

华安鼎利混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 4 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十日

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。本中期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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 4 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 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	12
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 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	41
7.7 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	42
7.8 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	42
7.9 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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	43
8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.3 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	44
9 开放式基金份额变动	44
10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
10.2 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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	45
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	45
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况	46
10.9 其他重大事件	46
11 影响投资者决策的其他重要信息	48
12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安鼎利混合型证券投资基金
基金简称	华安鼎利混合
基金主代码	009547
交易代码	009547
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年6月8日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,014,302.68 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采取相对灵活的资产配置策略。</p> <p>本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、资金供求因素、市场投资价值等方面，采取定量与定性相结合的分析方法，对证券市场投资机会与风险进行综合研判。</p> <p>本基金管理人根据多因素框架的分析结果，给出股票、债券和货币市场工具等资产投资机会的整体评估，作为资产配置的重要依据。基金管理人将根据股市、债市等的相对风险收益预期，调整股票、债券和货币市场工具等资产的配置比例。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×45%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%+中债综合全价指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

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		华安基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	田东辉
	联系电话	021-38969999	010-68858113
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		4008850099	95580
传真		021-68863414	010-68858120
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区	北京市西城区金融大街3号

	世纪大道8号国金中心二期31 -32层	
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 -32层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码	200120	100808
法定代表人	朱学华	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、 32层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31 层、32层

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2021年1月1日至2021年6月4日）
本期已实现收益	478,251.43
本期利润	-6,479,420.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0331
本期加权平均净值利润率	-2.90%
本期基金份额净值增长率	-0.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月4日)
期末可供分配利润	-11,897,966.70
期末可供分配基金份额利润	-0.9142
期末基金资产净值	14,697,158.40
期末基金份额净值	1.1293
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月4日)
基金份额累计净值增长率	12.93%

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（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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、本基金于 2020 年 6 月 8 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

5、本基金最后运作日为 2021 年 6 月 4 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

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
过去一个月	4.93%	0.88%	1.54%	0.45%	3.39%	0.43%
过去三个月	2.31%	1.15%	0.71%	0.54%	1.60%	0.61%
过去六个月	3.18%	1.16%	2.73%	0.59%	0.45%	0.57%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	12.93%	1.11%	13.19%	0.61%	-0.26%	0.50%

注：本基金最后运作日为 2021 年 6 月 4 日。

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

华安鼎利混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2020 年 6 月 8 日至 2021 年 6 月 4 日）



- 注：1、本基金于 2020 年 6 月 8 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年；
2、本基金最后运作日为 2021 年 6 月 4 日。

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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2021 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 163 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,256.69 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理	证券从业	说明
----	----	-----------	------	----

		(助理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
蒋璆	本基金的基金经理	2020-06-08	2021-06-04	13 年	硕士，13 年从业经历。曾任国泰君安证券有限公司研究员、华宝兴业基金管理有限公司研究员。2011 年 6 月加入华安基金管理有限公司，担任投资研究部行业分析师、基金经理助理。2015 年 6 月起担任华安动态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 6 月至 2016 年 9 月担任华安安信消费服务混合型证券投资基金、华安升级主题混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 11 月至 2018 年 9 月，担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月起，同时担任华安新乐享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2020 年 11 月，同时担任华安睿安定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 5 月起，同时担任华安安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月起，同时担任华安制造先锋混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月至 2021 年 6 月，同时担任华安鼎利混合型证券投资基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理

有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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（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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资

