

泰康沪港深精选灵活配置混合型
证券投资基金
2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。本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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现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及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
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.....	66

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泰康沪港深精选混合
基金主代码	002653
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 6 日
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	689, 513, 596. 09 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于中国大陆 A 股市场和法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，精选沪港深股票市场中的优质公司股票，力争获取超越业绩比较基准的最大化投资收益。
投资策略	<p>本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动式组合管理获得超过业绩比较基准的收益。</p> <p>大类资产配置方面，本基金综合分析宏观经济运行情况、宏观政策、股票市场与债券市场及其他替代资产市场的相对投资价值，在股票与债券等资产类别之间动态配置；根据 A 股、H 股溢价率的变化并综合市场行情，适当调整 A 股与港股的配置比例。</p> <p>股票市场投资方面，本基金在基本面研究的基础上，综合考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，对股票进行系统化、程序化筛选、排序，在一级、二级市场全面遴选优质估值水平相对合理的国内 A 股及香港股票市场交易互联互通机制下的港股投资标的股票进行重点投资。</p> <p>债券投资和流动性管理方面，本基金动态地确定并调整优先配置的资产类别和比例，并把控基金资产在流动性和收益性之间的平衡，通过现金留存、正回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*40%+恒生指数收益率*40%+中债新综合财富（总值）指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金为跨境证券投资的基

	金，主要投资于中国大陆 A 股市场和法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、流动性风险、香港市场风险等港股投资所面临的特别投资风险。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰康资产管理有限责任公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光	张燕
	联系电话	010-58753683	0755-83199084
	电子邮箱	chenwg06@taikangamc.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4001895522	95555
传真		010-57818785	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		段国圣	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰康资产管理有限责任公司	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 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 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	141,054,207.00
本期利润	83,648,583.27
加权平均基金份额本期利润	0.1187
本期加权平均净值利润率	6.37%
本期基金份额净值增长率	8.41%
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	342,797,996.53
期末可供分配基金份额利润	0.4972
期末基金资产净值	1,323,011,800.02
期末基金份额净值	1.9188
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	112.35%

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) 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) 本基金所述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。

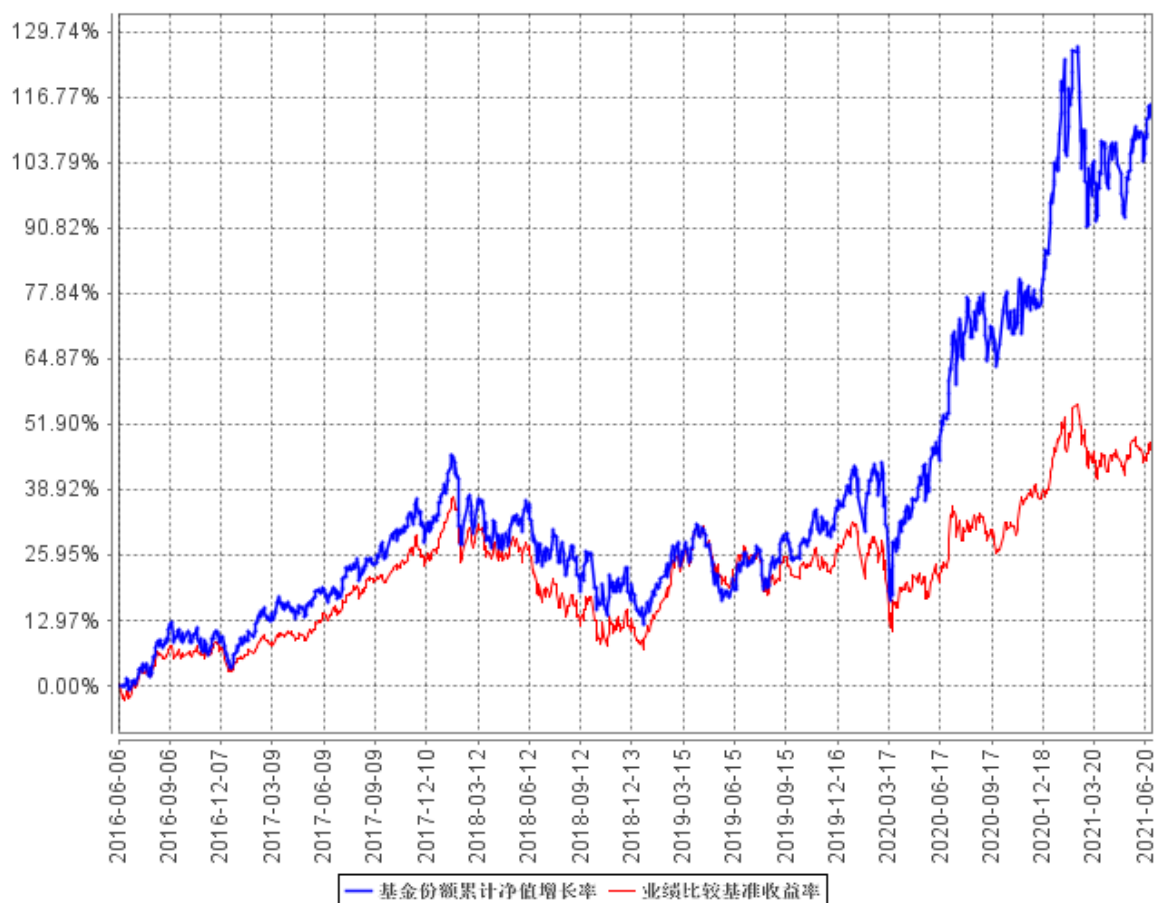
3.2 基金净值表现

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

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	1.52%	0.91%	-1.20%	0.57%	2.72%	0.34%
过去三个月	5.38%	1.10%	2.35%	0.67%	3.03%	0.43%
过去六个月	8.41%	1.67%	3.11%	0.90%	5.30%	0.77%
过去一年	37.84%	1.60%	18.31%	0.88%	19.53%	0.72%
过去三年	65.47%	1.38%	22.34%	0.96%	43.13%	0.42%
自基金合同生效起至今	112.35%	1.20%	47.01%	0.84%	65.34%	0.36%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 06 月 06 日生效。

