

# 中加心享灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 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、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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06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	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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 中期财务会计报告(未经审计)	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	21
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	56
7.1 期末基金资产组合情况	56
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	58
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	66
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	66
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	66
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	66
§8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68

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.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
§12 备查文件目录.....	73
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中加心享灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中加心享混合	
基金主代码	002027	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月02日	
基金管理人	中加基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,019,041,525.15份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中加心享混合A	中加心享混合C
下属分级基金的交易代码	002027	002533
报告期末下属分级基金的份额总额	996,711,761.34份	22,329,763.81份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在深入研究的基础上，运用灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，发现并精选能够分享中国经济发展方式调整中的上市公司构建投资组合。在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长，为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采用积极灵活的投资策略，通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上，力争实现长期稳健的绝对收益。
业绩比较基准	$30\% \times \text{沪深300指数收益率} + 70\% \times \text{中债总全价指数收益率}$
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与货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中加基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘凌
	联系电话	400-00-95526
	电子邮箱	service@bobbns.com
客户服务电话	400-00-95526	95595
传真	010-83197627	010-63639132
注册地址	北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	北京市西城区南纬路35号	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
邮政编码	100050	100033
法定代表人	夏英	李晓鹏

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bobbns.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、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	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35号

## §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01月01日-2021年06月30日)

	中加心享混合A	中加心享混合C
本期已实现收益	37,655,356.13	433,929.35
本期利润	52,256,269.96	701,849.90
加权平均基金份额本期利润	0.0459	0.0504
本期加权平均净值利润率	3.88%	4.24%
本期基金份额净值增长率	4.32%	4.26%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	146,090,569.16	3,505,948.96
期末可供分配基金份额利润	0.1466	0.1570
期末基金资产净值	1,215,066,957.79	27,239,532.83
期末基金份额净值	1.2191	1.2199
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	36.60%	56.21%

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、本期已实现收益是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的孰低数（为期末余额，不是当期发生额）。

### 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

中加心享混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

				④		
过去一个月	1.12%	0.21%	-0.71%	0.25%	1.83%	-0.04%
过去三个月	4.18%	0.19%	1.41%	0.30%	2.77%	-0.11%
过去六个月	4.32%	0.23%	0.45%	0.40%	3.87%	-0.17%
过去一年	8.90%	0.22%	6.98%	0.39%	1.92%	-0.17%
过去三年	28.63%	0.16%	17.80%	0.40%	10.83%	-0.24%
自基金合同生效起至今	36.60%	0.13%	16.62%	0.37%	19.98%	-0.24%

中加心享混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.11%	0.21%	-0.71%	0.25%	1.82%	-0.04%
过去三个月	4.15%	0.19%	1.41%	0.30%	2.74%	-0.11%
过去六个月	4.26%	0.23%	0.45%	0.40%	3.81%	-0.17%
过去一年	8.80%	0.22%	6.98%	0.39%	1.82%	-0.17%
过去三年	28.77%	0.16%	17.80%	0.40%	10.97%	-0.24%
自基金合同生效起至今	56.21%	0.40%	19.12%	0.35%	37.09%	0.05%

**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**



中加心享混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年12月02日-2021年06月30日)



中加心享混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年03月29日-2021年06月30日)



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系试点中首家获批的基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地种业（集团）有限公司6%、有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

本报告期内，本基金管理人共管理五十七只基金，分别是中加货币市场基金（A/C）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加丰润纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加丰尚纯债债券型证券投资基金、中加丰泽纯债债券型证券投资基金、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加丰享纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加颐享纯债债券型证券投资基金、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金、中加颐信纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加颐睿纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐智纯债债券型证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金、中加裕盈纯债债券型证券投资基金、中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金、中加颐瑾六个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加民丰纯债债券型证券投资基金、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金、中加享润两年定期开放债券型证券投资基金、中加优选中高等级债券型证券投资基金（A/C）、中加科盈混合型证券投资基金（A/C）、中加优享纯债债券型证券投资基金、中加瑞享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加安瑞稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金、中加中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、中加聚庆六个月定期开放混合型证券投资基金（A/C）、中加核心智造混合型证券投资基金（A/C）、中加优势企业混合型证券投资基金（A/C）、中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、中加博裕纯债债券型证券投资基金、中加新兴成长混合型证券投资基金（A/C）、中加中证500指数增强型证券投资基金（A/C）、中加科享混合型证券投资基金（A/C）、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中加新兴消费混合型证券投资基金（A/C）、中加穗盈纯债债券型证券投资基金、中加聚隆六个月持有期混合型证券投资基金（A/C）、

中加科鑫混合型证券投资基金（A/C）、中加中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、中加聚优一年定期开放混合型证券投资基金（A/C）。

#### 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		
闫沛贤	总经理助理兼固定收益部总监、本基金基金经理	2015-12-28	-	13	闫沛贤先生，英国帝国理工大学金融学硕士。2008年至2013年曾任职于平安银行资金交易部、北京银行资金交易部，担任债券交易员。2013年加入中加基金管理有限公司，曾任中加丰泽纯债债券型证券投资基金基金经理（2016年12月19日至2018年6月22日）、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2018年12月13日至2019年12月30日）、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理（2018年11月27日至2020年11月23日）、中加货币市场基金（2013年10月21日至2021年1月29日），现任总经理助理兼固定收益部总监、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（2014年3月24日至今）、中加纯债债券型证券投资

					基金（2014年12月17日至今）、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（2015年12月28日至今）、中加颐合纯债债券型证券投资基金（2018年9月13日至今）、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金（2018年11月8日至今）、中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金（2019年5月29日至今）、中加科盈混合型证券投资基金（2019年11月29日至今）的基金经理。
王梁	本基金基金经理	2019-10-23	-	13	王梁先生，北京交通大学产业经济学硕士。2008年至2015年曾历任山西证券、英大证券研究部、方正证券自营部汽车、机械行业研究员。2015年加入中加基金管理有限公司，担任公司汽车机械行业和主题策略研究员，拥有近10年行业研究经验。2017年起担任中加基金专户投资经理。现担任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金（2018年8月14日至今）、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（2019年10月23日至今）、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金（2020年04月24日至今）、中加科享混合

