

贝莱德中国新视野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：贝莱德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2022 年 3 月 30 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。

本报告期自 2021 年 09 月 07 日（基金合同生效日）起至 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.....	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	14
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.....	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§ 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.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	51

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	51
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	51
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
8.12 投资组合报告附注	52
§ 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	54
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的情况	55
§ 10 开放式基金份额变动	55
§ 11 重大事件揭示	56
11.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
11.4 基金投资策略的改变	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8 其他重大事件	57
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 13 备查文件目录	60
13.1 备查文件目录	60
13.2 存放地点	60
13.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金	
基金简称	贝莱德中国新视野混合	
基金主代码	013426	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 7 日	
基金管理人	贝莱德基金管理有限公司	
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	6,333,774,928.89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	贝莱德中国新视野混合 A	贝莱德中国新视野混合 C
下属分级基金的交易代码	013426	013427
报告期末下属分级基金的份额总额	5,430,613,803.20 份	903,161,125.69 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格风险控制的基础上，通过使用偏向长期投资的总收益策略，从深入的个股研究出发，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>在股票投资层面，本基金采用主动投资管理策略，精选具有核心竞争优势和长期持续稳定增长模式的上市公司。</p> <p>（1）定性分析，主要考虑以下四个方面因素：1）市场容量；2）行业周期；3）公司；4）人员。</p> <p>（2）定量分析，通过量化指标，考察个股的估值水平、上市公司成长性和盈利水平。</p> <p>（3）港股通标的股票投资策略。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。</p> <p>3、资产支持证券投资策略；</p> <p>4、金融衍生品投资策略；</p> <p>5、存托凭证投资策略；</p> <p>6、融资投资策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+一年期定期存款利率（税后）×25%+经人民币汇率调整的恒生指数收益率×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金或投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		贝莱德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈剑	李申
	联系电话	021- 80225022	021-60637102
	电子邮箱	Compliance_FMC@blackrock.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-002-6655	021-60637111
传真		021 - 80225288	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		张弛	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.blackrock.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

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）	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国建设银行股份有限公司	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 9 月 7 日（基金合同生效日）- 2021 年 12 月 31 日	
	贝莱德中国新视野混合 A	贝莱德中国新视野混合 C
本期已实现收益	-18,453,383.65	-4,661,871.98
本期利润	-71,972,209.31	-13,031,555.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0129	-0.0128
本期加权平均净值利润率	-1.29%	-1.29%
本期基金份额净值增长率	-1.33%	-1.49%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	
期末可供分配利润	-72,417,590.55	-13,449,973.69
期末可供分配基金份额利润	-0.0133	-0.0149
期末基金资产净值	5,358,196,212.65	889,711,152.00
期末基金份额净值	0.9867	0.9851
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-1.33%	-1.49%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

