

华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 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..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| §6 中期财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 18 |
| §7 投资组合报告 | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 38 |
| 7.2 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..... | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 44 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 48 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 48 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 49 |
| §8 基金份额持有人信息 | 49 |

| | |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 49 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 50 |
| §10 重大事件揭示..... | 50 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 51 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 51 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 51 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 51 |
| 10.8 其他重大事件..... | 52 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 54 |
| §12 备查文件目录..... | 54 |
| 12.1 备查文件目录..... | 54 |
| 12.2 存放地点..... | 54 |
| 12.3 查阅方式..... | 54 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------|
| 基金名称 | 华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华商健康生活混合 |
| 基金主代码 | 001106 |
| 交易代码 | 001106 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 3 月 17 日 |
| 基金管理人 | 华商基金管理有限公司 |
| 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 | 268,266,051.35 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金主要投资于与健康生活相关的优质上市公司，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金在资产配置中采用自上而下的策略，由基金经理和研究员组成的投研团队及时跟踪宏观经济运行态势和宏观经济政策动向，通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况、证券市场估值水平等的深入研究，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并适时动态地调整基金资产在股票、债券、现金三大类资产的投资比例，以规避市场系统性风险。</p> <p>在具体操作中，本基金结合市场主要经济变量和金融变量的变化，综合分析大类资产的预期收益和风险特征及其变化方向，将主要基金资产动态配置在股票和债券等大类资产之间，同时兼顾动态资产配置中的风险控制和成本控制。本基金通过资产配置策略，在股市系统性上涨阶段抓住权益类资产的收益机会，在股市系统性下跌阶段利用固定收益类资产及股指期货等其他金融工具降低损失，实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>具体投资策略详见基金合同。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|-------------------------|-----------------------|
| 名称 | | 华商基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 高敏 | 李申 |
| | 联系电话 | 010-58573600 | 021-60637102 |
| | 电子邮箱 | gaom@hsfund.com | lishen.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4007008880 | 021-60637111 |
| 传真 | | 010-58573520 | 021-60635778 |
| 注册地址 | | 北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | | 北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 100035 | 100033 |
| 法定代表人 | | 陈牧原 | 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 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.hsfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-------------------------|
| 注册登记机构 | 华商基金管理有限公司 | 北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 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 - 2021 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 55,271,144.36 |
| 本期利润 | 47,685,633.43 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1614 |
| 本期加权平均净值利润率 | 10.82% |
| 本期基金份额净值增长率 | 10.04% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 175,772,754.74 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6552 |

| | |
|---------------------|-------------------------|
| 期末基金资产净值 | 444,038,806.09 |
| 期末基金份额净值 | 1.655 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 71.70% |

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. 对期末可供分配利润，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余额的孰低数。

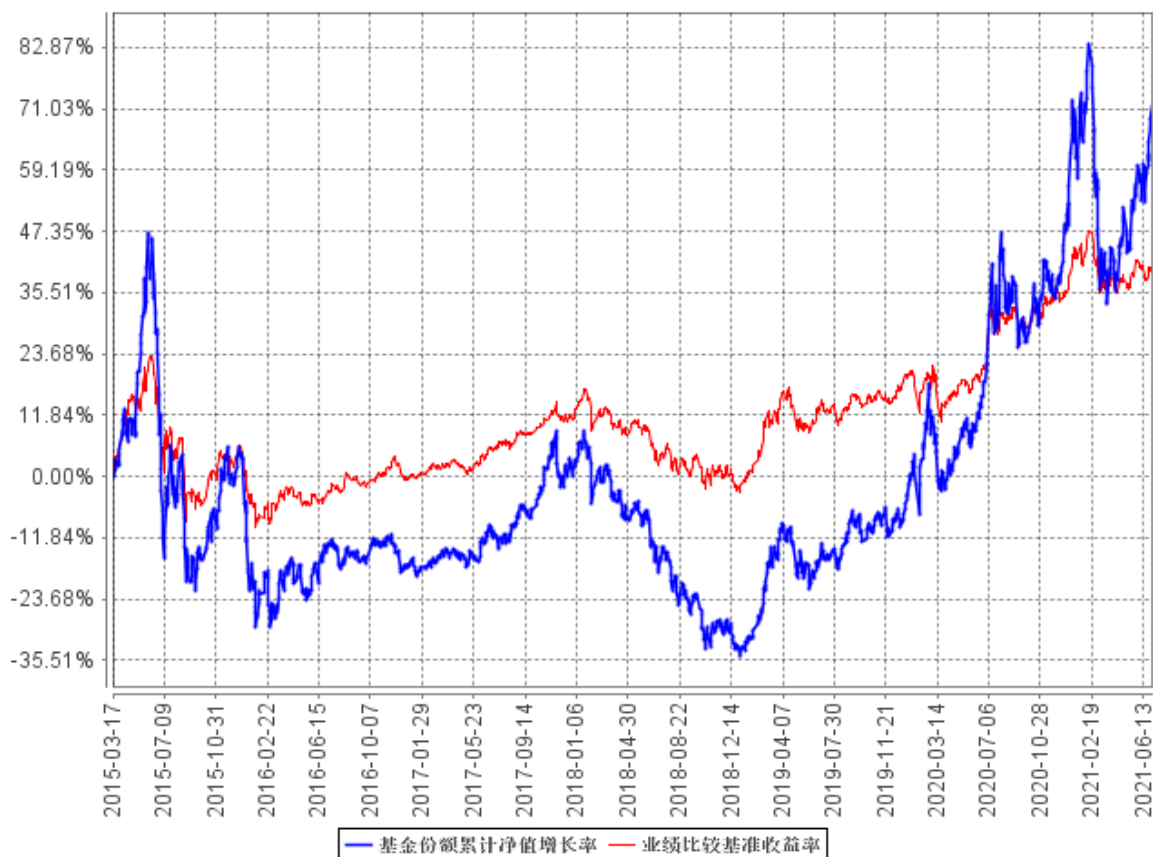
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 7.33% | 1.67% | -1.04% | 0.45% | 8.37% | 1.22% |
| 过去三个月 | 23.42% | 1.63% | 2.37% | 0.54% | 21.05% | 1.09% |
| 过去六个月 | 10.04% | 2.14% | 1.14% | 0.72% | 8.90% | 1.42% |
| 过去一年 | 41.45% | 1.99% | 15.13% | 0.73% | 26.32% | 1.26% |
| 过去三年 | 98.92% | 1.67% | 33.71% | 0.75% | 65.21% | 0.92% |
| 自基金合同生效起至今 | 71.70% | 1.71% | 40.13% | 0.82% | 31.57% | 0.89% |

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①本基金合同生效日为 2015 年 03 月 17 日。

②根据《华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括中小企业私募债券）、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货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的相关规定。本基金股票资产的投资比例为 0-95%，其中投资于健康生活相关上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%，债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5-100%，其中权证占基金资产净值的 0-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

§ 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

华商基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]160 号文批准设立，于 2005 年 12 月 20 日成立，注册资本为 1 亿元人民币，注册地北京。

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理六十一只基金产品，分别为华商领先企业混合型开放式证券投资基金、华商盛世成长混合型证券投资基金、华商收益增强债券型证券投资基金、华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华商产业升级混合型证券投资基金、华商稳健双利债券型证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华商稳定增利债券型证券投资基金、华商价值精选混合型证券投资基金、华商主题精选混合型证券投资基金、华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华商现金增利货币市场基金、华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金、华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金、华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金、华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金、华商双债丰利债券型证券投资基金、华商创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金、华商新量化灵活配置混合型证券投资基金、华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金、华商未来主题混合型证券投资基金、华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金、华商双翼平衡混合型证券投资基金、华商新常态灵活配置混合型证券投资基金、华商信用增强债券型证券投资基金、华商双驱优选灵活配置混合型证券投资基金、华商新动力混合型证券投资基金、华商智能生活灵活配置混合型证券投资基金、华商乐享互联灵活配置混合型证券投资基金、华商新兴活力灵活配置混合型证券投资基金、华商万众创新灵活配置混合型证券投资基金、华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金、华商丰利增强定期开放债券型证券投资基金、华商润丰灵活配置混合型证券投资基金、华商元亨灵活配置混合型证券投资基金、华商瑞丰短债债券型证券投资基金、华商研究精选灵活配置混合型证券投资基金、华商鑫安灵活配置混合型证券投资基金、华商可转债债券型证券投资基金、华商上游产业股票型证券投资基金、华商改革创新股票型证券投资基金、华商消费行业股票型证券投资基金、华商电子行业量化股票型发起式证券投资基金、华商计算机行业量化股票型发起式证券投资基金、华商高端装备制造股票型证券投资基金、华商医药医疗行业股票型证券投资基金、华商恒益稳健混合型证券投资基金、华商科技创新混合型证券投资基金、华商龙头优势混合型证券投资基金、华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华商鸿畅 39 个月定期开放利率债债券型证券投资基金、华商转债精选债券型证券投资基金、华商量化优

