

# 华商新常态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：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§6 中期财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	47
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>47</b>

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.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
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.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</b>
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.....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华商新常态灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华商新常态混合
基金主代码	001457
交易代码	001457
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 日
基金管理人	华商基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	194,224,427.02 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将密切关注中国经济“新常态”下的投资机会，在有效管理投资风险的前提下，追求超过基准的投资回报及基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金坚持“自上而下”、“自下而上”相结合的投资视角，在实际投资过程中充分体现“新常态”这个核心理念，精选优质上市公司股票，力求实现基金资产的长期稳健增值。 具体投资策略详见基金合同。
业绩比较基准	沪深 300 收益率×65%+上证国债指数收益率×35%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高敏	郭明
	联系电话	010-58573600	010-66105799
	电子邮箱	gaom@hsfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007008880	95588
传真		010-58573520	010-66105798
注册地址		北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	100035	100140
法定代表人	陈牧原	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华商基金管理有限公司	北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	33,451,942.77
本期利润	43,440,957.44
加权平均基金份额本期利润	0.2283
本期加权平均净值利润率	16.79%
本期基金份额净值增长率	19.89%
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	64,609,024.97
期末可供分配基金份额利润	0.3327
期末基金资产净值	298,558,718.65
期末基金份额净值	1.537
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	139.82%

注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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. 对期末可供分配利润，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余额的孰低数。

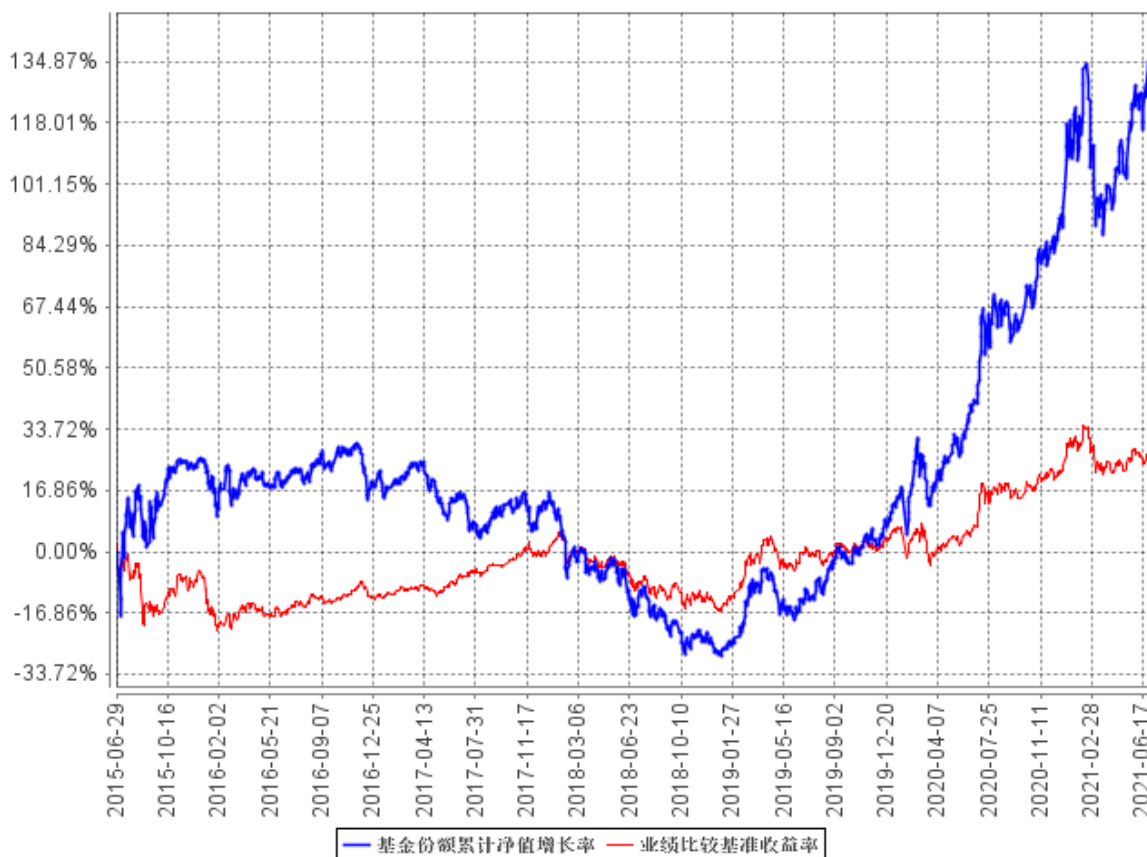
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.20%	1.45%	-1.26%	0.53%	6.46%	0.92%
过去三个月	22.18%	1.32%	2.62%	0.64%	19.56%	0.68%
过去六个月	19.89%	1.84%	0.98%	0.86%	18.91%	0.98%
过去一年	67.16%	1.69%	17.44%	0.87%	49.72%	0.82%
过去三年	176.33%	1.47%	37.25%	0.89%	139.08%	0.58%
自基金合同生效起至今	139.82%	1.46%	26.40%	0.94%	113.42%	0.52%

