国泰浓益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：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

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约定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 16
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 16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 18
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 18
5 托管人报告 18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 18
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 18
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 18
6 半年度财务会计报告（未经审计） 19
6.1 资产负债表 19
6.2 利润表 20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 21
6.4 报表附注 22
7 投资组合报告 46
7.1 期末基金资产组合情况 46
7.2 报告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 47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 52
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 53
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 53
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 53
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 53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 53
7.12 投资组合报告附注 53
8 基金份额持有人信息 55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 55

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 55
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 55
9 开放式基金份额变动 56
10 重大事件揭示 56
10.1 基金份额持有人大会决议 56
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 56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 56
10.4 基金投资策略的改变 56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 56
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 56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 57
10.8 其他重大事件 59
11 影响投资者决策的其他重要信息 59
12 备查文件目录 59
12.1 备查文件目录 59
12.2 存放地点 60
12.3 查阅方式 60

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	国泰浓益灵活配置混合	
基金主代码	000526	
交易代码	000526	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 3 月 4 日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
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	440,919,158.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰浓益灵活配置混合 A	国泰浓益灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	000526	002059
报告期末下属分级基金的份额总额	237,006,037.67 份	203,913,120.76 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求稳健的绝对回报。
投资策略	本基金采用积极灵活的投资策略，通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上，力争实现长期稳健的绝对收益。 本基金主要投资策略包括：1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、固定收益品种投资策略；4、股指期货投资策略；5、权证投资策略。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘国华	秦一楠
	联系电话	021-31081600转	010-66060069
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	（021）31089000，400-888-8688	95599
传真	021-31081800	010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层	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	200082	100031
法定代表人	邱军	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层和本基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国泰基金管理有限公司登记注册中心	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）**	
	国泰浓益灵活配置混合 A	国泰浓益灵活配置混合 C
本期已实现收益	21,929,419.05	20,570,208.59
本期利润	16,371,616.23	18,489,281.28
加权平均基金份额本期利润	0.0506	0.1089
本期加权平均净值利润率	3.85%	4.38%
本期基金份额净值增长率	4.31%	4.23%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2021 年 6 月 30 日)**	
	国泰浓益灵活配置混合 A	国泰浓益灵活配置混合 C
期末可供分配利润	73,016,439.85	285,951,887.46
期末可供分配基金份额利润	0.3081	1.4023
期末基金资产净值	310,022,477.52	489,865,008.22

期末基金份额净值	1.308	2.402
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2021 年 6 月 30 日)**	
	国泰浓益灵活配置混合 A	国泰浓益灵活配置混合 C
基金份额累计净值增长率	67.63%	150.66%

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，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

国泰浓益灵活配置混合 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	1.26%	0.24%	0.39%	0.01%	0.87%	0.23%
过去三个月	2.96%	0.21%	1.18%	0.01%	1.78%	0.20%
过去六个月	4.31%	0.29%	2.36%	0.01%	1.95%	0.28%
过去一年	15.43%	0.33%	4.74%	0.01%	10.69%	0.32%
过去三年	22.01%	0.58%	14.25%	0.01%	7.76%	0.57%
自基金合同生效起至今	67.63%	0.49%	36.20%	0.01%	31.43%	0.48%

国泰浓益灵活配置混合 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	1.26%	0.25%	0.39%	0.01%	0.87%	0.24%
过去三个月	2.93%	0.22%	1.18%	0.01%	1.75%	0.21%
过去六个月	4.23%	0.28%	2.36%	0.01%	1.87%	0.27%
过去一年	15.27%	0.33%	4.74%	0.01%	10.53%	0.32%
过去三年	21.69%	0.58%	14.25%	0.01%	7.44%	0.57%
自新增 C 类份额至今	150.66%	2.50%	26.69%	0.01%	123.97%	2.49%

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

国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2014 年 3 月 4 日至 2021 年 6 月 30 日）

国泰浓益灵活配置混合 A

注：1、本基金的合同生效日为 2014 年 3 月 4 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2、本基金自 2015 年 3 月 23 日起业绩比较基准由原“五年期银行定期存款利率（税后）+1%”，变更为“三年期银行定期存款利率（税后）+2%”。

国泰浓益灵活配置混合 C

注：1、本基金的合同生效日为 2014 年 3 月 4 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。自 2015 年 11 月 16 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

2、本基金自 2015 年 3 月 23 日起业绩比较基准由原“五年期银行定期存款利率（税后）+1%”，变更为“三年期银行定期存款利率（税后）+2%”。

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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 179 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利债券型证券投资基金（由国泰信用互利分级债券型证券投资基金转型而来）、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国证房地产行业指数证券投资基金（由国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资

基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（由国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数证券投资基金（由国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金（由国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型

证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来，国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鹿混合型证券投资基金（由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来）、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金（由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来）、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来）、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民利保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠丰纯债债券型证券投资基金、国泰惠融纯债债券型证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰鑫睿混合型证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来）、国泰惠享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰研究精选两年持有期混合型证券投资基金、国泰聚盈三年定期开放债券型证券投资基金、国泰合融纯债债券型证券投资基金、国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证钢铁交

