
湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:湘财基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 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及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责任。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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	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	6
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	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§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真实、准确和完整发表意见	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	51
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	51
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	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§9 开放式基金份额变动	54
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
11.1 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	湘财长兴灵活配置混合	
基金主代码	009169	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年04月23日	
基金管理人	湘财基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	135,789,120.19份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	湘财长兴灵活配置混合A	湘财长兴灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	009169	009170
报告期末下属分级基金的份额总额	67,275,240.51份	68,513,879.68份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用定性研究与定量分析相结合的方法，通过对于宏观、政策、流动性、资产相对价值水平等研究判断大类资产的配置比例。权益资产方面，根据不同行业景气度进行行业轮动调整，同时优选具有较高成长可能性或者底部基本面企稳的上市公司；固收资产方面，精选个券并深挖全市场机会，在严格控制风险和保持基金资产流动性良好的情况下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将实施积极主动的投资策略，运用多种方法进行资产配置。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和衍生品投资策略四个方面组成。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于

	债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。
--	-----------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		湘财基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孟爽	朱巍
	联系电话	021-50606800	0571-87659806
	电子邮箱	services@xc-fund.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		4009200759	95527
传真		021-50380285	0571-88268688
注册地址		上海市静安区共和路169号2层40室	浙江省杭州市萧山区鸿宁路1788号
办公地址		上海市浦东新区杨高南路428号1号楼3楼	浙江省杭州市延安路368号
邮政编码		200127	310006
法定代表人		王小平	沈仁康

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.xc-fund.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区杨高南路428号1号楼3楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	湘财基金管理有限公司	上海市浦东新区杨高南路428号1号楼3楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	湘财长兴灵活配置混合A	湘财长兴灵活配置混合C
本期已实现收益	6,053,219.22	6,221,063.45
本期利润	1,947,729.33	2,028,506.43
加权平均基金份额本期利润	0.0237	0.0231
本期加权平均净值利润率	2.03%	1.99%
本期基金份额净值增长率	2.11%	1.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	湘财长兴灵活配置混合A	湘财长兴灵活配置混合C
期末可供分配利润	13,484,301.42	13,122,792.40
期末可供分配基金份额利润	0.2004	0.1915
期末基金资产净值	80,759,541.93	81,636,672.08
期末基金份额净值	1.2004	1.1915
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	湘财长兴灵活配置混合A	湘财长兴灵活配置混合C
基金份额累计净值增长率	20.04%	19.15%

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）湘财长兴灵活配置混合A收取认（申）购费和赎回费，湘财长兴灵活配置混合C不收取认（申）购费但收取赎回费、计提销售服务费；

（3）上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；

（4）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

湘财长兴灵活配置混合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	2.57%	0.70%	-0.72%	0.47%	3.29%	0.23%
过去三个月	7.86%	0.70%	3.19%	0.53%	4.67%	0.17%
过去六个月	2.11%	1.05%	1.91%	0.73%	0.20%	0.32%
过去一年	17.04%	1.15%	14.93%	0.77%	2.11%	0.38%
自基金合同 生效起至今	20.04%	1.07%	20.79%	0.74%	-0.75%	0.33%

湘财长兴灵活配置混合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	2.54%	0.70%	-0.72%	0.47%	3.26%	0.23%
过去三个月	7.76%	0.70%	3.19%	0.53%	4.57%	0.17%
过去六个月	1.91%	1.05%	1.91%	0.73%	0.00%	0.32%
过去一年	16.37%	1.15%	14.93%	0.77%	1.44%	0.38%
自基金合同 生效起至今	19.15%	1.07%	20.79%	0.74%	-1.64%	0.33%

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

湘财长兴灵活配置混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年04月23日-2021年06月30日)



- 1、本基金合同于 2020 年 4 月 23 日生效，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内完成建仓，本报告期末距建仓结束不满一年。
- 2、本基金建仓结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

湘财长兴灵活配置混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年04月23日-2021年06月30日)



- 1、 本基金合同于 2020 年 4 月 23 日生效，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内完成建仓，本报告期末距建仓结束不满一年。
- 2、 本基金建仓结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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

湘财基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2018]976号文批准于2018年7月设立，注册资本人民币1.5亿元。公司设立在上海，股东为湘财证券股份有限公司。公司秉承“卓识远见、睿智创新、诚信规范、财富共享”的经营理念，以投资者利益至上为核心，全力打造综合性的金融服务平台。截止至2021年6月30日，公司旗下共管理湘财长顺混合型发起式证券投资基金、湘财长源股票型证券投资基金、湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金、湘财久丰3个月定期开放债券型证券投资基金、湘财长泽灵活配置混合型证券投资基金、湘财长弘灵活配置混合型证券投资基金、湘财久盈中短债债券型证券投资基金、湘财创新成长一年持有期混合型证券投资基金8只开放型基金，资产管理规模15.16亿元。

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		
车广路	湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理，公司总经理助理兼投资总监	2020-04-23	-	14年	车广路先生，总经理助理，投资总监，基金经理，工商管理学硕士。曾任泰信基金管理有限公司研究员、高级研究员、基金经理。先后担任泰信蓝筹精选基金、泰信发展主题基金、泰信国策驱动基金的基金经理。现任湘财基金管理有限公司总经理助