组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，宏观经济继续复苏，企业盈利持续改善，同时全球流动性保持宽裕，市场风险偏好整体上行，上半年主要指数均呈现震荡上行的走势，其中上证指数上涨 3.40%，深圳成指上涨 4.78%，沪深 300 上涨 0.24%，创业板指上涨 17.22%。从行业表现来看，约 2/3 的行业实现了正收益，其中基础化工、钢铁和新能源板块均获得了超过 20% 的指数涨幅，非银、家电、军工板块的指数跌幅则超过了 10%，整体分化还是比较大。从风格来看，周期和成长风格涨幅领先，消费风格表现稳定，金融风格相对落后。本基金在上半年维持中性仓位运行直至清盘，整体配置倾向于科技成长和高端制造方向，最终基金净值在报告期内小幅跑赢了业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 4 日，本基金份额净值为 1.1293 元，本报告期份额净值增长率为-0.16%，同期业绩比较基准增长率为 1.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济展望：（1）全球疫情逐步得到控制，防疫措施常态化叠加疫苗接种率提升，预计全球经济复苏步伐将会延续，但斜率会放缓。（2）国内经济增长延续良好势头，通胀较为温和，PPI 同比上行显示上游行业盈利情况良好，CPI 受猪价回落影响，预期全年通胀压力可控。（3）“十四五规划”正式出台，未来 5 年的战略导向和发展目标已经清晰，强调要坚持创新在我国现代化建设全局中的核心地位，把科技自立自强作为国家发展的战略支撑。（4）未来全球主要经济体退出非常规货币政策是必然，而央行“不急转弯”的表态说明退出的节奏将是渐进的和可控的，无论是货币总量还是信用条件的收紧都会以不引发金融风险作为前置条件。

股市走势展望：今年以来行业轮动频繁，呈现出很强的存量资金博弈特征，预计下半年仍会延续。总体判断，下半年指数缺乏趋势性上涨的基础，大概率会呈现整体震荡、结构分化的格局。理由：一，从盈利角度，疫情散发下的经济复苏已经进入稳定期，中报业绩高增长的预期已被市场部

分预期，环比来看下半年增速下行是大概率事件。二，从无风险利率角度，大宗商品涨价带来的通胀压力迫使全球央行缩减货币总量，中美利率都易上难下。三，从风险偏好角度，当前市场整体风险溢价率较低，情绪指标相对较热，特别是在部分新兴产业，需提防下半年紧信用强化对于估值的潜在压力。从全年角度，在整体估值受压的背景下，我们认为市场的结构性机会将主要集中在盈利快速增长的高景气行业和个股，景气度趋势将成为决定细分行业相对表现的最关键因素。

操作思路：本基金已触发基金合同终止情形，下一阶段将继续执行清算程序。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持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。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内基金持有人数不低于 200 人；基金资产净值连续超过 20 个工作日低于 5000 万元。

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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华安鼎利混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安鼎利混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 4 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 4 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	9,202,283.61	113,566,031.05
结算备付金		23,775.23	1,656,390.37
存出保证金		371,629.57	463,706.37
交易性金融资产	6.4.7.2	4,401,803.86	409,452,729.05
其中：股票投资		4,385,003.86	357,666,046.49
基金投资		-	-
债券投资		16,800.00	51,786,682.56

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	54,100,000.00
应收证券清算款		1,359,930.92	-
应收利息	6.4.7.5	17,140.75	137,016.17
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		15,376,563.94	579,375,873.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月4日	上年度末 2020年12月31日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	23,930,066.67
应付赎回款		1.13	-
应付管理人报酬		1,215.16	547,443.53
应付托管费		243.04	68,430.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	648,220.26	1,508,561.57
应交税费		0.05	463.43
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	29,725.90	120,000.00
负债合计		679,405.54	26,174,965.65
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	13,014,302.68	489,087,971.06
未分配利润	6.4.7.10	1,682,855.72	64,112,936.30
所有者权益合计		14,697,158.40	553,200,907.36
负债和所有者权益总计		15,376,563.94	579,375,873.01

注：报告截止日 2021 年 6 月 4 日，基金份额净值 1.1293 元，基金份额总额 13,014,302.68 份。

6.2 利润表

会计主体：华安鼎利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 4 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 4 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 8 日（基 金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		-4,155,045.78	2,610,613.01
1.利息收入		373,963.59	296,518.91
其中：存款利息收入	6.4.7.11	212,319.05	168,699.11
债券利息收入		22,502.27	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		139,142.27	127,819.80
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		379,628.20	92,154.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,041,869.02	17,585.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,665,814.72	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.14	3,573.90	74,569.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-6,957,671.49	2,221,939.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,049,033.92	-
减：二、费用		2,324,374.28	374,525.23
1. 管理人报酬	6.4.9.2	835,481.59	253,137.01
2. 托管费	6.4.9.2	150,531.82	31,642.15
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	1,249,553.94	76,012.74
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		81.03	-
7. 其他费用	6.4.7.18	88,725.90	13,733.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,479,420.06	2,236,087.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,479,420.06	2,236,087.78