易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金、国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、国泰蓝筹精选混合型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金、国泰大制造两年持有期混合型证券投资基金、国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金、国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国泰致远优势混合型证券投资基金、国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、国泰惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰医药健康股票型证券投资基金、国泰中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、国泰研究优势混合型证券投资基金、国泰民裕进取灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来）、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰合益混合型证券投资基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、国泰通利 9 个月持有期混合型证券投资基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰价值先锋股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰成长价值混合型证券投资基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金、国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金、国泰诚益混合型证券投资基金、国泰鑫享稳健 6 个月滚动持有债券型证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰核心价值两年持有期股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、国泰佳益混合型证券投资基金、国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金。另外，本

基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
樊利安	国泰浓益灵活配置混合、国泰民益灵活配置混合（LOF）、国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）、国泰宏益一年持有期混合、国泰浩益 18 个月封闭运作混合、国泰同益 18 个月持有期混合的基金经理	2014-10-21	-	15 年	硕士。曾任职上海鑫地投资管理有限公司、天治基金管理有限公司等。2010 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月起任国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原国泰淘新灵活配置混合型证券投资基金）和国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 1 月至 2018 年 8 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月至 2019 年 1 月任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 5 月至 2020 年 5 月任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2019 年 12 月任国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2018 年 2 月任国泰生益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2017 年 1 月任国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）的基金经理，2016 年 5 月至 2017 年 11 月任国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 8 月任国泰添益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 4 月任国泰福益灵活配置混合

					型证券投资基金的基金经理，2016年 11 月至 2018 年 12 月任国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2019年 12 月任国泰普益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年 12 月至 2020 年 5 月任国泰安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018年 3 月任国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年 12 月至 2018 年 5 月任国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018年 6 月任国泰景益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年 12 月至 2018 年 8 月任国泰信益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018年 9 月任国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年 3 月至 2018 年 5 月任国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至2018 年 9 月任国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 11月任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 9 月任国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8月至 2018 年 9 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 11 月起兼任国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，2018 年 1 月至 2018 年 5 月任国泰瑞益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月至 2018年 8 月任国泰恒益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018

					年 9 月至 2020 年 8 月任国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，2019 年 5 月至 2020 年 6 月任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月至 2020 年 10 月任国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 6 月起兼任国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月起兼任国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 4 月起兼任国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2016 年 1 月任研究部副总监，2016 年 1 月至 2018 年 7 月任研究部副总监（主持工作），2018 年 7 月至 2019 年 7 月任研究部总监。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

（一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值都在 1%数量级及以下，且大多数溢价率均值都可以通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数≥30），溢价率均值普遍在 1%数量级及以下。为稳妥起见，对于溢价率均值过大的基金或组合配对，我们也进行了模拟溢价金额计算。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，基金经理也对价差作出了解释，公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年沪深两市冲高回落后，展开反弹，继续保持了明显的结构性差异，中小市值风格明显占优。最终上证指数上涨 3.4%，深证成指上涨 4.78%，创业板指上涨 17.22%。从申万一级行业来看，电气设备、钢铁、化工行业涨幅较大，家电、非银金融、军工、房地产等几个行业跌幅明显。

上半年经济延续了“稳货币、紧信用”的政策，市场保持了较好的流动性，银行间 DR007 保持在 2.2%左右，这是支持市场走强的一个基本要素。我们认为，由于全球范围内疫情的反复，各国短期内难以收缩流动性，同时全球通胀的上行，部分源于疫情造成的供给收缩，也不支持欧美的政策转

向。二季度 10 年美债收益率从 1.74%回调到 1.47%,也反映了短期市场流动性难以收缩的预期。支持市场走强的另一个因素，我们认为还是中国的比较优势。在疫情的影响下，中国的新能源车、光伏、半导体等行业得到了更快的发展；同时，疫情影响了化工、有色等周期行业的供给，叠加行业自身周期，使产品价格快速上涨，企业利润大幅增长。

本基金以绝对收益策略为主，上半年对持仓结构持续进行调整，主要增持了光伏、锂电池、疫苗、半导体等行业个股，同时阶段性的配置了煤炭、化工等价格驱动型股票。本基金还积极地参与科创板、创业板、主板的新股配售，债券方面主要以高等级信用债票息策略为主，取得了较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为 4.31%，同期业绩比较基准收益率为 2.36%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 4.23%，同期业绩比较基准收益率为 2.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，一个确定性的事情是中国和欧美主要国家的新冠疫苗接种将达到较高的比例，那么其经济增长也会进一步恢复，流动性收紧的预期又会加强，美联储 Taper 和加息预期可能又会起来，10 年美债收益率可能再次回升。但我们判断，经济修复是一个缓慢的过程，政策收缩的节奏也是一个渐进的过程，对市场的冲击应该也是阶段性的。7 月初，央行下调了存款准备金率 0.5 个百分点，显示了短期对于经济恢复仍然不乐观。从 A 股市场来看，虽然经过上半年的估值修复，行业之间的差距仍然巨大，我们判断后续仍然会呈现结构性的行情。但由于部分景气行业和个股二季度涨幅较大，已经透支了未来 2-3 年的盈利预期，我们也要谨慎对待。