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金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

泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）成立于 2006 年，前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外公开市场投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等，所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII 专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至 2020 年 12 月 31 日，泰康资产管理资产总规模超过 22000 亿元。除管理泰康保险集团委托的资金外，泰康资产受托管理的第三方资产总规模突破 12000 亿元，另类投资管理规模超过 4400 亿元，退休金管理规模超过 5200 亿元，其中企业年金管理规模超过 3400 亿元。

2015 年 4 月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。截至 2021 年 6 月 30 日，公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金、泰康均衡优选混合型证券投资基金、泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金、泰康颐年混合型证券投资基金、泰康颐享混合型证券投资基金、泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金、泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金、泰康产业升级混合型证券投资基金、泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康信用精选债券型证券投资基金、泰康安欣纯债债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交

易型开放式指数证券投资基金、泰康润和两年定期开放债券型证券投资基金、泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金、泰康瑞丰纯债 3 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康长江经济带债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰康申润一年持有期混合型证券投资基金、泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康蓝筹优势一年持有期股票型证券投资基金、泰康创新成长混合型证券投资基金、泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、泰康优势企业混合型证券投资基金、泰康品质生活混合型证券投资基金、泰康合润混合型证券投资基金、泰康福泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、泰康浩泽混合型证券投资基金、泰康安泽中短债债券型证券投资基金、泰康福泽积极养老目标五年持有期混合型基金中基金 (FOF) 共 56 只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘伟	本基金基金经理	2017 年 5 月 4 日	-	10	刘伟于 2011 年 6 月加入泰康资产，历任风险控制部风险管理研究员、高级经理，公募事业部投资部金融工程研究员、基金经理助理。现任公募事业部投资部量化投资总监。2017 年 5 月 4 日至今担任泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 29 日至今担任泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金基金经理。2018 年 2 月 6 日至今担任泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金基金经理。2018 年 12 月 21 日至今担任泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 1 月 29 日至今担任泰康中证港股通地产指数型发起式

					<p>证券投资基金基金经理。2019年4月3日至今担任泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019年4月9日至今担任泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019年4月16日至今担任泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金基金经理。</p>
黄成扬	本基金基金经理	2017年11月21日	-	14	<p>黄成扬于2017年7月加入泰康资产管理有限责任公司，现担任公募事业部投资部股票投资总监。2007年7月至2008年12月在金捷基金担任研究部研究员，2009年1月至2012年2月在恒星资产管理公司担任研究部研究员，2012年2月至2017年7月在长盛基金国际业务部历任高级研究员、专户投资经理、基金经理。2015年7月21日至2017年7月14日担任长盛环球景气行业大盘精选证券投资基金基金经理。2017年11月21日至今担任泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年12月21日至2021年4月12日担任泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019年1月29日至2021年4月12日担任泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金基金经理。2019年4月3日至2021年4</p>

					月 12 日担任泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 9 日至 2021 年 4 月 12 日担任泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 16 日至 2021 年 4 月 12 日担任泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：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。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

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《证券法》、《证券投资基金法》、本基金合同和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

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

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行证监会《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制度，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。在投资管理活动中，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金所有投资组合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 5% 的情况。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

宏观经济方面，2021 年上半年经济延续复苏的格局，并呈现出稳中加固的态势。1 季度，各项经济数据在低基数的影响下表现较强，如果与 19 年相比，则出口延续了高景气度，房地产投资韧性较强，消费在冬季疫情的影响下有一定波折，3 月的 PMI 数据显示制造业或有所好转，货币政策保持相对稳定，实体经济的融资需求延续强劲，大宗商品价格在国际疫情恢复、全球复苏预期的带动下有较为明显的上行，通胀预期发酵，PPI 上行较快，CPI 保持稳定，人民币受到美元阶段性走强的影响，从升值转为震荡。2 季度，各项经济指标同比数据，由于基数效应而有所下滑，如果同 2019 年相比，则呈现出较为平稳的走势。经济内部延续了结构分化的特征，出口延续了较高景气，但零售的恢复力度仍然偏弱。投资内部也有所分化，制造业处于缓慢恢复中，上游价格带来的利润挤压仍需关注；地产的韧性较强，但基建由于政府投资意愿偏弱，而表现较为一般。在供给约束下，PPI 表现很强，但 CPI 由于需求偏平稳，向上的压力不大。融资需求受到表外多重因素的制约，增速有所走低。

港股今年以来波动较大，年初由于疫情结束后经济继续修复的预期支撑，伴随 A 股流动性的外溢，港股有一波急速上涨的行情；但春节过后，伴随着美国十年期国债利率大涨，投资者担心全球通胀的快速上涨以及后续的流动性紧缩，港股伴随 A 股迎来一波急速的调整，尤其是估值较高的成长股。进入二季度以后，投资者发现国内宏观环境实际平稳，同时流动性也相对宽松，仓位又重新回到成长性资产，偏防御的金融和食品饮料则逐渐遭到减持；但港股相对具备成长性的互联网板块由于反垄断调查的不断深入，表现受到较大的压制，尤其国家对于 K12 课后培训的规管，进一步引发了投资者对于诸多民生相关板块的担忧，港股有较大的跌幅。所幸，监管有诸如关于营造适合企业经营环境等的表述，给予了投资者一定的信心。