#### 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本基金合同生效日为 2015 年 6 月 29 日。

②根据《华商新常态灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围包

括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他依法发行、上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证、股指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。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

## § 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

华商基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]160 号文批准设立，于 2005 年 12 月 20 日成立，注册资本为 1 亿元人民币，注册地北京。

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理六十一只基金产品，分别为华商领先企业混合型开放式证券投资基金、华商盛世成长混合型证券投资基金、华商收益增强债券型证券投资基金、华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华商产业升级混合型证券投资基金、华商稳健双利债券型证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华商稳定增利债券型证券投资基金、华商价值精选混合型证券投资基金、华商主题精选混合型证券投资基金、华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华商现金增利货币市场基金、华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金、华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金、华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金、华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金、华商双债丰利债券型证券投资基金、华商创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金、华商新量化灵活配置混合型证券投资基金、华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金、华商未来主题混合型证券投资基金、华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金、华商双翼平衡混合型证券投资基金、华商新常态灵活配置混合型证券投资基金、华商信用增强债券型证券投资基金、华商双驱优选灵活配置混合型证券投资基金、华商新动力混合型证券投资基金、华商智能生活灵活配置混合型证券投资基金、华商乐享互联灵活配置混合型证券投资基金、华商新兴



活力灵活配置混合型证券投资基金、华商万众创新灵活配置混合型证券投资基金、华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金、华商丰利增强定期开放债券型证券投资基金、华商润丰灵活配置混合型证券投资基金、华商元亨灵活配置混合型证券投资基金、华商瑞丰短债债券型证券投资基金、华商研究精选灵活配置混合型证券投资基金、华商鑫安灵活配置混合型证券投资基金、华商可转债债券型证券投资基金、华商上游产业股票型证券投资基金、华商改革创新股票型证券投资基金、华商消费行业股票型证券投资基金、华商电子行业量化股票型发起式证券投资基金、华商计算机行业量化股票型发起式证券投资基金、华商高端装备制造股票型证券投资基金、华商医药医疗行业股票型证券投资基金、华商恒益稳健混合型证券投资基金、华商科技创新混合型证券投资基金、华商龙头优势混合型证券投资基金、华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华商鸿畅 39 个月定期开放利率债债券型证券投资基金、华商转债精选债券型证券投资基金、华商量化优质精选混合型证券投资基金、华商双擎领航混合型证券投资基金、华商景气优选混合型证券投资基金、华商甄选回报混合型证券投资基金、华商鸿盈 87 个月定期开放债券型证券投资基金、华商均衡成长混合型证券投资基金、华商嘉悦平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华商远见价值混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴昊	基金经理	2018 年 7 月 12 日	-	11.1	女，中国籍，经济学博士，具有基金从业资格。2010 年 5 月至 2011 年 11 月，就职于国都证券有限责任公司，任研究员；2011 年 11 月加入华商基金管理有限公司，曾任行业研究员；2016 年 10 月 20 日至 2017 年 7 月 25 日担任华商主题精选混合型证券投资基金的基金经理助理；2017 年 7 月 26 日至 2018 年 8 月 10 日担任华商主题精选混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 7 月 12 日起至今担任华商新常态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 12 月 10 日起至今

					担任华商高端装备制造股票型证券投资基金的基金经理；2021 年 1 月 20 日起至今担任华商领先企业混合型开放式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从《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合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、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

报告期内，本基金管理人严格执行了《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，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统中的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配，报告期内，系统的公平交易程序运作良好，未出现异常情况。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内，场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1 日、3 日、5 日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，统计了溢价率占优比例。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，公司制定了《异常交易管理办法》，对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、

控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度，未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易，按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

#### 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，一季度国内经济环比动能向上，工业生产继续加快，制造业持续高增长，全球经济修复下，出口持续强劲，但出于对国内外紧缩预期的担忧，节后市场风险偏好有所回落；二季度经济相对走弱，货币政策处于偏宽松的状态。制造业受到缺芯和原材料双重影响，扩张力度在减弱，服务业的增速也在减弱，市场对宏观的关注点聚焦在成本端和经济增长前景的担忧上。市场表现上，上半年 A 股市场整体震荡上行。一季度呈现了较大的波动，春节前延续之前的上涨趋势，节后有较大幅度的回调；二季度市场整体表现为震荡向上，结构呈现出明显的分化，成长风格主导市场，高景气行业如 CXO、医美、新能源、半导体等取得了非常明显的超额收益。

组合配置上，一方面产业升级、科技创新是大势所趋，我们会在其中积极挖掘护城河较高、竞争力可持续的公司；另一方面配置在消费升级以及低估值的蓝筹上，力求从不确定性中寻找确定性。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.537 元，份额累计净值为 2.080 元。本报告期内本基金份额净值增长率为 19.89%，同期基金业绩比较基准的收益率为 0.98%，本基金份额净值增长率高于业绩比较基准的收益率 18.91 个百分点。

