金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金
2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：金元顺安基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2021 年 08 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 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 01 月 01 日起至 2021 年 06 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 8
§3 主要财务指标和基金净值表现 9
3.1 主要会计数据和财务指标 9
3.2 基金净值表现 10
§4 管理人报告 12
4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 14
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17
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 17
§5 托管人报告 18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 18
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 18
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 18
§6 中期财务会计报告（未经审计） 19
6.1 资产负债表 19
6.2 利润表 21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表 23
6.4 报表附注 24
§7 投资组合报告 55
7.1 期末基金资产组合情况 55
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 55
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 57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 67
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 67
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 68
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 68
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 68
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 ..... **错误!未定义书签。**
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... **错误!未定义书签。**
7.12 投资组合报告附注 68
§8 基金份额持有人信息 70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 70
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 70
§9 开放式基金份额变动 71
§10 重大事件揭示 72
10.1 基金份额持有人大会决议 72
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 72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 72
10.4 基金投资策略的改变 72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 72
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 72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 72
10.8 其他重大事件 75
§11 影响投资者决策的其他重要信息 77

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 77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 77
§12 备查文件目录 78
12.1 备查文件目录 78
12.2 存放地点 78
12.3 查阅方式 78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	金元顺安元启灵活配置混合
基金主代码	004685
交易代码	004685
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 11 月 14 日
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	185,752,595.93 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极灵活的资产配置，在严格控制投资组合风险的基础上，力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金通过发掘经济发展及结构转型过程中所显现的投资机会，力争获取持续稳健的投资超额收益。在资产配置方面，本基金根据国内外宏观经济、政策环境、市场运行趋势等因素确定基金的大类资产配置比例。在权益资产投资方面，采用“自上而下”的方式，选择与政策调控、经济发展，深化改革具有相关性较高的行业中的个股进行配置；同时，结合“自下而上”的方式，精选上市公司股票作为投资方向。在债券投资方面，选择具有票息优势的债券品种作为主要的债券投资标的。最后，在综合考量投资组合的风险收益特征基础上，本基金完成组合构建。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%＋中债综合指数收益率×50%

风险收益特征	本基金系混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期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		金元顺安基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	封涌	罗菲菲
	联系电话	021-68881801	010-58560666
	电子邮箱	service@jysa99.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-666-0666	95568
传真		021-68881875	010-58560798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		任开宇	高迎欣

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.jysa99.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	金元顺安基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室

§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 01 月 01 日-2021 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	30,148,474.89
本期利润	34,911,694.88
加权平均基金份额本期利润	0.2173
本期加权平均净值利润率	11.32%
本期基金份额净值增长率	11.35%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末（2021 年 06 月 30 日）**
期末可供分配利润	193,888,987.12
期末可供分配基金份额利润	1.0438
期末基金资产净值	383,545,286.65
期末基金份额净值	2.0648
3.1.3 累计期末指标	**报告期末（2021 年 06 月 30 日）**
基金份额累计净值增长率	106.48%

注：

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

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

3、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 06 月 30 日；

4、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；

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.72%	0.42%	-1.02%	0.40%	1.74%	0.02%
过去三个月	8.21%	0.56%	2.03%	0.49%	6.18%	0.07%
过去六个月	11.35%	0.84%	0.70%	0.66%	10.65%	0.18%
过去一年	47.08%	0.94%	12.51%	0.66%	34.57%	0.28%
过去三年	95.73%	0.86%	26.94%	0.67%	68.79%	0.19%
自基金合同生效起至今	106.48%	0.78%	18.45%	0.66%	88.03%	0.12%

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：

1、本基金合同生效日为 2017 年 11 月 14 日，业绩基准累计增长率以 2017 年 11 月 13 日指数为基准；

2、本基金的投资组合比例为股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 0%－95%，权证投资比例占基金资产净值的比例不超过 3%，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；

3、本基金业绩比较基准为“沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%”。

§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

金元比联基金管理有限公司（以下简称“金元比联”、“公司”或“本基金管理人”，系金元顺安基金管理有限公司前身）成立于 2006 年 11 月，由金元证券股份有限公司（以下简称“金元证券”）与比利时联合资产管理公司（以下简称“比联资管”）共同发起设立的中外合资基金管理有限公司。公司总部设在上海陆家嘴，旗下设立北京分公司及子公司——上海金元百利资产管理有限公司。

2012 年 03 月，经中国证监会核准，比联资管将所持有的金元比联 49%股权转让于惠理基金管理香港有限公司（以下简称“惠理香港”），公司更名为金元惠理基金管理有限公司（以下简称“金元惠理”）。

2012 年 10 月，经中国证监会核准，公司双方股东按持股比例向公司增资人民币 9,500 万元，公司注册资本增加至 24,500 万元。

2016 年 03 月，经中国证监会核准，惠理香港将所持有的金元惠理 49%股权转让于上海泉意金融信息服务有限公司（以下简称“泉意金融”），公司更名为金元顺安基金管理有限公司（以下简称“金元顺安”）。

2017 年 11 月，经中国证监会核准，公司双方股东按持股比例向公司增资人民币 9,500 万元，公司注册资本增加至 34,000 万元。

2020 年 04 月，公司股东泉意金融更名为“上海前易信息咨询服务有限公司”。

金元顺安始终坚持以“取信于市场、取信于社会”作为行为准则，遵循“诚实信用，勤勉尽责，以专业经营方式管理和运作基金财产和客户资产，在合法、合规的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，从而使公司稳步、健康发展”的投资理念。遵守法律、行政法规和中国证券监督管理委员会的规定，遵守社会公德、商业道德，诚实守信，遵循基金份额持有人利益优先、公平对待其管理的不同基金财产和客户资产的原则，接受政府和社会公众的监督，承担社会责任。