4、表中的“期末”指报告期最后一日，即 12 月 31 日；“本期”指 2021 年 9 月 7 日（基金合同生效日）- 2021 年 12 月 31 日。

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

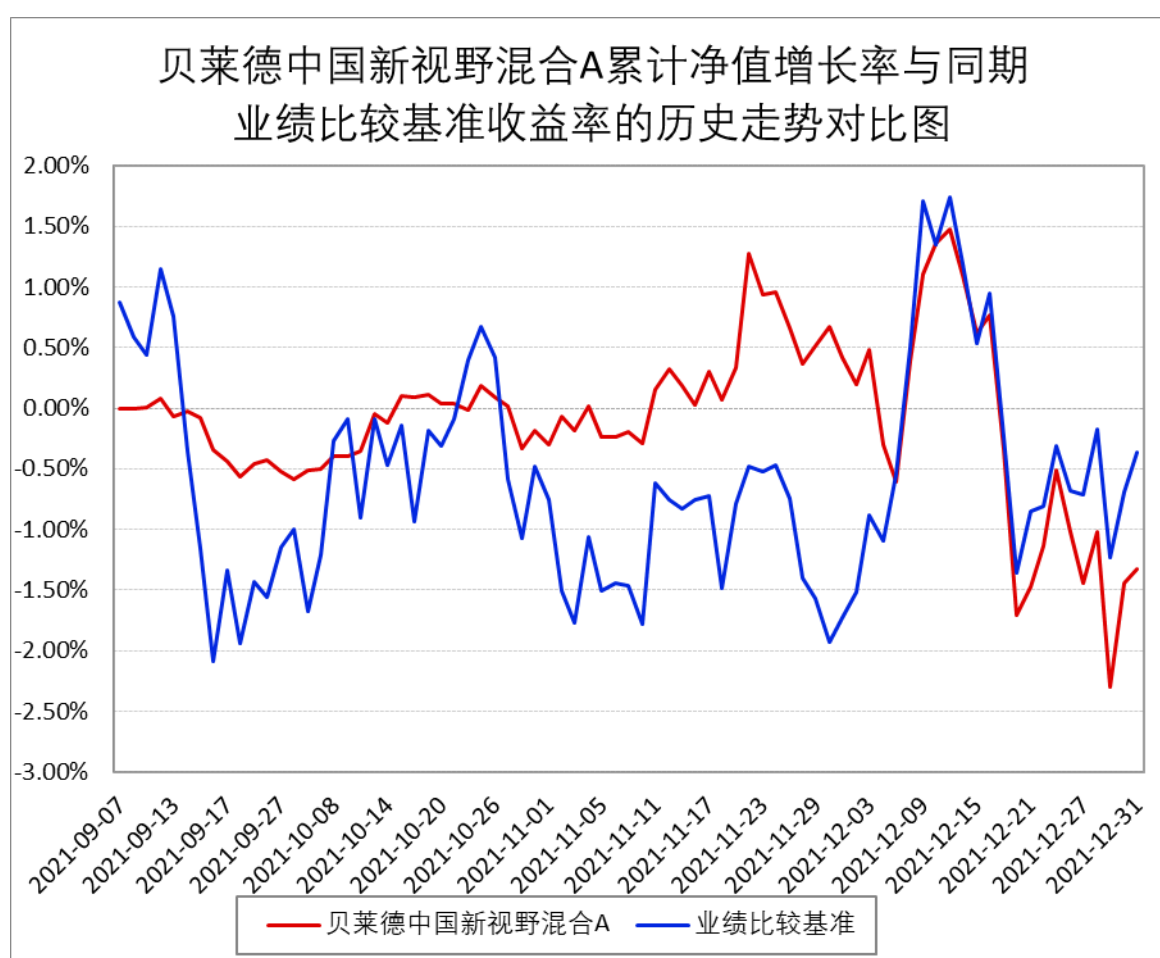
贝莱德中国新视野混合 A

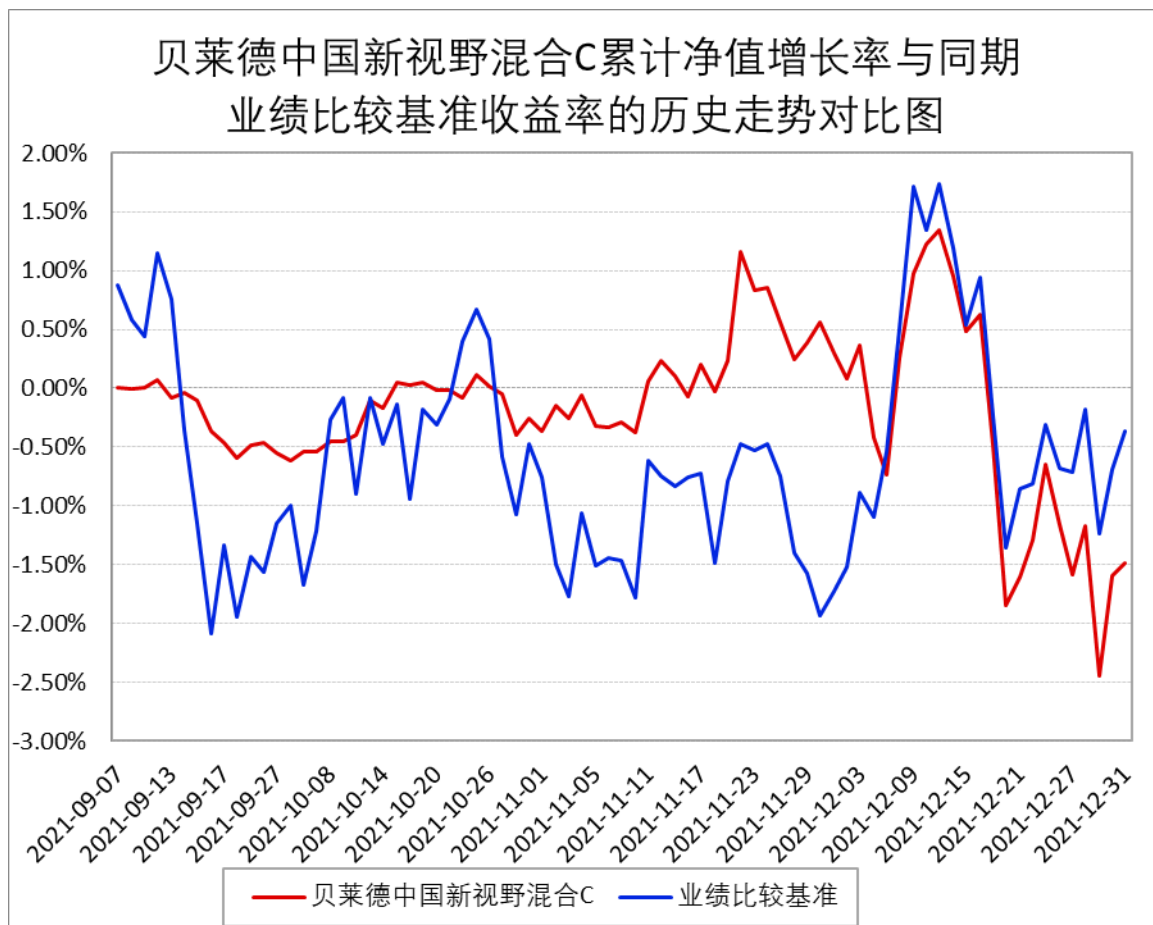
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.83%	0.44%	0.86%	0.58%	-1.69%	-0.14%
自基金合同生效起至今	-1.33%	0.40%	-0.36%	0.59%	-0.97%	-0.19%

