

融通新消费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：融通基金管理有限公司

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 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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融通新消费灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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 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	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	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	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	11
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	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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 中期财务会计报告（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	16
§ 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	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44

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	44
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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情况	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通新消费灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	融通新消费灵活配置混合
基金主代码	002605
前端交易代码	002605
后端交易代码	002606
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 27 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
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	209,584,152.85 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于新消费主题相关优质上市公司，同时通过合理的动态资产配置，在注重风险控制的原则下，追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。
投资策略	本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具等的比例进行大类资产配置，规避系统性风险，力争通过资产配置获得部分超额收益。
业绩比较基准	中证全指主要消费指数收益率×50%+中债综合全价（总值）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，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东	李申
	联系电话	(0755) 26948666	(021) 60637102
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	(021) 60637111
传真		(0755) 26935005	(021) 60635778
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518053	100033
法定代表人		高峰	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.rtfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 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	42,138,522.20
本期利润	26,576,750.49
加权平均基金份额本期利润	0.1020
本期加权平均净值利润率	5.51%
本期基金份额净值增长率	6.42%
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	193,990,827.73
期末可供分配基金份额利润	0.9256
期末基金资产净值	406,505,206.23
期末基金份额净值	1.940
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	94.00%

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

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

3、期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3.2 基金净值表现

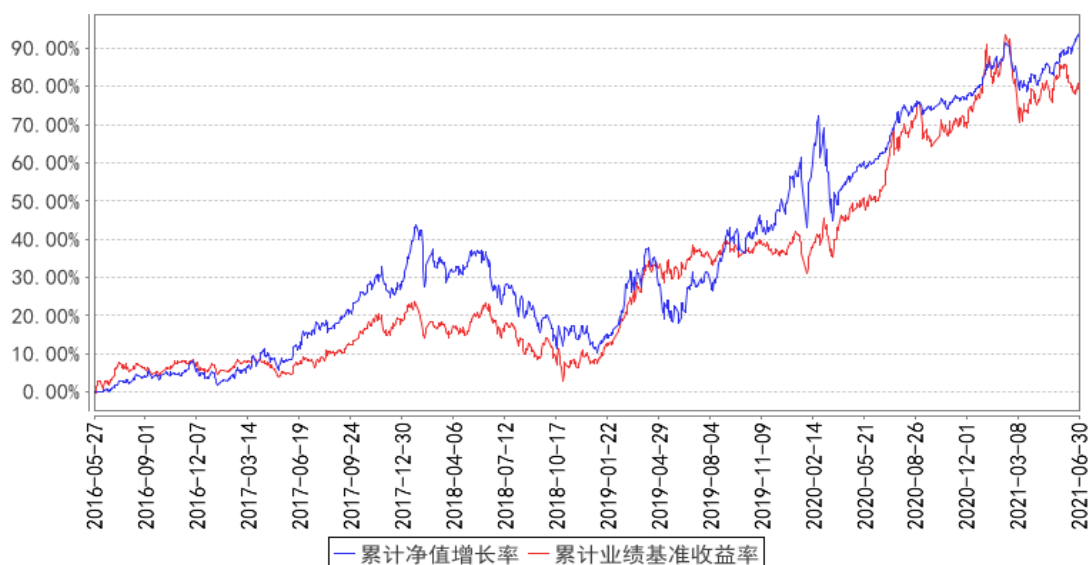
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.59%	0.41%	-2.90%	0.59%	5.49%	-0.18%

过去三个月	7.00%	0.44%	2.29%	0.67%	4.71%	-0.23%
过去六个月	6.42%	0.52%	-1.00%	0.91%	7.42%	-0.39%
过去一年	18.65%	0.46%	15.48%	0.87%	3.17%	-0.41%
过去三年	51.80%	1.05%	53.35%	0.83%	-1.55%	0.22%
自基金合同生效起至今	94.00%	0.93%	79.61%	0.73%	14.39%	0.20%

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

融通新消费灵活配置混合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



§ 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

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8 号文批准，于 2001 年 5 月 22 日成立，公司注册资本 12500 万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时代证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（NikkoAssetManagementCo., Ltd.）40%。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理七十六只开放式基金：即融通新蓝筹证券投资基金、融通债券投资基金、融通蓝筹成长证券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)、融通易支付货币市场证券投资基金、融通动力先锋混合型证券投资基金、融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF)、融通内需驱动混合型证券投资基金、融通深证成份指数证券投资基金、融通四季添利债券型证券投资基金 (LOF)、融通创业板指数增强型证券投资基金、融通医疗保健行业混合型证券投资基金、融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金、融通通源短融债券型证券投资基金、融通通瑞债券型证券投资基金、融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金、融通互

