

# 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
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.....	60
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.....	60
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.....	60
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.....	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.12 投资组合报告附注.....	61
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	63
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>64</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>65</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	67
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>70</b>
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.....	70

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>71</b>
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华润元大安鑫灵活配置混合	
基金主代码	000273	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 9 月 18 日	
基金管理人	华润元大基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	143,811,716.04 份	
下属分级基金的基金简称:	华润元大安鑫灵活配置混合 A	华润元大安鑫灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码:	000273	007632
报告期末下属分级基金的份额总额	6,011,548.40 份	137,800,167.64 份

注：自 2014 年 9 月 18 日起，华润元大保本混合型证券投资基金转型为华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金根据对宏观经济形势的研究，判断经济所处的经济周期阶段、景气循环状况和未来运行趋势，积极把握股票、债券等市场发展趋势，注重大类资产配置轮换特征、重点挖掘价值低洼，在适度控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、投资标的的评估以及组合风险管理全过程中。本基金为灵活配置基金，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%。首先根据宏观经济和政策预判，定性大类资产的边际变动方向。其次，参考全部 A 股整体估值（参照万得全 A 指数(除金融,石油石化)市盈率 TTM），每日追踪过去 20 年的历史情况，将 A 股历史估值区间划分成若干分位。如果估值在由低到高排列的 90 分位下方，股票仓位变动是 50%—95%；如果估值在由低到高排列的 90—100 分位，股票仓位在 0—50%。最后，根据短期上涨速度和获利水平，决定短期仓位变化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×25%+恒生指数收益率×15%。
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，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。 本基金将通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

注：自 2014 年 9 月 18 日起，华润元大保本混合型证券投资基金转型为华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金。

## 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		华润元大基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘豫皓	秦一楠
	联系电话	0755-88399008	010-66060069
	电子邮箱	kf@cryuantafund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4000-1000-89	95599
传真		0755-88399045	010-68121816
注册地址		深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-05 单元	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-05 单元	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518066	100031
法定代表人		李巍巍	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cryuantafund.com">http://www.cryuantafund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华润元大基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-2105 单元

### § 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

基金级别	华润元大安鑫灵活配置混合 A	华润元大安鑫灵活配置混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	1,254,254.08	27,106,760.77
本期利润	502,135.30	12,358,960.49
加权平均基金份额本期利润	0.0762	0.0848
本期加权平均净值利润率	4.16%	4.66%
本期基金份额净值增长率	4.13%	4.03%
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	4,129,092.72	93,253,758.26
期末可供分配基金份额利润	0.6869	0.6767
期末基金资产净值	11,244,677.64	256,351,652.20
期末基金份额净值	1.8705	1.8603
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	178.37%	51.49%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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

华润元大安鑫灵活配置混合 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④	①-③	②-④
过去一个月	0.08%	0.49%	-1.37%	0.56%	1.45%	-0.07%
过去三个月	4.84%	0.59%	2.50%	0.67%	2.34%	-0.08%
过去六个月	4.13%	0.80%	1.42%	0.91%	2.71%	-0.11%
过去一年	31.36%	0.91%	18.03%	0.91%	13.33%	0.00%
过去三年	60.83%	1.04%	29.99%	0.79%	30.84%	0.25%
自基金合同生效起至今	178.37%	1.05%	60.90%	0.63%	117.47%	0.42%

