

汇安核心资产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：汇安基金管理有限责任公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	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合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
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.....	63

§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安核心资产混合型证券投资基金	
基金简称	汇安核心资产混合	
基金主代码	009381	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 6 月 16 日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	712,940,683.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇安核心资产混合 A	汇安核心资产混合 C
下属分级基金的交易代码:	009381	009382
报告期末下属分级基金的份额总额	698,711,911.73 份	14,228,772.24 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于具有核心资产的优质上市企业，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金将结合对包括宏观经济形势、政策走势、证券市场环境等在内的因素的分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置策略，合理确定基金在股票、债券等各类资产上的投资比例，最大限度地降低投资组合的风险，提高收益。本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、参与融资业务策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险收益水平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	汇安基金管理有限责任公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青
	联系电话	01056711600
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn
客户服务电话	01056711690	95595
传真	01056711640	010-63639132
注册地址	上海市虹口区欧阳路 218 弄 1 号 2 楼 215 室	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址	北京市东城区东直门南大	北京市西城区太平桥大街 25 号

	街 5 号中青旅大厦 13 层； 上海市虹口区东大名路 501 号白玉兰大厦 36 层	中国光大中心
邮政编码	100007	100033
法定代表人	刘强	李晓鹏

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	www.huianfund.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地点

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇安基金管理有限责任公司	上海市虹口区东大名路 501 号上海 白玉兰广场 36 层 02 单元

§ 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

基金级别	汇安核心资产混合 A	汇安核心资产混合 C
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)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	165,036,496.18	3,269,532.08
本期利润	82,409,535.13	1,710,601.88
加权平均基金份额本期利润	0.0855	0.0875
本期加权平均净值利润率	7.31%	7.50%
本期基金份额净值增长率	4.97%	4.71%
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	124,038,409.84	2,436,053.91
期末可供分配基金份额利润	0.1775	0.1712
期末基金资产净值	833,369,581.02	16,882,708.08
期末基金份额净值	1.1927	1.1865
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	19.27%	18.65%

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分余额的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇安核心资产混合 A

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	0.56%	0.85%	-1.57%	0.64%	2.13%	0.21%
过去三个月	7.39%	0.99%	3.09%	0.78%	4.30%	0.21%
过去六个月	4.97%	1.55%	0.82%	1.05%	4.15%	0.50%
过去一年	18.97%	1.35%	20.99%	1.07%	-2.02%	0.28%
自基金合同	19.27%	1.33%	26.02%	1.05%	-6.75%	0.28%

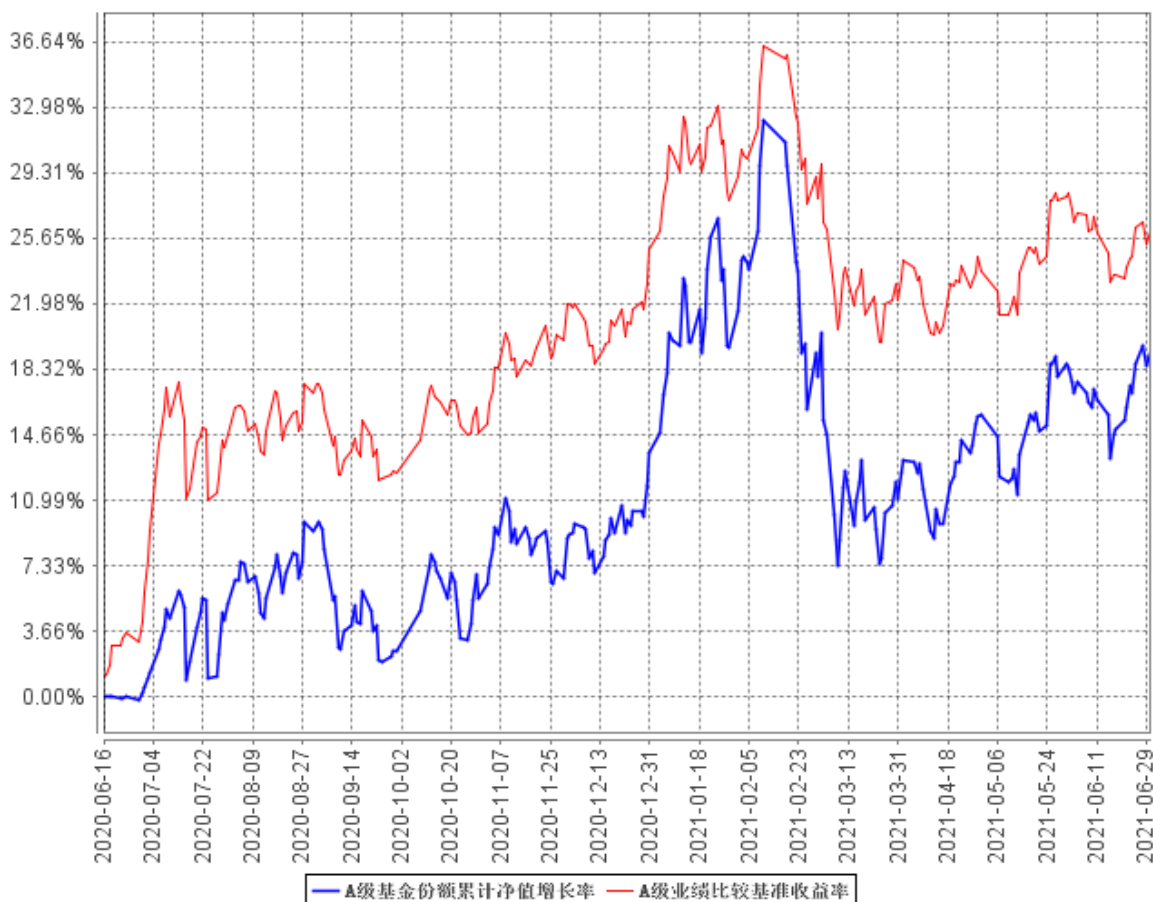
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