联网传媒灵活配置混合型证券投资基金、融通新区新经济灵活配置混合型证券投资基金、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源灵活配置混合型证券投资基金、融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通成长 30 灵活配置混合型证券投资基金、融通汇财宝货币市场基金、融通中国风 1 号灵活配置混合型证券投资基金、融通增鑫债券型证券投资基金、融通增益债券型证券投资基金、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金、融通通安债券型证券投资基金、融通通优债券型证券投资基金、融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金、融通通和债券型证券投资基金、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券型证券投资基金、融通可转债债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金 (LOF)、融通通宸债券型证券投资基金、融通通玺债券型证券投资基金、融通通润债券型证券投资基金、融通中证人工智能主题指数证券投资基金 (LOF)、融通收益增强债券型证券投资基金、融通中国概念债券型证券投资基金 (QDII)、融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增悦债券型证券投资基金、融通研究优选混合型证券投资基金、融通核心价值混合型证券投资基金 (QDII)、融通通盈灵活配置混合型证券投资基金、融通通慧混合型证券投资基金、融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增强收益债券型证券投资基金、融通消费升级混合型证券投资基金、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通昊三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增享纯债债券型证券投资基金、融通产业趋势股票型证券投资基金、融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通产业趋势先锋股票型证券投资基金、融通通益混合型证券投资基金、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金、融通通恒 63 个月定期开放债券型证券投资基金、融通产业趋势臻选股票型证券投资基金、融通稳健添盈灵活配置混合型证券投资基金、融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金 (LOF)、融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金、融通价值趋势混合型证券投资基金、融通核心趋势混合型证券投资基金。其中，融通债券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

关山	本基金的基金经理、研究部副总监	2016-6-3	-	15	关山女士，金融学硕士，15 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2006 年 3 月加入融通基金管理有限公司，历任纺织服装行业研究员、餐饮旅游行业研究员、轻工制造行业研究员、消费行业研究组组长、融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通消费升级混合型证券投资基金基金经理，现任研究部副总监、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通动力先锋混合型证券投资基金基金经理。
余志勇	本基金的基金经理、组合投资部总监	2020-4-8	-	21	余志勇先生，武汉大学金融学硕士，21 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。1992 年 7 月至 1997 年 9 月就职于湖北省农业厅任研究员，2000 年 7 月至 2004 年 7 月就职于闽发证券公司任研究员，2004 年 7 月至 2007 年 4 月就职于招商证券股份有限公司任研究员。2007 年 4 月加入融通基金管理有限公司，历任研究部行业研究员、行业研究组组长、研究部总监、融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通通泽灵活配置混合基金基金经理、融通增裕债券型证券投资基金基金经理、融通增丰债券型证券投资基金基金经理、融通通景灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通润债券型证券投资基金基金经理、融通通颐定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通泰保本混合型证券投资基金基金经理，现任组合投资部总监、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通四季添利债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通通慧混合型证券投资基金基金经理、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通增强收益债券型证券投资基金基金经理、融通蓝筹成长证券投资基金基金经理、融通新消费灵活配置混合型证券投资

					基金的基金经理。
黄浩荣	本基金的基金经理	2020-4-8	-	7	黄浩荣先生，厦门大学管理学硕士，7 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2014 年 6 月加入融通基金管理有限公司，历任固定收益部固定收益研究员、融通通安债券型证券投资基金基金经理、融通通和债券型证券投资基金基金经理、融通通弘债券型证券投资基金基金经理、融通通祺债券型证券投资基金基金经理、融通通宸债券型证券投资基金基金经理、融通通福债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通通源短融债券型证券投资基金基金经理、融通通润债券型证券投资基金基金经理、融通通玺债券型证券投资基金基金经理、融通通穗债券型证券投资基金基金经理、融通通颐定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通通昊定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通增利债券型证券投资基金基金经理，现任融通汇财宝货币市场基金基金经理、融通易支付货币市场证券投资基金基金经理、融通现金宝货币市场基金基金经理、融通通慧混合型证券投资基金基金经理、融通通昊三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、融通通益混合型证券投资基金基金经理、融通通远三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通通安债券型证券投资基金基金经理。

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券、基金业务相关工作的时间为计算标准。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

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

上半年 A 股市场出现了巨大的波动：一季度传统周期股涨幅巨大，消费和成长行业均大幅下跌；二季度以电气设备为代表的成长股重新大幅上涨。上半年涨幅居前的行业是钢铁、电气设备、化工、采掘、综合、医药生物、有色、电子、汽车；跌幅居前的是非银、家用电器、农林牧渔、国防军工、传媒。

由于本基金的投资目标是绝对收益，同时兼顾保持基金净值平稳增长的目标，因此本基金保持了较低的仓位，投资策略上继续采取了配置相对均衡的组合投资方式，但由于期间权益市场阶段性出现了剧烈波动，叠加权益仓位有时被动提高，基金净值的波动也有所加大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.940 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.42%，业绩比较基准收益率为-1.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观经济机遇多于挑战：一方面以新能源、半导体和医药生物代表的新型行业发展势头良好，另一方面传统经济很可能迎来国内外共振的发展机会。证券市场由于市场预期比较一致，不排除阶段性出现大的波动，但我们认为趋势难以发生大的变化。

下半年我们重点关注的方向：第一、顺周期行业的化工、竞争格局良好的重卡和工程机械等；第二，景气度高且具有中长期发展前景的科技板块，例如新能源、半导体等；第三，消费板块中的医药生物和食品饮料。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则