#### 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 2021 年下半年，后疫情时代伴随着全球经济逐步复苏，流动性紧缩的预期渐起，同时市场对国内经济的增速也有争议，权益市场的波动可能进一步加大。产业结构的升级和对更好生活的追求始终是社会前进发展的动力，本产品将始终密切关注中国经济“新常态”下的投资机会，坚持业绩和估值驱动的本源，继续秉承均衡配置、深入挖掘的思想，一方面配置在景气度比较确定的成长板块上，另一方面挖掘一些估值合适、调整充分的优质龙头资产。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定及基金合同中关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意

见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人设立的估值小组，负责组织制定、定期审核及适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值小组成员包括总经理、督察长、分管基金运营部的高管、分管投研部门的高管、固定收益部负责人、研究发展部负责人、基金运营部负责人、风险控制部负责人或上述部门负责人指定人员，由总经理任估值小组负责人，由基金运营部负责人任估值小组秘书。估值小组关于调整投资品种估值方法的决策，需经 1/2 以上的小组成员同意。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格，当对估值原则及技术有异议时，本基金托管人有义务要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。会计师事务所在对基金年度财务报告出具审计报告时，对报告期间基金的估值技术及其重大变化，特别是对估值的适当性，采用外部信息进行估值的客观性和可靠性程度，以及相关披露的充分性和及时性等发表意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易的债券品种的估值数据，以及流通受限股票的流动性折扣数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《华商新常态灵活配置型证券投资基金基金合同》约定，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，自本基金合同生效之日起每半年后的对日（若该日为非工作日则顺延至下一工作日）收盘后，每份基金份额可分配利润金额高于 0.04 元（含），则本基金以该日作为收益分配基准日，并在 15 个工作日之内进行收益分配，届时见基金管理人公告，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 60%。本报告期内收益分配情况如下：

本基金以截至 2020 年 12 月 29 日基金可分配收益 73,091,612.94 元为基准，以 2021 年 1 月 5 日为权益登记日、除息日，于 2021 年 1 月 7 日向本基金的基金持有人派发第一次分红，每 10 份基金份额派发红利 2.45 元。

#### 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者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

本报告期内，本基金托管人在对华商新常态灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，华商新常态灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华商基金管理有限公司在华商新常态灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华商基金管理有限公司编制和披露的华商新常态灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 中期财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华商新常态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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	28,426,439.90	23,642,935.99
结算备付金		1,703,886.43	1,298,520.98
存出保证金		210,595.44	154,098.44
交易性金融资产	6.4.7.2	270,928,715.40	248,134,742.84
其中：股票投资		270,928,715.40	248,134,742.84
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		40,147.00	2,687,542.56
应收利息	6.4.7.5	3,622.10	3,745.08
应收股利		-	-
应收申购款		495,598.64	160,124.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		301,809,004.91	276,081,710.47
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		720,330.34	2,197,967.12
应付赎回款		1,063,364.09	674,815.35
应付管理人报酬		342,433.47	323,219.76
应付托管费		57,072.24	53,869.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	972,755.11	943,223.05
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	94,331.01	184,696.09
负债合计		3,250,286.26	4,377,791.33
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	194,224,427.02	179,005,628.21
未分配利润	6.4.7.10	104,334,291.63	92,698,290.93
所有者权益合计		298,558,718.65	271,703,919.14
负债和所有者权益总计		301,809,004.91	276,081,710.47

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.537 元，基金份额总额 194,224,427.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华商新常态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
<b>一、收入</b>		49,449,735.66	69,021,949.44
1.利息收入		69,861.25	116,350.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	69,861.25	116,350.82
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		39,080,040.78	66,919,953.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	38,681,259.71	65,906,690.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	398,781.07	1,013,262.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	9,989,014.67	1,968,458.16
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	310,818.96	17,186.83
<b>减：二、费用</b>		6,008,778.22	5,643,460.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,943,041.25	1,840,729.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	323,840.21	306,788.25
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,641,316.86	3,394,536.38
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	100,579.90	101,406.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		43,440,957.44	63,378,489.32
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		43,440,957.44	63,378,489.32

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华商新常态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)	179,005,628.21	92,698,290.93	271,703,919.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	43,440,957.44	43,440,957.44
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)	15,218,798.81	11,869,765.35	27,088,564.16
其中：1.基金申购款	103,080,135.90	41,218,628.13	144,298,764.03
2.基金赎回款	-87,861,337.09	-29,348,862.78	-117,210,199.87
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)	-	-43,674,722.09	-43,674,722.09
五、期末所有者权益(基金净值)	194,224,427.02	104,334,291.63	298,558,718.65
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)	291,302,949.47	-35,804,150.85	255,498,798.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	63,378,489.32	63,378,489.32
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)	-73,084,116.40	1,583,950.27	-71,500,166.13
其中：1.基金申购款	12,189,342.39	14,573.87	12,203,916.26
2.基金赎回款	-85,273,458.79	1,569,376.40	-83,704,082.39
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)	218,218,833.07	29,158,288.74	247,377,121.81