贝莱德中国新视野混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.96%	0.44%	0.86%	0.58%	-1.82%	-0.14%
自基金合同生效起至今	-1.49%	0.40%	-0.36%	0.59%	-1.13%	-0.19%

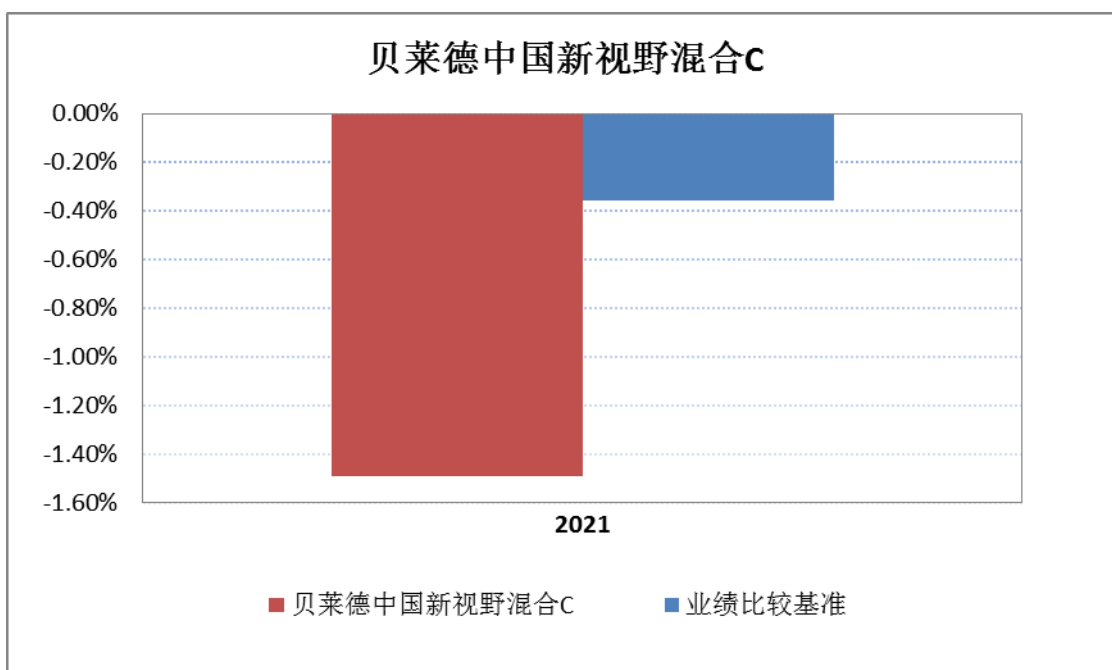
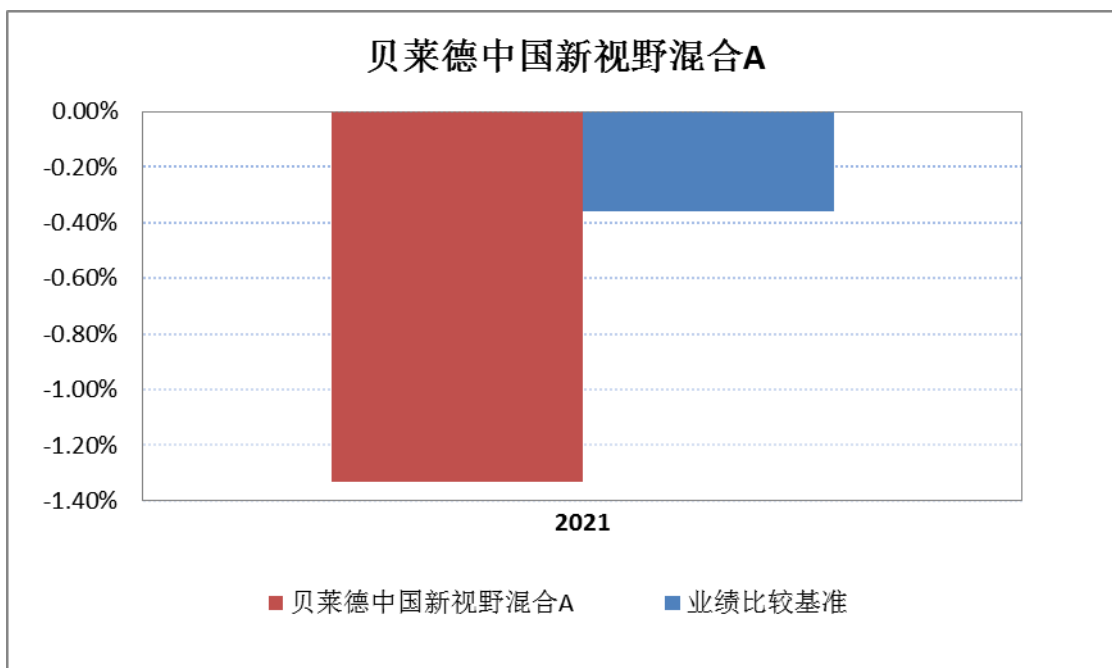
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注： 1、本基金的基金合同于 2021 年 9 月 7 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。
 2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金仍在建仓期。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1、本基金合同生效日期为 2021 年 9 月 7 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自 2021 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日未进行利润分配。

