

华融新利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：华融基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 15 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 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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51
§12 备查文件目录.....	52
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	华融新利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华融新利混合
基金主代码	001797
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 2 日
基金管理人	华融基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,386,462.18 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活运用多种投资策略，把握市场机会，分享中国经济转型和增长的红利，在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>本基金将采取积极主动的资产配置策略，注重风险与收益的平衡，选择适应经济转型升级、能够为股东持续创造价值的优质标的，运用多样化的投资策略实行组合管理，实现基金资产的长期增值。</p> <p>1、资产配置策略 从全球经济格局和中国经济发展方式的变化，分析经济的驱动力和阶段性特征，结合宏观政策、产业政策、结构变迁、市场情绪等对比分析大类资产风险收益比，合理分配各大类资产配置比例，以实现基金资产的稳健增值。</p> <p>2、股票投资策略 本基金的股票投资秉承价值投资理念，采取定量和定性相结合的方法，深挖符合经济升级转型、发展潜力巨大的行业与公司，通过上下游产业链的实地调研对研究逻辑和结论进行验证，灵活运用多种低风险投资策略，把握市场投资机会。</p> <p>3、债券投资策略 本基金将自上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上，灵活采用类属配置、个券选择、套利等投资策略。</p> <p>4、股指期货投资策略 本基金认为在符合一定条件的市场环境中，有必要审慎灵活地综合运用股指期货进行套期保值交易来对冲系统性风险、降低投资组合波动性并提高资金管理效率。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</p>

	<p>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。</p> <p>5、套利策略</p> <p>利用市场的弱有效性，以较低成本、较高效率、承担较低风险情况下把握市场定价偏差带来的机会，主要包括新可转换债券套利、增发套利、转债转股套利等。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+1 年期人民币定期存款基准利率×70%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

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		华融基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢超	秦一楠
	联系电话	010-59315649	010-66060069
	电子邮箱	xiechao@hr-fund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-819-0789	95599
传真		010-59315600	010-68121816
注册地址		河北省保定市雄县雄州路 452 号万博大厦 7 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 11 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100020	100031
法定代表人		冷慧卿	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.hr-fund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和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	华融基金管理有限公司	北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 11 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	159,124.28
本期利润	74,040.32
加权平均基金份额本期利润	0.0276
本期加权平均净值利润率	2.81%
本期基金份额净值增长率	2.83%
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	37,531.27
期末可供分配基金份额利润	0.0157
期末基金资产净值	2,423,993.45
期末基金份额净值	1.016
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	1.60%

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

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 期末可供分配利润，为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。

