

华润元大价值优选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：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 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.....	43
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55

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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金	
基金简称	华润元大价值优选	
基金主代码	004930	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 7 月 24 日	
基金管理人	华润元大基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	45,443,278.86 份	
下属分级基金的基金简称:	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C
下属分级基金的交易代码:	004930	004931
报告期末下属分级基金的份额总额	22,615,150.97 份	22,828,127.89 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行深入的个股/个券挖掘，积极优选具备利润创造能力并且估值水平具备竞争力的公司，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金具有前瞻性的宏观策略分析，自上而下分析与自下而上选股相结合，进行深入的个股/个券挖掘。本基金以价值投资理念为核心，根据中国股票市场的投资特点进行改良应用。首先根据不同的经济周期及市场趋势研判，决定本基金的大类资产配置以及行业偏离决策；其次在个股选择上，通过深入研究寻找优质企业，运用估值方法估算其内在投资价值，并根据国内市场的特殊性 & 波动性，综合考虑可能影响企业投资价值以及市场价格的所有因素，发现具备投资价值的个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中债总指数（全价）收益率×15%+恒生指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金。 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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘豫皓
	联系电话	0755-88399008
	电子邮箱	kf@cryuantafund.com
		郭明
		010-66105799
		custody@icbc.com.cn

客户服务电话	4000-1000-89	95588
传真	0755-88399045	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码	518066	100140
法定代表人	李巍巍	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.cryuantafund.com
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	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 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	4,044,159.43	4,977,222.93
本期利润	4,926,880.32	4,060,937.32
加权平均基金份额本期利润	0.1808	0.1301
本期加权平均净值利润率	17.50%	12.61%
本期基金份额净值增长率	16.28%	15.82%
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	615,102.11	440,628.12
期末可供分配基金份额利润	0.0272	0.0193
期末基金资产净值	25,771,084.30	25,820,274.23
期末基金份额净值	1.1395	1.1311
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	13.95%	13.11%

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

华润元大价值优选 A

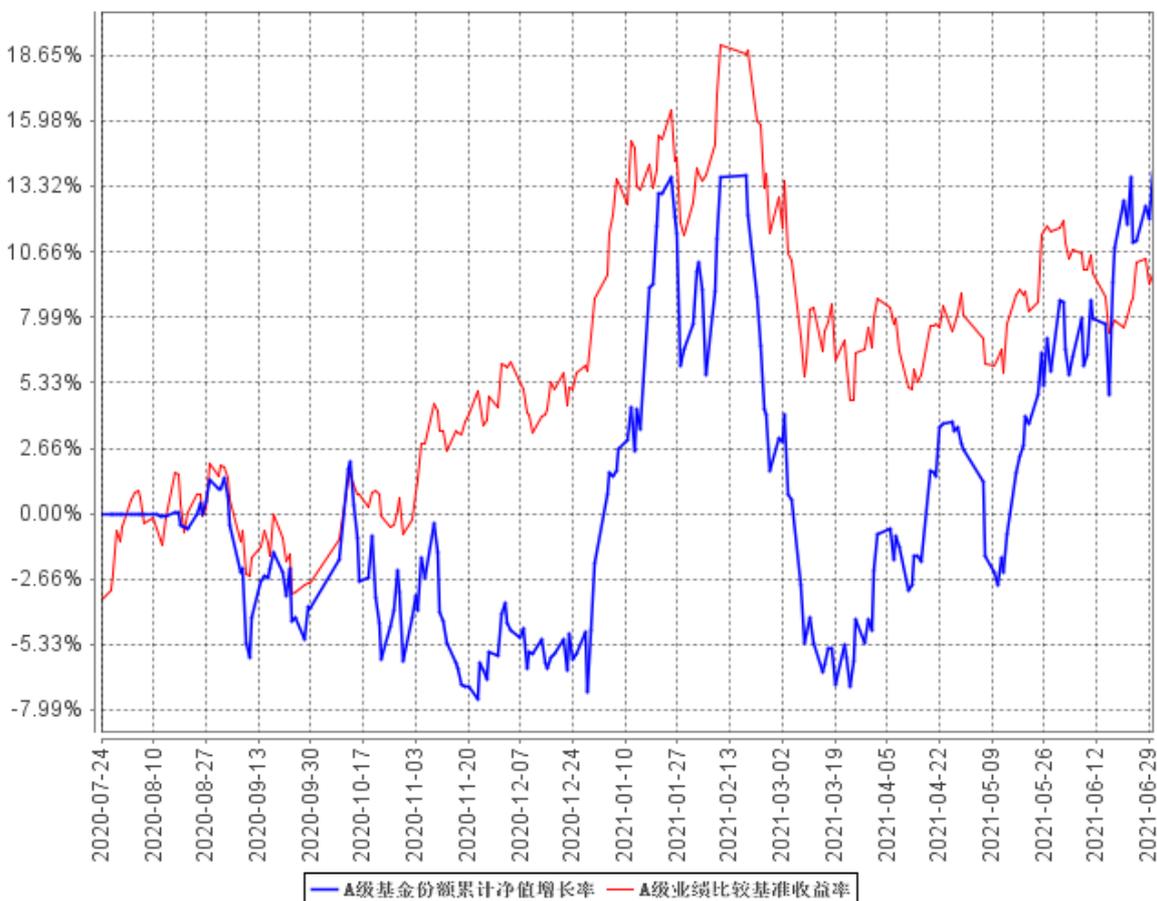
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.82%	1.70%	-1.64%	0.65%	6.46%	1.05%
过去三个月	19.59%	1.48%	2.88%	0.79%	16.71%	0.69%
过去六个月	16.28%	1.66%	0.98%	1.06%	15.30%	0.60%
自基金合同生效起至今	13.95%	1.46%	9.82%	0.99%	4.13%	0.47%

