

# 华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金

## 2020 年年度报告

### 2020 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年三月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 26 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，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
§4 管理人报告.....	7
§5 托管人报告.....	14
§6 审计报告.....	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
§8 投资组合报告.....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
8.12 投资组合报告附注.....	54
§9 基金份额持有人信息.....	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
§10 开放式基金份额变动.....	55
§11 重大事件揭示.....	55
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§13 备查文件目录.....	59

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华夏新锦升混合	
基金主代码	004050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年5月31日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	229,060,955.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏新锦升混合 A	华夏新锦升混合 C
下属分级基金的交易代码	004050	004051
报告期末下属分级基金的份额总额	229,060,955.69 份	-份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，把握市场机会，追求资产的稳健增值。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、期权投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金属于混合基金，风险与收益高于债券基金与货币市场基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	021-60637111
传真	010-63136700	021-60635778
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区金融大街25号
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	杨明辉	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
----------------	---------

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 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）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年		2019 年		2018 年	
	华夏新锦升混合 A	华夏新锦升混合 C	华夏新锦升混合 A	华夏新锦升混合 C	华夏新锦升混合 A	华夏新锦升混合 C
本期已实现收益	43,110,523.49	-	11,415,030.43	-	3,219,674.94	-
本期利润	86,614,626.66	-	33,912,713.36	-	-15,924,160.18	-
加权平均基金份额本期利润	0.4369	-	0.2983	-	-0.0796	-
本期加权平均净值利润率	35.82%	-	28.95%	-	-8.09%	-
本期基金份额净值增长率	40.71%	-	21.51%	-	-7.84%	-
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
	华夏新锦升混合 A	华夏新锦升混合 C	华夏新锦升混合 A	华夏新锦升混合 C	华夏新锦升混合 A	华夏新锦升混合 C
期末可供分配利润	57,525,207.43	-	3,840,067.63	-	-12,959,834.38	-
期末可供分配基金份额利润	0.2511	-	0.0341	-	-0.0648	-
期末基金资产净值	333,301,777.12	-	116,392,358.54	-	187,066,444.19	-

期末基金份额净值	1.4551	-	1.0341	-	0.9352	-
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
	华夏新锦升混合 A	华夏新锦升混合 C	华夏新锦升混合 A	华夏新锦升混合 C	华夏新锦升混合 A	华夏新锦升混合 C
基金份额累计净值增长率	67.92%	-	19.33%	-	-1.80%	-

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

华夏新锦升混合 A:

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	13.17%	0.70%	6.88%	0.50%	6.29%	0.20%
过去六个月	26.25%	0.93%	12.61%	0.67%	13.64%	0.26%
过去一年	40.71%	0.88%	15.58%	0.71%	25.13%	0.17%
过去三年	57.57%	0.79%	23.60%	0.67%	33.97%	0.12%
自基金合同生效起至今	67.92%	0.74%	33.53%	0.63%	34.39%	0.11%

华夏新锦升混合 C:

2017 年 5 月 31 日至 2020 年 12 月 31 日期间， 华夏新锦升混合 C 类基金份额为零。

#### 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

华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 5 月 31 日至 2020 年 12 月 31 日)

华夏新锦升混合 A



华夏新锦升混合 C

注：2017年5月31日至2020年12月31日期间，华夏新锦升混合C类基金份额为零。

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

华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金  
基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏新锦升混合 A



华夏新锦升混合 C

注：①本基金合同于 2017 年 5 月 31 日生效，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。

②2017 年 5 月 31 日至 2020 年 12 月 31 日期间， 华夏新锦升混合 C 类基金份额为零。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

华夏新锦升混合 A:

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	-	-	-	-	-
2019 年	1.000	10,150,563.18	1,021,969.35	11,172,532.53	-
合计	1.000	10,150,563.18	1,021,969.35	11,172,532.53	-

华夏新锦升混合 C:

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏上证科创板 50 成份 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏中证浙江国资创新发展 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、华夏

中证 5G 通信主题 ETF、华夏中证人工智能主题 ETF、华夏国证半导体芯片 ETF、华夏中证新能源汽车 ETF、华夏粤港澳大湾区创新 100ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏中证细分食品饮料产业主题 ETF、华夏中证全指证券公司 ETF、华夏中证银行 ETF、华夏中证全指房地产 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏恒生互联网科技业 ETF (QDII)、华夏野村日经 225ETF、华夏纳斯达克 100ETF (QDII)、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏饲料豆粕期货 ETF 和华夏黄金 ETF，初步形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，2020 年，华夏基金旗下主要产品在基金分类排名中（数据截至 2020 年 12 月 31 日），华夏创新前沿股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金（A 类）”中排序 21/201；华夏科技成长股票在“股票基金-行业主题股票型基金-TMT 与信息技术行业股票型基金（A 类）”中排序 3/10；华夏移动互联混合（QDII）和华夏新时代混合（QDII）在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中分别排序 4/34 和 2/34；华夏新兴消费混合在“混合基金-行业偏股型基金-消费行业偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）”中排序 1/18；华夏稳盛混合、华夏高端制造混合和华夏军工安全混合在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）”中分别排序 23/481、26/481 和 33/481；华夏消费升级混合 C 在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（非 A 类）”中排序 12/215；华夏聚利债券（A）、华夏双债债券（A 类）及华夏债券（A 类）在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（可投转债）（A 类）”中分别排序 1/184、3/184 和 5/184；华夏鼎利债券（A 类）在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（二级）（A 类）”中排序 5/238；华夏鼎琪三个月定开债券在“债券基金-定期开放式纯债债券型基金-定期开放式纯债债券型基金（A 类）”中排序 5/334；华夏可转债增强债券（A 类）在“债券基金-可转换债券型基金-可转换债券型基金（A 类）”中排序 3/34；华夏鼎通债券在“债券基金-纯债债券型基金-长期纯债债券型基金（A 类）”中排序 31/499；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数（C 类）在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金（非 A 类）”中排序 8/21；华夏创业板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 1/78；华夏消费 ETF 及华夏医药 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”中分别排序 1/33 和 4/33；华夏能源革新股票在“股票基金-行业股票型基金-其他行业股票型基金”中排序 2/36；华夏战略新兴成指 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-主题指数股票 ETF 基金”中排序 5/52；华夏创成长 ETF 及华夏创蓝筹 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-策