					理、投资总监、基金经理。
肖超虎	湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020-08-13	-	14 年	肖超虎先生，复旦大学经济学硕士，上海交通大学工学学士。曾任安永华明会计师事务所审计员，光大证券研究所行业研究员，太平洋资产管理有限责任公司宏观策略研究员、投资助理、投资经理。曾担任湘财长顺混合型发起式证券投资基金基金经理。现任湘财基金管理有限公司投资部基金经理。

注：1、上述职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、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，按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

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

公平交易制度和控制方法：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，本基金管理人制定了《湘财基金管理有限公司公平交易制度》，建立了贯穿授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，涵盖股票、债券的一级市场申购与二级市场投资业务的公平交易机制。

本基金管理人建立了事前审核、事中监控和事后稽核的控制机制，依靠信息系统与人工相结合的方式，确保公司旗下不同投资组合实现研究成果共享、投资决策独立、集中交易公平执行、交易严密监控以及稽核分析客观独立。

公平交易制度的执行情况：报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易相关制度，对不同投资组合同日及临近交易日的反向交易和可能导致不公平交易和利益输送的异常交易进行监控，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合未出现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%的情况。

报告期内，未发现任何可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

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股市场整体以横盘震荡为主，呈现冲高回落的走势，沪深300指数小幅上涨0.24%，中证500上涨6.93%。从板块来看，投资机会主要集中在低估值的周期和高成长的科技，周期板块中表现较好的是钢铁、化工、采掘和有色，科技中表现较好的新能源和半导体。市场呈现出结构性行情的特征，给投资带来的一定的难度。面对复杂的市场特环境，本基金继续坚持均衡的行业配置，在科技、周期和可选消费上进行了相对均衡的布局，在各个板块内部对行业进行精选，并根据市场环境和行业景气的变化进行了一定程度的轮动。具体而言，本基金在一季度重点把握了化工、基本金属等领域的机会，而在二季度则更加积极地布局了光伏、游戏等行业的机会。上半年湘财长兴A/C的净值分别上涨了2.11%和1.91%，表现基本符合预期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末湘财长兴灵活配置混合A基金份额净值为1.2004元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.11%，同期业绩比较基准收益率为1.91%；截至报告期末湘财长兴灵活配置混合C基金份额净值为1.1915元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.91%，同期业绩比较基准收益率为1.91%。

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，本基金管理人认为经济增长仍有望保持弱复苏的态势，其中消费增长的复苏力度仍然比较弱。从房地产和出口两个角度看，经济复苏的动能存在环比弱化的

可能。在这种环境下，货币政策出现急转弯的概率在下降，7月9日央行宣布降低存款准备金率0.5个百分点，这基本表明未来一段时间内货币政策不存在明显收紧的风险，甚至不排除存在连续放松货币的可能性。因此本基金管理人认为市场对估值的容忍度在上升，甚至会出现部分行业估值水平抬升的可能性。从投资收益来源看，景气度和业绩增长将成为更加重要的因素。本基金将积极从未来具备可持续成长能力的角度去选择行业和公司进行配置。

本基金仍然会坚持相对均衡、突出重点的行业配置策略，并适度地向高景气度的科技板块增加配置。科技板块中，本基金相对更为看好新能源、消费电子和半导体等长期方向，下半年行业景气仍将维持。周期板块中，本基金将聚焦于煤炭、能源金属、石化等偏上游的领域进行配置。消费板块中，本基金积极关注社会服务、化妆品、保健品等新兴领域，寻找具备性价比的行业进行配置。

本基金管理人始终坚持主动量化的投资体系，在自上而下对行业进行精选和配置的基础上，充分发挥投资和研究团队两方面的优势，自下而上深入研究相关标的，精选具有估值优势的优质公司进行布局。主动量化的投资体系的效果得到了充分的体现，未来仍将一如既往，遵循投资框架和逻辑，争取为投资者创造价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中与年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立估值委员会，成员由公司总经理、督察长、投资总监、基金结算部总经理、监察稽核部总经理、金融工程部总经理、基金会计和风控专员等成员组成。由于估值品种的特殊性，估值委员会可以增加临时成员。必要时可聘请外部定价机构或外部专家协助进行估值。估值委员会的投资研究相关人员，对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，为估值提供相关模型。估值委员会定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

上述参与基金估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经历，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中证指数有限公司，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券投资基金业协会等。

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实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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**

本报告期内，本托管人在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)**6.1 资产负债表**

会计主体：湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	11,875,303.83	17,222,791.56
结算备付金		25,092,519.46	40,059,614.54

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	125,879,480.30	227,907,185.95
其中：股票投资		114,980,226.26	216,900,694.23
基金投资		-	-
债券投资		10,899,254.04	11,006,491.72
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	-	9,000,045.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	127,204.14	266,338.73
应收股利		-	-
应收申购款		5,593.04	11,960.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		162,980,100.77	294,467,936.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06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		-	-
应付赎回款		229,552.37	4,199,097.93
应付管理人报酬		201,132.85	372,266.96
应付托管费		33,522.12	62,044.48
应付销售服务费		27,219.24	54,071.14
应付交易费用	6.4.7.7	-	280.50
应交税费		3,034.84	2,421.33