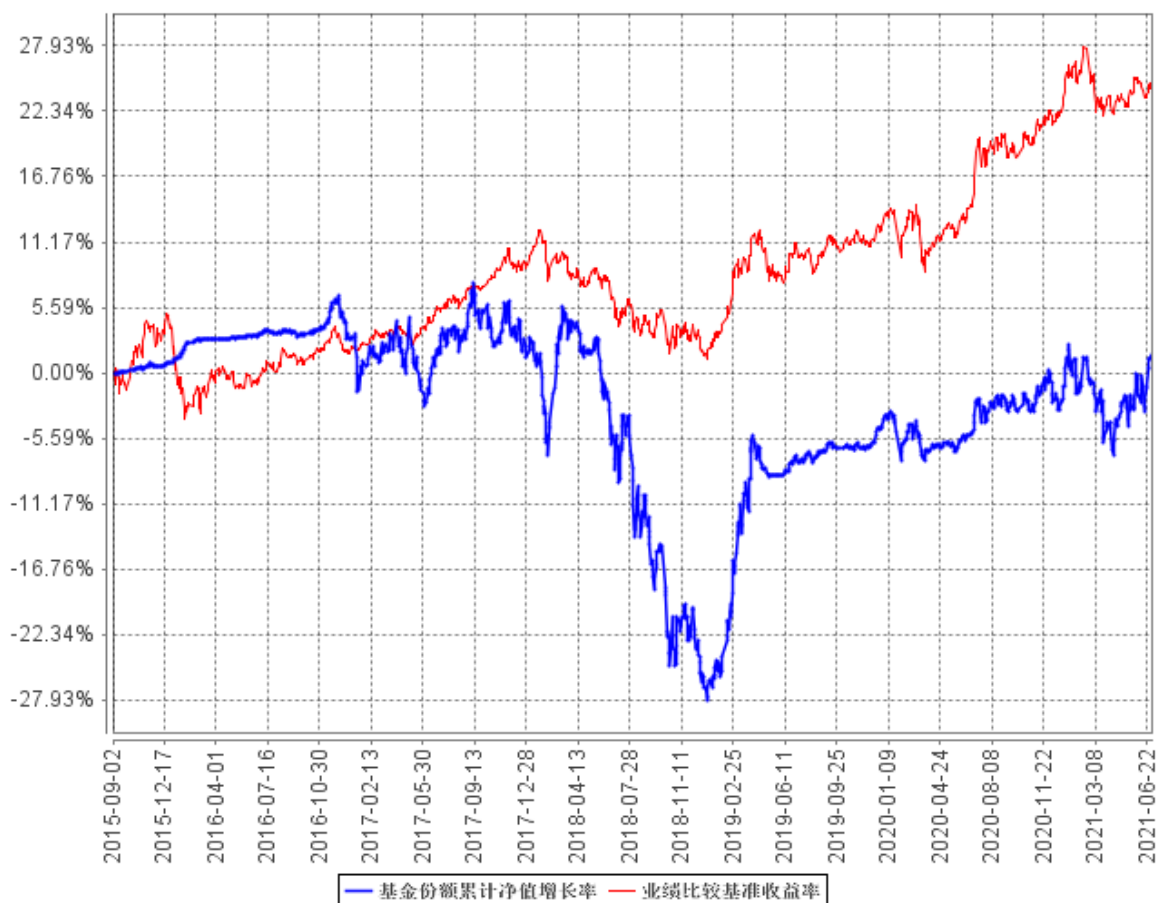
3.2 基金净值表现

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	1.60%	0.87%	-0.51%	0.24%	2.11%	0.63%
过去三个月	6.50%	0.86%	1.36%	0.29%	5.14%	0.57%
过去六个月	2.83%	0.83%	0.82%	0.39%	2.01%	0.44%
过去一年	7.06%	0.66%	8.68%	0.40%	-1.62%	0.26%
过去三年	7.29%	0.78%	18.01%	0.41%	-10.72%	0.37%
自基金合同生效起至今	1.60%	0.67%	24.56%	0.39%	-22.96%	0.28%

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：本基金的基金合同自 2015 年 9 月 2 日起生效。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

华融基金管理有限公司（以下简称“华融基金”）成立于 2019 年 3 月 1 日，是经中国证监会批准设立的首家及目前唯一一家落户雄安新区的公募基金管理公司及全国性证券类法人机构。公司股东为华融证券股份有限公司，持股比例 100%，公司注册资本人民币 2 亿元。

华融基金以“深植雄安、服务雄安”为己任，秉承“诚信、尽责、专业、奋进”的企业精神，致力于通过创新公募基金产品设计开发，引导社会资源配置，切实服务于供给侧结构性改革、产业结构转型升级与创新引领以及雄安新区建设发展等国家战略，推进创新科技和经济社会融合发展，努力为机构和个人投资者提供长期稳健的投资回报，打造雄安特色优秀公募基金管理公司。

截至报告期末，华融基金旗下管理 5 只公募基金产品，为华融现金增利货币市场基金、华融新锐灵活配置混合型证券投资基金、华融新利灵活配置混合型证券投资基金、华融雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金、华融荣赢 63 个月定期开放债券型证券投资基金。

