广发量化多因子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：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设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、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
5 托管人报告 11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11
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 11
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 12
6 半年度财务会计报告（未经审计） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 14
6.4 报表附注 15
7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
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 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 45
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 45
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 46
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 46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 46
7.12 投资组合报告附注 46
8 基金份额持有人信息 47

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 47
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 47
9 开放式基金份额变动 48
10 重大事件揭示 48
10.1 基金份额持有人大会决议 48
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 48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 48
10.4 基金投资策略的改变 48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 48
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 48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 48
10.8 其他重大事件 50
11 影响投资者决策的其他重要信息 50
12 备查文件目录 51
12.1 备查文件目录 51
12.2 存放地点 51
12.3 查阅方式 51

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	广发量化多因子混合
基金主代码	005225
交易代码	005225
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 21 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	177,568,006.02 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过量化模型构建股票组合，力争实现超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将从宏观环境、政策因素、资金供求因素、证券市场基本面等角度进行综合分析，判断各类资产的市场趋势和预期风险收益，在严格控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等大类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。

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		广发基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	程才良	李申
	联系电话	020-83936666	021-60637102
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		95105828	(021)60637111
传真		020-89899158	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号	北京市西城区闹市口大街1号

	保利国际广场南塔31-33楼	院1号楼
邮政编码	510308	100033
法定代表人	孙树明	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	41,418,021.78
本期利润	7,010,757.58
加权平均基金份额本期利润	0.0347
本期加权平均净值利润率	1.78%
本期基金份额净值增长率	3.77%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2021 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	143,955,182.80
期末可供分配基金份额利润	0.8107
期末基金资产净值	351,536,094.16
期末基金份额净值	1.9797
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2021 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	97.97%

注：（1）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。

（2）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。

（3）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（为期末余额，不是当期发生数）。

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.17%	0.96%	-1.81%	0.72%	1.98%	0.24%
过去三个月	7.07%	1.03%	3.16%	0.88%	3.91%	0.15%
过去六个月	3.77%	1.45%	0.33%	1.18%	3.44%	0.27%
过去一年	44.75%	1.41%	22.93%	1.20%	21.82%	0.21%
过去三年	102.92%	1.31%	44.04%	1.23%	58.88%	0.08%
自基金合同生效起至今	97.97%	1.28%	25.95%	1.22%	72.02%	0.06%

注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

广发量化多因子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

（2018 年 3 月 21 日至 2021 年 6 月 30 日）

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立，总部设在广州，在北京、上海、广州、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

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		
陈宇庭	本基金的基金经理；广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经	2020-05-06	-	5 年	陈宇庭先生，理学和金融学双硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任海富通基金管理有限公司量化投资部投资经理助理，广发基金管理有限公司量化投资部研究员、广发对冲套利定期开放混合

	理；广发转型升级灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理				型发起式证券投资基金基金经理助理(自 2019 年 2 月 25 日至 2020 年 5 月 6 日)、广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理(自 2019 年 2 月 25 日至 2020 年 5 月 6 日)。

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

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《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、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

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

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少

的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 13 次，其中 7 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 6 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本组合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

2021 年上半年，市场出现较为明显的风格切换，节前高 ROE、高成长的行业龙头持续走强，这一风格的估值也持续提升，而节后在海外新冠疫苗接种情况超预期、美国十年期国债收益率走高的背景下，高估值板块出现快速回调，低估值、高分红风格表现更好。进入二季度之后，市场呈现区间震荡的走势，在这个过程中美国十年期国债收益率震荡调整，国内外流动性整体保持中性略偏宽松的态势，市场重新回到成长风格更强的趋势之中。