注：本基金于 2020 年 6 月 8 日成立，上年度可比期间为 2020 年 6 月 8 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安鼎利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 4 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 4 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）	489,087,971.06	64,112,936.30	553,200,907.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,479,420.06	-6,479,420.06
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）	-476,073,668.38	-55,950,660.52	-532,024,328.90
其中：1.基金申购款	13,228,649.62	655,984.25	13,884,633.87
2.基金赎回款	-489,302,318.00	-56,606,644.77	-545,908,962.77
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）	13,014,302.68	1,682,855.72	14,697,158.40
项目	上年度可比期间 2020 年 6 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 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）	350,256,195.85	-	350,256,195.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,236,087.78	2,236,087.78
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	350,256,195.85	2,236,087.78	352,492,283.63

注：本基金于 2020 年 6 月 8 日成立，上年度可比期间为 2020 年 6 月 8 日至 2020 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安鼎利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]845号《关于准予华安鼎利混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司自2020年6月2日至2020年6月3日期间向社会公开发行人募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2020）验字第60971571_B05号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2020年6月8日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币350,244,943.66元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币11,252.19元，以上实收基金（本息）合计为人民币350,256,195.85元，折合350,256,195.85份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

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、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的30%-75%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包含结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。

本基金业绩比较基准为：中证800指数收益率×45%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%+中债综合全价指数收益率×50%。

华安鼎利混合型证券投资基金已连续50个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元。

为维护基金份额持有人利益，根据本基金基金合同的约定，不需召开基金份额持有人大会，本基金管理人决定本基金最后运作日为 2021 年 6 月 4 日，自 2021 年 6 月 5 日进入清算期。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 4 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 4 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金最后运作日为 2021 年 6 月 4 日，自 2021 年 6 月 5 日进入清算期。本基金财务报表所载财务信息依照《华安鼎利混合型证券投资基金基金合同》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个
人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加
的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，
自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用
基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通
知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，
暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，
对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收
入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通
知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，
暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得
有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人
所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别
化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转
让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应
纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期
限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个
人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市

场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 4 日
活期存款	9,202,283.61
定期存款	-
其他存款	-
合计	9,202,283.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 4 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,229,122.97	4,385,003.86	155,880.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	16,800.00	16,800.00
	银行间市场	-	-
	合计	16,800.00	16,800.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,245,922.97	4,401,803.86	155,880.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 4 日
应收活期存款利息	14,497.58
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	849.58
应收债券利息	1.62
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	1,791.97
合计	17,140.75

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 4 日
交易所市场应付交易费用	648,220.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	648,220.26

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 4 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	-
预提审计费	29,725.90

合计	29,725.90
----	-----------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 4 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	489,087,971.06	489,087,971.06
本期申购	13,228,649.62	13,228,649.62
本期赎回（以“-”号填列）	-489,302,318.00	-489,302,318.00
本期末	13,014,302.68	13,014,302.68

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	47,549,062.28	16,563,874.02	64,112,936.30
本期利润	478,251.43	-6,957,671.49	-6,479,420.06
本期基金份额交易产生的变动数	-59,925,280.41	3,974,619.89	-55,950,660.52
其中：基金申购款	-7,167,050.28	7,823,034.53	655,984.25
基金赎回款	-52,758,230.13	-3,848,414.64	-56,606,644.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,897,966.70	13,580,822.42	1,682,855.72

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 4 日
	活期存款利息收入
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	5,879.95
其他	3,504.05
合计	212,319.05

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 4 日

卖出股票成交总额	528,309,233.92
减：卖出股票成本总额	524,267,364.90
买卖股票差价收入	4,041,869.02

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月4日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	84,325,959.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	87,835,998.81
减：应收利息总额	155,775.37
买卖债券差价收入	-3,665,814.72

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月4日
股票投资产生的股利收益	3,573.90
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,573.90

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月4日
1.交易性金融资产	-6,957,671.49
——股票投资	-9,585,517.48
——债券投资	2,627,845.99
——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	-6,957,671.49