质精选混合型证券投资基金、华商双擎领航混合型证券投资基金、华商景气优选混合型证券投资基金、华商甄选回报混合型证券投资基金、华商鸿盈 87 个月定期开放债券型证券投资基金、华商均衡成长混合型证券投资基金、华商嘉悦平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华商远见价值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 | | |
| 何奇峰 | 基金经理 | 2017 年 12 月 21 日 | - | 14.5 | 男，中国籍，经济学硕士，具有基金从业资格。2004 年 6 月至 2006 年 12 月，就职于赛迪顾问股份有限公司，任高级分析师；2006 年 12 月至 2010 年 2 月，就职于长城证券金融研究所，任行业研究员、行业部经理；2010 年 2 月加入华商基金管理有限公司，曾任研究发展部行业研究员、研究组长；2014 年 1 月 28 日至 2015 年 1 月 26 日担任华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理助理；2015 年 1 月 27 日起至今担任华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理；2016 年 2 月 25 日至 2018 年 7 月 12 日担任华商新兴活力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 12 月 23 日至 2017 年 12 月 28 日担任华商盛世成长混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 3 月 15 日至 2019 年 7 月 3 日担任华商民营活力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 21 日起至今担任华商健康生活灵活配置混合型证券投资 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 基金的基金经理；2019 年 7 月 4 日起至今担任华商消费行业股票型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：①“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从《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

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

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

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》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统中的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配，报告期内，系统的公平交易程序运作良好，未出现异常情况。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内，场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1 日、3 日、5 日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，统计了溢价率占优比例。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，公司制定了《异常交易管理办法》，对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度，未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易，按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

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

上半年 A 股呈现大幅波动、结构分化的市场格局。上证指数期间上涨 3.4%，而创业板指数则上涨 17.22%。分季度来看，一季度 A 股市场先扬后抑，白酒、医药为代表的核心资产二月中旬后大幅下跌，上证指数单季度下跌了 0.9%，创业板一季度下跌 7%。二季度，随着美债利率见顶回落，国内市场开始逐步企稳回升。进入五月份之后，以新能源汽车为代表的成长板块带动下，A 股总体重新步入上行通道。上证指数二季度上涨 4.34%，创业板更是大幅上涨 26.05%。

从市场结构来看，2021 上半年 A 股市场依然呈现明显的结构分化特征。一方面，以新能源汽车、半导体、CXO 为代表的高成长性赛道，由于行业景气度高，行业和龙头个股整体估值不断抬升，板块的市场表现较为出色。另一方面，2020 年三季度以来的国内经济反弹渐入尾声，与基建和地产投资相关度较高的家电、建材、工程机械等行业数据不佳，上述行业和龙头个股的估值出现了明显的调整。

上半年组合配置方面，本基金一季度以医药、白酒和中游制造业行业龙头作为主要配置方向，二月中旬后出现了比较大的回撤。二季度，本基金在组合配置上进行了较大幅度调整，增配了较多的新能源汽车、光伏、CXO 等行业，使得基金组合净值有明显的回升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.655 元，份额累计净值为 1.705 元。本报告期内基金份额净值增长率为 10.04%，同期基金业绩比较基准收益率为 1.14%，本基金份额净值增长率高于业绩比较基准收益率 8.90 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历了上半年相对强势的结构行情，A 股市场下半年将面临较多的不确定性因素和内外部经济变化带来的挑战，市场预期收益率将逐步收敛。

下半年 A 股市场面临的几方面挑战，包括：（1）随着疫苗在全球范围内的广泛接种，全球经济继续延续复苏态势，去年以来全球各大央行史无前例的货币宽松有望边际收紧，这对全球权益市场而言意味着增量资金的减少和估值整体边际收缩的开始。（2）无论是美国市场还是国内 A 股，以科技股为代表，当前的市场整体估值水平都处于相对较高水平，未来大幅估值提升的空间不大。

（3）科创板和创业板改革推进，A 股持续扩容对市场整体表现也会造成一定程度的影响。

在行业配置方面，下半年本基金将继续围绕行业景气度高、业绩增长确定性强的行业作为配置重点，组合依然围绕新能源汽车、光伏、半导体、医药等行业和龙头公司作为投资重点。

4.6 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，根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定及基金合同中关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人设立的估值小组，负责组织制定、定期审核及适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值小组成员包括总经理、督察长、分管基金运营部的高管、分管投研部门的高管、固定收益部负责人、研究发展部负责人、基金运营部负责人、风险控制部负责人或上述部门负责人指定人员，由总经理任估值小组负责人，由基金运营部负责人任估值小组秘书。估值小组关于调整投资品种估值方法的决策，需经 1/2 以上的小组成员同意。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理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。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格，当对估值原则及技术有异议时，本基金托管人有义务要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。会计师事务所在对基金年度财务报告出具审计报告时，对报告期间基金的估值技术及其重大变化，特别是对估值的适当性，采用外部信息进行估值的客观性和可靠性程度，以及相关披露的充分性和及时性等发表意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易的债券品种的估值数据，以及流通受限股票的流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次。本基金本报告期末未进行利润分配。

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

本报告期，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。

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 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|------------|---------|-------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 45,217,139.35 | 52,425,316.85 |
| 结算备付金 | | 2,672,733.18 | 3,388,070.70 |
| 存出保证金 | | 326,472.99 | 637,944.91 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 407,574,828.64 | 519,033,286.90 |
| 其中：股票投资 | | 407,574,828.64 | 518,843,788.70 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 189,498.20 |
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 2,706,906.33 | 8,603,610.52 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 5,263.33 | 7,391.95 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 33,331.33 | 65,608.84 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 458,536,675.15 | 584,161,230.67 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021年6月30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 | | 9,536,959.90 | 14,651,040.83 |
| 应付赎回款 | | 2,579,127.74 | 8,410,200.11 |
| 应付管理人报酬 | | 519,327.77 | 692,952.13 |
| 应付托管费 | | 86,554.61 | 115,492.02 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,671,540.23 | 2,057,888.59 |
| 应交税费 | | - | 0.35 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 104,358.81 | 201,246.26 |
| 负债合计 | | 14,497,869.06 | 26,128,820.29 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 268,266,051.35 | 370,924,494.22 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 175,772,754.74 | 187,107,916.16 |
| 所有者权益合计 | | 444,038,806.09 | 558,032,410.38 |
| 负债和所有者权益总计 | | 458,536,675.15 | 584,161,230.67 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.655 元，基金份额总额 268,266,051.35 份。

6.2 利润表

会计主体：华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年6月30日 |
|-----|-----|--------------------------------|-------------------------------------|
| | | | |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|----------------|
| 一、收入 | | 57,248,120.76 | 244,028,048.48 |
| 1.利息收入 | | 104,017.65 | 390,842.67 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 104,004.99 | 390,842.67 |
| 债券利息收入 | | 12.66 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 64,654,553.46 | 201,115,549.69 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 63,977,423.98 | 198,653,361.63 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 30,241.07 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.3 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 646,888.41 | 2,462,188.06 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -7,585,510.93 | 42,453,208.95 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 75,060.58 | 68,447.17 |
| 减：二、费用 | | 9,562,487.33 | 25,189,080.47 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 3,306,507.34 | 5,936,925.41 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 551,084.56 | 989,487.56 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 5,587,175.13 | 18,133,077.96 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 0.05 | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 117,720.25 | 129,589.54 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 47,685,633.43 | 218,838,968.01 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 47,685,633.43 | 218,838,968.01 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|---------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 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) | 370,924,494.22 | 187,107,916.16 | 558,032,410.38 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 47,685,633.43 | 47,685,633.43 |
| 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) | -102,658,442.87 | -59,020,794.85 | -161,679,237.72 |
| 其中：1.基金申购款 | 13,996,740.48 | 7,446,299.33 | 21,443,039.81 |
| 2.基金赎回款 | -116,655,183.35 | -66,467,094.18 | -183,122,277.53 |
| 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) | 268,266,051.35 | 175,772,754.74 | 444,038,806.09 |
| 项目 | 上年度可比期间 2020年1月1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) | 964,744,269.24 | -102,041,918.26 | 862,702,350.98 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 218,838,968.01 | 218,838,968.01 |
| 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) | -329,716,893.57 | -8,730,495.58 | -338,447,389.15 |
| 其中：1.基金申购款 | 20,221,271.00 | 188,766.33 | 20,410,037.33 |
| 2.基金赎回款 | -349,938,164.57 | -8,919,261.91 | -358,857,426.48 |
| 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) | 635,027,375.67 | 108,066,554.17 | 743,093,929.84 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.3 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|----------|-----------|---------|
| 王小刚 | 程蕾 | 程蕾 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华商健康生活灵活配置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[2015]第 287 号《关于准予华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册,由华商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《华商健康生活灵活配置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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,982,493,903.09 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(2015)第 196 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 3 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,982,602,746.36 份基金份额,其中认购资金利息折合 108,843.27 份基金份额。本基金的基金管理人为华商基金管理有限公司,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《华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括中小企业私募债券)、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货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的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金股票资产的投资比例为 0-95%,其中投资于健康生活相关上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%,债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-100%,其中权证占基金资产净值的 0-3%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金参与股指期货交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