在具体操作上，1 季度，我们没能及时评估美国利率抬升对于股票定价的影响，但从中长期而言，我们对持仓的大部分股票仍然保持信心，特别在回调之后的估值并没有超出合理区间，我们认为仍有可能面临全球实际利率的提升，从而需要不断平衡组合的结构和仓位。2 季度，我们继续关注偏消费和医疗服务的行业，以及偏科技成长的行业，但同时也格外注意评估和防范互联网反垄断对于重点港股公司的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康沪港深精选基金份额净值为 1.9188 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.41%；同期业绩比较基准增长率为 3.11%。

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，经济可能保持相对平稳的格局，总量上变化不会很大，结构上的特点更为突出。总量方面，建筑业可能面临一定的下行压力，但总体可控，有望在政策逆周期调节、以及结构性宽松的支持下所对冲，总体波动不大。结构方面，制造业成本的压制难以消退，消费和服务业面临疫情的负面影响也很难消除，可能都会呈现出在波折中缓慢恢复的局面。政策方面的结构性特征将更为显著，对地产和平台的结构性紧信用持续，但对制造业、小微企业、绿色金融等相关的宽信用加大，货币政策也致力于缓解经济的结构性问题，总体基调是在稳健中注重结构性，保持流动性合理充裕。

投资方面，下半年，我们认为全球的宏观经济仍然大体平稳，但我们仍需要在自己的投资框架中加入政策考量的因素，寻找一些监管相对免疫或者鼓励的方向，比如广义的制造板块。同时，我们仍然坚持价值导向，自下而上的评估行业和公司的机会，尤其在消费、医疗以及创新领域寻找布局的机会，力争把握机会、规避风险，为基金持有人取得较好回报。

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，设有公募估值小组，并制定了相关制度及流程。公司公募估值小组设成员若干名，成员由公募各相关部门组成，包括风险控制部、运营管理部、投资部、监察稽核部等。公募估值小组成员均具有相关工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间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。

与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，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基金业协会等。

本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期本基金未进行利润分配。

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

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：泰康沪港深精选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	20,170,873.45	9,190,121.52
结算备付金		17,177,496.35	6,161,747.19
存出保证金		676,098.85	8,738,003.27
交易性金融资产	6.4.7.2	1,216,564,538.94	1,066,508,686.48
其中：股票投资		1,138,545,535.74	1,004,173,649.38
基金投资		-	-
债券投资		78,019,003.20	62,335,037.10
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	80,000,000.00	-
应收证券清算款		17,436,707.96	18,009,318.39
应收利息	6.4.7.5	768,125.36	644,468.74
应收股利		2,066,767.28	-
应收申购款		72,279.40	248,359.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,354,932,887.59	1,109,500,704.89
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		-	26,799,851.80
应付证券清算款		-	1,001,976.04
应付赎回款		29,230,323.77	233,675.13
应付管理人报酬		1,660,687.04	1,265,659.02
应付托管费		221,424.93	168,754.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	427,403.25	431,119.85
应交税费		201,837.19	201,844.98

应付利息		-	6,951.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	179,411.39	74,049.15
负债合计		31,921,087.57	30,183,881.70
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	689,513,596.09	609,816,537.69
未分配利润	6.4.7.10	633,498,203.93	469,500,285.50
所有者权益合计		1,323,011,800.02	1,079,316,823.19
负债和所有者权益总计		1,354,932,887.59	1,109,500,704.89

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.9188 元，基金份额总额 689,513,596.09 份。

6.2 利润表

会计主体：泰康沪港深精选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		98,647,255.06	117,011,412.44
1.利息收入		1,313,727.27	1,023,535.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	198,226.49	155,647.01
债券利息收入		677,940.49	699,548.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		437,560.29	168,339.52
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		154,571,631.61	42,079,162.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	145,761,881.96	34,180,983.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	624,370.90	331,118.03
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	155,650.48
股利收益	6.4.7.16	8,185,378.75	7,411,410.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-57,405,623.73	73,706,728.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	167,519.91	201,986.80
减：二、费用		14,998,671.79	10,109,050.37

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,799,096.14	6,789,069.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,306,546.10	905,209.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,716,917.21	2,290,500.74
5. 利息支出		35,525.73	-
其中：卖出回购金融资产支出		35,525.73	-
6. 税金及附加		36.44	597.21
7. 其他费用	6.4.7.20	140,550.17	123,673.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		83,648,583.27	106,902,362.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		83,648,583.27	106,902,362.07

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康沪港深精选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）	609,816,537.69	469,500,285.50	1,079,316,823.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	83,648,583.27	83,648,583.27
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）	79,697,058.40	80,349,335.16	160,046,393.56
其中：1.基金申购款	144,800,081.05	136,476,619.94	281,276,700.99
2.基金赎回款	-65,103,022.65	-56,127,284.78	-121,230,307.43
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）	689,513,596.09	633,498,203.93	1,323,011,800.02

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)	761,435,645.69	186,863,394.12	948,299,039.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	106,902,362.07	106,902,362.07
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)	-57,557,433.15	-17,837,263.10	-75,394,696.25
其中：1.基金申购款	41,320,556.87	8,303,518.35	49,624,075.22
2.基金赎回款	-98,877,990.02	-26,140,781.45	-125,018,771.47
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)	703,878,212.54	275,928,493.09	979,806,705.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>段国圣</u>	<u>金志刚</u>	<u>李俊佑</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康沪港深精选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[2016]第 661 号《关于准予泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康沪港深精选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 376,519,240.61 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(2016)第 574 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 376,540,794.43 份