截止至 2021 年 06 月 30 日，本基金管理人管理金元顺安宝石动力混合型证券投资基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安价值增长混合型证券投资基金、金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安金元宝货币市场基金、金元顺安沣楹债券型证券投资基金、金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安桉盛债券型证券投资基金、金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安沣顺定期开放债券型发起式证券投资基金、金元顺安沣泰定期开

放债券型发起式证券投资基金、金元顺安沣泉债券型证券投资基金和金元顺安泓丰纯债 87 个月定期开放债券型证券投资基金共 16 只开放式证券投资基金。

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		
缪玮彬	本基金基金经理	2017-11-14	-	23 年	总经理助理，金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，复旦大学经济学硕士。曾任华泰资产管理有限公司固定收益部总经理，宝盈基金管理有限公司研究员，金元证券有限责任公司资产管理部总经理助理，联合证券有限责任公司高级投资经理，华宝信托投资有限责任公司投资经理。2016 年 10 月加入金元顺安基金管理有限公司，历任金元顺安价值增长混合型证券投资基金和金元顺安桉盛债券型证券投资基金的基金经理。23 年基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

注：

1、此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控

制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》，建立了科学完善的制度和流程，从事前、事中、事后等各个业务环节严格控制不同基金之间可能存在的利益输送，覆盖了全部开放式基金及特定客户资产管理组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节。

在投资环节，本基金管理人建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。在交易环节，为确保交易的公平执行，本基金管理人交易管理实行集中交易，投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开，各投资组合的所有证券买卖活动须通过交易部集中统一完成。在报告分析环节，本基金管理人每季度和每年对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异、对连续四个季度期间内、不同时间窗内（日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析，根据收益率差异和交易价差的大小，说明是否符合公平交易的原则，由投资组合经理、分管风险管理副总经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》及其他相关法律法规和公司内部规章制度，制定了《金元顺安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，涵盖了所有可投资证券的一级市场申购、二级市场交易所公开竞价交易、交易所大宗交易、银行间债券交易以及非公开发行股票申购、以公司名义进行的一级市场债券交易等可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本基金管理人采用定量分析和定性分析相结合的方式，建立并严格执行有效的异常交易日常监控制度，形成定期交易监控报告，按照报告路线实行及时报告的机制。

本报告期内，未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年新冠疫情依然在不同国家间大规模流行，出现了间歇性的流行高峰。随着新冠疫苗接种的持续推进，接种率高的国家的疫情得到明显控制，但是随着高接种率国家活动管制的放松，疫情出现了一定程度的反弹，疫苗明显降低了病毒的致死率，同时新冠病毒在疫苗的控制下有长期化的趋势。在此背景下，各国的央行都没有急于退出宽松的货币政策，上半年主要国家长期利率都先上后下，仍旧保持在较低水平。在非常宽松的货币政策刺激下，虽然经济增长在局部领域仍存在结构性困难，但就整体而言景气度较高，较大地支持了我国的外需增长。我国经济在上半年增长动能依然较强，各项经济指标均表现较好，央行通过灵活适度的货币政策给予了略有回落的经济增长以有力支撑。在此经济与政策环境下，上半年债券收益率适度下行，股票指数则震荡上行。本基金在报告期内的策略为保持较高的股票仓位并低配债券资产，股票配置则更加注重估值水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金份额净值为 2.0648 元；

本报告期内，基金份额净值增长率为 11.35%，同期业绩比较基准收益率为 0.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然下半年疫情难见完全控制，并且各国央行暂缓退出宽松政策，但是随着经济活动的逐步正常化和宽松政策的持续发力下，经济将继续保持景气状态，原材料价格和资产价格将继续保持高位并可能续创高点，物价上涨压力延续的时间更长并可能导致进一步的通胀预期产生，并可能带动长期利率的回升。在此之前，债券收益率的当前性价比相对较差，而股票资产的吸引力更佳，股指仍较大可能继续震荡上行，风格上将更趋均衡化。因此本基金在未来将继续保持较高的股票仓位，以估值水平为重要依据之一并尽可能分散化投资，同时继续低配债券资产。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

1、估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由分管运营的副总经理、基金事务部、投资研究部、交易部、风险管理部、监察稽核部等部门总监组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

（1）制定估值制度并在必要时修改；

（2）确保估值方法符合现行法规；

（3）批准证券估值的步骤和方法；

（4）对异常情况做出决策。

分管运营的副总经理担任估值工作小组的组长，分管运营的副总经理在基金事务部总监或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

2、基金事务部的职责分工

基金事务部负责日常证券资产估值。该部门和公司投资部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金事务部定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金事务部职责：

（1）获得独立、完整的证券价格信息；

（2）每日证券估值；

（3）检查价格波动并进行一般准确性评估；

（4）向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；

（5）对每日证券价格信息和估值结果进行记录；

（6）对估值调整和人工估值进行记录；

（7）向估值工作小组报送月度估值报告。

基金事务部总监认为必要时，可以提议召开估值工作小组会议。

3、投资研究部的职责分工

（1）接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问询；

（2）对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；

（3）评价并确认基金事务部提供的估值报告；

（4）向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4、交易部的职责分工

（1）对基金事务部的证券价格信息需求做出即时回应；

（2）通知基金事务部关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；

（3）评价并确认基金事务部提供的估值报告。

5、风险管理部、监察稽核部的职责分工

（1）监督证券的整个估值过程；

（2）确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；

（3）确保公司的估值制度和方法符合现行法律、法规的要求；

（4）评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价值的风险；

（5）对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；

（6）对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.6.2 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,374,802.20	3,509,905.43
结算备付金		6,116,048.65	3,323,302.91
存出保证金		109,168.97	126,303.61
交易性金融资产	6.4.7.2	313,943,662.04	256,811,984.46
其中：股票投资		287,782,462.04	211,055,219.46
基金投资		-	-
债券投资		26,161,200.00	45,756,765.00
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	58,000,000.00	6,000,000.00
应收证券清算款		3,210,052.25	2,852,014.84
应收利息	6.4.7.5	581,831.08	469,898.77
应收股利		-	-