					型证券投资基金（2020年1月4日至今）、中加科鑫混合型证券投资基金（2021年5月26日至今）的基金经理。
--	--	--	--	--	--

- 1、任职日期说明：闫沛贤、王梁的任职日期以增聘公告为准。
- 2、离任日期说明：无。
- 3、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
- 4、本基金无基金经理助理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，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

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》，对买卖债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，本基金的基金管理人不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了同日反向交易控制的规则，并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时，公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，定期对组合间的同向交易进行分析。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果，表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，债券市场震荡中整体小幅下行，1年和10年期国债收益率分别较去年末下行了4BP和6BP，分别至2.43%和3.08%。具体看，年初，在永煤违约事件的冲击下，央行呵护态度明确，隔夜融资成本位于1%以下。加上中央经济工作会议不急转弯的定调加速了做多情绪释放，短端1年期国债快速下行13BP，长端波幅有限，曲线陡峭化。1月下旬开始，央行在公开市场上逐步回笼流动性，春节前也迟迟不投放跨节资金，资金面持续收紧。同时，股票市场的狂热带动风险偏好提升。叠加春节假期期间，亚洲股市连续大涨，大宗商品价格快速攀升，原油、铜、锂等屡创新高，通胀预期不断发酵，节前节后债市震荡中上行，1年和10年期国债收益率分别至上半年高点2.72%和3.28%。随后，在财政资金投放的助力下，加上“两会”期间呵护，随后，一季度货币政策执行报告公布，市场对流动性合理充裕预期得到强化。而且央行开辟专栏阐明通胀影响可控，此后国常会也多次强调“保供稳价”，大宗商品价格大幅下挫。另外，市场担忧的地方债供给也迟迟未落地，叠加投资者杠杆和久期普遍较低，债市再度进入温和上涨阶段。10年期国债收益率震荡下行至上半年低点3.04%。进入6月，上月通胀担忧再起，叠加地方债供给开始放量，中美也重启对话，风险偏好不利于债券标的，国债期货震荡下挫。之后，资金面推升行情再度出现，DR007维持稳定，年中跨季时点，央行也将100亿滚续操作改成300亿，债券情绪显著回暖。

报告期内，债券方面，我们总体采用哑铃型策略，一方面，可享有短端票息收益。操作上，我们卖出长久期债券，并在严格甄别信用风险的前提下，买入短久期票息相对较高的中高等级信用债，行业分布以城投债为主。另一方面，可把握住交易性机会。比如，从4月下旬开始，在基本面外热内冷结构仍不平衡、地方债发行迟迟未放量、通胀担忧后移及货币政策仍以稳为主的背景下，我们择机参与高流动性利率债波动操作，博弈利率下行带来的资本利得。转债方面，我们选择板块轮动和个券的中长期逻辑来应对短期的不确定性。在控制波动风险的前提下，自上而下精选优质板块和个券，增厚产品收益。

2021年二季度，大宗商品边际涨幅放缓，全球经济缓慢复苏，生产资料供需不平衡的状况环节，通胀滞胀预期逐渐消退。受益于碳中和、能源革命、人工智能、生命科学等行业的快速发展，相关行业的盈利迅速提升，以新能源、半导体、医药板块为代表的科技创新型赛道出现明显涨幅。本产品组合进行了部分调整，卖出估值明显高于业绩增速的相关标的，加仓了部分估值和业绩匹配度较好的细分行业龙头标的，整体行业配置仍以消费、科技、公用事业、金融等行业产业为主，行业配置相对均衡，在获得一定盈利的情况下力求较小的回撤幅度。整体仓位依旧保持中等水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加心享混合A基金份额净值为1.2191元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.32%，同期业绩比较基准收益率为0.45%；截至报告期末中加心享混合

C基金份额净值为1.2199元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.26%，同期业绩比较基准收益率为0.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，货币政策上，国常会年内首提降准，仅隔两日全面降准便落地，可见降准坚决果断，呵护态度明确。而且此前政治局会议和货币政策执行报告先后都强调了流动性合理充裕，货币政策总体取向仍是稳健，保持不缺不溢成为常态。基本上，虽然出口同比增速仍保持高位，但随着海外疫苗接种率的提高，供给逐步恢复，出口已有边际放缓的迹象。消费上，6月份数据显示，消费修复仍步履蹒跚，一方面是居民储蓄意愿上升，另一方面人均可支配收入增速仍低于实际GDP的增加，今年仍将逐步恢复，但是个慢变量。投资上，现在监管从房企融资，到银行融出、居民买房等多个维度调控，房地产投资增速已较高位回落。整体看，抛开基数效应的话，今年潜在增速大概率回落。而且长期来看，随着要素生产率下降，人口老龄化加深等因素，中国经济的潜在增速水平将逐步降低，利率中枢趋于回落。

整体看，我们认为债市短期内无忧，在资金面稳健的背景下，市场或维持震荡。中期在通胀和供给的双重压力下，较为谨慎。长期看，在潜在经济增速下行，叠加社融增速已经回落，GDP一季度见顶，PPI达到高点后回落的背景下，债市仍有比较大的机会。

展望2021年下半年，经历了2020年疫情和超常规政策的影响后，2021年经济复苏也必然伴随政策回归正常，只是目前在脆弱的经济复苏和通胀滞胀不断有预期冲击的环境下各国政策短期会摇摆不定，权益市场波动加大难以避免。

但我们认为，在全球经济政策随着疫情逐步回归正常，生产资料供需逐步恢复匹配，恶性通胀出现的概率较小，未来一段时间内全球仍将处于存量经济时代，资本和劳动力对经济增速的影响逐渐减少，劳动生产率及科学技术的提升才能对一国经济有明显促进。因此，我们中长期仍旧看好新能源、半导体、医药、工控等依靠科技进步的先进制造业，进而发掘在这些产业链的变革中能持续高速发展的细分行业龙头公司；同时对于国内而言，在大力发展新能源、半导体、智能制造、生命科学等行业的同时，受益于疫情的催化，相关上游支持产业的国产化必将如火如荼的进行。上述产业将是本产品重点关注的方向。