和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金不存在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的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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：融通新消费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	6,126,978.57	12,309,790.64
结算备付金		536,282.39	258,853.81
存出保证金		23,436.82	44,659.40
交易性金融资产	6.4.7.2	326,693,263.28	626,879,059.43
其中：股票投资		95,737,869.86	156,279,399.47
基金投资		-	-
债券投资		229,907,393.42	460,599,659.96
资产支持证券投资		1,048,000.00	10,000,000.00
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	14,850,127.43	20,025,130.01
应收证券清算款		56,243,073.68	756,152.51
应收利息	6.4.7.5	3,074,297.28	5,543,894.08
应收股利		-	-
应收申购款		11,973.00	6,736.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		407,559,432.45	665,824,276.84
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		-	-
应付赎回款		205,287.28	258,068.62
应付管理人报酬		492,341.01	829,623.08
应付托管费		82,056.86	138,270.52
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	177,101.80	135,793.63
应交税费		8,636.10	28,020.36
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	88,803.17	124,796.84
负债合计		1,054,226.22	1,514,573.05
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	209,584,152.85	364,331,719.23
未分配利润	6.4.7.10	196,921,053.38	299,977,984.56
所有者权益合计		406,505,206.23	664,309,703.79
负债和所有者权益总计		407,559,432.45	665,824,276.84

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.940 元，基金份额总额 209,584,152.85 份。

6.2 利润表

会计主体：融通新消费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	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		31,502,600.21	27,895,987.89
1. 利息收入		5,611,288.72	1,158,559.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	55,748.05	283,985.58
债券利息收入		5,188,039.51	492,282.94
资产支持证券利息收入		140,049.78	-
买入返售金融资产收入		227,451.38	382,291.11
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		41,070,046.44	16,026,397.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	42,125,769.14	16,406,960.35
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,829,326.78	-932,456.36
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	773,604.08	551,893.22
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-15,561,771.71	10,688,772.18
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	383,036.76	22,258.87
减：二、费用		4,925,849.72	2,562,217.34

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,612,145.96	1,652,599.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	602,024.40	275,433.32
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	561,584.67	561,875.18
5. 利息支出		27,212.30	604.60
其中：卖出回购金融资产支出		27,212.30	604.60
6. 税金及附加		8,128.61	914.95
7. 其他费用	6.4.7.20	114,753.78	70,789.53
三、利润总额		26,576,750.49	25,333,770.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润		26,576,750.49	25,333,770.55

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通新消费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）	364,331,719.23	299,977,984.56	664,309,703.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,576,750.49	26,576,750.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-154,747,566.38	-129,633,681.67	-284,381,248.05
其中：1. 基金申购款	28,373,433.36	24,449,884.86	52,823,318.22
2. 基金赎回款	-183,120,999.74	-154,083,566.53	-337,204,566.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	209,584,152.85	196,921,053.38	406,505,206.23
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）	46,843,271.35	24,981,928.74	71,825,200.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,333,770.55	25,333,770.55

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	334,682,975.77	191,997,614.03	526,680,589.80
其中：1. 基金申购款	357,017,648.38	204,766,115.12	561,783,763.50
2. 基金赎回款	-22,334,672.61	-12,768,501.09	-35,103,173.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	381,526,247.12	242,313,313.32	623,839,560.44

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：

张帆

颜锡廉

刘美丽

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

融通新消费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[2016]538号《关于融通新消费灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由融通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《融通新消费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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币315,879,567.45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(2016)第683号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年5月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为315,950,659.67份基金份额,其中认购资金利息折合71,092.22份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,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《融通新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票、存托凭证)、固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式债券回购、货币市场工具等)、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合中,本股

票资产占基金资产的比例为 0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于新消费相关上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金业绩比较基准为：中证全指主要消费指数收益率×50%+中债综合全价(总值)指数收益率×50%。

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》、《融通新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年中期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一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2

号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(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	6,126,978.57
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	6,126,978.57

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	74,233,833.44	95,737,869.86	21,504,036.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	71,226,493.42	-26,613.29
	银行间市场	158,680,900.00	-369,909.35
	合计	229,907,393.42	-396,522.64
资产支持证券	1,046,000.00	1,048,000.00	2,000.00
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	305,583,749.50	326,693,263.28	21,109,513.78

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	14,850,127.43	-
合计	14,850,127.43	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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	823.10
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	241.30
应收债券利息	3,070,957.81
应收资产支持证券利息	357.65

应收买入返售证券利息	1,906.82
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	10.60
合计	3,074,297.28

6.4.7.6 其他资产

无。

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	174,555.55
银行间市场应付交易费用	2,546.25
合计	177,101.80

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	460.01
应付证券出借违约金	-
预提费用	88,343.16
合计	88,803.17

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	364,331,719.23	364,331,719.23
本期申购	28,373,433.36	28,373,433.36
本期赎回	-183,120,999.74	-183,120,999.74
本期末	209,584,152.85	209,584,152.85

注：申购含转换入份额；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	275,713,445.50	24,264,539.06	299,977,984.56
本期利润	42,138,522.20	-15,561,771.71	26,576,750.49
本期基金份额交易产生的变动数	-123,861,139.97	-5,772,541.70	-129,633,681.67

其中：基金申购款	22,227,347.35	2,222,537.51	24,449,884.86
基金赎回款	-146,088,487.32	-7,995,079.21	-154,083,566.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	193,990,827.73	2,930,225.65	196,921,053.38

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		53,277.31
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		2,225.88
其他		244.86
合计		55,748.05

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		42,125,769.14
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		42,125,769.14

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额		209,120,236.80
减：卖出股票成本总额		166,994,467.66
买卖股票差价收入		42,125,769.14

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		-1,829,326.78

券到期兑付) 差价收入	
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	-1,829,326.78

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	446,554,067.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	442,147,952.74
减：应收利息总额	6,235,441.50
买卖债券差价收入	-1,829,326.78

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	9,081,888.89
减：卖出资产支持证券成本总额	8,954,000.00
减：应收利息总额	127,888.89
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