应收申购款		1,208,146.89	81,799.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		390,543,712.08	273,175,209.95
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 06 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		17,908.00	2,994,725.11
应付赎回款		6,247,186.40	713,680.85
应付管理人报酬		478,269.79	356,249.14
应付托管费		31,884.66	23,749.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	133,916.43	96,166.94
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	89,260.15	175,000.00
负债合计		6,998,425.43	4,359,572.03

所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	185,752,595.93	144,959,649.81
未分配利润	6.4.7.10	197,792,690.72	123,855,988.11
所有者权益合计		383,545,286.65	268,815,637.92
负债和所有者权益总计		390,543,712.08	273,175,209.95

注：

报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.0648 元，基金份额总额 185,752,595.93 份。

6.2 利润表

会计主体：金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
一、收入		**38,070,728.22**	**21,150,928.00**
1.利息收入		817,288.73	274,359.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	45,552.58	23,827.14
债券利息收入		287,828.28	155,995.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		483,907.87	94,536.05
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		31,485,950.13	23,956,363.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	29,558,031.08	23,177,943.55

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	161,118.62	-15,126.20
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	1,766,800.43	793,546.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,763,219.99	-3,104,498.84
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	1,004,269.37	24,703.98
减：二、费用		**3,159,033.34**	**1,670,005.80**
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,278,474.65	1,098,881.93
2.托管费	6.4.10.2.2	151,898.36	73,258.80
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	627,140.48	374,719.60
5.利息支出		139.66	27,083.95
其中：卖出回购金融资产支出		139.66	27,083.95
6.税金及附加		0.04	0.04
7.其他费用	6.4.7.20	101,380.15	96,061.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**34,911,694.88**	**19,480,922.20**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**34,911,694.88**	**19,480,922.20**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 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）	144,959,649.81	123,855,988.11	268,815,637.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,911,694.88	34,911,694.88
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）	40,792,946.12	39,025,007.73	79,817,953.85
其中：1.基金申购款	128,146,336.81	122,426,185.49	250,572,522.30
2.基金赎回款	-87,353,390.69	-83,401,177.76	-170,754,568.45
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）	185,752,595.93	197,792,690.72	383,545,286.65
项目	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 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）	112,088,428.78	26,289,735.06	138,378,163.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,480,922.20	19,480,922.20
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）	1,985,922.18	306,630.37	2,292,552.55

其中：1.基金申购款	10,045,840.64	2,682,216.35	12,728,056.99
2.基金赎回款	-8,059,918.46	-2,375,585.98	-10,435,504.44
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）	114,074,350.96	46,077,287.63	160,151,638.59

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：

邝晓星	符刃	季泽
————————————	————————————	————————————
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

金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2017]658 号文《关于准予金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的准予注册，由基金管理人金元顺安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2017 年 11 月 14 日正式生效，首次设立募集规模为 200,112,777.30 份基金份额。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构均为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金通过积极灵活的资产配置，在严格控制投资组合风险的基础上，力争实现基金资产的稳健增值。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款以及其他银行存款）、非金融企业债务融资工具、同业存单、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其

他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。如法律法规或监管机构允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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于 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 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

本基金半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 04 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 09 月 19 日起，调整由出让方按证券

（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 05 月 01 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 01 月 01 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。对资管产品在 2018 年 01 月 01 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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 01 月 01 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 09 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 01 月 01 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 09 月 08 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 06 月 30 日

活期存款	7,374,802.20
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	7,374,802.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 06 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		292,507,603.35	287,782,462.04	-4,725,141.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	26,210,930.89	26,161,200.00	-49,730.89
	银行间市场	-	-	-
	合计	26,210,930.89	26,161,200.00	-49,730.89
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		318,718,534.24	313,943,662.04	-4,774,872.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/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 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	58,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	58,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本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 06 月 30 日
应收活期存款利息	723.49
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	2,476.98
应收债券利息	578,586.42
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	44.19
合计	581,831.08

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 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	133,916.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	133,916.43

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 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	-
预提审计费用	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
合计	89,260.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	144,959,649.81	144,959,649.81
本期申购	128,146,336.81	128,146,336.81
本期赎回（以“-”号填列）	-87,353,390.69	-87,353,390.69
本期末	185,752,595.93	185,752,595.93

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	124,825,345.37	-969,357.26	123,855,988.11
本期利润	30,148,474.89	4,763,219.99	34,911,694.88
本期基金份额交易产生的变动数	38,915,166.86	109,840.87	39,025,007.73
其中：基金申购款	122,984,772.03	-558,586.54	122,426,185.49
基金赎回款	-84,069,605.17	668,427.41	-83,401,177.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	193,888,987.12	3,903,703.60	197,792,690.72

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	10,330.60
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	34,263.99
其他	957.99
合计	45,552.58

6.4.7.12 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 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	305,762,876.95
减：卖出股票成本总额	276,204,845.87
买卖股票差价收入	29,558,031.08

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 01 月 01 日至 2021 年 06 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	161,118.62
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	161,118.62

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 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	51,717,952.73
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	50,907,195.01
减：应收利息总额	649,639.10
买卖债券差价收入	161,118.62

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,766,800.43
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	1,766,800.43

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 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
1.交易性金融资产	4,763,219.99
——股票投资	4,894,669.98
——债券投资	-131,449.99
——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	4,763,219.99