§ 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

贝莱德基金管理有限公司成立于 2020 年 9 月 10 日，是国内首家外资全资控股的公募基金管理人。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准设立贝莱德基金管理有限公司的批复》（证监许可[2020]1917 号）批准，由贝莱德金融管理公司（BlackRock Financial Management, Inc.）出资 3 亿元成立。截至报告期末，公司旗下发行并管理了 1 只公开募集证券投资基金：贝莱德中国新视野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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
唐华	基金经理	2021 年 9 月 7 日	-	16	新加坡南洋理工大学工商管理硕士，特许金融分析师（CFA）。曾担任贝莱德投资管理（上海）有限公司投研董事、英国施罗德集团上海代表处首席代表、中原证券股份有限公司资产管理总部研究总监兼 A 股投资经理、香港鲍尔太平有限公司上海代表处资深研究员、东方证券股份有限公司策略研究员。
单秀丽	基金经理	2021 年 9 月 7 日	-	5	美国里海大学理学硕士学位，金融风险管理师（FRM）资格。曾担任贝莱德投资管理（上海）有限公司投资经理，贝莱德资本管理公司（威明顿，美国）量化风控/收益分析师。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，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

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《贝莱德基金管理有限公司公平交易管理流程》。公司通过严谨科学的投资决策体系、内控制度和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和内部审计等对公平交易过程和结果进行监督。

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投资组合，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，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部相关公平交易制度等规定。

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

截止到本报告期末，四季度 A 股市场大盘小幅上涨，上证指数上涨 2.01%，创业板上涨 2.4%，沪深 300 上涨 1.52%。

三季度表现较好的周期板块，随着疫情以及政策纠偏的强化，普涨行情进入尾声，煤炭、钢铁、石油石化行业出现较大幅度回调。新能源以及新能源车等高景气赛道在高位开启震荡走势。

此外，年底的中央经济工作会议释放明确的稳增长信号，市场对货币政策边际放松以及对地产阶段性松绑的预期，使得房地产产业链个股与大金融板块出现修复性反弹。另外，因部分消费产品的提价，市场风格重新回归较为均衡的阶段。消费电子板块经过较长时间的调整，出现了一些情绪修复的迹象，板块呈上行趋势。

本基金于三季度完成发行，四季度处于建仓期。自成立以来，A股市场处于风格切换频繁、震荡博弈行情。针对这种市场状况，本基金采取了比较稳健的建仓策略，整体行业配置较为均衡。我们恪守本基金的“长期可持续成长股”投资理念，关注各行业板块中盈利增速较高的公司，主要布局于食品饮料、消费电子、受益于国产替代的半导体、医疗服务等，同时也适当布局了我们认为被低估的部分成长类银行股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，A类基金份额净值 0.9867 元，净值增长率-1.33%，业绩比较基准收益率-0.36%；C类基金份额净值 0.9851 元，净值增长率-1.49%，业绩比较基准收益率-0.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面，2021 年末的中央经济工作会议确认了经济下行的压力加大，并明确提出了稳增长的方向。中央经济工作会议后，社融如期回升、财政节奏前移、针对地产的紧缩政策边际放松，此前一些掣肘经济增长的部分政策有所修复。然而国内反复点发的疫情对经济全面复苏仍然是一个重要的制约因素。海外宏观方面，美国通胀已可以用“广泛性”（broad）来表述，有工作愿望的劳动人口已实现充分就业，因此美联储进入加息窗口。目前市场普遍预期美联储全年加息七次左右，但美国收益率曲线的扁平化也隐含市场对明年美国经济增长放缓的预期，因此今年下半年需要继续紧密关注美联储加息意愿的变化。

市场层面，我们看到了机构为来年做资产再配置，国内政策稳增长预期强烈，加上美股由于加息预期导致风格偏向价值，投资者对年末风格切换的预期致使 A 股市场风格发生剧烈变化，进而扰动了资金面并导致市场的震荡。基建和地产链领跑市场，而估值较高的新能源板块出现了调整。展望 2022 年，全 A 非金融利润增速大概率比去年回落，而高品质的成长股则会凸显其稀缺性。

短期来说，我们需要关注（1）稳增长过程中受益于系统性风险被消除的行业和公司；（2）国外疫情常态化后，海运价格和原材料成本正常化后，中下游行业的盈利情况；（3）上游瓶颈行业的扩产情况，以及对新能源行业增长的压制何时结束。中长期看，我们持续关注（1）数字化经济逐渐渗透到传统经济的各个领域带来的投资机会；（2）全球碳中和政策背景下，新能源及其应用带来的投资机会；（3）人口老龄化过程中脱颖而出的新模式和新需求；（4）中国多层次消费市场

结构将在疫情后展现出来的消费潜力；（5）中国产业升级过程中的技术进步、产品附加值增加过程中带来的投资机会。

本基金将结合 2021 年年报和 2022 年一季报预披露的公司财务和经营数据，动态调整组合，择机增加之前跌幅比较大、而增长确定性较高的板块和公司的配置。本基金将继续秉持“投资优质可持续成长股”的投资理念，从下而上，精选个股，以行业和中长期基本面为锚，动态优化组合，利用贝莱德风险管理的优势，综合采纳可选择的投资工具来降低组合波动，控制好风险，以期为投资者创造长期合理的回报。