在配置方面，在这种政策多空交织和新兴行业盈利不断修复的背景下，权益投资策略注重业绩和估值的匹配度。目前A股市场整体估值合理，结构性机会多，随着经济逐步复苏，更多行业盈利将不断修复，预期相关公司股价和估值将逐步兑现业绩的修复和增长，2021年标的选择上盈利的稳定性和增速是关键，估值下有底上有顶，淡化短期波动。行业配置方面仍以相对均衡为主，在获得一定盈利的情况下力求较小的回撤幅度。整体仓位依旧保持中高水平。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组和风险内控小组。公司负责人（或其指定管理人员）任估值小组负责人，成员由固定收益部负责人、投资研究部门相关业务负责人、运营保障部门负责人、基金会计人员、投资研究相关人员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司分管风险管理业务的副总经理任风险内控小组负责人，成员包括风险管理部门、监察稽核部门相关人员、交易员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、本基金每份基金份额享有同等分配权；

4、基金可供分配利润为正的情况下，方可进行收益分配；

5、投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7、自2021年1月1日至2021年6月30日止，本基金未进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于人民币五千万元的情形。

### §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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在中加心享灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《中加心享灵活配置混合型证券投资基金2021年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## §6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：中加心享灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,868,949.55	8,672,024.45

结算备付金		2,550,021.79	9,131,235.41
存出保证金		26,784.76	26,654.63
交易性金融资产	6.4.7.2	1,633,522,666.32	1,684,953,167.14
其中：股票投资		218,629,911.32	199,699,352.54
基金投资		-	-
债券投资		1,414,892,755.00	1,485,253,814.60
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		-	2,401,239.41
应收利息	6.4.7.5	23,245,633.00	37,823,301.09
应收股利		-	-
应收申购款		559,532.31	19,898.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,663,773,587.73	1,743,027,520.13
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		419,973,968.38	272,148,102.34
应付证券清算款		9,197.53	3,003,732.00
应付赎回款		113,246.87	199,804.86
应付管理人报酬		605,165.70	742,157.73
应付托管费		201,721.89	247,385.90
应付销售服务费		1,885.33	1,403.14
应付交易费用	6.4.7.7	155,837.09	146,482.17

应交税费		152,798.12	169,271.99
应付利息		139,838.88	44,465.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	113,437.32	99,001.36
负债合计		421,467,097.11	276,801,806.79
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,019,041,525.15	1,254,646,073.62
未分配利润	6.4.7.10	223,264,965.47	211,579,639.72
所有者权益合计		1,242,306,490.62	1,466,225,713.34
负债和所有者权益总计		1,663,773,587.73	1,743,027,520.13

注：报告截止日2021年6月30日，A类基金份额净值人民币1.2191元，基金份额总额996,711,761.34份，C类基金份额净值人民币1.2199元，基金份额总额22,329,763.81份，总份额合计1,019,041,525.15份。

## 6.2 利润表

会计主体：中加心享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
<b>一、收入</b>		62,572,191.95	87,085,462.23
1.利息收入		36,988,784.94	41,530,413.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	87,412.49	159,604.94
债券利息收入		36,741,482.15	41,292,522.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		159,890.30	78,286.50
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,683,981.58	17,364,882.38
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,650,770.85	14,218,095.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,320,324.41	2,261,056.70
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.4	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,353,535.14	885,730.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	14,868,834.38	28,181,720.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	30,591.05	8,445.04
<b>减：二、费用</b>		9,614,072.09	10,838,749.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,064,721.55	4,655,057.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,354,907.22	1,551,685.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8,199.59	2,796.56
4. 交易费用	6.4.7.18	195,087.25	522,609.73
5. 利息支出		3,769,136.44	3,874,183.75
其中：卖出回购金融资产 支出		3,769,136.44	3,874,183.75
6. 税金及附加		101,024.85	109,390.63
7. 其他费用	6.4.7.19	120,995.19	123,026.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		52,958,119.86	76,246,712.43
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		52,958,119.86	76,246,712.43

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：中加心享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06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)	1,254,646,073.62	211,579,639.72	1,466,225,713.34
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	52,958,119.86	52,958,119.86
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)	-235,604,548.47	-41,272,794.11	-276,877,342.58
其中：1.基金申购款	15,424,517.60	3,133,039.96	18,557,557.56
2.基金赎回款	-251,029,066.07	-44,405,834.07	-295,434,900.14
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)	1,019,041,525.15	223,264,965.47	1,242,306,490.62
项目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06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)	1,393,097,186.00	118,078,116.89	1,511,175,302.89
二、本期经营活动产生 的基金净值变动	-	76,246,712.43	76,246,712.43

数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	9,846,680.96	1,234,462.35	11,081,143.31
其中：1.基金申购款	13,710,144.40	1,712,115.97	15,422,260.37
2.基金赎回款	-3,863,463.44	-477,653.62	-4,341,117.06
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)	1,402,943,866.96	195,559,291.67	1,598,503,158.63

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：

夏英

陈昕

陈昕

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

中加心享灵活配置混合型证券投资基金已经中国证券监督管理委员会2015年7月10日证监许可[2015]1598号《关于准予中加心享灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准募集，由中加基金管理有限公司(以下简称“中加基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加心享灵活配置混合型证券投资基金合同》(以下简称“《基金合同》”)公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金，托管人为中国光大银行股份有限公司(以下简称“光大银行”)。

本基金通过中加基金及北京银行股份有限公司(以下简称“北京银行”)的代销网点公开发售，募集期为2015年11月23日至2015年11月27日。本基金于2015年12月2日成立，成立之日基金实收份额为2,772,993,297.72份(含利息转份额人民币48,368.47元)，发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

本基金根据销售服务费及认购/申购费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。收取认购/申购费，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；不收取认购/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，成为C类基金份额。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款，货币市场工具等)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)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况、2021年中期的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金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所采用的会计政策、会计估计相一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金财务报表的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的编制期间为2021年1月1日至2021年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持

有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

(2) 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

(3) 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

(1) 所转移金融资产的账面价值

(2) 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：



公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平

准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的收入差异较小的可采用合同利率。

公允价值变动损益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的支出差异较小的可采用合同利率。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配。每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中债金融估值中心有限公司独立提供。

### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得

税若干优惠政策的通知》、财税[2008]132号文《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《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号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务规定，本基金适用的主要税项列示如下：

#### 1. 印花税

(1)自2008年9月19日起，证券（股票）交易印花税征收方式调整为单边征税，即对出让方按1‰的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

