

华富价值增长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：华富基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 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情况	46
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
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	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华富价值增长混合
基金主代码	410007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 7 月 15 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	192,548,951.21 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于价值相对低估且能为股东创造持续稳定回报的公司，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用较为灵活的投资策略。在资产配置中，本基金采用自上而下的方式，通过分析证券市场投资环境，预测股票市场和债券市场未来收益和风险，确定资产配置方案；在股票选择中，本基金采用定量分析、定性分析和实地调研等方法，自下而上，精选个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于灵活配置混合型证券投资基金，一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	满志弘	李帅帅
	联系电话	021-68886996	0755-25878287
	电子邮箱	manzh@hffund.com	LISHUAI@PINGAN.COM.CN
客户服务电话		400-700-8001	95511-3
传真		021-68887997	0755-82080387
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码		200120	518001
法定代表人		赵万里	谢永林

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	http://www.hffund.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	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	19,086,138.47
本期利润	78,360,386.85
加权平均基金份额本期利润	0.7045
本期加权平均净值利润率	27.57%
本期基金份额净值增长率	23.60%
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	165,954,390.15
期末可供分配基金份额利润	0.8619
期末基金资产净值	559,504,798.81
期末基金份额净值	2.9058
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	403.58%

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) 以上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（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数，表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日。

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	7.04%	1.19%	-1.13%	0.48%	8.17%	0.71%
过去三个月	21.18%	1.15%	2.68%	0.59%	18.50%	0.56%

过去六个月	23.60%	1.49%	1.31%	0.79%	22.29%	0.70%
过去一年	38.43%	1.50%	16.48%	0.80%	21.95%	0.70%
过去三年	158.22%	1.62%	36.72%	0.81%	121.50%	0.81%
自基金合同生效起至今	403.58%	1.60%	69.34%	0.89%	334.24%	0.71%

注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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



注：根据《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金股票投资占基金资产的比例为 30%-80%；债券、现金、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-70%；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，基金保留的现金以及投资于到期日一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2009 年 7 月 15 日到 2010 年 1 月 15 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§ 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

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金和华富新能源股票型发起式证券投资基金共四十六只基金。

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		
陈 启明	华富价值增长灵活配置混合型基金基金经理、华富成长趋势混合型基金基金经理、华富产业升级灵活配置混合型基金基金经理、华富天鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富成长企业精选股票型基金基金经理、公司公募投资决策委员会委员、公司总经理助理、权益投资部总监	2014 年 9 月 26 日	-	十五年	复旦大学会计学硕士，本科学历。历任日盛嘉富证券上海代表处研究员、群益证券上海代表处研究员、中银国际证券产品经理。2010 年 2 月加入华富基金管理有限公司，曾任行业研究员、研究发展部副总监，2013 年 3 月 1 日至 2014 年 9 月 25 日任华富成长趋势股票型基金基金经理助理，2015 年 5 月 11 日至 2019 年 7 月 19 日任华富竞争力优选混合型基金基金经理，2015 年 8 月 4 日至 2019 年 7 月 19 日任华富健康文娱灵活配置混合型基金基金经理。

注：这里的任职日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上，证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，尽管国内疫情局部反复，并且面临的国际政治经济环境更趋严峻，但在我国扎实推进疫情防控工作，保持宏观政策连续性稳定性，上半年内需总体保持复苏，同时在全球经济加快复苏及供给短期紧张的情况下，国内出口超预期，整体经济继续保持稳定恢复态势。拆分内需来看，消费保持温和修复态势，但恢复情况低于预期，投资整体平稳，主要是房地产投资提供了主要支撑，出口仍为拉动经济的重要力量。1-6 月社会消费品零售总额同比增长 23%，两年平均增长 4.3%，增速与 2019 年同期水平（8.4%）相比仍有较大差距，反应消费复苏整体仍然比较弱，具体细项来看，汽车销量不断走低，但是新能源销售情况良好，房地产带动家具、家电、建材等住房相关消费表现较好，但出行、住宿、接触式、服务类线下消费仍然受疫情反复影响弱于疫情前。1-6 月全国固定资产投资（不含农户）同比增长 12.6%，两年平均增长 4.6%，增速低于 2019 年同期水平（5.8%），1-6 月房地产开发投资同比增长 15%，两年平均增长 8.6%，表现出较强韧性，主要是房地产销售旺盛导致房地产资金来源稳定增长有关，1-6 月制造业投资同比增长 19.2%，两年平均增长 2.6%，实现转正，反应在外需回暖、企业利润改善等因素影响下，制造业投资持续回暖，但大宗商品价格上涨等原因导致回暖速度略低于预期，1-6 月基础设施投资（不含电力、热力、燃气及水生产和供应业）同比增长 7.8%，两年平均增长 2.4%，受地方债发行后置、优质项目有限等影响，基建投资较为低迷。1-6 月出口累计增长 38.6%，两年平均增长 14.8%，受海外需求复苏叠加全球供应链紧张，出口成为了上半年拉动我国经济的重要力量。