6.4.2 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》、《华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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[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]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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起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。

(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。

(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。

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 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 45,217,139.35 |
| 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： | 45,217,139.35 |

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 30 日 | | |
|-------------------|------------------------|----------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 328,115,699.15 | 407,574,828.64 | 79,459,129.49 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 328,115,699.15 | 407,574,828.64 | 79,459,129.49 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 3,913.69 |
| 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 | 1,202.70 |
| 应收债券利息 | - |
| 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 | 0.04 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 146.90 |
| 合计 | 5,263.33 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,671,540.23 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 1,671,540.23 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 679.86 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 103,678.95 |
| 合计 | 104,358.81 |

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 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 370,924,494.22 | 370,924,494.22 |
| 本期申购 | 13,996,740.48 | 13,996,740.48 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -116,655,183.35 | -116,655,183.35 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 268,266,051.35 | 268,266,051.35 |

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 | 189,801,714.51 | -2,693,798.35 | 187,107,916.16 |
| 本期利润 | 55,271,144.36 | -7,585,510.93 | 47,685,633.43 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -61,457,455.21 | 2,436,660.36 | -59,020,794.85 |
| 其中：基金申购款 | 8,527,578.96 | -1,081,279.63 | 7,446,299.33 |
| 基金赎回款 | -69,985,034.17 | 3,517,939.99 | -66,467,094.18 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 183,615,403.66 | -7,842,648.92 | 175,772,754.74 |

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30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 78,799.67 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 20.77 |
| 结算备付金利息收入 | 21,691.61 |
| 其他 | 3,492.94 |
| 合计 | 104,004.99 |

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30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,889,948,335.45 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,825,970,911.47 |
| 买卖股票差价收入 | 63,977,423.98 |

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 30,241.07 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |

| | |
|----------------|-----------|
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 30,241.07 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 179,273.40 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 149,000.00 |
| 减：应收利息总额 | 32.33 |
| 买卖债券差价收入 | 30,241.07 |

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内未发生贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未发生衍生工具收益。

6.4.7.16 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30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 646,888.41 |
| 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 | 646,888.41 |

6.4.7.17 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30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -7,585,510.93 |

| | |
|----------------------------|---------------|
| ——股票投资 | -7,545,012.73 |
| ——债券投资 | -40,498.20 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税 | - |
| 合计 | -7,585,510.93 |

6.4.7.18 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30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 75,060.58 |
| 合计 | 75,060.58 |

注：1. 基金赎回费收入含转换费收入。

2. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

3. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 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30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 5,587,175.13 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 交易基金产生的费用 | - |
| 其中：申购费 | - |
| 赎回费 | - |
| 合计 | 5,587,175.13 |

6.4.7.20 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 30 日 |
|---------|---------------------------------|
| 审计费用 | 39,671.58 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 4,500.00 |
| 银行费用 | 14,041.30 |
| 其他 | - |
| 合计 | 117,720.25 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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 |
|------------------------|---------------------|
| 华商基金管理有限公司（“华商基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 华龙证券股份有限公司（“华龙证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 2020年1月1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 |
| 华龙证券 | 350,955,367.63 | 9.73% | 1,235,337,410.25 | 10.49% |

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021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 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 华龙证券 | 326,844.13 | 9.73% | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2020年1月1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 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 华龙证券 | 1,150,471.41 | 10.49% | 828,360.17 | 16.64% |

注：1. 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的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券交易不计佣金。

2. 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,306,507.34 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,662,158.26 | 2,610,813.11 |

注：支付基金管理人华商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 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30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 551,084.56 | 989,487.56 |

注：支付基金托管人中国建设银行的基金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：日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金的情况。

6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日 | 上年度可比期间 2020年1月1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 |
|--------|---------------|-----------|---------------|------------|
| 中国建设银行 | 45,217,139.35 | 78,799.67 | 89,085,972.72 | 311,351.51 |