报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.3 财务报表由下列负责人签署：

<u>          王小刚          </u>	<u>          程蕾          </u>	<u>          程蕾          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华商新常态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[2015]1066号《关于准予华商新常态灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册,由华商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商新常态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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,530,205,319.69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(2015)第796号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华商新常态灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年6月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,529,761,052.49份基金份额,其中认购资金利息折合444,267.20份基金份额。本基金的基金管理人为华商基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商新常态灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票(包含中小板、创业板、存托凭证及其他依法发行、上市的股票),股指期货、权证,债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可交换公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证、股指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收益率 $\times$ 65%+上证国债指数收益率 $\times$ 35%。

## 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》、《华商新常态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相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

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

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

本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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

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

[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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	28,426,439.90
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:	28,426,439.90
-----	---------------

### 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	230,514,885.84	270,928,715.40	40,413,829.56
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	230,514,885.84	270,928,715.40	40,413,829.56

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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	2,760.70
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	766.70
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	94.70
合计	3,622.10

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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	972,755.11
银行间市场应付交易费用	-
合计	972,755.11

#### 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	570.86
应付证券出借违约金	-
预提费用	93,760.15
合计	94,331.01

#### 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	179,005,628.21	179,005,628.21
本期申购	103,080,135.90	103,080,135.90
本期赎回(以“-”号填列)	-87,861,337.09	-87,861,337.09
- 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	194,224,427.02	194,224,427.02

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	74,253,358.26	18,444,932.67	92,698,290.93
本期利润	33,451,942.77	9,989,014.67	43,440,957.44
本期基金份额交易产生的变动数	578,446.03	11,291,319.32	11,869,765.35
其中：基金申购款	26,823,950.51	14,394,677.62	41,218,628.13
基金赎回款	-26,245,504.48	-3,103,358.30	-29,348,862.78
本期已分配利润	-43,674,722.09	-	-43,674,722.09
本期末	64,609,024.97	39,725,266.66	104,334,291.63

#### 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	51,085.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,844.86
结算备付金利息收入	15,426.92
其他	1,504.24
合计	69,861.25

#### 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	1,203,519,091.04
减：卖出股票成本总额	1,164,837,831.33
买卖股票差价收入	38,681,259.71

### 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

本基金本报告期内未发生债券投资收益。

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内未发生债券投资收益。

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内未发生贵金属投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未发生衍生工具收益。

### 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	398,781.07
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	398,781.07

### 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	9,989,014.67
——股票投资	9,989,014.67
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	9,989,014.67

#### 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	310,818.96
合计	310,818.96

注：1. 基金赎回费收入含转换费收入。

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

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

#### 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	3,641,316.86
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	3,641,316.86

#### 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	2,319.75
其他	-
合计	100,579.90



## 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

本基金的基金管理人于 2021 年 7 月 3 日宣告 2021 年度第 2 次分红，向截至 2021 年 7 月 6 日止在本基金注册登记人华商基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 2.00 元。

## 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华商基金管理有限公司（“华商基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
华龙证券股份有限公司（“华龙证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年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
华龙证券	-	-	908,042,283.19	41.55%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 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
华龙证券	-	-	-	-
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
华龙证券	845,662.39	41.55%	261,659.11	30.05%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券交易不计佣金。

2. 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	1,943,041.25
其中：支付销售机构的客户维护费	607,730.34	744,421.20

注：支付基金管理人华商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 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	323,840.21	306,788.25

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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未发生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

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金的情况。

#### 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		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
中国工商银行	28,426,439.90	51,085.23	42,535,069.96	101,706.82

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券的买卖。

### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 1 月 5 日	-	2021 年 1 月 5 日	2.4500	30,121,704.85	13,553,017.24	43,674,722.09	
合计	-	-	-	2.4500	30,121,704.85	13,553,017.24	43,674,722.09	

### 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
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 12 日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁定	24.69	31.71	379	9,357.51	12,018.09	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁定	21.31	49.94	322	6,861.82	16,080.68	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁定	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	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁定	47.33	251.96	132	6,247.56	33,258.72	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁定	6.87	12.07	698	4,795.26	8,424.86	-

300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.50	241	8,006.02	21,087.50	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	142	6,899.78	12,835.38	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	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	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定	4.94	13.05	796	3,932.24	10,387.80	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定	12.54	27.89	481	6,031.74	13,415.09	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,296	50,420.16	50,420.16	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688317	之江生物	2021年1月8日	2021年7月19日	新股锁定	43.22	63.82	1,763	76,196.86	112,514.66	-
688328	深科达	2021年3月1日	2021年9月9日	新股锁定	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	1,786	69,386.10	69,386.10	-
688609	九联科技	2021年3月15日	2021年9月23日	新股锁定	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-

注：1. 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。

2. 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。

3. 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，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金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。

4. 本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

5. 以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末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**

#### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。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密切关注中国经济“新常态”下的投资机会，在有效管理投资风险的前提下，追求超过基准的投资回报及基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括三个层次：（1）第一层次风险控制：在董事会层面设立风险控制委员会，对公司规章制度、经营管理、基金运作、固有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查，对各种风险预测报告进行审议，提出相应的意见和建议。公司设督

察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。(2) 第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层面的风险控制，具体为在风险管理小组、投资决策委员会、监察稽核部和风险控制部层次对公司的风险进行的预防和控制。风险管理小组对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的分析、评估，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。监察稽核部和风险控制部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。(3) 第三层次风险控制：第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无交易性债券投资 (2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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%。2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.37%。