基于以上判断，我们下半年权益仓位继续保持稳定，继续自下而上寻找景气行业和个股机会，规避估值脱离基本面的品种。在新能源车、光伏、半导体等行业，行业整体景气度较高，但部分公司股价已经反应了其基本面变化，需要寻找预期差较大品种以及紧密跟踪其变化；在风格上，我们判断中证 500 仍然会强于沪深 300。债券方面，我们维持配置短久期高评级信用债，采用持有到期的票息策略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从

业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2021 年 6 月 18 日进行利润分配，国泰浓益 A 类每 10 份基金份额派发红利 0.400 元，国泰浓益 C 类每 10 份基金份额派发红利 1.530 元。

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

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

无。

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《中华人民共和国证券投资基金法》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—国泰基金管理有限公司 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, 国泰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《中华人民共和国证券投资基金法》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，国泰基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集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，未发现有损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：国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	3,863,402.13	2,858,669.32
结算备付金		3,050,170.01	2,537,075.80
存出保证金		85,358.63	138,546.06
交易性金融资产	6.4.7.2	771,701,072.16	900,980,185.49
其中：股票投资		174,607,615.04	157,249,961.49
基金投资		-	-
债券投资		597,093,457.12	743,730,224.00
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	9,500,000.00	12,000,000.00
应收证券清算款		2,863,393.39	1,114,591.02
应收利息	6.4.7.5	10,781,391.76	11,851,454.26
应收股利		-	-
应收申购款		128,976.95	504,086.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		801,973,765.03	931,984,608.37
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		-	1,818,365.08
应付赎回款		826,858.50	97,871.51
应付管理人报酬		660,374.13	764,010.45
应付托管费		165,093.54	191,002.61
应付销售服务费		40,641.12	30,566.44
应付交易费用	6.4.7.7	242,923.76	250,593.51
应交税费		45,257.33	53,117.81

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	105,130.91	180,000.15
负债合计		2,086,279.29	3,385,527.56
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	440,919,158.43	580,851,788.68
未分配利润	6.4.7.10	358,968,327.31	347,747,292.13
所有者权益合计		799,887,485.74	928,599,080.81
负债和所有者权益总计		801,973,765.03	931,984,608.37

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 440,919,158.43 份，其中国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金的份额净值 1.308 元，A 类基金的份额总额 237,006,037.67 份；国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金的份额净值 2.402 元，C 类基金的份额总额 203,913,120.76 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰浓益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
一、收入		**41,374,002.04**	**22,228,107.28**
1.利息收入		11,449,187.19	4,943,365.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	116,772.06	185,447.11
债券利息收入		11,307,942.04	4,235,706.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		24,473.09	522,211.64
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		37,401,448.51	18,543,967.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	37,030,402.24	19,270,033.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,051,150.23	-1,408,129.13
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,422,196.50	682,063.47
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-7,638,730.13	-1,263,964.67

4.汇兑收益（损失以“—”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	162,096.47	4,739.42
减：二、费用		**6,513,104.53**	**3,190,648.39**
1．管理人报酬		4,192,129.81	1,762,303.79
2．托管费		1,048,032.44	440,575.94
3．销售服务费		208,456.62	103,581.88
4．交易费用	6.4.7.18	828,745.74	757,959.42
5．利息支出		71,772.53	2,022.73
其中：卖出回购金融资产支出		71,772.53	2,022.73
6.税金及附加		36,979.59	12,639.39
7．其他费用	6.4.7.19	126,987.80	111,565.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**34,860,897.51**	**19,037,458.89**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**34,860,897.51**	**19,037,458.89**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰浓益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）	580,851,788.68	347,747,292.13	928,599,080.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,860,897.51	34,860,897.51
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）	-139,932,630.25	16,174,304.57	-123,758,325.68
其中：1.基金申购款	64,547,292.13	88,960,055.05	153,507,347.18
2.基金赎回款	-204,479,922.38	-72,785,750.48	-277,265,672.86
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）	-	-39,814,166.90	-39,814,166.90
五、期末所有者权益（基金净值）	440,919,158.43	358,968,327.31	799,887,485.74
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）	197,175,307.26	156,841,009.71	354,016,316.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,037,458.89	19,037,458.89
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）	125,853,313.79	41,012,297.16	166,865,610.95
其中：1.基金申购款	132,924,728.66	45,280,547.99	178,205,276.65
2.基金赎回款	-7,071,414.87	-4,268,250.83	-11,339,665.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-22,223,788.88	-22,223,788.88
五、期末所有者权益（基金净值）	323,028,621.05	194,666,976.88	517,695,597.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：倪蓥，会计机构负责人：吴洪涛

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 33 号《关于核准国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由国泰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《国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 415,881,668.40 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 088 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 3 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 416,064,316.18 份基金份额，其中认购资金利息折合 182,647.78 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据 2015 年 11 月 14 日发布的《关于国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，自 2015 年 11 月 16 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码，投资人申购时可以自主选择 A 类基金份额(现有份额)或 C 类基金份额对应的基金代码进行

