

华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金
2021 年中期报告
2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	52
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	52
9	开放式基金份额变动	53
10	重大事件揭示	53
10.1	基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4	基金投资策略的改变	53
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	53
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8.2	基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况	55
10.9	其他重大事件	55
11	影响投资者决策的其他重要信息	57
12	备查文件目录	57
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	华安安进灵活配置混合
基金主代码	002768
交易代码	002768
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2019 年 1 月 15 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	347,531,920.63 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过对权益类资产和固定收益类资产的灵活配置充分捕捉各证券子市场的投资收益机会，在合理控制风险、保障基金资产流动性的前提下，力求持续高效地获取稳健回报。
投资策略	<p>本基金为混合型基金，在投资中将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，结合投资时钟理论并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例；当市场环境发生变化时，本基金将依托仓位弹性优势并借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，对大类资产配置比例进行及时调整。</p> <p>此外，本基金还将广泛运用各种定量和定性分析模型研究和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会，以确定基金资产在各类具体券种间的配置比例。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	张燕
	联系电话	021-38969999	0755-83199084
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	95555
传真		021-68863414	0755-83195201

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	朱学华	缪建民

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	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	28,519,072.46
本期利润	22,266,783.56
加权平均基金份额本期利润	0.0442
本期加权平均净值利润率	3.02%
本期基金份额净值增长率	3.52%
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	173,602,127.55
期末可供分配基金份额利润	0.4995
期末基金资产净值	521,134,048.18
期末基金份额净值	1.4995
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	40.93%

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	1.28%	0.22%	-1.26%	0.48%	2.54%	-0.26%
过去三个月	3.94%	0.20%	2.33%	0.59%	1.61%	-0.39%
过去六个月	3.52%	0.33%	0.49%	0.79%	3.03%	-0.46%
过去一年	25.23%	0.55%	14.85%	0.79%	10.38%	-0.24%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	40.93%	0.51%	40.04%	0.79%	0.89%	-0.28%

3.2.2 自基金转型以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019 年 1 月 15 日至 2021 年 6 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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部高级总监	2016-07-05	-	23 年	金融学硕士（金融工程方向），23 年证券、基金从业经历。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。2008 年 4 月起担任华安稳定收益债券基金的基金经理。2011 年 6 月至 2021 年 3 月，同时担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 12 月至 2017 年 6 月担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 6 月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 10 月至 2017 年 7 月同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安现金富利投资基金的基金经理。2014 年 7 月至 2017 年 7 月同时担任华安汇财通货币

				<p>市场基金的基金经理。2015 年 2 月至 2017 年 6 月担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2017 年 7 月，担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 9 月至 2018 年 9 月，担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月至 2019 年 12 月，同时担任华安新乐享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 7 月，同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月至 2018 年 8 月，同时担任华安安华保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 1 月，同时担任华安安进保本混合型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月起，同时担任华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2017 年 12 月，同时担任华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月，同时担任华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起，同时担任华安新活力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 2 月至 2018 年 6 月，同时担任华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月至 2020 年 2 月，同时担任华安安盛 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 10 月起，同时担任华安安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安锦源 0-7 年金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基</p>
--	--	--	--	---

					金的基金经理。
马丁	本基金的基金经理	2021-01-18	-	5 年	博士研究生，5 年证券基金行业从业经验。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。2018 年 1 月加入华安基金，历任指数与量化投资部基金经理助理。2019 年 3 月起，担任华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月起，同时担任华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
孙晨进	本基金的基金经理、指数与量化投资部助理总监	2019-07-29	2021-01-18	10 年	硕士研究生，10 年基金行业从业经验，具有基金从业资格证书。2010 年应届毕业生进入华安基金，先后担任指数投资部数量分析师、投资经理、基金经理助理。2015 年 3 月至 2019 年 1 月，担任华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2019 年 1 月至 2021 年 1 月，同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)的基金经理。2015 年 3 月至 2015 年 12 月，同时担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月至 2021 年 1 月，同时担任华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 1 月至 2018 年 9 月，同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 1 月至 2019 年 8 月，同时担任华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月至 2021 年 1 月，同时担任华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月至 2021 年 1 月，同时担任华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金、华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵

从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进

行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，宏观经济继续复苏，企业盈利持续改善，同时全球流动性保持宽裕，市场风险偏好整体上行，上半年主要指数均呈现震荡上行的走势，其中上证指数上涨 3.40%，深圳成指上涨 4.78%，沪深 300 上涨 0.24%，创业板指上涨 17.22%。从行业表现来看，约 2/3 的行业实现了正收益，其中基础化工、钢铁和新能源板块均获得了超过 20% 的指数涨幅，非银、家电、军工板块的指数跌幅则超过了 10%，整体分化还是比较大。从风格来看，周期和成长风格涨幅领先，消费风格表现稳定，金融风格相对落后。

基金管理人采用多因子指数增强策略，根据市场风格的变化，逐渐增加了成长风格暴露。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金份额净值为 1.4995 元，本报告期份额净值增长率为 3.52%，同期业绩比较基准增长率为 0.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年股票市场，企业整体盈利依然在改善，降准后流动性充裕，社融将逐步企稳，预计股市