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，本基金管理人有效落实合规管理、风险防控及监察稽核工作。合规管理方面，公司制定了一系列合规管理制度，建立健全合规管理机制，并对投资交易等重点领域强化合规风险防控。公司建立了投资监督机制，对基金投资交易过程中的合规风险进行把控。公司积极开展合规培训，强化员工合规意识，培育合规文化，促进廉洁从业。公司严格落实信息披露要求，按期完成信息披露工作。风险防控方面，公司秉承风险管理为核心的管理理念，搭建了内部风险管理系统并持续完善，对投资、流动性、信用、集中度、赎回和可持续性等相关风险进行度量，保障基金承担的风险审慎、适当。同时，动态监测并与基金经理密切沟通基金风险水平，力争确保投资组合预期与业绩的一致性。监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及合规检查，对发现的问题积极完善，为公司业务合规运作和稳健经营保驾护航。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将持续加强监察稽核管理，坚持基金份额持有人利益优先，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

本报告期内，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，委托基金服务机构对基金所持有的投资品种进行估值，本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。基金管理人及委托的基金服务机构严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，基金份额净值经基金托管人复核无误后由基金管理人对外披露。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金基金合同的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金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，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 27375 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	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了贝莱德中国新视野混合型证券投资基金(以下简称“贝莱德中国新视野混合基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间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。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>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,公允反映了贝莱德中国新视野混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于贝莱德中国新视野混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	贝莱德中国新视野混合基金的基金管理人贝莱德基金管理有限公司(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

	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估贝莱德中国新视野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贝莱德中国新视野混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督贝莱德中国新视野混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对贝莱德中国新视野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贝莱德中国新视野混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>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。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 周祎
会计师事务所的地址	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 30 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：贝莱德中国新视野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
资产：		
银行存款	7.4.7.1	190,739,953.71
结算备付金		513,250,905.06
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	4,002,309,919.32
其中：股票投资		3,968,225,919.32
基金投资		-
债券投资		34,084,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,561,815,618.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	-716,481.49
应收股利		-
应收申购款		350,441.73
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		6,267,750,356.33
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		9,610,528.32
应付管理人报酬		8,202,930.96
应付托管费		1,367,155.16
应付销售服务费		398,840.57
应付交易费用	7.4.7.7	6,075.00
应交税费		137,517.48

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	119,944.19
负债合计		19,842,991.68
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	6,333,774,928.89
未分配利润	7.4.7.10	-85,867,564.24
所有者权益合计		6,247,907,364.65
负债和所有者权益总计		6,267,750,356.33

注：1、本基金基金合同于 2021 年 9 月 7 日生效，无上年度末数据。

2、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 6,333,774,928.89 份，其中 A 类基金份额净值 0.9867 元，基金份额 5,430,613,803.20 份；C 类基金份额净值 0.9851 元，基金份额 903,161,125.69 份。

7.2 利润表

会计主体：贝莱德中国新视野混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		-39,760,796.68
1.利息收入		26,772,107.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,787,244.23
债券利息收入		7,243,702.54
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		17,741,160.23
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,395,122.13
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-4,020,809.13
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,755,068.80
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	380,755.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-61,888,508.85

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	750,727.30
减：二、费用		45,242,967.80
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	31,246,947.80
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,207,824.61
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,601,204.11
4. 交易费用	7.4.7.18	6,939,850.74
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		63,868.17
7. 其他费用	7.4.7.19	183,272.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-85,003,764.48
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-85,003,764.48

注：本基金基金合同于 2021 年 9 月 7 日生效，无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：贝莱德中国新视野混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,681,345,901.11	-	6,681,345,901.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-85,003,764.48	-85,003,764.48
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）	-347,570,972.22	-863,799.76	-348,434,771.98
其中：1. 基金申购款	74,098,802.04	69,242.61	74,168,044.65
2. 基金赎回款	-421,669,774.26	-933,042.37	-422,602,816.63
四、本期向基金份额持有	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	6,333,774,928.89	-85,867,564.24	6,247,907,364.65

注：本基金基金合同于 2021 年 9 月 7 日生效，无上年度可比期间数据。

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：

_____ 张弛	_____ 张鹏军	_____ 罗元
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

贝莱德中国新视野混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]第 2646 号《关于准予贝莱德中国新视野混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由贝莱德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德中国新视野混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 6,680,197,191.98 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0853 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《贝莱德中国新视野混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 9 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,681,345,901.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,148,709.13 份基金份额。本基金的基金管理人为贝莱德基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《贝莱德中国新视野混合型证券投资基金基金合同》和《贝莱德中国新视野混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德中国新视野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（包括创业板及其他中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、债券（国债、政府债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、国债期货、股指期货、股票期权、存托凭证、信用衍生品、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具，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）。本基金可根据法律法规和基金合同的约定，参与融资融券业务中的融资业务。本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中，港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的 20%，投资于中国新视野主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。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： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 70\% + \text{一年期定期存款利率（税后）} \times 25\% + \text{经人民币汇率调整的恒生指数收益率} \times 5\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人贝莱德基金管理有限公司于 2022 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《贝莱德中国新视野混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止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。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终