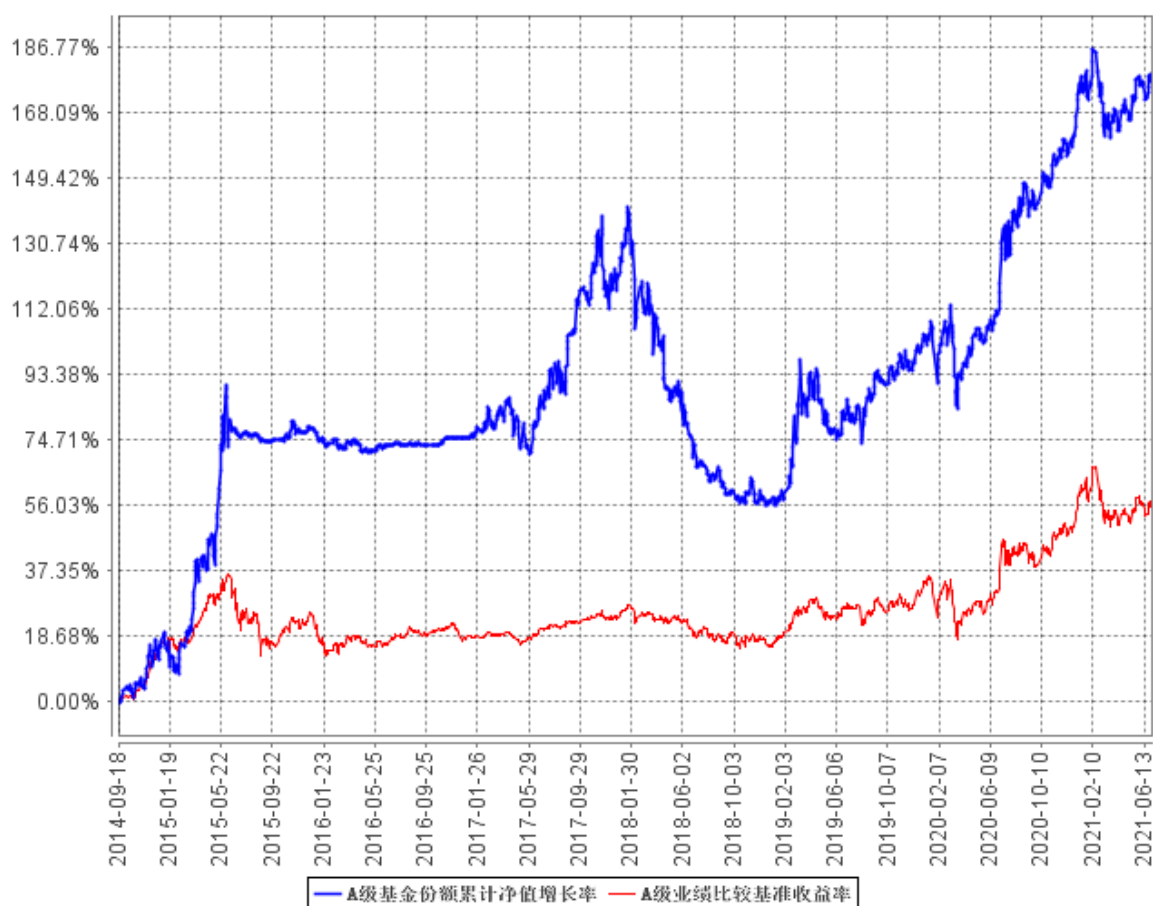


华润元大安鑫灵活配置混合 C

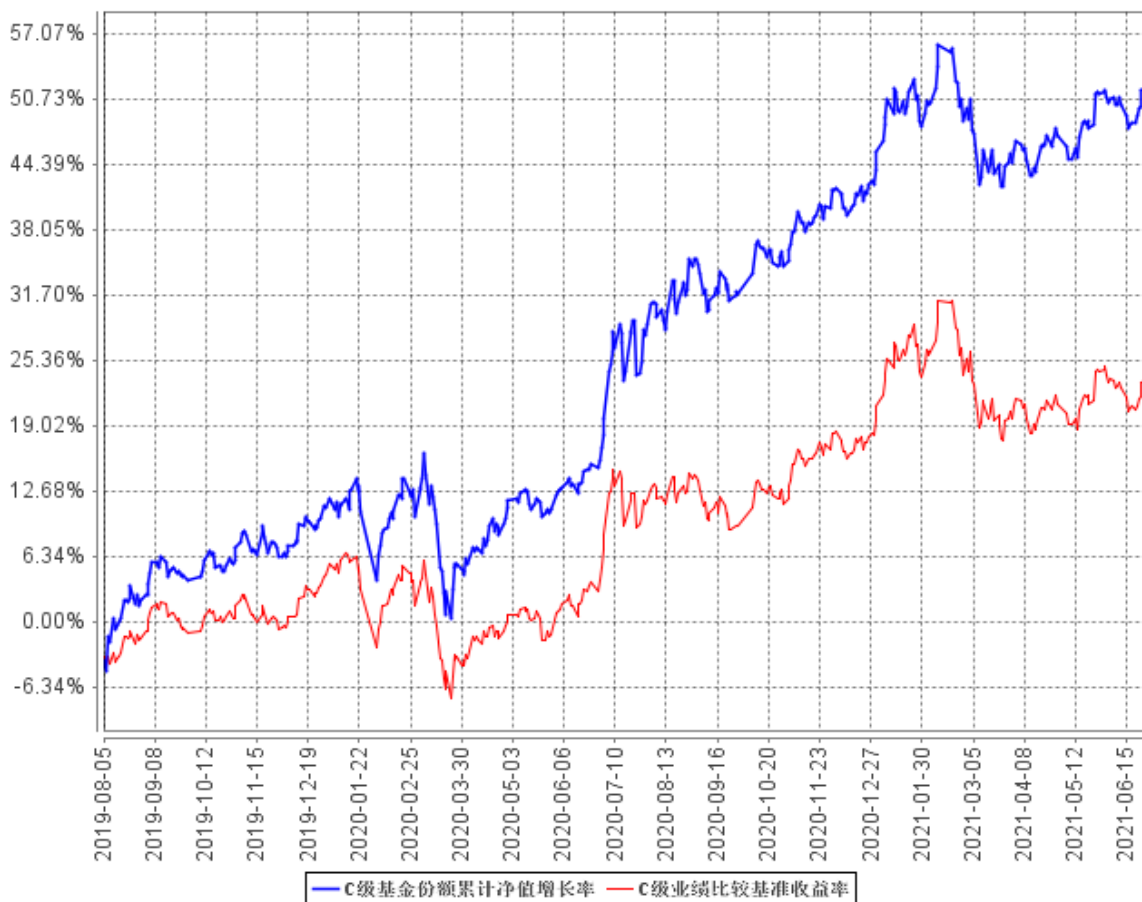
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.06%	0.49%	-1.37%	0.56%	1.43%	-0.07%
过去三个月	4.79%	0.59%	2.50%	0.67%	2.29%	-0.08%
过去六个月	4.03%	0.80%	1.42%	0.91%	2.61%	-0.11%
过去一年	31.10%	0.91%	18.03%	0.91%	13.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	51.49%	0.99%	22.69%	0.93%	28.80%	0.06%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2012】1746 号文批准，于 2013 年 1 月 17 日完成工商登记注册，总部位于深圳，注册资本 6 亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司、华润金控投资有限公司、台湾元大证券投资信托股份有限公司共同发起设立，占股比例分别为 51%、24.5%、24.5%。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理十六只基金产品：华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金、华润元大成长精选股票型发起式证券投资基金、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金、华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大景泰混合型证券投资基金、华润元大欣享混合型发起式证券投资基金、华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金、华润元大核心动力混合型证券投资基金、华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金货币市场基金、华润元大稳健收益债券型证券投资基金、华润元大润鑫债券型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金，华润元大润泽债券型证券投资基金、华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李武群	本基金基金经理、量化指数部负责人	2020 年 10 月 23 日	-	12 年	中国，中国科学院研究生院微电子学与固体电子学博士，具有基金从业资格。曾任中信银行福州分行统计分析岗、华西证券股份有限公司研究所高级研究员和股票投资部投资经理助理；2015 年 8 月 13 日加入华润元大基金管理有限公司，现任公司量化指数部总经理。2017 年 8 月 2 日起担任华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金基金经理；2019 年 10 月 18 日起担任华润元大量化优选混合型证券投资基金基金经理；2020 年 4

					月 8 日起担任华润元大成长精选股票型发起式证券投资基金基金经理；2020 年 8 月 13 日起担任华润元大景泰混合型证券投资基金基金经理；2020 年 10 月 23 日起担任华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大欣享混合型发起式证券投资基金基金经理。
胡永杰	本基金基金经理	2021 年 1 月 25 日	-	4 年	中国，清华大学电子专业硕士，具备基金从业资格。曾任招商银行总行信息技术部开发工程师、深圳前海金信大数据金融服务有限公司研究员。2017 年加入公司，现担任量化指数部基金经理。2021 年 1 月 25 日起担任华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大富时 A50 指数型证券投资基金、华润元大成长精选股票型发起式证券投资基金、华润元大欣享混合型发起式证券投资基金基金经理。
罗黎军	本基金基金经理	2020 年 7 月 16 日	-	9 年	中国，复旦大学发展经济学硕士，具有基金从业资格。曾任安信证券国际业务部、五牛基金证券投资部、香江金融控股集团投资管理部研究员。2017 年 9 月加入华润元大基金管理有限公司，2020 年 7 月 16 日起担任华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金经理。

### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期内无上述兼任情况。

## 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循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

## 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

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规及公司内部制度关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，未发生违反公平交易制度的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。基金管理人管理的所有投资组合未存在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超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

## 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

2021 年 5 月份经济增长速度趋缓，制造业 PMI 小幅回落服务业 PMI 小幅回升。国内大宗商品价格明显回落，通胀压力缓解，市场对流动性趋紧的担忧也随之缓解。股票市场整体震荡上行，消费成长板块反弹明显，同时日均成交量明显提升，市场情绪好转。分行业来看，食品饮料、国防军工以及 TMT 行业在 5 月下旬涨幅居前，农林牧渔以及钢铁等行业表现较弱。

2021 年 6 月份，经济走弱迹象逐步显现，经济复苏或向正常增长回归，供需缺口收窄，价格指数筑顶，流动性跨期相对平稳。股票市场整体风格偏向成长，双创板块明显上涨，上证 50 及沪深 300 指数则小幅下跌。行业层面，电子、新能源、汽车涨幅均超 10%，石油化工和煤炭等周期股稳步上涨，银行、非银金融等板块则延续弱势。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华润元大安鑫灵活配置 A 基金份额净值为 1.8705 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.13%；截至本报告期末华润元大安鑫灵活配置 C 基金份额净值为 1.8603 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.03%；同期业绩比较基准收益率为 1.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观经济存在下行压力，但流动性方面估计不会大幅收紧，预期将保持稳定宽松。证券市场方面，预计成长风格将会持续，新能源、半导体以及军工都有一定机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、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。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华润元大基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，华润元大基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华润元大基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有害基金持有人利益的行为。