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月4日
基金赎回费收入	2,042,335.27
转换费收入	6,698.65
合计	2,049,033.92

注：基金赎回费收入含赎回费收入和转换费收入。本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月4日
交易所市场交易费用	1,249,553.94
银行间市场交易费用	-
合计	1,249,553.94

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月4日
审计费用	29,725.90
信息披露费	50,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	88,725.90

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据本基金管理人于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经基金管理人股东会第六十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可【2021】669 号文核准，基金管理人股东上海锦江国际投资管理

有限公司将其持有的公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司(“邮储银行”)	基金托管人

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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月4日		上年度可比期间 2020年6月8日(基金合同生效日) 至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	706,749,414.62	100.00%	74,969,119.01	100.00%

注：本基金于 2020 年 6 月 8 日成立，上年度可比期间为 2020 年 6 月 8 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.9.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月4日		上年度可比期间 2020年6月8日(基金合同生效日) 至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	117,809,306.03	100.00%	-	-

注：本基金于 2020 年 6 月 8 日成立，上年度可比期间为 2020 年 6 月 8 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月4日		上年度可比期间 2020年6月8日（基金合同生效日） 至2020年6月30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
国泰君安证券股份有限公司	185,000,000.00	100.00%	420,700,000.00	100.00%

注：本基金于 2020 年 6 月 8 日成立，上年度可比期间为 2020 年 6 月 8 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.9.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月4日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
国泰君安证券股份有限公司	648,220.26	100.00%	648,220.26	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年6月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
国泰君安证券股份有限公司	69,137.25	100.00%	69,137.25	100.00%

注：本基金于 2020 年 6 月 8 日成立，上年度可比期间为 2020 年 6 月 8 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月4日	上年度可比期间 2020年6月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	835,481.59	253,137.01
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

(2) 本基金于 2020 年 6 月 8 日成立，上年度可比期间为 2020 年 6 月 8 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 4日	上年度可比期间 2020年6月8日（基金合同 生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	150,531.82	31,642.15

注：(1)基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

(2) 本基金于 2020 年 6 月 8 日成立，上年度可比期间为 2020 年 6 月 8 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.9.3 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。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月4日	上年度可比期间 2020年6月8日（基金合同生效日）至 2020年6月30日
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	12,868,965.94	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	12,868,965.94	-

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	98.88%	-
-----------------------	--------	---

注：本基金于 2020 年 6 月 8 日成立，上年度可比期间为 2020 年 6 月 8 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.9.5 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1月1日至2021年6月4日		上年度可比期间 2020年6月8日（基金合同生效日） 至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行	9,202,283.61	202,935.05	77,014,000.31	129,324.11

注：本基金于 2020 年 6 月 8 日成立，上年度可比期间为 2020 年 6 月 8 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.9.6 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 2021年1月1日至2021年6月4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
国泰君安	605005	合兴股份	网下申购	634.00	4,044.92
国泰君安	688070	纵横股份	网下申购	2,407.00	56,024.85
国泰君安	688677	海泰新光	网下申购	1,768.00	63,539.80

6.4.10 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.11 期末（2021年6月4日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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

6.4.11.1 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
300913	兆龙互连	2020-1-27	2021-06-07	新股限售	13.21	23.65	630.00	8,322.30	14,899.50	-

