、泓德裕泽一年定开债券、泓德裕鑫一年定开债券、泓德裕丰中短债、泓德裕瑞三年定开债券；货币基金2只，具体为泓德泓利货币、泓德添利货币。同时，公司管理多只特定客户资产管理计划。

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	说明
		任职日期	离任日期		

				限	
王克玉	投研总监，泓德优选成长混合、泓德优势领航混合、泓德研究优选混合、泓德瑞兴三年持有期混合、泓德瑞嘉三年持有期混合基金经理	2020-07-14	-	19 年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任长盛基金管理有限公司基金经理、权益投资部副总监，国都证券有限公司分析师，天相投资顾问有限公司分析师，元大京华证券上海代表处研究员。
操昭煦	泓德瑞兴三年持有期混合、泓德泓业混合基金经理	2021-01-04	-	6 年	硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验9年，曾任职于交通银行从事研究工作。

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、证券从业的含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《泓德基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《泓德基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本报告期内，本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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%的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

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年的A股市场给投资者（包括基金经理和基金持有人）都留下了深刻的印象。市场本身的波动和行业分化其实都在正常范围内，超出预期的主要还是在年内各类风格资产的快速轮换，以及一批在19-20年给投资者赚取丰厚回报的公司在21年经受了巨大的挑战，这里面部分业绩预期稳定或有所下调的公司在较高估值基础上，面对流动性的压力表现低迷。

组合在年初按照个股精选、行业均衡的目标进行调整，主要是为了适应2021年经济复苏的经济环境，年初组合表现相对较好。但是在五月份市场流动性发生明显变化，以及后期主要投资机会出现的情况下，组合的调整幅度太小，组合优化效果较差。另外年内港股投资也给组合带来很大损失。在四季度我们针对未来一个阶段的经济运行状况和企业盈利两个方向进行了初步的分析，相应的对组合进行了小幅调整，减持的主要是部分静态估值相对较高但增长预期不明确的标的，增持的主要集中在新兴产业、稳增长和“专精特新”三个方向上。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德瑞兴三年持有期混合基金份额净值为1.2392元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.37%，同期业绩比较基准收益率为-1.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.5.1 对宏观经济和证券市场展望

短期内经济增长还面临一定的压力，预期随着相关政策的调整，预计从22年下半年开始将有机会走出调整阶段，企业盈利开始逐渐恢复。过去两年中影响经济活动的供给问题，包括运输能力、核心零部件和劳动力等方面的问题，将有望随着疫情的变化对经济的负面冲击趋于改善。

对资本市场而言，通过持续的制度建设，市场体系中的投资者、上市公司等在持续的优胜劣汰，形成非常良好的运行机制。越来越多具备长期发展竞争力的企业上市，这将是我们的长期收益率的主要来源。

4.5.2 本基金下阶段投资策略

A股市场的投资环境随着市场的扩容和经济结构的转型不断发展进化，不同阶段的市场特征具有比较大的差异。2019年下半年到2020年是历史上比较难得的低波动投资环境，从2019年以来宏观经济逐渐恢复增长，在20年初疫情之后，中国作为一个全球制造业的中心，企业盈利不断超预期，这种情况下A股市场整体表现为波动上涨，而基金净值受投资结构影响表现突出。但是2021年下半年以来，经济增长的环境叠加其他的一些外部环境的冲击，导致市场表现同过去两年有比较大的差异。我认为这是权益投资难以避免的遇到的阶段性比较颠簸的状况。另外在20年中之后各类机构投资者的快速发展使得投资者结构发生了很大的变化，在市场进入震荡阶段之后也使得市场体现出非常明显的大幅波动，对主动定价能力提出了更高的要求。

短期内组合将更关注具备估值优势、盈利稳定的价值股，这类公司在22年相对比较波动的经济环境中将体现出比较明显的优势。着眼于中长期我们更关注中国产业升级过程中处于成长阶段的中小型公司，在市场持续调整之后已经有越来越多值得关注的投资机会。近期我们看到在股价持续调整之后，越来越多基础业务扎实、经营稳健、现金流充沛的企业在目前的情况下开始启动回购来实施员工激励，这样的做法将有利于提高企业价值。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（1）根据法律法规的要求，推动各业务单元更新、完善内部制度及业务流程。识别业务活动中的关键风险点，确定关键控制活动，持续完善内部控制措施。

（2）对合同、协议等法律文件及实务运作中存在的法律风险进行识别及防范。

（3）通过事前合规审核、持续优化合规监控系统、加强合规培训等方面，对业务活动中存在的合规风险进行识别及评估，完成各类合规管理工作。

（4）按计划完成定期稽核工作，检查内容覆盖公司主要业务部门和业务环节，并对整改情况进行跟踪。

（5）认真贯彻落实反洗钱各项法律法规，切实履行金融机构的反洗钱法定义务，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理、督察长、投研总监、固定收益投资部、监察稽核部、运营支持部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，2021年度未实施利润分配。

本基金截至2021年12月31日，期末可供分配利润为1,092,715,421.07元，其中：未分配利润已实现部分为1,092,715,421.07元，未分配利润未实现部分669,136,484.04元。