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		
毕子男	本基金的基金经理、首席投资官	2021 年 3 月 3 日	-	24	毕子男，吉林大学经济学博士、高级经济师，24 年证券从业经验。2020 年 3 月加入华融基金管理有限公司，现任华融基金管理有限公司首席投资官。2021 年 3 月 3 日起担任华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。历任东北证券公司创新业务部总经理、金融与产业研究所常务副所长，华融证券股份有限公司市场研究部副总经理、资产管理二部总经理。
范贵龙	本基金的基金经理、权益投资部负责	2019 年 4 月 24 日	2021 年 3 月 3 日	12	范贵龙，武汉大学金融学硕士，特许金融分析师（CFA），金融风险管理师（FRM），12 年证券从业经验。2009 年 6 月加入华融

	人			证券股份有限公司，2020年3月加入华融基金管理有限公司，现任权益投资部负责人。2015年9月2日至2017年6月2日、2019年4月24日至2021年3月3日任华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年4月15日至今任华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理。历任中国建设银行股份有限公司西安新城支行客户经理、国务院发展研究中心信息网金融部研究员、华融证券股份有限公司市场研究部研究员、资产管理二部投资经理助理、基金业务部基金经理。
--	---	--	--	--

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职日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截止本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规规定及《华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研

究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对证券交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内基金管理人管理的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

本报告期内，面对振荡分化特征明显的市场格局，本基金采取了相对积极的稳健策略，紧跟经济和市场变化，在上半年实现了较好的投资收益，累计净值增长率超越本基金业绩比较基准。

本基金以保持净值的稳健增长为主要目标，旨在通过灵活主动投资分享中国经济增长红利。

本基金在投资标的的选择上兼顾价值性与成长性，优先布局在以下方面：核心资产（具有垄断优势、技术优势、规模优势的行业、子行业龙头股）、战略新兴产业（重点是新能源和电动车产业链）、具有资源垄断优势的上游有色金属、稀有金属行业、具有国产替代趋势的电子半导体行业以及具有核心竞争力的中游高端制造行业；同时重点关注医药和金融行业的投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.016 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.83%，业绩比较基准收益率为 0.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年以来，国内经济持续修复，上半年 GDP 同比增长达 12.7%，但伴随基数上升，经济增速逐季回落，二季度宏观经济同比增长 7.9%，较一季度有所放缓；从供需两端看，供需缺口有所收窄但需求修复仍弱于生产。通胀方面，上半年 CPI 同比上涨 0.5%，同比增速有所回落；PPI 同比上涨 5.1%，同比增速显著提升，但 6 月有所回落。后续 CPI 总体可控，受全球产需错配修正及国内微观主体弱修复影响，PPI 持续攀升的可能性较低。整体看，国内经济后续生产端或延续扩

张放缓态势，需求端总体或仍处于弱修复区间，经济增速或面临一定边际回落压力。

上半年，伴随国内经济持续稳定修复，货币政策逐步回归常态，整体维持稳健基调，央行更加注重政策操作的有效性和精准性。7 月份全面降准为经济提供流动性支持，进一步促进资金成本稳中有降。展望三季度，货币政策总体目标或将延续稳健基调，注重总量适度 and 精准导向，资金面有望维持中性略宽松局面。

2021 年上半年市场风格演绎呈现分化走势：代表价值股的指数表现相对暗淡，上证 50 指数下跌 3.9%，沪深 300 上涨 0.24%；以成长股为主的创业板和科创板整体表现亮眼，其中创业板指涨幅 17.22%，市盈率已来到历史高分位水平，科创 50 指数涨幅 14.01%。

展望下半年，市场风格有望在聚焦行业景气度的前提下，逐步走向再平衡。一方面，以新能源、芯片为首的成长板块有望在高景气度和盈利高增长预期下延续行情，估值历史高位也将使得板块波动加剧；另一方面，部分高景气、估值相对合理的金融、消费行业有望迎来资金的重新布局。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会（主任委员由公司总经理担任，副主任由公司分管基金运营部的部门领导担任，委员由基金运营部负责人、投资总监、基金经理和基金会计组成），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。基金运营部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内依据基金合同的约定和基金运作情况，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

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本基金自 2017 年 9 月 5 日起存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。依据《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会