华润元大价值优选 C

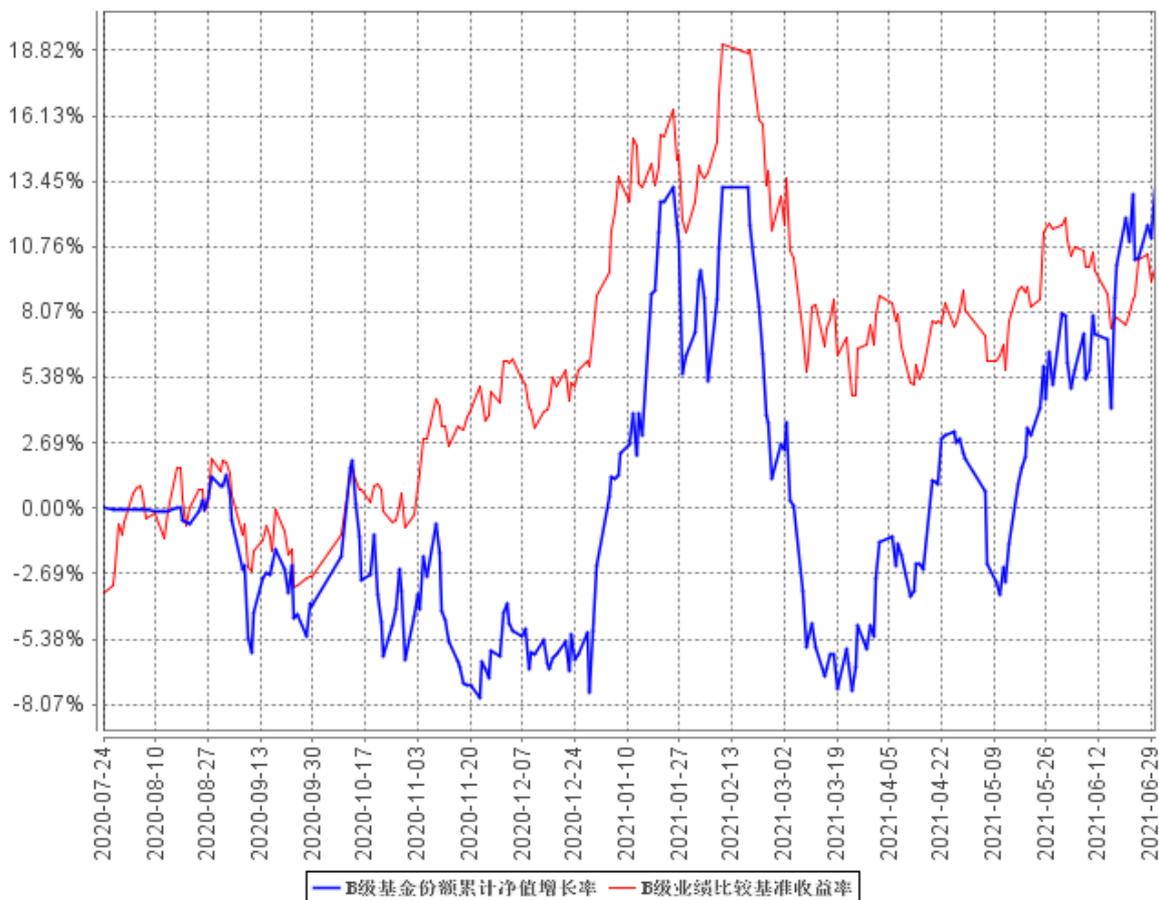
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.76%	1.71%	-1.64%	0.65%	6.40%	1.06%
过去三个月	19.36%	1.48%	2.88%	0.79%	16.48%	0.69%
过去六个月	15.82%	1.66%	0.98%	1.06%	14.84%	0.60%
自基金合同生效起至今	13.11%	1.46%	9.82%	0.99%	3.29%	0.47%