基金份额，其中认购资金利息折合 21,553.82 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康资产管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康沪港深精选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、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券等固定收益类金融工具(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公开发行公司债券、非公开发行公司债券、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购等)、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款、同业存单和其他银行存款)、货币市场工具、权证、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%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通投资标的股票的比例占基金资产的 0-95%)；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40%+恒生指数收益率×40%+中债新综合财富(总值)指数收益率×20%。

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》、《泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间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 重要会计政策和会计估计

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

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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	20,170,873.45
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：	20,170,873.45

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	911,230,651.96	1,138,545,535.74	227,314,883.78

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	37,370,987.40	37,779,003.20	408,015.80
	银行间市场	40,248,160.00	40,240,000.00	-8,160.00
	合计	77,619,147.40	78,019,003.20	399,855.80
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		988,849,799.36	1,216,564,538.94	227,714,739.58

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金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	80,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	80,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有因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	3,380.51
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	7,719.21
应收债券利息	756,746.17
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	0.83
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	278.64

合计	768,125.36
----	------------

6.4.7.6 其他资产

本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	427,153.25
银行间市场应付交易费用	250.00
合计	427,403.25

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	68,752.74
应付证券出借违约金	-
预提费用	110,658.65
合计	179,411.39

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	609,816,537.69	609,816,537.69
本期申购	144,800,081.05	144,800,081.05
本期赎回(以“-”号填列)	-65,103,022.65	-65,103,022.65
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	689,513,596.09	689,513,596.09

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

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	175,832,606.41	293,667,679.09	469,500,285.50
本期利润	141,054,207.00	-57,405,623.73	83,648,583.27
本期基金份额交易产生的变动数	25,911,183.12	54,438,152.04	80,349,335.16
其中：基金申购款	55,557,207.07	80,919,412.87	136,476,619.94
基金赎回款	-29,646,023.95	-26,481,260.83	-56,127,284.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	342,797,996.53	290,700,207.40	633,498,203.93

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	63,662.32
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	112,468.03
其他	22,096.14
合计	198,226.49

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,540,487,607.92
减：卖出股票成本总额	1,394,725,725.96
买卖股票差价收入	145,761,881.96

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	624,370.90
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	624,370.90

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	54,230,651.48
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	52,826,786.33
减：应收利息总额	779,494.25
买卖债券差价收入	624,370.90

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期，本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,185,378.75
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	8,185,378.75

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-57,405,623.73
——股票投资	-56,964,016.16
——债券投资	-441,607.57
——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	-57,405,623.73

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	167,519.91
合计	167,519.91

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% 计入基金财产。

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，其中申购费补差收取具体情况，视每次转换时的两只基金的费率差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	3,716,667.21
银行间市场交易费用	250.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	3,716,917.21

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	42,151.28
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	600.00
债券帐户维护费	18,000.00
银行费用	20,291.52
合计	140,550.17

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

本基金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 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东

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

本报告期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

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	9,799,096.14	6,789,069.56
其中：支付销售机构的客户维护费	148,424.76	86,829.34

注：支付基金管理人泰康资产管理有限责任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 X 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	1,306,546.10		905,209.28	

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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 × 0.2% / 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

本报告期及上年度可比期间，本基金未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**

本报告期及上年度可比期间，本基金未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

本报告期及上年度可比期间，本基金未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**

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，本基金管理人之外的其他关联方未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	20,170,873.45	63,662.32	37,173,970.38	56,642.76

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金无利润分配。

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
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	网下新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定期流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	网下新股流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	网下新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	网下新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688131	皓元医药	2021年6月1日	2021年12月8日	新股锁定期流通受限	64.99	247.10	1,955	127,055.45	483,080.50	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定期流通受限	47.33	251.96	829	39,236.57	208,874.84	-
688601	力芯微	2021年6月18日	2021年12月	新股锁定期流	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-

		日	月 28 日	通受限							
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁 定期流 通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-	
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定期流 通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-	
688659	元琛科技	2021 年 3 月 24 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁 定期流 通受限	6.50	10.46	3,671	23,861.50	38,398.66	-	
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁 定期流 通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-	
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁 定期流 通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-	
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股锁 定期流 通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-	
301013	C 利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股锁 定期流 通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-	
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁 定期流 通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-	
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁 定期流 通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-	
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁 定期流 通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-	
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股锁 定期流 通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-	
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁 定期流 通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-	

300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定期流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定期流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定期流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定期流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定期流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定期流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定期流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定期流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定期流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定期流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定期流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定期流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月	新股锁定期流	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-

		日	月 11 日	通受限							
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁 定期流 通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-	
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁 定期流 通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-	
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股锁 定期流 通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-	
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股锁 定期流 通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-	
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁 定期流 通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-	
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股锁 定期流 通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-	

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金可作为特定投资者，所认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内

不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。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》，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。

4、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》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5、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。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，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申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6. 截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

7. 根据冠中生态 2020 年年度权益分派实施公告，以方案实施前的公司总股本 93,340,000.00 股为基数，向全体股东每股派发现金红利 0.08 元（含税），每股派送红股 0.50 股。除权除息日为 2021 年 6 月 4 日，本基金所持有的处于流通受限的冠中生态获得转增股 108 股。

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，本基金未持有在银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质

押的债券。

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，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、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精选优质投资标的，在有效控制风险前提下保持一定流动性，力求超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

为加强公募基金管理的内部控制，促进诚信、合法、有效经营的内部控制环境，保障基金持有人利益，基金管理人遵照国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制订了系统完善的内部控制制度。内部控制的主要内容包括投资管理业务控制、市场营销与过户登记业务控制、信息披露控制、监察稽核控制等。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，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	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