报备。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华融基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华融基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华融基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华融新利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	207,888.09	300,987.38
结算备付金		32,415.77	128,054.69
存出保证金		3,218.55	890.05
交易性金融资产	6.4.7.2	1,524,749.00	2,472,974.00
其中：股票投资		1,523,749.00	2,157,479.00
基金投资		-	-
债券投资		1,000.00	315,495.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	500,000.00	1,100,000.00
应收证券清算款		314,379.05	337.43
应收利息	6.4.7.5	200.89	4,334.67
应收股利		-	-
应收申购款		198.80	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,583,050.15	4,007,578.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		80,340.62	54,694.72
应付赎回款		3,767.56	393.28
应付管理人报酬		1,208.38	1,979.37
应付托管费		302.10	494.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,971.27	4,208.98
应交税费		-	5.36

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	64,466.77	40,000.99
负债合计		159,056.70	101,777.59
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,386,462.18	3,954,546.23
未分配利润	6.4.7.10	37,531.27	-48,745.60
所有者权益合计		2,423,993.45	3,905,800.63
负债和所有者权益总计		2,583,050.15	4,007,578.22

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.016 元，基金份额总额 2,386,462.18 份。

6.2 利润表

会计主体：华融新利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		188,011.42	-56,363.97
1.利息收入		9,305.27	34,311.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,244.32	5,180.04
债券利息收入		1,065.20	9,992.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,995.75	19,138.82
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		262,855.50	55,303.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	244,849.49	40,779.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,706.70	8,160.53
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	12,299.31	6,363.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-85,083.96	-146,069.02
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	934.61	89.84
减：二、费用		113,971.10	24,605.83

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,821.24	15,933.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,955.31	3,983.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	29,410.94	4,714.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.84	5.98
7. 其他费用	6.4.7.20	74,781.77	-30.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		74,040.32	-80,969.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		74,040.32	-80,969.80

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华融新利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）	3,954,546.23	-48,745.60	3,905,800.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	74,040.32	74,040.32
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）	-1,568,084.05	12,236.55	-1,555,847.50
其中：1.基金申购款	340,119.66	-8,924.61	331,195.05
2.基金赎回款	-1,908,203.71	21,161.16	-1,887,042.55
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）	2,386,462.18	37,531.27	2,423,993.45

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)	6,759,622.56	-265,800.87	6,493,821.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-80,969.80	-80,969.80
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)	-1,856,106.63	98,795.93	-1,757,310.70
其中：1.基金申购款	32,655.07	-1,624.97	31,030.10
2.基金赎回款	-1,888,761.70	100,420.90	-1,788,340.80
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)	4,903,515.93	-247,974.74	4,655,541.19

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：

_____ 丁卓 _____	_____ 单国巍 _____	_____ 张毅 _____
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

华融新利灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 8 月 5 日经中国证监会（证监许可[2015]1907 号文）核准，由华融证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具信会师报字[2015]第 725475 号验资报告。经向中国证监会备案，《华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 9 月 2 日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。截止 2015 年 9 月 1 日，本基金募集资金人民币 263,756,837.54 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 11,080.92 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 263,756,837.54 元，折合 263,756,837.54 份基金份额。本基金的基金管理人为华融证券股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金于 2019 年 8 月 20 日在中国证监会变更注册（证监许可[2019]1524 号文），于 2019 年 11 月 13 日公告基金份额持有人大会决议生效，于 2020 年 4 月 27 日公告变更基金管理人为华融基金管理有限公司。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、债券、货币市场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，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的其它品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金将基金资产的 0%-95%投资于股票，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 30%+1 年期人民币定期存款基准利率 \times 70%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本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”）并参考中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》的规定而编制。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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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净值变动情况。

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

本基金财务报表的编制所遵循的会计政策与上年度会计报表相一致未发生变动。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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[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。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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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	207,888.09
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：	207,888.09

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	1,496,651.69	1,523,749.00	27,097.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,000.00	-
	银行间市场	-	-
	合计	1,000.00	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,497,651.69	1,524,749.00	27,097.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期无衍生金融资产/负债余额。

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	500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均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	127.44
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	13.14
应收债券利息	0.07
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	58.98
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	1.26
合计	200.89