申购。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，在收益分配数额方面可能有所不同。增加 C 类基金份额前已持有本基金基金份额的投资人，其基金账户中保留的本基金基金份额余额为 A 类基金份额。本基金不同类别基金份额之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0-95%，投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款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不低于基金资产的 5%；中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 20%；本基金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，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、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准：三年期银行定期存款利率(税后)+2%。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2021 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	3,863,402.13
定期存款	-
其他存款	-
合计	3,863,402.13

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		158,400,446.70	174,607,615.04	16,207,168.34
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	296,191,284.09	294,517,457.12	-1,673,826.97
	银行间市场	304,429,675.27	302,576,000.00	-1,853,675.27
	合计	600,620,959.36	597,093,457.12	-3,527,502.24
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		759,021,406.06	771,701,072.16	12,679,666.10

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	9,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	9,500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,606.40
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,174.57
应收债券利息	10,776,405.00
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,171.23
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	34.56
合计	10,781,391.76

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

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	241,423.76
银行间市场应付交易费用	1,500.00
合计	242,923.76

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	2.49
应付证券出借违约金	-
预提费用	105,128.42
合计	105,130.91

6.4.7.9 实收基金

国泰浓益灵活配置混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	427,881,881.51	427,881,881.51
本期申购	5,758,423.83	5,758,423.83
本期赎回（以“-”号填列）	-196,634,267.67	-196,634,267.67
本期末	237,006,037.67	237,006,037.67

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

国泰浓益灵活配置混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	152,969,907.17	152,969,907.17
本期申购	58,788,868.30	58,788,868.30
本期赎回（以“-”号填列）	-7,845,654.71	-7,845,654.71
本期末	203,913,120.76	203,913,120.76

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

国泰浓益灵活配置混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	200,530,799.43	-75,145,908.00	125,384,891.43
本期利润	21,929,419.05	-5,557,802.82	16,371,616.23
本期基金份额交易产生的变动数	-96,291,800.10	36,901,649.37	-59,390,150.73
其中：基金申购款	2,822,575.39	-1,102,265.60	1,720,309.79
基金赎回款	-99,114,375.49	38,003,914.97	-61,110,460.52
本期已分配利润	-9,349,917.08	-	-9,349,917.08
本期末	116,818,501.30	-43,802,061.45	73,016,439.85

国泰浓益灵活配置混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	275,629,423.66	-53,267,022.96	222,362,400.70
本期利润	20,570,208.59	-2,080,927.31	18,489,281.28
本期基金份额交易产生的变动数	94,977,494.10	-19,413,038.80	75,564,455.30
其中：基金申购款	109,510,292.03	-22,270,546.77	87,239,745.26
基金赎回款	-14,532,797.93	2,857,507.97	-11,675,289.96
本期已分配利润	-30,464,249.82	-	-30,464,249.82
本期末	360,712,876.53	-74,760,989.07	285,951,887.46

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	93,819.34
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	20,096.32
其他	2,856.40
合计	116,772.06

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	287,032,199.77
减：卖出股票成本总额	250,001,797.53
买卖股票差价收入	37,030,402.24

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	290,853,676.51
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	286,460,217.62
减：应收利息总额	5,444,609.12
买卖债券差价收入	-1,051,150.23

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 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	1,422,196.50
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	1,422,196.50

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-7,638,730.13
——股票投资	-8,087,093.19
——债券投资	448,363.06
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-

合计	-7,638,730.13

6.4.7.17 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	158,638.54
转换费收入	3,457.93
合计	162,096.47

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不少于转出基金赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 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	827,245.74
银行间市场交易费用	1,500.00
合计	828,745.74

6.4.7.19 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	45,621.05
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
上清查询服务费	600.00
银行汇划费用	3,409.38
银行间账户维护费	17,850.00
合计	126,987.80

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期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
国泰基金管理有限公司	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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

6.4.10.2 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	4,192,129.81	1,762,303.79
其中：支付销售机构的客户维护费	42,287.05	57,822.65

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值　X 1.00% /　当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,048,032.44	440,575.94

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

日托管费＝前一日基金资产净值　X 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		
	国泰浓益灵活配置混合 A	国泰浓益灵活配置混合 C	合计
国泰基金管理有限公司	-	193,239.77	193,239.77
合计	-	193,239.77	193,239.77
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		
	国泰浓益灵活配置混合A	国泰浓益灵活配置混合C	合计
国泰基金管理有限公司	-	99,247.37	99,247.37
合计	-	99,247.37	99,247.37

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.10%。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日 C 类基金资产净值 X 约定年费率 / 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的关联方均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,863,402.13	93,819.34	22,173,986.64	158,405.62

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

国泰浓益灵活配置混合 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2021-06-18	2021-06-18	0.400	5,131,903.03	4,218,014.05	9,349,917.08	-
合计			0.400	5,131,903.03	4,218,014.05	9,349,917.08	-