汇安核心资产混合 C

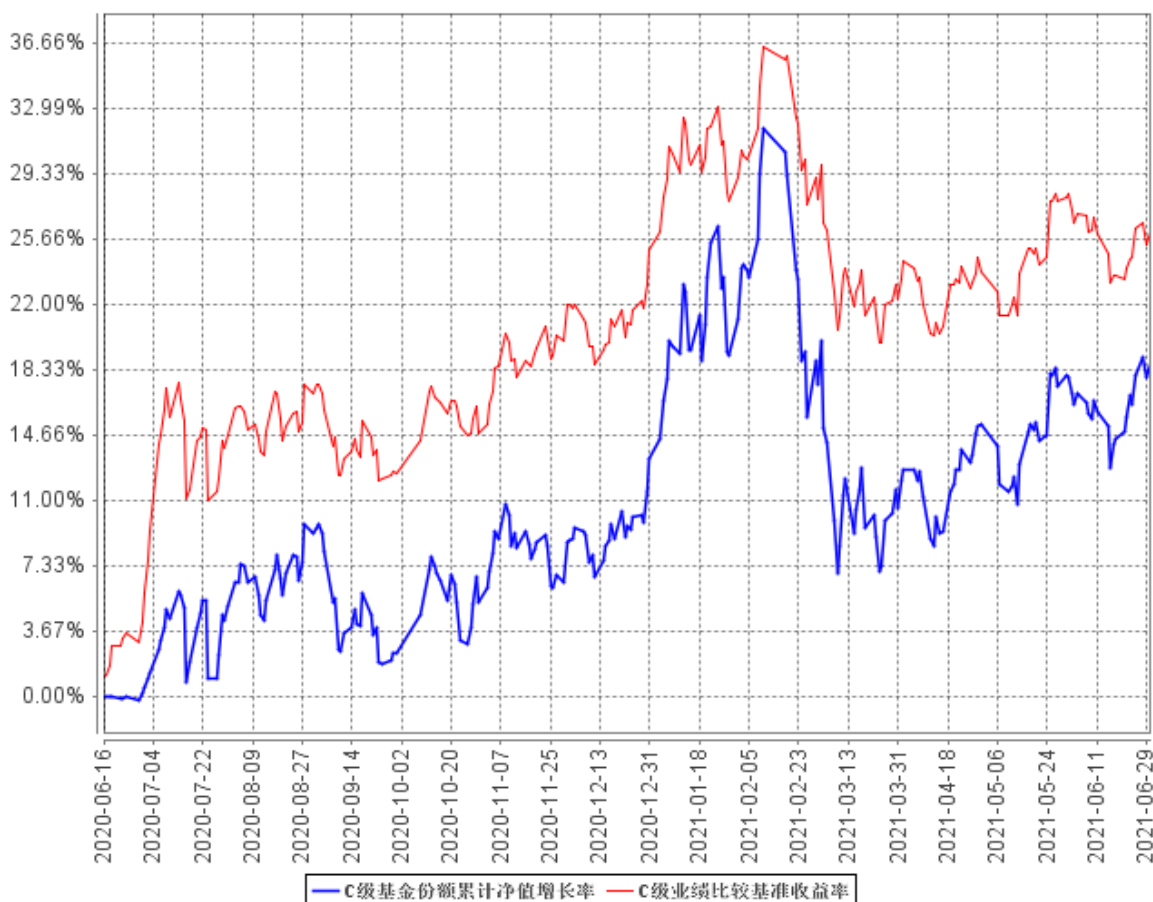
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.53%	0.86%	-1.57%	0.64%	2.10%	0.22%
过去三个月	7.26%	0.99%	3.09%	0.78%	4.17%	0.21%
过去六个月	4.71%	1.55%	0.82%	1.05%	3.89%	0.50%
过去一年	18.38%	1.35%	20.99%	1.07%	-2.61%	0.28%
自基金合同生效起至今	18.65%	1.33%	26.02%	1.05%	-7.37%	0.28%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①基金合同生效日为 2020 年 6 月 16 日，至本报告期末，本基金合同生效已满一年。