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	773,604.08
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	773,604.08

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	-15,561,771.71
股票投资	-16,750,045.39
债券投资	1,186,273.68
资产支持证券投资	2,000.00
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	-15,561,771.71

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	382,033.18
基金转换费收入	1,003.58
合计	383,036.76

注：1. 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。

2. 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赎回费用的 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	558,362.17
银行间市场交易费用	3,222.50
合计	561,584.67

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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	13,050.62
账户维护费	21,760.00
其他	600.00

合计	114,753.78
----	------------

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

截至本财务报表报出日，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

本报告期与本基金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
融通基金管理有限公司（“融通基金”）	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
新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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(%)
新时代证券	-	-	51,931,170.85	14.56

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 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(%)

新时代证券	-	-	-	-
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 (%)
新时代证券	48,141.12	14.60	1,760.85	0.88

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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等。

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	3,612,145.96	1,652,599.76
其中：支付销售机构的客户维护费	264,640.78	230,593.92

注：1、支付基金管理人融通基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

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	602,024.40	275,433.32

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年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	6,126,978.57	53,277.31	157,901,156.43	280,817.31

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	首发流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	首发流通受限	10.76	22.2	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	首发流通受限	13.39	30.1	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐	2021年1月	2021年7月	首发流	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-

	环保	12 日	20 日	通受限						
300930	屹通 新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	首发流 通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用 电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	首发流 通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友 联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	首发流 通受限	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	首发流 通受限	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	首发流 通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300941	创识 科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	首发流 通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞 生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	首发流 通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖 智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	首发流 通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡 龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	首发流 通受限	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	首发流 通受限	13	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中 生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	流通受 限	0	27.42	108	0	2,961.36	-
300950	德固 特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	首发流 通受限	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	首发流 通受限	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	首发流 通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨 家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	首发流 通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力 股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	首发流 通受限	12.85	25.8	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰 妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	首发流 通受限	47.33	251.96	372	17,606.76	93,729.12	-
300958	建工 修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	首发流 通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业 科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	首发流 通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水 海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	首发流 通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金 辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	首发流 通受限	3.4	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-

300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	首发流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	首发流通受限	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	首发流通受限	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	首发流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	首发流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	首发流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	首发流通受限	8.42	13.6	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	首发流通受限	33.22	87.5	551	18,304.22	48,212.50	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	首发流通受限	48.59	90.39	301	14,625.59	27,207.39	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	首发流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	首发流通受限	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	首发流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	首发流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	首发流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	首发流通受限	12.1	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇特新材	2021年5月17日	2021年11月26日	首发流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	首发流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	首发流通受限	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	首发流通受限	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	首发流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	首发流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈	2021年6月4日	2021年12月	首发流	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-

	仕	日	月 16 日	通受限						
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	首发流通受限	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	首发流通受限	14.2	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	首发流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	首发流通受限	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	首发流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	首发流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	首发流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	首发流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	首发流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021 年 6 月 2 日	2021 年 12 月 10 日	首发流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	首发流通受限	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	首发流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	首发流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	首发流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688425	铁建重工	2021 年 6 月 11 日	2021 年 12 月 22 日	首发流通受限	2.87	4.75	46,305	132,895.35	219,948.75	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	首发流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688597	煜邦电力	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	首发流通受限	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-
688621	阳光诺和	2021 年 6 月 11 日	2021 年 12 月 21 日	首发流通受限	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-
688687	凯因科技	2021 年 1 月 29 日	2021 年 8 月 9 日	首发流通受限	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123117	健帆	2021 年 6 月	2021 年 07	新债未	100.0	100.00	281	28,099.82	28,099.82	-

	转债	23 日	月 12 日	上市	0				
--	----	------	--------	----	---	--	--	--	--

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业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。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制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人奉行内控优先和全员风险管理理念，高度重视风险管理的组织保障和制度保障，建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程，力争在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化。

董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管

理战略和风险应对策略；审议重大事件、重大决策的风险评估意见，审批重大风险的解决方案，批准公司基本风险管理制度；审议公司风险管理报告。在董事会下设立风险控制与审计委员会，履行相应风险管理和监督职责。

公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，并确保风险管理制度得以全面、有效执行。在公司管理层下设立风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和个业务单元开展风险管理工作；制定相关风险控制政策，审批风险管理重要流程和风险限额，并与公司整体业务发展战略和风险承受能力相一致；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；识别和评估新产品、新业务的新增风险，并制定控制措施；重点关注内控机制薄弱环节和那些可能给公司带来重大损失的事件，提出控制措施和解决方案；协调突发性重大风险事件的处理；审定风险事件责任人的责任；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理制度和流程的有效性负责。公司所有员工是本岗位风险管理的直接责任人，各业务部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，基金经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，负责执行公司的风险管理战略和决策，拟定公司风险管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标；对风险进行定性和定量评估，改进风险管理方法、技术和模型，组织推动建立、持续优化风险管理信息系统；对新产品、新业务进行独立监测和评估，提出风险防范和控制建议；负责督促相关部门落实风险管理委员会的各项决策和风险管理制度，并对风险管理决策和风险管理制度执行情况进行检查、评估和报告。

监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险管理措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

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人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所

进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	30,039,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	18,500,000.00	99,839,000.00
合计	18,500,000.00	129,878,000.00

