

中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:中融基金管理有限公司

基金托管人:国信证券股份有限公司

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。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月24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，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，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	6
§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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	13
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	14
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	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	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	19
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	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	60
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	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
8.12 投资组合报告附注.....	60
§9 基金份额持有人信息.....	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
§10 开放式基金份额变动.....	61
§11 重大事件揭示.....	62
11.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
11.4 基金投资策略的改变.....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
11.8 其他重大事件.....	64
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
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.....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§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	中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中融国企改革混合
基金主代码	000928
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月16日
基金管理人	中融基金管理有限公司
基金托管人	国信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,180,999.30份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过自上而下资产配置与自下而上精选品种相结合的投资策略，动态平衡股票和债券的投资比例，控制组合整体风险，力争在不同的市场环境中都获得较稳定的收益。
投资策略	本基金投资组合中的股票类资产的选择采用“自下而上”为主的精选策略，基于对国企改革相关政策的分析和对企业基本面的深入研究，进行长期投资，并采用定性分析与定量分析相结合的方法，精选个股，构建投资组合。本基金投资组合中的债券类资产将采取自上而下和自下而上相结合的方式进行，积极主动地预测市场利率的变动趋势，同时审视夺度精选个券。 1. 股票类资产投资策略 2. 债券类资产投资策略 3. 中小企业私募债投资策略 4. 股指期货投资策略
业绩比较基准	中证国有企业改革指数收益率*55%+上证国债指数收益率*45%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属

	于证券投资基金中的中等风险和中等预期收益产品。
--	-------------------------

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		中融基金管理有限公司	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周妹云	薛璐
	联系电话	010-56517000	0755-22940163
	电子邮箱	zhoumeiyun@zrfunds.com.cn	03339@guosen.com.cn
客户服务电话		400-160-6000; 010-56517299	0755-22940701
传真		010-56517001	0755-22940165
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3202、3203B	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址		北京市朝阳区望京东园四区2号楼17层1701号01室	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦19楼
邮政编码		100102	518000
法定代表人		王瑶	张纳沙

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	http://www.zrfunds.com.cn/
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
注册登记机构	中融基金管理有限公司	北京市朝阳区望京东园四区2号楼17

层1701号01室

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年	2020年	2019年
本期已实现收益	13,846,042.67	43,594,097.94	8,543,502.65
本期利润	5,924,308.79	35,863,230.70	27,671,007.55
加权平均基金份额本期利润	0.2034	0.6467	0.2843
本期加权平均净值利润率	10.16%	48.38%	28.72%
本期基金份额净值增长率	12.20%	66.52%	32.91%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	25,351,097.51	27,404,603.61	-4,043,305.03
期末可供分配基金份额利润	1.1429	0.8074	-0.0476
期末基金资产净值	47,532,096.81	64,831,169.55	97,382,164.57
期末基金份额净值	2.143	1.910	1.147
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	114.30%	91.00%	14.70%

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的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.41%	1.06%	1.95%	0.43%	8.46%	0.63%

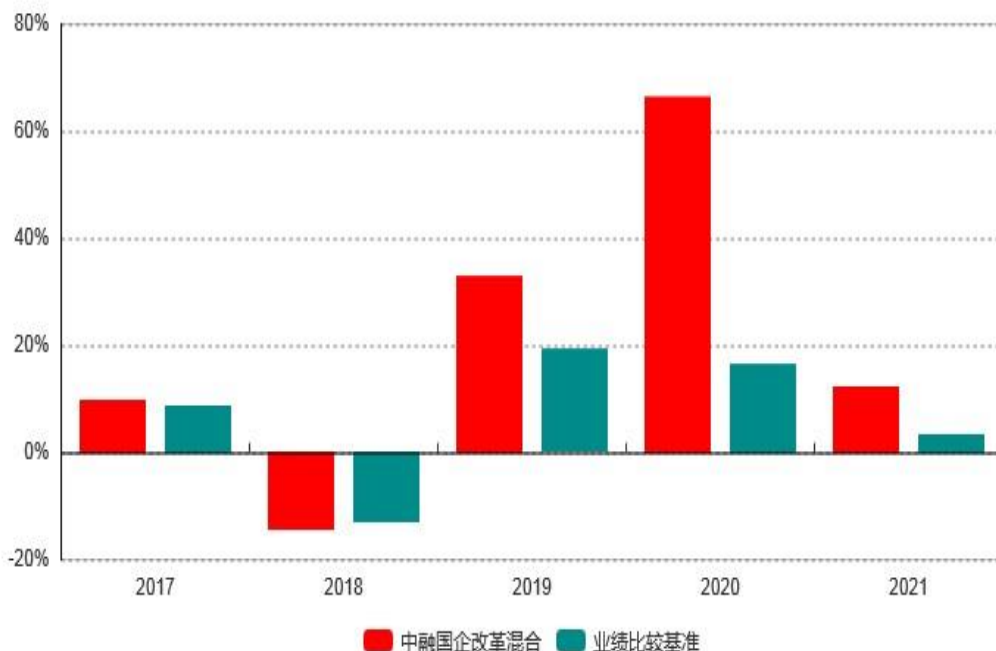
过去六个月	2.19%	1.34%	1.97%	0.54%	0.22%	0.80%
过去一年	12.20%	1.46%	3.39%	0.64%	8.81%	0.82%
过去三年	148.32%	1.40%	43.56%	0.72%	104.76%	0.68%
过去五年	132.68%	1.17%	35.89%	0.67%	96.79%	0.50%
自基金合同生效起至今	114.30%	1.43%	46.64%	0.90%	67.66%	0.53%