300912	凯龙高科	2020-1-26	2021-06-09	新股限售	17.62	37.75	5,117.00	90,161.54	193,166.75	-
300918	南山智尚	2020-1-2-15	2021-06-29	新股限售	4.97	11.18	1,063.00	5,283.11	11,884.34	-
300922	天秦装备	2020-1-2-18	2021-06-25	新股限售	16.05	34.12	287.00	4,606.35	9,792.44	-
300894	火星人	2020-1-2-24	2021-06-30	新股限售	14.07	61.85	628.00	8,835.96	38,841.80	-
300925	法本信息	2020-1-2-21	2021-06-30	新股限售	20.08	37.63	353.00	7,088.24	13,283.39	-
300927	江天化学	2020-1-2-29	2021-07-07	新股限售	13.39	29.64	217.00	2,905.63	6,431.88	-
300926	博俊科技	2020-1-2-29	2021-07-12	新股限售	10.76	21.20	359.00	3,862.84	7,610.80	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股限售	13.87	30.43	183.00	2,538.21	5,568.69	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股限售	4.31	14.82	672.00	2,896.32	9,959.04	-
688680	海优新材	2021-01-15	2021-07-22	新股限售	69.94	149.14	2,107.00	147,363.58	314,237.98	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股限售	12.25	52.36	244.00	2,989.00	12,775.84	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股限售	12.76	42.73	307.00	3,917.32	13,118.11	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	5.31	24.79	443.00	2,352.33	10,981.97	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	21.59	255.00	2,496.45	5,505.45	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	19.65	474.00	2,161.44	9,314.10	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股限售	13.00	25.33	324.00	2,808.00	8,206.92	在流通受限期内, 获得送股 108 股
688677	海泰新光	2021-02-18	2021-08-25	新股限售	35.76	96.17	1,768.00	63,223.68	170,028.56	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	37.73	219.00	1,841.79	8,262.87	-
6.4.11.1.2 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	认购价格	期末估值单价	数量(单位: 张)	期末成本	期末估值	备注

				限类型				总额	总额	
123114	三角转债	2021-05-25	2021-06-11	配债未上市	100.00	100.00	168.00	16,800.00	16,800.00	-

注：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。

6.4.11.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2021 年 6 月 4 日止，本基金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为 0，无抵押债券。

6.4.12 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金在日常经营活动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。本基金在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.12.2 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

放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

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。

6.4.12.3 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，有效保障基金份额持有人利益。

6.4.12.3.1 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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%。

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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资

金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：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。

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

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 利率风险

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

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

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 4 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	9,202,283.61	-	-	-	9,202,283.61
结算备付金	23,775.23	-	-	-	23,775.23
存出保证金	371,629.57	-	-	-	371,629.57
交易性金融资产	16,800.00	-	-	4,385,003.86	4,401,803.86
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,359,930.92	1,359,930.92
应收利息	-	-	-	17,140.75	17,140.75
资产总计	9,614,488.41	-	-	5,762,075.53	15,376,563.94
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1.13	1.13
应付管理人报酬	-	-	-	1,215.16	1,215.16
应付托管费	-	-	-	243.04	243.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	648,220.26	648,220.26
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	29,725.90	29,725.90
负债总计	-	-	-	679,405.54	679,405.54
利率敏感度缺口	9,614,488.41	0.00	0.00	5,082,669.99	14,697,158.40
上年度末 2020 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	113,566,031.05	-	-	-	113,566,031.05
结算备付金	1,656,390.37	-	-	-	1,656,390.37
存出保证金	463,706.37	-	-	-	463,706.37
交易性金融资产	51,786,682.56	-	-	357,666,046.49	409,452,729.05
买入返售金融资产	54,100,000.00	-	-	-	54,100,000.00

应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	137,016.17	137,016.17
资产总计	221,572,810.35	-	-	357,803,062.66	579,375,873.01
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	23,930,066.67	23,930,066.67
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	547,443.53	547,443.53
应付托管费	-	-	-	68,430.45	68,430.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,508,561.57	1,508,561.57
应交税费	-	-	-	463.43	463.43
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	120,000.00	120,000.00
负债总计	-	-	-	26,174,965.65	26,174,965.65
利率敏感度缺口	221,572,810.35	-	-	331,628,097.01	553,200,907.36

注：表中所示为本基金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予以分类。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2021 年 6 月 4 日未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：9.36%)。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试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。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 4 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,385,003.86	29.84	357,666,046.49	64.65
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,385,003.86	29.84	357,666,046.49	64.65

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准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：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 4 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

	业绩比较基准上升 5%	增加约 110	增加约 4,166
	业绩比较基准下降 5%	减少约 110	减少约 4,166

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.13.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.13.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.13.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 8 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