略指数股票 ETF 基金”中分别排序 1/16 和 3/16；华夏创业板 ETF 联接及华夏中小板 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）”中分别排序 1/61 和 14/61；华夏战略新兴成指 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-主题指数股票 ETF 联接基金（非 A 类）”中排序 2/18。

公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在中国证券报举办的第十七届中国基金业金牛奖评选活动中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖，华夏上证 50ETF 荣获“三年期开放式指数型持续优胜金牛基金”奖。在证券时报社主办，在晨星资讯、上海证券和济安金信提供数据和研究支持的第十五届中国基金业明星基金奖评选中，华夏基金荣获“ETF 管理明星基金公司”，华夏回报混合荣获“五年持续回报绝对收益策略明星基金”。

在客户服务方面，2020 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金管家客户端上线双周定投、日定投、部分基金定投止盈功能，丰富了投资者定期定额交易的投资形式；（2）华夏基金直销上线美元支付方式，为投资者使用美元交易提供便利；（3）华夏基金微信公众号上线货币基金收益播报推送功能，方便客户及时了解持有的货币基金收益变动情况；（4）与苏州农商银行、渤海银行、中天证券、华融融达等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；（5）开展“凡是家人，都有户口本”、“以家人之名”、“牙掉了之后”、“2020 新鲜事”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗皓亮	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2020-05-07	-	8 年	经济学硕士。2012 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员、基金经理助理等。
魏镇江	本基金的基金经理、固定收益部总监	2017-09-08	2020-06-23	17 年	北京大学经济学硕士。曾任德邦证券债券研究员等。2005 年 3 月加入华夏基金管理有限公司，曾任债券研究员，华夏理财 21 天债券型证券投资基金基金经理（2013 年 4 月

					<p>26 日至 2015 年 4 月 2 日期间)、华夏理财 30 天债券型证券投资基金基金经理 (2013 年 4 月 26 日至 2015 年 4 月 2 日期间)、华夏鼎诚债券型证券投资基金基金经理 (2016 年 12 月 13 日至 2017 年 8 月 30 日期间)、华夏鼎新债券型证券投资基金基金经理 (2016 年 3 月 22 日至 2017 年 11 月 15 日期间)、华夏债券投资基金基金经理 (2010 年 2 月 4 日至 2017 年 12 月 19 日期间)、华夏聚利债券型证券投资基金基金经理 (2014 年 10 月 17 日至 2018 年 1 月 8 日期间)、华夏可转债增强债券型证券投资基金基金经理 (2016 年 9 月 27 日至 2018 年 1 月 8 日期间)、华夏鼎实债券型证券投资基金基金经理 (2018 年 1 月 8 日至 2018 年 3 月 14 日期间)、华夏新锦顺灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 9 月 8 日至 2018 年 12 月 17 日期间)、华夏鼎汇债券型证</p>
--	--	--	--	--	--

					投资基金基金经理（2017年9月8日至2018年12月17日期间）、华夏新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017年9月8日至2018年12月17日期间）、华夏鼎融债券型证券投资基金基金经理（2017年9月8日至2018年12月17日期间）等。
--	--	--	--	--	--

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。

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守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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《华夏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《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

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

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

2020 年，新冠肆虐，国际政局动荡，当称变局之年。股票市场历经年初的短暂下跌后，一路上涨，气贯长虹。消费、医药、新能源、以及部分先进制造业成为全年市场追逐的重点。

在变局之年，股票市场的大幅飘红，除了流动性宽松定调的基础解释外，还是可以站在更高、更长远的维度看待这一现象。买哪些股票，其实非常直接的反映投资人对这个世界运行规则的本质认知。我们正处于变革时代，中国经济增长的资源禀赋在变化。教育与互联网的普及，迅速带动劳动人口素质提升，而人才与制造经验的双向积累为新技术领先带来更大可能性，同时，新生代与世界同辈的认知趋于同步。作为投资于未来企业现金流的股票资产，我们实则对变革时代的中国企业与劳动者，整体给予了更大的长期确定性权重。