市场方面，上半年呈现先抑后扬走势，大部分指数收红，其中上证、沪深 300、创业板指最

终分别录得 1.65%、-2.46%、10.98% 的表现。行业方面，中信一级行业指数涨幅居前 5 位的依次为基础化工、钢铁、有色金属、电力设备及新能源和煤炭，涨幅分别为 26.08%、23.54%、22.03%、20.77% 和 17.57%。下跌方面，非银行金融、家电、国防军工、农林牧渔和综合金融跌幅居前，分别下跌 20.19%、16.95%、15.83%、10.11% 和 8.50%。

不断深挖基本面有望持续甚至上升的子行业及个股仍然是未来获得期望收益的最大盈利来源。在坚持深度挖掘上市公司成长机会为核心理念的前提下，行业、个股配置更趋向于均衡化，更多考量股票盈利上升空间、持续性及其相对于估值的性价比。赚自己能够赚到的钱，本基金仍然坚持均衡配置理念，不过分倾斜于某些市场高热度板块，全市场范围的寻找稳健高速成长的子赛道，追求胜率提高，以期待获得中长期持续向好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，本基金份额净值为 2.9058 元，累计份额净值为 3.7058 元。报告期，本基金份额净值增长率为 23.60%，同期业绩比较基准收益率为 1.31%。

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，消费、投资等预计将延续改善趋势，两年维度的平均增速将继续回升，内需对于经济的支撑作用将进一步提高，外需由于基数作用的影响增速将有所下滑，对于经济的支撑作用将有所下降。下半年金融形势来看，预计信贷需求保持温和增长，但考虑到货币政策回归常态，叠加去年高基数的影响，预计社融增速难以出现明显反弹，政策利率和市场利率预计将维持平稳，同时需警惕海外影响，尤其是美联储货币政策转向对我国汇率、利率的影响。基金操作上，仍然将基本面的改善及可持续性放在首位，短期重点关注半年报的业绩兑现及预期调整。中国处于经济转型期，坚持认为政策对自主可控新兴产业的支持力度将长期持续，具体来看，5G 的商业化应用、物联网开拓与智能驾驶进入应用起步阶段等将长期推动半导体、AI、新能源、云计算新经济领域景气度持续向上，长期看好。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允

的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方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。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 78,360,386.85 元，期末可供分配利润为 165,954,390.15 元。本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 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：华富价值增长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	103,414,259.05	20,488,164.58

结算备付金		939,955.22	361,718.43
存出保证金		133,341.24	101,950.92
交易性金融资产	6.4.7.2	456,490,404.53	202,906,328.02
其中：股票投资		439,817,942.99	179,762,185.42
基金投资		-	-
债券投资		16,672,461.54	23,144,142.60
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		248,275.32	1,985,499.42
应收利息	6.4.7.5	32,245.08	24,435.72
应收股利		-	-
应收申购款		111,735.45	47,723.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		561,370,215.89	225,915,820.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		845,243.19	713,749.45
应付管理人报酬		571,353.96	280,267.06
应付托管费		95,225.64	46,711.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	256,425.61	49,967.53
应交税费		271.91	549.65
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	96,896.77	122,347.31
负债合计		1,865,417.08	1,213,592.17
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	192,548,951.21	95,576,715.51
未分配利润	6.4.7.10	366,955,847.60	129,125,512.94
所有者权益合计		559,504,798.81	224,702,228.45
负债和所有者权益总计		561,370,215.89	225,915,820.62