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	1,003,209.96
转换费收入	1,059.41
合计	1,004,269.37

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	627,140.48
银行间市场交易费用	-
合计	627,140.48

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 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	-
汇划手续费	120.00
账户维护费	9,000.00
其他费用	3,000.00
合计	101,380.15

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重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，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
金元顺安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司	基金托管人
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东
上海前易信息咨询服务有限公司	基金管理人的股东
上海金元百利资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

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 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,278,474.65	1,098,881.93
其中：支付销售机构的客户维护费	438,658.04	125,745.79

注：

基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%÷当年天数，

H 为每日应计提的基金管理费，

E 为前一日的基金资产净值。

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	151,898.36	73,258.80

注：

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%÷当年天数，

H 为每日应计提的基金托管费。

E 为前一日的基金资产净值基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作

日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

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可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券（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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	7,374,802.20	10,330.60	1,657,745.25	9,531.90

注：

本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间获得的利息收入为 34,263.99 元，2021 年 06 月 30 日止结算备付金余额为人民币 6,116,048.65 元。2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日止期间获得的利息收入为人民币 13,549.13 元，2020 年 06 月 30 日止结算备付金余额为人民币 1,440,046.07 元。

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均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

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无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 06 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**
688276	百克生物	2021-06-17	2021-12-27	科创板打新限售	36.35	99.68	2,735	99,417.25	272,624.80	-
688613	奥精医疗	2021-05-13	2021-11-22	科创板打新限售	16.43	82.75	2,617	42,997.31	216,556.75	-
688117	圣诺生物	2021-05-26	2021-12-03	科创板打新限售	17.90	45.87	1,672	29,928.80	76,694.64	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301018	申菱	2021-06-28	2021-07-07	新股未	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-

	环境			上市						
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
688092	爱科科技	2021-03-12	2021-09-22	科创板打新限售	19.11	33.20	1,137	21,728.07	37,748.40	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	48.59	106.28	258	12,536.22	27,420.24	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	创业板打新限售	7.64	54.81	462	3,529.68	25,322.22	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-18	创业板打新限售	28.77	99.89	240	6,904.80	23,973.60	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	创业板打新限售	21.31	49.91	399	8,502.69	19,914.09	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	创业板打新限售	6.87	14.98	1,162	7,982.94	17,406.76	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
301013	利和	2021-06-21	2021-12-29	创业板	8.72	35.33	471	4,107.12	16,640.43	-

	兴			打新限售						
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	创业板打新限售	9.19	49.61	329	3,023.51	16,321.69	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	15.83	50.96	317	5,018.11	16,154.32	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	创业板打新限售	18.71	76.32	201	3,760.71	15,340.32	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	创业板打新限售	12.76	43.35	307	3,917.32	13,308.45	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	创业板打新限售	12.25	53.66	244	2,989.00	13,093.04	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	创业板打新限售	3.40	22.12	576	1,958.40	12,741.12	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	创业板打新限售	5.31	28.49	443	2,352.33	12,621.07	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	创业板打新限售	20.81	50.60	241	5,015.21	12,194.60	-

301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	创业板打新限售	13.75	41.07	275	3,781.25	11,294.25	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	创业板打新限售	8.24	39.25	286	2,356.64	11,225.50	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	创业板打新限售	6.79	34.76	301	2,043.79	10,462.76	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	创业板打新限售	8.42	16.77	593	4,993.06	9,944.61	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	创业板打新限售	14.79	37.23	264	3,904.56	9,828.72	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	创业板打新限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	创业板打新限售	12.10	23.23	410	4,961.00	9,524.30	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	创业板打新限售	7.81	28.93	312	2,436.72	9,026.16	-

300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	4.56	18.87	474	2,161.44	8,944.38	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	创业板打新限售	8.67	27.39	324	2,808.00	8,874.36	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	创业板打新限售	4.31	13.10	672	2,896.32	8,803.20	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	创业板打新限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	创业板打新限售	13.06	34.14	254	3,317.24	8,671.56	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	创业板打新限售	8.41	39.12	219	1,841.79	8,567.28	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	创业板打新限售	5.48	17.07	492	2,696.16	8,398.44	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	创业板打新限售	18.24	33.37	245	4,468.80	8,175.65	-

300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	创业板打新限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	创业板打新限售	24.90	27.29	295	7,345.50	8,050.55	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	创业板打新限售	10.76	22.16	359	3,862.84	7,955.44	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	创业板打新限售	13.11	24.47	322	4,221.42	7,879.34	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	创业板打新限售	12.13	27.73	283	3,432.79	7,847.59	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	创业板打新限售	4.54	15.34	507	2,301.78	7,777.38	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	创业板打新限售	7.19	16.20	430	3,091.70	6,966.00	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	创业板打新限售	13.39	30.08	217	2,905.63	6,527.36	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	9.79	23.00	255	2,496.45	5,865.00	-

301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	创业板打新限售	5.29	19.12	303	1,602.87	5,793.36	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	创业板打新限售	6.02	28.50	201	1,210.02	5,728.50	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	创业板打新限售	14.72	28.81	191	2,811.52	5,502.71	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	创业板打新限售	8.05	32.12	170	1,368.50	5,460.40	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	创业板打新限售	13.87	29.53	183	2,538.21	5,403.99	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	创业板打新限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	创业板打新限售	9.36	26.89	200	1,872.00	5,378.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	创业板打新限售	7.83	22.61	218	1,706.94	4,928.98	-
6.4.12.1.2受限证券类别：债券										
证券代	**证券**	**成功认购日**	**可流通日**	**流通受**	**认购**	**期末**	**数量**	**期末成本**	**期末估值**	**备**