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,425.34	136,743.45
负债合计		583,886.76	4,826,925.79
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	135,789,120.19	247,091,081.92
未分配利润	6.4.7.10	26,607,093.82	42,549,928.46
所有者权益合计		162,396,214.01	289,641,010.38
负债和所有者权益总计		162,980,100.77	294,467,936.17

注：报告截止日2021年6月30日，湘财长兴灵活配置混合A份额净值1.2004元，基金份额总额67,275,240.51份；湘财长兴灵活配置混合C份额净值1.1915元，基金份额总额68,513,879.68份。基金份额总额合计为135,789,120.19份。

6.2 利润表

会计主体：湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年04月23日（基金 合同生效日）至2020 年06月30日
一、收入		6,694,942.43	16,133,575.36
1. 利息收入		449,522.47	1,080,227.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	118,999.04	792,268.26
债券利息收入		327,361.40	59,843.16
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,162.03	228,115.81
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,464,830.58	835,271.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,499,588.22	123,717.47
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	157,009.37	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.14. 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	808,232.99	711,553.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-8,298,046.91	13,978,533.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	78,636.29	239,543.54
减：二、费用		2,718,706.67	2,910,460.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	1,479,649.60	1,953,232.94
2. 托管费	6.4.10.2. 2	246,608.21	325,538.85
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	203,230.69	321,116.27
4. 交易费用	6.4.7.20	685,584.95	266,547.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		754.46	215.47
7. 其他费用	6.4.7.21	102,878.76	43,809.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,976,235.76	13,223,114.69
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,976,235.76	13,223,114.69
-------------------	--	--------------	---------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	247,091,081.92	42,549,928.46	289,641,010.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,976,235.76	3,976,235.76
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）	-111,301,961.73	-19,919,070.40	-131,221,032.13
其中：1. 基金申购款	5,947,501.76	1,166,804.65	7,114,306.41
2. 基金赎回款	-117,249,463.49	-21,085,875.05	-138,335,338.54
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）	135,789,120.19	26,607,093.82	162,396,214.01
项 目	上年度可比期间 2020年04月23日（基金合同生效日）至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益	790,907,696.35	-	790,907,696.35

(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)	-	13,223,114.69	13,223,114.69
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)	-287,715,914.06	-823,247.13	-288,539,161.19
其中：1. 基金申购款	2,534,139.39	19,485.06	2,553,624.45
2. 基金赎回款	-290,250,053.45	-842,732.19	-291,092,785.64
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)	503,191,782.29	12,399,867.56	515,591,649.85

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：

程涛

董志林

董志林

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

湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金（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[2020]335号文《关于准予长兴灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由湘财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《湘财长兴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790,863,091.70元，经天健会计师事务所(普通合伙)天健验[2020]2-10号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2020年4月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为790,907,696.35

份基金份额，其中认购资金利息折合44,604.65份基金份额。本基金的基金管理人为湘财基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，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（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、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的相关规定。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%-95%。基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约及国债期货合约所需缴纳的交易保证金后现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。本基金业绩比较基准为：中证800指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

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<年度报告和半年度报告>》、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》、《湘财长兴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。

本财务报表以持续经营为编制基础。

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本报告期末的财务状况以及本报告期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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与上一年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错和需更正的金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

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2018年1月1日起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费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06月30日
活期存款	96,278.64
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	11,779,025.19
合计	11,875,303.83

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		104,393,519.97	114,980,226.26	10,586,706.29
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	5,935,596.81	5,957,754.04	22,157.23
	银行间市场	5,000,191.78	4,941,500.00	-58,691.78
	合计	10,935,788.59	10,899,254.04	-36,534.55

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	115,329,308.56	125,879,480.30	10,550,171.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有自买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	114.98
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	2,768.02
应收结算备付金利息	21,066.08
应收债券利息	103,255.06
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	-
其他	-
合计	127,204.14

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	41.58
预提费用-审计费	14,876.39
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-账户维护费	9,000.00
其他应付	6,000.00
合计	89,425.34

6.4.7.9 实收基金**6.4.7.9.1 湘财长兴灵活配置混合A**

金额单位：人民币元

项目 (湘财长兴灵活配置混合A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	115,069,529.55	115,069,529.55
本期申购	5,221,575.91	5,221,575.91
本期赎回（以“-”号填列）	-53,015,864.95	-53,015,864.95
本期末	67,275,240.51	67,275,240.51

6.4.7.9.2 湘财长兴灵活配置混合C

金额单位：人民币元

项目 (湘财长兴灵活配置混合C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	132,021,552.37	132,021,552.37
本期申购	725,925.85	725,925.85
本期赎回（以“-”号填列）	-64,233,598.54	-64,233,598.54
本期末	68,513,879.68	68,513,879.68

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

6.4.7.10.1 湘财长兴灵活配置混合A

单位：人民币元

项目 (湘财长兴灵活配置混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,968,789.19	3,239,113.39	20,207,902.58
本期利润	6,053,219.22	-4,105,489.89	1,947,729.33
本期基金份额交易产生的变动数	-8,692,799.42	21,468.93	-8,671,330.49
其中：基金申购款	912,227.98	133,921.63	1,046,149.61
基金赎回款	-9,605,027.40	-112,452.70	-9,717,480.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,329,208.99	-844,907.57	13,484,301.42