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



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

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：本基金合同生效当年按实际存续期计算，不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

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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

本基金管理人为中融基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由中融国际信托有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2021年12月31日，中融基金管理有限公司共管理73只基金，包括中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融中证银行指数证券投资基金(LOF)、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融量化智选混合

型证券投资基金、中融盈泽中短债债券型证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融睿祥纯债债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金（FOF）、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融策略优选混合型证券投资基金、中融恒鑫纯债债券型证券投资基金、中融聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融恒安纯债债券型证券投资基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金、中融1-5年国开行债券指数证券投资基金、中融聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、中融价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金、中融成长优选混合型证券投资基金、中融景瑞一年持有期混合型证券投资基金、中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金、中融景颐6个月持有期混合型证券投资基金、中融行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、中融景盛一年持有期混合型证券投资基金、中融恒益纯债债券型证券投资基金、中融恒阳纯债债券型证券投资基金、中融低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、中融景泓一年持有期混合型证券投资基金、中融金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、中融匠心优选混合型证券投资基金、中融添益进取3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中融恒利纯债债券型证券投资基金、中融高质量成长混合型证券投资基金、中融景惠混合型证券投资基金、中融聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒泽纯债债券型证券投资基金、中融研发创新混合型证券投资基金。

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	说明
----	----	-----------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
赵睿	中融稳健添利债券型证券投资基金、中融融裕双利债券型证券投资基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融景瑞一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。	2020-02-04	-	7	赵睿女士，中国国籍，毕业于英国巴斯大学金融与银行专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限7年。2014年2月至2014年12月任国信证券（香港）资产管理有限公司固定收益部研究助理；2015年4月至2017年7月任宝盈基金管理有限公司研究部研究员。2017年7月加入中融基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理。

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（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

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理办法》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理办法要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金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5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年A股市场表现季度间波动较大，一季度春节后市场对全球流动性收紧的预期导致估值偏高的核心资产下跌，市场风险偏好有所下降，主要指数均出现下跌。二季度国内疫情有所反复，市场流动性维持宽松，在一季度市场大跌后估值和预期有一定修复的背景下，二季度主要指数均出现上涨，三季度政策影响了市场风险偏好，叠加部分的热门行业交易拥挤，估值偏高，主要指数出现下跌，但因供需缺口价格上涨的周期资源品板块表现亮眼。四季度中央经济会议定调稳增长，国内经济承压，流动性预计维持宽松基调，市场呈现震荡上行态势。全年本基金配置上偏均衡配置，强调盈利驱动，寻找结构性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融国企改革混合基金份额净值为2.143元，本报告期内，基金份额净值增长率为12.20%，同期业绩比较基准收益率为3.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022年是非常重要的年份，换届重要会议将会召开，2021年底中央经济工作会议已定调以经济建设为中心，稳字当头，稳中求进，为2022年的二十大胜利召开营造良好环境。2022年中国经济承压，政策求稳，预计国内流动性仍维持宽松基调，对2022年权益市场不悲观，寻找结构性机会。中长期来看，在房住不炒的背景下，打破中国居民大类资产配置重房产轻权益的格局，居民资产有望加速向权益市场转移；从全球资产配置的角度来看，随着中国综合竞争力提升，中国资产吸引力增加，外资流入或将是大势所趋，或会支撑股市的中长期向好。

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，本基金管理人在内部监察稽核工作中，一切从合规运作、保障基金份额持有人的利益出发，由督察长领导法律合规部及风险管理部对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，推动公司内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议，并跟踪改进落实情况。本报告期内，公司内部控制体系运行顺利，本基金运作没有出现违法违规行为。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

1、根据基金监管法律法规的最新变化，推动公司各部门及时完善与更新制度规范和业务流程，制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度，确保内控制度的适时性、全面性和合法合规性，并加强内部督导，将风险意识贯穿于各岗位与各业务环节。

2、日常监察和专项监察相结合，通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法，加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测，并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查。

3、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

4、规范基金投资业务，保证投资管理工作规范有序、合法合规进行。公司制定了严格规范的投资管理制度和流程机制，以投资决策委员会为最高投资决策机构，投资业务均按照管理制度和业务流程执行。