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	8,971.27
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,971.27

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	64,466.77
合计	64,466.77

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	3,954,546.23	3,954,546.23
本期申购	340,119.66	340,119.66
本期赎回(以“-”号填列)	-1,908,203.71	-1,908,203.71
- 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	2,386,462.18	2,386,462.18

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	-79,594.62	30,849.02	-48,745.60
本期利润	159,124.28	-85,083.96	74,040.32
本期基金份额交易产生的变动数	26,871.69	-14,635.14	12,236.55
其中：基金申购款	-814.25	-8,110.36	-8,924.61
基金赎回款	27,685.94	-6,524.78	21,161.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	106,401.35	-68,870.08	37,531.27

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	1,649.44
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	576.32
其他	18.56
合计	2,244.32

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	11,389,577.82
减：卖出股票成本总额	11,144,728.33
买卖股票差价收入	244,849.49

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	5,706.70
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	5,706.70

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	339,173.18
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	330,164.71
减：应收利息总额	3,301.77
买卖债券差价收入	5,706.70

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——赎回价差收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未产生资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期末未产生贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

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	12,299.31
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	12,299.31

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	-85,083.96
——股票投资	-81,753.67
——债券投资	-3,330.29
——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	-85,083.96

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	934.61
转换费收入	-
合计	934.61

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	29,410.94
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	29,410.94

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	39,671.58
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
帐户维护费	9,000.00
银行费用	1,315.00
其他手续费	-
-	-
合计	74,781.77

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不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。

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
华融基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华融证券股份有限公司	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
华融证券	-	-	2,842,896.00	93.03%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
华融证券	-	-	475,291.72	64.22%

6.4.10.1.3 债券回购交易

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	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华融证券	-	-	101,100,000.00	47.85%

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期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
-	-	-	-	-
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
华融证券	2,222.51	93.75%	-	-

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	7,821.24	15,933.12
其中：支付销售机构的客户维护费	3,102.36	3,506.36

注：①支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理费计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销

售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,955.31	3,983.24

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期及上年度可比期间，本基金未产生销售服务费。

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

本基金本报告期无证券出借业务。

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

本基金本报告期无证券出借业务。

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自有资金投资本基金的情况

本基金于本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	207,888.09	1,649.44	657,931.39	3,737.26

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内未有其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

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

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021 年 6 月 16 日	2021 年 7 月 1 日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

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

截至本报告期末，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截止本报告期末，本基金未参与转融通证券出借业务。

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

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以合规与风险控制委员会为核心，由合规与风险控制委员会、督察长、风险管理部、法律合规/监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合法律法规的要求、监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系，对发行人及债券进行内部评级，控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在托管行。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并设定交易额度，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不超过该证券的 10%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

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	1,000.00	143,852.00
AAA 以下	-	1,000.00
未评级	-	-
合计	1,000.00	144,852.00

注：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

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持的全部证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

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岗位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%。

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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理办法：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；在开展逆回购交易时，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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	207,888.09	-	-	-	-	-	207,888.09
结算备付金	32,415.77	-	-	-	-	-	32,415.77
存出保证金	3,218.55	-	-	-	-	-	3,218.55
交易性金融资产	-	-	-	-	1,000.00	1,523,749.00	1,524,749.00
买入返售金融资产	500,000.00	-	-	-	-	-	500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	314,379.05	314,379.05
应收利息	-	-	-	-	-	200.89	200.89
应收申购款	-	-	-	-	-	198.80	198.80
资产总计	743,522.41	-	-	-	1,000.00	1,838,527.74	2,583,050.15
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	80,340.62	80,340.62
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,767.56	3,767.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,208.38	1,208.38
应付托管费	-	-	-	-	-	302.10	302.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,971.27	8,971.27
其他负债	-	-	-	-	-	64,466.77	64,466.77
负债总计	-	-	-	-	-	159,056.70	159,056.70
利率敏感度缺口	743,522.41	-	-	-	1,000.00	1,679,471.04	2,423,993.45
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	300,987.38	-	-	-	-	-	300,987.38
结算备付金	128,054.69	-	-	-	-	-	128,054.69
存出保证金	890.05	-	-	-	-	-	890.05
交易性金融资产	99,990.00	-	70,653.00	142,852.00	2,000.00	2,157,479.00	2,472,974.00