国泰浓益灵活配置混合 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2021-06-18	2021-06-18	1.530	18,178,492.2	12,285,757.6	30,464,249.8	-

				1	1	2	
合计			1.530	18,178,492.21	12,285,757.61	30,464,249.82	-

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
603799	华友钴业	2021-02-18	2021-08-09	增发中签	84.00	108.54	47,619.00	3,999,996.00	5,168,566.26	-
000951	中国重汽	2021-03-12	2021-09-15	增发中签	29.82	26.27	134,138.00	3,999,995.16	3,523,805.26	-
688696	极米科技	2021-02-23	2021-09-03	新股锁定	133.73	780.24	1,252.00	167,429.96	976,860.48	-
688059	华锐精密	2021-02-01	2021-08-09	新股锁定	37.09	160.26	1,023.00	37,943.07	163,945.98	-
688315	诺禾致源	2021-04-02	2021-10-13	新股锁定	12.76	39.20	3,711.00	47,352.36	145,471.20	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股锁定	47.33	251.96	539.00	25,510.87	135,806.44	-
688575	亚辉龙	2021-05-10	2021-11-17	新股锁定	14.80	32.09	3,435.00	50,838.00	110,229.15	-
688109	品茗股份	2021-03-22	2021-09-30	新股锁定	50.05	72.10	1,301.00	65,115.05	93,802.10	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	网下中签	38.85	38.85	2,149.00	83,488.65	83,488.65	-
688663	星球石墨	2021-03-17	2021-09-24	新股锁定	33.62	53.14	1,558.00	52,379.96	82,792.12	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	新股锁定	7.72	19.11	3,493.00	26,965.96	66,751.23	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	网下中签	8.29	8.29	7,029.00	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股锁定	8.29	8.29	782.00	6,482.78	6,482.78	-
688355	明志科技	2021-04-30	2021-11-12	新股锁定	17.65	23.80	2,710.00	47,831.50	64,498.00	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	33.22	87.50	712.00	23,652.64	62,300.00	-

688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	网下中签	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	网下中签	8.86	8.86	4,995.00	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股锁定	8.86	8.86	555.00	4,917.30	4,917.30	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股锁定	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	-
688367	工大高科	2021-06-21	2021-12-28	新股锁定	11.53	17.94	1,717.00	19,797.01	30,802.98	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定	48.59	90.39	322.00	15,645.98	29,105.58	-
688681	科汇股份	2021-06-04	2021-12-16	新股锁定	9.56	14.54	1,899.00	18,154.44	27,611.46	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股锁定	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	21.31	49.94	399.00	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	网下中签	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股锁定	6.87	12.07	1,162.00	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股锁定	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股锁定	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	新股锁定	8.72	27.11	471.00	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-

300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股锁定	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定	3.37	10.44	1,112.00	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股锁定	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股锁定	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股锁定	12.85	25.80	371.00	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股锁定	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定	13.75	32.98	275.00	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股锁定	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股锁定	13.00	27.42	216.00	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021-06-04	2021-08-25	送股	-	27.42	108.00	-	2,961.36	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股锁定	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	网下中签	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股锁定	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股锁定	6.79	26.81	301.00	2,043.79	8,069.81	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股锁定	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股锁定	12.10	19.29	410.00	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定	13.11	24.48	322.00	4,221.42	7,882.56	-

300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股锁定	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股锁定	7.81	21.94	312.00	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股锁定	13.06	26.51	254.00	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股锁定	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股锁定	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股锁定	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股锁定	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股锁定	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股锁定	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股锁定	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股锁定	12.08	23.06	234.00	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股锁定	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股锁定	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股锁定	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股锁定	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股锁定	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
12703	国微	2021-0	2021-0	老股	100.00	100.00	598.00	59,800	59,800	-

8	转债	6-10	7-14	配债				.00	.00	

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，本基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，本基金获配的创业板股票如经摇号限售或者比例限售方式锁定的，锁定期限至少为自发行人股票上市之日起 6 个月。

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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项	56.35	2021-07-01	59.49	46,500.00	1,812,355.00	2,620,275.00	-

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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

本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基

金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部、审计部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	-	59,832,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	29,958,000.00
合计	-	89,790,000.00

注：本基金持有的未评级债券包括超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	455,442,000.00	485,302,000.00
AAA 以下	100,258,457.12	121,987,889.50
未评级	41,393,000.00	46,650,334.50
合计	597,093,457.12	653,940,224.00