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。2021 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿



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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金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、结算备付金和存出保证金等。

##### 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	28,426,439.90	-	-	-	28,426,439.90
结算备付金	1,703,886.43	-	-	-	1,703,886.43
存出保证金	210,595.44	-	-	-	210,595.44
交易性金融资产	-	-	-	270,928,715.40	270,928,715.40
应收证券清算款	-	-	-	40,147.00	40,147.00
应收利息	-	-	-	3,622.10	3,622.10
应收申购款	-	-	-	495,598.64	495,598.64
资产总计	30,340,921.77	-	-	271,468,083.14	301,809,004.91

负债					
应付证券清算款	-	-	-	720,330.34	720,330.34
应付赎回款	-	-	-	1,063,364.09	1,063,364.09
应付管理人报酬	-	-	-	342,433.47	342,433.47
应付托管费	-	-	-	57,072.24	57,072.24
应付交易费用	-	-	-	972,755.11	972,755.11
其他负债	-	-	-	94,331.01	94,331.01
负债总计	-	-	-	3,250,286.26	3,250,286.26
利率敏感度缺口	30,340,921.77	-	-	268,217,796.88	298,558,718.65
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	23,642,935.99	-	-	-	23,642,935.99
结算备付金	1,298,520.98	-	-	-	1,298,520.98
存出保证金	154,098.44	-	-	-	154,098.44
交易性金融资产	-	-	-	248,134,742.84	248,134,742.84
应收证券清算款	-	-	-	2,687,542.56	2,687,542.56
应收利息	-	-	-	3,745.08	3,745.08
应收申购款	-	-	-	160,124.58	160,124.58
资产总计	25,095,555.41	-	-	250,986,155.06	276,081,710.47
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,197,967.12	2,197,967.12
应付赎回款	-	-	-	674,815.35	674,815.35
应付管理人报酬	-	-	-	323,219.76	323,219.76
应付托管费	-	-	-	53,869.96	53,869.96
应付交易费用	-	-	-	943,223.05	943,223.05
其他负债	-	-	-	184,696.09	184,696.09
负债总计	-	-	-	4,377,791.33	4,377,791.33
利率敏感度缺口	25,095,555.41	-	-	246,608,363.73	271,703,919.14

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予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2020 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

本基金坚持“自上而下”、“自下而上”相结合的投资视角，在实际投资过程中充分体现“新常态”这个核心理念，精选优质上市公司股票，力求实现基金资产的长期稳健增值。

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资产占基金资产的比例为 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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	270,928,715.40	90.75	248,134,742.84	91.33
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	270,928,715.40	90.75	248,134,742.84	91.33

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%		17,949,643.84
2. 沪深 300 指数下降 5%		-17,949,643.84	-13,154,058.00

#### 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 269,828,834.70 元，属于第二层次的余额为 1,099,880.70 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 244,114,831.01 元，第二层次 4,019,911.83 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	270,928,715.40	89.77
	其中：股票	270,928,715.40	89.77
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	30,130,326.33	9.98
8	其他各项资产	749,963.18	0.25
9	合计	301,809,004.91	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	207,271,118.33	69.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	5,481,538.82	1.84
G	交通运输、仓储和邮政业	5,659,771.00	1.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,820,503.69	4.63
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	2,323.44	0.00
L	租赁和商务服务业	18,786,260.00	6.29
M	科学研究和技术服务业	16,997,489.25	5.69
N	水利、环境和公共设施管理业	22,457.73	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,802,850.00	0.94
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	270,928,715.40	90.75

### 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港股通股票。

### 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	300750	宁德时代	36,100	19,306,280.00	6.47
2	601888	中国中免	62,600	18,786,260.00	6.29
3	002812	恩捷股份	76,500	17,908,650.00	6.00
4	300450	先导智能	282,120	16,966,696.80	5.68
5	300124	汇川技术	172,700	12,824,702.00	4.30
6	300896	爱美客	16,160	12,748,300.80	4.27
7	603259	药明康德	78,880	12,351,819.20	4.14
8	000858	五粮液	37,600	11,200,664.00	3.75
9	300274	阳光电源	96,900	11,149,314.00	3.73
10	688111	金山办公	27,989	11,050,057.20	3.70
11	600110	诺德股份	894,500	10,895,010.00	3.65
12	603659	璞泰来	79,630	10,877,458.00	3.64
13	002568	百润股份	112,898	10,701,601.42	3.58
14	603799	华友钴业	89,000	10,163,800.00	3.40
15	688016	心脉医疗	19,178	8,718,510.58	2.92
16	300782	卓胜微	15,700	8,438,750.00	2.83
17	002459	晶澳科技	155,500	7,619,500.00	2.55
18	002920	德赛西威	55,300	6,087,424.00	2.04
19	601012	隆基股份	66,300	5,890,092.00	1.97
20	601816	京沪高铁	1,069,900	5,659,771.00	1.90
21	002594	比亚迪	22,400	5,622,400.00	1.88
22	603707	健友股份	131,800	5,502,650.00	1.84
23	000963	华东医药	117,200	5,392,372.00	1.81
24	688133	泰坦科技	14,615	4,645,670.05	1.56
25	603486	科沃斯	19,100	4,356,328.00	1.46