我们将本基金的股票仓位上限控制在六成左右，产品长期定位于偏绝对收益。因而，在持仓上，我们选取了竞争格局明朗，供给结构上非常稳定的子行业作为核心配置，比如金融、白酒、医药、家电，这类公司在中长期的盈利可展望性强，中长期回报的确定性更高。同时，我们在组合中小幅配置了需求急速扩张的子行业，尤其是拥有某类特殊资源禀赋或者治理水平显著更高的公司，组合中的快递、视频和个护/家庭护理相关个股基本属于此类情况。固定收益方面，组合对债券资产配置了合理的仓位和久期，并根据市场情况进行了一定的波段操作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，华夏新锦升混合 A 基金份额净值为 1.4551 元，本报告期份额净值增长率为 40.71%，同期业绩比较基准增长率为 15.58%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年，站在变革时代，作为投资者，我们除了对于流动性有一个基础判断以外，更重要是对于两方面需要有更清晰的认知，即，中国消费者需求迅速跃升与变迁，中国企业的技术创新与引领能力。

在组合构建中，作为一个长期定位偏绝对回报的产品，我们仍将维持原有行业配置思路，以低估值蓝筹与稳定成长作为核心配置。固定收益方面将继续对债券资产配置合理的仓位和久期，并根据市场情况进行一定的波段操作。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司持续完善合规管理制度建设，修订了合规风险管理制度，对各层级的合规管理职责、合规考核、奖惩、履职保障等方面进行完善，进一步健全了合规管理机制；修订了内幕交易防控制度，强化了投资交易重点领域的合规风险防控；制定了基金参与重大关联交易管理制度，确保基金投资操作符合法律法规和监管要求。对发现的基金投资交易过程中的合规风险进行提示，对遇到的合规问题进行研究分析，充分评估给予合规意见，把控合规风险。公司开展多种形式的法律法规和职业道德培训，通过法律法规和案例讲解，不断加深员工的理解，强化合规意识，促进廉洁从业。公司严格落实信息披露新规要求，按期完成基金产品资料概要披露工作，依法合规开展信息披露工作。在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及离任审计工作，对资产管理计划业务和分支机构业务进行检查监督，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

#### 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，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务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技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，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

报告期内，本基金未出现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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况真实、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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2021)第 23917 号

华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

#### (1) 我们审计的内容

我们审计了华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“华夏新锦升混合基金”）的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 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。

#### (2) 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，公允反映了华夏新锦升混合基金 2020 年 12

月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.2 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，我们独立于华夏新锦升混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

## 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏新锦升混合基金的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华夏新锦升混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华夏新锦升混合基金、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华夏新锦升混合基金的财务报告过程。

## 6.4 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。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏新锦升混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致华夏新锦升混合基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）中国注册会计师  
单峰 程红粤  
 上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼  
 2021 年 3 月 26 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,390,697.86	1,030,890.69
结算备付金		185,408.11	490,542.10
存出保证金		43,885.88	33,119.53
交易性金融资产	7.4.7.2	330,396,034.25	116,799,334.69
其中：股票投资		217,287,484.25	62,276,096.36
基金投资		-	-
债券投资		113,108,550.00	54,523,238.33
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		-	559,825.47
应收利息	7.4.7.5	1,846,481.16	787,682.38
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		336,862,507.26	119,701,394.86
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	3,000,000.00
应付证券清算款		3,001,438.36	-
应付赎回款		2,825.69	-
应付管理人报酬		164,307.42	59,516.07
应付托管费		27,384.57	9,919.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	188,066.85	66,063.70
应交税费		7,786.02	2,866.92
应付利息		-1,078.77	670.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	170,000.00	170,000.00
负债合计		3,560,730.14	3,309,036.32
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	229,060,955.69	112,552,290.91
未分配利润	7.4.7.10	104,240,821.43	3,840,067.63
所有者权益合计		333,301,777.12	116,392,358.54
负债和所有者权益总计		336,862,507.26	119,701,394.86

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，华夏新锦升混合 A 基金份额净值 1.4551 元，华夏新锦升混合基金份额总额 229,060,955.69 份（其中 A 类 229,060,955.69 份，C 类 0.00 份）。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
一、收入		89,355,235.43	35,807,571.14

1.利息收入		3,286,317.95	2,208,387.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	71,336.87	52,517.00
债券利息收入		3,145,170.88	2,131,204.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		69,810.20	24,666.23
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		42,120,906.65	10,995,695.72
其中：股票投资收益	7.4.7.12	40,012,826.13	7,058,544.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-223,152.57	2,599,724.11
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
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	2,331,233.09	1,337,426.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	43,504,103.17	22,497,682.93
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	443,907.66	105,804.82
<b>减：二、费用</b>		2,740,608.77	1,894,857.78
1.管理人报酬		1,439,531.84	703,761.24
2.托管费		239,922.01	117,293.51
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.20	766,522.40	407,195.97
5.利息支出		63,274.47	443,844.49
其中：卖出回购金融资产支出		63,274.47	443,844.49
6.税金及附加		8,598.60	5,398.83
7.其他费用	7.4.7.21	222,759.45	217,363.74
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		86,614,626.66	33,912,713.36
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		86,614,626.66	33,912,713.36

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	112,552,290.91	3,840,067.63	116,392,358.54
二、本期经营活动产生	-	86,614,626.66	86,614,626.66