6.4.7.10.2 湘财长兴灵活配置混合C

单位：人民币元

项目 (湘财长兴灵活配置混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,629,065.06	3,712,960.82	22,342,025.88
本期利润	6,221,063.45	-4,192,557.02	2,028,506.43
本期基金份额交易产生的变动数	-10,878,116.48	-369,623.43	-11,247,739.91
其中：基金申购款	134,248.38	-13,593.34	120,655.04
基金赎回款	-11,012,364.86	-356,030.09	-11,368,394.95

本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,972,012.03	-849,219.63	13,122,792.40

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	3,939.05
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	65,986.15
结算备付金利息收入	49,073.84
其他	-
合计	118,999.04

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	291,570,074.15
减：卖出股票成本总额	278,070,485.93
买卖股票差价收入	13,499,588.22

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内未持有基金。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	157,009.37

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	157,009.37

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,989,675.51
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,729,465.21
减：应收利息总额	103,200.93
买卖债券差价收入	157,009.37

6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	808,232.99
基金投资产生的股利收益	-
合计	808,232.99

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-8,298,046.91
——股票投资	-8,208,196.89
——债券投资	-89,850.02
——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	-8,298,046.91

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	78,365.91
转换费收入	270.38
合计	78,636.29

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	685,424.95

银行间市场交易费用	160.00
合计	685,584.95

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	2,845.00
账户维护费-中债登	9,000.00
其他	3,600.00
账户维护费-上清所	13,050.00
合计	102,878.76

6.4.7.22 分部报告

无。

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

截至本报告期期末，本基金没有需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本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
湘财基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

浙商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
湘财证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构、基金经纪服务商

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年04月23日（基金合同生效日） 至2020年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
湘财证券 股份有限 公司	147,133,205.26	31.05%	226,741,987.54	85.67%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年04月23日（基金合同生效日） 至2020年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
湘财证券	2,436,596.58	81.45%	-	-

股份有限 公司				
------------	--	--	--	--

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
湘财证券股份有限公司	107,189.23	31.07%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年04月23日（基金合同生效日）至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
湘财证券股份有限公司	164,892.56	80.31%	-	-

注：本基金管理人股东湘财证券股份有限公司受托作为本基金的证券经纪商，为本基金证券交易提供支持服务。上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年04月23日（基金合同 生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,479,649.60	1,953,232.94
其中：支付销售机构的客户维护费	504,909.70	438,086.50

注：（1）支付基金管理人湘财基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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×1.5%/当年天数。

（2）客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的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，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年04月23日（基金合同生 效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	246,608.21	325,538.85

注：支付基金托管人浙商银行股份有限公司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×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01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	湘财长兴灵活配置混合A	湘财长兴灵活配置混合C	合计
湘财基金	0.00	0.30	0.30

管理有限公司			
浙商银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
湘财证券股份有限公司	0.00	200,914.93	200,914.93
合计	0.00	200,915.23	200,915.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年04月23日（基金合同生效日）至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	湘财长兴灵活配置混合A	湘财长兴灵活配置混合C	合计
湘财基金管理有限公司	0.00	4,065.79	4,065.79
浙商银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
湘财证券股份有限公司	0.00	281,101.62	281,101.62
合计	0.00	285,167.41	285,167.41

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日C类基金份额对应的资产净值×0.40%÷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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券(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

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年04月23日（基金合同生效日） 至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	96,278.64	3,939.05	32,933,990.03	338,484.88
湘财证券股份有限公司	3,112,452.95	25,163.76	57,284,119.40	84,608.17

注：（1）浙商银行股份有限公司作为本基金的托管人，上述银行存款由基金托管人浙商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息；

（2）基金管理人股东湘财证券股份有限公司受托作为本基金的证券经纪商，上述存放于湘财证券股份有限公司的基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688687	凯因科技	2021-01-29	2021-08-09	科创板打新限售	18.98	27.98	4,781	90,743.38	133,772.38	-
688161	威高骨科	2021-06-23	2021-12-30	科创板打新限售	36.22	82.27	1,101	39,878.22	90,579.27	-
688633	星球石墨	2021-03-17	2021-09-24	科创板打新限售	33.62	53.14	1,558	52,379.96	82,792.12	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	1,290	50,116.50	50,116.50	-
688681	科汇股份	2021-06-04	2021-12-16	科创板打新限售	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	创业板打新限售	28.28	115.71	180	5,090.40	20,827.80	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
3009	南极	2021	2021	创业	12.7	43.3	307	3,91	13,3	-

40	光	-01- 27	-08- 03	板打 新限 售	6	8		7.32	17.6 6	
6052 87	德才 股份	2021 -06- 28	2021 -07- 06	新股 未上 市	31.5 6	31.5 6	349	11,0 14.4 4	11,0 14.4 4	-
3009 50	德固 特	2021 -02- 24	2021 -09- 03	创业 板打 新限 售	8.41	39.1 3	219	1,84 1.79	8,56 9.47	-
6051 62	新中 港	2021 -06- 29	2021 -07- 07	新股 未上 市	6.07	6.07	1,377	8,35 8.39	8,35 8.39	-
3009 58	建工 修复	2021 -03- 18	2021 -09- 29	创业 板打 新限 售	8.53	27.2 2	300	2,55 9.00	8,16 6.00	-
3009 26	博俊 科技	2020 -12- 29	2021 -07- 12	创业 板打 新限 售	10.7 6	22.2 0	359	3,86 2.84	7,96 9.80	-
3009 27	江天 化学	2020 -12- 29	2021 -07- 07	创业 板打 新限 售	13.3 9	30.1 0	217	2,90 5.63	6,53 1.70	-
3009 72	万辰 生物	2021 -04- 08	2021 -10- 19	创业 板打 新限 售	7.19	12.6 5	430	3,09 1.70	5,43 9.50	-
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