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

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数量不满二百人或者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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 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27601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	泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金(以下简称“泓德瑞兴三年持有期混合基金”)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。 (二) 我们的意见 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，公允反映了泓德瑞兴三年持有期混合基金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。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泓德瑞兴三年持有期混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	泓德瑞兴三年持有期混合基金的基金管理人泓德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括泓德瑞兴三年持有期混合基金2021年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。基于我们已经执行的工作，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	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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泓德瑞兴三年持有期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泓德瑞兴三年持有期混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督泓德瑞兴三年持有期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。 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： （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。 （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。 （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。 （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，就可能导致对泓德瑞兴三年持有期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泓德瑞兴三年持有期混合基金不能持续经营。 (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。 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	俞伟敏
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼	
审计报告日期	2022-03-29	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	391,277,749.70	238,851,793.77
结算备付金		6,109,182.53	3,069,272.10

存出保证金		788,238.57	1,470,383.95
交易性金融资产	7.4.7.2	8,396,707,191.61	7,141,685,994.24
其中：股票投资		7,960,382,191.61	6,844,359,994.24
基金投资		-	-
债券投资		436,325,000.00	297,326,000.00
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	-	-
应收证券清算款		359,642,317.20	9,830,252.38
应收利息	7.4.7.5	5,572,310.29	4,307,244.53
应收股利		1,667,560.00	484,800.00
应收申购款		47,257.20	2,494,894.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		9,161,811,807.10	7,402,194,635.94
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		18,195,609.58	5,083,111.27
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		11,578,642.10	8,832,812.99
应付托管费		1,929,773.69	1,472,135.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,080,133.52	973,243.52
应交税费		-	5.70

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	240,000.00	156,000.00
负债合计		35,024,158.89	16,517,308.97
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	7,364,935,743.10	6,101,539,086.48
未分配利润	7.4.7.10	1,761,851,905.11	1,284,138,240.49
所有者权益合计		9,126,787,648.21	7,385,677,326.97
负债和所有者权益总计		9,161,811,807.10	7,402,194,635.94

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值1.2392元，基金份额总额7,364,935,743.10份。

7.2 利润表

会计主体：泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年07月14日（基金 合同生效日）至2020年 12月31日
一、收入		290,818,171.80	1,326,769,492.08
1. 利息收入		11,984,845.00	5,871,674.41
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,561,145.66	1,394,423.07
债券利息收入		9,811,412.58	3,876,980.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		612,286.76	600,270.92
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		964,008,795.15	260,633,904.08

其中：股票投资收益	7.4.7.12	840,246,805.81	237,097,540.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	9,694,948.72	4,514,106.56
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	114,067,040.62	19,022,256.99
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.16	-685,175,468.35	1,060,263,913.59
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.17	-	-
减：二、费用		178,702,889.07	62,124,034.44
1. 管理人报酬		135,299,647.03	44,508,188.09
2. 托管费		22,549,941.21	7,418,031.35
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	20,542,601.44	10,019,811.52
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		25.78	10.85
7. 其他费用	7.4.7.19	310,673.61	177,992.63
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		112,115,282.73	1,264,645,457.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		112,115,282.73	1,264,645,457.64

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01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)	6,101,539,086.48	1,284,138,240.49	7,385,677,326.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	112,115,282.73	112,115,282.73
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)	1,263,396,656.62	365,598,381.89	1,628,995,038.51
其中：1. 基金申购款	1,263,396,656.62	365,598,381.89	1,628,995,038.51
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	7,364,935,743.10	1,761,851,905.11	9,126,787,648.21
项 目	上年度可比期间 2020年07月14日(基金合同生效日)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)	5,942,070,680.87	-	5,942,070,680.87
二、本期经营活动	-	1,264,645,457.64	1,264,645,457.64

产生的基金净值变动数(本期利润)			
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)	159,468,405.61	19,492,782.85	178,961,188.46
其中: 1. 基金申购款	159,468,405.61	19,492,782.85	178,961,188.46
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	6,101,539,086.48	1,284,138,240.49	7,385,677,326.97

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:

王德晓

王德晓

王玲

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

泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]381号《关于准予泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,对于每份基金份额,锁定期从起始日开始,至起始日次三年的年度对日的前一日止。在锁定期内,基金份额持有人不能提出赎回申请,锁定期届满后的下一个工作日起可以提出赎回申请。对于每份认购份额,起始日指基金

合同生效日；对于每份申购份额，起始日指该基金份额申购申请确认日。年度对日指某一日期在后续日历年中的对应日期，若该对应日为非工作日或该日历年实际不存在对应日期的，则顺延至下一工作日。存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集5,942,070,680.87元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0573号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2020年7月14日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为5,942,070,680.87份，其中认购资金利息折合0.00份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标为在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货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于其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%，其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过50%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+中国债券综合全价指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人泓德基金管理有限公司于2022年3月29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》、《泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金基金合同》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。比较财务报表的实际编制期间为2020年7月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日。

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、资产支持证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或资产支持证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、资产支持证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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分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。

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和托管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

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，但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。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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 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、债券投资和资产支持证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，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(可转换债券和私募债券除外)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(可转换债券和私募债券除外)，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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	391,277,749.70	238,851,793.77
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	391,277,749.70	238,851,793.77

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	7,585,037,796.37	7,960,382,191.61	375,344,395.24
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—