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）	116,508,664.78	13,786,127.14	130,294,791.92
其中：1.基金申购款	276,135,738.10	41,492,682.89	317,628,420.99
2.基金赎回款	-159,627,073.32	-27,706,555.75	-187,333,629.07
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）	229,060,955.69	104,240,821.43	333,301,777.12
项目	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019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）	200,026,278.57	-12,959,834.38	187,066,444.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,912,713.36	33,912,713.36
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）	-87,473,987.66	-5,940,278.82	-93,414,266.48
其中：1.基金申购款	99,304,008.46	5,066,322.31	104,370,330.77
2.基金赎回款	-186,777,996.12	-11,006,601.13	-197,784,597.25
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）	-	-11,172,532.53	-11,172,532.53
五、期末所有者权益（基金净值）	112,552,290.91	3,840,067.63	116,392,358.54

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：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 基金基本情况

华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]2883 号《关于准予华夏新锦升灵活配置混合型证券投资

基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2017 年 5 月 22 日至 2017 年 5 月 24 日共募集 200,003,883.99 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2017）验字第 60739337\_A22 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,028,329.22 份基金份额，其中认购资金利息折合 24,445.23 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会核准上市的股票）、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、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、期权等）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券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）。

#### 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颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、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》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂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中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 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，于交易日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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按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。当本基金依法有权抵销债权债务且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。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。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。对于已开放转换业务的基金，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。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内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；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为

投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率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。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴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；处置时其公允价值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按直线法近似计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

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 其他重要的会计政策和会计估计

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

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗

交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》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交易的固定收益品种，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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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《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[2015]125号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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《财政部、国家税务总局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《财政部、国家税务总局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) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 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。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，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。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 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。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	4,390,697.86	1,030,890.69
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	4,390,697.86	1,030,890.69

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		171,213,021.63	217,287,484.25	46,074,462.62
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	45,477,400.06	45,573,850.00	96,449.94
	银行间市场	68,233,437.09	67,534,700.00	-698,737.09
	合计	113,710,837.15	113,108,550.00	-602,287.15
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		284,923,858.78	330,396,034.25	45,472,175.47
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		60,711,758.76	62,276,096.36	1,564,337.60
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	54,119,503.63	54,523,238.33	403,734.70
	银行间市场	-	-	-
	合计	54,119,503.63	54,523,238.33	403,734.70
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		114,831,262.39	116,799,334.69	1,968,072.30

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	615.69	543.96
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	91.74	242.88
应收债券利息	1,845,751.95	786,879.15
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	21.78	16.39
合计	1,846,481.16	787,682.38

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	187,016.85	66,063.70
银行间市场应付交易费用	1,050.00	-
合计	188,066.85	66,063.70

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 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	170,000.00	170,000.00
合计	170,000.00	170,000.00

7.4.7.9 实收基金

华夏新锦升混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	112,552,290.91	112,552,290.91
本期申购	276,135,738.10	276,135,738.10
本期赎回（以“-”号填列）	-159,627,073.32	-159,627,073.32
本期末	229,060,955.69	229,060,955.69

华夏新锦升混合 C

无。

7.4.7.10 未分配利润

华夏新锦升混合 A

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	4,719,406.30	-879,338.67	3,840,067.63
本期利润	43,110,523.49	43,504,103.17	86,614,626.66
本期基金份额交易产生的变动数	9,695,277.64	4,090,849.50	13,786,127.14
其中：基金申购款	28,079,405.18	13,413,277.71	41,492,682.89
基金赎回款	-18,384,127.54	-9,322,428.21	-27,706,555.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,525,207.43	46,715,614.00	104,240,821.43

华夏新锦升混合 C

无。

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	61,805.33	35,199.66
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	8,845.24	16,206.96
其他	686.30	1,110.38
合计	71,336.87	52,517.00

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	238,498,882.00	157,366,043.96
减：卖出股票成本总额	198,486,055.87	150,307,499.01
买卖股票差价收入	40,012,826.13	7,058,544.95

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	164,403,510.59	277,826,124.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	162,058,670.28	271,594,221.10
减：应收利息总额	2,567,992.88	3,632,179.20
买卖债券差价收入	-223,152.57	2,599,724.11

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,331,233.09	1,337,426.66
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	2,331,233.09	1,337,426.66

## 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	43,504,103.17	22,497,682.93
——股票投资	44,510,125.02	21,874,615.38
——债券投资	-1,006,021.85	623,067.55
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	43,504,103.17	22,497,682.93

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	443,836.90	105,804.82
其他	70.76	-
合计	443,907.66	105,804.82

## 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	764,279.90	405,358.47
银行间市场交易费用	2,242.50	1,837.50
交易基金产生的费用	-	-

其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	766,522.40	407,195.97

## 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	15,199.45	10,163.74
银行间账户维护费	36,360.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	222,759.45	217,363.74

## 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，本基金无资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东

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

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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

中信证券	260,693,689.55	49.28%	97,148,059.61	40.28%
------	----------------	--------	---------------	--------

## 7.4.10.1.2 权证交易

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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
中信证券	36,582,619.53	18.45%	167,195,981.90	41.91%

## 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	283,900,000.00	42.08%	1,168,041,000.00	68.27%

## 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 2020年1月1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
中信证券	190,646.16	45.54%	130,887.00	69.99%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
中信证券	90,397.89	46.19%	279.54	0.42%

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、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,439,531.84	703,761.24
其中：支付销售机构的客户维护费	92,531.49	-

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	239,922.01	117,293.51

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	4,390,697.86	61,805.33	1,030,890.69	35,199.66