整体震荡，机会依然在行业景气度向好、盈利增长方向明确的行业和个股，我们关注“碳中和”、硬科技和新消费等高景气方向。下一步组合将关注盈利快速增长的高景气行业和个股，维持债券中短久期和高信用等级策略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	15,379,393.57	44,259,637.10
结算备付金		26,851.64	1,327,430.12
存出保证金		32,794.98	151,828.06
交易性金融资产	6.4.7.2	481,442,881.37	634,931,864.86
其中：股票投资		138,876,681.37	173,938,613.46
基金投资		-	-
债券投资		342,566,200.00	460,993,251.40
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	20,000,130.00	100,000,000.00
应收证券清算款		717,434.99	778,799.78
应收利息	6.4.7.5	4,305,524.24	3,865,026.51
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		521,905,010.79	785,314,586.43
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		30.14	200.87
应付管理人报酬		282,327.10	391,773.37
应付托管费		117,636.30	163,238.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	268,610.55	709,699.64
应交税费		3,179.57	26,621.44
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	99,178.95	170,000.13
负债合计		770,962.61	1,461,534.33
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	347,531,920.63	541,166,203.12
未分配利润	6.4.7.10	173,602,127.55	242,686,848.98
所有者权益合计		521,134,048.18	783,853,052.10
负债和所有者权益总计		521,905,010.79	785,314,586.43

注：报告截至日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4995 元，基金份额总额 347,531,920.63 份。

6.2 利润表

会计主体：华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		26,170,384.97	3,311,703.94
1.利息收入		8,247,425.40	696,692.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	184,428.78	117,699.13
债券利息收入		6,960,400.33	578,993.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,102,596.29	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		24,175,247.26	5,125,774.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,991,990.51	3,972,281.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,129,388.41	220,676.93
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.14	1,053,868.34	932,815.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-6,252,288.90	-2,510,763.65
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1.21	0.40
减：二、费用		3,903,601.41	728,531.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2	2,203,752.36	389,504.07
2. 托管费	6.4.10.2	918,230.22	162,293.36
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	607,626.41	65,672.99
5. 利息支出		35,281.15	-
其中：卖出回购金融资产支出		35,281.15	-
6.税金及附加		7,736.46	1,788.94
7. 其他费用	6.4.7.18	130,974.81	109,272.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,266,783.56	2,583,172.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,266,783.56	2,583,172.35

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金

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）	541,166,203.12	242,686,848.98	783,853,052.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,266,783.56	22,266,783.56
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）	-193,634,282.49	-91,351,504.99	-284,985,787.48
其中：1.基金申购款	868.18	415.18	1,283.36

2.基金赎回款	-193,635,150.67	-91,351,920.17	-284,987,070.84
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）	347,531,920.63	173,602,127.55	521,134,048.18
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）	126,860,355.30	20,437,927.44	147,298,282.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,583,172.35	2,583,172.35
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）	-17,505,374.70	-1,434,136.38	-18,939,511.08
其中：1.基金申购款	13,054,251.72	1,945,147.22	14,999,398.94
2.基金赎回款	-30,559,626.42	-3,379,283.60	-33,938,910.02
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）	109,354,980.60	21,586,963.41	130,941,944.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)由华安安进保本混合型发起式证券投资基金转型而成，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]888号《关于准予华安安进保本混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2016年7月5日生效，首次设立募集规模为1,831,061,042.72份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华安安进保本混合型发起式证券投资基金基金合同》以及《华安安进保本混合基金保本到期安排及转型为华安安进灵活配置混合基金相关业务规则的公告》的约定，本基金自 2019 年 1 月 15 日起转型为非保本的混合型证券投资基金并更名为华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、权证、股指期货等权益类金融工具，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、资产支持证券、债券回购、银行存款等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金整体业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2021 年 8 月 25 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变

动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有

关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

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

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

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

6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 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	15,379,393.57
定期存款	-
其他存款	-
合计	15,379,393.57

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	119,975,009.14	138,876,681.37	18,901,672.23
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	61,057,200.00	61,279,200.00	222,000.00
	银行间市场	279,944,844.51	281,287,000.00	1,342,155.49
	合计	341,002,044.51	342,566,200.00	1,564,155.49
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		460,977,053.65	481,442,881.37	20,465,827.72

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

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	20,000,130.00	-
合计	20,000,130.00	-

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	10,736.18
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	12.10
应收债券利息	4,290,507.60
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	4,253.56
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	14.80
合计	4,305,524.24

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	254,943.54
银行间市场应付交易费用	13,667.01
合计	268,610.55

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	-
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	39,671.58
合计	99,178.95

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	541,166,203.12	541,166,203.12
本期申购	868.18	868.18
本期赎回（以“-”号填列）	-193,635,150.67	-193,635,150.67
本期末	347,531,920.63	347,531,920.63