买入返售金融资产	1,100,000.00	-	-	-	-	-	1,100,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	337.43	337.43
应收利息	-	-	-	-	-	4,334.67	4,334.67
资产总计	1,629,922.12	-	70,653.00	142,852.00	2,000.00	2,162,151.10	4,007,578.22
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	54,694.72	54,694.72
应付赎回款	-	-	-	-	-	393.28	393.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,979.37	1,979.37
应付托管费	-	-	-	-	-	494.89	494.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,208.98	4,208.98
应交税费	-	-	-	-	-	5.36	5.36
其他负债	-	-	-	-	-	40,000.99	40,000.99
负债总计	-	-	-	-	-	101,777.59	101,777.59
利率敏感度缺口	1,629,922.12	-	70,653.00	142,852.00	2,000.00	2,060,373.51	3,905,800.63

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	14.34	854.89
	利率上升 25 个基点	-14.11	-848.78

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

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以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	1,523,749.00	62.86	2,157,479.00	55.24
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,000.00	0.04	315,495.00	8.08
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	1,524,749.00	62.90	2,472,974.00	63.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	42,419.89	54,681.21
2. 沪深 300 指数下降 5%	-42,419.89	-54,681.21	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	1,523,749.00	58.99
	其中：股票	1,523,749.00	58.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,000.00	0.04
	其中：债券	1,000.00	0.04
	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	500,000.00	19.36
	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	240,303.86	9.30
8	其他各项资产	317,997.29	12.31
9	合计	2,583,050.15	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	-	-
B	采矿业	35,550.00	1.47
C	制造业	937,813.00	38.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	49,250.00	2.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	334,500.00	13.80
K	房地产业	104,000.00	4.29
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	62,636.00	2.58
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	1,523,749.00	62.86

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投资股票。

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	占基金资产净值比例（%）
1	600926	杭州银行	8,000	118,000.00	4.87
2	600919	江苏银行	16,000	113,600.00	4.69
3	300122	智飞生物	600	112,038.00	4.62
4	000671	阳光城	20,000	104,000.00	4.29
5	002966	苏州银行	14,000	102,900.00	4.25
6	300083	创世纪	9,000	98,550.00	4.07
7	002709	天赐材料	700	74,606.00	3.08
8	300724	捷佳伟创	600	69,606.00	2.87
9	603259	药明康德	400	62,636.00	2.58
10	002049	紫光国微	400	61,676.00	2.54
11	300450	先导智能	1,000	60,140.00	2.48
12	300776	帝尔激光	400	59,744.00	2.46
13	600219	南山铝业	16,000	57,600.00	2.38
14	002597	金禾实业	1,500	52,050.00	2.15
15	603308	应流股份	2,500	51,625.00	2.13
16	002245	蔚蓝锂芯	2,500	49,250.00	2.03
17	002430	杭氧股份	1,200	41,508.00	1.71
18	601225	陕西煤业	3,000	35,550.00	1.47
19	002407	多氟多	1,000	35,540.00	1.47
20	300124	汇川技术	450	33,417.00	1.38
21	300763	锦浪科技	170	30,702.00	1.27
22	000933	神火股份	3,000	28,350.00	1.17
23	601689	拓普集团	700	26,201.00	1.08
24	688005	容百科技	200	24,240.00	1.00
25	600409	三友化工	2,000	20,220.00	0.83