在这个过程中，本产品坚持以低估值、高成长、高盈利质量等基本面因子为主构建股票组合，在风格快速切换的情况下，超额收益的波动也有所放大，但仍然取得了相对基准比较显著的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 3.77%，同期业绩比较基准收益率为 0.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们对市场维持中性偏乐观的态度，7 月上旬央行释放降准信号后，我们认为接下来 1-2 个季度内流动性大概率维持相对稳定偏宽松的局面，市场整体下行风险有限，建议关注成长风格的机会。在前期热门板块到达阶段性较高的位置之后，我们认为后续的超额收益主要来自于均衡配置下，对各行业高景气子板块的选择和自下而上的选股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程

序进行评价，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，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

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：广发量化多因子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	21,330,341.53	7,080,934.39
结算备付金		1,249,043.88	1,446,448.12
存出保证金		107,840.12	105,862.93
交易性金融资产	6.4.7.2	329,309,858.27	414,868,632.53
其中：股票投资		329,309,858.27	398,937,874.13
基金投资		-	-
债券投资		-	15,930,758.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		593,070.68	3,841,764.15
应收利息	6.4.7.5	3,019.35	343,697.92
应收股利		-	-
应收申购款		232,323.65	53,851.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		352,825,497.48	427,741,191.78
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		-	-
应付赎回款		315,610.02	193,852.18
应付管理人报酬		288,680.47	339,534.89
应付托管费		72,170.13	84,883.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	535,311.88	326,475.88
应交税费		-	10.07
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	77,630.82	156,100.45
负债合计		1,289,403.32	1,100,857.14
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	177,568,006.02	223,639,351.68
未分配利润	6.4.7.10	173,968,088.14	203,000,982.96
所有者权益合计		351,536,094.16	426,640,334.64
负债和所有者权益总计		352,825,497.48	427,741,191.78

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.9797 元，基金份额总额 177,568,006.02 份。

6.2 利润表

会计主体：广发量化多因子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		**11,297,056.67**	**34,640,587.76**
1.利息收入		75,178.91	90,597.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	67,393.67	89,300.61
债券利息收入		7,785.24	1,296.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		45,202,473.83	21,772,415.30
其中：股票投资收益	6.4.7.12	43,252,777.07	18,792,963.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	119,240.91	139,494.76
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	1,830,455.85	2,839,956.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-34,407,264.20	12,597,730.90
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	426,668.13	179,844.07
减：二、费用		**4,286,299.09**	**2,533,793.11**
1．管理人报酬		1,973,449.00	1,424,060.21
2．托管费		493,362.19	356,015.05
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.18	1,733,752.25	671,968.84
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		0.42	0.48
7．其他费用	6.4.7.19	85,735.23	81,748.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**7,010,757.58**	**32,106,794.65**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**7,010,757.58**	**32,106,794.65**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发量化多因子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）	223,639,351.68	203,000,982.96	426,640,334.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,010,757.58	7,010,757.58
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）	-46,071,345.66	-36,043,652.40	-82,114,998.06
其中：1.基金申购款	74,259,571.33	77,326,439.19	151,586,010.52
2.基金赎回款	-120,330,916.99	-113,370,091.59	-233,701,008.58
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）	177,568,006.02	173,968,088.14	351,536,094.16
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）	208,245,236.93	50,191,118.41	258,436,355.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,106,794.65	32,106,794.65
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）	44,667,372.42	10,688,529.43	55,355,901.85
其中：1.基金申购款	121,626,142.40	31,339,213.77	152,965,356.17
2.基金赎回款	-76,958,769.98	-20,650,684.34	-97,609,454.32
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）	252,912,609.35	92,986,442.49	345,899,051.84

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：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可〔2017〕1514 号《关于准予广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2018 年 2 月 12 日向社会公开发行募集并于 2018 年 3 月 21 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2018 年 2 月 12 日至 2018 年 3 月 16 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 237,368,420.96 元，有效认购户数为 1,851 户。其中，认购资金在募集期

间产生的利息共计人民币 48,803.01 元，折合基金份额 48,803.01 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2021 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

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颁布的企业会计准则 （以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，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 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	21,330,341.53
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	21,330,341.53