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	305,975,191.53	-63,288,342.55	242,686,848.98
本期利润	28,519,072.46	-6,252,288.90	22,266,783.56
本期基金份额交易产生的变动数	-117,530,310.53	26,178,805.54	-91,351,504.99
其中：基金申购款	528.22	-113.04	415.18
基金赎回款	-117,530,838.75	26,178,918.58	-91,351,920.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	216,963,953.46	-43,361,825.91	173,602,127.55

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	178,582.28
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,110.69
其他	735.81
合计	184,428.78

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	211,052,520.03
减：卖出股票成本总额	189,060,529.52
买卖股票差价收入	21,991,990.51

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	746,949,216.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	739,619,225.60
减：应收利息总额	6,200,602.68
买卖债券差价收入	1,129,388.41

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,053,868.34
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	1,053,868.34

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-6,252,288.90
——股票投资	-6,804,591.74
——债券投资	552,302.84
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-6,252,288.90

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	1.21
合计	1.21

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	600,476.41
银行间市场交易费用	7,150.00
合计	607,626.41

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	39,671.58

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	13,645.86
账户维护费	17,550.00
其他费用	600.00
合计	130,974.81

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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

根据本基金管理人于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经基金管理人股东会第六十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可【2021】669 号文核准，基金管理人股东上海锦江国际投资管理有限公司将其持有的公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无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	2,203,752.36	389,504.07
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

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	918,230.22	162,293.36

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

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

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	102,095,893.15	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
	期初持有的基金份额	10,001,350.14
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,001,350.14	10,001,350.14
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.88%	9.15%

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

关联方名称	本期末 2021 年 6 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
国泰君安投资管理股份有限公司	14,416,810.84	4.15%	14,416,810.84	2.66%

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
招商银行	15,379,393.57	178,582.28	33,624,806.53	117,548.16

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安	605005	合兴股份	网下申购	634.00	4,044.92
国泰君安	688070	纵横股份	网下申购	2,407.00	56,024.85
国泰君安	688677	海泰新光	网下申购	1,768.00	63,539.80
国泰君安	605089	味知香	网下申购	370.00	10,556.10
国泰君安	605180	华生科技	网下申购	384.00	8,593.92
国泰君安	688395	正弦电气	网下申购	1,627.00	26,080.40
国泰君安	605319	无锡振华	网下申购	764.00	8,572.08
国泰君安	301009	可靠股份	网下申购	8,007.00	100,407.78
国泰君安	688276	百克生物	网下申购	3,244.00	118,509.00
国泰君安	688087	英科再生	网下申购	2,469.00	54,490.34
国泰君安	113049	长汽转债	老股东配售	180.00	18,000.00
国泰君安	113050	南银转债	老股东配售	10,550.00	1,055,000.00
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

				股/张)	
--	--	--	--	------	--

6.4.11 利润分配情况

本报告期末进行收益分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股限售	2.65	5.67	907,763.00	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688161	威高骨科	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	36.22	82.27	3,069.00	111,159.18	252,486.63	-
688076	诺泰生物	2021-05-12	2021-11-22	新股限售	15.57	48.55	4,984.00	77,600.88	241,973.20	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	新股限售	10.19	18.40	10,622.00	108,238.18	195,444.80	-
688317	之江生物	2021-01-08	2021-07-19	新股限售	43.22	63.82	2,952.00	127,585.44	188,396.64	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	473.00	22,387.09	119,177.08	-
688682	霍莱沃	2021-04-13	2021-10-20	新股限售	45.72	103.85	946.00	43,251.12	98,242.10	-
688621	阳光诺和	2021-06-11	2021-12-21	新股限售	26.89	63.99	1,485.00	39,931.65	95,025.15	-
688456	有研粉材	2021-03-10	2021-09-17	新股限售	10.62	26.50	3,396.00	36,065.52	89,994.00	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	731.00	24,283.82	63,962.50	-
688616	西力科技	2021-03-10	2021-09-22	新股限售	7.35	13.78	3,918.00	28,797.30	53,990.04	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	-
688092	爱科科技	2021-03-12	2021-09-22	新股限售	19.11	33.21	1,137.00	21,728.07	37,759.77	-
688067	爱威科技	2021-06-07	2021-12-16	新股限售	14.71	24.83	1,259.00	18,519.89	31,260.97	-
30098	中红	2021-0	2021-1	新股	48.59	90.39	335.00	16,277	30,280	-

1	医疗	4-19	0-27	限售				.65	.65	
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股限售	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股限售	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股限售	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股限售	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	13.75	32.98	275.00	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股限售	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股限售	13.00	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股限售	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股限售	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
30098	志特	2021-0	2021-1	新股	14.79	30.57	264.00	3,904.	8,070.	-