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.9058 元，基金份额总额 192,548,951.21 份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：华富价值增长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		81,438,393.65	50,380,209.79
1. 利息收入		184,739.56	105,688.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	159,102.58	98,953.95
债券利息收入		25,636.98	6,734.77
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）		21,885,049.28	14,047,106.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,707,012.32	11,898,112.24
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	6,734,557.85	1,698,867.87
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	1,443,479.11	450,126.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	59,274,248.38	36,060,724.37
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	94,356.43	166,690.52
减：二、费用		3,078,006.80	1,586,632.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,097,732.61	1,042,399.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	349,622.08	173,733.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	536,340.25	310,803.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 税金及附加		92.31	24.20
7. 其他费用	6.4.7.20	94,219.55	59,672.34
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		78,360,386.85	48,793,577.40
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		78,360,386.85	48,793,577.40

注: 后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 华富价值增长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)	95,576,715.51	129,125,512.94	224,702,228.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	78,360,386.85	78,360,386.85
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)	96,972,235.70	159,469,947.81	256,442,183.51
其中: 1. 基金申购款	131,359,688.19	212,141,917.24	343,501,605.43
2. 基金赎回款	-34,387,452.49	-52,671,969.43	-87,059,421.92
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)	192,548,951.21	366,955,847.60	559,504,798.81
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)	52,634,745.75	20,823,015.44	73,457,761.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	48,793,577.40	48,793,577.40
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)	59,061,227.36	53,144,528.28	112,205,755.64
其中：1. 基金申购款	118,348,219.16	99,330,558.01	217,678,777.17
2. 基金赎回款	-59,286,991.80	-46,186,029.73	-105,473,021.53
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)	111,695,973.11	122,761,121.12	234,457,094.23

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：

赵万里

曹华玮

邵恒

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

华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）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[2009]309号）核准，基金合同于2009年7月15日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况经天健光华（北京）会计师事务所审验，并出具《验资报告》（天健华证验（2009）综字第070003号）。有关基金设立等文件已按规定报中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、资产支持证券以及经中国

证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照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》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

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

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1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〔2012〕85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〔2015〕101号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36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〕46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〔2016〕140号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号）、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》（财税〔2016〕70号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税〔2017〕90号）及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（一）自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

（二）对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税；

(三) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 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, 暂减按 25% 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。

主要税种及税率列示如下:

税 种 计 税 依 据 税 率

增值税 金融服务销售额 3%

城市维护建设税 应缴流转税税额 7%

教育费附加 应缴流转税税额 3%

地方教育附加[注] 应缴流转税税额 1%、2%

[注]: 接地方税务局通知, 自 2019 年 7 月 1 日起调整地方教育附加税税率, 由原来的 1% 调整为 2%。

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	103,414,259.05
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	103,414,259.05

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	329,206,492.35	439,817,942.99	110,611,450.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	15,634,430.38	16,672,461.54
	银行间市场	-	-
	合计	15,634,430.38	16,672,461.54
			1,038,031.16

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	344,840,922.73	456,490,404.53	111,649,481.80

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/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

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	18,817.79
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	422.90
应收债券利息	12,944.39
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	60.00
合计	32,245.08

注：本表列示的其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	256,425.61
银行间市场应付交易费用	-

合计	256,425.61
----	------------

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	2,677.22
应付证券出借违约金	-
应付审计费	34,712.18
应付信息披露费	59,507.37
合计	96,896.77

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	95,576,715.51	95,576,715.51
本期申购	131,359,688.19	131,359,688.19
本期赎回（以“-”号填列）	-34,387,452.49	-34,387,452.49
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	192,548,951.21	192,548,951.21

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	64,979,365.19	64,146,147.75	129,125,512.94
本期利润	19,086,138.47	59,274,248.38	78,360,386.85
本期基金份额交易产生的变动数	81,888,886.49	77,581,061.32	159,469,947.81
其中：基金申购款	109,439,281.51	102,702,635.73	212,141,917.24
基金赎回款	-27,550,395.02	-25,121,574.41	-52,671,969.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	165,954,390.15	201,001,457.45	366,955,847.60

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	155,683.81
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	2,537.53
其他	881.24
合计	159,102.58