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		295,502,761.63	329,309,858.27	33,807,096.64
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		295,502,761.63	329,309,858.27	33,807,096.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,408.75
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	48.50
应收结算备付金利息	562.10
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	3,019.35

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	535,311.88
银行间市场应付交易费用	-
合计	535,311.88

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	271.42

应付证券出借违约金	-
预提费用	77,359.40
合计	77,630.82

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	223,639,351.68	223,639,351.68
本期申购	74,259,571.33	74,259,571.33
本期赎回（以“-”号填列）	-120,330,916.99	-120,330,916.99
本期末	177,568,006.02	177,568,006.02

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	136,922,411.68	66,078,571.28	203,000,982.96
本期利润	41,418,021.78	-34,407,264.20	7,010,757.58
本期基金份额交易产生的变动数	-34,385,250.66	-1,658,401.74	-36,043,652.40
其中：基金申购款	53,018,905.12	24,307,534.07	77,326,439.19
基金赎回款	-87,404,155.78	-25,965,935.81	-113,370,091.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	143,955,182.80	30,012,905.34	173,968,088.14

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	60,814.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	837.74
结算备付金利息收入	5,741.51
其他	-
合计	67,393.67

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	678,270,791.73
减：卖出股票成本总额	635,018,014.66

买卖股票差价收入	43,252,777.07

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	119,240.91
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	119,240.91

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,264,622.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,795,429.34
减：应收利息总额	349,952.15
买卖债券差价收入	119,240.91

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	1,830,455.85
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	1,830,455.85

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	-34,407,264.20
——股票投资	-34,271,935.14

——债券投资	-135,329.06
——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	-34,407,264.20

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	218,361.03
基金转换费收入	208,307.10
合计	426,668.13

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	1,733,752.25
银行间市场交易费用	-
合计	1,733,752.25

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	17,852.03
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	8,375.83
合计	85,735.23

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	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
广发证券股份有限公司	-	-	131,392,226.81	28.13%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	358,160.60	12.55%

6.4.10.1.4 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 1 月 1 日至 2021 年 6 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
广发证券股份有限公司	-	-	-	-
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
广发证券股份有限公司	122,361.96	30.86%	-	-

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	1,973,449.00	1,424,060.21
其中：支付销售机构的客户维护费	46,617.03	91,368.98

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.00%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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	493,362.19	356,015.05

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

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
报告期初持有的基金份额	-	32,565,873.88
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	32,565,873.88
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	12.88%

注：本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	21,330,341.53	60,814.42	21,611,352.86	84,153.13

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688083	中望软件	2021-03-04	2021-09-13	新股流通受限	150.50	524.08	399.00	60,049.50	209,107.92	20210528 除权除息,派息比例 0.7000 (含税)
688070	纵横股份	2021-02-02	2021-08-10	新股流通受限	23.16	34.47	2,407.00	55,746.12	82,969.29	20210608 除权除息,派息比例 0.2200

										(含税)
688314	康拓医疗	2021-05-11	2021-11-18	新股流通受限	17.34	74.48	1,085.00	18,813.90	80,810.80	-
688499	利元亨	2021-06-23	2022-01-03	新股流通受限	38.85	38.85	1,620.00	62,937.00	62,937.00	-
688611	杭州柯林	2021-04-01	2021-10-12	新股流通受限	33.44	42.34	1,400.00	46,816.00	59,276.00	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	8.29	8.29	7,029.00	58,270.41	58,270.41	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	342.00	8,413.20	55,746.00	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	47.33	251.96	202.00	9,560.66	50,895.92	20210624 除权除息,派息比例 0.4500 (含税)
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股流通受限	21.96	21.96	1,802.00	39,571.92	39,571.92	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	20210617 除权除息,派息比例 0.1400 (含税)
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	115.71	177.00	5,005.56	20,480.67	20210622 除权除息,派息比例 0.5000