注：本基金持有的未评级债券包括国债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进

行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	3,863,402.13	-	-	-	3,863,402.13
结算备付金	3,050,170.01	-	-	-	3,050,170.01
存出保证金	85,358.63	-	-	-	85,358.63
交易性金融资产	291,065,800.00	301,079,000.00	4,948,657.12	174,607,615.04	771,701,072.16
买入返售金融资产	9,500,000.00	-	-	-	9,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	2,863,393.39	2,863,393.39
应收利息	-	-	-	10,781,391.76	10,781,391.76
应收申购款	-	-	-	128,976.95	128,976.95
资产总计	307,564,730.77	301,079,000.00	4,948,657.12	188,381,377.14	801,973,765.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	826,858.50	826,858.50
应付管理人报酬	-	-	-	660,374.13	660,374.13
应付托管费	-	-	-	165,093.54	165,093.54
应付销售服务费	-	-	-	40,641.12	40,641.12
应付交易费用	-	-	-	242,923.76	242,923.76
应交税费	-	-	-	45,257.33	45,257.33
其他负债	-	-	-	105,130.91	105,130.91
负债总计	-	-	-	2,086,279.29	2,086,279.29
利率敏感度缺口	307,564,730.77	301,079,000.00	4,948,657.12	186,295,097.85	799,887,485.74
上年度末 2020 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**

资产					
银行存款	2,858,669.32	-	-	-	2,858,669.32
结算备付金	2,537,075.80	-	-	-	2,537,075.80
存出保证金	138,546.06	-	-	-	138,546.06
交易性金融资产	263,614,534.50	473,287,379.00	6,828,310.50	157,249,961.49	900,980,185.49
买入返售金融资产	12,000,000.00	-	-	-	12,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,114,591.02	1,114,591.02
应收利息	-	-	-	11,851,454.26	11,851,454.26
应收申购款	-	-	-	504,086.42	504,086.42
资产总计	281,148,825.68	473,287,379.00	6,828,310.50	170,720,093.19	931,984,608.37
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,818,365.08	1,818,365.08
应付赎回款	-	-	-	97,871.51	97,871.51
应付管理人报酬	-	-	-	764,010.45	764,010.45
应付托管费	-	-	-	191,002.61	191,002.61
应付销售服务费	-	-	-	30,566.44	30,566.44
应付交易费用	-	-	-	250,593.51	250,593.51
应付税费	-	-	-	53,117.81	53,117.81
其他负债	-	-	-	180,000.15	180,000.15
负债总计	-	-	-	3,385,527.56	3,385,527.56
利率敏感度缺口	281,148,825.68	473,287,379.00	6,828,310.50	167,334,565.63	928,599,080.81

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率外其他市场条件不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	利率下降 25BP	增加约 133	增加约 329
	利率上升 25BP	减少约 133	减少约 326

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用积极灵活的投资策略，通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上，力争实现长期稳健的绝对收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产占基金资产的 0%-95%；投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款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不低于基金资产的 5%；中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 20%；本基金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，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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	174,607,615.04	21.83	157,249,961.49	16.93
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	174,607,615.04	21.83	157,249,961.49	16.93

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 6,184	-
	沪深 300 指数下降 5%	减少约 6,184	-

注：于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例不足 20%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 165,352,488.84 元，属于第二层次的余额为 606,348,583.32 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日，第一层次：156,709,305.09 元，第二层次：744,270,880.40 元，无第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

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	174,607,615.04	21.77
	其中：股票	174,607,615.04	21.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	597,093,457.12	74.45
	其中：债券	597,093,457.12	74.45
	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	9,500,000.00	1.18

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,913,572.14	0.86
8	其他各项资产	13,859,120.73	1.73
9	合计	801,973,765.03	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	5,616,090.96	0.70
C	制造业	119,855,747.81	14.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	3,623,115.58	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	6,210,730.00	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,539,074.00	1.94
J	金融业	14,579,792.10	1.82
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	1,696,675.20	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	7,436,707.35	0.93
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	174,607,615.04	21.83

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	300776	帝尔激光	115,600	17,266,016.00	2.16
2	300460	惠伦晶体	291,600	6,896,340.00	0.86
3	300750	宁德时代	11,600	6,203,680.00	0.78
4	600690	海尔智家	236,400	6,125,124.00	0.77
5	688188	柏楚电子	13,912	6,065,632.00	0.76
6	600887	伊利股份	153,400	5,649,722.00	0.71
7	002643	万润股份	300,710	5,346,623.80	0.67
8	603799	华友钴业	47,619	5,168,566.26	0.65
9	601166	兴业银行	233,400	4,796,370.00	0.60
10	603588	高能环境	325,520	4,713,529.60	0.59
11	002340	格林美	433,200	4,050,420.00	0.51
12	603179	新泉股份	119,410	3,926,200.80	0.49
13	600588	用友网络	116,000	3,858,160.00	0.48
14	600018	上港集团	784,000	3,739,680.00	0.47
15	002049	紫光国微	24,200	3,731,398.00	0.47
16	603368	柳药股份	178,700	3,527,538.00	0.44
17	000951	中国重汽	134,138	3,523,805.26	0.44
18	300674	宇信科技	174,980	3,270,376.20	0.41
19	300077	国民技术	198,600	3,173,628.00	0.40
20	600188	兖州煤业	202,600	3,111,936.00	0.39
21	002080	中材科技	114,460	2,995,418.20	0.37
22	000519	中兵红箭	268,700	2,880,464.00	0.36
23	002266	浙富控股	538,458	2,686,905.42	0.34
24	601601	中国太保	92,600	2,682,622.00	0.34
25	002409	雅克科技	32,800	2,656,800.00	0.33
26	300699	光威复材	34,500	2,620,275.00	0.33
26	600460	士兰微	46,500	2,620,275.00	0.33
28	601398	工商银行	502,700	2,598,959.00	0.32
29	002756	永兴材料	42,800	2,541,892.00	0.32
30	000762	西藏矿业	94,212	2,504,154.96	0.31
31	002352	顺丰控股	36,500	2,471,050.00	0.31
32	300450	先导智能	40,500	2,435,670.00	0.30
33	600596	新安股份	135,780	2,406,021.60	0.30
34	600219	南山铝业	666,400	2,399,040.00	0.30
35	300115	长盈精密	113,320	2,334,392.00	0.29
36	601318	中国平安	35,700	2,294,796.00	0.29
37	002876	三利谱	35,460	2,294,262.00	0.29
38	600570	恒生电子	23,600	2,200,700.00	0.28
39	601988	中国银行	705,300	2,172,324.00	0.27
40	002154	报 喜 鸟	329,900	2,101,463.00	0.26
41	601012	隆基股份	23,240	2,064,641.60	0.26
42	300037	新宙邦	18,500	1,851,850.00	0.23