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



B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		
刘宏毅	本基金基金经理，权益投资部负责人	2020 年 7 月 24 日	-	12 年	中国，复旦大学发展经济学硕士，具有基金从业资格。曾任湘财证券有限责任公司研究员、信诚基金管理有限公司宏观分析师。2017 年 7 月 17 日加入华润元大基金管理有限公司，现任公司权益投资部负责人。2019 年 2 月 14 日起担任华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理；2020 年 3 月 18 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 7 月 24 日起担任华润元大价值优选混合型发起式

					证券投资基金基金经理、2020 年 8 月 10 日起担任华润元大欣享混合型发起式证券投资基金基金经理、2020 年 8 月 24 日起担任华润元大核心动力混合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 年上半年，A 股震荡中开始分化，并开始呈现风格切换：投资者更关注估值模型中的分子端即成长性，而不再沉迷于分母的不断下行带来的估值提升。市场随流动性预期波动后，产业逻辑逐渐占据主导：细分行业景气持续，成长股重新获得重视。

本基金将继续挖掘高成长行业的龙头标的，力争获取中国转型升级带来的长期回报。

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价值优选 A 基金份额净值为 1.1395 元，本报告期基金份额净值增长

率为 16.28%；截至本报告期末华润元大价值优选 C 基金份额净值为 1.1311 元，本报告期基金份额净值增长率为 15.82%；同期业绩比较基准收益率为 0.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年，全球经济增长节奏仍然受疫情影响：上半年随着主要国家的疫苗接种率上升，经济复苏预期增强，年初流动性出现了提前收紧的预期；但随着年中疫情变种的出现和扩散，全球经济复苏又有放缓迹象，相应政策预期也有微调。整体而言，全球经济仍在复苏只是节奏比预期慢，疫情对经济的短期冲击强度小于 2020 年。

在宏观经济预期波动影响下，证券市场上半年主要交易的是复苏相关的再通胀逻辑，而年中开始更多转向成长行业。展望未来，疫情的影响比预期时间持续长，再通胀逻辑降温，投资逻辑更注重行业空间和成长性，可以说是回归常态。