										(含税)
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	21.31	49.94	368.00	7,842.08	18,377.92	20210629 除权除息,派息比例 0.3000 (含税)
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	20210618 除权除息,派息比例 0.5000 (含税)
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	493.00	6,182.22	13,749.77	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	20210618 除权除息,派息比例 0.0790 (含税)
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	20210602 除权除息,派息比例 0.0450 (含税)
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	976.00	6,705.12	11,780.32	-

300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112.00	3,747.44	11,609.28	20210618 除权除息,派息比例 0.0300 (含税)
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股流通受限	16.53	46.07	229.00	3,785.37	10,550.03	20210628 除权除息,派息比例 0.4100 (含税)
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股流通受限	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	764.00	3,774.16	9,970.20	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股流通受限	12.85	25.80	371.00	4,767.35	9,571.80	20210527 除权除息,派息比例 0.3000 (含税)
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股流通受限	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	20210610 除权除息,派息比例 0.1600 (含税)
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股流通受限	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	20210603 除权除息,派

										息比例 0.2200 (含税)
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	275.00	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	20210609 除权除息,派息比例 0.0950 (含税)
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-24	新股流通受限	13.00	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	20210604 除权除息,派息比例 0.0800 (含税) ,转增比例 0.5000
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股流通受限	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	20210611 除权除息,派息比例 0.0530 (含税)
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	20210601 除权除息,派

										息比例 0.1000 (含税)
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股流通受限	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通受限	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股流通受限	6.79	26.81	301.00	2,043.79	8,069.81	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股流通受限	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	20210519 除权除息,派息比例 0.0500 (含税)
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	13.11	24.48	322.00	4,221.42	7,882.56	20210528 除权除息,派息比例 0.1000 (含税)
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	8.29	8.29	782.00	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	20210608 除权除息,派息比例 0.0360 (含税)
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	20210617 除权除息,派息比

										例 0.1000 (含税)
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股流通受限	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股流通受限	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	20210618 除权除息,派息比例 0.1200 (含税)
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	23.06	234.00	2,826.72	5,396.04	20210623 除权除息,派息比例 0.4000 (含税)
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	198.00	4,930.20	4,912.38	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股流通受限	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股流通受限	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-

注：截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债

券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约

风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	15,536,446.20
合计	-	15,536,446.20

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、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	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	384,312.20
AAA 以下	-	10,000.00
未评级	-	-
合计	-	394,312.20

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，

本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的最大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券资产。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

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	21,330,341.53	-	-	-	21,330,341.53
结算备付金	1,249,043.88	-	-	-	1,249,043.88
存出保证金	107,840.12	-	-	-	107,840.12
交易性金融资产	-	-	-	329,309,858.27	329,309,858.27
应收证券清算款	-	-	-	593,070.68	593,070.68
应收利息	-	-	-	3,019.35	3,019.35
应收申购款	-	-	-	232,323.65	232,323.65
资产总计	22,687,225.53	-	-	330,138,271.95	352,825,497.48
负债：					
应付赎回款	-	-	-	315,610.02	315,610.02
应付管理人报酬	-	-	-	288,680.47	288,680.47
应付托管费	-	-	-	72,170.13	72,170.13
应付交易费用	-	-	-	535,311.88	535,311.88
其他负债	-	-	-	77,630.82	77,630.82