5、以外聘律师、讲座等多种方式加强合规教育与培训，促进公司合规文化的建设，及时向公司传达基金相关的法律法规；加大了对员工行为的监察稽核力度，从源头上防范合规风险，防范利益输送行为。公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风

风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。我们将继续以风险控制为核心，进一步提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金的规范运作，充分保障基金份额持有人的利益。

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基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。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与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，成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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，本基金存在连续20个工作日基金资产净值低于5000万的情形。

§ 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，在本报告期间，本基金托管人——国信证券股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人对基金管理人的投资运作进行了必要监督，对资产净值的计算、利润分配、基金费用开支等业务进行了认真复核，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、投资组合情况等财务数据内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第61067197_A02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	中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的中融国企改革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，公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中融国企改革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	—
其他事项	—
其他信息	中融国企改革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，管理层负责评估中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在

	按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中融国企改革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中融国企改革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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	许培菁	朱燕
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层	

审计报告日期	2022-03-23
--------	------------

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	674,705.66	1,235,903.12
结算备付金		106,165.01	112,101.47
存出保证金		101,331.13	100,518.54
交易性金融资产	7.4.7.2	46,830,434.52	64,142,483.99
其中：股票投资		44,388,702.22	60,837,785.69
基金投资		-	-
债券投资		2,441,732.30	3,304,698.30
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		17,864.55	151,517.22
应收利息	7.4.7.5	40,362.78	33,434.33
应收股利		-	-
应收申购款		4,399.63	143,147.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		47,775,263.28	65,919,105.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		16,719.11	756,101.38
应付管理人报酬		62,040.52	81,408.81
应付托管费		10,340.07	13,568.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	69,752.80	72,462.55
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	84,313.97	164,395.37
负债合计		243,166.47	1,087,936.26
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	22,180,999.30	33,940,686.08
未分配利润	7.4.7.10	25,351,097.51	30,890,483.47
所有者权益合计		47,532,096.81	64,831,169.55
负债和所有者权益总计		47,775,263.28	65,919,105.81

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值人民币2.143元，基金份额总额22,180,999.30份。

7.2 利润表

会计主体：中融国企改革灵活配置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	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2021年01月01日至 2021年12月31日	2020年01月01日至202 0年12月31日
一、收入		7,947,258.87	38,264,100.09
1. 利息收入		82,846.39	169,222.45
其中：存款利息收入	7.4.7.11	16,557.57	43,594.24
债券利息收入		66,288.82	125,628.21
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		15,692,207.68	45,771,893.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	15,093,151.91	45,112,655.72
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	78,812.53	154,440.96
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	520,243.24	504,796.67
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.18	-7,921,733.88	-7,730,867.24
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.19	93,938.68	53,851.53
减：二、费用		2,022,950.08	2,400,869.39
1. 管理人报酬		875,068.96	1,117,581.16
2. 托管费		145,844.77	186,263.58
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.20	807,413.02	904,551.92
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.09	0.69
7. 其他费用	7.4.7.21	194,623.24	192,472.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,924,308.79	35,863,230.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,924,308.79	35,863,230.70

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中融国企改革灵活配置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)	33,940,686.08	30,890,483.47	64,831,169.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,924,308.79	5,924,308.79
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)	-11,759,686.78	-11,463,694.75	-23,223,381.53
其中：1. 基金申购款	15,466,029.95	15,159,797.08	30,625,827.03
2. 基金赎回	-27,225,716.73	-26,623,491.83	-53,849,208.56

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）	22,180,999.30	25,351,097.51	47,532,096.81
项 目	上年度可比期间 2020年01月01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）	84,927,951.31	12,454,213.26	97,382,164.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,863,230.70	35,863,230.70
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）	-50,987,265.23	-17,426,960.49	-68,414,225.72
其中：1. 基金申购款	9,595,545.98	4,869,378.24	14,464,924.22
2. 基金赎回款	-60,582,811.21	-22,296,338.73	-82,879,149.94
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）	33,940,686.08	30,890,483.47	64,831,169.55

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：

王瑶

曹健

李克

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

中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]1252号文《关于准予中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册，由中融基金管理有限公司于2014年12月3日至2014年12月12日向社会公开募集，基金合同于2014年12月16日正式生效。本基金属于契约型开放式，存续期限不定。首次设立募集规模为640,520,239.64份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为中融基金管理有限公司，基金托管人为国信证券股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的各类股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、中期票据、央行票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、股指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法律法规或相关规定。基金的投资组合比例为：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）投资比例为基金资产的0-95%，其中投资于国企改革主题方向的相关证券比例不低于非现金基金资产的80%。债券、权证、中期票据、中小企业私募债、现金、货币市场工具和资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5%-100%，其中权证投资比例不超过基金资产净值的3%，中小企业私募债的投资比例不超过基金资产净值的10%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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：中证国有企业改革指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