## § 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：华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	14,785,627.00	22,087,342.51
结算备付金		74,349,576.01	91,656,861.26
存出保证金		97,617.15	104,554.59
交易性金融资产	6.4.7.2	270,800,639.57	180,055,266.98
其中：股票投资		165,226,789.57	175,255,746.98
基金投资		-	-
债券投资		105,573,850.00	4,799,520.00
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		2,203,844.53	621,280.49
应收利息	6.4.7.5	1,164,479.65	111,822.82
应收股利		-	-
应收申购款		1,643,773.71	1,019.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		365,045,557.62	294,638,147.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 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		83,600,000.00	-
应付证券清算款		967,718.91	-
应付赎回款		12,187,907.21	1,701,564.79
应付管理人报酬		304,583.49	317,244.54
应付托管费		43,511.94	45,320.64
应付销售服务费		41,650.02	43,255.76
应付交易费用	6.4.7.7	209,597.34	96,971.02
应交税费		-	-



应付利息		9,928.31	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,330.56	165,177.43
负债合计		97,449,227.78	2,369,534.18
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	143,811,716.04	163,412,754.15
未分配利润	6.4.7.10	123,784,613.80	128,855,859.59
所有者权益合计		267,596,329.84	292,268,613.74
负债和所有者权益总计		365,045,557.62	294,638,147.92

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 143,811,716.04 份，其中华润元大安鑫灵活配置 A 基金份额净值 1.8705 元，份额总额 6,011,548.40 份；华润元大安鑫灵活配置 C 基金份额净值 1.8603 元，份额总额 137,800,167.64 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		16,374,224.25	7,249,503.30
1.利息收入		424,565.83	271,987.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	191,001.05	53,425.01
债券利息收入		233,564.78	218,562.47
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		31,429,411.54	6,008,341.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	30,604,812.54	5,250,093.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,024.86	1,971.33
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-309,960.00	-
股利收益	6.4.7.16	1,136,583.86	756,276.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-15,499,919.06	898,602.13
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	20,165.94	70,572.08
<b>减：二、费用</b>		3,513,128.46	1,215,550.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,933,884.97	674,711.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	276,269.32	96,387.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	264,290.07	82,215.85
4. 交易费用	6.4.7.19	747,015.71	188,207.49
5. 利息支出		189,759.07	95,081.69
其中：卖出回购金融资产支出		189,759.07	95,081.69
6. 税金及附加		-	0.04
7. 其他费用	6.4.7.20	101,909.32	78,945.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		12,861,095.79	6,033,953.08
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		12,861,095.79	6,033,953.08

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	163,412,754.15	128,855,859.59	292,268,613.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,861,095.79	12,861,095.79
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）	-19,601,038.11	-17,932,341.58	-37,533,379.69
其中：1.基金申购款	175,485,719.63	142,594,948.35	318,080,667.98
2.基金赎回款	-195,086,757.74	-160,527,289.93	-355,614,047.67
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）	143,811,716.04	123,784,613.80	267,596,329.84
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）	69,780,017.37	25,442,019.66	95,222,037.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,033,953.08	6,033,953.08
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）	26,669,225.45	8,983,788.21	35,653,013.66
其中：1.基金申购款	85,450,639.32	30,316,109.68	115,766,749.00
2.基金赎回款	-58,781,413.87	-21,332,321.47	-80,113,735.34
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）	96,449,242.82	40,459,760.95	136,909,003.77

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：

李仆

张彦军

张彦军

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由华润元大保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后转型而来。华润元大保本混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]872号文予以募集注册,自2013年8月19日至2013年9月6日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为6,465户,募集资金及其产生的利息共计630,303,516.04元,折合基金份额630,303,516.04份,于2013年9月11日

基金合同正式生效。根据《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，2014 年 9 月 11 日，华润元大保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后，未能符合保本基金存续条件，自 2014 年 9 月 18 日起变更为本基金。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容根据《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》的相关约定作相应修改为《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。上述变更无须经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》中予以说明。本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的约定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，华润元大基金管理有限公司决定自 2019 年 8 月 1 日起对华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费用，而不计提销售服务费；C 类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而在赎回时根据持有期限收取赎回费，且从本类别基金资产中计提销售服务费。两类基金份额分别设置代码，并分别计算基金份额净值。在《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效 3 个工作日以后，两类份额之间不得相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金及到期日在一年以内的政府债券，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，其中港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的 50%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×25%+恒生指数收益率×15%。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《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,在具体会计估值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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

### 6.4.4.1 会计年度

-

### 6.4.4.2 记账本位币

-

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

-

### 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

-

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

-

### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

-

#### 6.4.4.7 实收基金

-

#### 6.4.4.8 损益平准金

-

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

-

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

-

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

-

#### 6.4.4.12 分部报告

-

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

-

#### 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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税及附加、企业所得税

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。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、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，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；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，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（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。管理人应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。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。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。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息

红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 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	14,785,627.00
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：	14,785,627.00

##### 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	157,821,055.01	165,226,789.57	7,405,734.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	105,723,643.20	105,573,850.00
	银行间市场	-	-
	合计	105,723,643.20	105,573,850.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	263,544,698.21	270,800,639.57	7,255,941.36

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。



#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：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

注：截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,544.46
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	32,080.20
应收债券利息	1,130,815.48
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	39.51
合计	1,164,479.65

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	209,597.34
银行间市场应付交易费用	-
合计	209,597.34

#### 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	28.00
应付证券出借违约金	-
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
合计	84,330.56

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华润元大安鑫灵活配置混合 A		
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	6,909,201.17	6,909,201.17
本期申购	980,658.70	980,658.70
本期赎回(以“-”号填列)	-1,878,311.47	-1,878,311.47
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	6,011,548.40	6,011,548.40

金额单位：人民币元

华润元大安鑫灵活配置混合 C		
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	156,503,552.98	156,503,552.98
本期申购	174,505,060.93	174,505,060.93
本期赎回(以“-”号填列)	-193,208,446.27	-193,208,446.27
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	137,800,167.64	137,800,167.64

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华润元大安鑫灵活配置混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,440,449.86	2,061,141.06	5,501,590.92
本期利润	1,254,254.08	-752,118.78	502,135.30
本期基金份额交易产生的变动数	-565,611.22	-204,985.76	-770,596.98
其中：基金申购款	526,644.03	293,277.85	819,921.88
基金赎回款	-1,092,255.25	-498,263.61	-1,590,518.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,129,092.72	1,104,036.52	5,233,129.24

单位：人民币元

华润元大安鑫灵活配置混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	76,766,151.24	46,588,117.43	123,354,268.67
本期利润	27,106,760.77	-14,747,800.28	12,358,960.49
本期基金份额交易产生的变动数	-10,619,153.75	-6,542,590.85	-17,161,744.60
其中：基金申购款	104,378,740.65	37,396,285.82	141,775,026.47
基金赎回款	-114,997,894.40	-43,938,876.67	-158,936,771.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	93,253,758.26	25,297,726.30	118,551,484.56