7 投资组合报告

7.1 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	4,385,003.86	28.52
	其中：股票	4,385,003.86	28.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,800.00	0.11
	其中：债券	16,800.00	0.11
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,226,058.84	60.00
8	其他各项资产	1,748,701.24	11.37
9	合计	15,376,563.94	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	112,600.00	0.77
C	制造业	2,676,886.17	18.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	405,348.00	2.76
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	22,089.94	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	269,695.00	1.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,283.39	0.09
J	金融业	139,772.00	0.95
K	房地产业	135,542.00	0.92
L	租赁和商务服务业	402,845.00	2.74
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	206,942.36	1.41
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	4,385,003.86	29.84

7.3 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	600900	长江电力	20,400	405,348.00	2.76
2	688680	海优新材	2,127	317,366.78	2.16
3	002475	立讯精密	8,044	308,487.40	2.10

4	300696	爱乐达	7,280	275,766.40	1.88
5	600138	中青旅	23,500	261,555.00	1.78
6	600216	浙江医药	15,700	250,886.00	1.71
7	601689	拓普集团	5,800	216,456.00	1.47
8	002938	鹏鼎控股	6,803	208,852.10	1.42
9	300912	凯龙高科	5,117	193,166.75	1.31
10	688677	海泰新光	1,768	170,028.56	1.16
11	600438	通威股份	4,400	156,992.00	1.07
12	002027	分众传媒	14,200	141,290.00	0.96
13	601288	农业银行	42,100	139,772.00	0.95
14	688330	宏力达	1,851	139,694.97	0.95
15	601816	京沪高铁	23,900	135,991.00	0.93
16	600048	保利地产	10,100	135,542.00	0.92
17	601333	广深铁路	61,900	133,704.00	0.91
18	002179	中航光电	1,800	133,650.00	0.91
19	000333	美的集团	1,600	124,368.00	0.85
20	000923	河钢资源	5,000	112,600.00	0.77
21	300724	捷佳伟创	1,000	110,860.00	0.75
22	002837	英维克	3,700	67,932.00	0.46
23	002600	领益智造	6,952	58,257.76	0.40
24	300894	火星人	628	38,841.80	0.26
25	300913	兆龙互连	630	14,899.50	0.10
26	300925	法本信息	353	13,283.39	0.09
27	300940	南极光	307	13,118.11	0.09
28	300937	药易购	244	12,775.84	0.09
29	300918	南山智尚	1,063	11,884.34	0.08
30	300942	易瑞生物	443	10,981.97	0.07
31	300931	通用电梯	672	9,959.04	0.07
32	300922	天秦装备	287	9,792.44	0.07
33	300945	曼卡龙	474	9,314.10	0.06
34	300950	德固特	219	8,262.87	0.06
35	300948	冠中生态	324	8,206.92	0.06
36	300926	博俊科技	359	7,610.80	0.05
37	300927	江天化学	217	6,431.88	0.04
38	300929	华骐环保	183	5,568.69	0.04
39	300943	春晖智控	255	5,505.45	0.04

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300207	欣旺达	15,469,876.37	2.80
2	601689	拓普集团	11,220,735.85	2.03
3	002759	天际股份	11,152,692.00	2.02
4	002241	歌尔股份	10,923,877.10	1.97
5	300751	迈为股份	10,595,739.00	1.92
6	000100	TCL 科技	8,452,453.00	1.53
7	002304	洋河股份	6,734,573.00	1.22
8	300775	三角防务	6,697,200.00	1.21
9	002475	立讯精密	5,734,465.96	1.04
10	600406	国电南瑞	5,684,077.00	1.03
11	603369	今世缘	5,681,785.00	1.03
12	002572	索菲亚	5,677,475.00	1.03
13	002407	多氟多	5,627,248.23	1.02
14	000333	美的集团	5,543,909.00	1.00
15	000516	国际医学	5,435,948.00	0.98
16	600745	闻泰科技	5,405,918.00	0.98
17	688680	海优新材	5,163,483.24	0.93
18	300724	捷佳伟创	5,153,400.00	0.93
19	300457	赢合科技	5,079,040.00	0.92
20	002938	鹏鼎控股	4,028,649.00	0.73