6	新材	4-21	1-01	限售				56	48	
30098	川网	2021-0	2021-1	新股	6.79	26.81	301.00	2,043.	8,069.	-
7	传媒	4-28	1-11	限售				79	81	
30097	东箭	2021-0	2021-1	新股	8.42	13.60	593.00	4,993.	8,064.	-
8	科技	4-15	0-26	限售				06	80	
30092	博俊	2020-1	2021-0	新股	10.76	22.20	359.00	3,862.	7,969.	-
6	科技	2-29	7-12	限售				84	80	
30099	玉马	2021-0	2021-1	新股	12.10	19.29	410.00	4,961.	7,908.	-
3	遮阳	5-17	1-24	限售				00	90	
30098	致远	2021-0	2021-1	新股	24.90	24.81	295.00	7,345.	7,318.	-
5	新能	4-21	0-29	限售				50	95	
30100	嘉益	2021-0	2021-1	新股	7.81	21.94	312.00	2,436.	6,845.	-
4	股份	6-18	2-27	限售				72	28	
30092	江天	2020-1	2021-0	新股	13.39	30.10	217.00	2,905.	6,531.	-
7	化学	2-29	7-07	限售				63	70	
30101	申菱	2021-0	2022-0	新股	8.29	8.29	782.00	6,482.	6,482.	-
8	环境	6-28	1-07	限售				78	78	
30097	商络	2021-0	2021-1	新股	5.48	13.03	492.00	2,696.	6,410.	-
5	电子	4-14	0-21	限售				16	76	
30096	中洲	2021-0	2021-1	新股	12.13	22.49	283.00	3,432.	6,364.	-
3	特材	3-30	0-11	限售				79	67	
30101	华立	2021-0	2021-1	新股	14.20	33.84	175.00	2,485.	5,922.	-
1	科技	6-09	2-17	限售				00	00	
30094	春晖	2021-0	2021-0	新股	9.79	23.01	255.00	2,496.	5,867.	-
3	智控	2-03	8-10	限售				45	55	
30096	晓鸣	2021-0	2021-1	新股	4.54	11.54	507.00	2,301.	5,850.	-
7	股份	4-02	0-13	限售				78	78	
30097	万辰	2021-0	2021-1	新股	7.19	12.65	430.00	3,091.	5,439.	-
2	生物	4-08	0-19	限售				70	50	
30092	华骐	2021-0	2021-0	新股	13.87	29.55	183.00	2,538.	5,407.	-
9	环保	1-12	7-21	限售				21	65	
30096	通业	2021-0	2021-0	新股	12.08	23.06	234.00	2,826.	5,396.	-
0	科技	3-22	9-29	限售				72	04	
30101	漱玉	2021-0	2022-0	新股	8.86	8.86	555.00	4,917.	4,917.	-
7	平民	6-23	1-05	限售				30	30	
30102	密封	2021-0	2022-0	新股	10.64	10.64	421.00	4,479.	4,479.	-
0	科技	6-28	1-06	限售				44	44	
30099	奇德	2021-0	2021-1	新股	14.72	23.32	191.00	2,811.	4,454.	-
5	新材	5-17	1-26	限售				52	12	
30100	德迈	2021-0	2021-1	新股	5.29	14.44	303.00	1,602.	4,375.	-
7	仕	6-04	2-16	限售				87	32	
30099	宁波	2021-0	2021-1	新股	6.02	21.32	201.00	1,210.	4,285.	-
8	方正	5-25	2-02	限售				02	32	
30101	扬电	2021-0	2021-1	新股	8.05	24.26	170.00	1,368.	4,124.	-

2	科技	6-15	2-22	限售				50	20	
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029.00	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926.00	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995.00	44,255.70	44,255.70	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
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
113049	长汽转债	2021-06-10	2021-07-08	配债未上市	100.00	100.00	180.00	18,000.00	18,000.00	-
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	配债未上	100.00	100.00	10,550.00	1,055,000.00	1,055,000.00	-

				市						
11305 1	节能 转债	2021-0 6-21	2021-0 7-22	配债 未上 市	100.00	100.00	40.00	4,000. 00	4,000. 00	-
12311 7	健帆 转债	2021-0 6-23	2021-0 7-12	配债 未上 市	100.00	100.00	102.00	10,200 .00	10,200 .00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金。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。本基金通过对权益类资产和固定收益类资产的灵活配置充分捕捉各证券子市场的投资收益机会，在合理控制风险、保障基金资产流动性的前提下，力求持续高效地获取稳健回报。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损

失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 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经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

6.4.13.3 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，有效保障基金份额持有人利益。

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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流

通受限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%。

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

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

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

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

6.4.13.4 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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 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	15,379,393.57	-	-	-	15,379,393.57
结算备付金	26,851.64	-	-	-	26,851.64
存出保证金	32,794.98	-	-	-	32,794.98
交易性金融资产	41,108,200.00	301,458,000.00	-	138,876,681.37	481,442,881.37
买入返售金融资产	20,000,130.00	-	-	-	20,000,130.00
应收证券清算款	-	-	-	717,434.99	717,434.99
应收利息	-	-	-	4,305,524.24	4,305,524.24
资产总计	76,547,370.19	301,458,000.00	-	143,899,640.60	521,905,010.79
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	30.14	30.14
应付管理人报酬	-	-	-	282,327.10	282,327.10
应付托管费	-	-	-	117,636.30	117,636.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	268,610.55	268,610.55
应交税费	-	-	-	3,179.57	3,179.57
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	99,178.95	99,178.95
负债总计	-	-	-	770,962.61	770,962.61