### 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	153,619.16
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	36,674.14
其他	707.75
合计	191,001.05

注：其他为结算保证金利息收入。

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	253,296,576.40
减：卖出股票成本总额	222,691,763.86
买卖股票差价收入	30,604,812.54

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,024.86
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	-2,024.86

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,905,376.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,800,584.86
减：应收利息总额	106,816.44
买卖债券差价收入	-2,024.86

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

-

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

-

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

-

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

-

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

-

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-309,960.00

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,136,583.86
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	1,136,583.86
----	--------------

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-15,499,919.06
——股票投资	-15,351,190.72
——债券投资	-148,728.34
——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	-15,499,919.06

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	20,165.94
转换费收入	-
合计	20,165.94

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	747,015.71
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-

合计	747,015.71
----	------------

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	8,006.76
账户维护费	9,000.00
其他费用	600.00
合计	101,909.32

#### 6.4.7.21 分部报告

-

#### 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，本基金无需作说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华润元大基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

### 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

-

#### 6.4.10.1.2 债券交易

-

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

-

#### 6.4.10.1.4 权证交易

-

#### 6.4.10.1.5 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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,933,884.97	674,711.88
其中：支付销售机构的客户维护费	239,425.02	84,290.15

注：(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.40% 的年费率计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.40%÷当年天数。

(2) 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日



当期发生的基金应支付的托管费	276,269.32	96,387.39
----------------	------------	-----------

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华润元大安鑫灵活配置混合 A	华润元大安鑫灵活配置混合 C	合计
华润元大基金管理有限公司	-	164,749.52	164,749.52
合计	-	164,749.52	164,749.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华润元大安鑫灵活配置混合 A	华润元大安鑫灵活配置混合 C	合计
华润元大基金管理有限公司	-	64,349.68	64,349.68
合计	-	64,349.68	64,349.68

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日对应级别基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华润元大基金管理有限公司，再由华润元大基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.2%。其计算公式为：

日销售服务费=前一日该级别基金资产净值×对应销售服务费年费率/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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

-

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

-

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	14,785,627.00	153,619.16	40,141,475.80	51,304.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行间同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688626	翔宇医疗	2021年3月23日	2021年10月8日	新股流通受限	28.82	104.16	2,374	68,418.68	247,275.84	-

688059	华锐精密	2021年2月1日	2021年8月9日	新股流通受限	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-
688097	博众精工	2021年4月29日	2021年11月12日	新股流通受限	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-
688109	品茗股份	2021年3月22日	2021年9月30日	新股流通受限	50.05	72.10	1,301	65,115.05	93,802.10	-
688329	艾隆科技	2021年3月16日	2021年9月29日	新股流通受限	16.81	50.04	1,846	31,031.26	92,373.84	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688314	康拓医疗	2021年5月11日	2021年11月18日	新股流通受限	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688468	科美诊断	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-
688359	三孚新科	2021年5月14日	2021年11月22日	新股流通受限	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	213	10,081.29	53,667.48	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-

300894	火星 人	2020 年 12 月 24 日	2021 年 7 月 1 日	新股流 通受限	14.07	68.00	628	8,835.96	42,704.00	-
300979	华利 集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流 通受限	33.22	87.50	361	11,992.42	31,587.50	-
300973	立高 食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股流 通受限	28.28	115.71	267	7,550.76	30,894.57	-
301021	英诺 激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流 通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕 科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股流 通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠 股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股流 通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
300981	中红 医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流 通受限	48.59	90.39	228	11,078.52	20,608.92	-
300941	创识 科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流 通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋 医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流 通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾 电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流 通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友 联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流 通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文 电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流 通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林	2021 年	2021	新股流	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-

	精密	4月6日	年10月15日	通受限						
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔	2021年	2021	新股流	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

	伟	6月23日	年12月30日	通受限						
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德国特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通	2021年	2021	新股流	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-

	新材	1月13日	年7月21日	通受限						
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	292	7,270.80	7,244.52	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-

301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

注：上述流通受限证券的“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终可流通日期以上市公司公告为准。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年6月16日	临时停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	31,900	255,396.93	178,321.00	-



### 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，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本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 83,600,000.00 元，于 2021 年 7 月 6 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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

-

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由涉及金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、董事会下设风险控制委员会，督察长、管理层下设风险管理委员会，合规管理部、风险管理部和各业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有除国

债、央行票据和政策性金融债以外的债券资产（上年度末：同）。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	105,573,850.00	4,799,520.00
合计	105,573,850.00	4,799,520.00

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

（2）未评级债券包括债券期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据和部分短期融资券等。

（3）债券投资以净价列示。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金与本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

-

### 6.4.13.3.2 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

### 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因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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本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。下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 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	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产						
银行存款	14,785,627.00	-	-	-	-	14,785,627.00
结算备付金	74,349,576.01	-	-	-	-	74,349,576.01
存出保证金	97,617.15	-	-	-	-	97,617.15
交易性金融 资产	-	105,573,850.00	-	-	165,226,789.57	270,800,639.57
应收证券清 算款	-	-	-	-	2,203,844.53	2,203,844.53
应收利息	-	-	-	-	1,164,479.65	1,164,479.65
应收申购款	-	-	-	-	1,643,773.71	1,643,773.71
资产总计	89,232,820.16	105,573,850.00	-	-	170,238,887.46	365,045,557.62
负债						
卖出回购金 融资产款	83,600,000.00	-	-	-	-	83,600,000.00
应付证券清 算款	-	-	-	-	967,718.91	967,718.91
应付赎回款	-	-	-	-	12,187,907.21	12,187,907.21
应付管理人 报酬	-	-	-	-	304,583.49	304,583.49
应付托管费	-	-	-	-	43,511.94	43,511.94
应付销售服 务费	-	-	-	-	41,650.02	41,650.02
应付交易费 用	-	-	-	-	209,597.34	209,597.34
应付利息	-	-	-	-	9,928.31	9,928.31
其他负债	-	-	-	-	84,330.56	84,330.56
负债总计	83,600,000.00	-	-	-	13,849,227.78	97,449,227.78
利率敏感度 缺口	5,632,820.16	105,573,850.00	-	-	156,389,659.68	267,596,329.84
上年度末 2020 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产						
银行存款	22,087,342.51	-	-	-	-	22,087,342.51
结算备付金	91,656,861.26	-	-	-	-	91,656,861.26
存出保证金	104,554.59	-	-	-	-	104,554.59
交易性金融 资产	4,799,520.00	-	-	-	175,255,746.98	180,055,266.98
应收证券清 算款	-	-	-	-	621,280.49	621,280.49

应收利息	-	-	-	-	111,822.82	111,822.82
应收申购款	-	-	-	-	1,019.27	1,019.27
资产总计	118,648,278.36	-	-	-	175,989,869.56	294,638,147.92
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,701,564.79	1,701,564.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	317,244.54	317,244.54
应付托管费	-	-	-	-	45,320.64	45,320.64
应付销售服务费	-	-	-	-	43,255.76	43,255.76
应付交易费用	-	-	-	-	96,971.02	96,971.02
其他负债	-	-	-	-	165,177.43	165,177.43
负债总计	-	-	-	-	2,369,534.18	2,369,534.18
利率敏感度缺口	118,648,278.36	-	-	-	173,620,335.38	292,268,613.74