负债总计	-	-	-	1,289,403.32	1,289,403.32
利率敏感度缺口	22,687,225.53	-	-	328,848,868.63	351,536,094.16
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	7,080,934.39	-	-	-	7,080,934.39
结算备付金	1,446,448.12	-	-	-	1,446,448.12
存出保证金	105,862.93	-	-	-	105,862.93
交易性金融资产	15,930,758.40	-	-	398,937,874.13	414,868,632.53
应收证券清算款	-	-	-	3,841,764.15	3,841,764.15
应收利息	-	-	-	343,697.92	343,697.92
应收申购款	-	-	-	53,851.74	53,851.74
资产总计	24,564,003.84	-	-	403,177,187.94	427,741,191.78
负债：					
应付赎回款	-	-	-	193,852.18	193,852.18
应付管理人报酬	-	-	-	339,534.89	339,534.89
应付托管费	-	-	-	84,883.67	84,883.67
应付交易费用	-	-	-	326,475.88	326,475.88
应交税费	-	-	-	10.07	10.07
其他负债	-	-	-	156,100.45	156,100.45
负债总计	-	-	-	1,100,857.14	1,100,857.14
利率敏感度缺口	24,564,003.84	-	-	402,076,330.80	426,640,334.64

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券资产（不含可转债、可交换债），上年度末持有的债券资产（不含可转债、可交换债）占基金资产净值较小，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇资产，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

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	329,309,858.27	93.68	398,937,874.13	93.51
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	394,312.20	0.09
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	329,309,858.27	93.68	399,332,186.33	93.60

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	上升 5%	21,496,023.67	19,147,699.07
	下降 5%	-21,496,023.67	-19,147,699.07

注：上年度末的假设条件为“除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变”。

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

（1）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，其账面价值接近于公允价值。

（2）以公允价值计量的金融工具

（i）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。

（ii）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的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 328,234,260.49 元，属于第二层次的余额为人民币 1,075,597.78 元，无属于第三层次的金额（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 394,470,331.04 元，属于第二层次的余额为人民币 20,398,301.49 元，无属于第三层次的金额）。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

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	329,309,858.27	93.34
	其中：股票	329,309,858.27	93.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,579,385.41	6.40
8	其他各项资产	936,253.80	0.27
9	合计	352,825,497.48	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	3,128,424.86	0.89
B	采矿业	8,425,967.00	2.40
C	制造业	203,653,675.98	57.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,315,301.39	0.66
E	建筑业	2,849,379.37	0.81
F	批发和零售业	15,359.88	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	8,260,826.00	2.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,051,496.28	1.72
J	金融业	55,815,932.01	15.88
K	房地产业	2,637,883.44	0.75
L	租赁和商务服务业	9,649,816.00	2.75
M	科学研究和技术服务业	10,922,665.00	3.11
N	水利、环境和公共设施管理业	36,272.33	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	13,424,576.70	3.82
R	文化、体育和娱乐业	2,106,020.00	0.60

S	综合	-	-
	合计	329,309,858.27	93.68

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	600519	贵州茅台	7,087	14,575,832.90	4.15
2	000858	五粮液	46,900	13,971,041.00	3.97
3	600036	招商银行	252,967	13,708,281.73	3.90
4	603259	药明康德	52,700	8,252,293.00	2.35
5	600809	山西汾酒	17,700	7,929,600.00	2.26
6	601888	中国中免	23,200	6,962,320.00	1.98
7	300059	东方财富	203,192	6,662,665.68	1.90
8	601012	隆基股份	74,480	6,616,803.20	1.88
9	300750	宁德时代	11,300	6,043,240.00	1.72
10	300014	亿纬锂能	55,100	5,726,543.00	1.63
11	601318	中国平安	86,995	5,592,038.60	1.59
12	601699	潞安环能	470,000	5,550,700.00	1.58
13	000725	京东方 A	816,600	5,095,584.00	1.45
14	600030	中信证券	198,300	4,945,602.00	1.41
15	603501	韦尔股份	15,200	4,894,400.00	1.39
16	300347	泰格医药	25,000	4,832,500.00	1.37
17	000001	平安银行	206,600	4,673,292.00	1.33
18	601166	兴业银行	224,000	4,603,200.00	1.31
19	300142	沃森生物	66,900	4,127,730.00	1.17
20	300122	智飞生物	21,500	4,014,695.00	1.14
21	000333	美的集团	55,900	3,989,583.00	1.13
22	002821	凯莱英	10,400	3,875,040.00	1.10
23	600763	通策医疗	9,300	3,822,300.00	1.09
24	600919	江苏银行	533,300	3,786,430.00	1.08
25	300124	汇川技术	49,200	3,653,592.00	1.04
26	002508	老板电器	72,600	3,375,900.00	0.96
27	601919	中远海控	106,600	3,255,564.00	0.93
28	600309	万华化学	29,754	3,237,830.28	0.92
29	300015	爱尔眼科	45,365	3,220,007.70	0.92