资本市场短期波动可能受流动性和情绪影响，我们更看好成长板块长期逻辑，包括但不限于科技、新能源、创新药等板块。

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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金的管理人——华润元大基金管理有限公司在华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人依法对华润元大基金管理有限公司编制和披露的华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金本报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：华润元大价值优选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	9,985,756.34	9,347,497.14
结算备付金		141,981.44	1,451,477.22
存出保证金		58,811.52	161,374.37
交易性金融资产	6.4.7.2	46,320,673.36	75,989,728.02
其中：股票投资		46,320,673.36	75,989,728.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	946.81	1,858.69
应收股利		-	-
应收申购款		37,244.04	62,771.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		56,545,413.51	87,014,706.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,752,825.34	4,834,158.66
应付赎回款		926,149.12	1,504,662.24
应付管理人报酬		63,919.77	102,932.72
应付托管费		10,653.32	17,155.46
应付销售服务费		17,261.71	29,211.85
应付交易费用	6.4.7.7	128,365.92	239,229.63
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	54,879.80	67,644.11
负债合计		4,954,054.98	6,794,994.67
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	45,443,278.86	82,009,568.66
未分配利润	6.4.7.10	6,148,079.67	-1,789,856.83
所有者权益合计		51,591,358.53	80,219,711.83
负债和所有者权益总计		56,545,413.51	87,014,706.50

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，华润元大价值优选 A 基金份额净值 1.1395 元，基金份额总额 22,615,150.97 份；华润元大价值优选 C 基金份额净值 1.1311 元，基金份额总额 22,828,127.89 份。华润元大价值优选份额总额合计为 45,443,278.86 份。

6.2 利润表

会计主体：华润元大价值优选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		10,424,990.54	-
1.利息收入		26,673.24	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	26,673.24	-
债券利息收入		-	-
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）		10,369,463.47	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,275,281.02	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	-	-
股利收益	6.4.7.16	94,182.45	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-33,564.72	-
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	62,418.55	-
减：二、费用		1,437,172.90	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	452,837.28	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	75,472.94	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	129,204.65	-
4. 交易费用	6.4.7.19	724,918.06	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	54,739.97	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,987,817.64	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,987,817.64	-

注：本基金基金合同于 2020 年 7 月 24 日生效，无上年度可比期间及可比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华润元大价值优选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）	82,009,568.66	-1,789,856.83	80,219,711.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,987,817.64	8,987,817.64
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）	-36,566,289.80	-1,049,881.14	-37,616,170.94
其中：1.基金申购款	16,206,342.66	962,271.42	17,168,614.08
2.基金赎回款	-52,772,632.46	-2,012,152.56	-54,784,785.02
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)	45,443,278.86	6,148,079.67	51,591,358.53
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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

注：本基金基金合同于 2020 年 7 月 24 日生效，无上年度可比期间及可比数据。

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：

<u>李仆</u>	<u>张彦军</u>	<u>张彦军</u>
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

华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2017]1065号文《关于准予华润元大润丰债券型证券投资基金注册的批复》及证监许可[2018]1102号文《关于准予华润元大润丰债券型证券投资基金变更注册的批复》的核准，由华润元大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》

和《华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2020 年 6 月 22 日至 2020 年 7 月 21 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 81,610,555.89 元，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2020)验字第 61032987_H03 号验资报告。经向中国证监会备案，《华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 81,642,582.59 份基金份额，其中认购资金利息折合 32,026.70 份基金份额。本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要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（包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、股指期货、权证、国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转换债券、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括同业存款、定期存款、协议存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、国债期货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。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 60%-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%，持有全部权证的比例不得超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或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×75%+中债总指数（全价）收益率×15%+恒生指数收益率×10%。

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

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 外币交易

-

6.4.4.13 分部报告

-

6.4.4.14 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) 境内投资

(i) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

(ii) 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。

（iii）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。

（2）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税

[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	9,985,756.34
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：	9,985,756.34

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	38,498,615.47	46,320,673.36	7,822,057.89
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	38,498,615.47	46,320,673.36	7,822,057.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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：本基金本报告期末无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	844.17
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	76.14
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	26.50
合计	946.81

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	128,365.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	128,365.92

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	331.83
应付证券出借违约金	-
预提审计费	14,876.39
预提信息披露费	39,671.58
合计	54,879.80

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华润元大价值优选 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	38,055,122.91	38,055,122.91
本期申购	7,333,076.75	7,333,076.75
本期赎回(以“-”号填列)	-22,773,048.69	-22,773,048.69
- 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	22,615,150.97	22,615,150.97