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	688057	金达莱	新股发行	10,051	259,717.84
中信证券	688289	圣湘生物	新股发行	3,232	163,151.36
中信证券	688221	前沿生物	新股发行	6,697	137,288.50
中信证券	300896	爱美客	新股发行	1,040	123,000.80
中信证券	688578	艾力斯	新股发行	5,181	117,764.13
中信证券	688617	惠泰医疗	新股发行	1,405	104,616.30
中信证券	688559	海目星	新股发行	5,924	86,253.44
中信证券	300898	熊猫乳品	新股发行	4,953	53,393.34
中信证券	605136	丽人丽妆	新股发行	867	10,603.41
中信证券	003013	地铁设计	新股发行	724	9,723.32
中信证券	605099	共创草坪	新股发行	624	9,634.56
中信证券	003018	金富科技	新股发行	1,027	9,171.11
中信证券	605179	一鸣食品	新股发行	939	8,648.19
中信证券	003015	日久光电	新股发行	1,128	7,410.96
中信证券	605299	舒华体育	新股发行	738	5,365.26
中信证券	003006	百亚股份	新股发行	804	5,314.44
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2020 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
601995	中金公司	2020-10-22	2021-05-06	新发流通受限	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-
688339	亿华通	2020-07-31	2021-02-10	新发流通受限	76.65	257.95	2,098	160,811.70	541,179.10	-
688055	龙腾光电	2020-08-10	2021-02-18	新发流通受限	1.22	8.04	45,228	55,178.16	363,633.12	-
688788	科思科技	2020-10-13	2021-04-22	新发流通受限	106.04	109.59	1,814	192,356.56	198,796.26	-
688286	敏芯股份	2020-07-31	2021-02-10	新发流通受限	62.67	117.33	1,681	105,348.27	197,231.73	-

				限							
688313	仕佳光子	2020-08-04	2021-02-18	新发流通受限	10.82	22.92	7,151	77,373.82	163,900.92	-	
300903	科翔股份	2020-10-29	2021-05-06	新发流通受限	13.06	30.47	4,775	62,361.50	145,494.25	-	
300901	中胤时尚	2020-10-19	2021-04-29	新发流通受限	8.96	15.00	9,611	86,114.56	144,165.00	-	
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	新发流通受限	25.70	88.29	1,575	40,477.50	139,056.75	-	
688589	力合微	2020-07-15	2021-01-22	新发流通受限	17.91	35.33	3,562	63,795.42	125,845.46	-	
688550	瑞联新材	2020-08-24	2021-03-02	新发流通受限	113.72	84.08	1,321	150,224.12	111,069.68	-	
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新发流通受限	74.46	74.46	1,405	104,616.30	104,616.30	-	
688330	宏力	2020-09-28	2021-04-15	新发	88.23	75.87	1,291	113,904.93	97,948.17	-	

	达			流 通 受 限						
300869	康泰医学	2020-08-12	2021-02-24	新发 流 通 受 限	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	新发 流 通 受 限	118.27	603.36	104	12,300.08	62,749.44	-
688215	瑞晟智能	2020-08-20	2021-03-01	新发 流 通 受 限	34.73	46.12	1,229	42,683.17	56,681.48	-
300867	圣元环保	2020-08-12	2021-03-03	新发 流 通 受 限	19.34	31.97	1,146	22,163.64	36,637.62	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新发 流 通 受 限	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300870	欧陆通	2020-08-13	2021-02-24	新发 流 通 受 限	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新发 流 通 受	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-

				限						
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	新发流通受限	24.60	61.51	403	9,913.80	24,788.53	-
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	新发流通受限	43.76	51.10	394	17,241.44	20,133.40	-
300910	瑞丰新材	2020-11-20	2021-05-27	新发流通受限	30.26	47.87	415	12,557.90	19,866.05	-
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	新发流通受限	30.72	41.32	427	13,117.44	17,643.64	-
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	新发流通受限	138.02	126.67	133	18,356.66	16,847.11	-
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	新发流通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-24	新发流通受限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300887	谱尼	2020-09-09	2021-03-16	新发	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-

	测试			流 通 受 限						
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	新发 流 通 受 限	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	新发 流 通 受 限	27.97	30.12	470	13,145.90	14,156.40	-
300902	国安达	2020-10-22	2021-04-29	新发 流 通 受 限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300925	法本信息	2020-12-21	2021-06-30	新发 流 通 受 限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	新发 流 通 受 限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	新发 流 通 受 限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300907	康平科技	2020-11-11	2021-05-18	新发 流 通 受	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-

				限						
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	新发流通受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	新发流通受限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300911	亿田智能	2020-11-24	2021-06-03	新发流通受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	新发流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300918	南山智尚	2020-12-15	2021-06-22	新发流通受限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	新发流通受限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	新发流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300917	特发	2020-12-14	2021-06-21	新发	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-

	服务			流通受限						
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新发流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新发流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	新发流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新发流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新发流通受限	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新发流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。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》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。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。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《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》的有关规定。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③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。

④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。

⑤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。

⑥以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎

回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，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 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	4,390,697.86	-	-	4,390,697.86
结算备付金	185,408.11	-	-	185,408.11
结算保证金	43,885.88	-	-	43,885.88
债券投资	63,561,050.00	49,547,500.00	-	113,108,550.00
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	1,030,890.69	-	-	1,030,890.69
结算备付金	490,542.10	-	-	490,542.10