利率敏感度缺口	76,547,370.19	301,458,000.00	-	143,128,677.99	521,134,048.18
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	44,259,637.10	-	-	-	44,259,637.10
结算备付金	1,327,430.12	-	-	-	1,327,430.12
存出保证金	151,828.06	-	-	-	151,828.06
交易性金融资产	260,270,251.40	200,723,000.00	-	173,938,613.46	634,931,864.86
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	100,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	778,799.78	778,799.78
应收利息	-	-	-	3,865,026.51	3,865,026.51
资产总计	406,009,146.68	200,723,000.00	-	178,582,439.75	785,314,586.43
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	200.87	200.87
应付管理人报酬	-	-	-	391,773.37	391,773.37
应付托管费	-	-	-	163,238.88	163,238.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	709,699.64	709,699.64
应交税费	-	-	-	26,621.44	26,621.44
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	170,000.13	170,000.13
负债总计	-	-	-	1,461,534.33	1,461,534.33
利率敏感度缺口	406,009,146.68	200,723,000.00	-	177,120,905.42	783,853,052.10

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末	上年度末
		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 249	增加约 127
	市场利率上行 25 个基点	减少约 246	减少约 126

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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票占基金资产的比例为 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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	上年度末
	2021 年 6 月 30 日	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	138,876,681.37	26.65	173,938,613.46	22.19
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	138,876,681.37	26.65	173,938,613.46	22.19

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,044	增加约 2,784
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,044	减少约 2,784

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	138,876,681.37	26.61
	其中: 股票	138,876,681.37	26.61
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	342,566,200.00	65.64
	其中：债券	342,566,200.00	65.64
	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	20,000,130.00	3.83
	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	15,406,245.21	2.95
8	其他各项资产	5,055,754.21	0.97
9	合计	521,905,010.79	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	2,221,924.00	0.43
C	制造业	74,812,336.10	14.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,279,507.60	1.20
E	建筑业	1,370,482.37	0.26
F	批发和零售业	1,429,626.90	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	4,198,409.00	0.81
H	住宿和餐饮业	763,520.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,683,593.74	0.51
J	金融业	30,908,812.36	5.93
K	房地产业	3,176,009.40	0.61
L	租赁和商务服务业	2,289,216.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	2,685,963.29	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	1,092,547.00	0.21
Q	卫生和社会工作	3,084,245.00	0.59
R	文化、体育和娱乐业	1,824,760.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	138,876,681.37	26.65

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002142	宁波银行	222,100	8,655,237.00	1.66
2	601318	中国平安	92,792	5,964,669.76	1.14
3	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.99
4	000001	平安银行	178,800	4,044,456.00	0.78
5	600519	贵州茅台	1,700	3,496,390.00	0.67
6	600600	青岛啤酒	24,300	2,810,295.00	0.54
7	601166	兴业银行	131,200	2,696,160.00	0.52
8	300327	中颖电子	31,600	2,693,268.00	0.52
9	600809	山西汾酒	5,900	2,643,200.00	0.51
10	601009	南京银行	249,600	2,625,792.00	0.50
11	002415	海康威视	40,400	2,605,800.00	0.50
12	603259	药明康德	16,546	2,590,938.14	0.50
13	000858	五粮液	8,600	2,561,854.00	0.49
14	002032	苏泊尔	40,100	2,557,979.00	0.49
15	002812	恩捷股份	9,900	2,317,590.00	0.44
16	300122	智飞生物	11,400	2,128,722.00	0.41
17	601377	兴业证券	200,300	1,934,898.00	0.37
18	603345	安井食品	7,200	1,828,944.00	0.35
19	002821	凯莱英	4,900	1,825,740.00	0.35
20	300413	芒果超媒	26,600	1,824,760.00	0.35
21	002352	顺丰控股	26,900	1,821,130.00	0.35
22	002028	思源电气	56,500	1,739,635.00	0.33
23	603986	兆易创新	9,240	1,736,196.00	0.33
24	600763	通策医疗	4,200	1,726,200.00	0.33
25	603369	今世缘	30,000	1,624,800.00	0.31
26	603659	璞泰来	11,600	1,584,560.00	0.30
27	601995	中金公司	24,951	1,534,486.50	0.29
28	601601	中国太保	52,600	1,523,822.00	0.29
29	000661	长春高新	3,800	1,470,600.00	0.28
30	600276	恒瑞医药	20,760	1,411,057.20	0.27