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券的买卖。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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 |
|--------|------|-------------|-------------|--------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 300926 | 博俊科技 | 2020年12月29日 | 2021年7月12日 | 新股锁定 | 10.76 | 22.20 | 359 | 3,862.84 | 7,969.80 | - |
| 300927 | 江天化学 | 2020年12月29日 | 2021年7月7日 | 新股锁定 | 13.39 | 30.10 | 217 | 2,905.63 | 6,531.70 | - |
| 300929 | 华骐环保 | 2021年1月12日 | 2021年7月21日 | 新股锁定 | 13.87 | 29.55 | 183 | 2,538.21 | 5,407.65 | - |
| 300932 | 三友联众 | 2021年1月15日 | 2021年7月22日 | 新股锁定 | 24.69 | 31.71 | 492 | 12,147.48 | 15,601.32 | - |
| 300933 | 中辰股份 | 2021年1月15日 | 2021年7月22日 | 新股锁定 | 3.37 | 10.44 | 1,112 | 3,747.44 | 11,609.28 | - |
| 300937 | 药易购 | 2021年1月20日 | 2021年7月27日 | 新股锁定 | 12.25 | 53.71 | 244 | 2,989.00 | 13,105.24 | - |
| 300940 | 南极光 | 2021年1月27日 | 2021年8月3日 | 新股锁定 | 12.76 | 43.38 | 307 | 3,917.32 | 13,317.66 | - |
| 300941 | 创识科技 | 2021年2月2日 | 2021年8月9日 | 新股锁定 | 21.31 | 49.94 | 399 | 8,502.69 | 19,926.06 | - |
| 300945 | 曼卡龙 | 2021年2月3日 | 2021年8月10日 | 新股锁定 | 4.56 | 18.88 | 474 | 2,161.44 | 8,949.12 | - |
| 300948 | 冠中生态 | 2021年2月18日 | 2021年8月25日 | 新股锁定 | 8.67 | 27.42 | 324 | 2,808.00 | 8,884.08 | - |
| 300950 | 德固特 | 2021年2月24日 | 2021年9月3日 | 新股锁定 | 8.41 | 39.13 | 219 | 1,841.79 | 8,569.47 | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021年3月3日 | 2021年9月13日 | 新股锁定 | 11.72 | 27.08 | 340 | 3,984.80 | 9,207.20 | - |
| 300953 | 震裕科技 | 2021年3月11日 | 2021年9月22日 | 新股锁定 | 28.77 | 99.85 | 240 | 6,904.80 | 23,964.00 | - |
| 300956 | 英力股份 | 2021年3月16日 | 2021年9月27日 | 新股锁定 | 12.85 | 25.80 | 371 | 4,767.35 | 9,571.80 | - |
| 300957 | 贝泰妮 | 2021年3月18日 | 2021年9月27日 | 新股锁定 | 47.33 | 251.96 | 233 | 11,027.89 | 58,706.68 | - |
| 300958 | 建工修复 | 2021年3月18日 | 2021年9月29日 | 新股锁定 | 8.53 | 27.22 | 300 | 2,559.00 | 8,166.00 | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021年3月29日 | 2021年10月11日 | 新股锁定 | 3.40 | 16.37 | 576 | 1,958.40 | 9,429.12 | - |
| 300963 | 中洲特材 | 2021年3月30日 | 2021年10月11日 | 新股锁定 | 12.13 | 22.49 | 283 | 3,432.79 | 6,364.67 | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021年4月2日 | 2021年10月13日 | 新股锁定 | 4.54 | 11.54 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78 | - |
| 300968 | 格林精密 | 2021年4月6日 | 2021年10月15日 | 新股锁定 | 6.87 | 12.07 | 1,162 | 7,982.94 | 14,025.34 | - |
| 300971 | 博亚精工 | 2021年4月7日 | 2021年10月15日 | 新股锁定 | 18.24 | 28.29 | 245 | 4,468.80 | 6,931.05 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|--------|--------|--------|-------|------------|------------|---|
| 300972 | 万辰生物 | 2021年4月8日 | 2021年10月19日 | 新股锁定 | 7.19 | 12.65 | 430 | 3,091.70 | 5,439.50 | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021年4月15日 | 2021年10月26日 | 新股锁定 | 8.42 | 13.60 | 593 | 4,993.06 | 8,064.80 | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021年4月15日 | 2021年10月26日 | 新股锁定 | 33.22 | 87.50 | 416 | 13,819.52 | 36,400.00 | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 新股锁定 | 48.59 | 90.39 | 245 | 11,904.55 | 22,145.55 | - |
| 300982 | 苏文电能 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 新股锁定 | 15.83 | 45.29 | 317 | 5,018.11 | 14,356.93 | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021年4月21日 | 2021年10月29日 | 新股锁定 | 24.90 | 24.81 | 295 | 7,345.50 | 7,318.95 | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021年4月21日 | 2021年11月1日 | 新股锁定 | 14.79 | 30.57 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48 | - |
| 300987 | 川网传媒 | 2021年4月28日 | 2021年11月11日 | 新股锁定 | 6.79 | 26.81 | 301 | 2,043.79 | 8,069.81 | - |
| 300992 | 泰福泵业 | 2021年5月17日 | 2021年11月25日 | 新股锁定 | 9.36 | 20.32 | 200 | 1,872.00 | 4,064.00 | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021年5月17日 | 2021年11月26日 | 新股锁定 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12 | - |
| 300997 | 欢乐家 | 2021年5月26日 | 2021年12月2日 | 新股锁定 | 4.94 | 13.05 | 928 | 4,584.32 | 12,110.40 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021年5月25日 | 2021年12月2日 | 新股锁定 | 6.02 | 21.32 | 201 | 1,210.02 | 4,285.32 | - |
| 301002 | 崧盛股份 | 2021年5月27日 | 2021年12月7日 | 新股锁定 | 18.71 | 57.62 | 201 | 3,760.71 | 11,581.62 | - |
| 301007 | 德迈仕 | 2021年6月4日 | 2021年12月16日 | 新股锁定 | 5.29 | 14.44 | 303 | 1,602.87 | 4,375.32 | - |
| 301009 | 可靠股份 | 2021年6月8日 | 2021年12月17日 | 新股锁定 | 12.54 | 27.89 | 801 | 10,044.54 | 22,339.89 | - |
| 301010 | 晶雪节能 | 2021年6月9日 | 2021年12月20日 | 新股锁定 | 7.83 | 17.61 | 218 | 1,706.94 | 3,838.98 | - |
| 301011 | 华立科技 | 2021年6月9日 | 2021年12月17日 | 新股锁定 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021年6月15日 | 2021年12月22日 | 新股锁定 | 8.05 | 24.26 | 170 | 1,368.50 | 4,124.20 | - |
| 301013 | 利和兴 | 2021年6月21日 | 2021年12月29日 | 新股锁定 | 8.72 | 27.11 | 471 | 4,107.12 | 12,768.81 | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021年6月22日 | 2021年12月30日 | 新股锁定 | 7.64 | 38.83 | 462 | 3,529.68 | 17,939.46 | - |
| 301016 | 雷尔伟 | 2021年6月23日 | 2021年12月30日 | 新股锁定 | 13.75 | 32.98 | 275 | 3,781.25 | 9,069.50 | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021年6月23日 | 2022年1月5日 | 新股锁定 | 8.86 | 8.86 | 555 | 4,917.30 | 4,917.30 | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021年6月23日 | 2021年7月5日 | 新股流通受限 | 8.86 | 8.86 | 4,995 | 44,255.70 | 44,255.70 | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021年6月28日 | 2022年1月7日 | 新股锁定 | 8.29 | 8.29 | 782 | 6,482.78 | 6,482.78 | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021年6月28日 | 2021年7月7日 | 新股流通受限 | 8.29 | 8.29 | 7,029 | 58,270.41 | 58,270.41 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021年6月28日 | 2022年1月6日 | 新股锁定 | 9.46 | 9.46 | 290 | 2,743.40 | 2,743.40 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日 | 新股流通受限 | 9.46 | 9.46 | 2,609 | 24,681.14 | 24,681.14 | - |
| 605162 | 新中港 | 2021年6月29日 | 2021年7月7日 | 新股流通受限 | 6.07 | 6.07 | 1,377 | 8,358.39 | 8,358.39 | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日 | 新股流通受限 | 31.56 | 31.56 | 349 | 11,014.44 | 11,014.44 | - |
| 688076 | 诺泰生物 | 2021年5月12日 | 2021年11月22日 | 新股锁定 | 15.57 | 48.55 | 4,984 | 77,600.88 | 241,973.20 | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021年6月30日 | 2021年7月9日 | 新股流通受限 | 21.96 | 21.96 | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24 | - |
| 688161 | 威高骨科 | 2021年6月23日 | 2021年12月30日 | 新股锁定 | 36.22 | 82.27 | 2,334 | 84,537.48 | 192,018.18 | - |
| 688195 | 腾景科技 | 2021年3月18日 | 2021年9月27日 | 新股锁定 | 13.60 | 19.87 | 2,693 | 36,624.80 | 53,509.91 | - |
| 688201 | 信安世纪 | 2021年4月13日 | 2021年10月21日 | 新股锁定 | 26.78 | 45.41 | 2,129 | 57,014.62 | 96,677.89 | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021年6月28日 | 2021年7月7日 | 新股流通受限 | 6.42 | 6.42 | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06 | - |
| 688239 | 航宇科技 | 2021年6月25日 | 2021年7月5日 | 新股流通受限 | 11.48 | 11.48 | 4,926 | 56,550.48 | 56,550.48 | - |
| 688499 | 利元亨 | 2021年6月23日 | 2021年7月1日 | 新股流通受限 | 38.85 | 38.85 | 2,149 | 83,488.65 | 83,488.65 | - |
| 688565 | 力源科技 | 2021年5月6日 | 2021年11月15日 | 新股锁定 | 9.39 | 14.00 | 2,464 | 23,136.96 | 34,496.00 | - |
| 688613 | 奥精医疗 | 2021年5月13日 | 2021年11月22日 | 新股锁定 | 16.43 | 63.50 | 2,617 | 42,997.31 | 166,179.50 | - |
| 688636 | 智明达 | 2021年3月30日 | 2021年10月8日 | 新股锁定 | 34.50 | 80.72 | 918 | 31,671.00 | 74,100.96 | - |
| 688696 | 极米科技 | 2021年2月23日 | 2021年9月3日 | 新股锁定 | 133.73 | 780.24 | 1,002 | 133,997.46 | 781,800.48 | - |

注：1. 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。

2. 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。

3. 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。

4. 本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

5. 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.4 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证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险，中高收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是积极投资于与健康生活相关的优质上市公司，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的

长期稳定增值。

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括三个层次：(1)第一层次风险控制：在董事会层面设立风险控制委员会,对公司规章制度、经营管理、基金运作、固有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查,对各种风险预测报告进行审议,提出相应的意见和建议。公司设督察长。督察长对董事会负责,按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。(2)第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层层面的风险控制,具体为在风险管理小组、投资决策委员会、监察稽核部和风险控制部层次对公司的风险进行的预防和控制。风险管理小组对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的分析、评估,全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略,对基金的总体投资情况提出指导性意见,从而达到分散投资风险,提高基金资产的安全性的目的。监察稽核部和风险控制部独立于公司各业务部门和各分支机构,对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。(3)第三层次风险控制：第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施,相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行,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 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2020 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债券占基金资产净值的比例为 0.03%)。

6.4.13.3 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 6 月 30 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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12。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 6 月 30 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为 0.59%。