结算保证金	33,119.53	-	-	33,119.53
债券投资	15,742,179.53	36,027,343.60	2,753,715.20	54,523,238.33
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	3,000,000.00	-	-	3,000,000.00

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	利率下降 25 个基点	250,172.88	320,143.55
	利率上升 25 个基点	-249,180.55	-315,406.19

#### 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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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	217,287,484.25	65.19	62,276,096.36	53.51
交易性金融资产—债券投资	-	-	15,382,707.33	13.22
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
合计	217,287,484.25	65.19	77,658,803.69	66.72

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	-5%	-10,359,586.06	-2,636,395.30
	+5%	10,359,586.06	2,636,395.30

#### 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) 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

##### (2) 各层次金融工具公允价值

截至 2020 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 212,725,681.38 元，第二层次的余额为 117,670,352.87 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2019 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 70,110,218.65 元，第二层次的余额为 46,689,116.04 元，第三层次的余额为 0 元。）

##### (3) 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

##### (4) 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## §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	217,287,484.25	64.50
	其中：股票	217,287,484.25	64.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	113,108,550.00	33.58
	其中：债券	113,108,550.00	33.58
	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	4,576,105.97	1.36
8	其他各项资产	1,890,367.04	0.56
9	合计	336,862,507.26	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	101,091,016.92	30.33
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	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	11,487,543.64	3.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,944,083.59	1.18
J	金融业	66,465,562.21	19.94
K	房地产业	6,977,335.14	2.09
L	租赁和商务服务业	3,163,440.00	0.95

M	科学研究和技术服务业	10,937,414.20	3.28
N	水利、环境和公共设施管理业	51,718.72	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,246,700.00	0.67
R	文化、体育和娱乐业	10,906,347.11	3.27
S	综合	-	-
	合计	217,287,484.25	65.19

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	297,500	25,876,550.00	7.76
2	600036	招商银行	492,500	21,645,375.00	6.49
3	000001	平安银行	800,000	15,472,000.00	4.64
4	600519	贵州茅台	6,300	12,587,400.00	3.78
5	002352	顺丰控股	130,000	11,469,900.00	3.44
6	300413	芒果超媒	150,200	10,889,500.00	3.27
7	603259	药明康德	80,000	10,777,600.00	3.23
8	000858	五粮液	33,600	9,806,160.00	2.94
9	000651	格力电器	134,600	8,337,124.00	2.50
10	600276	恒瑞医药	69,680	7,766,532.80	2.33
11	000333	美的集团	75,200	7,402,688.00	2.22
12	300824	北鼎股份	261,600	7,306,488.00	2.19
13	000002	万科A	242,800	6,968,360.00	2.09
14	300888	稳健医疗	34,809	5,778,294.00	1.73
15	600031	三一重工	144,900	5,068,602.00	1.52
16	688050	爱博医疗	28,345	4,903,118.10	1.47
17	002304	洋河股份	20,000	4,719,800.00	1.42
18	002475	立讯精密	83,580	4,690,509.60	1.41
19	300750	宁德时代	11,900	4,178,209.00	1.25
20	603444	吉比特	8,507	3,623,982.00	1.09
21	688363	华熙生物	24,744	3,623,263.92	1.09
22	601888	中国中免	11,200	3,163,440.00	0.95
23	002271	东方雨虹	80,000	3,104,000.00	0.93
24	300782	卓胜微	5,100	2,909,754.00	0.87
25	300015	爱尔眼科	30,000	2,246,700.00	0.67
26	603288	海天味业	10,000	2,005,400.00	0.60
27	601166	兴业银行	84,200	1,757,254.00	0.53
28	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.51
29	002415	海康威视	33,000	1,600,830.00	0.48
30	000100	TCL 科技	221,800	1,570,344.00	0.47

31	688063	派能科技	2,448	633,101.76	0.19
32	688339	亿华通	2,098	541,179.10	0.16
33	688055	龙腾光电	45,228	363,633.12	0.11
34	688686	奥普特	1,515	328,452.00	0.10
35	688788	科思科技	1,814	198,796.26	0.06
36	688286	敏芯股份	1,681	197,231.73	0.06
37	688313	仕佳光子	7,151	163,900.92	0.05
38	300925	法本信息	3,528	162,719.99	0.05
39	300903	科翔股份	4,775	145,494.25	0.04
40	300901	中胤时尚	9,611	144,165.00	0.04
41	300999	金龙鱼	1,575	139,056.75	0.04
42	688589	力合微	3,562	125,845.46	0.04
43	688550	瑞联新材	1,321	111,069.68	0.03
44	688617	惠泰医疗	1,405	104,616.30	0.03
45	688330	宏力达	1,291	97,948.17	0.03
46	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.03
47	300896	爱美客	104	62,749.44	0.02
48	688618	三旺通信	1,117	59,938.22	0.02
49	688215	瑞晟智能	1,229	56,681.48	0.02
50	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
51	300867	圣元环保	1,146	36,637.62	0.01
52	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.01
53	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
54	300919	中伟股份	403	24,788.53	0.01
55	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
56	300861	美畅股份	394	20,133.40	0.01
57	300910	瑞丰新材	415	19,866.05	0.01
58	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
59	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
60	300873	海晨股份	427	17,643.64	0.01
61	605186	健麾信息	626	17,609.38	0.01
62	300860	锋尚文化	133	16,847.11	0.01
63	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
64	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
65	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
66	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
67	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
68	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.00
69	300889	爱克股份	470	14,156.40	0.00
70	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
71	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
72	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
73	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
74	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00