31	600115	中国东航	277,600	1,410,208.00	0.27
32	000651	格力电器	26,800	1,396,280.00	0.27
33	002027	分众传媒	147,600	1,388,916.00	0.27
34	600690	海尔智家	52,900	1,370,639.00	0.26
35	603882	金城医学	8,500	1,358,045.00	0.26
36	601633	长城汽车	30,700	1,338,213.00	0.26
37	002250	联化科技	47,600	1,328,040.00	0.25
38	002064	华峰化学	93,200	1,323,440.00	0.25
39	300957	贝泰妮	4,726	1,274,674.65	0.24
40	000538	云南白药	10,900	1,261,348.00	0.24
41	002007	华兰生物	33,400	1,225,112.00	0.24
42	002311	海大集团	14,600	1,191,360.00	0.23
43	300124	汇川技术	15,900	1,180,734.00	0.23
44	600837	海通证券	101,000	1,161,500.00	0.22
45	000002	万科A	48,700	1,159,547.00	0.22
46	600309	万华化学	10,500	1,142,610.00	0.22
47	603501	韦尔股份	3,500	1,127,000.00	0.22
48	000822	山东海化	141,700	1,105,260.00	0.21
49	601607	上海医药	52,100	1,100,873.00	0.21
50	002129	中环股份	28,400	1,096,240.00	0.21
51	000725	京东方A	175,200	1,093,248.00	0.21
52	002607	中公教育	52,300	1,092,547.00	0.21
53	002230	科大讯飞	16,100	1,088,038.00	0.21
54	300496	中科创达	6,900	1,083,714.00	0.21
55	603806	福斯特	10,080	1,059,710.40	0.20
56	603229	奥翔药业	31,700	1,058,463.00	0.20
57	002236	大华股份	50,100	1,057,110.00	0.20
58	002841	视源股份	8,500	1,056,465.00	0.20
59	603260	合盛硅业	13,100	1,007,521.00	0.19
60	603786	科博达	12,800	966,400.00	0.19
61	601012	隆基股份	10,780	957,695.20	0.18
62	600741	华域汽车	35,200	924,704.00	0.18
63	000338	潍柴动力	50,800	907,796.00	0.17
64	601888	中国中免	3,000	900,300.00	0.17
65	000100	TCL 科技	113,600	869,040.00	0.17
66	600438	通威股份	19,900	861,073.00	0.17
67	601600	中国铝业	160,300	849,590.00	0.16
68	600258	首旅酒店	32,000	763,520.00	0.15
69	300033	同花顺	6,500	733,070.00	0.14
70	002146	荣盛发展	129,300	729,252.00	0.14
71	300529	健帆生物	8,200	708,152.00	0.14
72	000671	阳光城	135,800	706,160.00	0.14
73	601618	中国中冶	236,200	703,876.00	0.14
74	000703	恒逸石化	58,300	696,685.00	0.13

75	002179	中航光电	8,700	687,474.00	0.13
76	002563	森马服饰	56,700	677,565.00	0.13
77	601668	中国建筑	137,900	641,235.00	0.12
78	601899	紫金矿业	64,300	623,067.00	0.12
79	600048	保利地产	48,260	581,050.40	0.11
80	600801	华新水泥	32,300	567,511.00	0.11
81	600886	国投电力	58,900	566,029.00	0.11
82	600900	长江电力	25,600	528,384.00	0.10
83	002444	巨星科技	15,000	511,200.00	0.10
84	600028	中国石化	115,800	504,888.00	0.10
85	601006	大秦铁路	75,500	496,790.00	0.10
86	601816	京沪高铁	88,900	470,281.00	0.09
87	603712	七一二	12,100	436,810.00	0.08
88	600188	兖州煤业	26,200	402,432.00	0.08
89	600989	宝丰能源	28,900	395,352.00	0.08
90	600346	恒力石化	14,500	380,480.00	0.07
91	600985	淮北矿业	28,500	347,985.00	0.07
92	601088	中国神华	17,600	343,552.00	0.07
93	603638	艾迪精密	7,700	330,099.00	0.06
94	600050	中国联通	76,400	330,048.00	0.06
95	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.05
96	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.05
97	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.05
98	603338	浙江鼎力	3,700	217,153.00	0.04
99	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.04
100	688317	之江生物	2,952	188,396.64	0.04
101	600966	博汇纸业	9,700	126,585.00	0.02
102	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
103	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.02
104	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.02
105	688698	伟创电气	4,751	94,972.49	0.02
106	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.02
107	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
108	300979	华利集团	731	63,962.50	0.01
109	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
110	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
111	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.01
112	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
113	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
114	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
115	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
116	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.01
117	600570	恒生电子	400	37,300.00	0.01
118	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01

119	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
120	300981	中红医疗	335	30,280.65	0.01
121	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
122	601016	节能风电	6,700	25,058.00	0.00
123	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
124	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
125	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
126	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
127	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
128	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
129	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
130	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
131	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
132	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
133	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
134	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
135	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
136	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
137	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
138	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
139	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
140	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
141	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
142	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
143	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
144	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
145	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
146	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
147	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
148	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
149	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
150	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
151	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
152	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
153	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
154	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
155	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
156	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
157	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
158	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
159	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
160	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
161	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
162	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00