30	002415	海康威视	49,800	3,212,100.00	0.91
31	600600	青岛啤酒	27,300	3,157,245.00	0.90
32	002714	牧原股份	51,348	3,122,985.36	0.89
33	300782	卓胜微	5,800	3,117,500.00	0.89
34	601211	国泰君安	181,300	3,107,482.00	0.88
35	002709	天赐材料	28,200	3,005,556.00	0.85
36	300408	三环集团	70,500	2,990,610.00	0.85
37	688005	容百科技	24,419	2,959,582.80	0.84
38	600132	重庆啤酒	14,900	2,949,455.00	0.84
39	002230	科大讯飞	41,900	2,831,602.00	0.81
40	603486	科沃斯	12,400	2,828,192.00	0.80
41	600039	四川路桥	450,400	2,824,008.00	0.80
42	601838	成都银行	220,600	2,788,384.00	0.79
43	002594	比亚迪	10,900	2,735,900.00	0.78
44	300274	阳光电源	23,700	2,726,922.00	0.78
45	600660	福耀玻璃	48,400	2,703,140.00	0.77
46	002179	中航光电	34,165	2,699,718.30	0.77
47	002027	分众传媒	285,600	2,687,496.00	0.76
48	002271	东方雨虹	48,200	2,666,424.00	0.76
49	002371	北方华创	9,500	2,635,110.00	0.75
50	603799	华友钴业	22,400	2,558,080.00	0.73
51	002241	歌尔股份	58,900	2,517,386.00	0.72
52	002812	恩捷股份	10,500	2,458,050.00	0.70
53	002142	宁波银行	61,900	2,412,243.00	0.69
54	600674	川投能源	187,100	2,306,943.00	0.66
55	600779	水井坊	18,000	2,274,300.00	0.65
56	300760	迈瑞医疗	4,600	2,208,230.00	0.63
57	002311	海大集团	26,800	2,186,880.00	0.62
58	300413	芒果超媒	30,700	2,106,020.00	0.60
59	600887	伊利股份	55,900	2,058,797.00	0.59
60	002648	卫星石化	51,460	2,016,717.40	0.57
61	688036	传音控股	9,569	2,004,705.50	0.57
62	603995	甬金股份	51,700	1,987,865.00	0.57
63	300316	晶盛机电	38,800	1,959,400.00	0.56
64	300759	康龙化成	9,000	1,952,910.00	0.56
65	300529	健帆生物	22,500	1,943,100.00	0.55
66	601633	长城汽车	44,500	1,939,755.00	0.55
67	000568	泸州老窖	7,900	1,863,926.00	0.53
68	002460	赣锋锂业	15,200	1,840,568.00	0.52
69	600436	片仔癀	4,100	1,838,030.00	0.52
70	000830	鲁西化工	97,800	1,831,794.00	0.52
71	603288	海天味业	14,184	1,829,026.80	0.52
72	002920	德赛西威	16,300	1,794,304.00	0.51
73	000063	中兴通讯	51,200	1,701,376.00	0.48