注：本项“买入金额”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。

7.4.2 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	002129	中环股份	19,972,908.74	3.61
2	600745	闻泰科技	19,967,100.86	3.61
3	300751	迈为股份	18,307,207.00	3.31
4	300613	富瀚微	18,066,349.48	3.27
5	300724	捷佳伟创	17,676,787.00	3.20
6	000977	浪潮信息	15,741,465.80	2.85
7	300457	赢合科技	15,171,435.00	2.74
8	000100	TCL 科技	14,517,060.45	2.62
9	002475	立讯精密	14,331,922.70	2.59
10	300059	东方财富	14,117,949.18	2.55
11	603993	洛阳钼业	13,665,950.00	2.47
12	600111	北方稀土	13,622,221.32	2.46
13	300207	欣旺达	13,302,735.80	2.40
14	002241	歌尔股份	10,862,763.83	1.96

15	300073	当升科技	10,844,636.40	1.96
16	002759	天际股份	10,048,809.89	1.82
17	688396	华润微	9,601,054.78	1.74
18	002074	国轩高科	9,378,555.00	1.70
19	601689	拓普集团	9,185,762.22	1.66
20	600519	贵州茅台	8,302,683.00	1.50

注：本项“卖出金额”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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	180,571,839.75
卖出股票的收入（成交）总额	528,309,233.92

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	16,800.00	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,800.00	0.11

7.6 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	123114	三角转债	168	16,800.00	0.11

7.7 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。

7.8 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投资。

7.9 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投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据权益类资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 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	371,629.57
2	应收证券清算款	1,359,930.92
3	应收股利	-
4	应收利息	17,140.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,748,701.24

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	688680	海优新材	314,237.98	2.14	新股流通受限
2	300912	凯龙高科	193,166.75	1.31	新股流通受限
3	688677	海泰新光	170,028.56	1.16	新股流通受限

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
212	61,388.22	12,868,965.94	98.88%	145,336.74	1.12%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,207.87	0.08%

8.3 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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年6月8日）基金份额总额	350,256,195.85
本报告期期初基金份额总额	489,087,971.06
本报告期基金总申购份额	13,228,649.62
减：本报告期基金总赎回份额	489,302,318.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,014,302.68

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2021 年 2 月 6 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，杨牧云先生新任本基金管理人的督察长。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
国泰君安证券	2	706,749,414.62	100.00%	648,220.26	100.00%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

10.8.2 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		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
国泰君安证券	117,809,306.03	100.00%	185,000,000.00	100.00%	-	-

10.9 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	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(合兴股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-12
2	关于调整华安鼎利混合型证券投资基金基金费率并修改基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-13
3	华安鼎利混合型证券投资基金基金合同(更新)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-13
4	华安鼎利混合型证券投资基金托管协议(更新)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-13
5	华安鼎利混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-18
6	华安鼎利混合型证券投资基金更新的招募说明书(2021 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-18
7	华安鼎利混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-21
8	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(纵横股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-03
9	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-06
10	华安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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-09
11	华安鼎利混合型证券投资基金基金合同(更新)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-09
12	华安鼎利混合型证券投资基金托管协议(更新)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-09
13	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(海泰新光)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-19
14	华安鼎利混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-19
15	华安鼎利混合型证券投资基金更新的招募说	中国证监会基金电子披	2021-02-19

	明书(2021 年第 2 号)	露网站和公司网站等指定媒介	
16	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-09
17	华安鼎利混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-30
18	华安鼎利混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-21
19	关于华安鼎利混合型证券投资基金资产净值低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-05-11
20	关于华安鼎利混合型证券投资基金资产净值低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-05-24
21	关于华安鼎利混合型证券投资基金资产净值低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-05-31
22	关于华安鼎利混合型证券投资基金触发基金合同终止情形的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-05

注：注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20210101-20210222	222,920,074.09	0.00	222,920,074.09	0.00	0.00%
	2	20210101-20210322	99,999,000.00	0.00	99,999,000.00	0.00	0.00%
	3	20210223-20210303	75,002,375.00	0.00	75,002,375.00	0.00	0.00%
	4	20210223-20210323	90,003,050.00	0.00	90,003,050.00	0.00	0.00%

			0				
	5	20210324-202106 04	0.00	12,868 ,965.9 4	0.00	12,868,965. 94	98.88%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安鼎利混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安鼎利混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安鼎利混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安鼎利混合型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

二〇二一年八月三十日