43	600885	宏发股份	28,200	1,768,140.00	0.22
44	600389	江山股份	48,100	1,654,159.00	0.21
45	600499	科达制造	111,300	1,602,720.00	0.20
46	600141	兴发集团	85,000	1,600,550.00	0.20
47	603018	华设集团	195,120	1,551,204.00	0.19
48	002436	兴森科技	139,700	1,536,700.00	0.19
49	603308	应流股份	71,500	1,476,475.00	0.18
50	002311	海大集团	16,900	1,379,040.00	0.17
51	605499	东鹏饮料	4,232	1,061,385.60	0.13
52	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.12
53	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.02
54	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.02
55	300957	贝泰妮	539	135,806.44	0.02
56	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.01
57	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
58	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.01
59	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
60	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.01
61	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.01
62	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
63	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.01
64	300979	华利集团	712	62,300.00	0.01
65	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
66	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
67	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
68	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
69	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
70	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00
71	300981	中红医疗	322	29,105.58	0.00
72	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.00
73	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
74	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
75	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
76	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
77	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
78	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
79	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
80	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
81	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
82	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
83	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
84	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
85	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
86	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00

87	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
88	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
89	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
90	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
91	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
92	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
93	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
94	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
95	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
96	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
97	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
98	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
99	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
100	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
101	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
102	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
103	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
104	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
105	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
106	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
107	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
108	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
109	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
110	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
111	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
112	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
113	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
114	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
115	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
116	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
117	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
118	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
119	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
120	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
121	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
122	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
123	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
124	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
125	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
126	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
127	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
128	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	300776	帝尔激光	14,953,812.00	1.61
2	002064	华峰化学	8,304,952.16	0.89
3	002236	大华股份	7,071,149.00	0.76
4	002643	万润股份	6,415,384.80	0.69
5	600389	江山股份	5,821,367.00	0.63
6	601398	工商银行	5,557,890.00	0.60
7	300750	宁德时代	4,831,929.00	0.52
8	600141	兴发集团	4,830,771.00	0.52
9	300059	东方财富	4,682,010.00	0.50
10	300132	青松股份	4,679,966.00	0.50
11	000488	晨鸣纸业	4,650,945.00	0.50
12	601988	中国银行	4,627,096.00	0.50
13	601601	中国太保	4,609,381.00	0.50
14	002601	龙佰集团	4,596,067.22	0.49
15	002340	格林美	4,513,731.00	0.49
16	000932	华菱钢铁	4,481,715.00	0.48
17	603588	高能环境	4,326,779.00	0.47
18	688188	柏楚电子	4,273,469.11	0.46
19	002876	三利谱	4,168,742.00	0.45
20	600588	用友网络	4,076,584.00	0.44

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	002466	天齐锂业	11,983,891.05	1.29
2	002064	华峰化学	8,336,827.00	0.90
3	002594	比亚迪	8,215,002.00	0.88
4	601899	紫金矿业	7,773,922.00	0.84
5	000001	平安银行	7,740,273.00	0.83
6	300750	宁德时代	7,429,021.48	0.80
7	600660	福耀玻璃	6,411,446.00	0.69
8	002236	大华股份	5,937,641.33	0.64

9	000725	京东方 A	5,934,641.00	0.64
10	600219	南山铝业	5,683,559.00	0.61
11	600389	江山股份	5,414,074.00	0.58
12	300132	青松股份	5,259,464.00	0.57
13	002475	立讯精密	5,129,270.39	0.55
14	002601	龙佰集团	4,803,780.00	0.52
15	601658	邮储银行	4,741,861.89	0.51
16	000547	航天发展	4,443,054.00	0.48
17	000488	晨鸣纸业	4,265,477.00	0.46
18	300059	东方财富	4,225,209.00	0.46
19	603738	泰晶科技	4,164,937.00	0.45
20	000895	双汇发展	4,039,662.00	0.44