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率增加 25 个基点	-144,826.42	-293.31
	市场利率减少 25 个基点	145,232.87	293.31

#### 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。

本基金持有的金融工具以人民币计价，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，所面临的最大其他价格风险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风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施

监控。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	165,226,789.57	61.74	175,255,746.98	59.96
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	105,573,850.00	39.45	4,799,520.00	1.64
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	270,800,639.57	101.20	180,055,266.98	61.61

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
		沪深 300 指数上升 5%	11,329,700.00
	沪深 300 指数下降 5%	-11,329,700.00	-6,986,100.00

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

-

#### 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	165,226,789.57	45.26
	其中：股票	165,226,789.57	45.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	105,573,850.00	28.92
	其中：债券	105,573,850.00	28.92
	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	89,135,203.01	24.42
8	其他各项资产	5,109,715.04	1.40
9	合计	365,045,557.62	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,724,652.38	0.64
B	采矿业	3,353,217.00	1.25
C	制造业	89,671,178.32	33.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,867,678.39	1.07
E	建筑业	1,987,866.37	0.74
F	批发和零售业	1,218,699.58	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	4,642,965.24	1.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,291,658.80	1.98
J	金融业	41,781,764.65	15.61
K	房地产业	3,218,635.00	1.20
L	租赁和商务服务业	2,920,844.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	2,216,701.80	0.83

N	水利、环境和公共设施管理业	39,030.68	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	288,282.00	0.11
Q	卫生和社会工作	3,350,617.36	1.25
R	文化、体育和娱乐业	652,998.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	165,226,789.57	61.74

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

-

### 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	600519	贵州茅台	4,700	9,666,490.00	3.61
2	000858	五粮液	18,400	5,481,176.00	2.05
3	601318	中国平安	81,779	5,256,754.12	1.96
4	600036	招商银行	92,175	4,994,963.25	1.87
5	000001	平安银行	194,662	4,403,254.44	1.65
6	002142	宁波银行	80,402	3,133,265.94	1.17
7	601012	隆基股份	31,080	2,761,147.20	1.03
8	000333	美的集团	37,300	2,662,101.00	0.99
9	600276	恒瑞医药	33,220	2,257,963.40	0.84
10	601888	中国中免	7,400	2,220,740.00	0.83
11	002415	海康威视	34,300	2,212,350.00	0.83
12	601166	兴业银行	102,200	2,100,210.00	0.78
13	603259	药明康德	13,020	2,038,801.80	0.76
14	300059	东方财富	62,140	2,037,570.60	0.76
15	000651	格力电器	36,100	1,880,810.00	0.70
16	600900	长江电力	86,100	1,777,104.00	0.66
17	002594	比亚迪	6,800	1,706,800.00	0.64
18	002475	立讯精密	37,100	1,706,600.00	0.64
19	600887	伊利股份	45,500	1,675,765.00	0.63
20	600030	中信证券	64,100	1,598,654.00	0.60
21	000725	京东方A	253,900	1,584,336.00	0.59
22	300015	爱尔眼科	19,582	1,389,930.36	0.52
23	601398	工商银行	260,100	1,344,717.00	0.50



24	600031	三一重工	44,900	1,305,243.00	0.49
25	600309	万华化学	11,500	1,251,430.00	0.47
26	000568	泸州老窖	5,300	1,250,482.00	0.47
27	603288	海天味业	9,560	1,232,762.00	0.46
28	002714	牧原股份	20,180	1,227,347.60	0.46
29	000002	万科A	50,700	1,207,167.00	0.45
30	603501	韦尔股份	3,600	1,159,200.00	0.43
31	300122	智飞生物	6,000	1,120,380.00	0.42
32	601919	中远海控	35,500	1,084,170.00	0.41
33	601899	紫金矿业	104,500	1,012,605.00	0.38
34	601328	交通银行	203,800	998,620.00	0.37
35	600436	片仔癀	2,200	986,260.00	0.37
36	002304	洋河股份	4,700	973,840.00	0.36
37	002352	顺丰控股	13,700	927,490.00	0.35
38	300014	亿纬锂能	8,600	893,798.00	0.33
39	002230	科大讯飞	12,900	871,782.00	0.33
40	600000	浦发银行	87,100	871,000.00	0.33
41	002812	恩捷股份	3,700	866,170.00	0.32
42	601688	华泰证券	52,400	827,920.00	0.31
43	600837	海通证券	71,600	823,400.00	0.31
44	600438	通威股份	18,900	817,803.00	0.31
45	300274	阳光电源	7,100	816,926.00	0.31
46	000661	长春高新	2,100	812,700.00	0.30
47	000100	TCL 科技	106,000	810,900.00	0.30
48	300124	汇川技术	10,550	783,443.00	0.29
49	000063	中兴通讯	23,500	780,905.00	0.29
50	002241	歌尔股份	18,200	777,868.00	0.29
51	601816	京沪高铁	146,836	776,762.44	0.29
52	601601	中国太保	26,400	764,808.00	0.29
53	601668	中国建筑	162,900	757,485.00	0.28
54	300347	泰格医药	3,900	753,870.00	0.28
55	600690	海尔智家	29,000	751,390.00	0.28
56	600585	海螺水泥	18,100	743,005.00	0.28
57	002271	东方雨虹	13,400	741,288.00	0.28
58	300142	沃森生物	12,000	740,400.00	0.28
59	002460	赣锋锂业	6,000	726,540.00	0.27
60	603986	兆易创新	3,760	706,504.00	0.26
61	002027	分众传媒	74,400	700,104.00	0.26
62	600763	通策医疗	1,700	698,700.00	0.26

63	600016	民生银行	157,500	694,575.00	0.26
64	603799	华友钴业	5,900	673,780.00	0.25
65	600048	保利地产	53,800	647,752.00	0.24
66	600703	三安光电	20,200	647,410.00	0.24
67	600196	复星医药	8,900	641,957.00	0.24
68	000338	潍柴动力	35,000	625,450.00	0.23
69	600919	江苏银行	87,000	617,700.00	0.23
70	600050	中国联通	142,100	613,872.00	0.23
71	002129	中环股份	15,600	602,160.00	0.23
72	601229	上海银行	73,100	599,420.00	0.22
73	600660	福耀玻璃	10,700	597,595.00	0.22
74	600104	上汽集团	27,100	595,387.00	0.22
75	601211	国泰君安	33,425	572,904.50	0.21
76	601766	中国中车	91,200	554,496.00	0.21
77	600570	恒生电子	5,800	540,850.00	0.20
78	601169	北京银行	110,200	536,674.00	0.20
79	600999	招商证券	27,600	524,952.00	0.20
80	688111	金山办公	1,300	513,240.00	0.19
81	600019	宝钢股份	66,500	508,060.00	0.19
82	300498	温氏股份	34,200	491,454.00	0.18
83	002311	海大集团	5,900	481,440.00	0.18
84	002049	紫光国微	3,100	477,989.00	0.18
85	600406	国电南瑞	20,560	477,814.40	0.18
86	002410	广联达	7,000	477,400.00	0.18
87	601988	中国银行	154,100	474,628.00	0.18
88	601088	中国神华	24,200	472,384.00	0.18
89	002371	北方华创	1,700	471,546.00	0.18
90	300601	康泰生物	3,100	461,900.00	0.17
91	601818	光大银行	121,700	460,026.00	0.17
92	000625	长安汽车	17,200	452,016.00	0.17
93	600745	闻泰科技	4,600	445,740.00	0.17
94	600893	航发动力	8,200	436,158.00	0.16
95	601628	中国人寿	12,700	430,403.00	0.16
96	000538	云南白药	3,700	428,164.00	0.16
97	600028	中国石化	98,200	428,152.00	0.16
98	300450	先导智能	6,900	414,966.00	0.16
99	002821	凯莱英	1,100	409,860.00	0.15
100	601633	长城汽车	9,300	405,387.00	0.15
101	601377	兴业证券	41,600	401,856.00	0.15