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 6 月 30 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|---------------|-------|-------|-----|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 45,217,139.35 | - | - | - | 45,217,139.35 |
| 结算备付金 | 2,672,733.18 | - | - | - | 2,672,733.18 |

| | | | | | |
|--------------------------|---------------|-------|------------|----------------|----------------|
| 存出保证金 | 326,472.99 | - | - | - | 326,472.99 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 407,574,828.64 | 407,574,828.64 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 2,706,906.33 | 2,706,906.33 |
| 应收利息 | - | - | - | 5,263.33 | 5,263.33 |
| 应收申购款 | - | - | - | 33,331.33 | 33,331.33 |
| 资产总计 | 48,216,345.52 | - | - | 410,320,329.63 | 458,536,675.15 |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 9,536,959.90 | 9,536,959.90 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,579,127.74 | 2,579,127.74 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 519,327.77 | 519,327.77 |
| 应付托管费 | - | - | - | 86,554.61 | 86,554.61 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,671,540.23 | 1,671,540.23 |
| 其他负债 | - | - | - | 104,358.81 | 104,358.81 |
| 负债总计 | - | - | - | 14,497,869.06 | 14,497,869.06 |
| 利率敏感度缺口 | 48,216,345.52 | - | - | 395,822,460.57 | 444,038,806.09 |
| 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 | 52,425,316.85 | - | - | - | 52,425,316.85 |
| 结算备付金 | 3,388,070.70 | - | - | - | 3,388,070.70 |
| 存出保证金 | 637,944.91 | - | - | - | 637,944.91 |
| 交易性金融资产 | - | - | 189,498.20 | 518,843,788.70 | 519,033,286.90 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 8,603,610.52 | 8,603,610.52 |
| 应收利息 | - | - | - | 7,391.95 | 7,391.95 |
| 应收申购款 | - | - | - | 65,608.84 | 65,608.84 |
| 资产总计 | 56,451,332.46 | - | 189,498.20 | 527,520,400.01 | 584,161,230.67 |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 14,651,040.83 | 14,651,040.83 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 8,410,200.11 | 8,410,200.11 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 692,952.13 | 692,952.13 |
| 应付托管费 | - | - | - | 115,492.02 | 115,492.02 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 2,057,888.59 | 2,057,888.59 |
| 应交税费 | - | - | - | 0.35 | 0.35 |
| 其他负债 | - | - | - | 201,246.26 | 201,246.26 |
| 负债总计 | - | - | - | 26,128,820.29 | 26,128,820.29 |
| 利率敏感度缺口 | 56,451,332.46 | - | 189,498.20 | 501,391,579.72 | 558,032,410.38 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2020 年 12 月 31 日：0.03%），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：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

本基金在资产配置中采用“自上而下”的策略，由基金经理和研究员组成的投研团队及时跟踪宏观经济运行态势和宏观经济政策动向，通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况、证券市场估值水平等的深入研究，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并适时动态地调整基金资产在股票、债券、现金三大类资产的投资比例，以规避市场系统性风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产的投资比例为 0-95%，其中投资于健康生活相关上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%，债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%—100%，其中权证占基金资产净值的 0—3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 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 | 407,574,828.64 | 91.79 | 518,843,788.70 | 92.98 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | - | - | - | - |
| 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 | 407,574,828.64 | 91.79 | 518,843,788.70 | 92.98 |

6.4.13.4.3.2 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 (2021 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2020 年 12 月 31 日) |
| | 1. 沪深 300 指数上升 5% | 31,576,114.01 | 29,371,268.36 |
| 2. 沪深 300 指数下降 5% | -31,576,114.01 | -29,371,268.36 | |

6.4.14 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 6 月 30 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 405,062,973.87 元，属于第二层次的余额为 2,511,854.77 元，无属于第三层次的余额 (2020 年 12 月 31 日：第一层次 513,921,186.06 元，属于第二层次的余额为 5,112,100.84 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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 | 407,574,828.64 | 88.89 |
| | 其中：股票 | 407,574,828.64 | 88.89 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 47,889,872.53 | 10.44 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,071,973.98 | 0.67 |
| 9 | 合计 | 458,536,675.15 | 100.00 |