(2)股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东(本基金)支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 2. 企业所得税

(1)自2014年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

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

(3)股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东(本基金)支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东(本基金)应缴纳的企业所得税。

#### 3. 个人所得税

(1)自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

(2)股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东(本基金)支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东(本基金)应缴纳的个人所得税。

(3)自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在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，股息红利所得暂免征收个人所得税。对证券投资基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利，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. 增值税

(1)经国务院批准,自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,金融业全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。本基金适用不征增值税项目:存款利息收入。本基金适用免征增值税项目:①国债、地方政府债利息收入;②证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的金融商品转让收入;③金融同业往来利息收入。

(2)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。

(3)自2018年1月1日起,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外;管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

(4)增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加,以实际缴纳的增值税税额为计税依据,分别按5%、3%和2%的比例缴纳。

## 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06月30日
活期存款	3,868,949.55
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	3,868,949.55

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
----	--------------------

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	145,370,649.12	218,629,911.32	73,259,262.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	174,569,746.08	177,647,755.00
	银行间市场	1,241,228,353.65	1,237,245,000.00
	合计	1,415,798,099.73	1,414,892,755.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,561,168,748.85	1,633,522,666.32	72,353,917.47

#### 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/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

本基金在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06月30日
应收活期存款利息	3,713.48
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	1,147.50
应收债券利息	23,240,760.02

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	12.00
合计	23,245,633.00

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产（其他应收款和待摊费用）。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	128,063.57
银行间市场应付交易费用	27,773.52
合计	155,837.09

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.13
应付证券出借违约金	-
预提费用	113,435.19
合计	113,437.32

注：预提费用包括预提信息披露费、预提审计费和预提账户维护费。

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 中加心享混合A

金额单位：人民币元

项目 (中加心享混合A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,239,901,854.08	1,239,901,854.08
本期申购	1,021,678.57	1,021,678.57
本期赎回(以“-”号填列)	-244,211,771.31	-244,211,771.31
本期末	996,711,761.34	996,711,761.34

#### 6.4.7.9.2 中加心享混合C

金额单位：人民币元

项目 (中加心享混合C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	14,744,219.54	14,744,219.54
本期申购	14,402,839.03	14,402,839.03
本期赎回(以“-”号填列)	-6,817,294.76	-6,817,294.76
本期末	22,329,763.81	22,329,763.81

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 中加心享混合A

单位：人民币元

项目 (中加心享混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	140,934,197.97	68,138,991.41	209,073,189.38
本期利润	37,655,356.13	14,600,913.83	52,256,269.96
本期基金份额交易产生的变动数	-32,498,984.94	-10,475,277.95	-42,974,262.89
其中：基金申购款	139,117.52	62,323.76	201,441.28
基金赎回款	-32,638,102.46	-10,537,601.71	-43,175,704.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	146,090,569.16	72,264,627.29	218,355,196.45



## 6.4.7.10.2 中加心享混合C

单位：人民币元

项目 (中加心享混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,838,432.98	668,017.36	2,506,450.34
本期利润	433,929.35	267,920.55	701,849.90
本期基金份额交易产生的变动数	1,233,586.63	467,882.15	1,701,468.78
其中：基金申购款	2,197,442.74	734,155.94	2,931,598.68
基金赎回款	-963,856.11	-266,273.79	-1,230,129.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,505,948.96	1,403,820.06	4,909,769.02

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	45,794.06
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	41,421.62
其他	196.81
合计	87,412.49

## 6.4.7.12 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01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	57,262,268.27
减：卖出股票成本总额	46,611,497.42
买卖股票差价收入	10,650,770.85

**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01月01日至2021年06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	-1,320,324.41
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	-1,320,324.41

**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01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,728,658,734.56
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,681,627,079.88
减：应收利息总额	48,351,979.09
买卖债券差价收入	-1,320,324.41

注：本基金本报告期内无债转股业务。

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金在本报告期内无债券投资赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金在本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金在本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,353,535.14
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	1,353,535.14

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1.交易性金融资产	14,868,834.38
——股票投资	15,527,485.22
——债券投资	-658,650.84
——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	14,868,834.38

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	30,591.05
合计	30,591.05

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	166,199.75
银行间市场交易费用	28,887.50
合计	195,087.25

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	44,927.82
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
上清所账户维护费	6,960.00
中债登账户维护费	9,000.00
上清所查询费	600.00
合计	120,995.19

### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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

本报告期不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。

### 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
中加基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人
北京银行股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

以下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

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过交易。

### 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

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

## 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01月01日至202 1年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,064,721.55	4,655,057.25
其中：支付销售机构的客户维护费	45,045.52	5,923.66

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/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01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,354,907.22	1,551,685.74

注：支付基金托管人光大银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加心享混合A	中加心享混合C	合计
中加基金 管理有限 公司	0.00	14.82	14.82
北京银行 股份有限 公司	0.00	4,995.82	4,995.82
合计	0.00	5,010.64	5,010.64
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加心享混合A	中加心享混合C	合计
中加基金 管理有限 公司	0.00	16.38	16.38
北京银行 股份有限	0.00	1,720.39	1,720.39

公司			
合计	0.00	1,736.77	1,736.77

注：本基金仅针对C类基金份额收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日该类基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C类基金日基金销售服务费=C类基金前一日基金资产净值×0.10%/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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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 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

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

##### 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

份额单位：份

中加心享混合A

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
北京银行股份有限公司	976,880,667.76	95.86%	976,880,667.76	77.86%

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金 C 类份额。

##### 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01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大	3,868,949.55	45,794.06	22,627,556.61	60,186.55

银行股份 有限公司				
--------------	--	--	--	--

注：本基金通过“光大银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于2021年6月30日的相关余额合计为人民币2,576,806.55元（2020年6月30日：人民币12,194,896.88元）。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与各关联方承销的证券。

#### 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——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021年06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
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	首次公开发行带锁定期	47.33	251.96	826	39,094.58	208,118.96	-
688661	和林微纳	2021-03-19	2021-09-29	首次公开发行带锁定期	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
688323	瑞华泰	2021-04-21	2021-10-28	首次公开	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14	-