102	600588	用友网络	12,000	399,120.00	0.15
103	002493	荣盛石化	23,100	398,937.00	0.15
104	601009	南京银行	37,800	397,656.00	0.15
105	600346	恒力石化	15,100	396,224.00	0.15
106	601658	邮储银行	78,900	396,078.00	0.15
107	601390	中国中铁	75,500	395,620.00	0.15
108	300595	欧普康视	3,800	393,490.00	0.15
109	601857	中国石油	72,300	382,467.00	0.14
110	300413	芒果超媒	5,300	363,580.00	0.14
111	002601	龙麟佰利	10,500	363,090.00	0.14
112	600132	重庆啤酒	1,800	356,310.00	0.13
113	600009	上海机场	7,300	351,349.00	0.13
114	600584	长电科技	9,300	350,424.00	0.13
115	601225	陕西煤业	29,300	347,205.00	0.13
116	600426	华鲁恒升	11,200	346,640.00	0.13
117	002001	新和成	11,740	336,703.20	0.13
118	688012	中微公司	2,022	335,490.24	0.13
119	688036	传音控股	1,600	335,200.00	0.13
120	601100	恒立液压	3,900	335,088.00	0.13
121	000776	广发证券	22,100	334,594.00	0.13
122	601939	建设银行	50,300	334,495.00	0.12
123	300433	蓝思科技	11,338	333,450.58	0.12
124	300408	三环集团	7,800	330,876.00	0.12
125	000895	双汇发展	10,400	330,720.00	0.12
126	002179	中航光电	4,100	323,982.00	0.12
127	600741	华域汽车	12,300	323,121.00	0.12
128	600958	东方证券	32,100	320,679.00	0.12
129	600926	杭州银行	21,700	320,075.00	0.12
130	603882	金域医学	2,000	319,540.00	0.12
131	000786	北新建材	8,100	317,925.00	0.12
132	000166	申万宏源	67,700	316,836.00	0.12
133	600111	北方稀土	15,300	316,710.00	0.12
134	002050	三花智控	13,100	314,138.00	0.12
135	002841	视源股份	2,500	310,725.00	0.12
136	300003	乐普医疗	9,500	305,140.00	0.11
137	002007	华兰生物	8,200	300,776.00	0.11
138	600600	青岛啤酒	2,600	300,690.00	0.11
139	000963	华东医药	6,500	299,065.00	0.11
140	601155	新城控股	7,000	291,200.00	0.11

141	601336	新华保险	6,300	289,233.00	0.11
142	000157	中联重科	31,200	288,288.00	0.11
143	002607	中公教育	13,800	288,282.00	0.11
144	002236	大华股份	13,600	286,960.00	0.11
145	601901	方正证券	30,600	286,416.00	0.11
146	601006	大秦铁路	43,500	286,230.00	0.11
147	600029	南方航空	47,500	285,950.00	0.11
148	600015	华夏银行	46,000	284,740.00	0.11
149	601877	正泰电器	8,200	273,716.00	0.10
150	000768	中航西飞	10,400	273,312.00	0.10
151	600176	中国巨石	17,560	272,355.60	0.10
152	601989	中国重工	65,700	270,684.00	0.10
153	600352	浙江龙盛	19,700	270,678.00	0.10
154	601138	工业富联	21,700	269,297.00	0.10
155	600143	金发科技	12,900	269,094.00	0.10
156	300529	健帆生物	3,100	267,716.00	0.10
157	603993	洛阳钼业	51,800	267,288.00	0.10
158	600010	包钢股份	172,400	267,220.00	0.10
159	603806	福斯特	2,500	262,825.00	0.10
160	600760	中航沈飞	4,340	261,702.00	0.10
161	603369	今世缘	4,800	259,968.00	0.10
162	601788	光大证券	14,530	259,941.70	0.10
163	000876	新希望	17,400	255,258.00	0.10
164	002008	大族激光	6,300	254,457.00	0.10
165	601186	中国铁建	34,200	254,106.00	0.09
166	601600	中国铝业	47,800	253,340.00	0.09
167	001979	招商蛇口	23,100	252,945.00	0.09
168	002202	金风科技	20,800	252,928.00	0.09
169	688169	石头科技	200	252,200.00	0.09
170	600547	山东黄金	13,100	251,782.00	0.09
171	601799	星宇股份	1,100	248,292.00	0.09
172	688626	翔宇医疗	2,374	247,275.84	0.09
173	000938	紫光股份	11,200	245,056.00	0.09
174	600989	宝丰能源	17,400	238,032.00	0.09
175	002555	三七互娱	9,900	237,798.00	0.09
176	601916	浙商银行	59,800	237,406.00	0.09
177	003816	中国广核	88,500	236,295.00	0.09
178	000069	华侨城A	31,300	232,872.00	0.09
179	600109	国金证券	17,800	225,882.00	0.08

180	000425	徐工机械	35,300	224,861.00	0.08
181	002624	完美世界	9,400	224,754.00	0.08
182	600150	中国船舶	13,600	224,536.00	0.08
183	601066	中信建投	7,100	223,153.00	0.08
184	600795	国电电力	91,500	222,345.00	0.08
185	300136	信维通信	7,200	222,336.00	0.08
186	601669	中国电建	57,400	222,138.00	0.08
187	603160	汇顶科技	1,700	220,371.00	0.08
188	603899	晨光文具	2,600	219,856.00	0.08
189	002384	东山精密	10,500	218,820.00	0.08
190	688008	澜起科技	3,461	215,897.18	0.08
191	600079	人福医药	7,400	209,198.00	0.08
192	600085	同仁堂	5,100	208,335.00	0.08
193	601238	广汽集团	16,000	207,200.00	0.08
194	000783	长江证券	28,300	207,156.00	0.08
195	603019	中科曙光	7,500	207,075.00	0.08
196	600886	国投电力	21,500	206,615.00	0.08
197	600183	生益科技	8,800	206,008.00	0.08
198	000066	中国长城	14,100	205,860.00	0.08
199	300558	贝达药业	1,900	205,656.00	0.08
200	000703	恒逸石化	17,200	205,540.00	0.08
201	000977	浪潮信息	7,300	205,349.00	0.08
202	603659	璞泰来	1,500	204,900.00	0.08
203	601838	成都银行	16,200	204,768.00	0.08
204	603833	欧派家居	1,400	198,744.00	0.07
205	002600	领益智造	21,000	192,990.00	0.07
206	601108	财通证券	18,300	191,967.00	0.07
207	000596	古井贡酒	800	191,600.00	0.07
208	300144	宋城演艺	11,400	191,520.00	0.07
209	601555	东吴证券	22,900	190,986.00	0.07
210	601985	中国核电	37,700	190,762.00	0.07
211	601360	三六零	15,600	190,476.00	0.07
212	002414	高德红外	6,900	190,302.00	0.07
213	002252	上海莱士	25,400	190,246.00	0.07
214	601077	渝农商行	47,600	189,924.00	0.07
215	002044	美年健康	20,700	188,577.00	0.07
216	300677	英科医疗	1,500	187,200.00	0.07
217	300033	同花顺	1,600	180,448.00	0.07
218	002938	鹏鼎控股	5,000	179,400.00	0.07