本基金的财务报表于2022年3月24日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证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<年度和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

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。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资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

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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为10次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%，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，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	674,705.66	1,235,903.12
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	674,705.66	1,235,903.12

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		42,329,779.53	44,388,702.22	2,058,922.69
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	2,447,874.63	2,441,732.30	-6,142.33
	银行间市场	—	—	—
	合计	2,447,874.63	2,441,732.30	-6,142.33

资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		44,777,654.16	46,830,434.52	2,052,780.36
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		50,864,593.15	60,837,785.69	9,973,192.54
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,303,376.60	3,304,698.30	1,321.70
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,303,376.60	3,304,698.30	1,321.70
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		54,167,969.75	64,142,483.99	9,974,514.24

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

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

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

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	171.46	388.75
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	52.58	55.44
应收债券利息	40,088.58	32,940.42
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
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	50.16	49.72
合计	40,362.78	33,434.33

7.4.7.6 其他资产

注：无。

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	69,752.80	72,462.55
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	69,752.80	72,462.55

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	13.97	95.37
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	84,300.00	164,300.00

合计	84,313.97	164,395.37
----	-----------	------------

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	33,940,686.08	33,940,686.08
本期申购	15,466,029.95	15,466,029.95
本期赎回（以“-”号填列）	-27,225,716.73	-27,225,716.73
本期末	22,180,999.30	22,180,999.30

注：本期申购中含转换入份额及金额，本期赎回中含转换出份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,404,603.61	3,485,879.86	30,890,483.47
本期利润	13,846,042.67	-7,921,733.88	5,924,308.79
本期基金份额交易产生的变动数	-13,669,108.56	2,205,413.81	-11,463,694.75
其中：基金申购款	15,521,294.38	-361,497.30	15,159,797.08
基金赎回款	-29,190,402.94	2,566,911.11	-26,623,491.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,581,537.72	-2,230,440.21	25,351,097.51

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01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	11,385.02	37,890.48
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	3,292.85	3,580.76
其他	1,879.70	2,123.00
合计	16,557.57	43,594.24

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	288,183,804.24	349,715,490.91
减：卖出股票成本总额	273,090,652.33	304,602,835.19
买卖股票差价收入	15,093,151.91	45,112,655.72

7.4.7.13 基金投资收益

注：无。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

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01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	78,812.53	154,440.96
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	78,812.53	154,440.96

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01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	6,202,388.81	17,589,323.97
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,023,983.87	16,980,406.48
减：应收利息总额	99,592.41	454,476.53
买卖债券差价收入	78,812.53	154,440.96

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.16 衍生工具收益

注：无。

7.4.7.17 股利收益

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01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	520,243.24	504,796.67
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	520,243.24	504,796.67

7.4.7.18 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2021年12	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12
------	---------------------------	--------------------------------

	月31日	月31日
1. 交易性金融资产	-7,921,733.88	-7,730,867.24
——股票投资	-7,914,269.85	-7,747,188.94
——债券投资	-7,464.03	16,321.70
——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	-7,921,733.88	-7,730,867.24

7.4.7.19 其他收入

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01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	85,579.03	45,914.59
转换费收入	8,359.65	7,936.94
合计	93,938.68	53,851.53

7.4.7.20 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01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	807,413.02	904,551.92
银行间市场交易费用	-	-
合计	807,413.02	904,551.92

7.4.7.21 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01月01日至2020年 12月31日
审计费用	75,000.00	75,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	2,423.24	272.04
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	194,623.24	192,472.04

7.4.7.22 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

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
国信证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
中融（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司
中融国际信托有限公司	基金管理人股东
中融基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国信证券股份有限公司	334,361,893.43	60.61%	177,359,282.28	28.01%

7.4.10.1.2 权证交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：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01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国信证券股份有限公司	1,728,023.80	21.62%	10,403,176.40	33.92%

7.4.10.1.4 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国信证券股份有限公司	311,391.69	66.21%	69,752.80	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国信证券股份有限公司	165,172.37	33.13%	22,475.67	31.02%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	875,068.96	1,117,581.16
其中：支付销售机构的客户维护费	310,775.15	422,042.82

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 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01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	145,844.77	186,263.58

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

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

份额单位：份

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01月01日至 2020年12月31日
基金合同生效日（2014年12月16日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	18,247,262.77
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	18,247,262.77
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：(1) 基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付；
(2) 期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：含转换出份额。

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

注：无。

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01月01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
国信证券股份有限公司	674,705.66	11,385.02	1,235,903.12	37,890.48

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，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

注：无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

注：无。

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	可流通日	流通受限	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本	期末估值	备注

		日		类型		单价	位：股)	总额	总额	
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未流通	16.53	16.53	268	4,430.04	4,430.04	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

注：无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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涉及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实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