26	688598	金博股份	15,809	4,252,621.00	1.42
27	300347	泰格医药	14,500	2,802,850.00	0.94
28	002624	完美世界	114,200	2,730,522.00	0.91
29	688116	天奈科技	17,636	2,081,048.00	0.70
30	002026	山东威达	112,300	1,534,018.00	0.51
31	300861	美畅股份	16,000	1,348,960.00	0.45
32	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.05
33	688317	之江生物	1,763	112,514.66	0.04
34	688499	利元亨	1,786	69,386.10	0.02
35	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
36	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.02
37	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
38	603529	爱玛科技	962	55,911.44	0.02
39	688087	英科再生	2,296	50,420.16	0.02
40	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
41	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.02
42	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
43	300957	贝泰妮	132	33,258.72	0.01
44	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
45	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
46	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
47	300979	华利集团	241	21,087.50	0.01
48	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
49	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
50	300941	创识科技	322	16,080.68	0.01
51	300925	法本信息	600	15,774.00	0.01
52	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
53	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
54	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
55	301009	可靠股份	481	13,415.09	0.00
56	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
57	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
58	300981	中红医疗	142	12,835.38	0.00
59	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
60	300932	三友联众	379	12,018.09	0.00
61	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
62	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
63	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
64	300997	欢乐家	796	10,387.80	0.00

65	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
66	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
67	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
68	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
69	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
70	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
71	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
72	300968	格林精密	698	8,424.86	0.00
73	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
74	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
75	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
76	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
77	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
78	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
79	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
80	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
81	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
82	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
83	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
84	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
85	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
86	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
87	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
88	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
89	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
90	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
91	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
92	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
93	300918	南山智尚	363	3,778.83	0.00
94	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	601601	中国太保	29,473,055.90	10.85



2	603799	华友钴业	29,448,270.18	10.84
3	300124	汇川技术	25,566,488.00	9.41
4	300896	爱美客	24,281,021.60	8.94
5	000858	五粮液	24,015,702.94	8.84
6	600989	宝丰能源	23,195,659.00	8.54
7	600258	首旅酒店	21,282,615.26	7.83
8	601058	赛轮轮胎	21,105,292.30	7.77
9	600176	中国巨石	21,022,845.72	7.74
10	000568	泸州老窖	20,537,101.00	7.56
11	601888	中国中免	19,683,779.10	7.24
12	600754	锦江酒店	18,782,959.59	6.91
13	300274	阳光电源	17,120,284.37	6.30
14	300450	先导智能	15,867,023.57	5.84
15	603259	药明康德	15,538,849.70	5.72
16	300415	伊之密	15,129,945.00	5.57
17	002271	东方雨虹	14,981,827.61	5.51
18	300014	亿纬锂能	14,921,724.92	5.49
19	300122	智飞生物	14,817,923.84	5.45
20	601816	京沪高铁	14,122,991.52	5.20
21	688111	金山办公	14,032,840.08	5.16
22	002563	森马服饰	13,916,473.21	5.12
23	600426	华鲁恒升	13,533,420.62	4.98
24	300750	宁德时代	13,425,465.00	4.94
25	002080	中材科技	13,281,351.16	4.89
26	603993	洛阳钼业	12,926,526.00	4.76
27	605089	味知香	12,867,664.50	4.74
28	002920	德赛西威	12,388,126.00	4.56
29	300662	科锐国际	12,074,150.00	4.44
30	003022	联泓新科	11,861,767.00	4.37
31	601012	隆基股份	11,413,246.44	4.20
32	688016	心脉医疗	11,247,333.12	4.14
33	002812	恩捷股份	11,195,347.00	4.12
34	300782	卓胜微	11,138,930.00	4.10
35	600809	山西汾酒	11,017,983.00	4.06
36	603486	科沃斯	11,002,801.20	4.05
37	002568	百润股份	10,865,464.64	4.00

38	002385	大北农	10,860,288.00	4.00
39	000963	华东医药	10,845,701.00	3.99
40	000799	酒鬼酒	10,569,398.00	3.89
41	603659	璞泰来	10,433,402.80	3.84
42	688598	金博股份	10,034,724.72	3.69
43	600887	伊利股份	10,026,486.69	3.69
44	002624	完美世界	9,980,808.13	3.67
45	002541	鸿路钢构	9,866,623.00	3.63
46	688169	石头科技	9,798,966.69	3.61
47	603517	绝味食品	9,496,747.80	3.50
48	603587	地素时尚	9,319,544.89	3.43
49	600110	诺德股份	9,278,688.00	3.41
50	002756	永兴材料	9,162,764.01	3.37
51	000661	长春高新	9,147,846.00	3.37
52	002594	比亚迪	9,136,486.00	3.36
53	688133	泰坦科技	8,918,302.48	3.28
54	300470	中密控股	8,889,356.00	3.27
55	600346	恒力石化	8,697,900.80	3.20
56	002332	仙琚制药	8,570,170.00	3.15
57	603678	火炬电子	8,184,556.00	3.01
58	002044	美年健康	8,179,264.79	3.01
59	600660	福耀玻璃	7,837,152.02	2.88
60	002460	赣锋锂业	7,805,212.98	2.87
61	688208	道通科技	7,722,975.38	2.84
62	600845	宝信软件	7,663,082.00	2.82
63	601318	中国平安	7,626,200.00	2.81
64	600438	通威股份	7,551,200.35	2.78
65	603708	家家悦	7,540,640.85	2.78
66	603707	健友股份	7,517,983.65	2.77
67	002459	晶澳科技	7,140,604.86	2.63
68	601689	拓普集团	7,077,762.84	2.60
69	002025	航天电器	7,036,262.44	2.59
70	601233	桐昆股份	7,028,568.00	2.59
71	300001	特锐德	6,915,927.60	2.55
72	002026	山东威达	6,853,459.00	2.52
73	600690	海尔智家	6,821,220.00	2.51