219	002024	苏宁易购	31,900	178,321.00	0.07
220	300676	华大基因	1,500	177,900.00	0.07
221	300623	捷捷微电	4,700	177,801.00	0.07
222	600872	中炬高新	4,200	176,484.00	0.07
223	000728	国元证券	22,100	176,137.00	0.07
224	600332	白云山	5,200	176,020.00	0.07
225	300628	亿联网络	2,100	175,980.00	0.07
226	601607	上海医药	8,300	175,379.00	0.07
227	600161	天坛生物	5,100	174,675.00	0.07
228	600362	江西铜业	7,800	174,564.00	0.07
229	601800	中国交建	26,900	174,312.00	0.07
230	601111	中国国航	22,400	174,272.00	0.07
231	600115	中国东航	34,300	174,244.00	0.07
232	600522	中天科技	17,400	174,000.00	0.07
233	002602	世纪华通	27,100	173,982.00	0.07
234	600383	金地集团	16,900	173,056.00	0.06
235	000860	顺鑫农业	4,100	172,938.00	0.06
236	603517	绝味食品	2,000	168,580.00	0.06
237	002916	深南电路	1,500	166,695.00	0.06
238	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.06
239	600061	国投资本	19,000	161,310.00	0.06
240	601727	上海电气	37,800	160,272.00	0.06
241	601162	天风证券	32,900	159,894.00	0.06
242	600845	宝信软件	3,130	159,317.00	0.06
243	601618	中国中冶	53,300	158,834.00	0.06
244	002508	老板电器	3,400	158,100.00	0.06
245	600705	中航资本	40,700	157,509.00	0.06
246	603939	益丰药房	2,800	157,052.00	0.06
247	000708	中信特钢	7,500	156,300.00	0.06
248	601878	浙商证券	11,100	145,188.00	0.05
249	601990	南京证券	13,800	145,176.00	0.05
250	600521	华海药业	6,900	144,072.00	0.05
251	600655	豫园股份	12,400	143,716.00	0.05
252	000656	金科股份	24,800	143,592.00	0.05
253	002157	正邦科技	12,000	143,400.00	0.05
254	002463	沪电股份	9,200	142,324.00	0.05
255	601021	春秋航空	2,500	142,250.00	0.05
256	600606	绿地控股	26,100	142,245.00	0.05
257	600011	华能国际	33,700	142,214.00	0.05

258	002456	欧菲光	16,000	142,080.00	0.05
259	601696	中银证券	6,500	133,835.00	0.05
260	601995	中金公司	2,100	129,150.00	0.05
261	600118	中国卫星	4,400	128,744.00	0.05
262	600848	上海临港	7,140	127,806.00	0.05
263	002558	巨人网络	9,600	127,680.00	0.05
264	600018	上港集团	26,600	126,882.00	0.05
265	601933	永辉超市	26,800	126,764.00	0.05
266	600489	中金黄金	14,700	126,714.00	0.05
267	601216	君正集团	24,800	126,232.00	0.05
268	603195	公牛集团	600	121,200.00	0.05
269	603392	万泰生物	460	119,222.80	0.04
270	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.04
271	603338	浙江鼎力	1,900	111,511.00	0.04
272	601319	中国人保	18,800	111,484.00	0.04
273	002673	西部证券	13,500	111,375.00	0.04
274	601998	中信银行	21,800	111,180.00	0.04
275	688363	华熙生物	400	111,144.00	0.04
276	688126	沪硅产业	3,800	110,884.00	0.04
277	688009	中国通号	19,443	110,630.67	0.04
278	601872	招商轮船	23,740	109,678.80	0.04
279	002120	韵达股份	8,100	109,593.00	0.04
280	603156	养元饮品	3,702	105,803.16	0.04
281	002739	万达电影	6,200	97,898.00	0.04
282	601881	中国银河	8,900	95,942.00	0.04
283	600233	圆通速递	9,400	94,094.00	0.04
284	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.04
285	603658	安图生物	1,230	93,197.10	0.03
286	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.03
287	603233	大参林	1,800	91,998.00	0.03
288	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.03
289	002032	苏泊尔	1,300	82,927.00	0.03
290	601236	红塔证券	6,000	81,360.00	0.03
291	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.03
292	600482	中国动力	4,600	80,132.00	0.03
293	600025	华能水电	13,700	79,323.00	0.03
294	601231	环旭电子	4,700	79,007.00	0.03
295	000800	一汽解放	7,300	78,986.00	0.03
296	002153	石基信息	3,260	76,642.60	0.03

297	002939	长城证券	6,200	69,006.00	0.03
298	300919	中伟股份	418	68,134.00	0.03
299	600918	中泰证券	6,100	66,002.00	0.02
300	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
301	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.02
302	601808	中海油服	4,500	64,620.00	0.02
303	002773	康弘药业	2,700	62,451.00	0.02
304	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.02
305	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
306	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
307	300957	贝泰妮	213	53,667.48	0.02
308	601698	中国卫通	2,900	46,951.00	0.02
309	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
310	300894	火星人	628	42,704.00	0.02
311	603087	甘李药业	400	42,632.00	0.02
312	688092	爱科科技	1,137	39,283.35	0.01
313	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
314	600299	安迪苏	2,700	32,292.00	0.01
315	002945	华林证券	2,300	31,786.00	0.01
316	300979	华利集团	361	31,587.50	0.01
317	300973	立高食品	267	30,894.57	0.01
318	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
319	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
320	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
321	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
322	300981	中红医疗	228	20,608.92	0.01
323	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
324	300985	致远新能	692	18,800.52	0.01
325	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
326	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
327	300925	法本信息	600	15,774.00	0.01
328	300932	三友联众	492	15,601.32	0.01
329	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
330	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.01
331	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
332	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
333	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
334	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
335	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00



336	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
337	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
338	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
339	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
340	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
341	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
342	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
343	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
344	300931	通用电梯	713	9,360.14	0.00
345	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
346	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
347	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
348	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
349	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
350	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
351	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
352	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
353	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
354	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
355	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
356	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
357	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
358	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
359	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
360	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
361	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
362	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
363	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
364	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
365	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
366	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
367	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
368	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
369	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
370	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
371	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
372	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
373	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
374	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