				发行带锁定期						
688607	康众医疗	2021-01-25	2021-08-02	首次公开发行带锁定期	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行带锁定期	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	首次公开发行带锁定期	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688663	新风光	2021-04-06	2021-10-13	首次公开发行带锁定期	14.48	19.21	3,279	47,479.92	62,989.59	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-01-07	新股未上市	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-

				市						
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-01-05	新股未上市	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-01-06	新股未上市	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-01-06	新股未上市	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	首次公开发行带锁定期	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	首次公开发行带锁定期	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋	2021-06-22	2021-12-30	首次	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-

	医药			公开发行 带锁 定期						
6882 26	威腾 电气	2021- 06-28	2021- 07-07	新股 未上 市	6.42	6.42	2,693	17,28 9.06	17,28 9.06	-
3009 32	三友 联众	2021- 01-15	2021- 07-22	首次 公开发 行带 锁定期	24.69	31.71	492	12,14 7.48	15,60 1.32	-
3009 68	格林 精密	2021- 04-06	2021- 10-15	首次 公开发 行带 锁定期	6.87	12.07	1,162	7,98 2.94	14,02 5.34	-
3009 40	南极 光	2021- 01-27	2021- 08-03	首次 公开发 行带 锁定期	12.76	43.38	307	3,91 7.32	13,31 7.66	-
3006 14	百川 畅银	2021- 05-18	2021- 11-25	首次 公开发 行带 锁定期	9.19	40.38	329	3,02 3.51	13,28 5.02	-
3009 37	药易 购	2021- 01-20	2021- 07-27	首次 公开发 行带 锁定期	12.25	53.71	244	2,98 9.00	13,10 5.24	-
3009 42	易瑞 生物	2021- 02-02	2021- 08-09	首次 公开	5.31	28.52	443	2,35 2.33	12,63 4.36	-

				发行带锁定期						
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	首次公开发行带锁定期	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	首次公开发行带锁定期	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	首次公开发行带锁定期	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	首次公开发行带锁定期	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	首次公开发行带锁定期	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	首次公开发行带锁定期	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
3009	共同	2021-	2021-	首次	8.24	31.54	286	2,35	9,02	-

66	药业	03-31	10-11	公开发行 带锁 定期				6.64	0.44	
3009 45	曼卡 龙	2021- 02-03	2021- 08-10	首次公 开发行 带锁 定期	4.56	18.88	474	2,16 1.44	8,94 9.12	-
3009 31	通用 电梯	2021- 01-13	2021- 07-21	首次公 开发行 带锁 定期	4.31	13.11	672	2,89 6.32	8,80 9.92	-
3009 61	深水 海纳	2021- 03-23	2021- 09-30	首次公 开发行 带锁 定期	8.48	22.07	394	3,34 1.12	8,69 5.58	-
3009 50	德固 特	2021- 02-24	2021- 09-03	首次公 开发行 带锁 定期	8.41	39.13	219	1,84 1.79	8,56 9.47	-
6051 62	新中 港	2021- 06-29	2021- 07-07	新股 未上 市	6.07	6.07	1,377	8,35 8.39	8,35 8.39	-
3009 58	建工 修复	2021- 03-18	2021- 09-29	首次公 开发行 带锁 定期	8.53	27.22	300	2,55 9.00	8,16 6.00	-
3009 86	志特 新材	2021- 04-21	2021- 11-01	首次公 开	14.79	30.57	264	3,90 4.56	8,07 0.48	-

				发行带锁定期						
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	首次公开发行带锁定期	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行带锁定期	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	首次公开发行带锁定期	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	首次公开发行带锁定期	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	首次公开发行带锁定期	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	首次公开发行带锁定期	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
3009	江天	2020-	2021-	首次	13.39	30.10	217	2,90	6,53	-

27	化学	12-29	07-07	公开发行 带锁 定期				5.63	1.70	
3009 63	中洲 特材	2021- 03-30	2021- 10-11	首次公 开发 行 带锁 定期	12.13	22.49	283	3,43 2.79	6,36 4.67	-
3009 43	春晖 智控	2021- 02-03	2021- 08-10	首次公 开发 行 带锁 定期	9.79	23.01	255	2,49 6.45	5,86 7.55	-
3009 72	万辰 生物	2021- 04-08	2021- 10-19	首次公 开发 行 带锁 定期	7.19	12.65	430	3,09 1.70	5,43 9.50	-
3009 29	华骐 环保	2021- 01-12	2021- 07-21	首次公 开发 行 带锁 定期	13.87	29.55	183	2,53 8.21	5,40 7.65	-
3009 60	通业 科技	2021- 03-22	2021- 09-29	首次公 开发 行 带锁 定期	12.08	23.06	234	2,82 6.72	5,39 6.04	-
3010 07	德迈 仕	2021- 06-04	2021- 12-16	首次公 开发 行 带锁 定期	5.29	14.44	303	1,60 2.87	4,37 5.32	-

300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	首次公开发行带锁定期	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	首次公开发行带锁定期	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	首次公开发行带锁定期	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
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（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-16	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	3,550	355,000.00	355,000.00	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2021年6月30日，本基金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

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额341,073,968.38元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101900543	19哈尔滨投MTN001	2021-07-02	99.91	66,000	6,594,060.00
102000518	20河钢集MTN004	2021-07-02	92.16	500,000	46,080,000.00
200309	20进出09	2021-07-02	100.04	500,000	50,020,000.00
210205	21国开05	2021-07-02	101.25	400,000	40,500,000.00
210210	21国开10	2021-07-02	99.36	1,347,000	133,837,920.00
210210	21国开10	2021-07-05	99.36	800,000	79,488,000.00
合计				3,613,000	356,519,980.00

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额78,900,000.00元，于2021年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## 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

本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在控制风险并保持资产流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对金融工具的风险管理办法主要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，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的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范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指本基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国光大银行股份有限公司和信用风险较低的股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金投资于信用类产品以及投资于资产支持证券的信用级别评级应为BBB以上（含BBB），在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。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06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	59,972,000.00	49,990,000.00
合计	59,972,000.00	49,990,000.00

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为期限在一年及以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

##### 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**

无。

**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06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	469,166,999.60	675,109,814.60
AAA以下	606,789,755.40	740,070,000.00
未评级	278,964,000.00	20,084,000.00
合计	1,354,920,755.00	1,435,263,814.60