②根据《汇安核心资产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（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，不需要召开基金份额持有人大会。本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于本基金定义的核心资产主题相关证券比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配

置比例需符合基金合同要求。截至本报告期末，本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。建仓期为 2020 年 6 月 16 日至 2020 年 12 月 15 日，建仓结束时各项资产比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，于 2016 年 4 月 19 日获中国证监会批复，2016 年 4 月 25 日正式成立，是业内首家全自然人、由内部核心专业人士控股的公募基金管理公司，注册资本 1 亿元人民币，注册地为上海市，设北京、上海双总部。公司目前具有公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理的资格。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司旗下管理 50 只公募基金——汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金、汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金、汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金、汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金、汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安稳裕债券型证券投资基金、汇安趋势动力股票型证券投资基金、汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金、汇安短债债券型证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金、汇安核心成长混合型证券投资基金、汇安鼎利纯债债券型证券投资基金、汇安多因子混合型证券投资基金、汇安嘉诚债券型证券投资基金、汇安行业龙头混合型证券投资基金、汇安中短债债券型证券投资基金、汇安量化先锋混合型证券投资基金、汇安宜创量化精选混合型证券投资基金、汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金、汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金、汇安信利债券型证券投资基金、汇安裕和纯债债券型证券投资基金、汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金、汇安嘉利混合型证券投资基金、汇安核心资产混合型证券投资基金、汇安裕鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安价值蓝筹混合型证券投资基金、汇安消费龙头混合型证券投资基金、汇安恒鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安中证 500 指数增强型证券投资基金、汇安泓阳三年持有期混合型证券投资基金、汇安恒利 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、汇安盛鑫三年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金、汇安均衡优选混合型证券投资基金、汇安核心价值混合型证券投资基金、汇安鑫利优选混合型证券投资基金、汇安泓利一年持有期混合型证券投资基

金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈欣	指数与量化投资部总经理、本基金的基金经理	2020年6月16日	-	13年	陈欣，华东理工大学企业管理硕士。13年证券、基金行业从业经历，曾任中银基金管理有限公司渠道经理，华安基金管理有限公司指数与量化事业部高级经理，从事指数与量化投资工作。2016年8月19日加入汇安基金管理有限责任公司，担任指数与量化投资部总经理一职。2018年3月21日至2019年5月10日，任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年4月30日至今，任汇安多因子混合型证券投资基金基金经理；2019年12月11日至今，任汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2020年5月20日至今，任汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020年6月16日至今，任汇安核心资产混合型证券投资基金基金经理；2021年3月16日至今，任汇安核心价值混合型证券投资基金基金经理。
朱晨歌	指数与量化投资部高级经理、本基金的基金经理	2020年6月16日	-	6年	朱晨歌，复旦大学理论物理硕士，6年证券、基金行业从业经历，曾任华安基金管理有限公司指数与量化投资事业部数量分析师、投资经理，从事量化投资研究工作。2017年12月29日加入汇安基金管理有限责任公司，担任指