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的发行人出现违约、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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：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。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因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关于未来现金流的风险。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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2021 年 1 2 月 31 日					
资产					
银行存款	674,705.66	-	-	-	674,705.66
结算备 付金	106,165.01	-	-	-	106,165.01
存出保 证金	101,331.13	-	-	-	101,331.13
交易性 金融资 产	2,441,732.30	-	-	44,388,702.22	46,830,434.52
应收证 券清算 款	-	-	-	17,864.55	17,864.55
应收利 息	-	-	-	40,362.78	40,362.78
应收申 购款	-	-	-	4,399.63	4,399.63
资产总 计	3,323,934.10	-	-	44,451,329.18	47,775,263.28
负债					
应付赎 回款	-	-	-	16,719.11	16,719.11
应付管 理人报 酬	-	-	-	62,040.52	62,040.52
应付托 管费	-	-	-	10,340.07	10,340.07
应付交 易费用	-	-	-	69,752.80	69,752.80
其他负 债	-	-	-	84,313.97	84,313.97
负债总 计	-	-	-	243,166.47	243,166.47
利率敏 感度缺 口	3,323,934.10	-	-	44,208,162.71	47,532,096.81
上年度 末 2020 年 1 2 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	1,235,903.12	-	-	-	1,235,903.12
结算备付金	112,101.47	-	-	-	112,101.47
存出保证金	100,518.54	-	-	-	100,518.54
交易性金融资产	3,304,698.30	-	-	60,837,785.69	64,142,483.99
应收证券清算款	-	-	-	151,517.22	151,517.22
应收利息	-	-	-	33,434.33	33,434.33
应收申购款	-	-	-	143,147.14	143,147.14
资产总计	4,753,221.43	-	-	61,165,884.38	65,919,105.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	756,101.38	756,101.38
应付管理人报酬	-	-	-	81,408.81	81,408.81
应付托管费	-	-	-	13,568.15	13,568.15
应付交易费用	-	-	-	72,462.55	72,462.55
其他负债	-	-	-	164,395.37	164,395.37
负债总计	-	-	-	1,087,936.26	1,087,936.26
利率敏感度缺口	4,753,221.43	-	-	60,077,948.12	64,831,169.55

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

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对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，无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外币汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	44,388,702.22	93.39	60,837,785.69	93.84
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,441,732.30	5.14	3,304,698.30	5.10
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	46,830,434.52	98.52	64,142,483.99	98.94

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；		
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；		
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
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
	沪深300指数上升5%	2,431,015.65	3,199,366.47
	沪深300指数下降5%	-2,431,015.65	-3,199,366.47

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币44,384,272.18元，属于第二层次的余额为人民币2,446,162.34元，属于第三层次的余额为人民币0.00元（上年度末：属于第一层次的余额为人民币60,817,648.67元，属于第二层次的余额为人民币3,324,835.32元，属于第三层次的余额为人民币0.00元）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为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。本基金本报告期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，在第一层次和第二层次之间无重大转换（上年度：无）。本基金本报告期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未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（上年度：无）。

7.4.14.2 承诺事项

无。

7.4.14.3 其他事项

本报告期内，本基金存在连续20个工作日基金资产净值低于人民币5000万元的情况，出现该情况的时间范围为2021年12月3日至2021年12月31日。

截止财务报表批准日，本基金存在连续60个工作日基金资产净值低于人民币5000万元的情况，出现该情况的时间范围为2021年12月3日至2022年3月23日。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2022年3月23日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	44,388,702.22	92.91
	其中：股票	44,388,702.22	92.91
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,441,732.30	5.11
	其中：债券	2,441,732.30	5.11
	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	780,870.67	1.63
8	其他各项资产	163,958.09	0.34
9	合计	47,775,263.28	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	32,053,638.22	67.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,716,980.00	3.61
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	9,224,184.00	19.41
K	房地产业	1,393,900.00	2.93
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	44,388,702.22	93.39

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	300059	东方财富	55,900	2,074,449.00	4.36
2	002409	雅克科技	24,800	2,013,016.00	4.24
3	600703	三安光电	50,600	1,900,536.00	4.00
4	002049	紫光国微	8,300	1,867,500.00	3.93
5	002594	比亚迪	6,900	1,850,028.00	3.89
6	600036	招商银行	37,400	1,821,754.00	3.83
7	000776	广发证券	73,500	1,807,365.00	3.80
8	600754	锦江酒店	29,300	1,716,980.00	3.61