7.2 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

金额单位：人民币元

| 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 | 44,382.10 | 0.01 |
| B | 采矿业 | 87,263.74 | 0.02 |
| C | 制造业 | 351,406,478.45 | 79.14 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,326.79 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 50,509.38 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | 159,054.72 | 0.04 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 31,461.39 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | 45,334.00 | 0.01 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 352,502.80 | 0.08 |
| J | 金融业 | 40,782.66 | 0.01 |
| K | 房地产业 | 10,095.90 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 17,363,904.36 | 3.91 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 22,996,147.02 | 5.18 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 129,516.60 | 0.03 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 16,262.03 | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | 14,795,375.30 | 3.33 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 29,431.40 | 0.01 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 407,574,828.64 | 91.79 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 81,100 | 43,372,280.00 | 9.77 |
| 2 | 603799 | 华友钴业 | 233,591 | 26,676,092.20 | 6.01 |
| 3 | 300450 | 先导智能 | 387,145 | 23,282,900.30 | 5.24 |
| 4 | 603259 | 药明康德 | 146,640 | 22,962,357.60 | 5.17 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 77,051 | 22,952,722.39 | 5.17 |
| 6 | 601012 | 隆基股份 | 247,897 | 22,023,169.48 | 4.96 |
| 7 | 002812 | 恩捷股份 | 76,800 | 17,978,880.00 | 4.05 |
| 8 | 601888 | 中国中免 | 57,800 | 17,345,780.00 | 3.91 |
| 9 | 002129 | 中环股份 | 445,200 | 17,184,720.00 | 3.87 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 10 | 002594 | 比亚迪 | 67,901 | 17,043,151.00 | 3.84 |
| 11 | 300347 | 泰格医药 | 76,541 | 14,795,375.30 | 3.33 |
| 12 | 300274 | 阳光电源 | 123,900 | 14,255,934.00 | 3.21 |
| 13 | 603501 | 韦尔股份 | 43,400 | 13,974,800.00 | 3.15 |
| 14 | 603659 | 璞泰来 | 100,700 | 13,755,620.00 | 3.10 |
| 15 | 300568 | 星源材质 | 325,555 | 13,468,210.35 | 3.03 |
| 16 | 600809 | 山西汾酒 | 28,700 | 12,857,600.00 | 2.90 |
| 17 | 300014 | 亿纬锂能 | 117,100 | 12,170,203.00 | 2.74 |
| 18 | 300122 | 智飞生物 | 60,400 | 11,278,492.00 | 2.54 |
| 19 | 688116 | 天奈科技 | 81,274 | 9,590,332.00 | 2.16 |
| 20 | 002821 | 凯莱英 | 23,000 | 8,569,800.00 | 1.93 |
| 21 | 300782 | 卓胜微 | 13,692 | 7,359,450.00 | 1.66 |
| 22 | 300896 | 爱美客 | 8,883 | 7,007,621.04 | 1.58 |
| 23 | 002459 | 晶澳科技 | 141,781 | 6,947,269.00 | 1.56 |
| 24 | 688598 | 金博股份 | 25,188 | 6,775,572.00 | 1.53 |
| 25 | 600438 | 通威股份 | 123,403 | 5,339,647.81 | 1.20 |
| 26 | 603986 | 兆易创新 | 24,000 | 4,509,600.00 | 1.02 |
| 27 | 600519 | 贵州茅台 | 2,170 | 4,463,039.00 | 1.01 |
| 28 | 002156 | 通富微电 | 178,000 | 4,279,120.00 | 0.96 |
| 29 | 688696 | 极米科技 | 1,002 | 781,800.48 | 0.18 |
| 30 | 688063 | 派能科技 | 3,479 | 684,667.20 | 0.15 |
| 31 | 688076 | 诺泰生物 | 4,984 | 241,973.20 | 0.05 |
| 32 | 688161 | 威高骨科 | 2,334 | 192,018.18 | 0.04 |
| 33 | 688613 | 奥精医疗 | 2,617 | 166,179.50 | 0.04 |
| 34 | 688555 | 泽达易盛 | 3,004 | 103,157.36 | 0.02 |
| 35 | 688201 | 信安世纪 | 2,129 | 96,677.89 | 0.02 |
| 36 | 688129 | 东来技术 | 5,033 | 94,368.75 | 0.02 |
| 37 | 688560 | 明冠新材 | 3,832 | 92,351.20 | 0.02 |
| 38 | 300985 | 致远新能 | 2,945 | 83,877.45 | 0.02 |
| 39 | 688499 | 利元亨 | 2,149 | 83,488.65 | 0.02 |
| 40 | 300957 | 贝泰妮 | 324 | 83,430.47 | 0.02 |
| 41 | 688117 | 圣诺生物 | 1,672 | 80,924.80 | 0.02 |
| 42 | 688359 | 三孚新科 | 2,213 | 78,561.50 | 0.02 |
| 43 | 688577 | 浙海德曼 | 1,503 | 77,675.04 | 0.02 |
| 44 | 688590 | 新致软件 | 4,171 | 77,163.50 | 0.02 |
| 45 | 001203 | 大中矿业 | 3,809 | 76,751.35 | 0.02 |
| 46 | 688636 | 智明达 | 918 | 74,100.96 | 0.02 |
| 47 | 300861 | 美畅股份 | 806 | 67,953.86 | 0.02 |
| 48 | 301018 | 申菱环境 | 7,811 | 64,753.19 | 0.01 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 49 | 688655 | 迅捷兴 | 3,083 | 62,893.20 | 0.01 |
| 50 | 688239 | 航宇科技 | 4,926 | 56,550.48 | 0.01 |
| 51 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24 | 0.01 |
| 52 | 688195 | 腾景科技 | 2,693 | 53,509.91 | 0.01 |
| 53 | 600916 | 中国黄金 | 3,371 | 52,317.92 | 0.01 |
| 54 | 688585 | 上纬新材 | 4,922 | 52,173.20 | 0.01 |
| 55 | 688215 | 瑞晟智能 | 1,229 | 51,445.94 | 0.01 |
| 56 | 301017 | 漱玉平民 | 5,550 | 49,173.00 | 0.01 |
| 57 | 688156 | 路德环境 | 2,602 | 47,928.84 | 0.01 |
| 58 | 688618 | 三旺通信 | 1,117 | 47,718.24 | 0.01 |
| 59 | 605337 | 李子园 | 788 | 46,886.00 | 0.01 |
| 60 | 600258 | 首旅酒店 | 1,900 | 45,334.00 | 0.01 |
| 61 | 300979 | 华利集团 | 460 | 41,411.60 | 0.01 |
| 62 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.01 |
| 63 | 688565 | 力源科技 | 2,464 | 34,496.00 | 0.01 |
| 64 | 300887 | 谱尼测试 | 378 | 33,789.42 | 0.01 |
| 65 | 300981 | 中红医疗 | 344 | 33,318.69 | 0.01 |
| 66 | 300872 | 天阳科技 | 871 | 31,617.30 | 0.01 |
| 67 | 300953 | 震裕科技 | 294 | 29,847.30 | 0.01 |
| 68 | 300860 | 锋尚文化 | 505 | 29,431.40 | 0.01 |
| 69 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.01 |
| 70 | 001201 | 东瑞股份 | 668 | 27,347.92 | 0.01 |
| 71 | 605080 | 浙江自然 | 374 | 23,487.20 | 0.01 |
| 72 | 001207 | 联科科技 | 682 | 22,581.02 | 0.01 |
| 73 | 301009 | 可靠股份 | 807 | 22,541.97 | 0.01 |
| 74 | 300877 | 金春股份 | 569 | 20,922.13 | 0.00 |
| 75 | 601279 | 英利汽车 | 2,004 | 20,901.72 | 0.00 |
| 76 | 301015 | 百洋医药 | 514 | 20,859.78 | 0.00 |
| 77 | 300884 | 狄耐克 | 749 | 20,133.12 | 0.00 |
| 78 | 300941 | 创识科技 | 399 | 19,926.06 | 0.00 |
| 79 | 605305 | 中际联合 | 368 | 19,364.16 | 0.00 |
| 80 | 001205 | 盛航股份 | 577 | 18,850.59 | 0.00 |
| 81 | 300878 | 维康药业 | 401 | 18,714.67 | 0.00 |
| 82 | 300868 | 杰美特 | 593 | 18,151.73 | 0.00 |
| 83 | 300864 | 南大环境 | 315 | 17,328.15 | 0.00 |
| 84 | 300982 | 苏文电能 | 370 | 17,322.28 | 0.00 |
| 85 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 86 | 300909 | 汇创达 | 386 | 16,636.60 | 0.00 |
| 87 | 300913 | 兆龙互连 | 630 | 16,506.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 88 | 605098 | 行动教育 | 289 | 16,262.03 | 0.00 |
| 89 | 605196 | 华通线缆 | 1,172 | 16,079.84 | 0.00 |
| 90 | 603836 | 海程邦达 | 733 | 15,994.06 | 0.00 |
| 91 | 000568 | 泸州老窖 | 67 | 15,807.98 | 0.00 |
| 92 | 300925 | 法本信息 | 600 | 15,774.00 | 0.00 |
| 93 | 300890 | 翔丰华 | 286 | 15,615.60 | 0.00 |
| 94 | 300932 | 三友联众 | 492 | 15,601.32 | 0.00 |
| 95 | 300968 | 格林精密 | 1,220 | 14,941.74 | 0.00 |
| 96 | 605180 | 华生科技 | 384 | 14,208.00 | 0.00 |
| 97 | 301013 | 利和兴 | 504 | 13,986.51 | 0.00 |
| 98 | 605060 | 联德股份 | 883 | 13,933.74 | 0.00 |
| 99 | 300907 | 康平科技 | 473 | 13,915.66 | 0.00 |
| 100 | 605319 | 无锡振华 | 764 | 13,706.16 | 0.00 |
| 101 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 102 | 605133 | 嵘泰股份 | 618 | 13,398.24 | 0.00 |
| 103 | 300940 | 南极光 | 307 | 13,317.66 | 0.00 |
| 104 | 300937 | 药易购 | 244 | 13,105.24 | 0.00 |
| 105 | 300997 | 欢乐家 | 979 | 13,067.16 | 0.00 |
| 106 | 300892 | 品渥食品 | 272 | 12,479.36 | 0.00 |
| 107 | 301016 | 雷尔伟 | 347 | 12,175.58 | 0.00 |
| 108 | 300889 | 爱克股份 | 479 | 11,639.70 | 0.00 |
| 109 | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 110 | 301002 | 崧盛股份 | 201 | 11,581.62 | 0.00 |
| 111 | 300962 | 中金辐照 | 657 | 11,373.12 | 0.00 |
| 112 | 300950 | 德固特 | 286 | 11,320.49 | 0.00 |
| 113 | 605303 | 园林股份 | 610 | 11,242.30 | 0.00 |
| 114 | 300945 | 曼卡龙 | 584 | 11,119.42 | 0.00 |
| 115 | 605488 | 福莱新材 | 416 | 11,103.04 | 0.00 |
| 116 | 300918 | 南山智尚 | 1,063 | 11,065.83 | 0.00 |
| 117 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 118 | 605289 | 罗曼股份 | 379 | 10,930.36 | 0.00 |
| 119 | 300958 | 建工修复 | 393 | 10,879.74 | 0.00 |
| 120 | 300952 | 恒辉安防 | 398 | 10,840.48 | 0.00 |
| 121 | 300986 | 志特新材 | 332 | 10,808.84 | 0.00 |
| 122 | 300956 | 英力股份 | 407 | 10,548.12 | 0.00 |
| 123 | 605259 | 绿田机械 | 295 | 10,516.75 | 0.00 |
| 124 | 605086 | 龙高股份 | 443 | 10,512.39 | 0.00 |
| 125 | 003038 | 鑫铂股份 | 383 | 10,463.56 | 0.00 |
| 126 | 605189 | 富春染织 | 422 | 10,165.98 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 127 | 300917 | 特发服务 | 365 | 10,095.90 | 0.00 |
| 128 | 300882 | 万胜智能 | 572 | 9,981.40 | 0.00 |
| 129 | 003041 | 真爱美家 | 349 | 9,876.70 | 0.00 |
| 130 | 301011 | 华立科技 | 250 | 9,424.50 | 0.00 |
| 131 | 600600 | 青岛啤酒 | 80 | 9,252.00 | 0.00 |
| 132 | 300963 | 中洲特材 | 373 | 9,154.67 | 0.00 |
| 133 | 001202 | 炬申股份 | 459 | 9,014.76 | 0.00 |
| 134 | 300881 | 盛德鑫泰 | 291 | 8,959.89 | 0.00 |
| 135 | 300948 | 冠中生态 | 324 | 8,884.08 | 0.00 |
| 136 | 300978 | 东箭科技 | 630 | 8,741.53 | 0.00 |
| 137 | 605162 | 新中港 | 1,377 | 8,358.39 | 0.00 |
| 138 | 300987 | 川网传媒 | 304 | 8,186.69 | 0.00 |
| 139 | 605499 | 东鹏饮料 | 32 | 8,025.60 | 0.00 |
| 140 | 300926 | 博俊科技 | 359 | 7,969.80 | 0.00 |
| 141 | 605298 | 必得科技 | 391 | 7,847.37 | 0.00 |
| 142 | 300363 | 博腾股份 | 88 | 7,402.56 | 0.00 |
| 143 | 300971 | 博亚精工 | 245 | 6,931.05 | 0.00 |
| 144 | 300992 | 泰福泵业 | 298 | 6,885.42 | 0.00 |
| 145 | 300967 | 晓鸣股份 | 561 | 6,749.88 | 0.00 |
| 146 | 300972 | 万辰生物 | 500 | 6,635.10 | 0.00 |
| 147 | 300927 | 江天化学 | 217 | 6,531.70 | 0.00 |
| 148 | 605089 | 味知香 | 70 | 6,091.40 | 0.00 |
| 149 | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 150 | 301010 | 晶雪节能 | 272 | 5,127.96 | 0.00 |
| 151 | 603267 | 鸿远电子 | 40 | 5,116.80 | 0.00 |
| 152 | 300995 | 奇德新材 | 209 | 5,008.52 | 0.00 |
| 153 | 301012 | 扬电科技 | 191 | 4,854.16 | 0.00 |
| 154 | 301007 | 德迈仕 | 322 | 4,766.15 | 0.00 |
| 155 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 156 | 300998 | 宁波方正 | 203 | 4,347.24 | 0.00 |
| 157 | 002466 | 天齐锂业 | 70 | 4,341.40 | 0.00 |
| 158 | 002714 | 牧原股份 | 60 | 3,649.20 | 0.00 |
| 159 | 300873 | 海晨股份 | 84 | 3,596.04 | 0.00 |
| 160 | 300850 | 新强联 | 40 | 3,507.60 | 0.00 |
| 161 | 605117 | 德业股份 | 27 | 3,445.20 | 0.00 |
| 162 | 605378 | 野马电池 | 73 | 3,353.62 | 0.00 |
| 163 | 605389 | 长龄液压 | 56 | 3,286.08 | 0.00 |
| 164 | 601995 | 中金公司 | 51 | 3,136.50 | 0.00 |
| 165 | 300867 | 圣元环保 | 98 | 2,970.38 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 166 | 605090 | 九丰能源 | 90 | 2,916.90 | 0.00 |
| 167 | 605339 | 南侨食品 | 63 | 2,720.34 | 0.00 |
| 168 | 300893 | 松原股份 | 114 | 2,544.48 | 0.00 |
| 169 | 601156 | 东航物流 | 90 | 2,130.30 | 0.00 |
| 170 | 605300 | 佳禾食品 | 76 | 2,112.80 | 0.00 |
| 171 | 605286 | 同力日升 | 97 | 1,983.65 | 0.00 |
| 172 | 300999 | 金龙鱼 | 23 | 1,954.08 | 0.00 |
| 173 | 603511 | 爱慕股份 | 53 | 1,749.00 | 0.00 |
| 174 | 600906 | 财达证券 | 97 | 1,637.36 | 0.00 |
| 175 | 603588 | 高能环境 | 112 | 1,621.76 | 0.00 |
| 176 | 605016 | 百龙创园 | 45 | 1,438.20 | 0.00 |
| 177 | 001206 | 依依股份 | 21 | 1,333.92 | 0.00 |
| 178 | 603324 | 盛剑环境 | 32 | 1,164.16 | 0.00 |
| 179 | 603529 | 爱玛科技 | 19 | 1,104.28 | 0.00 |
| 180 | 601009 | 南京银行 | 95 | 999.40 | 0.00 |
| 181 | 300891 | 惠云钛业 | 43 | 747.77 | 0.00 |
| 182 | 300911 | 亿田智能 | 9 | 623.52 | 0.00 |
| 183 | 605268 | 王力安防 | 42 | 579.60 | 0.00 |
| 184 | 003042 | 中农联合 | 20 | 563.80 | 0.00 |
| 185 | 603759 | 海天股份 | 19 | 389.50 | 0.00 |
| 186 | 601665 | 齐鲁银行 | 31 | 288.30 | 0.00 |
| 187 | 600176 | 中国巨石 | 16 | 248.16 | 0.00 |
| 188 | 003040 | 楚天龙 | 1 | 30.40 | 0.00 |
| 189 | 605208 | 永茂泰 | 1 | 21.83 | 0.00 |