债券	交易所市场	4,929,000.00	4,929,000.00	-
	银行间市场	431,651,950.00	431,396,000.00	-255,950.00
	合计	436,580,950.00	436,325,000.00	-255,950.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		8,021,618,746.37	8,396,707,191.61	375,088,445.24
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		5,783,671,815.65	6,844,359,994.24	1,060,688,178.59
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,695,000.00	1,695,000.00	-
	银行间市场	296,055,265.00	295,631,000.00	-424,265.00
	合计	297,750,265.00	297,326,000.00	-424,265.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,081,422,080.65	7,141,685,994.24	1,060,263,913.59

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末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

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
----	--------------------	---------------------

应收活期存款利息	47,000.03	25,357.41
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	10,001.18	3,100.12
应收债券利息	5,649,645.02	4,277,619.10
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-135,493.26	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	1,157.32	1,167.90
合计	5,572,310.29	4,307,244.53

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,078,198.52	973,243.52
银行间市场应付交易费用	1,935.00	-
合计	3,080,133.52	973,243.52

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	240,000.00	156,000.00

合计	240,000.00	156,000.00
----	------------	------------

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,101,539,086.48	6,101,539,086.48
本期申购	1,263,396,656.62	1,263,396,656.62
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,364,935,743.10	7,364,935,743.10

注：申购含转换入份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	208,617,465.58	1,075,520,774.91	1,284,138,240.49
本期利润	797,290,751.08	-685,175,468.35	112,115,282.73
本期基金份额交易产生的变动数	86,807,204.41	278,791,177.48	365,598,381.89
其中：基金申购款	86,807,204.41	278,791,177.48	365,598,381.89
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,092,715,421.07	669,136,484.04	1,761,851,905.11

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年07月14日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	1,294,509.72	1,217,192.49
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	233,683.51	151,654.53
其他	32,952.43	25,576.05
合计	1,561,145.66	1,394,423.07

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年07月14日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	6,962,130,961.10	1,705,296,926.96
减：卖出股票成本总额	6,121,884,155.29	1,468,199,386.43
买卖股票差价收入	840,246,805.81	237,097,540.53

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年07月14日（基金合同生效日） 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	446,804,604.42	17,847,174.61
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	426,053,665.00	13,330,100.00
减：应收利息总额	11,055,990.70	2,968.05
买卖债券差价收入	9,694,948.72	4,514,106.56

7.4.7.14 衍生工具收益

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 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至	上年度可比期间 2020年07月14日（基金合同生
----	--------------------	------------------------------

	2021年12月31日	效日) 至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	114,067,040.62	19,022,256.99
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	114,067,040.62	19,022,256.99

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年07月14日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-685,175,468.35	1,060,263,913.59
——股票投资	-685,343,783.35	1,060,688,178.59
——债券投资	168,315.00	-424,265.00
——资产支持证券投资	-	-
——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	-685,175,468.35	1,060,263,913.59

7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.18 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年07月14日(基金合同生效 日) 至2020年12月31日
----	-----------------------------------	--

交易所市场交易费用	20,539,026.44	10,018,024.02
银行间市场交易费用	3,575.00	1,787.50
合计	20,542,601.44	10,019,811.52

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年07月14日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
审计费用	120,000.00	96,000.00
信息披露费	120,000.00	60,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	39,473.61	18,992.63
账户维护费	30,000.00	3,000.00
开户费	400.00	-
其他	800.00	-
合计	310,673.61	177,992.63

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，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作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
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
王德晓	基金管理人股东
阳光资产管理股份有限公司	基金管理人股东
泓德基业控股股份有限公司	基金管理人股东

珠海市基业长青股权投资基金（有限合伙）	基金管理人股东
南京民生租赁股份有限公司	基金管理人股东
江苏岛村实业发展有限公司	基金管理人股东
上海捷朔信息技术有限公司	基金管理人股东

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年07月14日（基金合同 生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	135,299,647.03	44,508,188.09
其中：支付销售机构的客户维护费	61,917,820.04	22,794,944.06

注：支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年07月14日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	22,549,941.21	7,418,031.35

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率每日计提，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。

7.4.10.3 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 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年07月14日（基金合同生效日） 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
招商银行	391,277,749.70	1,294,509.72	238,851,793.77	1,217,192.49

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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
603596	伯特利	2021-07-27	2022-01-27	限售股	32.99	67.12	550,000	18,144,500.00	36,916,000.00	-
600941	中国移动	2021-12-	2022-07-	新股未上	57.58	57.58	87,363	5,030,36	5,030,36	-