金额单位：人民币元

华润元大价值优选 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	43,954,445.75	43,954,445.75
本期申购	8,873,265.91	8,873,265.91
本期赎回(以“-”号填列)	-29,999,583.77	-29,999,583.77
- 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	22,828,127.89	22,828,127.89

注：申购包含基金转入及红利再投资的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华润元大价值优选 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,287,246.65	3,526,170.29	-761,076.36
本期利润	4,044,159.43	882,720.89	4,926,880.32
本期基金份额交易产生的变动数	858,189.33	-1,868,059.96	-1,009,870.63
其中：基金申购款	-73,771.79	449,943.76	376,171.97
基金赎回款	931,961.12	-2,318,003.72	-1,386,042.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	615,102.11	2,540,831.22	3,155,933.33

单位：人民币元

华润元大价值优选 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,088,351.68	4,059,571.21	-1,028,780.47
本期利润	4,977,222.93	-916,285.61	4,060,937.32
本期基金份额交易产生的变动数	551,756.87	-591,767.38	-40,010.51
其中：基金申购款	-185,706.46	771,805.91	586,099.45
基金赎回款	737,463.33	-1,363,573.29	-626,109.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	440,628.12	2,551,518.22	2,992,146.34

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	22,182.95
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	3,892.76
其他	597.53
合计	26,673.24

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	243,439,361.52
减：卖出股票成本总额	233,164,080.50
买卖股票差价收入	10,275,281.02

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

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

-

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。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

-

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	94,182.45
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	94,182.45

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	-33,564.72
——股票投资	-33,564.72
——债券投资	-
——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	-33,564.72

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	61,342.90

转换费收入	1,075.65
合计	62,418.55

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	724,918.06
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	724,918.06

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	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	192.00
合计	54,739.97

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

本基金本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
珠海华润银行股份有限公司（“珠海华润银行”）	与基金管理人受同一实际控制的公司

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 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	452,837.28	-
其中：支付销售机构的客户维护费	177,468.95	-

注：(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷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	75,472.94	-

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷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		
	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C	合计
中国工商银行	-	56,404.39	56,404.39
华润元大基金管理有限公司	-	40,896.77	40,896.77
合计	-	97,301.16	97,301.16
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		
	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C	合计
合计	-	-	-

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 0.8%。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：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

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

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C
基金合同生效日（2020 年 7 月 24 日）持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	22.0055%

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C

基金合同生效日（2020 年 7 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注 1：关联方投资本基金适用基金合同的约定费率。

注 2：期间申购/买入含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出含转换出份额。

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
中国工商银行	9,985,756.34	22,182.95	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

-

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工商银行股份有限公司，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（上年度末：同）。

6.4.13.2.1 按短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短期信用评级列示的债券。

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	9,985,756.34	-	-	-	-	9,985,756.34
结算备付金	141,981.44	-	-	-	-	141,981.44
存出保证金	58,811.52	-	-	-	-	58,811.52
交易性金融资产	-	-	-	-	46,320,673.36	46,320,673.36
应收利息	-	-	-	-	946.81	946.81
应收申购款	-	-	-	-	37,244.04	37,244.04
其他资产	-	-	-	-	-0.27	-0.27

资产总计	10,186,549.30	-	-	-	-46,358,863.94	56,545,413.24
负债						
应付证券清算款		-	-	-	-3,752,825.34	3,752,825.34
应付赎回款		-	-	-	-926,149.12	926,149.12
应付管理人报酬		-	-	-	-63,919.77	63,919.77
应付托管费		-	-	-	-10,653.32	10,653.32
应付销售服务费		-	-	-	-17,261.71	17,261.71
应付交易费用		-	-	-	-128,365.92	128,365.92
其他负债		-	-	-	-54,879.53	54,879.53
负债总计		-	-	-	-4,954,054.71	4,954,054.71
利率敏感度缺口	10,186,549.30				-41,404,809.23	51,591,358.53
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	9,347,497.14	-	-	-	-	9,347,497.14
结算备付金	1,451,477.22	-	-	-	-	1,451,477.22
存出保证金	161,374.37	-	-	-	-	161,374.37
交易性金融资产		-	-	-	-75,989,728.02	75,989,728.02
应收利息		-	-	-	-1,858.69	1,858.69
应收申购款		-	-	-	-62,771.06	62,771.06
资产总计	10,960,348.73	-	-	-	-76,054,357.77	87,014,706.50
负债						
应付证券清算款		-	-	-	-4,834,158.66	4,834,158.66
应付赎回款		-	-	-	-1,504,662.24	1,504,662.24
应付管理人报酬		-	-	-	-102,932.72	102,932.72
应付托管费		-	-	-	-17,155.46	17,155.46
应付销售服务费		-	-	-	-29,211.85	29,211.85
应付交易费用		-	-	-	-239,229.63	239,229.63
其他负债		-	-	-	-67,644.11	67,644.11
负债总计		-	-	-	-6,794,994.67	6,794,994.67
利率敏感度缺口	10,960,348.73	-	-	-	-69,259,363.10	80,219,711.83