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央票。

3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**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所持金融工具变现的难易程度。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。

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金所持大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，除前文披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。

于2021年6月30日，本基金所承担的金融负债的合同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，因此账面余额约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

报告期内，本基金的流动性风险管理，按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性风险管理相关制度，对基金组合资产流动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

#### 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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金管理人定期对基金面临的利率敏感度缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年06 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	3,868,949.55	-	-	-	3,868,949.55
结算备付金	2,550,021.79	-	-	-	2,550,021.79
存出保证金	26,784.76	-	-	-	26,784.76
交易性金融资产	644,413,635.00	491,515,120.00	278,964,000.00	218,629,911.32	1,633,522,666.32
应收利息	-	-	-	23,245,633.00	23,245,633.00
应收申购款	-	-	-	559,532.31	559,532.31
资产总计	650,859,391.10	491,515,120.00	278,964,000.00	242,435,076.63	1,663,773,587.73
负债					
卖出回购金融资产	419,973,968.38	-	-	-	419,973,968.38

款					
应付证券清算款	-	-	-	9,197.53	9,197.53
应付赎回款	-	-	-	113,246.87	113,246.87
应付管理人报酬	-	-	-	605,165.70	605,165.70
应付托管费	-	-	-	201,721.89	201,721.89
应付销售服务费	-	-	-	1,885.33	1,885.33
应付交易费用	-	-	-	155,837.09	155,837.09
应交税费	-	-	-	152,798.12	152,798.12
应付利息	-	-	-	139,838.88	139,838.88
预提费用	-	-	-	113,435.19	113,435.19
应付赎回费	-	-	-	2.13	2.13
负债总计	419,973,968.38	-	-	1,493,128.73	421,467,097.11
利率敏感度缺口	230,885,422.72	491,515,120.00	278,964,000.00	240,941,947.90	1,242,306,490.62
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	8,672,024.45	-	-	-	8,672,024.45
结算备付金	9,131,235.41	-	-	-	9,131,235.41
存出保证金	26,654.63	-	-	-	26,654.63
交易性金融资产	707,183,434.60	778,070,380.00	-	199,699,352.54	1,684,953,167.14
应收证券清算款	-	-	-	2,401,239.41	2,401,239.41
应收利息	-	-	-	37,823,301.09	37,823,301.09
应收申购款	-	-	-	19,898.00	19,898.00
资产总计	725,013,349.09	778,070,380.00	-	239,943,791.04	1,743,027,520.13
负债					
卖出回购金融资产款	272,148,102.34	-	-	-	272,148,102.34
应付证券清算款	-	-	-	3,003,732.00	3,003,732.00
应付赎回款	-	-	-	199,804.86	199,804.86
应付管理人报酬	-	-	-	742,157.73	742,157.73
应付托管	-	-	-	247,385.90	247,385.90

费					
应付销售服务费	-	-	-	1,403.14	1,403.14
应付交易费用	-	-	-	146,482.17	146,482.17
应交税费	-	-	-	169,271.99	169,271.99
应付利息	-	-	-	44,465.30	44,465.30
预提费用	-	-	-	99,000.00	99,000.00
应付赎回费	-	-	-	1.36	1.36
负债总计	272,148,102.34	-	-	4,653,704.45	276,801,806.79
利率敏感度缺口	452,865,246.75	778,070,380.00	-	235,290,086.59	1,466,225,713.34

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予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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06月30日	上年度末 2020年12月31日
		市场利率下降25个基点	8,418,611.89
市场利率上升25个基点	-8,418,611.89	-4,492,892.79	

#### 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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格的风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

##### 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06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	218,629,911.32	17.60	199,699,352.54	13.62
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,414,892,755.00	113.89	1,485,253,814.60	101.30
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	1,633,522,666.32	131.49	1,684,953,167.14	114.92

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	14,761,015.75	15,036,104.60
业绩比较基准下降5%	-14,761,015.75	-15,036,104.60	

#### 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) 以公允价值计量的资产和负债

下述列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于2021年6月30日，本基金持有的持续的公允价值计量资产中属于第一层次的股票投资余额为217,130,943.82元，属于第二层次的股票投资余额为1,092,916.55元，属于第三层次的股票投资余额为406,050.95元，属于第一层次的债券投资余额为69,724,304.20元，属于第二层次的债券投资余额为1,344,813,450.80元，属于第三层次债券投资余额355,000.00元。

于2021年6月30日，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的三个层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

#### (a)第二层次及第三层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

#### (b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### (2)其他金融工具的公允价值(期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## §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	218,629,911.32	13.14
	其中：股票	218,629,911.32	13.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,414,892,755.00	85.04



	其中：债券	1,414,892,755.00	85.04
	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	6,418,971.34	0.39
8	其他各项资产	23,831,950.07	1.43
9	合计	1,663,773,587.73	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,439.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	166,444,019.22	13.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,209,116.39	0.18
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,531,717.14	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	7,811,023.00	0.63
H	住宿和餐饮业	2,773,465.00	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,698,430.87	0.14
J	金融业	14,094,763.60	1.13
K	房地产业	5,091,686.00	0.41
L	租赁和商务服务业	1,020,340.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	5,661,719.87	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	1,584,823.25	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	3,756,687.48	0.30
R	文化、体育和娱乐业	946,680.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	218,629,911.32	17.60

### 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	601633	长城汽车	206,800	9,014,412.00	0.73
2	600436	片仔癀	17,700	7,934,910.00	0.64
3	300059	东方财富	213,480	7,000,009.20	0.56
4	603659	璞泰来	49,840	6,808,144.00	0.55
5	002352	顺丰控股	99,626	6,744,680.20	0.54
6	600600	青岛啤酒	52,800	6,106,320.00	0.49
7	002129	中环股份	154,300	5,955,980.00	0.48
8	000858	五粮液	19,300	5,749,277.00	0.46
9	603986	兆易创新	30,284	5,690,363.60	0.46
10	002594	比亚迪	22,200	5,572,200.00	0.45
11	600703	三安光电	169,800	5,442,090.00	0.44
12	002690	美亚光电	92,100	5,135,496.00	0.41
13	002223	鱼跃医疗	112,600	4,293,438.00	0.35
14	601601	中国太保	148,200	4,293,354.00	0.35
15	600298	安琪酵母	74,600	4,056,748.00	0.33
16	603345	安井食品	15,600	3,962,712.00	0.32
17	600315	上海家化	65,000	3,909,100.00	0.31
18	300015	爱尔眼科	52,926	3,756,687.48	0.30