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	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.4 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	8,589,124.80	8,859,331.20
AAA 以下	1,689,878.40	2,146,854.90
未评级	0.00	0.00
合计	10,279,003.20	11,006,186.10

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

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，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他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，因此账面余额约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期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%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未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。于 2021

年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 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未来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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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。

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	20,170,873.45	-	-	-	20,170,873.45
结算备付金	17,177,496.35	-	-	-	17,177,496.35
存出保证金	676,098.85	-	-	-	676,098.85
交易性金融资产	67,740,000.00	10,279,003.20	-	1,138,545,535.74	1,216,564,538.94
买入返售金融资产	80,000,000.00	-	-	-	80,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	17,436,707.96	17,436,707.96

应收利息	-	-	-	768,125.36	768,125.36
应收股利	-	-	-	2,066,767.28	2,066,767.28
应收申购款	994.04	-	-	71,285.36	72,279.40
资产总计	185,765,462.69	10,279,003.20	-	1,158,888,421.70	1,354,932,887.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	29,230,323.77	29,230,323.77
应付管理人报酬	-	-	-	1,660,687.04	1,660,687.04
应付托管费	-	-	-	221,424.93	221,424.93
应付交易费用	-	-	-	427,403.25	427,403.25
应交税费	-	-	-	201,837.19	201,837.19
其他负债	-	-	-	179,411.39	179,411.39
负债总计	-	-	-	31,921,087.57	31,921,087.57
利率敏感度缺口	185,765,462.69	10,279,003.20	-	1,126,967,334.13	1,323,011,800.02
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	9,190,121.52	-	-	-	9,190,121.52
结算备付金	6,161,747.19	-	-	-	6,161,747.19
存出保证金	8,738,003.27	-	-	-	8,738,003.27
交易性金融资产	51,328,851.00	10,825,192.30	180,993.80	1,004,173,649.38	1,066,508,686.48
应收证券清算款	-	-	-	18,009,318.39	18,009,318.39
应收利息	-	-	-	644,468.74	644,468.74
应收申购款	41,749.51	-	-	206,609.79	248,359.30
资产总计	75,460,472.49	10,825,192.30	180,993.80	1,023,034,046.30	1,109,500,704.89
负债					
卖出回购金融资产款	26,799,851.80	-	-	-	26,799,851.80
应付证券清算款	-	-	-	1,001,976.04	1,001,976.04
应付赎回款	-	-	-	233,675.13	233,675.13
应付管理人报酬	-	-	-	1,265,659.02	1,265,659.02
应付托管费	-	-	-	168,754.56	168,754.56
应付交易费用	-	-	-	431,119.85	431,119.85
应付利息	-	-	-	6,951.17	6,951.17
应交税费	-	-	-	201,844.98	201,844.98
其他负债	-	-	-	74,049.15	74,049.15
负债总计	26,799,851.80	-	-	3,384,029.90	30,183,881.70
利率敏感度缺口	48,660,620.69	10,825,192.30	180,993.80	1,019,650,016.40	1,079,316,823.19

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	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响
----	--

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下调 0.25%	154,760.82	122,810.84
	市场利率上调 0.25%	-153,758.47	-121,809.89

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 906,257,663.38 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 906,257,663.38 元（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 841,366,008.12 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 841,366,008.12 元）。

假设其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的股票公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响。若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 9,062,576.63 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-9,062,576.63 元（于 2020 年 12 月 31 日，若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 8,413,660.08 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-8,413,660.08 元）。

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。

本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动组合管理获得超过业绩比较基准的收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0-95%；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债

券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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	1,138,545,535.74	86.06	1,004,173,649.38	93.04
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,138,545,535.74	86.06	1,004,173,649.38	93.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的权益指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准中的权益指数上涨 5%	73,451,276.12	51,156,291.26
业绩比较基准中的权益指数下降 5%	-73,451,276.12	-51,156,291.26	

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 1,140,056,879.86 元，属于第二层次的余额为 76,507,659.08 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 1,006,755,977.38 元，第二层次 59,752,709.10 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

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	1,138,545,535.74	84.03
	其中：股票	1,138,545,535.74	84.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	78,019,003.20	5.76
	其中：债券	78,019,003.20	5.76
	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	80,000,000.00	5.90
	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	37,348,369.80	2.76
8	其他各项资产	21,019,978.85	1.55
9	合计	1,354,932,887.59	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 906,257,663.38 元，占期末资产净值比例为 68.50%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	199,622,717.73	15.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	3,368,014.44	0.25
F	批发和零售业	28,465.12	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,226.27	0.00
J	金融业	14,062,713.03	1.06
K	房地产业	119,592.00	0.01
L	租赁和商务服务业	14,494,314.27	1.10

M	科学研究和技术服务业	483,080.50	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.00
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	232,287,872.36	17.56

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	23,192,937.38	1.75
B 消费者非必需品	242,076,175.01	18.30
C 消费者常用品	79,086,573.50	5.98
D 能源	5,412.57	0.00
E 金融	94,858,238.90	7.17
F 医疗保健	131,583,369.84	9.95
G 工业	26,976,986.31	2.04
H 信息技术	124,963,318.44	9.45
I 电信服务	105,008,687.57	7.94
J 公用事业	5,559,562.50	0.42
K 房地产	72,946,401.36	5.51
合计	906,257,663.38	68.50