注：其他所列本期金额为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	13,707,012.32
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	13,707,012.32

6.4.7.12.2 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	114,914,535.48
减：卖出股票成本总额	101,207,523.16
买卖股票差价收入	13,707,012.32

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	6,734,557.85
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	6,734,557.85

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	54,027,930.84
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	47,237,217.43
减：应收利息总额	56,155.56
买卖债券差价收入	6,734,557.85

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

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	1,443,479.11
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,443,479.11

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	59,274,248.38
股票投资	59,287,612.31
债券投资	-13,363.93
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	59,274,248.38

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	94,296.62
基金转换费收入	59.81
合计	94,356.43

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	536,340.25
银行间市场交易费用	-
合计	536,340.25

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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	94,219.55

6.4.7.21 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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
华富基金管理有限公司	基金管理人

平安银行股份有限公司（“平安银行股份有限公司”）	基金托管人
华安证券（“华安证券”）	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华安证券	150,647,336.78	37.71	-	-

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 (%)
华安证券	64,941,736.57	68.82	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内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

注：本基金本报告期和上年度可比期间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 (%)
华安证券	140,246.65	38.17	85,464.96	33.33

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 (%)
-	-	-	-	-

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	2,097,732.61	1,042,399.21
其中：支付销售机构的客户维护费	320,995.24	263,039.37

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

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	349,622.08	173,733.20

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2009 年 7 月 15 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	4,713,904.14	0.00
报告期间申购/买入总份额	2,124,251.05	4,713,904.14
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	4,713,904.14	0.00
报告期末持有的基金份额	2,124,251.05	4,713,904.14
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.10%	4.2200%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求，申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
上海华富利得资产管理有限公司	2,551,680.14	1.33	0.00	0

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

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
平安银行股份有限公司	103,414,259.05	155,683.81	79,933,705.96	97,108.96

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000526	学大教育	2021 年 3 月 19 日	2021 年 9 月 22 日	新股流通受限	38.53	25.07	197,249	7,600,003.97	4,945,032.43	-
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	新股流通受限	24.60	163.00	205	5,043.00	33,415.00	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 12 日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月	2021 年 7 月	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-

		13 日	21 日							
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	24.69	31.71	325	8,024.25	10,305.75	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	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	新股流通受限	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	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	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	新股流通受限	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	新股流通受限	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	新股流通受限	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	新股流通受限	28.77	99.85	206	5,926.62	20,569.10	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股流通受限	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	新股流通受限	47.33	251.96	148	7,004.84	37,290.08	-
300958	建工	2021	2021	新股流	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

	修复	年 3 月 18 日	年 9 月 29 日	通受限						
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股流 通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股流 通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股流 通受限	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	新股流 通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股流 通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股流 通受限	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	新股流 通受限	6.87	12.07	714	4,905.18	8,617.98	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股流 通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股流 通受限	28.28	115.71	153	4,326.84	17,703.63	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股流 通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流 通受限	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	新股流通受限	33.22	87.50	236	7,839.92	20,650.00	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	198	4,930.20	4,912.38	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	245	3,623.55	7,489.65	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	836	4,129.84	10,909.80	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	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	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈	2021	2021	新股流	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-

	仕	年 6 月 4 日	年 12 月 16 日	通受限						
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	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	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	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	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
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	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
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	2,899	27,424.54	27,424.54	-
600905	三峡能源	2021 年 6 月 2 日	2021 年 12 月 10 日	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
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	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688217	睿昂基因	2021 年 5 月 7 日	2021 年 11 月 17 日	新股流通受限	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-

			日							
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	新股流通受限	43.22	63.82	1,476	63,792.72	94,198.32	-
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	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688616	西力科技	2021年3月10日	2021年9月22日	新股流通受限	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-
688656	浩欧博	2021年1月6日	2021年7月13日	新股流通受限	35.26	72.60	1,261	44,462.86	91,548.60	-
688660	电气风电	2021年5月11日	2021年11月19日	新股流通受限	5.44	7.26	10,862	59,089.28	78,858.12	-
688689	银河微电	2021年1月15日	2021年7月27日	新股流通受限	14.01	35.62	2,101	29,435.01	74,837.62	-
688700	东威科技	2021年6月7日	2021年12月15日	新股流通受限	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-