1136 26	伯特 转债	2021 -06- 29	-	新债 未上 市	100. 00	100. 00	890	89,0 00.0 0	89,0 00.0 0	-
------------	----------	--------------------	---	---------------	------------	------------	-----	-------------------	-------------------	---

注：（1）上述可流通日系本基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准；

（2）基金持有的股票在流通受限期内，如获送股、转增股、配股的，则该股票数量和期末成本总额相应调整，新增股票的可流通日、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

本基金本报告期末无参与银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无参与交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人将风险可计量、可控制与可承担作为风险管理的主要政策，以承担目标风险获取最大收益为风险管理的主要目标。本基金管理人遵循“全面、独立、制衡、适时”的原则，建立了由董事会及其下设的风险管理委员会、经理层及其下设的风险控制委员会、督察长、监察稽核部以及相关部门构成的多层次、全方位的风险管理架构，将风险管理渗透至各个业务环节，覆盖所有部门和岗位。本基金管理人建立了以风险识别、风险计量、风险控制、风险评价和风险报告为一体的风险管理机制，有效识别、分析和评估公司日常经营和基金运作过程中可能面临的各种风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指来源于借贷业务中的贷方、债券发行人及衍生产品交易对手不能或不愿意履行合约而给对手方带来损失的可能性。本基金的信用风险主要是指债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险、由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，以及因交易对手违约而产生的交割风险。

本基金管理人通过建立内部评级体系、信用债券投资库和交易对手分类管理等制度，对发行人及债券投资进行内部评级并根据评级结果划分投资库，对交易对手的资信情况进行分析评估、设定授信额度，防范和控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	—	713,861.80
AAA以下	5,688,854.04	5,030,749.92
未评级	5,210,400.00	5,261,880.00
合计	10,899,254.04	11,006,491.72

注：（1）以上未评级部分为国债；

（2）债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持有金融工具变现困难或在履行相关合同义务时发生资金短缺的风险。本基金流动性风险一方面来自于基金管理人无法以合理价格及时将持有的资产变现用以支付投资者赎回款项，另一方面来自于基金所持有的投资品种所处的交易市场不活跃而导致的变现困难。

本基金通过限制流动性受限资产和流通受限证券的比例、控制投资集中度等方式保证基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。同时，本基金管理人已建立多维度、全覆盖的综合性压力测试制度，由监察稽核部独立负责流动性压力测试的实施与评估。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在开放期内，本基金管理人在日常运作中能合理安排所持有金融工具的流动性，使其与本基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，期末除6.4.12列示券种流通暂时受限制不能自由交易外，其余均能在证券交易所或者银行间市场交易。本基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、持仓集中度、7个工作日可变现资产价值等反映资产流动性水平的风险指标，并由监察稽核部定期独立地开展综合性压力测试，详细评估在不同极端情景下资产变现水平的变化。此外，本基金还可以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。

在负债端，本基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者结构和类型等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求。当市场环境和投

投资者结构发生变化时，及时调整基金资产结构与比例，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限相匹配。

如遇市场极端情况或非预期下的投资者巨额赎回情况，本基金管理人将采用基金合同约定的赎回申请处理方式及其他流动性管理工具，控制极端情形下的流动性风险。

本基金于报告期内未发生重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于证券价格、利率、汇率、商品价格等基础要素的变动导致基金所持有金融工具的公允价值或未来现金流发生波动的风险。本基金管理人通过监测基金组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由利率变动引起基金所持有的金融资产特别是债券资产的公允价值或未来现金流变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债均不计息。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	11,875,303.83	-	-	-	-	-	11,875,303.83
结算备付金	25,092,519.46	-	-	-	-	-	25,092,519.46
交易性金融资产	5,210,400.00	-	-	4,941,500.00	747,354.04	114,980,226.26	125,879,480.30
应收利息	-	-	-	-	-	127,204.14	127,204.14
应收申购款	-	-	-	-	-	5,593.04	5,593.04
资产总计	42,178,223.29	-	-	4,941,500.00	747,354.04	115,113,023.44	162,980,100.77
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	229,552.37	229,552.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	201,132.85	201,132.85
应付托	-	-	-	-	-	33,522.12	33,522.12

管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	27,219.24	27,219.24
应交税费	-	-	-	-	-	3,034.84	3,034.84
其他负债	-	-	-	-	-	89,425.34	89,425.34
负债总计	-	-	-	-	-	583,886.76	583,886.76
利率敏感度缺口	42,178,223.29	-	-	4,941,500.00	747,354.04	114,529,136.68	162,396,214.01
上年度末 2020年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	17,222,791.56	-	-	-	-	-	17,222,791.56
结算备付金	40,059,614.54	-	-	-	-	-	40,059,614.54
交易性金融资产	-	500,500.00	5,261,880.00	5,200,361.80	43,749.92	216,900,694.23	227,907,185.95
买入返售金融资产	9,000,045.00	-	-	-	-	-	9,000,045.00
应收利息	-	-	-	-	-	266,338.73	266,338.73
应收申购款	-	-	-	-	-	11,960.39	11,960.39
资产总计	66,282,451.10	500,500.00	5,261,880.00	5,200,361.80	43,749.92	217,178,993.35	294,467,936.17
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,199,097.93	4,199,097.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	372,266.96	372,266.96
应付托管费	-	-	-	-	-	62,044.48	62,044.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-	54,071.14	54,071.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	280.50	280.50
应交税费	-	-	-	-	-	2,421.33	2,421.33
其他负债	-	-	-	-	-	136,743.45	136,743.45