码	名称			限类型	价格	估值单价	（单位：张）	总额	总额	注
113050	南银转债	2021-06-16	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	1,110	111,000.00	111,000.00	-

注：

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末及上年度末均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

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入公司各个业务层面的全面控制过程之中，并建立了三道防线：以各岗位职责为基础，形成第一道防线；通过相关岗位之间、相关部门之间相互监督制衡，形成第二道防线；由督察长、分管风险管理副总经理、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务进行监督、检查、评价，形成的第三道防线。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且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的基金管理人管理的全部基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,004,300.00	38,799,495.00
合计	9,004,300.00	38,799,495.00

注：

未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债和超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

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 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

AAA	111,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	17,045,900.00	6,957,270.00
合计	17,156,900.00	6,957,270.00

注：

未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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。本基金的生息资产主要为银行存款、清算备付金、存出保证金及债券投资。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 06 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	7,374,802.20	-	-	-	7,374,802.20
结算备付金	6,116,048.65	-	-	-	6,116,048.65
存出保证金	109,168.97	-	-	-	109,168.97
交易性金融资产	26,161,200.00	-	-	287,782,462.04	313,943,662.04
买入返售金融资产	58,000,000.00	-	-	-	58,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	3,210,052.25	3,210,052.25
应收利息	-	-	-	581,831.08	581,831.08
应收申购款	-	-	-	1,208,146.89	1,208,146.89
资产总计	**97,761,219.82**	**-**	**-**	**292,782,492.26**	**390,543,712.08**
负债					
应付证券清算款	-	-	-	17,908.00	17,908.00

应付赎回款	-	-	-	6,247,186.40	6,247,186.40
应付管理人报酬	-	-	-	478,269.79	478,269.79
应付托管费	-	-	-	31,884.66	31,884.66
应付交易费用	-	-	-	133,916.43	133,916.43
预提费用	-	-	-	89,260.15	89,260.15
负债总计	**-**	**-**	**-**	**6,998,425.43**	**6,998,425.43**
利率敏感度缺口	**97,761,219.82**	**-**	**-**	**285,784,066.83**	**383,545,286.65**
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	3,509,905.43	-	-	-	3,509,905.43
结算备付金	3,323,302.91	-	-	-	3,323,302.91
存出保证金	126,303.61	-	-	-	126,303.61
交易性金融资产	45,756,765.00	-	-	211,055,219.46	256,811,984.46
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	2,852,014.84	2,852,014.84
应收利息	-	-	-	469,898.77	469,898.77
应收申购款	-	-	-	81,799.93	81,799.93
资产总计	**58,716,276.95**	**-**	**-**	**214,458,933.00**	**273,175,209.95**
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,994,725.11	2,994,725.11
应付赎回款	-	-	-	713,680.85	713,680.85
应付管理人报酬	-	-	-	356,249.14	356,249.14

应付托管费	-	-	-	23,749.99	23,749.99
应付交易费用	-	-	-	96,166.94	96,166.94
其他负债	-	-	-	175,000.00	175,000.00
负债总计	**-**	**-**	**-**	**4,359,572.03**	**4,359,572.03**
利率敏感度缺口	**58,716,276.95**	**-**	**-**	**210,099,360.97**	**268,815,637.92**

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了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、以中央国债登记结算有限责任公司公布的 2021 年 06 月 30 日和 2020 年 12 月 31 日各债券的基点价值（BP 价值)为主要计算依据；		
	2、债券持仓结构保持不变；		
	3、银行存款、清算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益/卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	4、该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
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 06 月 30 日**	**上年度末** **2020 年 12 月 31 日**
	基准利率增加一个基点	-891.39	-2,494.96
	基准利率减少一个基点	891.46	2,495.15

注：

上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 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	287,782,462.04	75.03	211,055,219.46	78.51
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	287,782,462.04	75.03	211,055,219.46	78.51

注：

于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表，由于本基金的市场价格风险主要与基金投资组合中股票投资的贝塔系数相关，故不在上表中列示债券投资的公允价值。

本基金投资组合中股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 0%－95%，权证投资比例占基金资产净值的比例不超过 3%，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。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合中股票投资的贝塔系数紧密相关；		
	2、以下分析中，除市场指标发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变；		
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 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	443,602.79	8,983,652.16
	沪深 300 指数下跌 5%	-443,602.79	-8,983,652.16

注：

本基金管理人运用资本——资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 06 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工具中属于第一层次的余额为人民币 286,391,346.57 元，第二层次的余额为人民币 26,445,603.74 元，第三层次的余额为人民币 1,106,711.73 元。（2020 年 06 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工具中属于第一层次的余额为人民币 139,973,261.46 元，属于第二层次的余额为人民币

54,438,428.22 元，无属于第三层次的余额。）

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值期末余额为人民币 1,106,711.73 元，期初余额为人民币 3,948,364.53 元，本期减少人民币 2,841,652.80 元。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他事项。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 08 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§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	287,782,462.04	73.69
	其中：股票	287,782,462.04	73.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	26,161,200.00	6.70
	其中：债券	26,161,200.00	6.70
	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	58,000,000.00	14.85
	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	13,490,850.85	3.45
8	其他各项资产	5,109,199.19	1.31
9	合计	390,543,712.08	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,745,020.38	0.72

B	采矿业	-	-
C	制造业	136,857,392.97	35.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,065,315.39	4.45
E	建筑业	25,615,169.39	6.68
F	批发和零售业	39,763,071.87	10.37
G	交通运输、仓储和邮政业	29,002,049.57	7.56
H	住宿和餐饮业	2,889,855.00	0.75
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,047,610.79	0.79
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	17,235,825.40	4.49
L	租赁和商务服务业	2,738,173.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	3,213,249.56	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	3,009,791.62	0.78
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	1,827,000.00	0.48
S	综合	2,738,216.00	0.71
	合计	287,782,462.04	75.03