注：未评级部分为国债、政策性金融债、短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	22,335,300.00	88,897,000.00
合计	22,335,300.00	88,897,000.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	185,965,141.80	187,523,260.00
AAA 以下	98,851.62	50,300,999.96
未评级	3,008,100.00	4,000,400.00

合计	189,072,093.42	241,824,659.96
----	----------------	----------------

注：1、未评级部分为国债、政策性金融债。

2、债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	1,048,000.00	10,000,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	1,048,000.00	10,000,000.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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上市公司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未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。截止 2021 年 6 月 30 日，本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产账面金额与净赎回金额符合上述法规要求。

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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

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	6,126,978.57	-	-	-	6,126,978.57
结算备付金	536,282.39	-	-	-	536,282.39
存出保证金	23,436.82	-	-	-	23,436.82
交易性金融资产	169,926,041.80	60,930,500.00	98,851.62	95,737,869.86	326,693,263.28
买入返售金融资产	14,850,127.43	-	-	-	14,850,127.43
应收利息	-	-	-	3,074,297.28	3,074,297.28
应收申购款	-	-	-	11,973.00	11,973.00
应收证券清算款	-	-	-	56,243,073.68	56,243,073.68
资产总计	191,462,867.01	60,930,500.00	98,851.62	155,067,213.82	407,559,432.45
负债					
应付赎回款	-	-	-	205,287.28	205,287.28
应付管理人报酬	-	-	-	492,341.01	492,341.01
应付托管费	-	-	-	82,056.86	82,056.86
应付交易费用	-	-	-	177,101.80	177,101.80
应交税费	-	-	-	8,636.10	8,636.10
其他负债	-	-	-	88,803.17	88,803.17
负债总计	-	-	-	1,054,226.22	1,054,226.22
利率敏感度缺口	191,462,867.01	60,930,500.00	98,851.62	154,012,987.60	406,505,206.23
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	12,309,790.64	-	-	-	12,309,790.64
结算备付金	258,853.81	-	-	-	258,853.81
存出保证金	44,659.40	-	-	-	44,659.40
交易性金融资产	334,898,200.00	135,700,460.00	999.96	156,279,399.47	626,879,059.43
买入返售金融资产	20,025,130.01	-	-	-	20,025,130.01
应收利息	-	-	-	5,543,894.08	5,543,894.08
应收申购款	-	-	-	6,736.96	6,736.96
应收证券清算款	-	-	-	756,152.51	756,152.51
资产总计	367,536,633.86	135,700,460.00	999.96	162,586,183.02	665,824,276.84
负债					

应付赎回款	-	-	-	258,068.62	258,068.62
应付管理人报酬	-	-	-	829,623.08	829,623.08
应付托管费	-	-	-	138,270.52	138,270.52
应付交易费用	-	-	-	135,793.63	135,793.63
应交税费	-	-	-	28,020.36	28,020.36
其他负债	-	-	-	124,796.84	124,796.84
负债总计	-	-	-	1,514,573.05	1,514,573.05
利率敏感度缺口	367,536,633.86	135,700,460.00	999.96	161,071,609.97	664,309,703.79

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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)
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	471,846.02	527,680.69
	2. 市场利率上升 25 个基点	-469,741.96	-525,054.97

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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。

基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产(含存托凭证)占基金

资产的比例为 0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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	95,737,869.86	23.55	156,279,399.47	23.53
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	95,737,869.86	23.55	156,279,399.47	23.53

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证全指主要消费指数以外的其他市场变量保持不变		
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)	
分析	1. 中证全指主要消费指数上升 5%	4,640,498.97	14,276,141.95
	2. 中证全指主要消费指数下降 5%	-4,640,498.97	-14,276,141.95

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	95,737,869.86	23.49
	其中：股票	95,737,869.86	23.49
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	230,955,393.42	56.67
	其中：债券	229,907,393.42	56.41
	资产支持证券	1,048,000.00	0.26
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	14,850,127.43	3.64
	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	6,663,260.96	1.63
8	其他各项资产	59,352,780.78	14.56
9	合计	407,559,432.45	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	5,850.78	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	71,142,387.94	17.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,158,260.60	1.27
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	46,404.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,089,102.40	0.27
H	住宿和餐饮业	381,565.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,610,319.70	1.13
J	金融业	4,789,444.90	1.18
K	房地产业	726,205.00	0.18
L	租赁和商务服务业	3,238,925.00	0.80
M	科学研究和技术服务业	95,025.15	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	50,364.88	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	342,596.00	0.08
Q	卫生和社会工作	3,425,506.56	0.84
R	文化、体育和娱乐业	610,540.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	95,737,869.86	23.55