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本期末本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上年度末			
	2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	13,644,331.02	-	13,644,331.02
资产合计	-	13,644,331.02	-	13,644,331.02
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	13,644,331.02	-	13,644,331.02

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

-

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证券，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、国债期货、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	46,320,673.36	89.78	75,989,728.02	94.73
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	46,320,673.36	89.78	75,989,728.02	94.73

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月 30日）	上年度末（2020年12月 31日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,630,640.00	1,939,600.00
	沪深 300 指数下降 5%	-3,630,640.00	-1,939,600.00

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	46,320,673.36	81.92
	其中：股票	46,320,673.36	81.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,127,737.78	17.91
8	其他各项资产	97,002.37	0.17
9	合计	56,545,413.51	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,480,390.00	55.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,651,000.00	24.52
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	1,659,600.00	3.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	42,790,990.00	82.94

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	449,323.20	0.87
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	581,623.92	1.13
G 工业	-	-
H 信息技术	2,498,736.24	4.84
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	3,529,683.36	6.84

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	002241	歌尔股份	129,000	5,513,460.00	10.69
2	002920	德赛西威	47,000	5,173,760.00	10.03
3	688536	思瑞浦	9,000	4,959,000.00	9.61
4	605499	东鹏饮料	15,500	3,887,400.00	7.53
5	300236	上海新阳	70,000	3,397,800.00	6.59
6	688012	中微公司	20,000	3,318,400.00	6.43
7	300496	中科创达	20,000	3,141,200.00	6.09
8	300454	深信服	10,000	2,594,800.00	5.03
9	01347	华虹半导体	70,000	2,498,736.24	4.84
10	600718	东软集团	200,000	1,956,000.00	3.79
11	688019	安集科技	6,000	1,866,000.00	3.62
12	300614	百川畅银	30,000	1,659,600.00	3.22

13	605376	博迁新材	20,000	1,477,600.00	2.86
14	300219	鸿利智汇	80,000	1,056,000.00	2.05
15	605111	新洁能	5,000	901,350.00	1.75
16	689009	九号公司	10,000	851,200.00	1.65
17	02096	先声药业	50,000	581,623.92	1.13
18	01316	耐世特	50,000	449,323.20	0.87
19	603915	国茂股份	10,000	395,000.00	0.77
20	688314	康拓医疗	3,000	316,920.00	0.61
21	688127	蓝特光学	10,000	278,100.00	0.54
22	300806	斯迪克	1,000	47,400.00	0.09

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	002241	歌尔股份	10,199,979.01	12.72
2	300236	上海新阳	6,860,380.00	8.55
3	603799	华友钴业	6,613,590.00	8.24
4	601888	中国中免	6,024,404.00	7.51
5	688019	安集科技	4,757,961.24	5.93
6	000301	东方盛虹	4,740,632.04	5.91
7	603236	移远通信	4,271,548.00	5.32
8	002291	星期六	4,211,514.00	5.25
9	605499	东鹏饮料	3,809,437.00	4.75
10	603005	晶方科技	3,738,957.00	4.66
11	601012	隆基股份	3,731,111.00	4.65
12	00522	ASM PACIFIC	3,598,292.47	4.49
13	300601	康泰生物	3,591,401.00	4.48
14	01478	丘钛科技	3,584,964.84	4.47
15	603113	金能科技	3,551,686.38	4.43
16	002920	德赛西威	3,446,947.00	4.30
17	002460	赣锋锂业	3,431,598.15	4.28
18	00700	腾讯控股	3,238,885.88	4.04
19	601336	新华保险	3,236,212.00	4.03
20	601233	桐昆股份	3,209,455.00	4.00