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 | 000799 | 酒鬼酒 | 59,430,508.16 | 10.65 |
| 2 | 601012 | 隆基股份 | 58,512,230.30 | 10.49 |
| 3 | 300122 | 智飞生物 | 52,240,892.00 | 9.36 |
| 4 | 002466 | 天齐锂业 | 46,010,041.40 | 8.25 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 45,773,177.01 | 8.20 |
| 6 | 600809 | 山西汾酒 | 44,652,142.20 | 8.00 |
| 7 | 000661 | 长春高新 | 42,974,659.46 | 7.70 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 41,862,978.98 | 7.50 |
| 9 | 000858 | 五粮液 | 41,650,773.28 | 7.46 |
| 10 | 300014 | 亿纬锂能 | 40,008,872.76 | 7.17 |
| 11 | 300450 | 先导智能 | 39,265,606.44 | 7.04 |
| 12 | 603259 | 药明康德 | 37,906,859.25 | 6.79 |
| 13 | 603185 | 上机数控 | 36,322,327.00 | 6.51 |
| 14 | 002129 | 中环股份 | 33,577,849.66 | 6.02 |
| 15 | 300274 | 阳光电源 | 32,966,521.85 | 5.91 |
| 16 | 300896 | 爱美客 | 32,909,620.62 | 5.90 |
| 17 | 601888 | 中国中免 | 32,783,195.52 | 5.87 |
| 18 | 603659 | 璞泰来 | 31,535,220.96 | 5.65 |
| 19 | 300347 | 泰格医药 | 30,680,700.00 | 5.50 |
| 20 | 002594 | 比亚迪 | 30,606,542.44 | 5.48 |
| 21 | 603501 | 韦尔股份 | 28,737,902.00 | 5.15 |
| 22 | 600660 | 福耀玻璃 | 28,068,764.25 | 5.03 |
| 23 | 603799 | 华友钴业 | 27,884,057.50 | 5.00 |
| 24 | 002460 | 赣锋锂业 | 26,729,771.89 | 4.79 |
| 25 | 002812 | 恩捷股份 | 25,057,968.52 | 4.49 |
| 26 | 002714 | 牧原股份 | 24,786,941.00 | 4.44 |
| 27 | 600176 | 中国巨石 | 24,766,113.98 | 4.44 |
| 28 | 002271 | 东方雨虹 | 24,493,592.59 | 4.39 |
| 29 | 300015 | 爱尔眼科 | 22,830,715.64 | 4.09 |
| 30 | 601166 | 兴业银行 | 22,461,568.91 | 4.03 |
| 31 | 300142 | 沃森生物 | 19,928,322.34 | 3.57 |
| 32 | 600570 | 恒生电子 | 18,165,934.92 | 3.26 |
| 33 | 601058 | 赛轮轮胎 | 17,782,363.78 | 3.19 |
| 34 | 000963 | 华东医药 | 16,982,184.49 | 3.04 |
| 35 | 000568 | 泸州老窖 | 16,661,994.00 | 2.99 |
| 36 | 300124 | 汇川技术 | 16,028,974.98 | 2.87 |
| 37 | 600438 | 通威股份 | 14,515,317.00 | 2.60 |
| 38 | 601601 | 中国太保 | 14,304,044.00 | 2.56 |
| 39 | 002475 | 立讯精密 | 13,686,969.70 | 2.45 |
| 40 | 600031 | 三一重工 | 13,509,641.00 | 2.42 |
| 41 | 603520 | 司太立 | 13,329,371.00 | 2.39 |
| 42 | 688598 | 金博股份 | 12,703,037.82 | 2.28 |
| 43 | 600309 | 万华化学 | 12,510,892.80 | 2.24 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 44 | 600426 | 华鲁恒升 | 12,429,095.55 | 2.23 |
| 45 | 300759 | 康龙化成 | 12,179,500.79 | 2.18 |
| 46 | 601899 | 紫金矿业 | 12,054,043.71 | 2.16 |
| 47 | 300750 | 宁德时代 | 11,960,013.00 | 2.14 |
| 48 | 603456 | 九洲药业 | 11,889,837.00 | 2.13 |
| 49 | 300568 | 星源材质 | 11,744,760.63 | 2.10 |
| 50 | 000001 | 平安银行 | 11,560,194.06 | 2.07 |
| 51 | 000739 | 普洛药业 | 11,412,015.00 | 2.05 |
| 52 | 002821 | 凯莱英 | 11,323,346.00 | 2.03 |