				<p>数与量化投资部高级经理一职。2018 年 2 月 8 日至 2019 年 5 月 10 日，任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 7 月 27 日，任汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 4 月 26 日至 2019 年 5 月 10 日，任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 24 日至 2021 年 2 月 2 日，任汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金经理；2018 年 8 月 9 日至今，任汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 8 月 22 日至今，任汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金；2019 年 3 月 13 日至今，任汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019 年 6 月 14 日至今，任富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019 年 10 月 30 日至今，任汇安量化先锋混合型证券投资基金基金经理；2020 年 4 月 9 日至今，任汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 4 月 9 日至今，任汇安核心资产混合型证券投资基金基金经理；2020 年 11 月 16 日至今，任汇安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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法》、《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无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

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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

今年上半年，国内宏观经济稳步复苏，企业盈利较显著改善，尤其是新能源、半导体、医疗服务等高景气以及顺周期等疫情受损板块。年初受利率波动影响而大幅调整的一线核心资产，在二季度走势出现分化，核心影响因素还是业绩。过去几年，A 股优质核心资产经历了一波显著的估值提升过程，其背后既有经济转型中龙头公司的竞争格局变化，也有流动性支持下的新增资金对于盈利确定性的青睐。今年，在流动性边际收紧的大背景下，靠盈利增长消化短期偏高估值是市场主线，因此，在投资中，需要对短期业绩增速更加重视。本着长期价值投资的理念，以及对短期市场估值偏高的考虑，基金上半年的整体配置均衡偏价值，以估值合理甚至低估的一二线龙头公司为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇安核心资产混合 A 基金份额净值为 1.1927 元，本报告期基金份额净值增长

率为 4.97%，同期业绩比较基准收益率为 0.82%；截至本报告期末汇安核心资产混合 C 基金份额净值为 1.1865 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.71%，同期业绩比较基准收益率为 0.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，估值和盈利的匹配程度仍将是选择投资标的的首要考量因素，对于增速显著领先行业且可持续性较强的优质标的，我们也将提升对短期估值的容忍度；而中长期来看，盈利确定性较高的优质核心资产，在短期承压之后，仍具有较高的配置价值。从量化因子维度，高景气、低拥挤的行业和板块有望在下半年获得超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司运营总监担任估值委员会主席，投资部门、合规风控部和运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未发生利润分配情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在汇安核心资产混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《汇安核心资产混合型证券投资基金 2021 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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：汇安核心资产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	49,786,323.22	96,816,845.98
结算备付金		8,815,986.99	70,266,475.84
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	801,509,060.17	1,635,168,459.66
其中：股票投资		801,509,060.17	1,615,410,459.66
基金投资		-	-
债券投资		-	19,758,000.00
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	11,504.80	136,642.56
应收股利		-	-
应收申购款		40,932.45	550,670.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		860,163,807.63	1,802,939,094.50
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		8,394,975.04	32,386,762.87
应付管理人报酬		1,101,422.00	2,339,352.39
应付托管费		146,856.26	311,913.64
应付销售服务费		7,375.48	16,975.01
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	260,889.75	251,062.63
负债合计		9,911,518.53	35,306,066.54
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	712,940,683.97	1,555,838,640.13
未分配利润	6.4.7.10	137,311,605.13	211,794,387.83
所有者权益合计		850,252,289.10	1,767,633,027.96
负债和所有者权益总计		860,163,807.63	1,802,939,094.50

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，汇安核心资产混合 A 基金份额净值 1.1927 元，基金份额总额 698,711,911.73 份；汇安核心资产混合 C 基金份额净值 1.1865 元，基金份额总额 14,228,772.24 份。汇安核心资产混合份额总额合计为 712,940,683.97 份。

6.2 利润表

会计主体：汇安核心资产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 6 月 16 日(基金 合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		98,243,260.10	8,082,844.58
1.利息收入		299,925.92	1,225,700.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	272,294.38	335,617.42
债券利息收入		27,631.54	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	890,082.60
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		181,886,474.66	102,045.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	178,916,791.83	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	10,560.00	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-1,619,880.00	-
股利收益	6.4.7.16	4,579,002.83	102,045.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-84,185,891.25	6,755,099.56
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	242,750.77	-
减：二、费用		14,123,123.09	2,124,433.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,643,860.64	1,363,186.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,152,514.72	181,758.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	57,198.25	13,457.43
4. 交易费用	6.4.7.19	4,148,253.54	547,187.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	121,295.94	18,844.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		84,120,137.01	5,958,410.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		84,120,137.01	5,958,410.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇安核心资产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）	1,555,838,640.13	211,794,387.83	1,767,633,027.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	84,120,137.01	84,120,137.01
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）	-842,897,956.16	-158,602,919.71	-1,001,500,875.87
其中：1.基金申购款	53,533,328.59	10,550,237.31	64,083,565.90
2.基金赎回款	-896,431,284.75	-169,153,157.02	-1,065,584,441.77
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)	712,940,683.97	137,311,605.13	850,252,289.10
项目	上年度可比期间 2020年6月16日(基金合同生效日)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)	2,376,446,088.54	-	2,376,446,088.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,958,410.65	5,958,410.65
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)	2,376,446,088.54	-	2,376,446,088.54
其中：1.基金申购款	2,376,446,088.54	-	2,376,446,088.54
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	4,752,892,177.08	5,958,410.65	4,758,850,587.73