9	603369	今世缘	31,000	1,686,400.00	3.55
10	600872	中炬高新	43,800	1,663,086.00	3.50
11	688187	时代电气	20,263	1,661,566.00	3.50
12	600522	中天科技	96,200	1,631,552.00	3.43
13	000519	中兵红箭	59,800	1,594,866.00	3.36
14	001215	千味央厨	26,200	1,525,102.00	3.21
15	600223	鲁商发展	105,200	1,393,900.00	2.93
16	002074	国轩高科	27,182	1,393,077.50	2.93
17	000001	平安银行	81,500	1,343,120.00	2.83
18	601658	邮储银行	259,400	1,322,940.00	2.78
19	603707	健友股份	31,200	1,310,400.00	2.76
20	601012	隆基股份	15,090	1,300,758.00	2.74
21	605117	德业股份	4,700	1,286,813.00	2.71
22	600418	江淮汽车	73,500	1,278,900.00	2.69
23	300203	聚光科技	44,300	1,251,918.00	2.63
24	600745	闻泰科技	9,300	1,202,490.00	2.53
25	600660	福耀玻璃	22,800	1,074,792.00	2.26
26	301129	瑞纳智能	12,000	1,016,160.00	2.14
27	002241	歌尔股份	17,800	962,980.00	2.03
28	601628	中国人寿	28,400	854,556.00	1.80
29	688599	天合光能	9,850	777,165.00	1.64
30	603786	科博达	8,800	706,640.00	1.49
31	300601	康泰生物	5,400	532,116.00	1.12
32	300973	立高食品	4,000	528,320.00	1.11
33	300850	新强联	100	17,851.00	0.04
34	001296	长江材料	256	15,175.68	0.03
35	001234	泰慕士	268	4,430.04	0.01

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	600754	锦江酒店	6,799,778.00	10.49
2	600036	招商银行	5,925,585.00	9.14
3	002142	宁波银行	5,280,621.12	8.15
4	601677	明泰铝业	5,108,725.00	7.88
5	002049	紫光国微	4,214,826.00	6.50
6	002074	国轩高科	3,950,955.54	6.09
7	601012	隆基股份	3,918,998.00	6.04
8	300363	博腾股份	3,671,594.00	5.66
9	002460	赣锋锂业	3,593,974.00	5.54
10	601658	邮储银行	3,541,836.00	5.46
11	000848	承德露露	3,475,257.00	5.36
12	600745	闻泰科技	3,446,724.00	5.32
13	688580	伟思医疗	3,363,683.92	5.19
14	002594	比亚迪	3,356,971.00	5.18
15	000001	平安银行	3,311,806.00	5.11
16	000568	泸州老窖	3,152,835.00	4.86
17	601567	三星医疗	3,112,085.00	4.80
18	002847	盐津铺子	3,092,370.66	4.77
19	300059	东方财富	2,934,389.00	4.53
20	600882	妙可蓝多	2,881,143.00	4.44
21	688033	天宜上佳	2,829,239.45	4.36
22	000625	长安汽车	2,806,309.00	4.33
23	300791	仙乐健康	2,793,088.00	4.31
24	002466	天齐锂业	2,760,491.45	4.26
25	600887	伊利股份	2,725,921.00	4.20
26	600276	恒瑞医药	2,694,767.00	4.16
27	603501	韦尔股份	2,692,609.00	4.15
28	002371	北方华创	2,663,628.00	4.11
29	600809	山西汾酒	2,660,096.00	4.10

30	600703	三安光电	2,637,375.60	4.07
31	300294	博雅生物	2,636,999.00	4.07
32	300274	阳光电源	2,507,602.00	3.87
33	603259	药明康德	2,498,788.23	3.85
34	601166	兴业银行	2,465,507.00	3.80
35	002409	雅克科技	2,449,401.00	3.78
36	600019	宝钢股份	2,438,149.00	3.76
37	300788	中信出版	2,416,930.00	3.73
38	688187	时代电气	2,378,973.47	3.67
39	001215	千味央厨	2,370,714.73	3.66
40	600258	首旅酒店	2,356,825.00	3.64
41	300077	国民技术	2,350,188.00	3.63
42	300760	迈瑞医疗	2,316,272.00	3.57
43	300034	钢研高纳	2,300,985.60	3.55
44	000519	中兵红箭	2,274,894.00	3.51
45	688087	英科再生	2,180,388.99	3.36
46	605117	德业股份	2,161,352.00	3.33
47	600418	江淮汽车	2,135,715.00	3.29
48	300750	宁德时代	2,123,635.00	3.28
49	002050	三花智控	2,094,725.00	3.23
50	600519	贵州茅台	2,079,450.00	3.21
51	688598	金博股份	2,040,709.92	3.15
52	002129	中环股份	2,033,573.00	3.14
53	300458	全志科技	2,018,977.00	3.11
54	688059	华锐精密	1,995,442.13	3.08
55	000776	广发证券	1,962,233.00	3.03
56	688981	中芯国际	1,960,661.42	3.02
57	000657	中钨高新	1,949,184.40	3.01
58	603369	今世缘	1,926,884.00	2.97
59	000021	深科技	1,924,132.00	2.97
60	688793	倍轻松	1,852,963.16	2.86