止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别内每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金分红形式与红利再投资形式分配，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的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。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末

可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和资产支持证券除外)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(可转换债券和资产支持证券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	190,739,953.71
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计:	190,739,953.71
-----	----------------

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	4,030,114,428.17	3,968,225,919.32	-61,888,508.85
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	34,084,000.00	34,084,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	34,084,000.00	34,084,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,064,198,428.17	4,002,309,919.32	-61,888,508.85

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,561,815,618.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,561,815,618.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日

应收活期存款利息	29,253.68
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	26,067.45
应收债券利息	747.05
应收买入返售证券利息	-772,549.67
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	-716,481.49

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	6,075.00
合计	6,075.00

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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	19,544.19
应付证券出借违约金	-
预提费用	100,400.00
合计	119,944.19

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

贝莱德中国新视野混合 A		
项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

基金合同生效日	5,635,009,473.43	5,635,009,473.43
本期申购	57,923,397.29	57,923,397.29
本期赎回（以“-”号填列）	-262,319,067.52	-262,319,067.52
本期末	5,430,613,803.20	5,430,613,803.20

金额单位：人民币元

贝莱德中国新视野混合 C		
项目	本期 2021 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,046,336,427.68	1,046,336,427.68
本期申购	16,175,404.75	16,175,404.75
本期赎回（以“-”号填列）	-159,350,706.74	-159,350,706.74
本期末	903,161,125.69	903,161,125.69

注：1、本基金自 2021 年 8 月 30 日至 2021 年 9 月 3 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 6,680,197,191.98 元。根据《贝莱德中国新视野混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 1,148,709.13 元在本基金成立后，折算为 1,148,709.13 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

贝莱德中国新视野混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-18,453,383.65	-53,518,825.66	-71,972,209.31
本期基金份额交易产生的变动数	159,771.60	-605,152.84	-445,381.24
其中：基金申购款	-36,874.37	108,418.41	71,544.04
基金赎回款	196,645.97	-713,571.25	-516,925.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,293,612.05	-54,123,978.50	-72,417,590.55

单位：人民币元

贝莱德中国新视野混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-4,661,871.98	-8,369,683.19	-13,031,555.17
本期基金份额交易	198,536.61	-616,955.13	-418,418.52

产生的变动数			
其中：基金申购款	-35,261.97	32,960.54	-2,301.43
基金赎回款	233,798.58	-649,915.67	-416,117.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,463,335.37	-8,986,638.32	-13,449,973.69

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年 12月31日
活期存款利息收入	486,931.04
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	1,300,313.19
其他	-
合计	1,787,244.23

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021 年12月31日
卖出股票成交总额	1,228,196,616.65
减：卖出股票成本总额	1,232,217,425.78
买卖股票差价收入	-4,020,809.13

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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9月7日（基金合同生效日）至 2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,057,651,608.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,980,065,118.00
减：应收利息总额	79,341,558.80
买卖债券差价收入	-1,755,068.80

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	380,755.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	380,755.80

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-61,888,508.85
——股票投资	-61,888,508.85
——债券投资	-
——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	-
合计	-61,888,508.85

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	750,727.30
其他	-
合计	750,727.30

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	6,933,775.74
银行间市场交易费用	6,075.00
合计	6,939,850.74

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	100,400.00
信息披露费	80,000.00
律师费	-
账户维护费	-
持有人大会费用	-
银行费用	2,472.37
开户费	400.00
合计	183,272.37

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
贝莱德基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
贝莱德金融管理公司	基金管理人的股东
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构、注册登记机构

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 本报告期的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	31,246,947.80
其中：支付销售机构的客户维护费	15,140,708.89

注：支付基金管理人贝莱德基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,207,824.61

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	贝莱德中国新视野混合 A	贝莱德中国新视野混合 C	合计
中国建设银行	-	322,558.43	322,558.43
合计	-	322,558.43	322,558.43

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50%的年费率计提，

逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	190,739,953.71	486,931.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300896	爱美	2021年	2022年	大宗交	589.73	509.68	61,800	36,445,314.00	31,498,224.00	

	客	10月13日	4月15日	易流通受限						
--	---	--------	-------	-------	--	--	--	--	--	--

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021年12月28日	2022年1月14日	新债未上市	100.00	100.00	340,840	34,084,000.00	34,084,000.00	

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《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》规范的非公开发行股份，所认购的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，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其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%。此外，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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于依法发行上市的股票、港股通标的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证

监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建立，建立了由董事会、公司管理层、风险管理部门和业务职能部门构成的四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会对风险管理的责任包括制定业务战略和风险管理目标、审阅重大事件和决策的风险评估等；管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，确保有效管理所有重大风险，下设风险管理委员会，根据董事会和管理层的授权开展风险管理工作；风险管理部门负责风险评估、报告、监控和管理，主要职责包括制定公司风险管理制度和程序、实施定量和定性的风险评估等；业务职能部门从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施。在业务操作层面，各部门积极配合风险管理部门完成运作风险管理，其他中后台部门包括但不限于财务、合规稽核和运营等部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种相关风险可能造成的影响。从定性分析的角度触发，判断风险的种类、风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度触发，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、模型和日常风险报告等，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的固定收益品种