		24	05	市且 限售				1.54	1.54	
6009 41	中国 移动	2021 -12- 24	2022 -01- 05	新股 未上 市	57.5 8	57.5 8	37,440	2,15 5,79 5.20	2,15 5,79 5.20	-
6017 28	中国 电信	2021 -08- 11	2022 -02- 21	限售 股	4.53	4.27	394,01 1	1,78 4,86 9.83	1,68 2,42 6.97	-
6881 76	亚虹 医药	2021 -12- 29	2022 -01- 07	新股 未上 市	22.9 8	22.9 8	37,990	873, 010. 20	873, 010. 20	-
6881 12	鼎阳 科技	2021 -11- 24	2022 -06- 01	限售 股	46.6 0	80.0 5	4,901	228, 386. 60	392, 325. 05	-
6882 11	中科 微至	2021 -10- 18	2022 -04- 26	限售 股	90.2 0	71.3 2	4,501	405, 990. 20	321, 011. 32	-
6882 62	国芯 科技	2021 -12- 28	2022 -07- 06	新股 未上 市且 限售	41.9 8	41.9 8	7,129	299, 275. 42	299, 275. 42	-
6882 46	嘉和 美康	2021 -12- 07	2022 -06- 14	限售 股	39.5 0	34.8 9	7,719	304, 900. 50	269, 315. 91	-
6881 21	卓然 股份	2021 -08- 30	2022 -03- 07	限售 股	18.1 6	36.4 2	3,681	66,8 46.9 6	134, 062. 02	-
3011 55	海力 风电	2021 -11- 17	2022 -05- 24	限售 股	60.6 6	96.7 5	1,054	63,9 35.6 4	101, 974. 50	-
6886 97	纽威 数控	2021 -09- 09	2022 -03- 17	限售 股	7.55	16.0 3	5,837	44,0 69.3 5	93,5 67.1 1	-

301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	限售股	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
301136	招标股份	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	限售股	93.09	75.34	848	78,940.32	63,888.32	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	限售股	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	限售股	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
688038	中科通达	2021-07-05	2022-01-13	限售股	8.60	18.72	2,132	18,335.20	39,911.04	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	限售股	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	限售股	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	限售股	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	限售股	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301099	雅创电子	2021-11-10	2022-05-23	限售股	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-

3012 21	光庭 信息	2021 -12- 15	2022 -06- 22	限售 股	69.8 9	88.7 2	280	19,5 69.2 0	24,8 41.6 0	-
3011 89	奥尼 电子	2021 -12- 21	2022 -06- 28	限售 股	66.1 8	56.6 2	435	28,7 88.3 0	24,6 29.7 0	-
3011 66	优宁 维	2021 -12- 21	2022 -06- 28	限售 股	86.0 6	94.5 0	253	21,7 73.1 8	23,9 08.5 0	-
3010 69	凯盛 新材	2021 -09- 16	2022 -03- 28	限售 股	5.17	44.2 1	539	2,78 6.63	23,8 29.1 9	-
3010 96	百诚 医药	2021 -12- 13	2022 -06- 20	限售 股	79.6 0	78.5 3	272	21,6 51.2 0	21,3 60.1 6	-
3010 93	华兰 股份	2021 -10- 21	2022 -05- 05	限售 股	58.0 8	49.8 5	409	23,7 54.7 2	20,3 88.6 5	-
3011 49	隆华 新材	2021 -11- 03	2022 -05- 10	限售 股	10.0 7	16.7 6	1,214	12,2 24.9 8	20,3 46.6 4	-
3009 94	久祺 股份	2021 -08- 02	2022 -02- 14	限售 股	11.9 0	45.4 5	420	4,99 8.00	19,0 89.0 0	-
3011 00	风光 股份	2021 -12- 10	2022 -06- 17	限售 股	27.8 1	31.1 4	599	16,6 58.1 9	18,6 52.8 6	-
3010 60	兰卫 医学	2021 -09- 06	2022 -03- 14	限售 股	4.17	30.9 4	587	2,44 7.79	18,1 61.7 8	-
3010 88	戎美 股份	2021 -10- 19	2022 -04- 28	限售 股	33.1 6	24.6 7	704	23,3 44.6 4	17,3 67.6 8	-

301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	限售股	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	限售股	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	限售股	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	限售股	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	限售股	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	限售股	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	限售股	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	限售股	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301180	万祥科技	2021-11-09	2022-05-16	限售股	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	限售股	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	限售股	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-

301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	限售股	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	限售股	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	限售股	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	限售股	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	限售股	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301126	达嘉维康	2021-11-30	2022-06-07	限售股	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301185	鸥玛软件	2021-11-11	2022-05-19	限售股	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	限售股	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	限售股	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	限售股	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	限售股	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-

300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	限售股	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	限售股	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	限售股	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	限售股	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	限售股	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	限售股	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	限售股	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	限售股	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	限售股	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	限售股	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	限售股	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-

301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	限售股	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	限售股	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	限售股	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	限售股	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	限售股	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	限售股	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	限售股	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	限售股	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	限售股	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	限售股	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	限售股	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-

001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	限售股	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	限售股	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	限售股	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	限售股	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	限售股	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	限售股	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	限售股	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	限售股	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021-12-	2022-01-	新债未上	100.00	100.00	49,290	4,929.00	4,929.00	-

		29	14	市				0.00	0.00	
--	--	----	----	---	--	--	--	------	------	--

注： 1、根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

2、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。

3、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。

4、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中作为抵押的债券。

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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上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“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去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

重程度和出现同类风险损失的频度。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特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

于本报告期期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.05%(上年度末：0.02%)。

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。

于本报告期期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即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该比例限制)。

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%。于本报告期期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未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。于本报告期期末，本基金确认的净赎回申请未超过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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
---------------	-------	-------	-------	-----	----