21	601319	中国人保	3,109,424.00	3.88
22	002648	卫星石化	3,099,023.00	3.86
23	605006	山东玻纤	3,002,059.00	3.74
24	688111	金山办公	2,897,351.50	3.61
25	600584	长电科技	2,851,654.00	3.55
26	600718	东软集团	2,811,803.00	3.51
27	002414	高德红外	2,798,025.00	3.49
28	002129	中环股份	2,722,473.00	3.39
29	688012	中微公司	2,628,681.14	3.28
30	000703	恒逸石化	2,510,126.48	3.13
31	01347	华虹半导体	2,465,695.30	3.07
32	000636	风华高科	2,447,108.00	3.05
33	300679	电连技术	2,438,976.00	3.04
34	600438	通威股份	2,432,351.00	3.03
35	300363	博腾股份	2,416,571.00	3.01
36	600699	均胜电子	2,397,181.00	2.99
37	00981	中芯国际	2,238,008.98	2.79
38	601899	紫金矿业	2,212,000.00	2.76
39	688065	凯赛生物	2,188,778.33	2.73
40	002415	海康威视	2,186,330.00	2.73
41	688677	海泰新光	2,075,509.76	2.59
42	300614	百川畅银	2,074,356.40	2.59
43	600882	妙可蓝多	2,056,434.00	2.56
44	02269	药明生物	2,012,691.46	2.51
45	688578	艾力斯	1,990,944.01	2.48
46	600546	山煤国际	1,867,360.00	2.33
47	300666	江丰电子	1,757,020.00	2.19
48	688665	四方光电	1,684,677.75	2.10
49	688630	芯碁微装	1,672,132.76	2.08
50	300953	震裕科技	1,636,595.00	2.04
51	603068	博通集成	1,626,662.00	2.03
52	300763	锦浪科技	1,613,567.00	2.01

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	603799	华友钴业	9,615,535.40	11.99
2	601888	中国中免	6,726,292.00	8.38
3	02382	舜宇光学科技	6,210,525.26	7.74
4	002241	歌尔股份	6,175,826.67	7.70
5	00175	吉利汽车	5,299,279.18	6.61
6	000301	东方盛虹	4,982,712.70	6.21
7	300454	深信服	4,935,116.00	6.15
8	01347	华虹半导体	4,920,049.72	6.13
9	002291	星期六	4,461,335.00	5.56
10	603236	移远通信	4,150,994.00	5.17
11	605006	山东玻纤	4,143,709.00	5.17
12	603005	晶方科技	4,051,962.00	5.05
13	601012	隆基股份	3,690,124.32	4.60
14	300601	康泰生物	3,663,620.00	4.57
15	603993	洛阳钼业	3,596,700.00	4.48
16	603113	金能科技	3,585,023.01	4.47
17	300236	上海新阳	3,506,677.00	4.37
18	00522	ASM PACIFIC	3,495,273.84	4.36
19	00700	腾讯控股	3,458,349.03	4.31
20	01478	丘钛科技	3,443,020.07	4.29
21	688012	中微公司	3,382,529.52	4.22
22	688002	睿创微纳	3,361,840.18	4.19
23	688023	安恒信息	3,349,780.66	4.18
24	688536	思瑞浦	3,144,719.34	3.92
25	688200	华峰测控	3,034,000.00	3.78
26	601319	中国人保	3,030,487.02	3.78
27	300776	帝尔激光	3,014,023.00	3.76
28	300207	欣旺达	3,006,592.00	3.75
29	601336	新华保险	2,953,813.00	3.68
30	000703	恒逸石化	2,944,281.64	3.67
31	601233	桐昆股份	2,909,663.60	3.63
32	002414	高德红外	2,905,913.61	3.62
33	300496	中科创达	2,858,310.00	3.56
34	600741	华域汽车	2,846,806.00	3.55
35	688063	派能科技	2,842,960.00	3.54