注：实际可流通日以该证券公告为准。本报告期间若有除权，认购价格为除权后价格，数量为期末实际持有数量。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

注：本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末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

本基金在日常经营活动中面临的風險主要包括信用風險、流动性風險及市場風險。本基金管理人已建立董事會領導下的架構清晰、控制有效、系統全面、切實可行的風險控制體系，並設定適當的風險限額及內部控制流程，通過可靠的管理及信息系統持續監控上述各類風險。

董事會下設風險管理委員會，負責對公司風險管理制度進行審查並提供諮詢和建議。總經理下設投資決策委員會和風險控制委員會，負責對公司经营及基金運作中的風險進行研究、評估和監控。公司設督察長，組織、指導公司監察稽核工作，監督檢查基金及公司運作的合法合規情況和公司的內部風險控制情況。公司設有獨立的監察稽核部門，監察稽核部有權對公司各部門內部風險控制制度的建立和落實情況進行檢查，對公司的內部風險控制制度的合理性、有效性進行分析，提出改進意見，上報總經理，通報督察長。

6.4.13.2 信用風險

信用風險是指基金在交易過程中因交易對手未履行合約責任，或者基金所投資證券之發行人出現違約、拒絕支付到期本息，導致基金資產損失和收益變化的風險。本基金均投資於具有良好信用等級的證券，且通過分散化投資以分散信用風險。本基金投資於一家公司發行的證券市值不超過基金資產淨值的 10%，且本基金與由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的證券不得超過該證券的 10%。

本基金在交易所進行的交易均與中國證券登記結算有限責任公司完成證券交收和款項清算，因此違約風險發生的可能性很小；基金在進行銀行間同業市場交易前均對交易對手進行信用評估以控制相應的信用風險。

6.4.13.2.1 按短期信用評級列示的債券投資

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的信用债券

6.4.13.2.2 按短期信用評級列示的資產支持證券投資

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持债券

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单

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	0.00	0.00
AAA 以下	16,672,461.54	23,144,142.60
未评级	0.00	0.00
合计	16,672,461.54	23,144,142.60

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括期末本基金所投资的所有信用产品，具体包括短期融资券、公司债、企业债、可转债、公募可交换债、商业银行债、非银行金融债等债券基金可投资的信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。短期信用产品的长期信用评级指主体评级，长期信用产品的长期信用评级指债券评级。信用等级按期末评级结果列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持债券

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 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，其余均能及时变现。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。本基金所持有的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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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	103,414,259.05	-	-	-	-	-	103,414,259.05
结算备付金	939,955.22	-	-	-	-	-	939,955.22
存出保证金	133,341.24	-	-	-	-	-	133,341.24
交易性金融资产	-	4,642,500.00	12,029,961.54	-	-	439,817,942.99	456,490,404.53
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	32,245.08	32,245.08
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	111,735.45	111,735.45
应收证券清算款	-	-	-	-	-	248,275.32	248,275.32
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	104,487,555.51	4,642,500.00	12,029,961.54	-	-	440,210,198.84	561,370,215.89
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	845,243.19	845,243.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	571,353.96	571,353.96
应付托管费	-	-	-	-	-	95,225.64	95,225.64

应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	256,425.61	256,425.61
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	271.91	271.91
其他负债	-	-	-	-	-	96,896.77	96,896.77
负债总计	-	-	-	-	-	1,865,417.08	1,865,417.08
利率敏感度缺口	104,487,555.51	4,642,500.00	12,029,961.54	-	-	438,344,781.76	559,504,798.81
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	20,488,164.58	-	-	-	-	-	20,488,164.58
结算备付金	361,718.43	-	-	-	-	-	361,718.43
存出保证金	101,950.92	-	-	-	-	-	101,950.92
交易性金融资产	-	-	23,144,142.60	-	-	179,762,185.42	202,906,328.02
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	24,435.72	24,435.72
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	47,723.53	47,723.53
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,985,499.42	1,985,499.42
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	20,951,833.93	-	23,144,142.60	-	-	181,819,844.09	225,915,820.62
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	713,749.45	713,749.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	280,267.06	280,267.06
应付托管费	-	-	-	-	-	46,711.17	46,711.17
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	49,967.53	49,967.53
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	549.65	549.65
其他负债	-	-	-	-	-	122,347.31	122,347.31
负债总计	-	-	-	-	-	1,213,592.17	1,213,592.17
利率敏感度缺口	20,951,833.93	-	23,144,142.60	-	-	180,606,251.92	224,702,228.45