19	603127	昭衍新药	20,300	3,730,125.00	0.30
20	002507	涪陵榨菜	98,200	3,698,212.00	0.30
21	601100	恒立液压	39,072	3,357,066.24	0.27
22	600519	贵州茅台	1,600	3,290,720.00	0.26
23	000651	格力电器	62,900	3,277,090.00	0.26
24	000661	长春高新	8,000	3,096,000.00	0.25
25	002695	煌上煌	186,900	2,958,627.00	0.24
26	603043	广州酒家	112,700	2,898,644.00	0.23
27	600741	华域汽车	109,900	2,887,073.00	0.23
28	000963	华东医药	60,900	2,802,009.00	0.23
29	600754	锦江酒店	48,700	2,773,465.00	0.22
30	000538	云南白药	23,884	2,763,856.48	0.22
31	002459	晶澳科技	55,600	2,724,400.00	0.22
32	688329	艾隆科技	49,503	2,705,833.98	0.22
33	600036	招商银行	49,900	2,704,081.00	0.22
34	002371	北方华创	9,700	2,690,586.00	0.22
35	300124	汇川技术	35,850	2,662,221.00	0.21
36	002080	中材科技	99,200	2,596,064.00	0.21
37	300327	中颖电子	29,900	2,548,377.00	0.21
38	600729	重庆百货	87,700	2,407,365.00	0.19
39	600660	福耀玻璃	42,900	2,395,965.00	0.19
40	000725	京东方 A	378,500	2,361,840.00	0.19
41	002475	立讯精密	50,700	2,332,200.00	0.19
42	300957	贝泰妮	8,251	2,225,417.21	0.18
43	600900	长江电力	106,400	2,196,096.00	0.18
44	300601	康泰生物	13,800	2,056,200.00	0.17
45	300782	卓胜微	3,780	2,031,750.00	0.16
46	603755	日辰股份	32,300	2,016,166.00	0.16
47	001914	招商积余	114,500	1,967,110.00	0.16
48	600690	海尔智家	73,900	1,914,749.00	0.15
49	600761	安徽合力	169,200	1,871,352.00	0.15

50	002460	赣锋锂业	15,100	1,828,459.00	0.15
51	600309	万华化学	16,400	1,784,648.00	0.14
52	605338	巴比食品	53,700	1,736,121.00	0.14
53	688065	凯赛生物	16,028	1,681,176.92	0.14
54	600383	金地集团	162,100	1,659,904.00	0.13
55	300624	万兴科技	27,840	1,630,867.20	0.13
56	600323	瀚蓝环境	71,100	1,549,269.00	0.12
57	002832	比音勒芬	60,400	1,545,636.00	0.12
58	300747	锐科激光	13,400	1,528,404.00	0.12
59	600438	通威股份	34,800	1,505,796.00	0.12
60	600862	中航高科	48,000	1,477,440.00	0.12
61	600641	万业企业	80,300	1,464,672.00	0.12
62	603558	健盛集团	160,500	1,394,745.00	0.11
63	002938	鹏鼎控股	38,300	1,374,204.00	0.11
64	002821	凯莱英	3,600	1,341,360.00	0.11
65	300999	金龙鱼	15,700	1,333,872.00	0.11
66	300012	华测检测	38,300	1,221,004.00	0.10
67	603713	密尔克卫	9,600	1,036,608.00	0.08
68	601888	中国中免	3,400	1,020,340.00	0.08
69	300413	芒果超媒	13,800	946,680.00	0.08
70	603313	梦百合	30,771	924,668.55	0.07
71	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.05
72	300896	爱美客	801	631,892.88	0.05
73	688660	电气风电	51,238	450,894.40	0.04
74	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.03
75	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.03
76	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.03
77	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.02
78	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.01
79	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
80	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.01

81	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.01
82	300991	创益通	2,535	89,214.50	0.01
83	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.01
84	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
85	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
86	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.01
87	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
88	688663	新风光	3,279	62,989.59	0.01
89	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
90	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
91	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
92	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
93	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.00
94	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
95	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
96	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
97	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
98	300887	谱尼测试	378	33,789.42	0.00
99	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
100	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
101	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
102	300877	金春股份	569	20,922.13	0.00
103	300873	海晨股份	484	20,720.04	0.00
104	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
105	300878	维康药业	401	18,714.67	0.00
106	300898	熊猫乳品	496	17,984.96	0.00
107	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
108	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
109	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
110	300913	兆龙互连	630	16,506.00	0.00
111	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00

112	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
113	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
114	300907	康平科技	473	13,915.66	0.00
115	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
116	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
117	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
118	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
119	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
120	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
121	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
122	300889	爱克股份	479	11,639.70	0.00
123	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
124	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
125	300895	铜牛信息	340	11,563.40	0.00
126	300879	大叶股份	466	11,267.88	0.00
127	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
128	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
129	300882	万胜智能	572	9,981.40	0.00
130	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
131	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
132	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
133	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
134	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
135	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
136	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
137	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
138	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
139	300950	德固特	219	8,569.47	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	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
146	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
147	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
148	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
149	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
150	300886	华业香料	191	6,194.13	0.00
151	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
152	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
153	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
154	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
155	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
156	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
157	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
158	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
159	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	002475	立讯精密	3,631,148.60	0.25
2	688329	艾隆科技	2,469,741.01	0.17
3	603986	兆易创新	2,465,044.00	0.17
4	002459	晶澳科技	2,424,716.00	0.17
5	605338	巴比食品	2,414,880.00	0.16
6	002690	美亚光电	2,407,025.85	0.16
7	002223	鱼跃医疗	2,405,250.00	0.16
8	000725	京东方 A	2,404,185.00	0.16