74	002601	龙佰集团	49,000	1,694,420.00	0.48
75	002475	立讯精密	36,300	1,669,800.00	0.48
76	000807	云铝股份	139,800	1,663,620.00	0.47
77	603986	兆易创新	8,700	1,634,730.00	0.47
78	002568	百润股份	17,000	1,611,430.00	0.46
79	300896	爱美客	2,000	1,577,760.00	0.45
80	603882	金域医学	9,700	1,549,769.00	0.44
81	601899	紫金矿业	158,300	1,533,927.00	0.44
82	600115	中国东航	295,900	1,503,172.00	0.43
83	688200	华峰测控	3,135	1,483,889.55	0.42
84	300638	广和通	31,700	1,480,390.00	0.42
85	601021	春秋航空	25,000	1,422,500.00	0.40
86	000069	华侨城 A	186,500	1,387,560.00	0.39
87	300628	亿联网络	16,423	1,376,247.40	0.39
88	601377	兴业证券	141,800	1,369,788.00	0.39
89	000799	酒鬼酒	5,300	1,354,680.00	0.39
90	002541	鸿路钢构	23,200	1,353,720.00	0.39
91	601898	中煤能源	187,600	1,341,340.00	0.38
92	600196	复星医药	18,400	1,327,192.00	0.38
93	600989	宝丰能源	93,500	1,279,080.00	0.36
94	601155	新城控股	30,000	1,248,000.00	0.36
95	603833	欧派家居	8,511	1,208,221.56	0.34
96	300474	景嘉微	11,400	1,116,288.00	0.32
97	603806	福斯特	10,600	1,114,378.00	0.32
98	002049	紫光国微	7,200	1,110,168.00	0.32
99	601688	华泰证券	70,000	1,106,000.00	0.31
100	002245	蔚蓝锂芯	55,600	1,095,320.00	0.31
101	000625	长安汽车	41,500	1,090,620.00	0.31
102	600926	杭州银行	71,900	1,060,525.00	0.30
103	600399	抚顺特钢	57,000	1,033,980.00	0.29
104	300496	中科创达	6,500	1,020,890.00	0.29
105	002791	坚朗五金	5,200	1,009,060.00	0.29
106	688111	金山办公	2,534	1,000,423.20	0.28
107	300450	先导智能	16,500	992,310.00	0.28
108	603885	吉祥航空	64,500	984,270.00	0.28
109	600845	宝信软件	18,720	952,848.00	0.27
110	000786	北新建材	20,700	812,475.00	0.23
111	300363	博腾股份	8,900	748,668.00	0.21
112	600111	北方稀土	35,300	730,710.00	0.21
113	688202	美迪西	1,380	717,462.00	0.20
114	688083	中望软件	399	209,107.92	0.06
115	688070	纵横股份	2,407	82,969.29	0.02
116	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.02
117	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02

118	688499	利元亨	1,620	62,937.00	0.02
119	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.02
120	300919	中伟股份	342	55,746.00	0.02
121	300957	贝泰妮	202	50,895.92	0.01
122	688087	英科再生	1,802	39,571.92	0.01
123	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
124	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
125	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
126	605378	野马电池	473	21,729.62	0.01
127	300973	立高食品	177	20,480.67	0.01
128	300941	创识科技	368	18,377.92	0.01
129	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
130	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
131	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
132	301009	可靠股份	493	13,749.77	0.00
133	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
134	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
135	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
136	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
137	300968	格林精密	976	11,780.32	0.00
138	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
139	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
140	300955	嘉亨家化	229	10,550.03	0.00
141	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
142	300997	欢乐家	764	9,970.20	0.00
143	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
144	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
145	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
146	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
147	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
148	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
149	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
150	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
151	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
152	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
153	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
154	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
155	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
156	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
157	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
158	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
159	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
160	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
161	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00