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。

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 | 600519 | 贵州茅台 | 76,809,008.40 | 13.76 |
| 2 | 300122 | 智飞生物 | 71,020,618.01 | 12.73 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 67,492,370.69 | 12.09 |
| 4 | 601012 | 隆基股份 | 59,118,901.02 | 10.59 |
| 5 | 000799 | 酒鬼酒 | 51,879,566.64 | 9.30 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 49,062,667.15 | 8.79 |
| 7 | 000661 | 长春高新 | 49,043,128.62 | 8.79 |
| 8 | 000858 | 五粮液 | 48,204,187.73 | 8.64 |
| 9 | 002466 | 天齐锂业 | 47,677,975.73 | 8.54 |
| 10 | 600660 | 福耀玻璃 | 44,821,017.38 | 8.03 |
| 11 | 300014 | 亿纬锂能 | 44,466,006.97 | 7.97 |
| 12 | 603799 | 华友钴业 | 40,197,571.18 | 7.20 |
| 13 | 002812 | 恩捷股份 | 38,673,077.76 | 6.93 |
| 14 | 002460 | 赣锋锂业 | 36,498,494.00 | 6.54 |
| 15 | 603185 | 上机数控 | 35,900,180.50 | 6.43 |
| 16 | 600809 | 山西汾酒 | 32,134,277.59 | 5.76 |
| 17 | 600438 | 通威股份 | 28,593,308.26 | 5.12 |
| 18 | 300124 | 汇川技术 | 27,598,478.78 | 4.95 |
| 19 | 002475 | 立讯精密 | 27,557,258.94 | 4.94 |
| 20 | 600031 | 三一重工 | 27,463,960.35 | 4.92 |
| 21 | 300015 | 爱尔眼科 | 27,358,925.00 | 4.90 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 22 | 300896 | 爱美客 | 27,021,321.00 | 4.84 |
| 23 | 002271 | 东方雨虹 | 25,774,240.77 | 4.62 |
| 24 | 300750 | 宁德时代 | 25,498,360.96 | 4.57 |
| 25 | 002714 | 牧原股份 | 22,276,153.20 | 3.99 |
| 26 | 600176 | 中国巨石 | 21,520,187.40 | 3.86 |
| 27 | 300677 | 英科医疗 | 21,418,131.00 | 3.84 |
| 28 | 300142 | 沃森生物 | 21,313,859.00 | 3.82 |
| 29 | 300274 | 阳光电源 | 20,862,040.00 | 3.74 |
| 30 | 603659 | 璞泰来 | 20,695,297.68 | 3.71 |
| 31 | 002129 | 中环股份 | 20,365,641.00 | 3.65 |
| 32 | 601166 | 兴业银行 | 19,476,566.00 | 3.49 |
| 33 | 603259 | 药明康德 | 19,034,343.60 | 3.41 |
| 34 | 300450 | 先导智能 | 18,769,581.88 | 3.36 |
| 35 | 600570 | 恒生电子 | 17,679,718.40 | 3.17 |
| 36 | 002594 | 比亚迪 | 17,326,530.19 | 3.10 |
| 37 | 603501 | 韦尔股份 | 17,017,679.38 | 3.05 |
| 38 | 000333 | 美的集团 | 16,873,264.00 | 3.02 |
| 39 | 603456 | 九洲药业 | 16,603,696.80 | 2.98 |
| 40 | 000963 | 华东医药 | 16,542,625.80 | 2.96 |
| 41 | 300347 | 泰格医药 | 16,350,870.00 | 2.93 |
| 42 | 601058 | 赛轮轮胎 | 16,168,892.00 | 2.90 |
| 43 | 601633 | 长城汽车 | 15,791,229.92 | 2.83 |
| 44 | 603267 | 鸿远电子 | 15,202,575.00 | 2.72 |
| 45 | 601888 | 中国中免 | 14,360,034.00 | 2.57 |
| 46 | 603520 | 司太立 | 14,117,181.00 | 2.53 |
| 47 | 002025 | 航天电器 | 12,884,982.00 | 2.31 |
| 48 | 600521 | 华海药业 | 12,769,203.09 | 2.29 |
| 49 | 601601 | 中国太保 | 12,312,013.01 | 2.21 |
| 50 | 002304 | 洋河股份 | 12,122,885.96 | 2.17 |
| 51 | 300759 | 康龙化成 | 12,083,000.00 | 2.17 |
| 52 | 688390 | 固德威 | 12,005,945.40 | 2.15 |
| 53 | 000651 | 格力电器 | 11,778,631.00 | 2.11 |
| 54 | 600893 | 航发动力 | 11,483,255.00 | 2.06 |
| 55 | 000739 | 普洛药业 | 11,474,198.00 | 2.06 |
| 56 | 600309 | 万华化学 | 11,413,377.00 | 2.05 |
| 57 | 000001 | 平安银行 | 11,401,091.00 | 2.04 |

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。

7.4.3 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 | 1,722,246,964.14 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,889,948,335.45 |

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末投资贵金属投资。

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。

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。

在预判市场系统风险较大时，应用股指期货对冲策略，即在保有股票头寸不变的情况下或者逐步降低股票仓位后，在市场面临下跌时择机卖出期指合约进行套期保值，当股市好转之后再将期指合约空单平仓。

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

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

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 | 326,472.99 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,706,906.33 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,263.33 |
| 5 | 应收申购款 | 33,331.33 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,071,973.98 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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。

§ 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 |
| 11,835 | 22,667.18 | 0.00 | 0.00% | 268,266,051.35 | 100.00% |

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 | 102,996.28 | 0.0384% |

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

| 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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2015 年 3 月 17 日) 基金份额总额 | 3,982,602,746.36 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 370,924,494.22 |
| 本报告期基金总申购份额 | 13,996,740.48 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 116,655,183.35 |
| 本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 268,266,051.35 |

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未举行基金份额持有人大会。

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

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）自 2015 年 3 月 17 日（基金合同生效日）起至今为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | |
| 开源证券 | 2 | 2,165,188,387.84 | 60.05% | 2,016,439.13 | 60.05% | - |
| 华泰证券 | 2 | 515,175,622.69 | 14.29% | 479,784.51 | 14.29% | - |
| 浙商证券 | 1 | 429,737,090.47 | 11.92% | 400,215.99 | 11.92% | - |
| 华龙证券 | 1 | 350,955,367.63 | 9.73% | 326,844.13 | 9.73% | - |
| 中信证券 | 1 | 144,320,234.10 | 4.00% | 134,404.92 | 4.00% | - |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1. 选择专用席位的标准和程序：

(1) 选择标准

- ① 证券经营机构财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进。
- ② 证券经营机构具有较强的研究能力：有较强的研究分析能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息咨询服务。

③ 证券经营机构能提供最优惠合理的佣金率：与其他证券经营机构相比，该证券经营机构能够提供最优惠、最合理的佣金率。

(2) 选择程序

① 基金管理人根据上述标准考察后确定选用证券交易单元的证券经营机构；

② 基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券交易单元租用协议。

10.7.2 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 |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华龙证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 179,273.40 | 100.00% | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 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 | 华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东莞农村商业银行股份有限公司费率优惠活动的公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报 | 2021年1月4日 |
| 2 | 华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报 | 2021年1月7日 |
| 3 | 华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加腾安基金销售（深圳）有限公司费率优惠活动的公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报 | 2021年1月7日 |

| | | | |
|----|--|--|-----------------|
| 4 | 华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 1 月 22 日 |
| 5 | 华商基金管理有限公司旗下基金 2020 年第四季度报告提示性公告 | 证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报 | 2021 年 1 月 22 日 |
| 6 | 华商基金管理有限公司关于开展网上直销系统定投费率优惠的公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报 | 2021 年 2 月 3 日 |
| 7 | 华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报 | 2021 年 3 月 9 日 |
| 8 | 华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加安信证券股份有限公司费率优惠活动的公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报 | 2021 年 3 月 15 日 |
| 9 | 华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京度小满基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报 | 2021 年 3 月 30 日 |
| 10 | 华商基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 11 | 华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 12 | 华商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第一季度报告提示性公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 13 | 华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 14 | 华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加南京证券股份有限公司费率优惠活动的公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报 | 2021 年 4 月 28 日 |
| 15 | 华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报 | 2021 年 6 月 24 日 |
| 16 | 华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报 | 2021 年 6 月 30 日 |

§ 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

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。

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. 中国证监会批准华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
2. 《华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 报告期内华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

基金托管人地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：4007008880（免长途费），010—58573300

基金管理人网址：<http://www.hsfund.com>

中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

华商基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日