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 除利率外其他市场变量保持不变		
	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）
分析	市场利率下降 25 基点	228,829.53	311,601.16
	市场利率上升 25 基点	-228,829.53	-311,601.16

6.4.13.4.2 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其他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，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.2.1 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	439,817,942.99	78.61	179,762,185.42	80.00
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	16,672,461.54	2.98	23,144,142.60	10.30
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	456,490,404.53	81.59	202,906,328.02	90.30

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变		
	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）
分析	沪深 300 指数上升百分之五	21,119,559.81	4,337,443.02
	沪深 300 指数下降百分之五	-21,119,559.81	-4,337,443.02

6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间（95%）		
	2. 观察期（1 年）		
	—		
分析	风险价值 （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）
	合计	181,613,118.42	79,363,738.14

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 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	439,817,942.99	78.35
	其中：股票	439,817,942.99	78.35
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	16,672,461.54	2.97
	其中：债券	16,672,461.54	2.97
	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	104,354,214.27	18.59
8	其他各项资产	525,597.09	0.09
9	合计	561,370,215.89	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 7.12.3 期末其他各项资产构成。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	18,217,200.00	3.26
C	制造业	304,436,799.11	54.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.92
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	47,258,137.58	8.45
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	48,851,855.24	8.73
J	金融业	97,319.40	0.02
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	49,470.30	0.01
M	科学研究和技术服务业	10,726,400.00	1.92
N	水利、环境和公共设施管理业	39,030.68	0.01

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,945,032.43	0.88
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	439,817,942.99	78.61

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603939	益丰药房	668,800	37,512,992.00	6.70
2	002415	海康威视	518,000	33,411,000.00	5.97
3	300363	博腾股份	388,800	32,705,856.00	5.85
4	603986	兆易创新	168,748	31,707,749.20	5.67
5	000830	鲁西化工	1,188,800	22,266,224.00	3.98
6	002153	石基信息	888,820	20,896,158.20	3.73
7	300750	宁德时代	36,800	19,680,640.00	3.52
8	603501	韦尔股份	58,800	18,933,600.00	3.38
9	601899	紫金矿业	1,880,000	18,217,200.00	3.26
10	300763	锦浪科技	99,960	18,052,776.00	3.23
11	688390	固德威	51,800	17,301,200.00	3.09
12	603799	华友钴业	118,000	13,475,600.00	2.41
13	300454	深信服	50,800	13,181,584.00	2.36
14	688626	翔宇医疗	108,000	13,050,720.00	2.33
15	603915	国茂股份	318,612	12,585,174.00	2.25
16	300274	阳光电源	108,000	12,426,480.00	2.22
17	002049	紫光国微	80,000	12,335,200.00	2.20
18	300215	电科院	1,280,000	10,726,400.00	1.92
19	002353	杰瑞股份	218,000	9,744,600.00	1.74
20	603233	大参林	188,800	9,649,568.00	1.72
21	300911	亿田智能	138,262	9,578,791.36	1.71
22	300124	汇川技术	120,000	8,911,200.00	1.59
23	300894	火星人	118,894	8,084,792.00	1.44
24	002460	赣锋锂业	50,000	6,054,500.00	1.08
25	688111	金山办公	15,000	5,922,000.00	1.06
26	600588	用友网络	158,000	5,255,080.00	0.94
27	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.92
28	000526	学大教育	197,249	4,945,032.43	0.88