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	600409	三友化工	313,996.00	8.04
2	300122	智飞生物	291,483.00	7.46
3	300083	创世纪	241,850.00	6.19
4	600926	杭州银行	213,270.00	5.46
5	000807	云铝股份	195,480.00	5.00
6	600919	江苏银行	195,330.00	5.00
7	002245	蔚蓝锂芯	191,593.00	4.91
8	600438	通威股份	189,720.00	4.86
9	601009	南京银行	189,504.00	4.85
10	000933	神火股份	186,966.00	4.79
11	601233	桐昆股份	177,773.00	4.55
12	002597	金禾实业	177,105.00	4.53
13	002444	巨星科技	169,640.00	4.34
14	000301	东方盛虹	168,774.00	4.32
15	002709	天赐材料	168,177.00	4.31
16	000725	京东方 A	164,600.00	4.21
17	003022	联泓新科	162,560.00	4.16
18	601899	紫金矿业	162,360.00	4.16
19	000683	远兴能源	151,800.00	3.89
20	603393	新天然气	150,275.00	3.85
21	603799	华友钴业	147,547.00	3.78
22	600219	南山铝业	145,260.00	3.72
23	002966	苏州银行	144,720.00	3.71
24	002049	紫光国微	137,420.00	3.52
25	300450	先导智能	130,389.00	3.34
26	002460	赣锋锂业	128,403.00	3.29
27	601988	中国银行	128,000.00	3.28
28	601225	陕西煤业	112,365.00	2.88
29	601939	建设银行	111,200.00	2.85

30	002643	万润股份	109,950.00	2.82
31	002407	多氟多	105,632.00	2.70
32	002043	兔宝宝	104,360.00	2.67
33	000671	阳光城	104,100.00	2.67
34	600887	伊利股份	99,498.00	2.55
35	000002	万科 A	98,750.00	2.53
36	002532	天山铝业	96,815.00	2.48
37	600985	淮北矿业	95,300.00	2.44
38	603218	日月股份	93,264.00	2.39
39	300724	捷佳伟创	92,735.00	2.37
40	603308	应流股份	92,685.00	2.37
41	600507	方大特钢	92,652.00	2.37
42	601336	新华保险	90,431.00	2.32
43	002192	融捷股份	89,829.00	2.30
44	000858	五粮液	88,726.00	2.27
45	300776	帝尔激光	87,796.00	2.25
46	002241	歌尔股份	87,375.00	2.24
47	601012	隆基股份	85,960.00	2.20
48	601618	中国中冶	79,650.00	2.04
49	600516	方大炭素	79,620.00	2.04
50	600823	世茂股份	78,990.00	2.02

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600409	三友化工	293,310.00	7.51
2	601009	南京银行	232,552.00	5.95
3	600519	贵州茅台	231,498.00	5.93
4	600030	中信证券	211,715.00	5.42
5	000301	东方盛虹	198,445.00	5.08
6	000807	云铝股份	195,430.00	5.00
7	300122	智飞生物	193,685.00	4.96
8	600438	通威股份	191,489.00	4.90
9	601233	桐昆股份	181,183.00	4.64
10	000683	远兴能源	178,860.00	4.58

11	003022	联泓新科	173,570.60	4.44
12	002245	蔚蓝锂芯	173,486.00	4.44
13	601939	建设银行	171,970.00	4.40
14	601899	紫金矿业	162,690.00	4.17
15	000725	京东方 A	160,340.00	4.11
16	002444	巨星科技	159,662.00	4.09
17	002332	仙琚制药	155,978.00	3.99
18	603799	华友钴业	153,632.00	3.93
19	000933	神火股份	149,126.00	3.82
20	603393	新天然气	147,006.00	3.76
21	601336	新华保险	146,132.00	3.74
22	300083	创世纪	137,090.00	3.51
23	002460	赣锋锂业	133,965.00	3.43
24	601988	中国银行	128,300.00	3.28
25	000858	五粮液	125,913.00	3.22
26	600276	恒瑞医药	122,277.00	3.13
27	002597	金禾实业	121,715.00	3.12
28	002142	宁波银行	119,699.00	3.06
29	002709	天赐材料	118,687.00	3.04
30	601211	国泰君安	117,390.00	3.01
31	601318	中国平安	115,934.00	2.97
32	002043	兔宝宝	107,160.00	2.74
33	601012	隆基股份	106,423.60	2.72
34	002643	万润股份	104,484.00	2.68
35	000001	平安银行	98,697.00	2.53
36	002532	天山铝业	96,750.00	2.48
37	002192	融捷股份	96,011.00	2.46
38	002241	歌尔股份	95,276.00	2.44
39	600985	淮北矿业	95,000.00	2.43
40	600309	万华化学	94,213.00	2.41
41	600009	上海机场	93,831.00	2.40
42	603218	日月股份	91,557.00	2.34
43	002407	多氟多	91,476.00	2.34
44	600660	福耀玻璃	90,274.00	2.31
45	600507	方大特钢	90,204.00	2.31
46	600887	伊利股份	90,061.00	2.31
47	000002	万科 A	87,150.00	2.23
48	002049	紫光国微	87,040.00	2.23