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	02333	长城汽车	3,940,186	82,310,485.54	6.22
2	00700	腾讯控股	159,977	77,737,623.61	5.88
3	03690	美团-W	202,000	53,853,200.00	4.07
4	06098	碧桂园服务	760,000	53,055,600.00	4.01
5	02269	药明生物	392,000	46,412,800.00	3.51
6	02319	蒙牛乳业	1,180,050	46,104,553.50	3.48
7	06169	宇华教育	7,000,000	40,950,000.00	3.10
8	00939	建设银行	6,300,000	32,004,000.00	2.42
9	02013	微盟集团	2,220,000	31,635,000.00	2.39
10	00966	中国太平	2,500,000	26,875,000.00	2.03
11	00285	比亚迪电子	600,000	25,464,000.00	1.92

12	03888	金山软件	630,000	24,399,900.00	1.84
13	00291	华润啤酒	388,000	22,519,520.00	1.70
14	000739	普洛药业	720,000	21,168,000.00	1.60
15	600519	贵州茅台	9,000	18,510,300.00	1.40
16	00826	天工国际	6,500,000	17,875,000.00	1.35
17	02020	安踏体育	112,634	17,131,631.40	1.29
18	01299	友邦保险	210,000	16,863,000.00	1.27
19	01765	希望教育	10,000,000	15,600,000.00	1.18
20	02869	绿城服务	1,500,000	15,045,000.00	1.14
21	00512	远大医药	2,480,000	14,979,200.00	1.13
22	00941	中国移动	368,000	14,867,200.00	1.12
23	002010	传化智联	1,879,937	14,494,314.27	1.10
24	002142	宁波银行	359,969	14,027,991.93	1.06
25	00522	ASM PACIFIC	160,000	14,004,800.00	1.06
26	03908	中金公司	780,000	13,564,200.00	1.03
27	01801	信达生物	180,000	13,561,200.00	1.03
28	000858	五粮液	45,000	13,405,050.00	1.01
29	01873	维亚生物	1,600,000	13,232,000.00	1.00
30	02313	申洲国际	80,016	13,056,210.72	0.99
31	300151	昌红科技	419,950	11,313,453.00	0.86
32	01066	威高股份	719,283	10,846,787.64	0.82
33	06078	海吉亚医疗	125,000	10,608,750.00	0.80
34	01458	周黑鸭	1,350,000	10,462,500.00	0.79
35	01951	锦欣生殖	640,000	10,438,400.00	0.79
36	01448	福寿园	1,600,000	10,096,000.00	0.76
37	06049	保利物业	225,200	9,875,020.00	0.75
38	00354	中国软件国际	810,000	9,541,800.00	0.72
39	01896	猫眼娱乐	910,000	9,254,700.00	0.70
40	00853	微创医疗	144,000	8,344,800.00	0.63
41	300850	新强联	89,940	7,886,838.60	0.60
42	600426	华鲁恒升	250,000	7,737,500.00	0.58
43	300470	中密控股	199,980	7,727,227.20	0.58
44	01888	建滔积层板	500,000	7,245,000.00	0.55
45	01755	新城悦服务	368,000	7,227,520.00	0.55
46	603906	龙蟠科技	199,880	6,995,800.00	0.53
47	601636	旗滨集团	360,000	6,681,600.00	0.51
48	00868	信义玻璃	250,000	6,585,000.00	0.50
49	00177	江苏宁沪高	900,818	6,584,979.58	0.50

		速公路			
50	688116	天奈科技	55,000	6,490,000.00	0.49
51	00763	中兴通讯	320,000	6,457,600.00	0.49
52	002043	兔宝宝	650,000	6,409,000.00	0.48
53	603185	上机数控	35,000	6,263,250.00	0.47
54	301002	崧盛股份	70,000	5,733,000.00	0.43
55	002304	洋河股份	27,000	5,594,400.00	0.42
56	02688	新奥能源	45,090	5,545,168.20	0.42
57	03877	中国船舶租 赁	4,500,000	5,535,000.00	0.42
58	00268	金蝶国际	250,000	5,482,500.00	0.41
59	03323	中国建材	700,000	5,313,000.00	0.40
60	03311	中国建筑国 际	1,202,518	5,303,104.38	0.40
61	600521	华海药业	250,000	5,220,000.00	0.39
62	300073	当升科技	90,000	5,057,100.00	0.38
63	002026	山东威达	359,959	4,917,039.94	0.37
64	603277	银都股份	200,000	4,650,000.00	0.35
65	002984	森麒麟	120,000	4,374,000.00	0.33
66	605186	健麾信息	119,931	4,111,234.68	0.31
67	603113	金能科技	225,000	4,063,500.00	0.31
68	002539	云图控股	450,000	3,928,500.00	0.30
69	601567	三星医疗	183,700	3,912,810.00	0.30
70	300122	智飞生物	20,000	3,734,600.00	0.28
71	603355	莱克电气	60,000	3,733,800.00	0.28
72	603995	甬金股份	90,000	3,460,500.00	0.26
73	300119	瑞普生物	99,938	3,379,903.16	0.26
74	300982	苏文电能	60,000	3,357,000.00	0.25
75	600031	三一重工	110,000	3,197,700.00	0.24
76	603155	新亚强	70,000	3,184,300.00	0.24
77	01981	华夏视听教 育	700,000	3,143,000.00	0.24
78	01515	华润医疗	400,000	3,140,000.00	0.24
79	601100	恒立液压	36,000	3,093,120.00	0.23
80	02669	中海物业	400,000	2,764,000.00	0.21
81	603180	金牌厨柜	50,072	2,387,933.68	0.18
82	01478	丘钛科技	160,000	2,120,000.00	0.16
83	00148	建滔集团	20,000	717,200.00	0.05
84	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.04