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的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600629	华建集团	443,819	3,213,249.56	0.84
2	002787	华源控股	563,821	3,208,141.49	0.84
3	000605	渤海股份	602,940	3,195,582.00	0.83
4	000419	通程控股	718,600	3,190,584.00	0.83
5	002037	保利联合	531,304	3,171,884.88	0.83
6	600683	京投发展	841,100	3,145,714.00	0.82
7	600939	重庆建工	916,600	3,143,938.00	0.82
8	000548	湖南投资	830,400	3,138,912.00	0.82
9	002040	南京港	520,700	3,134,614.00	0.82
10	600272	开开实业	403,714	3,116,672.08	0.81
11	300466	赛摩智能	525,000	3,108,000.00	0.81
12	603015	弘讯科技	450,600	3,068,586.00	0.80
13	300155	安居宝	457,600	3,029,312.00	0.79
14	002713	东易日盛	433,440	3,021,076.80	0.79
15	603861	白云电器	365,600	3,016,200.00	0.79
16	300240	飞力达	483,300	3,006,126.00	0.78
17	300150	世纪瑞尔	715,983	2,992,808.94	0.78
18	600082	海泰发展	984,300	2,982,429.00	0.78
19	300173	福能东方	529,700	2,976,914.00	0.78
20	600665	天地源	921,000	2,965,620.00	0.77

21	600706	曲江文旅	419,000	2,962,330.00	0.77
22	603289	泰瑞机器	320,512	2,958,325.76	0.77
23	300163	先锋新材	819,400	2,941,646.00	0.77
24	002752	昇兴股份	526,885	2,929,480.60	0.76
25	002357	富临运业	578,685	2,910,785.55	0.76
26	002691	冀凯股份	692,700	2,909,340.00	0.76
27	300165	天瑞仪器	600,500	2,906,420.00	0.76
28	603889	新澳股份	526,990	2,903,714.90	0.76
29	603030	全筑股份	654,500	2,899,435.00	0.76
30	000757	浩物股份	741,400	2,898,874.00	0.76
31	600099	林海股份	448,600	2,893,470.00	0.75
32	000721	西安饮食	670,500	2,889,855.00	0.75
33	603011	合锻智能	599,500	2,889,590.00	0.75
34	600302	标准股份	674,600	2,887,288.00	0.75
35	002593	日上集团	776,000	2,886,720.00	0.75
36	002337	赛象科技	935,100	2,880,108.00	0.75
37	002209	达意隆	420,900	2,874,747.00	0.75
38	600561	江西长运	690,800	2,873,728.00	0.75
39	000619	海螺型材	545,000	2,872,150.00	0.75
40	300335	迪森股份	569,000	2,862,070.00	0.75
41	002708	光洋股份	470,200	2,849,412.00	0.74
42	002682	龙洲股份	822,800	2,846,888.00	0.74
43	000759	中百集团	540,400	2,842,504.00	0.74

44	002150	通润装备	478,100	2,835,133.00	0.74
45	000819	岳阳兴长	456,696	2,826,948.24	0.74
46	603767	中马传动	422,266	2,820,736.88	0.74
47	601518	吉林高速	1,235,714	2,817,427.92	0.73
48	002205	国统股份	397,305	2,816,892.45	0.73
49	000593	大通燃气	587,400	2,813,646.00	0.73
50	603321	梅轮电梯	395,400	2,803,386.00	0.73
51	002790	瑞尔特	513,408	2,803,207.68	0.73
52	600287	江苏舜天	526,244	2,799,618.08	0.73
53	600386	北巴传媒	795,200	2,799,104.00	0.73
54	002347	泰尔股份	655,000	2,796,850.00	0.73
55	600190	锦州港	994,600	2,794,826.00	0.73
56	603828	柯利达	676,600	2,794,358.00	0.73
57	600493	凤竹纺织	570,000	2,793,000.00	0.73
58	601086	国芳集团	718,800	2,788,944.00	0.73
59	600232	金鹰股份	565,130	2,786,090.90	0.73
60	002863	今飞凯达	552,300	2,772,546.00	0.72
61	000632	三木集团	780,700	2,771,485.00	0.72
62	002731	萃华珠宝	447,400	2,769,406.00	0.72
63	603817	海峡环保	493,800	2,765,280.00	0.72
64	603366	日出东方	601,000	2,764,600.00	0.72
65	600361	华联综超	773,600	2,761,752.00	0.72
66	002116	中国海诚	447,900	2,759,064.00	0.72

67	600962	国投中鲁	353,700	2,758,860.00	0.72
68	002112	三变科技	386,800	2,757,884.00	0.72
69	002307	北新路桥	609,800	2,756,296.00	0.72
70	600689	上海三毛	415,701	2,756,097.63	0.72
71	000533	顺钠股份	950,000	2,755,000.00	0.72
72	600854	春兰股份	788,900	2,753,261.00	0.72
73	000514	渝开发	809,136	2,751,062.40	0.72
74	600279	重庆港九	753,434	2,750,034.10	0.72
75	002671	龙泉股份	725,300	2,748,887.00	0.72
76	603009	北特科技	473,900	2,748,620.00	0.72
77	600853	龙建股份	1,124,552	2,743,906.88	0.72
78	600463	空港股份	454,765	2,742,232.95	0.71
79	000833	粤桂股份	605,800	2,738,216.00	0.71
80	603569	长久物流	367,540	2,738,173.00	0.71
81	603021	山东华鹏	545,900	2,734,959.00	0.71
82	603006	联明股份	309,300	2,731,119.00	0.71
83	002696	百洋股份	528,100	2,730,277.00	0.71
84	000715	中兴商业	566,174	2,728,958.68	0.71
85	000755	山西路桥	821,900	2,728,708.00	0.71
86	601199	江南水务	751,500	2,727,945.00	0.71
87	603388	元成股份	456,900	2,727,693.00	0.71
88	603527	众源新材	360,640	2,722,832.00	0.71
89	600250	南纺股份	576,500	2,721,080.00	0.71