负债总计	-	-	-	-	-	4,826,925.79	4,826,925.79
利率敏感度缺口	66,282,451.10	500,500.00	5,261,880.00	5,200,361.80	43,749.92	212,352,067.56	289,641,010.38

注：表中所示为本基金资产以及负责的账面价值，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

截至本报告期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值比例为6.71%（2020年12月31日：3.80%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020年12月31日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指因外汇汇率变动引起金融工具的公允价值或未来现金流发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指除利率风险和外汇风险以外的市场因素的变动对基金所持有的金融工具的公允价值或未来现金流产生波动的风险。本基金的其他价格风险主要为单个证券发行主体自身经营情况变化或证券市场整体波动等因素对基金资产带来损失的可能性。

本基金通过分散化投资降低投资组合市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施每日监控，并定期运用多种定量方法对本基金进行风险度量和评估，对风险进行及时有效的追踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	114,980,226.26	70.80	216,900,694.23	74.89

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	10,899,254.04	6.71	11,006,491.72	3.80
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	125,879,480.30	77.51	227,907,185.95	78.69

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、测算组合市场价格风险的数据为中证800指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定中证800指数变化5%，其他市场变量均不发生变化。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	中证800指数上升5%	6,264,265.97	13,464,208.79
	中证800指数下降5%	-6,264,265.97	-13,464,208.79

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115,147,912.49元，属于第二层次的余额为10,731,567.81元，无属于第三层次的余额。

(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。

(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，其公允价值与账面价值相若。

(2) 其他

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	114,980,226.26	70.55
	其中：股票	114,980,226.26	70.55
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	10,899,254.04	6.69
	其中：债券	10,899,254.04	6.69
	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	36,967,823.29	22.68
8	其他各项资产	132,797.18	0.08
9	合计	162,980,100.77	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,439.50	0.00
B	采矿业	7,158,700.00	4.41
C	制造业	77,807,288.43	47.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,025,020.39	0.63
E	建筑业	11,014.44	0.01
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	3,340,400.00	2.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,039,280.40	6.80
J	金融业	9,043,121.10	5.57
K	房地产业	1,190,500.00	0.73
L	租赁和商务服务业	1,500,500.00	0.92
M	科学研究和技术服务业	688,996.00	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	8,166.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	417,800.00	0.26
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,744,000.00	1.07
S	综合	-	-
	合计	114,980,226.26	70.80

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300059	东方财富	120,000	3,934,800.00	2.42
2	603348	文灿股份	110,000	3,850,000.00	2.37
3	300433	蓝思科技	129,964	3,822,241.24	2.35
4	601012	隆基股份	39,390	3,499,407.60	2.15
5	600600	青岛啤酒	30,000	3,469,500.00	2.14
6	002624	完美世界	140,000	3,347,400.00	2.06
7	600258	首旅酒店	140,000	3,340,400.00	2.06
8	603444	吉比特	6,000	3,180,000.00	1.96
9	002353	杰瑞股份	59,912	2,678,066.40	1.65
10	600438	通威股份	60,000	2,596,200.00	1.60
11	000949	新乡化纤	300,000	2,541,000.00	1.56
12	600985	淮北矿业	200,000	2,442,000.00	1.50
13	601233	桐昆股份	100,000	2,409,000.00	1.48
14	002648	卫星石化	55,889	2,190,289.91	1.35
15	600036	招商银行	40,000	2,167,600.00	1.33
16	300724	捷佳伟创	17,960	2,083,539.60	1.28
17	002867	周大生	105,000	2,075,850.00	1.28
18	002230	科大讯飞	30,000	2,027,400.00	1.25
19	601808	中海油服	140,000	2,010,400.00	1.24
20	002508	老板电器	40,000	1,860,000.00	1.15
21	601225	陕西煤业	150,000	1,777,500.00	1.09
22	600919	江苏银行	250,000	1,775,000.00	1.09