85	00425	敏实集团	12,000	368,400.00	0.03
86	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.02
87	300957	贝泰妮	829	208,874.84	0.02
88	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.01
89	600817	宏盛科技	8,800	119,592.00	0.01
90	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
91	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
92	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
93	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
94	300894	火星号	628	42,704.00	0.00
95	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
96	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.00
97	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
98	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
99	00688	中国海外发展	1,534	22,519.12	0.00
100	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
101	00144	招商局港口	1,811	17,095.84	0.00
102	02382	舜宇光学科技	76	15,518.44	0.00
103	03898	中车时代电气	380	14,512.20	0.00
104	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
105	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
106	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
107	301013	C利和兴	471	12,768.81	0.00
108	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
109	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
110	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
111	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
112	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
113	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
114	00867	康哲药业	618	10,518.36	0.00
115	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
116	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
117	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
118	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
119	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
120	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00

121	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
122	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
123	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
124	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
125	00270	粤海投资	868	8,063.72	0.00
126	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
127	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
128	00165	中国光大控 股	955	7,267.55	0.00
129	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
130	02628	中国人寿	539	6,904.59	0.00
131	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
132	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
133	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
134	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
135	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
136	02607	上海医药	392	5,531.12	0.00
137	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
138	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
139	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
140	00857	中国石油股 份	1,449	4,564.35	0.00
141	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
142	01055	中国南方航 空股份	950	3,809.50	0.00
143	00694	北京首都机 场股份	845	3,625.05	0.00
144	01114	BRILLIANCE CHI	578	3,508.46	0.00
145	01099	国药控股	176	3,382.72	0.00
146	00902	华能国际电 力股份	1,266	3,202.98	0.00
147	01060	阿里影业	3,520	3,168.00	0.00
148	00728	中国电信	1,238	2,995.96	0.00
149	00358	江西铜业股 份	219	2,897.37	0.00
150	002773	康弘药业	120	2,775.60	0.00
151	00656	复星国际	298	2,771.40	0.00
152	00338	上海石油化 工股份	1,351	2,040.01	0.00

153	00384	中国燃气	97	1,912.84	0.00
154	01211	比亚迪股份	9	1,738.89	0.00
155	01109	华润置地	64	1,674.88	0.00
156	01988	民生银行	400	1,240.00	0.00
157	00392	北京控股	53	1,214.76	0.00
158	03988	中国银行	475	1,102.00	0.00
159	00257	光大环境	286	1,046.76	0.00
160	01766	中国中车	330	940.50	0.00
161	01088	中国神华	67	848.22	0.00
162	01359	中国信达	337	414.51	0.00
163	01336	新华保险	5	110.25	0.00
164	00390	中国中铁	30	101.10	0.00
165	03333	中国恒大	8	67.36	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	02319	蒙牛乳业	45,228,972.79	4.19
2	02333	长城汽车	27,549,556.49	2.55
3	00939	建设银行	26,174,071.21	2.43
4	00941	中国移动	26,068,076.15	2.42
5	002010	传化智联	24,255,763.14	2.25
6	06169	宇华教育	24,127,226.99	2.24
7	03690	美团-W	21,785,649.15	2.02
8	00826	天工国际	21,527,120.57	1.99
9	00966	中国太平	21,152,345.04	1.96
10	000739	普洛药业	20,561,698.30	1.91
11	01299	友邦保险	19,950,448.29	1.85
12	00291	华润啤酒	19,445,084.78	1.80
13	01888	建滔积层板	19,047,827.76	1.76
14	00883	中国海洋石油	18,184,489.14	1.68
15	002304	洋河股份	17,366,385.00	1.61
16	02318	中国平安	17,163,862.06	1.59

17	01066	威高股份	15,853,744.38	1.47
18	00285	比亚迪电子	15,330,732.62	1.42
19	00868	信义玻璃	14,518,113.80	1.35
20	01478	丘钛科技	14,181,473.64	1.31

注：（1）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。

（2）“买入金额”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	02318	中国平安	43,533,259.87	4.03
2	02333	长城汽车	41,305,224.65	3.83
3	02331	李宁	30,904,412.80	2.86
4	01066	威高股份	27,868,987.32	2.58
5	00968	信义光能	25,770,193.08	2.39
6	00868	信义玻璃	25,268,560.61	2.34
7	00268	金蝶国际	23,062,068.25	2.14
8	600031	三一重工	20,317,573.84	1.88
9	00883	中国海洋石油	20,066,591.18	1.86
10	00939	建设银行	18,821,349.36	1.74
11	03690	美团-W	17,883,387.06	1.66
12	00027	银河娱乐	17,548,663.51	1.63
13	06862	海底捞	17,424,606.70	1.61
14	02013	微盟集团	17,319,533.38	1.60
15	01888	建滔积层板	16,795,539.04	1.56
16	603997	继峰股份	16,503,327.37	1.53
17	688536	思瑞浦	16,194,257.80	1.50
18	03669	永达汽车	14,574,646.29	1.35
19	06169	宇华教育	14,522,892.81	1.35
20	03888	金山软件	14,356,091.49	1.33

注：（1）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。

（2）“卖出金额”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。

7.4.3 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	1,586,061,628.48
卖出股票收入（成交）总额	1,540,487,607.92

注：（1）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。

（2）“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	27,500,000.00	2.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,240,000.00	3.04
	其中：政策性金融债	40,240,000.00	3.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,279,003.20	0.78
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	78,019,003.20	5.90

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	190207	19 国开 07	400,000	40,240,000.00	3.04
2	019640	20 国债 10	275,000	27,500,000.00	2.08
3	113011	光大转债	41,410	4,786,167.80	0.36
4	128035	大族转债	15,000	1,659,000.00	0.13
5	110053	苏银转债	11,690	1,418,698.40	0.11