12 月 31 日					
资产					
银行存款	391,277,749.70	-	-	-	391,277,749.70
结算备付金	6,109,182.53	-	-	-	6,109,182.53
存出保证金	788,238.57	-	-	-	788,238.57
交易性金融资产	431,396,000.00	-	4,929,000.00	7,960,382,191.61	8,396,707,191.61
应收证券清算款	-	-	-	359,642,317.20	359,642,317.20
应收利息	-	-	-	5,572,310.29	5,572,310.29
应收股利	-	-	-	1,667,560.00	1,667,560.00
应收申购款	-	-	-	47,257.20	47,257.20
资产总计	829,571,170.80	-	4,929,000.00	8,327,311,636.30	9,161,811,807.10
负债					
应付证券清算款	-	-	-	18,195,609.58	18,195,609.58
应付管理人报酬	-	-	-	11,578,642.10	11,578,642.10
应付托管费	-	-	-	1,929,773.69	1,929,773.69
应付交易费用	-	-	-	3,080,133.52	3,080,133.52
其他负债	-	-	-	240,000.00	240,000.00
负债总计	-	-	-	35,024,158.89	35,024,158.89
利率敏感度缺口	829,571,170.80	-	4,929,000.00	8,292,287,477.41	9,126,787,648.21
上年度末 2020 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	238,851,793.77	-	-	-	238,851,793.77
结算备付金	3,069,272.10	-	-	-	3,069,272.10
存出保证金	1,470,383.95	-	-	-	1,470,383.95
交易性金融资产	295,631,000.00	-	1,695,000.00	6,844,359,994.24	7,141,685,994.24
应收证券清算款	-	-	-	9,830,252.38	9,830,252.38
应收利息	-	-	-	4,307,244.53	4,307,244.53
应收股利	-	-	-	484,800.00	484,800.00
应收申购款	-	-	-	2,494,894.97	2,494,894.97
资产总计	539,022,449.82	-	1,695,000.00	6,861,477,186.12	7,402,194,635.94
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,083,111.27	5,083,111.27
应付管理人报酬	-	-	-	8,832,812.99	8,832,812.99
应付托管费	-	-	-	1,472,135.49	1,472,135.49
应付交易费用	-	-	-	973,243.52	973,243.52
应交税费	-	-	-	5.70	5.70
其他负债	-	-	-	156,000.00	156,000.00
负债总计	-	-	-	16,517,308.97	16,517,308.97
利率敏感度缺口	539,022,449.82	-	1,695,000.00	6,844,959,877.15	7,385,677,326.97

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

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.78%(上年度末：4.03%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元折 合人民 币	港币折合人民 币	其他币 种折合 人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,119,443,31 0.36	-	1,119,443,31 0.36
应收股利	-	1,667,560.00	-	1,667,560.00
资产合计	-	1,121,110,87 0.36	-	1,121,110,87 0.36
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口 净额	-	1,121,110,87 0.36	-	1,121,110,87 0.36
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折 合人民 币	港币折合人民 币	其他币 种折合 人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,358,935,62 5.74	-	1,358,935,62 5.74
应收股利	-	484,800.00	-	484,800.00

资产合计	-	1,359,420,425.74	-	1,359,420,425.74
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,359,420,425.74	-	1,359,420,425.74

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇以外的其他市场变量保持不变		
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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	港币相对人民币升值5%	56,055,543.52	67,971,021.29
	港币相对人民币贬值5%	-56,055,543.52	-67,971,021.29

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，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，做出资产配置及组合构建的决定；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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，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	上年度末
----	-----	------

	2021年12月31日		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	7,960,382,191.61	87.22	6,844,359,994.24	92.67
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	7,960,382,191.61	87.22	6,844,359,994.24	92.67

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	547,610,286.65	—
	业绩比较基准下降5%	-547,610,286.65	—

注：于上年度末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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2021年12月31日，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7,910,860,802.44元，属于第二层次的余额为444,764,396.29元，属于第三层次的余额为41,081,992.88元。(2020年12月31日：第一层次6,660,708,600.46元，第二层次480,977,393.78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，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中归属于第三层次的余额为41,081,992.88元(2020年12月31日：无)。其中，2021年度，本基金购买第三层次的金额为21,788,829.83元(2020年7月14日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间：无)，计入损益(均计入利润表中的公允价值变动损益项目)的利得/(损失)为19,293,163.05元(2020年7月14日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间：无)，本基金于2021年12月31日仍持有的第三层次的金融资产从年初起算计入2021年度公允价值变动损益的金额为19,293,163.05元(2020年7月14日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间：无)。

于2021年12月31日，使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的证券交易所上市但尚在限售期内的股票投资公允价值为41,081,992.88元，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，不可观察输入值与公允价值之间的关系为负相关。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：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) 除公允价值和执行新金融工具准则外,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	7,960,382,191.61	86.89
	其中:股票	7,960,382,191.61	86.89
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	436,325,000.00	4.76
	其中:债券	436,325,000.00	4.76
	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	397,386,932.23	4.34
8	其他各项资产	367,717,683.26	4.01
9	合计	9,161,811,807.10	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币1,119,443,310.36元，占期末净值比例12.27%。

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

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	365,535,595.04	4.01
C	制造业	4,423,327,121.15	48.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	223,409,866.59	2.45
F	批发和零售业	193,376.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	257,323,937.40	2.82
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	240,831,933.63	2.64
J	金融业	486,004,798.12	5.33
K	房地产业	736,464,928.15	8.07
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	519,260.62	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	50,198.91	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	107,232,718.00	1.17
R	文化、体育和娱乐业	40,539.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	6,840,938,881.25	74.95