74	600219	南山铝业	6,754,859.00	2.49
75	603267	鸿远电子	6,733,166.00	2.48
76	600031	三一重工	6,668,951.00	2.45
77	300073	当升科技	6,243,131.00	2.30
78	002371	北方华创	6,214,317.00	2.29
79	601899	紫金矿业	6,192,787.00	2.28
80	601336	新华保险	6,183,681.00	2.28
81	601933	永辉超市	6,133,273.00	2.26
82	601995	中金公司	5,964,984.00	2.20
83	002601	龙鳞佰利	5,795,160.00	2.13
84	688002	睿创微纳	5,561,790.84	2.05
85	002847	盐津铺子	5,439,936.00	2.00

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	601601	中国太保	29,716,953.89	10.94
2	000568	泸州老窖	27,086,996.00	9.97
3	000858	五粮液	25,929,573.00	9.54
4	300896	爱美客	25,000,997.00	9.20
5	600989	宝丰能源	24,846,745.99	9.14
6	600031	三一重工	23,585,442.24	8.68
7	600258	首旅酒店	21,379,629.00	7.87
8	300122	智飞生物	21,091,131.50	7.76
9	603799	华友钴业	21,022,309.42	7.74
10	601058	赛轮轮胎	19,581,550.98	7.21
11	300014	亿纬锂能	18,239,348.07	6.71
12	600754	锦江酒店	18,155,725.76	6.68
13	300415	伊之密	17,458,796.40	6.43
14	002080	中材科技	17,409,251.72	6.41
15	600809	山西汾酒	17,200,188.00	6.33
16	002271	东方雨虹	16,910,193.00	6.22
17	600176	中国巨石	16,842,685.98	6.20
18	600690	海尔智家	16,586,880.63	6.10

19	300059	东方财富	15,637,335.60	5.76
20	003022	联泓新科	14,750,557.92	5.43
21	300124	汇川技术	14,373,372.53	5.29
22	002563	森马服饰	13,987,669.13	5.15
23	603678	火炬电子	13,407,827.00	4.93
24	688169	石头科技	13,044,981.49	4.80
25	603993	洛阳钼业	12,979,562.00	4.78
26	601966	玲珑轮胎	12,474,943.84	4.59
27	601816	京沪高铁	12,314,154.00	4.53
28	300662	科锐国际	12,298,690.00	4.53
29	600426	华鲁恒升	11,938,478.00	4.39
30	300750	宁德时代	11,651,451.00	4.29
31	300450	先导智能	11,472,276.00	4.22
32	605089	味知香	11,198,716.11	4.12
33	000799	酒鬼酒	10,928,857.00	4.02
34	002541	鸿路钢构	10,837,175.69	3.99
35	000963	华东医药	10,720,841.20	3.95
36	601100	恒立液压	10,381,464.00	3.82
37	603128	华贸物流	10,184,702.96	3.75
38	000596	古井贡酒	10,151,838.00	3.74
39	600346	恒力石化	9,959,579.90	3.67
40	603587	地素时尚	9,331,295.60	3.43
41	002385	大北农	9,317,778.00	3.43
42	600887	伊利股份	9,197,827.00	3.39
43	002332	仙琚制药	8,910,879.00	3.28
44	688002	睿创微纳	8,562,211.28	3.15
45	600845	宝信软件	8,531,010.00	3.14
46	688363	华熙生物	8,473,367.00	3.12
47	300470	中密控股	8,175,940.80	3.01
48	600660	福耀玻璃	8,106,702.00	2.98
49	300001	特锐德	8,096,812.71	2.98
50	603517	绝味食品	8,021,800.78	2.95
51	002460	赣锋锂业	7,872,578.00	2.90
52	000661	长春高新	7,788,683.00	2.87
53	688208	道通科技	7,781,752.19	2.86
54	002624	完美世界	7,705,792.82	2.84
55	603486	科沃斯	7,696,492.00	2.83
56	601899	紫金矿业	7,593,234.00	2.79