29	600570	恒生电子	36,800	3,431,600.00	0.61
30	603808	歌力思	118,000	1,864,400.00	0.33
31	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.03
32	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.03
33	301006	迈拓股份	5,051	154,055.50	0.03
34	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.03
35	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.02
36	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.02
37	688317	之江生物	1,476	94,198.32	0.02
38	688656	浩欧博	1,261	91,548.60	0.02
39	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
40	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.01
41	688660	电气风电	10,862	78,858.12	0.01
42	688689	银河微电	2,101	74,837.62	0.01
43	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
44	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.01
45	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.01
46	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
47	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
48	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
49	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.01
50	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.01
51	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.01
52	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
53	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
54	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.01
55	300957	贝泰妮	148	37,290.08	0.01
56	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
57	300919	中伟股份	205	33,415.00	0.01
58	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
59	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
60	300910	瑞丰新材	214	22,373.70	0.00
61	300979	华利集团	236	20,650.00	0.00
62	300953	震裕科技	206	20,569.10	0.00
63	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
64	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
65	300973	立高食品	153	17,703.63	0.00
66	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
67	300913	兆龙互连	630	16,506.00	0.00
68	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
69	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
70	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00

71	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
72	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
73	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
74	300925	法本信息	481	12,645.49	0.00
75	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
76	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
77	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
78	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
79	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
80	300997	欢乐家	836	10,909.80	0.00
81	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
82	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
83	300932	三友联众	325	10,305.75	0.00
84	605189	富春染织	423	10,190.07	0.00
85	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
86	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
87	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
88	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
89	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
90	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
91	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
92	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
93	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
94	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
95	300968	格林精密	714	8,617.98	0.00
96	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
97	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
98	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
99	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
100	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
101	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
102	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
103	300986	志特新材	245	7,489.65	0.00
104	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
105	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
106	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
107	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
108	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
109	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
110	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
111	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
112	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00

113	300985	致远新能	198	4,912.38	0.00
114	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
115	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
116	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
117	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603939	益丰药房	29,776,840.50	13.25
2	002415	海康威视	21,987,763.00	9.79
3	300454	深信服	13,857,903.00	6.17
4	688390	固德威	12,596,076.58	5.61
5	603915	国茂股份	12,339,302.33	5.49
6	002153	石基信息	12,246,505.00	5.45
7	002049	紫光国微	11,736,805.00	5.22
8	603233	大参林	10,682,740.80	4.75
9	601899	紫金矿业	10,547,900.00	4.69
10	688626	翔宇医疗	10,194,536.15	4.54
11	300274	阳光电源	9,365,323.15	4.17
12	603501	韦尔股份	8,564,117.00	3.81
13	002353	杰瑞股份	8,556,789.00	3.81
14	300911	亿田智能	8,506,216.00	3.79
15	000830	鲁西化工	8,200,381.00	3.65
16	000526	学大教育	7,600,003.97	3.38
17	300124	汇川技术	7,434,940.00	3.31
18	603986	兆易创新	7,164,911.00	3.19
19	300894	火星人	7,010,256.00	3.12
20	000963	华东医药	6,864,966.00	3.06
21	000338	潍柴动力	6,763,390.20	3.01
22	603678	火炬电子	6,481,995.21	2.88
23	300019	硅宝科技	5,797,307.00	2.58
24	000426	兴业矿业	5,420,498.33	2.41
25	300750	宁德时代	5,364,713.00	2.39
26	603799	华友钴业	5,207,864.00	2.32
27	300763	锦浪科技	5,088,824.00	2.26
28	300215	电科院	4,910,163.00	2.19
29	002607	中公教育	4,662,324.00	2.07
30	002460	赣锋锂业	4,661,339.96	2.07
31	600570	恒生电子	4,633,125.00	2.06

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费

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	601899	紫金矿业	8,444,834.50	3.76
2	300274	阳光电源	7,999,268.00	3.56
3	000963	华东医药	6,560,837.38	2.92
4	603308	应流股份	6,261,765.00	2.79
5	300073	当升科技	5,982,605.00	2.66
6	002439	启明星辰	5,468,043.04	2.43
7	300019	硅宝科技	5,311,705.78	2.36
8	000338	潍柴动力	5,217,621.45	2.32
9	300253	卫宁健康	5,059,059.87	2.25
10	600547	山东黄金	4,811,611.94	2.14
11	002607	中公教育	4,669,790.96	2.08
12	603678	火炬电子	4,619,902.69	2.06
13	000426	兴业矿业	4,567,920.51	2.03
14	000603	盛达资源	3,863,435.41	1.72
15	600195	中牧股份	3,786,993.99	1.69
16	603920	世运电路	3,610,917.01	1.61
17	300408	三环集团	2,471,320.00	1.10
18	300740	水羊股份	1,947,820.00	0.87
19	603799	华友钴业	1,732,195.00	0.77
20	600905	三峡能源	1,717,302.60	0.76