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	50,366,535.00	0.55
日常消费品	33,895,262.00	0.37

医疗保健	12,130,418.00	0.13
信息技术	812,646,028.36	8.90
电信服务	77,310,717.00	0.85
地产业	133,094,350.00	1.46
合计	1,119,443,310.36	12.27

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	02382	舜宇光学科技	2,524,178	508,924,768.36	5.58
2	000002	万科A	19,714,904	389,566,503.04	4.27
3	603596	伯特利	5,433,466	376,805,233.60	4.13
4	600048	保利发展	22,194,397	346,898,425.11	3.80
5	002142	宁波银行	8,548,579	327,239,604.12	3.59
6	300750	宁德时代	500,349	294,205,212.00	3.22
7	601899	紫金矿业	29,249,300	283,718,210.00	3.11
8	000338	潍柴动力	15,560,263	278,373,105.07	3.05
9	603228	景旺电子	7,961,323	274,904,483.19	3.01
10	603501	韦尔股份	875,058	271,941,774.66	2.98
11	603345	安井食品	1,550,352	264,769,114.56	2.90
12	01810	小米集团—W	17,094,400	264,108,480.00	2.89
13	600176	中国巨石	12,804,889	233,048,979.80	2.55
14	601021	春秋航空	3,587,268	203,756,822.40	2.23
15	601233	桐昆股份	9,043,494	191,541,202.92	2.10
16	600309	万华化学	1,835,335	185,368,835.00	2.03
17	300628	亿联网络	2,166,233	176,439,677.85	1.93
18	601636	旗滨集团	10,020,100	171,343,710.00	1.88
19	603160	汇顶科技	1,387,856	149,569,241.12	1.64
20	002916	深南电路	1,188,306	144,759,436.92	1.59
21	000001	平安银行	8,758,300	144,336,784.00	1.58

22	601966	玲珑轮胎	3,948,852	144,330,540.60	1.58
23	601668	中国建筑	26,955,500	134,777,500.00	1.48
24	00960	龙湖集团	4,435,000	133,094,350.00	1.46
25	300003	乐普医疗	5,230,691	118,370,537.33	1.30
26	603882	金域医学	962,406	107,183,156.22	1.17
27	688157	松井股份	788,906	96,009,860.20	1.05
28	601186	中国铁建	11,361,647	88,620,846.60	0.97
29	600487	亨通光电	5,788,247	87,518,294.64	0.96
30	600582	天地科技	19,613,227	85,905,934.26	0.94
31	688521	芯原股份	1,059,857	81,990,537.52	0.90
32	603727	博迈科	3,987,202	81,817,385.04	0.90
33	00700	腾讯控股	206,700	77,198,316.00	0.85
34	002831	裕同科技	2,268,846	76,437,421.74	0.84
35	600801	华新水泥	3,922,737	75,708,824.10	0.83
36	603338	浙江鼎力	937,782	75,266,383.32	0.82
37	688029	南微医学	351,091	74,666,522.97	0.82
38	688299	长阳科技	2,266,315	74,108,500.50	0.81
39	300558	贝达药业	779,352	62,215,670.16	0.68
40	603337	杰克股份	2,546,739	59,721,029.55	0.65
41	002609	捷顺科技	5,904,059	57,564,575.25	0.63
42	002600	领益智造	7,544,803	55,529,750.08	0.61
43	601816	京沪高铁	11,090,500	53,567,115.00	0.59
44	688050	爱博医疗	252,108	53,000,664.84	0.58
45	02020	安踏体育	523,200	50,007,456.00	0.55
46	300188	美亚柏科	2,790,100	47,961,819.00	0.53
47	603515	欧普照明	2,169,600	45,040,896.00	0.49
48	300470	中密控股	982,277	43,878,313.59	0.48
49	00268	金蝶国际	2,019,000	39,612,780.00	0.43
50	300768	迪普科技	905,893	37,368,086.25	0.41
51	300782	卓胜微	103,760	33,908,768.00	0.37
52	00291	华润啤酒	648,000	33,825,600.00	0.37

53	002475	立讯精密	640,747	31,524,752.40	0.35
54	300124	汇川技术	386,400	26,507,040.00	0.29
55	002920	德赛西威	145,836	20,637,252.36	0.23
56	603517	绝味食品	280,100	19,139,233.00	0.21
57	300725	药石科技	112,300	15,965,691.00	0.17
58	601658	邮储银行	2,829,100	14,428,410.00	0.16
59	01951	锦欣生殖	1,650,500	11,751,560.00	0.13
60	603005	晶方科技	199,980	11,016,898.20	0.12
61	600941	中国移动	124,803	7,186,156.74	0.08
62	002465	海格通信	654,200	7,143,864.00	0.08
63	688083	中望软件	17,910	6,265,455.30	0.07
64	601100	恒立液压	72,100	5,897,780.00	0.06
65	000725	京东方 A	772,500	3,901,125.00	0.04
66	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.02
67	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.01
68	300760	迈瑞医疗	1,800	685,440.00	0.01
69	600809	山西汾酒	1,540	486,301.20	0.01
70	600779	水井坊	3,400	407,966.00	0.00
71	688112	鼎阳科技	4,901	392,325.05	0.00
72	600276	恒瑞医药	7,560	383,367.60	0.00
73	603288	海天味业	3,250	341,607.50	0.00
74	688211	中科微至	4,501	321,011.32	0.00
75	603259	药明康德	2,680	317,794.40	0.00
76	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.00
77	688246	嘉和美康	7,719	269,315.91	0.00
78	600132	重庆啤酒	1,500	226,980.00	0.00
79	688008	澜起科技	2,600	218,062.00	0.00
80	300896	爱美客	400	214,444.00	0.00
81	300122	智飞生物	1,700	211,820.00	0.00
82	600519	贵州茅台	100	205,000.00	0.00
83	03690	美团-W	1,100	202,719.00	0.00