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

中国建设银行股份有限公司因内控管理不到位等原因在本报告编制前一年内受到中国银保监会的行政处罚,因占压财政存款或者资金等行为在本报告编制前一年内受到中国人民银行的行政处罚。

国家开发银行因为违规的政府购买服务项目提供融资等原因在本报告编制前一年内受到中国银保监会的行政处罚。

基金投资上述主体相关证券的决策流程符合公司投资制度的规定。

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体除上述主体收到监管部门处罚决定书或行政监管措施决定书外,其他发行主体未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	676,098.85
2	应收证券清算款	17,436,707.96
3	应收股利	2,066,767.28
4	应收利息	768,125.36
5	应收申购款	72,279.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,019,978.85

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	113011	光大转债	4,786,167.80	0.36
2	128035	大族转债	1,659,000.00	0.13
3	110053	苏银转债	1,418,698.40	0.11
4	110059	浦发转债	1,251,694.60	0.09
5	132022	20 广版 EB	300,810.00	0.02
6	110062	烽火转债	187,299.20	0.01
7	113030	东风转债	30,878.40	0.00

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未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 1、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。
- 2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

§ 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
2,702	255,186.38	643,226,519.92	93.29%	46,287,076.17	6.71%

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	541,353.18	0.0785%

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	10~50
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（2016年6月6日）基金份额总额	376,540,794.43
本报告期期初基金份额总额	609,816,537.69
本报告期基金总申购份额	144,800,081.05
减：本报告期基金总赎回份额	65,103,022.65
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	689,513,596.09

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

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

本报告期本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

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

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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	
国盛证券	2	943,323,728.66	30.23%	270,207.83	30.17%	-
兴业证券	2	568,076,488.65	18.21%	164,981.06	18.42%	-

中信证券	2	564,969,748.66	18.11%	161,481.22	18.03%	-
东方证券	2	359,104,074.33	11.51%	102,288.80	11.42%	-
光大证券	4	353,276,160.51	11.32%	100,369.91	11.21%	-
国信证券	2	279,785,188.21	8.97%	81,393.34	9.09%	-
东吴证券	2	51,514,441.50	1.65%	14,863.78	1.66%	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

交易单元租用券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，包括但不限于满足以下条件：

- （1）经营行为规范，近一年内无重大违规行为，未受监管机构重大处罚；
- （2）财务状况和经营状况良好；
- （3）内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；
- （4）有较强的研究能力，能提供质量较高的市场研究报告，并能根据基金投资需求提供专门的研究报告；
- （5）能及时提供准确的信息资讯服务；
- （6）满足基金运作的保密要求；
- （7）符合中国证监会规定的其他条件。

本基金管理人依据以上标准，定期或者不定期对候选券商研究实力和服务质量进行评估，确定租用交易单元的券商，基金管理人与被选择的券商签订相关协议并通知托管行。

3、本报告期内本基金新增租用 4 个交易单元，分别为开源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国盛证券	1,306,851.08	4.43%	2,114,000,000.00	40.23%	-	-
兴业证券	17,023,800.00	57.75%	493,000,000.00	9.38%	-	-
中信证券	10,492,800.00	35.59%	436,500,000.00	8.31%	-	-
东方证券	167,258.80	0.57%	687,000,000.00	13.07%	-	-
光大证券	206,138.10	0.70%	1,246,000,000.00	23.71%	-	-
国信证券	281,878.50	0.96%	205,000,000.00	3.90%	-	-
东吴证券	-	-	73,000,000.00	1.39%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

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	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年非港股通交易日不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 1 月 1 日
2	关于直销电子交易平台开展汇款交易；赎回转认购业务费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；	2021 年 1 月 21 日

		中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
3	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增招商银行招赢通为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 1 月 22 日
4	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加北京度小满基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 1 月 22 日
5	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 1 月 29 日
6	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“春节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 2 月 5 日
7	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 2 月 8 日
8	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增招商银行招赢通为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 3 月 2 日
9	关于泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金新增安信证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 3 月 3 日
10	关于泰康资产管理有限责任公司	《中国证券报》;《上	2021 年 3 月 12 日

	旗下部分开放式基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
11	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增北京度小满基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 3 月 16 日
12	泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下部分开放式基金在珠海盈米基金销售有限公司最低申购金额；追加申购最低金额；赎回最低份额和持有最低限额的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 3 月 19 日
13	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“香港耶稣受难节；清明节；香港复活节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 3 月 31 日
14	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增光大证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 4 月 26 日
15	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“劳动节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 4 月 27 日
16	泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下部分开放式基金在济安财富（北京）基金销售有限公司最低申购金额；追加申购最低金额；赎回最低份额和持有最低限额的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 4 月 30 日
17	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；	2021 年 5 月 10 日

	并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
18	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“香港佛诞日”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 5 月 17 日
19	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增北京度小满基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 5 月 18 日
20	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金开通在北京植信基金销售有限公司定投及转换业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 5 月 21 日
21	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增通华财富(上海)基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 6 月 8 日
22	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“端午节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 6 月 9 日
23	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增光大证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 6 月 15 日
24	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增中泰证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金	2021 年 6 月 17 日

		管理人网站	
25	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 6 月 18 日
26	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 6 月 28 日
27	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“香港特别行政区成立纪念日”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 6 月 29 日
28	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 6 月 30 日
29	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 7 月 12 日
30	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增中信建投证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021 年 7 月 15 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101 - 20210630	375,589,655.36	0.00	0.00	375,589,655.36	54.47%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《上海证券报》）或登录基金管理人网站（<http://www.tkfunds.com.cn>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅。

泰康资产管理有限责任公司

2021 年 8 月 31 日