61	603801	志邦家居	1,822,205.00	2.81
62	688363	华熙生物	1,783,689.55	2.75
63	600660	福耀玻璃	1,782,405.00	2.75
64	600161	天坛生物	1,773,167.00	2.74
65	300653	正海生物	1,739,386.30	2.68
66	000636	风华高科	1,735,098.00	2.68
67	600872	中炬高新	1,674,689.00	2.58
68	605305	中际联合	1,650,806.49	2.55
69	300339	润和软件	1,631,125.00	2.52
70	601899	紫金矿业	1,623,181.00	2.50
71	000672	上峰水泥	1,615,297.00	2.49
72	600522	中天科技	1,614,493.00	2.49
73	688308	欧科亿	1,602,165.48	2.47
74	600741	华域汽车	1,585,953.00	2.45
75	300171	东富龙	1,578,613.00	2.43
76	603707	健友股份	1,556,482.00	2.40
77	300203	聚光科技	1,526,736.00	2.35
78	601717	郑煤机	1,502,175.00	2.32
79	600905	三峡能源	1,491,878.00	2.30
80	600223	鲁商发展	1,484,588.00	2.29
81	002928	华夏航空	1,466,437.00	2.26
82	300957	贝泰妮	1,462,018.00	2.26
83	601799	星宇股份	1,459,234.00	2.25
84	600483	福能股份	1,422,590.61	2.19
85	601111	中国国航	1,397,995.00	2.16
86	600588	用友网络	1,355,292.00	2.09
87	300973	立高食品	1,347,553.00	2.08
88	603939	益丰药房	1,346,706.00	2.08
89	002867	周大生	1,342,917.50	2.07
90	300122	智飞生物	1,329,018.00	2.05

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

8.4.2 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	600036	招商银行	6,559,051.24	10.12
2	002460	赣锋锂业	6,484,053.98	10.00
3	002074	国轩高科	5,597,928.40	8.63
4	002142	宁波银行	5,390,709.00	8.31
5	601677	明泰铝业	5,268,205.00	8.13
6	600809	山西汾酒	5,220,183.26	8.05
7	600519	贵州茅台	5,195,493.96	8.01
8	600754	锦江酒店	5,173,898.00	7.98
9	601012	隆基股份	5,104,580.06	7.87
10	002594	比亚迪	5,011,825.52	7.73
11	300750	宁德时代	4,924,420.00	7.60
12	600276	恒瑞医药	4,734,397.60	7.30
13	601567	三星医疗	4,557,961.00	7.03
14	601166	兴业银行	4,465,224.20	6.89
15	000625	长安汽车	4,177,484.75	6.44
16	600745	闻泰科技	4,119,771.00	6.35
17	300363	博腾股份	3,937,000.00	6.07
18	688580	伟思医疗	3,705,231.92	5.72
19	300059	东方财富	3,679,858.06	5.68
20	002049	紫光国微	3,661,953.00	5.65
21	688981	中芯国际	3,621,837.68	5.59
22	000848	承德露露	3,538,447.90	5.46
23	300413	芒果超媒	3,456,688.00	5.33
24	688033	天宜上佳	3,408,986.58	5.26

25	603939	益丰药房	3,395,581.00	5.24
26	300274	阳光电源	3,276,986.00	5.05
27	000568	泸州老窖	3,222,851.00	4.97
28	600305	恒顺醋业	3,072,832.99	4.74
29	601318	中国平安	2,948,683.00	4.55
30	300122	智飞生物	2,922,543.00	4.51
31	600893	航发动力	2,883,541.00	4.45
32	300294	博雅生物	2,877,528.20	4.44
33	000021	深科技	2,854,622.00	4.40
34	603501	韦尔股份	2,700,478.00	4.17
35	300791	仙乐健康	2,677,606.00	4.13
36	300896	爱美客	2,651,165.00	4.09
37	688598	金博股份	2,629,881.86	4.06
38	002129	中环股份	2,627,097.00	4.05
39	300458	全志科技	2,587,785.00	3.99
40	600882	妙可蓝多	2,556,193.00	3.94
41	600019	宝钢股份	2,490,359.00	3.84
42	300077	国民技术	2,479,459.00	3.82
43	688139	海尔生物	2,469,226.74	3.81
44	600887	伊利股份	2,445,414.00	3.77
45	600258	首旅酒店	2,440,096.80	3.76
46	688059	华锐精密	2,381,116.66	3.67
47	603259	药明康德	2,365,397.00	3.65
48	000657	中钨高新	2,311,490.00	3.57
49	300760	迈瑞医疗	2,278,346.00	3.51
50	002847	盐津铺子	2,246,915.76	3.47
51	002466	天齐锂业	2,182,794.00	3.37
52	002050	三花智控	2,133,122.00	3.29
53	600161	天坛生物	2,130,493.00	3.29
54	600438	通威股份	2,129,788.36	3.29
55	601658	邮储银行	2,124,347.00	3.28