162	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
163	300985	致远新能	198	4,912.38	0.00
164	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
165	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
166	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
167	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
168	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
169	300917	特发服务	84	2,323.44	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	600031	三一重工	13,962,453.00	3.27
2	000858	五粮液	12,554,999.46	2.94
3	000725	京东方 A	10,786,472.00	2.53
4	600036	招商银行	10,256,926.00	2.40
5	603259	药明康德	8,867,832.28	2.08
6	600809	山西汾酒	8,291,989.00	1.94
7	601012	隆基股份	8,248,492.80	1.93
8	002714	牧原股份	8,017,857.24	1.88
9	300750	宁德时代	7,885,966.98	1.85
10	600919	江苏银行	7,294,224.00	1.71
11	600309	万华化学	6,961,365.00	1.63
12	601211	国泰君安	6,370,570.00	1.49
13	601888	中国中免	6,360,419.00	1.49
14	002601	龙佰集团	6,336,632.92	1.49
15	601166	兴业银行	5,803,454.00	1.36
16	300347	泰格医药	5,549,868.92	1.30
17	601699	潞安环能	5,489,759.39	1.29
18	300014	亿纬锂能	5,452,440.00	1.28
19	600703	三安光电	5,433,730.00	1.27
20	601377	兴业证券	5,433,212.50	1.27

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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。

7.4.2 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	600036	招商银行	18,488,531.00	4.33
2	600031	三一重工	18,452,317.00	4.33
3	000858	五粮液	16,019,410.00	3.75
4	601318	中国平安	14,837,774.00	3.48
5	000333	美的集团	13,116,255.00	3.07
6	600276	恒瑞医药	12,531,679.26	2.94
7	002142	宁波银行	11,771,944.00	2.76
8	601012	隆基股份	11,240,630.43	2.63
9	000661	长春高新	10,954,214.28	2.57
10	600519	贵州茅台	10,717,985.00	2.51
11	002475	立讯精密	10,401,393.43	2.44
12	600309	万华化学	10,289,417.00	2.41
13	002541	鸿路钢构	10,255,532.50	2.40
14	601166	兴业银行	10,145,003.00	2.38
15	000001	平安银行	10,090,046.17	2.37
16	601888	中国中免	9,353,002.52	2.19
17	000725	京东方 A	9,280,538.00	2.18
18	002714	牧原股份	7,988,398.00	1.87
19	000002	万科 A	7,267,633.80	1.70
20	300750	宁德时代	6,653,530.00	1.56

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	599,661,933.94
卖出股票收入（成交）总额	678,270,791.73

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会（含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会）或其派出机构的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

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	107,840.12
2	应收证券清算款	593,070.68
3	应收股利	-

4	应收利息	3,019.35
5	应收申购款	232,323.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	936,253.80

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,801	98,594.12	166,907,933.24	94.00%	10,660,072.78	6.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	72,564.70	0.0409%

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	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	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 3 月 21 日）基金份额总额	237,368,420.96
本报告期期初基金份额总额	223,639,351.68
本报告期基金总申购份额	74,259,571.33
减：本报告期基金总赎回份额	120,330,916.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	177,568,006.02

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、本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管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
申万宏源	1	334,789.41	0.03%	311.80	0.03%	-

开源证券	2	82,701,185.00	6.49%	60,479.85	6.49%	-
中信证券	4	498,584,184.05	39.15%	364,616.94	39.15%	-
江海证券	1	691,821,641.27	54.33%	505,929.41	54.32%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
方正证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
广发证券	4	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	4	-	-	-	-	新增 2 个

注：1、交易单元选择标准：

（1）财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；

（2）经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

（3）具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；

（4）具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

（5）能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；

（6）能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易单元选择流程：

（1）对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

（2）协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	377,017.40	100.00%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

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	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-21
2	关于广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金调整机构投资者大额申购（含转换转入、定期定额和不定额投资）业务限额的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-02-02
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-30
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-21

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210217,20210224-20210630	47,489,151.82	-	-	47,489,151.82	26.74%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： ① 当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；							

② 在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；
③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；
④ 在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；
⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。
本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1.中国证监会注册广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2.《广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
4.《广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
5.法律意见书

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
2.网站查阅：基金管理人网址 http://www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日