90	600156	华升股份	723,200	2,719,232.00	0.71
91	600828	茂业商业	766,100	2,711,994.00	0.71
92	600791	京能置业	786,600	2,705,904.00	0.71
93	600829	人民同泰	454,515	2,695,273.95	0.70
94	600617	国新能源	668,600	2,687,772.00	0.70
95	600159	大龙地产	1,082,700	2,685,096.00	0.70
96	002599	盛通股份	701,960	2,681,487.20	0.70
97	002397	梦洁股份	671,000	2,663,870.00	0.69
98	603838	四通股份	405,500	2,510,045.00	0.65
99	000785	居然之家	371,000	2,251,970.00	0.59
100	603999	读者传媒	350,000	1,827,000.00	0.48
101	002265	西仪股份	190,000	1,276,800.00	0.33
102	002264	新华都	150,000	628,500.00	0.16
103	002633	申科股份	60,863	457,081.13	0.12
104	688276	百克生物	2,735	272,624.80	0.07
105	688613	奥精医疗	2,617	216,556.75	0.06
106	688117	圣诺生物	1,672	76,694.64	0.02
107	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
108	300919	中伟股份	351	57,213.00	0.01
109	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
110	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
111	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
112	300894	火星人	628	42,704.00	0.01

113	688092	爱科科技	1,137	37,748.40	0.01
114	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
115	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
116	300981	中红医疗	258	27,420.24	0.01
117	301015	百洋医药	462	25,322.22	0.01
118	300953	震裕科技	240	23,973.60	0.01
119	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
120	300941	创识科技	399	19,914.09	0.01
121	300968	格林精密	1,162	17,406.76	0.00
122	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
123	301013	利和兴	471	16,640.43	0.00
124	300614	百川畅银	329	16,321.69	0.00
125	300982	苏文电能	317	16,154.32	0.00
126	301002	崧盛股份	201	15,340.32	0.00
127	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
128	300940	南极光	307	13,308.45	0.00
129	300937	药易购	244	13,093.04	0.00
130	300962	中金辐照	576	12,741.12	0.00
131	300942	易瑞生物	443	12,621.07	0.00
132	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
133	300996	普联软件	241	12,194.60	0.00
134	301016	雷尔伟	275	11,294.25	0.00
135	300966	共同药业	286	11,225.50	0.00

136	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
137	300987	川网传媒	301	10,462.76	0.00
138	300978	东箭科技	593	9,944.61	0.00
139	300986	志特新材	264	9,828.72	0.00
140	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
141	300993	玉马遮阳	410	9,524.30	0.00
142	301004	嘉益股份	312	9,026.16	0.00
143	300945	曼卡龙	474	8,944.38	0.00
144	300948	冠中生态	324	8,874.36	0.00
145	300931	通用电梯	672	8,803.20	0.00
146	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
147	300991	创益通	254	8,671.56	0.00
148	300950	德固特	219	8,567.28	0.00
149	300975	商络电子	492	8,398.44	0.00
150	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
151	300971	博亚精工	245	8,175.65	0.00
152	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
153	300985	致远新能	295	8,050.55	0.00
154	300926	博俊科技	359	7,955.44	0.00
155	300930	屹通新材	322	7,879.34	0.00
156	300963	中洲特材	283	7,847.59	0.00
157	300967	晓鸣股份	507	7,777.38	0.00
158	300972	万辰生物	430	6,966.00	0.00

159	300927	江天化学	217	6,527.36	0.00
160	300943	春晖智控	255	5,865.00	0.00
161	301007	德迈仕	303	5,793.36	0.00
162	300998	宁波方正	201	5,728.50	0.00
163	300995	奇德新材	191	5,502.71	0.00
164	301012	扬电科技	170	5,460.40	0.00
165	300929	华骐环保	183	5,403.99	0.00
166	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
167	300992	泰福泵业	200	5,378.00	0.00
168	301010	晶雪节能	218	4,928.98	0.00
169	605011	杭州热电	525	4,662.00	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	000759	中百集团	5,692,841.00	2.12
2	002790	瑞尔特	5,485,570.39	2.04
3	002696	百洋股份	5,461,233.90	2.03
4	002682	龙洲股份	5,306,584.75	1.97
5	603828	柯利达	5,304,167.44	1.97
6	603817	海峡环保	5,197,181.00	1.93
7	600617	国新能源	4,416,409.00	1.64
8	002731	萃华珠宝	3,836,183.00	1.43

9	000605	渤海股份	3,795,016.60	1.41
10	000419	通程控股	3,707,213.00	1.38
11	600828	茂业商业	3,647,839.00	1.36
12	600683	京投发展	3,590,303.00	1.34
13	000632	三木集团	3,460,175.00	1.29
14	601199	江南水务	3,451,944.00	1.28
15	603021	山东华鹏	3,354,146.81	1.25
16	600302	标准股份	3,342,183.00	1.24
17	600853	龙建股份	3,301,700.56	1.23
18	600939	重庆建工	3,295,250.00	1.23
19	002040	南京港	3,282,666.00	1.22
20	300164	通源石油	3,275,805.00	1.22