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

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	301,975,668.42
卖出股票收入（成交）总额	114,914,535.48

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

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）	16,672,461.54	2.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,672,461.54	2.98

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	123110	九典转债	51,682	7,471,666.74	1.34
2	123066	赛意转债	30,000	4,642,500.00	0.83
3	113585	寿仙转债	32,310	4,558,294.80	0.81

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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本报告期内基金投资的前十名证券中的发行主体包括重庆博腾制药科技股份有限公司。中国证监会重庆监管局于 2020 年 5 月 15 日对重庆博腾制药科技股份有限公司作出了处罚决定。但本基金投资相关证券的投资决策程序符合相关法律、法规的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于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	133,341.24
2	应收证券清算款	248,275.32
3	应收股利	—
4	应收利息	32,245.08
5	应收申购款	111,735.45
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	525,597.09

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	123066	赛意转债	4,642,500.00	0.83
2	113585	寿仙转债	4,558,294.80	0.81

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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

由于计算中四舍五入的原因，本报告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 (%)
14,146	13,611.55	151,489,422.15	78.68	41,059,529.06	21.32

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	208,017.11	0.1080

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	
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（2009 年 7 月 15 日） 基金份额总额	679,121,902.68
本报告期期初基金份额总额	95,576,715.51
本报告期基金总申购份额	131,359,688.19
减：本报告期基金总赎回份额	34,387,452.49
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	192,548,951.21

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；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

本报告期内未召开持有人大会。

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

1. 2021 年 3 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣女士为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
2. 2021 年 3 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陈奇先生为华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
3. 2021 年 3 月 26 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，张亮先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
4. 2021 年 3 月 26 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，张亮先生不再担任华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
5. 2021 年 5 月 7 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘李孝华先生为华富中证 100 指数证券投资基金基金经理。
6. 2021 年 6 月 28 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘李孝华先生为华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
7. 2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副

总裁（主持工作）。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

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

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

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	
华安证券	2	150,647,336.78	37.71%	140,246.65	38.17%	-
申万宏源	1	120,904,927.43	30.26%	110,181.13	29.99%	-
海通证券	1	109,352,025.56	27.37%	99,652.15	27.12%	-
中泰证券	1	18,610,011.30	4.66%	17,331.42	4.72%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

注：1)根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的券商租用了基金专用交易单元。

2) 本报告期本基金无席位变化。

3) 此处的佣金指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券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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
华安证券	64,941,736.57	68.82%	-	-	-	-
申万宏源	5,755,864.97	6.10%	-	-	-	-
海通证券	12,674,287.71	13.43%	-	-	-	-
中泰证券	10,999,257.80	11.66%	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

注：债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

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	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2021倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021年1月4日
2	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行 AI 投服务基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021年1月4日
3	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021年1月4日
4	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与国金证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021年1月16日
5	华富基金管理有限公司旗下全部基金2020年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021年1月22日
6	华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2021年1月22日
7	华富基金管理有限公司关于设立北京	中国证监会指定媒介	2021年1月26日

	分公司的公告		
8	华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 2 月 23 日
9	华富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与科创板股票投资及相关风险提示的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 18 日
10	华富基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 20 日
11	关于华富基金管理有限公司旗下部分基金参加国金证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 26 日
12	华富基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 30 日
13	华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 31 日
14	华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2020 年度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 31 日
15	关于华富基金管理有限公司旗下部分基金参加天风证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 16 日
16	关于华富基金管理有限公司旗下部分基金参加招商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 17 日
17	华富基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第一季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 22 日
18	华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 22 日
19	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
------	----------------	------------

别	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	2021. 1. 1-2021. 6. 30	24, 231, 365. 71	19, 680, 057. 16	0. 00	43, 911, 422. 87	22. 81
	2	2021. 5. 17-2021. 6. 30	0. 00	39, 518, 688. 56	0. 00	39, 518, 688. 56	20. 52
产品特有风险							

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、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅, 相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日