75	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
76	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
77	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
78	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
79	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
80	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
81	300922	C 天秦	287	9,063.46	0.00
82	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
83	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
84	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
85	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
86	003031	中瓷电子	387	5,909.49	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	601318	中国平安	21,065,645.00	18.10
2	603259	药明康德	17,697,025.40	15.20
3	600036	招商银行	16,943,933.61	14.56
4	002352	顺丰控股	13,022,462.41	11.19
5	300413	芒果超媒	12,713,691.00	10.92
6	000001	平安银行	11,480,155.00	9.86
7	600519	贵州茅台	9,755,462.42	8.38
8	300059	东方财富	9,332,057.60	8.02
9	603444	吉比特	8,949,452.08	7.69
10	688363	华熙生物	8,463,649.80	7.27
11	601688	华泰证券	8,210,719.00	7.05
12	300824	北鼎股份	8,139,082.09	6.99
13	000651	格力电器	7,917,750.02	6.80
14	600276	恒瑞医药	6,945,617.80	5.97
15	002271	东方雨虹	6,833,897.00	5.87
16	000002	万科 A	6,496,412.00	5.58
17	688050	爱博医疗	6,163,176.28	5.30
18	000858	五粮液	5,990,863.90	5.15
19	601166	兴业银行	5,270,000.00	4.53
20	000786	北新建材	4,997,453.00	4.29
21	300888	稳健医疗	4,662,458.85	4.01
22	300142	沃森生物	4,520,595.06	3.88
23	000333	美的集团	4,497,777.00	3.86
24	002475	立讯精密	4,335,653.50	3.73
25	601211	国泰君安	3,996,777.50	3.43

26	600196	复星医药	3,965,818.00	3.41
27	002304	洋河股份	3,482,347.00	2.99
28	300010	豆神教育	3,000,779.00	2.58
29	600031	三一重工	2,998,637.00	2.58
30	300326	凯利泰	2,998,034.00	2.58
31	002311	海大集团	2,996,782.00	2.57
32	300122	智飞生物	2,996,450.00	2.57
33	002049	紫光国微	2,994,229.00	2.57
34	300529	健帆生物	2,993,629.00	2.57
35	300782	卓胜微	2,953,410.00	2.54
36	601933	永辉超市	2,666,016.00	2.29
37	601696	中银证券	2,639,024.81	2.27
38	300383	光环新网	2,627,554.00	2.26
39	300440	运达科技	2,627,088.00	2.26
40	601398	工商银行	2,587,500.00	2.22
41	601888	中国中免	2,473,515.00	2.13
42	603456	九洲药业	2,433,299.00	2.09
43	300999	金龙鱼	2,399,063.90	2.06

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	300059	东方财富	12,698,901.32	10.91
2	603259	药明康德	10,635,706.00	9.14
3	002352	顺丰控股	10,022,825.56	8.61
4	688363	华熙生物	9,441,621.58	8.11
5	601166	兴业银行	7,866,018.00	6.76
6	603444	吉比特	7,313,750.44	6.28
7	000786	北新建材	7,144,066.72	6.14
8	601688	华泰证券	7,107,665.00	6.11
9	603096	新经典	6,576,004.00	5.65
10	300413	芒果超媒	5,696,034.00	4.89
11	601398	工商银行	5,334,000.00	4.58
12	002271	东方雨虹	4,715,026.00	4.05
13	600196	复星医药	4,693,107.00	4.03
14	002311	海大集团	4,547,297.00	3.91
15	601933	永辉超市	4,444,973.80	3.82
16	300142	沃森生物	4,115,255.72	3.54
17	300122	智飞生物	3,940,152.00	3.39
18	689009	九号公司	3,886,996.26	3.34
19	600104	上汽集团	3,816,120.00	3.28

20	300896	爱美客	3,753,506.90	3.22
21	601211	国泰君安	3,663,227.00	3.15
22	601607	上海医药	3,392,313.00	2.91
23	601601	中国太保	3,387,601.00	2.91
24	300999	金龙鱼	3,376,961.60	2.90
25	300326	凯利泰	3,261,903.16	2.80
26	603456	九洲药业	3,199,548.00	2.75
27	601186	中国铁建	3,196,367.00	2.75
28	300529	健帆生物	3,150,582.20	2.71
29	600383	金地集团	3,149,505.00	2.71
30	601818	光大银行	3,082,824.00	2.65
31	600519	贵州茅台	2,991,983.00	2.57
32	600377	宁沪高速	2,980,539.36	2.56
33	601098	中南传媒	2,908,079.00	2.50
34	601328	交通银行	2,766,933.00	2.38
35	601696	中银证券	2,708,085.35	2.33
36	600000	浦发银行	2,616,609.56	2.25
37	300383	光环新网	2,578,012.56	2.21
38	300440	运达科技	2,532,818.00	2.18
39	002049	紫光国微	2,457,467.00	2.11
40	601021	春秋航空	2,333,383.00	2.00

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	308,987,318.74
卖出股票收入（成交）总额	238,498,882.00

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	14,980,500.00	4.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,024,000.00	3.01
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	20,569,350.00	6.17
5	企业短期融资券	19,910,000.00	5.97
6	中期票据	47,624,700.00	14.29