23	603605	珀莱雅	9,000	1,770,390.00	1.09
24	688390	固德威	5,000	1,670,000.00	1.03
25	300146	汤臣倍健	50,000	1,645,000.00	1.01
26	603501	韦尔股份	4,949	1,593,578.00	0.98
27	601888	中国中免	5,000	1,500,500.00	0.92
28	300450	先导智能	24,000	1,443,360.00	0.89
29	603596	伯特利	40,000	1,430,000.00	0.88
30	000333	美的集团	20,000	1,427,400.00	0.88
31	600567	山鹰国际	400,000	1,380,000.00	0.85
32	603799	华友钴业	12,000	1,370,400.00	0.84
33	603960	克来机电	40,000	1,324,000.00	0.82
34	000932	华菱钢铁	200,000	1,320,000.00	0.81
35	601633	长城汽车	30,000	1,307,700.00	0.81
36	600309	万华化学	12,000	1,305,840.00	0.80
37	000651	格力电器	24,986	1,301,770.60	0.80
38	601636	旗滨集团	70,000	1,299,200.00	0.80
39	688023	安恒信息	5,000	1,260,000.00	0.78
40	300737	科顺股份	40,000	1,257,600.00	0.77
41	600010	宝钢股份	800,000	1,240,000.00	0.76
42	600862	中航高科	40,000	1,231,200.00	0.76
43	600570	恒生电子	13,000	1,212,250.00	0.75
44	603187	海容冷链	27,972	1,199,439.36	0.74
45	000002	万科A	50,000	1,190,500.00	0.73
46	002756	永兴材料	20,000	1,187,800.00	0.73
47	000001	平安银行	50,000	1,131,000.00	0.70
48	600584	长电科技	29,910	1,127,008.80	0.69
49	688526	科前生物	30,000	1,086,600.00	0.67
50	300750	宁德时代	2,000	1,069,600.00	0.66
51	601952	苏垦农发	100,000	1,038,000.00	0.64
52	300196	长海股份	60,000	1,029,600.00	0.63
53	601985	中国核电	200,000	1,012,000.00	0.62

54	300661	圣邦股份	4,000	1,010,920.00	0.62
55	300144	宋城演艺	60,000	1,008,000.00	0.62
56	002460	赣锋锂业	8,000	968,720.00	0.60
57	000933	神火股份	100,000	945,000.00	0.58
58	600123	兰花科创	120,000	928,800.00	0.57
59	600480	凌云股份	100,000	916,000.00	0.56
60	002409	雅克科技	10,000	810,000.00	0.50
61	603786	科博达	10,000	755,000.00	0.46
62	603103	横店影视	50,000	736,000.00	0.45
63	300894	火星号	10,628	722,704.00	0.45
64	603259	药明康德	4,400	688,996.00	0.42
65	002876	三利谱	9,920	641,824.00	0.40
66	300073	当升科技	10,000	561,900.00	0.35
67	002414	高德红外	20,000	551,600.00	0.34
68	688169	石头科技	400	504,400.00	0.31
69	000807	云铝股份	40,000	476,000.00	0.29
70	002475	立讯精密	10,000	460,000.00	0.28
71	688036	传音控股	2,000	419,000.00	0.26
72	002607	中公教育	20,000	417,800.00	0.26
73	688626	翔宇医疗	3,000	362,520.00	0.22
74	300003	乐普医疗	10,000	321,200.00	0.20
75	603806	福斯特	3,000	315,390.00	0.19
76	000683	远兴能源	50,000	233,500.00	0.14
77	002304	洋河股份	1,000	207,200.00	0.13
78	688687	凯因科技	4,781	133,772.38	0.08
79	688161	威高骨科	1,101	90,579.27	0.06
80	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.05
81	688499	利元亨	1,290	50,116.50	0.03
82	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
83	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.02
84	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01

85	300973	立高食品	180	20,827.80	0.01
86	300932	三友联众	492	15,601.32	0.01
87	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
88	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
89	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
90	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
91	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
92	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.01
93	300958	建工修复	300	8,166.00	0.01
94	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
95	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
96	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
97	605011	杭州热电	525	4,662.00	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	600258	首旅酒店	3,995,127.00	1.38
2	002624	完美世界	3,246,394.00	1.12
3	601233	桐昆股份	3,125,119.00	1.08
4	603605	珀莱雅	3,084,196.00	1.06
5	600600	青岛啤酒	3,061,830.00	1.06
6	601012	隆基股份	2,880,859.67	0.99
7	300224	正海磁材	2,811,199.00	0.97
8	000933	神火股份	2,743,442.00	0.95
9	601398	工商银行	2,706,565.00	0.93
10	601808	中海油服	2,677,298.00	0.92
11	002221	东华能源	2,620,194.00	0.90
12	603612	索通发展	2,494,210.00	0.86

13	002408	齐翔腾达	2,378,358.14	0.82
14	002607	中公教育	2,378,067.00	0.82
15	300118	东方日升	2,372,481.47	0.82
16	603596	伯特利	2,229,995.00	0.77
17	002867	周大生	2,221,355.00	0.77
18	603501	韦尔股份	2,211,229.99	0.76
19	600966	博汇纸业	2,154,218.00	0.74
20	002050	三花智控	2,087,074.30	0.72

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	600409	三友化工	6,060,622.00	2.09
2	000933	神火股份	5,593,007.00	1.93
3	000100	TCL科技	5,474,834.00	1.89
4	000887	中鼎股份	5,452,370.79	1.88
5	600352	浙江龙盛	5,193,673.00	1.79
6	688051	佳华科技	5,041,985.52	1.74
7	601318	中国平安	4,973,131.00	1.72
8	300059	东方财富	4,886,283.60	1.69
9	002497	雅化集团	4,738,488.04	1.64
10	601899	紫金矿业	4,662,540.16	1.61
11	688005	容百科技	4,628,672.06	1.60
12	600048	保利地产	4,471,265.26	1.54
13	601128	常熟银行	4,105,915.00	1.42
14	601166	兴业银行	4,079,130.00	1.41
15	600486	扬农化工	3,997,375.00	1.38
16	002739	万达电影	3,868,968.00	1.34