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	10,800	5,775,840.00	1.42

2	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	1.27
3	600519	贵州茅台	1,500	3,085,050.00	0.76
4	000858	五粮液	8,900	2,651,221.00	0.65
5	300782	卓胜微	4,720	2,537,000.00	0.62
6	601888	中国中免	8,300	2,490,830.00	0.61
7	601100	恒立液压	25,044	2,151,780.48	0.53
8	600809	山西汾酒	4,800	2,150,400.00	0.53
9	300124	汇川技术	28,650	2,127,549.00	0.52
10	688007	光峰科技	49,108	2,056,643.04	0.51
11	000338	潍柴动力	114,690	2,049,510.30	0.50
12	600031	三一重工	67,850	1,972,399.50	0.49
13	688536	思瑞浦	3,521	1,940,071.00	0.48
14	300347	泰格医药	9,900	1,913,670.00	0.47
15	601012	隆基股份	20,180	1,792,791.20	0.44
16	300274	阳光电源	14,400	1,656,864.00	0.41
17	000001	平安银行	70,800	1,601,496.00	0.39
18	688002	睿创微纳	14,715	1,468,998.45	0.36
19	300122	智飞生物	7,500	1,400,475.00	0.34
20	300725	药石科技	8,580	1,363,447.80	0.34
21	603369	今世缘	22,000	1,191,520.00	0.29
22	300529	健帆生物	13,220	1,141,679.20	0.28
23	002142	宁波银行	29,000	1,130,130.00	0.28
24	000661	长春高新	2,900	1,122,300.00	0.28
25	600276	恒瑞医药	16,036	1,089,966.92	0.27
26	300760	迈瑞医疗	2,100	1,008,105.00	0.25
27	601058	赛轮轮胎	99,400	993,006.00	0.24
28	300015	爱尔眼科	13,772	977,536.56	0.24
29	002484	江海股份	62,900	973,692.00	0.24
30	601636	旗滨集团	48,200	894,592.00	0.22
31	688696	极米科技	1,067	887,744.00	0.22
32	300496	中科创达	5,500	863,830.00	0.21
33	603737	三棵树	4,876	858,176.00	0.21
34	603267	鸿远电子	6,400	818,688.00	0.20
35	601799	星宇股份	3,600	812,592.00	0.20
36	002812	恩捷股份	3,400	795,940.00	0.20
37	600782	新钢股份	138,400	772,272.00	0.19
38	002460	赣锋锂业	6,300	762,867.00	0.19
39	002092	中泰化学	73,100	750,737.00	0.18
40	002027	分众传媒	79,500	748,095.00	0.18
41	601233	桐昆股份	30,700	739,563.00	0.18
42	000002	万科A	30,500	726,205.00	0.18
43	603816	顾家家居	9,200	710,976.00	0.17

44	600660	福耀玻璃	12,600	703,710.00	0.17
45	688200	华峰测控	1,481	701,001.73	0.17
46	300454	深信服	2,700	700,596.00	0.17
47	300059	东方财富	21,220	695,803.80	0.17
48	000786	北新建材	17,700	694,725.00	0.17
49	000807	云铝股份	58,300	693,770.00	0.17
50	300737	科顺股份	22,000	691,680.00	0.17
51	600919	江苏银行	96,200	683,020.00	0.17
52	600141	兴发集团	36,000	677,880.00	0.17
53	603236	移远通信	3,900	665,379.00	0.16
54	002179	中航光电	8,400	663,768.00	0.16
55	300450	先导智能	11,020	662,742.80	0.16
56	688111	金山办公	1,675	661,290.00	0.16
57	603659	璞泰来	4,800	655,680.00	0.16
58	601689	拓普集团	17,000	636,310.00	0.16
59	300146	汤臣倍健	19,100	628,390.00	0.15
60	603517	绝味食品	7,300	615,317.00	0.15
61	300413	芒果超媒	8,900	610,540.00	0.15
62	002824	和胜股份	17,000	599,420.00	0.15
63	002539	云图控股	67,900	592,767.00	0.15
64	688363	华熙生物	2,120	589,063.20	0.14
65	002206	海利得	89,600	556,416.00	0.14
66	603833	欧派家居	3,900	553,644.00	0.14
67	600763	通策医疗	1,300	534,300.00	0.13
68	002078	太阳纸业	39,800	531,330.00	0.13
69	300482	万孚生物	8,140	526,576.60	0.13
70	600309	万华化学	4,700	511,454.00	0.13
71	300408	三环集团	11,100	470,862.00	0.12
72	603605	珀莱雅	2,300	452,433.00	0.11
73	603960	克来机电	13,000	430,300.00	0.11
74	600486	扬农化工	3,839	429,085.03	0.11
75	002311	海大集团	5,200	424,320.00	0.10
76	002920	德赛西威	3,800	418,304.00	0.10
77	603277	银都股份	17,900	416,175.00	0.10
78	603039	泛微网络	5,980	397,969.00	0.10
79	002928	华夏航空	26,300	397,130.00	0.10
80	600150	中国船舶	23,800	392,938.00	0.10
81	600754	锦江酒店	6,700	381,565.00	0.09
82	601166	兴业银行	18,500	380,175.00	0.09
83	603128	华贸物流	26,600	374,794.00	0.09
84	688526	科前生物	10,344	374,659.68	0.09
85	600166	福田汽车	107,600	371,220.00	0.09

86	000951	中国重汽	13,300	359,898.00	0.09
87	600438	通威股份	8,300	359,141.00	0.09
88	000157	中联重科	38,000	351,120.00	0.09
89	002607	中公教育	16,400	342,596.00	0.08
90	603565	中谷物流	10,640	317,178.40	0.08
91	002677	浙江美大	16,800	307,104.00	0.08
92	688276	百克生物	2,681	280,378.98	0.07
93	601601	中国太保	9,600	278,112.00	0.07
94	688425	铁建重工	46,305	219,948.75	0.05
95	600690	海尔智家	8,188	212,151.08	0.05
96	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.04
97	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
98	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.02
99	300957	贝泰妮	372	93,729.12	0.02
100	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
101	688345	博力威	777	57,148.35	0.01
102	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
103	688571	杭华股份	5,458	49,176.58	0.01
104	300979	华利集团	551	48,212.50	0.01
105	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
106	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
107	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.01
108	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
109	300981	中红医疗	301	27,207.39	0.01
110	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
111	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
112	601528	瑞丰银行	1,330	20,708.10	0.01
113	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
114	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
115	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
116	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
117	300948	冠中生态	529	14,810.63	0.00
118	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
119	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
120	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
121	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
122	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
123	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
124	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
125	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
126	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
127	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00