56	688016	心脉医疗	2,123,351.92	3.28
57	300653	正海生物	2,059,934.00	3.18
58	000001	平安银行	1,995,011.00	3.08
59	300788	中信出版	1,976,567.54	3.05
60	605305	中际联合	1,950,390.80	3.01
61	002371	北方华创	1,936,105.00	2.99
62	688126	沪硅产业	1,925,428.22	2.97
63	688308	欧科亿	1,865,627.32	2.88
64	603801	志邦家居	1,853,522.00	2.86
65	688363	华熙生物	1,825,189.65	2.82
66	688187	时代电气	1,812,999.54	2.80
67	603658	安图生物	1,755,013.00	2.71
68	688087	英科再生	1,737,379.77	2.68
69	300034	钢研高纳	1,706,931.00	2.63
70	300171	东富龙	1,666,341.00	2.57
71	002756	永兴材料	1,625,351.00	2.51
72	688012	中微公司	1,616,932.86	2.49
73	000636	风华高科	1,591,206.00	2.45
74	688793	倍轻松	1,541,969.64	2.38
75	002928	华夏航空	1,519,983.00	2.34
76	300957	贝泰妮	1,518,322.00	2.34
77	601111	中国国航	1,507,420.00	2.33
78	601799	星宇股份	1,472,580.00	2.27
79	600905	三峡能源	1,430,262.00	2.21
80	600741	华域汽车	1,413,267.00	2.18
81	600588	用友网络	1,389,300.00	2.14
82	601717	郑煤机	1,359,084.00	2.10
83	000672	上峰水泥	1,345,674.00	2.08
84	601899	紫金矿业	1,343,238.00	2.07
85	600660	福耀玻璃	1,325,222.00	2.04

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

8.4.3 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	264,555,838.71
卖出股票收入（成交）总额	288,183,804.24

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

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	2,441,732.30	5.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,441,732.30	5.14

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	019654	21国债06	24,410	2,441,732.30	5.14

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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内基金投资的前十名证券除招商银行(600036), 广发证券(000776), 今世缘(603369)外其他证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。 银保监会2021年05月17日发布对招商银行股份有限公司的处罚(银保监罚决字〔2021〕16号), 陕西省西安市碑林区城市管理局2021年02月02日发布对广发证券股份有限公司的处罚(10375), 国家外汇管理局广东省分局2021年11月30日发布对广发证券股份有限公司的处罚(粤汇处〔2021〕12号), 淮安市清江浦区市场监督管理局2021年09月03日发布对江苏今世缘酒业股份有限公司的处罚(淮清市监处罚(2021)00351号), 淮安市清江浦区市场监督管理局2021年04月16日发布对江苏今世缘酒业股份有限公司的处罚(淮清市监处罚(2021)00352号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作, 上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超过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	101,331.13
2	应收证券清算款	17,864.55
3	应收股利	-
4	应收利息	40,362.78

5	应收申购款	4,399.63
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	163,958.09

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

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，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
3,289	6,743.99	94.97	0.00%	22,180,904.33	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；

2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年12月16日)基金份额总额	640,520,239.64
本报告期期初基金份额总额	33,940,686.08
本报告期基金总申购份额	15,466,029.95
减：本报告期基金总赎回份额	27,225,716.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	22,180,999.30

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2021年6月19日发布公告，中融基金管理有限公司副总裁罗杰先生离任。

本基金管理人于2021年8月28日发布公告，中融基金管理有限公司副总裁田刚先生离任。

公司其他高管人员未变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期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

本报告期内，未改聘会计师事务所。该审计机构已经连续7年为本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为75,000元人民币。

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

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	1	2,768,409.80	0.50%	2,024.54	0.43%	-
银河证券	1	19,000,072.83	3.44%	13,894.63	2.95%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	334,361,893.43	60.61%	311,391.69	66.21%	-
首创证券	2	102,282,145.54	18.54%	74,798.43	15.91%	新增2个交易单元。
中金公司	2	93,221,060.02	16.90%	68,171.32	14.50%	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。
- v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	1,728,023.80	21.62%	-	-	-	-	-	-
首创证券	3,174,651.80	39.73%	-	-	-	-	-	-
中金公司	3,088,634.00	38.65%	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司基金部分渠道申购费率和全渠道定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-04
2	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-06
3	中融基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-27
4	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-17
5	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司公募基金部分渠道申购费率和全渠道定期	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-31

	定额投资费率优惠活动的公告		
6	中融基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
7	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-29
8	中融基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-19
9	中融基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用“中融基金”名义进行诈骗活动的风险提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-09
10	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-14
11	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-21
12	中融基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-28
13	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-26
14	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-18
15	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司“2022倾心回馈”基金定投优惠活动	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-24

	的公告		
16	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-24

§ 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

注：本基金本报告期间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

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会注册中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 《中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (5) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (6) 中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：中融基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，（010）56517299。

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日