375	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	600519	贵州茅台	11,189,960.00	3.83
2	600036	招商银行	8,551,225.79	2.93
3	000858	五粮液	8,264,138.00	2.83
4	601318	中国平安	7,833,361.00	2.68
5	000001	平安银行	5,823,883.00	1.99
6	002142	宁波银行	4,357,074.50	1.49
7	000333	美的集团	3,776,610.00	1.29
8	600030	中信证券	3,585,895.00	1.23
9	601166	兴业银行	3,480,287.00	1.19
10	601012	隆基股份	3,412,894.60	1.17
11	600276	恒瑞医药	3,141,245.00	1.07
12	601888	中国中免	3,124,036.72	1.07
13	600887	伊利股份	2,504,025.00	0.86
14	600031	三一重工	2,278,542.00	0.78
15	002415	海康威视	2,226,716.00	0.76
16	000651	格力电器	2,150,468.00	0.74
17	603259	药明康德	2,138,035.00	0.73
18	300059	东方财富	2,107,579.00	0.72
19	000725	京东方 A	2,080,215.00	0.71
20	600900	长江电力	2,069,716.00	0.71

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	10,699,676.00	3.66
2	600036	招商银行	9,320,039.46	3.19
3	601318	中国平安	9,021,123.00	3.09

4	000858	五 粮 液	8,040,027.00	2.75
5	000333	美的集团	4,174,192.00	1.43
6	601166	兴业银行	3,967,674.00	1.36
7	600030	中信证券	3,772,567.00	1.29
8	600276	恒瑞医药	3,509,348.00	1.20
9	601012	隆基股份	3,447,199.84	1.18
10	000001	平安银行	3,333,986.00	1.14
11	601888	中国中免	3,271,896.00	1.12
12	600887	伊利股份	2,890,644.00	0.99
13	000651	格力电器	2,508,403.56	0.86
14	300059	东方财富	2,425,822.00	0.83
15	600031	三一重工	2,400,142.00	0.82
16	002142	宁波银行	2,268,770.00	0.78
17	601939	建设银行	2,217,329.60	0.76
18	002594	比亚迪	2,193,503.76	0.75
19	603259	药明康德	2,162,199.60	0.74
20	601398	工商银行	2,153,331.00	0.74

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	229,138,771.89
卖出股票收入（成交）总额	253,296,576.40

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	105,573,850.00	39.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	105,573,850.00	39.45

## 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	019649	21 国债 01	1,055,000	105,573,850.00	39.45

注：本基金本报告期末仅持有 1 只债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					-309,960.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					0.00

注：本基金本报告期末未持仓股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持仓股指期货。

## 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

本基金本报告期末未持仓国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持仓国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

因平安银行股份有限公司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行为，中国银保监会云南监管局于 2021 年 5 月 28 日作出《云银保监罚决字（2021）34 号》，对平安银行处以罚款 210 万元的行政处罚。

因招商银行股份有限公司为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等二十七项违法违规行为，中国银保监会于 2021 年 5 月 17 日作出《银保监罚决字（2021）16 号》，对招商银行处以罚款 7170 万元的行政处罚。

报告期内，本基金管理人严格遵循基金投资管理相关制度要求，上述证券发行主体的违法违规行为暂不会造成重大负面影响，投资决策程序符合法律法规和公司制度的规定。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本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	97,617.15
2	应收证券清算款	2,203,844.53
3	应收股利	-
4	应收利息	1,164,479.65
5	应收申购款	1,643,773.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,109,715.04

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
华润元大安鑫灵活配置混合 A	648	9,277.08	664,656.75	11.06%	5,346,891.65	88.94%
华润元大安鑫灵活配置混合 C	123	1,120,326.57	137,317,263.45	99.65%	482,904.19	0.35%
合计	771	186,526.22	137,981,920.20	95.95%	5,829,795.84	4.05%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	华润元大安鑫灵活配置混合 A	776.84	0.0129%
	华润元大安鑫灵活配置混合 C	0.00	0.0000%
	合计	776.84	0.0005%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	华润元大安鑫灵活配置混合 A	0
	华润元大安鑫灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华润元大安鑫灵活配置混合 A	0~10
	华润元大安鑫灵活配置混合 C	0
	合计	0~10

注：1、本期末本基金的基金经理持有本基金的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

2、截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华润元大安鑫灵 活配置混合 A	华润元大安鑫灵 活配置混合 C
基金合同生效日（2014 年 9 月 18 日）基金份 额总额	65,878,168.77	-
本报告期期初基金份额总额	6,909,201.17	156,503,552.98
本报告期基金总申购份额	980,658.70	174,505,060.93
减：本报告期基金总赎回份额	1,878,311.47	193,208,446.27
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,011,548.40	137,800,167.64

注：本基金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。



## § 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

本报告期内，本基金管理人发生重大人事变动如下：自 2021 年 3 月 3 日起，黄昭棠先生不再担任华润元大基金管理有限公司第三届监事会监事职务；2021 年 3 月 29 日，改选林瑞源为华润元大基金管理有限公司第三届监事会监事。

上述变更已按照规定报相关监管机构备案，并进行公告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门变动如下：2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人，托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚。

### 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	
国盛证券	1	208,860,753.16	44.10%	148,559.88	37.68%	-
中信证券	2	172,341,613.83	36.39%	160,501.94	40.71%	-
招商证券	1	88,080,570.41	18.60%	82,029.84	20.81%	-
海通证券	1	4,331,545.20	0.91%	3,167.67	0.80%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

民生证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本基金本报告期内租用的基金专用交易单元未发生变化。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

国盛证券	105,723,643.20	95.66%	287,200,000.00	63.20%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	4,798,560.00	4.34%	167,200,000.00	36.80%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华润元大基金管理有限公司关于终止深圳前海汇联基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021年1月8日
2	华润元大基金管理有限公司季度报告提示性公告（2020年第4季度）	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021年1月22日
3	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021年1月22日
4	华润元大基金管理有限公司关于增聘胡永杰为华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	证券时报、基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021年1月26日
5	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2021年第1号）	基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021年2月18日
6	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金（华润元大安	基金管理人公司网站、证监会基金电子	2021年2月18日

	鑫灵活配置 A 份额) 基金产品资料概要 (更新)	披露网站	
7	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 (华润元大安鑫灵活配置 C 份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 18 日
8	关于警惕冒用华润元大基金管理有限公司产品销售机构名义进行诈骗活动的特别提示公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 2 日
9	关于华润元大基金管理有限公司监事辞职的公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 4 日
10	华润元大基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 6 日
11	华润元大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	证券时报、证券日报、基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 18 日
12	华润元大基金管理有限公司年度报告提示性公告 (2020 年度)	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
13	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
14	关于华润元大基金管理有限公司监事变更的公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 1 日
15	华润元大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	证券时报、证券日报、基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 21 日
16	华润元大基金管理有限公司季度报告提示性公告 (2021	证券时报、中证报、上证报、证券日报、	2021 年 4 月 22 日

	年第 1 季度)	基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	
17	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 22 日
18	华润元大基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 5 日
19	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金根据侧袋机制指引修订基金合同的公告	证券时报、中证报、上证报、证券日报、基金管理人公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 22 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无

### 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、中国证监会关于核准本基金募集的批复；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日