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	113,108,550.00	33.94

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	019640	20 国债 10	150,000	14,980,500.00	4.49
2	101764030	17 济西城投 MTN001	100,000	10,295,000.00	3.09
3	101800996	18 苏工业园 MTN001	100,000	10,100,000.00	3.03
4	155352	19 华电 01	100,000	10,086,000.00	3.03
5	101900193	19 河钢集 MTN002A	100,000	10,081,000.00	3.02

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，平安银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.12.3 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	43,885.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,846,481.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,890,367.04

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏新锦升混合 A	207	1,106,574.67	228,653,474.45	99.82%	407,481.24	0.18%
华夏新锦	-	-	-	-	-	-

升混合 C						
合计	207	1,106,574.67	228,653,474.45	99.82%	407,481.24	0.18%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏新锦升混合 A	103,272.18	0.05%
	华夏新锦升混合 C	-	-
	合计	103,272.18	0.05%

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏新锦升混合 A	0~10
	华夏新锦升混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏新锦升混合 A	0
	华夏新锦升混合 C	0
	合计	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏新锦升混合 A	华夏新锦升混合 C
基金合同生效日（2017 年 5 月 31 日）基金份额总额	200,028,329.22	-
本报告期期初基金份额总额	112,552,290.91	-
本报告期基金总申购份额	276,135,738.10	-
减：本报告期基金总赎回份额	159,627,073.32	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	229,060,955.69	-

## §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，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2020 年 4 月 1 日发布公告，张德根先生担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本基金管理人于 2020 年 9 月 18 日发布公告，张霄岭先生不再担任华夏基金管理有限公司副总

经理。

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

本报告期内，根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等相关法律法规的规定，本基金修订基金合同等法律文件，投资范围增加存托凭证，并据此增加存托凭证的投资策略。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 4 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关责令改正的行政监管措施，公司已按要求改正并报告。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	3	260,693,689.55	49.28%	190,646.16	45.54%	-
东莞证券	1	88,281,449.58	16.69%	82,293.31	19.66%	-
光大证券	1	49,598,385.77	9.38%	36,271.57	8.66%	-
东方证券	2	35,085,282.78	6.63%	25,657.62	6.13%	-
海通证券	1	31,877,908.12	6.03%	29,687.62	7.09%	-
信达证券	1	23,280,357.39	4.40%	21,681.03	5.18%	-
长江证券	1	15,081,842.57	2.85%	11,029.39	2.63%	-
万联证券	1	11,765,281.01	2.22%	10,956.93	2.62%	-
中信建投证券	1	9,298,771.49	1.76%	8,660.18	2.07%	-
华创证券	1	3,996,777.50	0.76%	1,724.06	0.41%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

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。

③ 除本表列示外，本基金还选择了安信证券、财通证券、长城证券、川财证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、高华证券、国海证券、国盛证券、国信证券、华西证券、汇丰前海、开源证券、民生证券、申万宏源、天风证券、万和证券、西部证券、银河证券、招商证券、中航证券、中金公司、中泰证券、中信证券华南的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④ 本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

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		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
中信证券	36,582,619.53	18.45%	283,900,000.00	42.08%
东莞证券	15,425,600.20	7.78%	52,200,000.00	7.74%
光大证券	26,827,444.20	13.53%	172,500,000.00	25.57%
东方证券	4,507,229.40	2.27%	75,700,000.00	11.22%
海通证券	11,830,026.60	5.97%	15,500,000.00	2.30%
信达证券	3,906,282.23	1.97%	35,000.00	0.01%
长江证券	1,128,817.70	0.57%	-	-
万联证券	-	-	-	-
中信建投证券	3,304,588.00	1.67%	4,000,000.00	0.59%
华创证券	6,787,782.30	3.42%	67,000,000.00	9.93%
华泰证券	78,280,340.00	39.48%	-	-
国泰君安证券	9,686,300.00	4.89%	-	-

平安证券	-	-	3,844,000.00	0.57%
------	---	---	--------------	-------

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于根据国家延长春节假期通知及交易所休市安排等调整旗下基金春节后业务办理日期的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-30
2	华夏基金管理有限公司关于旗下公募基金2019年年报延缓审计与披露的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-26
3	华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金在直销机构开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-27
4	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-01
5	华夏基金管理有限公司关于增聘华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-09
6	华夏基金管理有限公司关于调整华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-24
7	华夏基金管理有限公司住所变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-02
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-22
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-29
10	华夏基金管理有限公司关于上海分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-12
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-23
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-24
13	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-12
14	华夏基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-13
15	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-15
16	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-21
17	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-22
18	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-24
19	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-02
20	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会指定报刊及	2020-11-04

	关联方承销证券的公告	网站	
21	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-06
22	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-25
23	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-07
24	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-11
25	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-14
26	华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-19
27	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-21

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020-01-01 至 2020-02-03	38,314,089.92	-	38,314,089.92	-	-
	2	2020-01-01 至 2020-03-12	32,940,000.00	-	-	32,940,000.00	14.38%
	3	2020-01-17 至 2020-04-22	-	47,905,528.41	47,905,528.41	-	-
	4	2020-05-14 至 2020-09-06	-	46,871,799.83	46,871,799.83	-	-
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏新锦升灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二一年三月三十日