57	002044	美年健康	7,482,075.00	2.75
58	002920	德赛西威	7,440,491.80	2.74
59	688122	西部超导	7,270,162.24	2.68
60	601318	中国平安	7,173,624.00	2.64
61	002756	永兴材料	7,110,217.00	2.62
62	601233	桐昆股份	7,042,170.00	2.59
63	300593	新雷能	7,038,458.73	2.59
64	601995	中金公司	6,952,886.50	2.56
65	002601	龙蟠佰利	6,718,609.00	2.47
66	300034	钢研高纳	6,599,563.59	2.43
67	603267	鸿远电子	6,589,513.00	2.43
68	002025	航天电器	6,575,485.40	2.42
69	688510	航亚科技	6,573,134.51	2.42
70	002026	山东威达	6,520,012.80	2.40
71	601689	拓普集团	6,415,253.00	2.36
72	603708	家家悦	6,398,636.69	2.36
73	000066	中国长城	6,326,905.53	2.33
74	600219	南山铝业	6,261,478.80	2.30
75	600438	通威股份	6,213,541.00	2.29
76	688133	泰坦科技	6,049,542.16	2.23
77	300073	当升科技	5,952,118.00	2.19
78	601933	永辉超市	5,905,683.00	2.17
79	688598	金博股份	5,904,124.41	2.17
80	600893	航发动力	5,870,939.63	2.16
81	002833	弘亚数控	5,849,443.00	2.15
82	002414	高德红外	5,834,655.00	2.15
83	601336	新华保险	5,827,114.43	2.14
84	601012	隆基股份	5,818,195.00	2.14
85	600600	青岛啤酒	5,690,914.00	2.09
86	002938	鹏鼎控股	5,677,996.00	2.09
87	002371	北方华创	5,637,951.00	2.08
88	300316	晶盛机电	5,502,939.70	2.03

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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	1,177,642,789.22
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,203,519,091.04
--------------	------------------

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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投资贵金属投资。

## 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

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。

在预判市场系统风险较大时，应用股指期货对冲策略，即在保有股票头寸不变的情况下或者逐步降低股票仓位后，在市场面临下跌时择机卖出期指合约进行套期保值，当股市好转之后再为期指合约空单平仓。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 7.12.2 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	210,595.44
2	应收证券清算款	40,147.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,622.10
5	应收申购款	495,598.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	749,963.18

### 7.12.3 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。

### 7.12.4 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的情况。

### 7.12.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
5,035	38,574.86	67,388,199.16	34.70%	126,836,227.86	65.30%

### 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	8,031.58	0.0041%
------------------	----------	---------

### 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、基金投资和相关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	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月29日）基金份额总额	1,530,205,319.69
本报告期期初基金份额总额	179,005,628.21
本报告期基金总申购份额	103,080,135.90
减：本报告期基金总赎回份额	87,861,337.09
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	194,224,427.02

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。



### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）自 2015 年 6 月 29 日（基金合同生效日）起至今为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

### 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、托管人及高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	1,199,845,966.33	50.50%	1,117,417.79	50.50%	-
湘财证券	1	970,656,732.00	40.86%	903,972.42	40.86%	-
华西证券	2	148,232,534.72	6.24%	138,048.89	6.24%	-
国元证券	1	56,999,784.18	2.40%	53,083.68	2.40%	-
华龙证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用席位的标准和程序：

(1) 选择标准

- ① 证券经营机构财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进。
- ② 证券经营机构具有较强的研究能力：有较强的研究分析能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息咨询服务。
- ③ 证券经营机构能提供最优惠合理的佣金率：与其他证券经营机构相比，该证券经营机构能够提

供最优惠、最合理的佣金率。

(2) 选择程序

- ①基金管理人根据上述标准考察后确定选用证券交易单元的证券经营机构；
- ②基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券交易单元租用协议。

**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**

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东莞农村商业银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021年1月4日
2	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021年1月7日
3	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加腾安基金销售（深圳）有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021年1月7日
4	华商基金管理有限公司关于华商新常态灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报	2021年1月8日
5	华商新常态灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021年1月22日
6	华商基金管理有限公司旗下基金 2020 年第四季度报告提示性公告	证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021年1月22日
7	华商基金管理有限公司关于开展网上直销系统定投费率优惠的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021年2月3日
8	华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021年3月9日
9	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加安信证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021年3月15日

10	华商基金管理有限公司关于旗下部分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	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 3 月 30 日
11	华商基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 3 月 31 日
12	华商新常态灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
13	华商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第一季度报告提示性公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 4 月 22 日
14	华商新常态灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 22 日
15	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加南京证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 4 月 28 日
16	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 6 月 24 日
17	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 6 月 30 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超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021-01-01 至 2021-05-25	47,324,476.35	0.00	11,000,000.00	36,324,476.35	18.70%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

本基金存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%及以上的情况，由于持有人相对集中，本基金可能面临基金净值大幅波动的风险、延迟或暂停赎回的风险，且根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定本基金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的风险。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准华商新常态灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
2. 《华商新常态灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《华商新常态灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《华商新常态灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 报告期内华商新常态灵活配置混合型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告的原稿。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

基金托管人地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：4007008880（免长途费），010—58573300

基金管理人网址：<http://www.hsfund.com>

中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

华商基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日