占基金资产净值的比例为 0.55%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金

持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	190,739,953.71	-	-	-	190,739,953.71
结算备付金	513,250,905.06	-	-	-	513,250,905.06
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	34,084,000.00	3,968,225,919.32	4,002,309,919.32
买入返售金融资产	1,561,815,618.00	-	-	-	1,561,815,618.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-716,481.49	-716,481.49
应收申购款	-	-	-	350,441.73	350,441.73
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,265,806,476.77	-	34,084,000.00	3,967,859,879.56	6,267,750,356.33
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	9,610,528.32	9,610,528.32
应付管理人报酬	-	-	-	8,202,930.96	8,202,930.96
应付托管费	-	-	-	1,367,155.16	1,367,155.16
应付销售服务费	-	-	-	398,840.57	398,840.57
应交税费	-	-	-	137,517.48	137,517.48
应付交易费用	-	-	-	6,075.00	6,075.00
其他负债	-	-	-	119,944.19	119,944.19
负债总计	-	-	-	19,842,991.68	19,842,991.68
利率敏感度缺口	2,265,806,476.77	-	34,084,000.00	3,948,016,887.88	6,247,907,364.65

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.55%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在注重严格风险控制的基础上，动态调整资产配置，使风险和预期目标

相匹配，并选择符合基金合同约定范围内的投资品种进行投资。同时，本基金充分发挥基金管理人的研究优势，通过对经济发展、社会结构、宏观政策、产业政策和科学技术的跟踪研究，将定性分析和定量模型相结合，根据投资策略或市场环境的变化构建和管理投资组合，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资组合中股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中，港股通标的的股票最高投资比例不得超过股票资产的 20%，投资于中国新视野主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，以识别和测算本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	3,968,225,919.32	63.51
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	34,084,000.00	0.55
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	4,002,309,919.32	64.06

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 3,936,727,695.32 元，属于第二层次的余额为 34,084,000.00 元，属于第三层次的余额为 31,498,224.00 元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具 31,498,224.00 元。于 2021 年度，本基金购买第三层次金融工具 36,445,314.00 元，计入当期损益的利得或损失（公允价值变动损益等项目）的金额为-4,947,090.00 元，2021 年 12 月 31 日仍持有的第三层次金融工具计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动金额（公允价值变动损益）为-4,947,090.00 元。

于 2021 年 12 月 31 日，上述第三层次金融工具均为股票投资，公允价值为 31,498,224.00 元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

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

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,968,225,919.32	63.31
	其中：股票	3,968,225,919.32	63.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,084,000.00	0.54
	其中：债券	34,084,000.00	0.54
	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	1,561,815,618.00	24.92
	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	703,990,858.77	11.23
8	其他资产	-366,039.76	-0.01
9	合计	6,267,750,356.33	100.00

- 注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。
 2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。
 3、本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

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	3,344,822,291.00	53.54
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	-	-

	业		
J	金融业	578,566,203.87	9.26
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	44,837,424.45	0.72
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	3,968,225,919.32	63.51

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002475	立讯精密	7289500	358,643,400.00	5.74
2	600460	士兰微	6083662	329,734,480.40	5.28
3	600036	招商银行	6340405	308,841,127.55	4.94
4	000568	泸州老窖	1112618	282,460,331.66	4.52
5	601166	兴业银行	14166233	269,725,076.32	4.32
6	600519	贵州茅台	120600	247,230,000.00	3.96
7	002444	巨星科技	7931465	241,988,997.15	3.87
8	688208	道通科技	2808020	222,956,788.00	3.57
9	002541	鸿路钢构	2402663	128,638,577.02	2.06
10	300171	东富龙	2483200	125,500,928.00	2.01
11	603596	伯特利	1748241	121,677,573.60	1.95
12	300661	圣邦股份	383955	118,642,095.00	1.90
13	603681	永冠新材	2792310	109,737,783.00	1.76
14	002008	大族激光	1787600	96,530,400.00	1.55
15	601966	玲珑轮胎	2457836	89,833,905.80	1.44
16	603290	斯达半导	226800	86,410,800.00	1.38
17	002139	拓邦股份	4085800	76,363,602.00	1.22
18	300750	宁德时代	129800	76,322,400.00	1.22

19	300408	三环集团	1455800	64,928,680.00	1.04
20	300896	爱美客	123600	64,629,822.00	1.03
21	603456	九洲药业	1111100	62,510,486.00	1.00
22	300628	亿联网络	765781	62,372,862.45	1.00
23	000725	京东方 A	12338200	62,307,910.00	1.00
24	688187	时代电气	723984	59,366,688.00	0.95
25	300274	阳光电源	406950	59,333,310.00	0.95
26	002460	赣锋锂业	411317	58,756,633.45	0.94
27	300363	博腾股份	633120	56,632,584.00	0.91
28	002372	伟星新材	2179100	52,995,712.00	0.85
29	002027	分众传媒	5474655	44,837,424.45	0.72
30	688711	宏微科技	228517	28,315,541.47	0.45