17	601336	新华保险	3,816,767.00	1.32
18	601168	西部矿业	3,731,496.72	1.29
19	601601	中国太保	3,675,130.00	1.27
20	002938	鹏鼎控股	3,633,643.00	1.25

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	184,358,214.85
卖出股票收入（成交）总额	291,570,074.15

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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	5,210,400.00	3.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	4,941,500.00	3.04
7	可转债(可交换债)	747,354.04	0.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,899,254.04	6.71

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	010107	21国债(7)	52,000	5,210,400.00	3.21
2	102001205	20万盛经开MTN 002	50,000	4,941,500.00	3.04
3	113606	荣泰转债	3,000	375,600.00	0.23
4	123111	东财转3	1,820	266,380.66	0.16
5	113626	伯特转债	890	89,000.00	0.05

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参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	127,204.14
5	应收申购款	5,593.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	132,797.18

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	113606	荣泰转债	375,600.00	0.23

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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，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	持有份额	占总份

	(户)			份额 比例		额比例
湘财 长兴 灵活 配置 混合A	1,363	49,358.21	23,373,611.60	34.74%	43,901,628.91	65.26%
湘财 长兴 灵活 配置 混合C	854	80,227.03	0.00	0.00%	68,513,879.68	100.00%
合计	2,170	62,575.63	23,373,611.60	17.21%	112,415,508.59	82.79%

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	湘财长兴灵活配 置混合A	199.80	0.00%
	湘财长兴灵活配 置混合C	9.01	0.00%
	合计	208.81	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资 和研究部门负责人持有本开放式 基金	湘财长兴灵活配置 混合A	0
	湘财长兴灵活配置 混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基	湘财长兴灵活配置	0

金	混合A	
	湘财长兴灵活配置混合C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	湘财长兴灵活配置混合 A	湘财长兴灵活配置混合 C
基金合同生效日(2020年04月23日)基金份额总额	285,679,652.05	505,228,044.30
本报告期期初基金份额总额	115,069,529.55	132,021,552.37
本报告期基金总申购份额	5,221,575.91	725,925.85
减：本报告期基金总赎回份额	53,015,864.95	64,233,598.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	67,275,240.51	68,513,879.68

§ 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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

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	
长江证券	2	289,689,003.77	61.13%	209,979.27	60.86%	-
申万宏源	2	37,039,100.87	7.82%	27,837.48	8.07%	-
湘财证券	2	147,133,205.26	31.05%	107,189.23	31.07%	-

注：1、经纪商选择标准：评价维度包括公司基本情况（财务状况、公司信誉）和公司经营行为（内控制度、数据通讯及信息服务）等方面。另外，经纪服务佣金费率应符合行业内普遍采取的收费标准。

2、经纪商选择程序：（1）组织对经纪商开展尽职调查，评估是否满足经纪合作要求；（2）每年对经纪商的各个考评指标进行考核并形成综合评分；（3）经审批以及协议签署后可新增、变更或终止经纪商。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

长江证 券	493,333.27	16.4 9%	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	61,504.00	2.06%	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	2,436,596. 58	81.4 5%	-	-	-	-	-	-

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	湘财基金管理有限公司年度最后一日基金净值公告	证监会指定网站	2021-01-01
2	湘财基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	《证券日报》和证监会指定网站	2021-01-08
3	湘财基金管理有限公司关于旗下部分基金新增诺亚正行基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务以及参与其费率优惠活动的公告	《证券日报》和证监会指定网站	2021-01-13
4	湘财基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆金所基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务以及参与其费率优惠活动的公告	《证券日报》和证监会指定网站	2021-01-13
5	湘财基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	《证券日报》	2021-01-22
6	湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金2020年第四季度报告	证监会指定网站	2021-01-22
7	湘财基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公	《证券日报》	2021-03-31

	告		
8	湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告	证监会指定网站	2021-03-31
9	湘财基金管理有限公司关于旗下基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务以及参与其费率优惠活动的公告	《证券日报》和证监会指定网站	2021-03-31
10	湘财基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公示	证监会指定网站	2021-03-31
11	湘财基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	《证券日报》和证监会指定网站	2021-04-16
12	湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金基金合同（更新）	证监会指定网站	2021-04-16
13	湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金托管协议（更新）	证监会指定网站	2021-04-16
14	湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021年第1号）及产品资料概要更新	证监会指定网站	2021-04-16
15	湘财基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	《证券日报》	2021-04-22
16	湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金2021年第一季度报告	证监会指定网站	2021-04-22
17	湘财基金管理有限公司关于对投资者证件有效期过期超过6个月采取限制交易措施的公告	《证券日报》和证监会指定网站	2021-04-26

18	湘财基金管理有限公司关于旗下基金新增大河财富基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务以及参与其费率优惠活动的公告	《证券日报》和证监会指定网站	2021-05-17
19	湘财基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中正达广基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务以及参与其费率优惠活动的公告	《证券日报》和证监会指定网站	2021-06-01

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件；
- 2、《湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《湘财长兴灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所，并登载于中国证监会基金电子披露网站和基金管理人互联网站www.xc-fund.com。

12.3 查阅方式

投资者可登陆中国证监会基金电子披露网站和基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人的办公场所免费查阅。

湘财基金管理有限公司
二〇二一年八月三十一日