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

买入股票的成本（成交）总额	275,446,544.27
卖出股票的收入（成交）总额	287,032,199.77

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	41,393,000.00	5.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	248,175,800.00	31.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	302,576,000.00	37.83
7	可转债（可交换债）	4,948,657.12	0.62
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	597,093,457.12	74.65

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019640	20 国债 10	413,930	41,393,000.00	5.17
2	136789	16 东航 01	400,000	40,028,000.00	5.00
3	101759009	17 金融街 MTN001B	300,000	30,444,000.00	3.81
4	101901193	19 电建地产 MTN001	300,000	30,414,000.00	3.80
5	136522	16 首股债	300,000	30,000,000.00	3.75

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“招商证券”违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

招商证券因违反反洗钱法、未依法履行职责等原因，受到央行派出机构、上交所的罚款、警示等公

开处罚。

本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

7.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

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	85,358.63
2	应收证券清算款	2,863,393.39
3	应收股利	-
4	应收利息	10,781,391.76
5	应收申购款	128,976.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,859,120.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128141	旺能转债	4,888,857.12	0.61

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603799	华友钴业	5,168,566.26	0.65	增发中签

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
国泰浓益灵活配置混合 A	1,994	118,859.60	225,345,496.95	95.08%	11,660,540.72	4.92%
国泰浓益灵活配置混合 C	3,572	57,086.54	190,946,536.88	93.64%	12,966,583.88	6.36%
合计	5,566	79,216.52	416,292,033.83	94.41%	24,627,124.60	5.59%

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	国泰浓益灵活配置混合 A	8,414.63	0.00%
	国泰浓益灵活配置混合 C	4.81	0.00%
	合计	8,419.44	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	国泰浓益灵活配置混合 A	0
	国泰浓益灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰浓益灵活配置混合 A	0
	国泰浓益灵活配置混合 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰浓益灵活配置混合 A	国泰浓益灵活配置混合 C
基金合同生效日（2014 年 3 月 4 日）基金份额总额	416,064,316.18	-
本报告期期初基金份额总额	427,881,881.51	152,969,907.17
本报告期基金总申购份额	5,758,423.83	58,788,868.30
减：本报告期基金总赎回份额	196,634,267.67	7,845,654.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	237,006,037.67	203,913,120.76

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2021 年 3 月 31 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告》，经本基金管理人第八届董事会第四次会议审议通过，张玮先生担任本基金管理人副总经理。

2021 年 4 月 1 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司董事变更公告》，经本基金管理人股东会审议通过，对本基金管理人董事会成员进行了调整。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

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

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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	
东兴证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投	3	93,943,444.98	17.24%	87,492.22	18.94%	-
浙商证券	1	70,188,737.76	12.88%	51,328.05	11.11%	-
方正证券	2	69,286,262.99	12.71%	64,526.13	13.97%	-
长江证券	1	51,963,513.79	9.53%	38,000.67	8.22%	-
天风证券	1	48,511,560.68	8.90%	35,476.85	7.68%	-
江海证券	1	46,057,881.62	8.45%	42,893.92	9.28%	-
银河证券	2	41,988,349.38	7.70%	34,790.37	7.53%	-
华泰证券	3	41,027,546.36	7.53%	38,209.02	8.27%	-
国信证券	2	35,932,357.97	6.59%	33,785.76	7.31%	-
光大证券	2	28,845,711.26	5.29%	21,094.93	4.57%	-
中金公司	2	8,222,259.84	1.51%	6,012.78	1.30%	-
申万宏源	1	6,120,787.65	1.12%	5,700.00	1.23%	-
海通证券	1	2,439,107.90	0.45%	2,271.77	0.49%	-
招商证券	1	256,058.40	0.05%	238.47	0.05%	-
中信证券	1	227,855.32	0.04%	212.22	0.05%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

（1）资力雄厚，信誉良好；

（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，在最近一年内无重大违规经营行为；

（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）公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	2,822,595.57	1.77%	18,000,000.00	15.24%	-	-
浙商证券	55,580,486.42	34.82%	-	-	-	-
方正证券	1,406,761.91	0.88%	22,500,000.00	19.05%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	10,725,786.92	6.72%	-	-	-	-
银河证券	3,348,741.34	2.10%	20,000,000.00	16.93%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	2,594,225.10	1.63%	30,000,000.00	25.40%	-	-
光大证券	3,917,412.41	2.45%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	49,008,420.75	30.70%	27,600,000.00	23.37%	-	-
海通证券	30,224,819.72	18.93%	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配非公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、《上海证券报》	2021-02-20
2	国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配非公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2021-03-16
3	国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2021-03-31
4	国泰基金管理有限公司董事变更公告	《中国证券报》	2021-04-01
5	国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金分红公告	《证券日报》	2021-06-16

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 01 月 01 日至 2021 年 04 月 01 日	173,803,911.74	-	173,803,911.74	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金基金合同

2、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金托管协议

3、关于核准国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金募集的批复

4、报告期内披露的各项公告

5、法律法规要求备查的其他文件

12.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

基金托管人住所。

12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：http://www.gtfund.com

国泰基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日