84	01801	信达生物	5,000	197,250.00	0.00
85	02269	药明生物	2,400	181,608.00	0.00
86	301190	善水科技	5,741	171,802.70	0.00
87	002624	完美世界	7,500	152,325.00	0.00
88	688121	卓然股份	3,681	134,062.02	0.00
89	002050	三花智控	4,400	111,320.00	0.00
90	603899	晨光文具	1,600	103,216.00	0.00
91	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00
92	002138	顺络电子	2,600	99,268.00	0.00
93	01999	敏华控股	10,000	98,800.00	0.00
94	688697	纽威数控	5,837	93,567.11	0.00
95	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
96	000858	五 粮 液	400	89,064.00	0.00
97	01024	快手一W	1,500	88,365.00	0.00
98	603986	兆易创新	500	87,925.00	0.00
99	603290	斯达半导	200	76,200.00	0.00
100	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
101	300347	泰格医药	500	63,900.00	0.00
102	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.00
103	603833	欧派家居	400	59,000.00	0.00
104	06862	海底捞	4,000	57,560.00	0.00
105	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
106	688557	兰剑智能	1,812	49,830.00	0.00
107	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
108	06618	京东健康	800	40,192.00	0.00
109	688038	中科通达	2,132	39,911.04	0.00
110	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
111	300979	华利集团	400	35,620.00	0.00
112	300251	光线传媒	2,500	32,125.00	0.00
113	002044	美年健康	4,000	31,400.00	0.00
114	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00

115	01579	颐海国际	1,000	29,470.00	0.00
116	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
117	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
118	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
119	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
120	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
121	00772	阅文集团	600	24,036.00	0.00
122	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
123	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
124	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
125	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
126	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
127	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
128	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
129	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
130	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
131	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
132	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
133	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
134	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
135	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
136	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
137	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
138	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
139	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
140	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
141	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
142	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
143	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
144	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
145	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00

146	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
147	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
148	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
149	301092	争光股份	323	11,472.96	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	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
157	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
158	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
159	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
160	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
161	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
162	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
163	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
164	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
165	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
166	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
167	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
168	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
169	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
170	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
171	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
172	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
173	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
174	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
175	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
176	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00

177	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
178	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
179	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
180	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
181	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
182	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
183	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000338	潍柴动力	399,453,654.45	5.41
2	01810	小米集团-W	303,322,409.08	4.11
3	000001	平安银行	288,451,568.06	3.91
4	601899	紫金矿业	266,709,802.00	3.61
5	002600	领益智造	261,615,612.45	3.54
6	603501	韦尔股份	236,851,745.01	3.21
7	02382	舜宇光学科技	234,275,845.37	3.17
8	600048	保利发展	232,230,566.56	3.14
9	601636	旗滨集团	230,984,951.59	3.13
10	600176	中国巨石	229,545,452.39	3.11
11	00700	腾讯控股	218,292,499.33	2.96
12	02202	万科企业	213,117,135.42	2.89
13	300628	亿联网络	204,609,440.05	2.77
14	603345	安井食品	201,355,644.85	2.73
15	601318	中国平安	185,832,506.32	2.52
16	603160	汇顶科技	172,722,430.73	2.34
17	600309	万华化学	163,349,053.36	2.21
18	601966	玲珑轮胎	145,608,202.50	1.97

19	002142	宁波银行	144,781,189.67	1.96
20	601668	中国建筑	139,523,029.00	1.89

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	300750	宁德时代	530,126,386.99	7.18
2	600779	水井坊	354,246,494.34	4.80
3	600309	万华化学	346,658,264.07	4.69
4	601318	中国平安	327,108,472.44	4.43
5	000001	平安银行	306,713,555.70	4.15
6	02382	舜宇光学科技	296,884,095.89	4.02
7	00700	腾讯控股	294,985,215.50	3.99
8	000338	潍柴动力	278,458,768.03	3.77
9	603259	药明康德	243,642,730.11	3.30
10	000725	京东方A	236,759,873.25	3.21
11	601636	旗滨集团	219,622,601.39	2.97
12	603866	桃李面包	211,539,445.64	2.86
13	02269	药明生物	178,594,922.72	2.42
14	603659	璞泰来	166,853,125.65	2.26
15	00268	金蝶国际	160,163,266.10	2.17
16	601233	桐昆股份	158,935,535.75	2.15
17	02202	万科企业	147,333,356.74	1.99
18	002142	宁波银行	144,064,326.38	1.95
19	300558	贝达药业	132,679,226.50	1.80
20	002600	领益智造	126,169,001.30	1.71