128	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
129	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
130	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
131	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
132	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
133	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
134	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
135	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
136	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
137	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
138	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
139	603171	税友股份	437	8,390.40	0.00
140	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
141	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
142	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
143	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
144	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
145	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
146	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
147	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
148	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
149	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
150	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
151	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
152	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
153	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
154	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
155	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
156	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
157	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
158	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
159	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
160	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
161	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
162	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
163	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
164	605011	杭州热电	325	2,886.00	0.00
165	300896	爱美客	3	2,366.64	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	000858	五 粮 液	4,456,682.00	0.67
2	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.52
3	600809	山西汾酒	3,415,715.00	0.51
4	300782	卓胜微	3,086,804.97	0.46
5	000338	潍柴动力	2,858,468.68	0.43
6	000001	平安银行	2,644,609.00	0.40
7	300122	智飞生物	2,192,957.00	0.33
8	603369	今世缘	2,008,635.00	0.30
9	688007	光峰科技	1,966,219.51	0.30
10	601899	紫金矿业	1,839,165.00	0.28
11	000786	北新建材	1,776,023.00	0.27
12	000661	长春高新	1,744,376.00	0.26
13	002460	赣锋锂业	1,739,068.06	0.26
14	601058	赛轮轮胎	1,676,041.00	0.25
15	300760	迈瑞医疗	1,619,102.00	0.24
16	002484	江海股份	1,577,028.00	0.24
17	600660	福耀玻璃	1,533,366.00	0.23
18	600782	新钢股份	1,502,810.00	0.23
19	601601	中国太保	1,456,814.00	0.22
20	300737	科顺股份	1,439,204.00	0.22

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

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	600031	三一重工	6,258,662.00	0.94
2	002475	立讯精密	4,566,583.56	0.69
3	000661	长春高新	4,464,395.04	0.67
4	600519	贵州茅台	4,342,432.00	0.65
5	000001	平安银行	4,019,135.00	0.61
6	000338	潍柴动力	3,946,587.00	0.59
7	000568	泸州老窖	3,654,308.00	0.55
8	601899	紫金矿业	3,210,752.00	0.48
9	601888	中国中免	3,181,147.00	0.48
10	002304	洋河股份	2,786,543.00	0.42
11	600809	山西汾酒	2,677,844.00	0.40
12	600176	中国巨石	2,550,205.61	0.38
13	300124	汇川技术	2,386,947.00	0.36
14	600048	保利地产	2,358,652.00	0.36
15	601100	恒立液压	2,341,901.48	0.35
16	601318	中国平安	2,250,634.00	0.34

17	002241	歌尔股份	2,232,819.94	0.34
18	601012	隆基股份	2,183,727.00	0.33
19	300168	万达信息	2,099,671.00	0.32
20	300737	科顺股份	1,975,132.00	0.30

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

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	123,202,983.44
卖出股票收入（成交）总额	209,120,236.80

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

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	8,500,000.00	2.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	144,168,430.00	35.47
	其中：政策性金融债	13,008,100.00	3.20
4	企业债券	34,818,811.80	8.57
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,986,000.00	4.92
7	可转债（可交换债）	98,851.62	0.02
8	同业存单	22,335,300.00	5.49
9	其他	-	-
10	合计	229,907,393.42	56.56

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	1928005	19 浦发银行小微债 01	300,000	30,192,000.00	7.43
2	2028020	20 兴业银行小微债 03	300,000	29,727,000.00	7.31
3	1828016	18 民生银行 01	260,000	26,236,600.00	6.45
4	112103018	21 农业银行 CD018	230,000	22,335,300.00	5.49
5	1828005	18 浙商银行 01	200,000	20,204,000.00	4.97

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	179126	美团 2 优 A	100,000	1,048,000.00	0.26

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

无。

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

无。

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

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。

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

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、本基金投资的前十名证券中的 20 兴业银行小微债 03，其发行主体为兴业银行股份有限公司。

2020 年 9 月 4 日，中国人民银行福州中心支行针对兴业银行股份有限公司为无证机构提供转接清算服务，为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，未按规定履行客户身份识别义务等五项违法违规行做出行政处罚决定（福银罚字（2020）35 号），决定给予其警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

投资决策说明：兴业银行股份有限公司（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 年全年净利润中占比小于 0.1%，对公司整体业务开展以及持续经营无重大不利影响，对公司资金周

转和债务偿还影响小。

2、本基金投资的前十名证券中的 21 农业银行 CD018，其发行主体为中国农业银行股份有限公司。

2020 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会向中国农业银行股份有限公司做出行政处罚决定（银保监罚决字〔2020〕36 号）；2020 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会向中国农业银行股份有限公司做出行政处罚决定（银保监罚决字〔2020〕66 号）；

其中，银保监罚决字〔2020〕36 号处罚决定书依据《中华人民共和国银行业监督管理法》，《中华人民共和国商业银行法》和相关审慎经营规则就其向关系人发放信用贷款等违法违规行为，决定没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元；银保监罚决字〔2020〕66 号处罚决定书依据《中华人民共和国商业银行法》第五十条、《关于银行业金融机构免除部分服务收费的通知》第一条和《中华人民共和国商业银行法》第七十三条就其收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）等违法违规行为，决定没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 万元。