36	002648	卫星石化	2,822,678.00	3.52
37	002129	中环股份	2,810,267.00	3.50
38	002460	赣锋锂业	2,807,491.00	3.50
39	601908	京运通	2,739,509.00	3.42
40	600584	长电科技	2,710,371.00	3.38
41	00981	中芯国际	2,668,641.26	3.33
42	688127	蓝特光学	2,612,923.49	3.26
43	688111	金山办公	2,563,599.26	3.20
44	688008	澜起科技	2,554,584.40	3.18
45	002415	海康威视	2,493,869.20	3.11
46	300679	电连技术	2,477,956.56	3.09
47	300363	博腾股份	2,433,723.00	3.03
48	600438	通威股份	2,382,380.00	2.97
49	002876	三利谱	2,329,734.00	2.90
50	000636	风华高科	2,283,633.00	2.85
51	688677	海泰新光	2,256,137.62	2.81
52	603068	博通集成	2,220,195.00	2.77
53	600699	均胜电子	2,162,745.00	2.70
54	601899	紫金矿业	2,154,000.00	2.69
55	688578	艾力斯	2,109,887.55	2.63
56	300763	锦浪科技	2,048,702.00	2.55
57	688630	芯碁微装	2,027,463.95	2.53
58	300663	科蓝软件	2,018,064.00	2.52
59	688065	凯赛生物	2,002,459.32	2.50
60	300666	江丰电子	1,991,627.00	2.48
61	600546	山煤国际	1,926,400.00	2.40
62	688019	安集科技	1,875,314.66	2.34
63	600882	妙可蓝多	1,832,853.00	2.28
64	688665	四方光电	1,816,845.60	2.26
65	02269	药明生物	1,787,907.05	2.23
66	300953	震裕科技	1,779,317.00	2.22

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	203,528,590.56
卖出股票收入（成交）总额	243,439,361.52

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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）					0.00
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投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末持仓股指期货。

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

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

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	58,811.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	946.81
5	应收申购款	37,244.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	97,002.37

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
华润元大价值优选 A	1,391	16,258.20	0.00	0.00%	22,615,150.97	100.00%
华润元大价值优选 C	1,052	21,699.74	10,000,000.00	43.81%	12,828,127.89	56.19%
合计	2,443	18,601.42	10,000,000.00	22.01%	35,443,278.86	77.99%

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	华润元大价值优选 A	0.00	0.0000%
	华润元大价值优选 C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

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	华润元大价值优选 A	0
	华润元大价值优选 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华润元大价值优选 A	0
	华润元大价值优选 C	0
	合计	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	10,000,000.00	22.01	10,000,000.00	22.01	3 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	10,000,000.00	22.01	10,000,000.00	22.01	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华润元大价值优选 A	华润元大价值优选 C
基金合同生效日（2020 年 7 月 24 日）基金份额总额	46,720,178.03	34,922,404.56
本报告期期初基金份额总额	38,055,122.91	43,954,445.75
本报告期基金总申购份额	7,333,076.75	8,873,265.91
减：本报告期基金总赎回份额	22,773,048.69	29,999,583.77
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	22,615,150.97	22,828,127.89

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：中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）任命刘彤女士担任资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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	
中信证券	1	232,880,549.66	52.10%	218,965.48	52.34%	-
国信证券	1	214,087,402.42	47.90%	199,409.04	47.66%	-

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
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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	2021 年 1 月 22 日

3	华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金 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	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
5	关于华润元大基金管理有限公司监 事免职的公告	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
6	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
7	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	2021 年 3 月 31 日
8	华润元大价值优选混合型发起式证 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
9	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
10	华润元大基金管理有限公司季度报 告提示性公告（2021 年第 1 季度）	证券时报、中证报、上证报、证 券日报	2021 年 4 月 22 日
11	华润元大价值优选混合型发起式证 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
12	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 4 日
13	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

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	2021 年 5 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	22.01%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金于本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，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

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、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