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600460	士兰微	379,486,696.40	6.07
2	600036	招商银行	333,015,684.42	5.33
3	002475	立讯精密	327,943,101.20	5.25
4	601166	兴业银行	276,195,148.13	4.42
5	000568	泸州老窖	268,073,379.04	4.29
6	600519	贵州茅台	258,456,675.00	4.14
7	002444	巨星科技	256,726,959.66	4.11
8	688208	道通科技	213,325,021.21	3.41
9	300014	亿纬锂能	204,810,133.42	3.28
10	002241	歌尔股份	167,695,867.56	2.68
11	603290	斯达半导	149,624,918.00	2.39
12	601966	玲珑轮胎	137,879,759.85	2.21
13	600809	山西汾酒	136,576,871.36	2.19
14	300171	东富龙	125,934,599.63	2.02
15	002541	鸿路钢构	124,458,752.07	1.99
16	300661	圣邦股份	123,515,918.83	1.98
17	603596	伯特利	115,204,404.50	1.84

18	603681	永冠新材	106,888,741.88	1.71
19	002410	广联达	101,606,477.23	1.63
20	002027	分众传媒	101,575,235.80	1.63

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300014	亿纬锂能	187,550,318.81	3.00
2	002241	歌尔股份	173,937,053.64	2.78
3	600809	山西汾酒	131,113,636.89	2.10
4	002410	广联达	103,892,695.40	1.66
5	300059	东方财富	100,227,924.29	1.60
6	002027	分众传媒	63,950,726.00	1.02
7	300207	欣旺达	60,903,274.46	0.97
8	601012	隆基股份	54,009,664.96	0.86
9	688711	宏微科技	51,362,479.97	0.82
10	603290	斯达半导	50,202,678.00	0.80
11	601966	玲珑轮胎	46,935,990.80	0.75
12	603197	保隆科技	45,617,526.00	0.73
13	688050	爱博医疗	39,778,948.30	0.64
14	300274	阳光电源	39,261,369.40	0.63
15	002271	东方雨虹	32,887,845.00	0.53
16	002402	和而泰	23,585,782.60	0.38
17	002139	拓邦股份	22,978,702.13	0.37

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	5,262,331,853.95
卖出股票收入（成交）总额	1,228,196,616.65

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	34,084,000.00	0.55
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	34,084,000.00	0.55

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	113052	兴业转债	340,840	34,084,000.00	0.55

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等。

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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

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

本基金投资的前十名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。

8.12.2

本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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-716,481.49

5	应收申购款	350,441.73
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	-366,039.76

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，投资组合报告中市值占净值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

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
贝莱德中国新视野混合 A	85927	63,200.32	158,219,077.00	2.91%	5,272,394,726.20	97.09%
贝莱德中国新视野混合 C	19879	45,432.93	13,722,288.92	1.52%	889,438,836.77	98.48%
合计	105806	59,862.15	171,941,365.92	2.71%	6,161,833,562.97	97.29%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	贝莱德中国新视野混合 A	5,897,319.74	0.1086%
	贝莱德中国新视野混合 C	1,052,939.10	0.1166%
	合计	6,950,258.84	0.1097%

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	贝莱德中国新视野混合 A	贝莱德中国新视野混合 C
基金合同生效日（2021 年 9 月 7 日）基金份额总额	5,635,009,473.43	1,046,336,427.68
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	57,923,397.29	16,175,404.75
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	262,319,067.52	159,350,706.74
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,430,613,803.20	903,161,125.69

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

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

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本基金本报告期应支付给该事务所审计报酬为 100,400.00 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

报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券（山东）有限责任公司	2	6,490,528,470.60	100.00%	6,184,410.89	100.00%	

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发[2019]14号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的 30%”的分仓规定。

3、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

4、本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券（山东）有限责任公司	2,234,436,458.00	100.00%	105,482,301,000.00	100.00%		

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于贝莱德中国新视野混合型证券投资基金增加天天基金为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人的官方网站、电子披露网站	2021-11-24
2	贝莱德基金管理有限公司关于贝莱德中国新视野混合型证券投资基金参加部分销售机构费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人的官方网站、电子披露网站	2021-11-22
3	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务公告	上海证券报、基金管理人的官方网站、电子披露网站	2021-11-22
4	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金（A类份额）	基金管理人的官方网站、电	2021-09-09

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
	基金产品资料概要更新	子披露网站、中数平台	
5	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	基金管理人的官方网站、电子披露网站、中数平台	2021-09-09
6	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、基金管理人的官方网站、电子披露网站	2021-09-08
7	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金基金提前结束募集的公告	上海证券报、基金管理人的官方网站、电子披露网站	2021-09-03
8	关于贝莱德中国新视野混合型证券投资基金增加销售机构的公告	上海证券报、基金管理人的官方网站、电子披露网站	2021-08-27
9	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报、基金管理人的官方网站、电子披露网站	2021-08-20
10	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金托管协议	基金管理人的官方网站、电子披露网站	2021-08-20
11	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金基金份额发售公告	上海证券报、基金管理人的官方网站、电子披露网站	2021-08-20
12	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金基金合同	基金管理人的官方网站、电子披露网站	2021-08-20
13	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金招募说明书	基金管理人的官方网站、电子披露网站	2021-08-20
14	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要	基金管理人的官方网站、电子披露网站、中数平台	2021-08-20
15	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要	基金管理人的官方网站、电子披露网站、中数平台	2021-08-20

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（www.blackrock.com.cn）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

贝莱德基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日