投资决策说明：中国农业银行股份有限公司（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 年全年净利润中占比小于 0.1%，对公司整体业务开展以及持续经营无重大不利影响，对公司资金周转和债务偿还影响小。

3、本基金投资的前十名证券中的 18 民生银行 01，其发行主体为中国民生银行股份有限公司。

2020 年 7 月 14 日，中国银行保险监督管理委员会向中国民生银行股份有限公司做出了行政处罚决定（银保监罚决字〔2020〕43 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十条、第二十一条、第四十六条，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第五十五条、第七十四条规定和相关审慎经营的规则，就其为房地产企业缴纳土地出让金提供融资、为“四证”不全的房地产项目提供融资等三十项违法违规行为，决定没收违法所得及罚款合计 10782.94 万元。

投资决策说明：中国民生银行股份有限公司（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 年全年净利润中占比小于 1%，对公司整体业务开展以及持续经营无重大不利影响，对公司资金周转和债务偿还影响小。

4、本基金投资的前十名证券中的 19 浦发银行小微债 01，其发行主体为上海浦东发展银行股份有限公司。

2020 年 8 月 10 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局向上海浦东发展银行股份有限公司做出了行政处罚决定（沪银保监银罚决字〔2020〕12 号），依据《中华人民共和国银行业监

督管理法》第四十六条第（五）项等规定，就其未按专营部门制规定开展同业业务、同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目等违法违规行为，决定责令改正，并处罚款共计 2100 万元。

投资决策说明：浦发银行股份有限公司（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 年全年净利润中占比小于 0.1%，对公司整体业务开展以及持续经营无重大不利影响，对公司资金周转和债务偿还影响小。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出本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	23,436.82
2	应收证券清算款	56,243,073.68
3	应收股利	-
4	应收利息	3,074,297.28
5	应收申购款	11,973.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,352,780.78

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123091	长海转债	1,230.80	0.00

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	600905	三峡能源	5,147,016.21	1.27	首发流通受限

§ 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（%）
2,041	102,686.99	191,556,103.36	91.40	18,028,049.49	8.60

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	8,399.80	0.00401

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、基金投资和研发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（2016年5月27日）基金份额总额	315,950,659.67
本报告期期初基金份额总额	364,331,719.23
本报告期基金总申购份额	28,373,433.36
减：本报告期基金总赎回份额	183,120,999.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	209,584,152.85

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本基金本报告期未召开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**10.2.1 基金管理人的重大变动**

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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，本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
华创证券	2	90,734,229.28	28.30%	84,102.61	28.47%	-
天风证券	2	35,123,687.37	10.96%	32,009.82	10.84%	-
长江证券	1	34,948,939.71	10.90%	31,848.98	10.78%	-
东吴证券	2	34,248,891.85	10.68%	31,895.40	10.80%	-
东方证券	1	28,913,341.06	9.02%	26,927.17	9.12%	-
光大证券	2	27,832,937.36	8.68%	25,364.35	8.59%	-
广发证券	1	26,912,245.24	8.39%	25,064.64	8.49%	-
中金公司	3	24,942,117.36	7.78%	22,727.75	7.69%	-
中信证券	2	16,959,720.26	5.29%	15,453.62	5.23%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价；
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、交易单元变更情况

本基金本报告期新增租用东兴证券交易单元 1 个，终止中金公司交易单元一个。

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
华创证券	53,135,616.08	64.75%	152,100,000.00	100.00%	-	-
天风证券	19,867,024.66	24.21%	-	-	-	-
长江证券	8,979,605.79	10.94%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	987.37	0.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	75,600.00	0.09%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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	关于融通新消费灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购限制金额的公告	上海证券报、管理人网站	2021-1-7
2	关于融通新消费灵活配置混合型证券投资基金开展直销柜台赎回费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2021-1-11
3	融通关于旗下部分开放式基金新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为销售机构并开通转换业务及参加其费率优惠的公告	上海证券报、管理人网站	2021-3-10
4	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、管理人网站	2021-3-16
5	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并开通定期定额投资及转换业务的公告	上海证券报、管理人网站	2021-3-29
6	融通关于旗下部分开放式基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构和新增开通基金定期定额投资业务的公告	上海证券报、管理人网站	2021-3-30
7	融通关于旗下部分开放式基金在上海华夏财富开通定投及参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2021-4-12
8	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、管理人网站	2021-4-14
9	关于旗下部分开放式基金参与中国国际金融股份有限公司及中国中金财富证券有限公司费率优惠的公告	上海证券报、管理人网站	2021-4-27
10	融通关于旗下部分开放式基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2021-5-17
11	融通关于旗下部分开放式基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司转换费率优	上海证券报、管理人网站	2021-5-31

	惠活动的公告		
12	关于东方财富证券销售的融通基金旗下部分开放式基金开通定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2021-6-8
13	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与上海基煜基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、管理人网站	2021-6-24

§ 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	20210101-20210322	90,121,248.92	0.00	50,573,729.22	39,547,519.70	18.87
	2	20210101-20210111	75,781,984.64	0.00	56,698,651.31	19,083,333.33	9.11
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通新消费灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通新消费灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通新消费灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登录本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查阅。

融通基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日