163	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
164	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
165	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
166	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
167	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
168	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
169	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
170	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
171	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	000001	平安银行	3,837,085.00	0.49
2	600519	贵州茅台	3,464,720.00	0.44
3	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.44
4	002242	九阳股份	3,195,175.00	0.41
5	002508	老板电器	2,804,357.00	0.36
6	000568	泸州老窖	2,556,924.00	0.33
7	601009	南京银行	2,303,920.90	0.29
8	601939	建设银行	2,303,902.00	0.29
9	300146	汤臣倍健	2,224,411.00	0.28
10	002008	大族激光	2,224,242.00	0.28
11	002415	海康威视	2,221,486.00	0.28
12	601601	中国太保	2,221,413.00	0.28
13	603160	汇顶科技	2,217,074.00	0.28
14	601319	中国人保	2,215,365.00	0.28
15	603501	韦尔股份	2,215,337.00	0.28
16	000538	云南白药	2,141,105.00	0.27
17	600872	中炬高新	1,947,406.00	0.25
18	600809	山西汾酒	1,921,383.00	0.25
19	600600	青岛啤酒	1,836,730.00	0.23
20	601607	上海医药	1,609,106.00	0.21

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	000568	泸州老窖	10,668,637.00	1.36
2	300124	汇川技术	5,919,257.00	0.76
3	600919	江苏银行	4,877,179.40	0.62
4	601328	交通银行	4,777,410.00	0.61
5	000895	双汇发展	4,589,406.92	0.59
6	601318	中国平安	4,446,033.40	0.57
7	000858	五粮液	4,174,676.00	0.53
8	600031	三一重工	3,854,750.00	0.49
9	000333	美的集团	3,565,288.00	0.45
10	300347	泰格医药	3,446,409.00	0.44
11	002920	德赛西威	3,346,254.00	0.43
12	601012	隆基股份	3,284,850.00	0.42
13	601919	中远海控	3,247,972.00	0.41
14	002242	九阳股份	3,135,604.00	0.40
15	002271	东方雨虹	3,024,424.00	0.39
16	300015	爱尔眼科	3,000,310.10	0.38
17	601009	南京银行	2,887,764.00	0.37
18	002001	新 和 成	2,861,415.46	0.37
19	002508	老板电器	2,754,674.00	0.35
20	600958	东方证券	2,700,554.64	0.34

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	160,803,189.17
卖出股票的收入（成交）总额	211,052,520.03

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	30,021,000.00	5.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	241,013,000.00	46.25
	其中：政策性金融债	40,150,000.00	7.70
4	企业债券	30,171,000.00	5.79
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	40,274,000.00	7.73

7	可转债（可交换债）	1,087,200.00	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	342,566,200.00	65.73

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	2028047	20 交通银行 02	500,000	50,560,000.00	9.70
2	2128007	21 华夏银行 01	500,000	50,405,000.00	9.67
3	2128017	21 中信银行永续债	400,000	40,288,000.00	7.73
4	175630	21 海通 01	300,000	30,171,000.00	5.79
5	102100061	21 浙能源 MTN001	300,000	30,156,000.00	5.79

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据权益类资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。此外，基金管理人还将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2020 年 10 月 16 日，宁波银行因授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2020〕48 号）给予罚款人民币 30 万元的行政处罚，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分。2021 年 6 月 10 日，宁波银行因代理销售保险不规范，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2021〕36 号）给予罚款人民币 25 万元的行政处罚，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

2020 年 10 月 16 日，平安银行因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违法违规事项，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2020〕66 号）给予合计罚款人民币 100 万元的行政处罚。2021 年 5 月 28 日，平安银行因利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险等违法违规事项，被中国银保监会云南监管局（云银保监罚决字〔2021〕34 号）给予罚款人民币 210 万元的行政处罚。

2020 年 8 月 31 日，兴业银行因同业投资用途不合规、授信管理不尽职等违法违规行为，被中国银保监会福建监管局（闽银保监罚决字〔2020〕24 号）给予没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元的行政处罚。2020 年 9 月 4 日，兴业银行因为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性等违法违规行为，被中国人民银行福州中心支行（福银罚字〔2020〕35 号）给予警告，

没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款的行政处罚。

2020 年 12 月 28 日，南京银行因未按规定履行客户身份识别义务等违法违规事项，被人民银行南京分行（（南银）罚字（2020）第 30 号）给予警告，并处罚款 736 万元，没收违法所得人民币 208778.02 元的行政处罚。

2020 年 7 月 13 日，华夏银行因内控制度执行不到位，严重违反审慎经营规则等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2020）24 号）给予罚款 110 万元的行政处罚。2020 年 8 月 25 日，华夏银行因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理结汇、售汇业务等违法违规事项，被国家外汇管理局北京外汇管理部（京汇罚（2020）19 号）给予警告，没收违法所得 344,694.85 元人民币，并处 300 万元人民币罚款的行政处罚。2020 年 10 月 20 日，华夏银行因违反银行交易记录管理规定，被国家外汇管理局北京外汇管理部（京汇罚（2020）27 号）给予罚款 60 万元人民币的行政处罚，并要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。2020 年 10 月 20 日，华夏银行因违规开展外汇掉期业务、外汇即期业务和外汇远期业务，被国家外汇管理局北京外汇管理部（京汇罚（2020）28 号）给予罚款 100 万元人民币的行政处罚，并要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。2021 年 5 月 17 日，华夏银行因违规使用自营资金、理财资金购买本行转让的信贷资产等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2021）19 号）给予罚款 9830 万元的行政处罚。