9	600660	福耀玻璃	2,398,062.32	0.16
10	600745	闻泰科技	2,344,354.00	0.16
11	000858	五粮液	2,315,928.50	0.16
12	002013	中航机电	2,301,348.00	0.16
13	600519	贵州茅台	2,280,600.00	0.16
14	600741	华域汽车	2,237,616.00	0.15
15	600761	安徽合力	2,200,686.00	0.15
16	001914	招商积余	2,173,884.00	0.15
17	601888	中国中免	1,173,544.00	0.08
18	600641	万业企业	1,100,710.00	0.08
19	688819	天能股份	673,111.53	0.05
20	688538	和辉光电	629,899.70	0.04

#### 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	600030	中信证券	5,415,604.86	0.37
2	300999	金龙鱼	3,897,831.00	0.27
3	600745	闻泰科技	3,434,223.00	0.23
4	300251	光线传媒	3,231,522.00	0.22
5	601633	长城汽车	2,417,939.00	0.16
6	002475	立讯精密	2,268,775.70	0.15
7	000625	长安汽车	2,172,069.00	0.15
8	002013	中航机电	1,824,054.00	0.12
9	000895	双汇发展	1,812,541.81	0.12
10	600588	用友网络	1,632,328.00	0.11
11	603214	爱婴室	1,463,354.48	0.10
12	600699	均胜电子	1,351,420.00	0.09
13	603212	赛伍技术	1,229,983.00	0.08
14	000651	格力电器	1,229,023.00	0.08



15	688425	铁建重工	1,071,702.68	0.07
16	300136	信维通信	1,055,061.00	0.07
17	002352	顺丰控股	1,049,601.00	0.07
18	601933	永辉超市	1,048,225.00	0.07
19	688538	和辉光电	919,891.26	0.06
20	688819	天能股份	884,365.40	0.06

### 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	50,014,570.98
卖出股票收入（成交）总额	57,262,268.27

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	338,936,000.00	27.28
	其中：政策性金融债	338,936,000.00	27.28
4	企业债券	167,993,450.80	13.52
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	837,884,000.00	67.45
7	可转债(可交换债)	70,079,304.20	5.64
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,414,892,755.00	113.89

### 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	210210	21国开10	2,400,000	238,464,000.00	19.20
2	101753003	17营口港MTN001	1,000,000	102,080,000.00	8.22
3	101654074	16京煤MTN001	1,000,000	100,940,000.00	8.13
4	101662058	16镇江城建MTN002	700,000	70,504,000.00	5.68
5	200309	20进出09	500,000	50,020,000.00	4.03

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**  
本基金本报告期末未持有贵金属。

**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**  
本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**  
本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

### 7.12 投资组合报告附注

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

**7.12.2 本报告期内，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	26,784.76

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,245,633.00
5	应收申购款	559,532.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,831,950.07

#### 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	110053	苏银转债	24,272,000.00	1.95
2	110059	浦发转债	15,364,500.00	1.24
3	127018	本钢转债	13,447,749.60	1.08
4	110064	建工转债	8,916,390.40	0.72
5	110066	盛屯转债	6,445,365.00	0.52

#### 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

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### §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

份额	持	户均持有的	持有人结构
----	---	-------	-------

级别	有人户数 (户)	基金份额	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
中加心享混合A	185	5,387,631.14	995,185,865.19	99.85%	1,525,896.15	0.15%
中加心享混合C	1,145	19,501.98	2,332,944.56	10.45%	19,996,819.25	89.55%
合计	1,330	766,196.64	997,518,809.75	97.89%	21,522,715.40	2.11%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中加心享混合A	14,962.75	0.00%
	中加心享混合C	10,019.26	0.04%
	合计	24,982.01	0.00%

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	中加心享混合A	中加心享混合C
基金合同生效日(2015年12月02日)基金份额总额	2,772,993,297.72	100.00
本报告期期初基金份额总额	1,239,901,854.08	14,744,219.54
本报告期基金总申购份额	1,021,678.57	14,402,839.03
减：本报告期基金总赎回份额	244,211,771.31	6,817,294.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	996,711,761.34	22,329,763.81

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。自2016年3月29日起，本基金增加C类基金份额，初始申购份额为100份。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金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

基金管理人本报告期内人事变动情况：无。

基金托管人本报告期内人事变动情况：无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日期起至今聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处罚。

## 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	
华西证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	20,333,439.87	20.66%	14,870.22	20.66%	-
兴业证券	2	78,077,551.68	79.34%	57,098.08	79.34%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1.公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

- (1) 基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；
- (2) 公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；
- (3) 研究服务实力。

2.券商及交易单元的选择流程如下：

- (1) 投资研究部经集体讨论后遵照《中加基金管理有限公司交易单元管理办法》标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；
- (2) 公司执行委员会负责审批、确定券商名单及相应的席位租用安排；
- (3) 券商名单及相应的席位租用安排确定后,由监察稽核门部负责审查相关协议内容,交易室负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

3.投资研究部于每年第一季度内根据《券商选择标准评分表》对券商进行重新评估,拟定是否需要新增、续用或取消券商、调整相应席位安排,并报公司执行委员会审批、确定。

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	646,500,00 0.00	11.8 0%	-	-	-	-
兴业证券	102,883,94 0.16	64.5 3%	3,548,100,0 00.00	64.7 7%	-	-	-	-
中信建投	56,550,76 9.06	35.4 7%	1,283,280,0 00.00	23.4 3%	-	-	-	-

### 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	中加心享灵活配置混合型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
2	中加心享灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-08
3	中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-08
4	中加基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-08
5	中加心享灵活配置混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-10
6	中加心享灵活配置混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-10
7	中加心享灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-10

	新)		
8	中加心享灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
9	中加基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京度小满基金销售有限公司为代理销售机构并开通基金定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-16
10	中加心享灵活配置混合型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21
11	中加心享灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-02
12	中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-02
13	中加心享灵活配置混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-07
14	中加心享灵活配置混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-07
15	中加心享灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-07

## §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	20210101-20210630	976,880,667.76	0.00	0.00	976,880,667.76	95.86%
产品特有风险							
本基金报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该投资者所持有的基金份额的占比较大，该投资者在赎回所持有的基金份额时，存在基金份额净值波动的风险；另外，该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时，基金可能存在为应对赎回证券变现产							



生的冲击成本。

## 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、中国证监会批准中加心享灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加心享灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

### 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：北京市西城区南纬路35号综合办公楼

基金托管人地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：[www.bobbns.com](http://www.bobbns.com)

中加基金管理有限公司  
二〇二一年八月二十七日