49	600048	保利地产	87,020.00	2.23
50	601618	中国中冶	84,000.00	2.15
51	600516	方大炭素	83,310.00	2.13
52	600926	杭州银行	82,810.00	2.12
53	300274	阳光电源	79,404.00	2.03
54	600919	江苏银行	78,830.00	2.02
55	300298	三诺生物	78,426.00	2.01

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	10,592,752.00
卖出股票收入（成交）总额	11,389,577.82

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,000.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000.00	0.04

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	113050	南银转债	10	1,000.00	0.04

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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投资。

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持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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**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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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**

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

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未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,218.55
2	应收证券清算款	314,379.05
3	应收股利	-
4	应收利息	200.89
5	应收申购款	198.80
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	317,997.29

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
346	6,897.29	0.00	0.00%	2,386,462.18	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	247,984.25	10.3900%

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	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年9月2日）基金份额总额	263,756,837.54
本报告期期初基金份额总额	3,954,546.23
本报告期基金总申购份额	340,119.66
减：本报告期基金总赎回份额	1,908,203.71
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	2,386,462.18

§ 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

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

本报告期内，本基金管理人根据工作需要，于 2021 年 3 月 11 日任命丁卓先生担任本基金管理人的总经理，免去李骥先生总经理职务。2021 年 4 月 19 日任命毕子男先生担任本基金管理人的首席投资官。2021 年 6 月 2 日决定由总经理丁卓先生代为履行本基金管理人董事长职务，免去冷慧卿女士董事长职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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

本报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	9,872,872.00	44.93%	7,219.93	44.93%	-
财达证券	2	7,151,891.60	32.55%	5,230.21	32.55%	-
天风证券	1	4,949,921.22	22.53%	3,619.64	22.52%	-
华融证券	2	-	-	-	-	-

注:1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 租用证券公司交易单元的选择标准：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 10 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证券监督管理委员会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需
要，并能为基金提供全面的信息服
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场投资策略、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求提供专门研究报告；
- (7) 收取的佣金率符合市场平均水平。

3. 交易单元选择程序：我司根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

4. 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：新增财达证券交易单元 2 个。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

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
中泰证券	73,479.30	31.15%	27,300,000.00	61.76%	-	-
财达证券	-	-	1,300,000.00	2.94%	-	-
天风证券	162,395.19	68.85%	15,600,000.00	35.29%	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-

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	华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 22 日
2	华融基金管理有限公司旗下基金	中国证券报、证券时报、上海	2021 年 1 月 22 日

	2020 年 4 季度报告提示性公告	证券报	
3	华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 4 日
4	华融新利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 4 日
5	关于华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 4 日
6	华融基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 12 日
7	华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
8	华融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、证券时报、上海证券报	2021 年 3 月 31 日
9	华融基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 21 日
10	华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 22 日
11	华融基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021 年 4 月 22 日
12	华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 27 日
13	华融新利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 27 日
14	华融基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 4 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	2021.1.1~2021.2.3	946,969.70	-	946,969.70	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在持有人大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，存在流动性风险，且在特定市场条件下，若基金管理人及时变现基金资产，存在基金净值波动风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件
- 2、《华融新利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 4、《华融新利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

12.2 存放地点

上述备查文件存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站(www.hr-fund.com.cn)查阅。

华融基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日