2020 年 8 月 25 日，中信银行因违规办理内保外贷业务等违法违规事项，被国家外汇管理局北京外汇管理部（京汇罚（2020）17 号）给予警告，没收违法所得 14,857,527.66 元人民币，并处 1,177.04 万元人民币罚款的行政处罚。2020 年 11 月 26 日，中信银行因违反规定办理售汇业务，被国家外汇管理局北京外汇管理部（京汇罚（2020）43 号）给予没收违法所得 661,782.53 元人民币，并处 40 万元人民币罚款的行政处罚。2021 年 2 月 5 日，中信银行因未按规定履行客户身份识别义务等违法违规事项，被中国人民银行（银罚字（2021）1 号）给予罚款 2890 万元的行政处罚。2021 年 3 月 17 日，中信银行因客户信息保护体制机制不健全；柜面非密查询客户账户明细缺乏规范、统一的业务流程与必要的内部控制措施，乱象整治自查不力等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2021）5 号）给予罚款 450 万元的行政处罚。

2020 年 7 月 14 日，民生银行因违反宏观调控政策，违规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违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2020）43 号）给予没收违法所得 296.47 万元，罚款 10486.47 万元，罚没合计 10782.94 万元的行政处罚。2020 年 11 月 26 日，民生银行因违反规定办理售汇业务等违法违规事项，被国家

外汇管理局北京外汇管理部（京汇罚〔2020〕44 号）给予警告，没收违法所得 1,910,822.20 元人民币，并处 80 万元人民币罚款的行政处罚。

2020 年 10 月 26 日，工商银行因违规开展外汇掉期业务、外汇远期业务和外汇期权业务，被国家外汇管理局北京外汇管理部（京汇罚〔2020〕31 号）给予罚款 100 万元人民币的行政处罚，并要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。2020 年 11 月 6 日，工商银行因违反反洗钱法被中国人民银行衡水市中心支行（衡银罚字[2020]第 1 号）给予罚款 21 万元的行政处罚。2020 年 12 月 25 日，工商银行因未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告、关键岗位未进行实质性轮岗等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2020〕71 号）给予罚款 5470 万元的行政处罚。

本基金投资宁波银行、南京银行、平安银行、兴业银行、21 华夏银行 01、21 中信银行永续债、21 民生银行永续债 01、21 工商银行永续债 01 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。报告期内，本基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	32,794.98
2	应收证券清算款	717,434.99
3	应收股利	-
4	应收利息	4,305,524.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,055,754.21

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	0.99	新股流通受限

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
215	1,616,427.54	347,066,759.24	99.87%	465,161.39	0.13%

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	21,888.56	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额总 数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承 诺持有期限

基金管理人固有资金	10,001,350.1 4	2.88%	10,001,350.1 4	2.88%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,350.1 4	2.88%	10,001,350.1 4	2.88%	-

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年1月15日）基金份额总额	1,831,061,042.72
本报告期期初基金份额总额	541,166,203.12
本报告期基金总申购份额	868.18
减：本报告期基金总赎回份额	193,635,150.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	347,531,920.63

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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，无涉及基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	1	141,377,809.88	39.28%	131,665.49	39.72%	-
中信证券	2	128,475,046.17	35.69%	117,760.49	35.52%	-
信达证券	1	84,028,176.05	23.35%	76,574.54	23.10%	-
浙商证券	1	6,054,650.59	1.68%	5,517.56	1.66%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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

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

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

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

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4)协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2021 年 2 月完成租用托管在招商银行的信达证券深交所 011318 交易单元

2021 年 5 月完成租用托管在招商银行的浙商证券深交所 012813 交易单元

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	47,953,800.00	96.37%	50,000,000.00	71.43%	-	-
中信证券	1,638,920.80	3.29%	20,000,000.00	28.57%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	165,721.33	0.33%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(合兴股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-12
2	华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-16
3	华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-20
4	华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基	中国证监会基金电子披	2021-01-20

	金更新的招募说明书(2021 年第 1 号)	露网站和公司网站等指定媒介	
5	华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-21
6	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(纵横股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-03
7	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-06
8	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(海泰新光)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-19
9	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-09
10	华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-30
11	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(味知香)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-20
12	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(华生科技)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-21
13	华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-21
14	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(正弦电气)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-22
15	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(无锡振华)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-05-31
16	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(可靠股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-09
17	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(长汽转债)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-15
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(南银转债)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-17

19	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（百克生物）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-18
----	------------------------------------	-------------------------	------------

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210518	143,399,297.34	0.00	143,399,297.34	0.00	0.00%
	2	20210101-20210630	250,949,308.09	0.00	0.00	250,949,308.09	72.21%
	3	20210623-20210630	71,699,290.17	0.00	0.00	71,699,290.17	20.63%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 2、《华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日