注：

本项的“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

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	300164	通源石油	6,132,248.56	2.28
2	000852	石化机械	5,810,866.30	2.16
3	002790	瑞尔特	5,290,105.06	1.97
4	002687	乔治白	5,171,879.50	1.92
5	002492	恒基达鑫	5,105,926.00	1.90
6	000838	财信发展	4,983,298.34	1.85

7	600796	钱江生化	4,440,019.21	1.65
8	000695	滨海能源	4,395,354.00	1.64
9	600778	友好集团	4,286,480.00	1.59
10	600128	弘业股份	3,921,390.00	1.46
11	600828	茂业商业	3,216,648.06	1.20
12	600735	新华锦	3,202,681.00	1.19
13	601199	江南水务	3,186,957.00	1.19
14	002615	哈尔斯	3,161,403.00	1.18
15	603316	诚邦股份	3,155,036.00	1.17
16	002682	龙洲股份	3,086,948.00	1.15
17	000716	黑芝麻	3,080,259.00	1.15
18	601999	出版传媒	3,075,312.80	1.14
19	600613	神奇制药	3,068,520.00	1.14
20	002514	宝馨科技	3,066,263.00	1.14

注：

本项的“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

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	348,037,418.47
卖出股票收入（成交）总额	305,762,876.95

注：

本项的“买入股票的成本”、“卖出股票的收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,004,300.00	2.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,045,900.00	4.44
	其中：政策性金融债	17,045,900.00	4.44
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）	111,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,161,200.00	6.82

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	108604	国开 1805	170,000	17,045,900.00	4.44
2	019654	21 国债 06	50,000	5,001,500.00	1.30
3	019649	21 国债 01	40,000	4,002,800.00	1.04
4	113050	南银转债	1,110	111,000.00	0.03
5	-	-	-	-	-

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投资资产支持证券。

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。

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投资权证。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票没有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	109,168.97
2	应收证券清算款	3,210,052.25
3	应收股利	-
4	应收利息	581,831.08
5	应收申购款	1,208,146.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,109,199.19

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

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§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
21,696	8,561.61	87,463,602.11	47.09%	98,288,993.82	52.91%

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	9,462,362.97	5.09%

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	＞100
本基金基金经理持有本开放式基金	＞100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 11 月 14 日）基金份额总额	200,112,777.30
本报告期期初基金份额总额	144,959,649.81
本报告期基金总申购份额	128,146,336.81
减：本报告期基金总赎回份额	87,353,390.69
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	185,752,595.93

§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，本基金未举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内本基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，未发生改聘会计师事务所的情况。

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

本报告期内，中国证监会上海监管局对公司采取责令改正等相关措施，公司高度重视，全面梳理了相关业务流程，针对性的制定、落实整改措施，并将及时向监管部门提交整改报告。

本报告期内，本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚。

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	
东方证券	1	289,617,270.24	44.77%	95,952.08	39.50%	-
中泰证券	1	357,342,593.75	55.23%	146,975.13	60.50%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：

1、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29 号）和《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）的有关规定，我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序：

（1）选择标准：

1）公司具有较强的研究实力，能够出具高质量的各种研究报告。研究及投资建议质量较高、报告出具及时、能及时地交流和对需求做出反应，有较广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

2）公司资信状况较好，无重大不良记录。

3）公司经营规范，能满足基金运作的合法、合规需求。

4）能够对持有人提供较高质量的服务。能够向持有人提供咨询、查询等服务；可以向投资人提供及时、主动的信息以及其它增值服务，无被持有人投诉的记录。

（2）选择流程：

公司投研和市场部门定期对券商服务质量根据选择标准进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元。

2、截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金新租用东吴证券股份有限公司 1 个上海交易单元 1 个深圳交易单元、五矿证券有限公司 1 个上海交易单元 1 个深圳交易单元、中信建投证券股份有限公司 1 个深圳交易单元、长江证券股份有限公司 1 个深圳交易单元，无退租交易单元。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方证券	58,070,460.30	70.68%	5,170,200,000.00	99.94%	-	-	-	-
中泰证券	24,087,966.22	29.32%	3,000,000.00	0.06%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金 2020 年第四季度的报告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-01-22
2	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加众惠基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-03-03
3	金元顺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在盈米基金销售有限公司开展转换费率优惠活动的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-03-09
4	金元顺安基金管理有限公司关于旗下部分基金开通东方财富证券股份有限公司基金定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-03-17
5	金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-03-23
6	金元顺安基金有限公司旗下证券投资基金 2020 年度报告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-03-31
7	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-04-07
8	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加天风证券	《证券时报》和	2021-04-12

	股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	www.jysa99.com	
9	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加兴业银行股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-04-13
10	金元顺安基金管理有限公司关于修改旗下部分基金的基金合同及托管协议的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-04-21
11	金元顺安旗下证券投资基金 2021 年第一季度报告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-04-22
12	金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金招募说明书[2021 年 04 月 26 日更新]	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-04-26
13	金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新[2021 年 04 月 26 日更新]	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-04-26
14	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-05-19
15	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-06-04
16	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加上海长量基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-06-16
17	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加申万宏源证券有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-06-24
18	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加申万宏源西部证券有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-06-24

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021 年 01 月 01 日-2021 年 06 月 30 日	49,734,000.00	-	7,445,000.00	42,289,000.00	22.77%
产品特有风险							
• 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。 • 基金净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。 • 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无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、中国证监会准予金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；

2、《金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金基金招募说明书》；

4、《金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

5、关于申请募集注册金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金的法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照；

8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

金元顺安基金管理有限公司

中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间至办公地点进行查询，或登录本基金管理人网站 www.jysa99.com 查阅。投资者对本报告书存有疑问，可咨询本基金管理人金元顺安基金管理有限公司，本公司客服电话 400-666-0666、021-68881898。

金元顺安基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日