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	7,923,250,136.01
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	6,962,130,961.10
--------------	------------------

注：本项中8.4.1、8.4.2、8.4.3表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	431,396,000.00	4.73
	其中：政策性金融债	431,396,000.00	4.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	4,929,000.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	436,325,000.00	4.78

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	190214	19国开14	1,300,000	130,728,000.00	1.43
2	190407	19农发07	500,000	50,195,000.00	0.55
3	190403	19农发03	500,000	50,100,000.00	0.55
4	150412	15农发12	400,000	40,284,000.00	0.44
5	210306	21进出06	400,000	39,972,000.00	0.44

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券除宁波银行（证券代码：002142）、韦尔股份（证券代码：603501）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2021年12月29日，宁波银行（证券代码：002142）发行人宁波银行股份有限公司因信用卡业务管理不到位被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局罚款人民币30万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

2021年07月30日，宁波银行（证券代码：002142）发行人宁波银行股份有限公司因贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储等被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局罚款人民币275万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

2021年07月14日，宁波银行（证券代码：002142）发行人宁波银行股份有限公司因违规为存款人多头开立银行结算账户及超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料等被中国人民银行宁波市中心支行给予警告，并处罚款286.2万元。

2021年06月10日，宁波银行（证券代码：002142）发行人宁波银行股份有限公司因代理销售保险不规范被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局罚款人民币25万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

2021年05月01日，韦尔股份（证券代码：603501）发行人上海韦尔半导体股份有限公司因未及时在临时公告中披露资产质押情况被中国证券监督管理委员会上海监管局决定采取出具警示函的监管措施。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和视为，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。

8.12.2 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	788,238.57
2	应收证券清算款	359,642,317.20
3	应收股利	1,667,560.00
4	应收利息	5,572,310.29
5	应收申购款	47,257.20
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	367,717,683.26

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603596	伯特利	36,916,000.00	0.40	股东减持

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§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
71,459	103,065.19	3,439,796.25	0.05%	7,361,495,946.85	99.95%

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	10,394,978.37	0.1411%

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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年07月14日)基金份额总额	5,942,070,680.87
本报告期期初基金份额总额	6,101,539,086.48
本报告期基金总申购份额	1,263,396,656.62
减：本报告期基金总赎回份额	—
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	7,364,935,743.10

注：总申购份额含转换入份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，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

本报告期基金管理人无重大人事变动。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自2021年10月27日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人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

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。本报告期应支付给该会计师事务所的报酬120,000.00元，已连续为本基金提供审计服务2年。

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

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所施以重大处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	2	4,922,419,357.91	33.79%	3,485,063.35	33.77%	—
中信证券	2	4,535,892,671.53	31.14%	3,202,990.07	31.04%	—
长江证券	2	1,311,621,075.93	9.00%	932,965.02	9.04%	—
方正证券	2	1,301,482,388.72	8.93%	925,728.18	8.97%	—
首创证券	2	755,143,111.84	5.18%	536,745.72	5.20%	—
海通证券	2	639,594,819.60	4.39%	452,806.48	4.39%	—
西部证券	1	354,418,955.97	2.43%	252,099.01	2.44%	—
中国中金财富证券	2	336,211,335.68	2.31%	239,150.68	2.32%	—
广发证券	2	251,484,889.43	1.73%	178,880.39	1.73%	—

长城证券	1	159,301,516.64	1.09%	113,311.55	1.10%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 经营行为规范，内控制度健全，信誉良好。

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(3) 研究实力较强，能及时为本公司提供高质量的研究服务。

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需
要，并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、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：海通证券、华安证券、方正证券、东亚前海证券、长城证
券、中国中金财富证券、东方证券、开源证券、西部证券、国联证券、中银国际证券、首创证券及
长江证券

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无

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
中信建投证	1,751,66	4.30%	-	-	-	-	-	-

券	0.40							
中信证券	5,722,060.32	14.04%	-	-	-	-	-	-
长江证券	20,516,533.00	50.34%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	300,000,000.00	66.67%	-	-	-	-
首创证券	-	-	150,000,000.00	33.33%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	12,765,850.70	31.32%	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	泓德基金管理有限公司关于泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-04
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加交通银行股份有限公司为销售机构及	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-13

	开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告		
3	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加光大证券股份有限公司为销售机构及参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-16
4	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-19
5	泓德基金管理有限公司关于泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-22
6	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-06
7	泓德基金管理有限公司关于泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-03
8	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-31
9	泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与北京汇成基金销售有限公司基金转换费率	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-01

	优惠的公告		
10	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加财通证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-29
11	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中泰证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-30
12	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-30
13	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信建投期货有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-20
14	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加第一创业证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-28
15	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-29
16	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-07-28
17	泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与兴业银行股份有限公司费率优惠活动并调整最低申购及定投金额起点的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-08-07
18	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京度小	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-08-10

	满基金销售有限公司为销售机构的公告		
19	泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司基金转换费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-14

§ 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

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。

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

- 1、中国证监会批准泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德瑞兴三年持有期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和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

13.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- 2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司，客户服务电话：4009-100-888
- 3、投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.hongdefund.com

泓德基金管理有限公司
二〇二二年三月三十日