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：

刘强

王嘉浩

江士

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

汇安核心资产混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]504号《关于准予汇安核心资产混合型证券投资基金注册的批复》核准,由汇安基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安核心资产混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,

首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,375,785,779.10 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0503 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇安核心资产混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,376,446,088.54 份基金份额,其中认购资金利息折合 660,309.44 份基金份额。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《汇安核心资产混合型证券投资基金基金合同》和《汇安核心资产混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购费/申购费和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安核心资产混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%,其中,投资于本基金定义的核心资产主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 80%+中证全债指数收益率 \times 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于 2021 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投

资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇安核心资产混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管

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

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

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

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

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,039,360.95
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	47,746,962.27
合计：	49,786,323.22

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	668,715,344.09	801,509,060.17	132,793,716.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	668,715,344.09	801,509,060.17	132,793,716.08

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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	475.30
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	4,827.40
应收结算备付金利息	6,202.10
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	11,504.80

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

无。

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	796.01
应付证券出借违约金	-
其他	997.80
预提费用	259,095.94
合计	260,889.75

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇安核心资产混合 A		
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	1,522,293,942.15	1,522,293,942.15
本期申购	51,533,833.04	51,533,833.04
本期赎回(以“-”号填列)	-875,115,863.46	-875,115,863.46
本期末	698,711,911.73	698,711,911.73

金额单位：人民币元

汇安核心资产混合 C		
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	33,544,697.98	33,544,697.98
本期申购	1,999,495.55	1,999,495.55
本期赎回(以“-”号填列)	-21,315,421.29	-21,315,421.29

本期末	14,228,772.24	14,228,772.24
-----	---------------	---------------

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

汇安核心资产混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	39,528,401.96	167,800,673.57	207,329,075.53
本期利润	165,036,496.18	-82,626,961.05	82,409,535.13
本期基金份额交易产生的变动数	-80,526,488.30	-74,554,453.07	-155,080,941.37
其中：基金申购款	4,552,968.72	5,630,087.00	10,183,055.72
基金赎回款	-85,079,457.02	-80,184,540.07	-165,263,997.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	124,038,409.84	10,619,259.45	134,657,669.29

单位：人民币元

汇安核心资产混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	773,720.86	3,691,591.44	4,465,312.30
本期利润	3,269,532.08	-1,558,930.20	1,710,601.88
本期基金份额交易产生的变动数	-1,607,199.03	-1,914,779.31	-3,521,978.34
其中：基金申购款	194,247.34	172,934.25	367,181.59
基金赎回款	-1,801,446.37	-2,087,713.56	-3,889,159.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,436,053.91	217,881.93	2,653,935.84

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	38,686.46
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	136,730.53
其他	96,877.39
合计	272,294.38

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,777,191,636.88
减：卖出股票成本总额	1,598,274,845.05
买卖股票差价收入	178,916,791.83

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	10,560.00
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	10,560.00

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	19,870,998.33
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	19,752,260.00
减：应收利息总额	108,178.33
买卖债券差价收入	10,560.00

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-1,619,880.00

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	4,579,002.83
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	4,579,002.83
----	--------------

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	-84,185,891.25
—— 股票投资	-84,180,151.25
—— 债券投资	-5,740.00
—— 资产支持证券投资	-
—— 贵金属投资	-
—— 其他	-
2. 衍生工具	-
—— 权证投资	-
股指期货投资	-
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	-84,185,891.25

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	242,249.58
转换费收入	501.19
合计	242,750.77

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 50% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	4,147,903.54
银行间市场交易费用	350.00

合计	4,148,253.54
----	--------------

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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
上清所证书使用费	200.00
账户维护费	12,000.00
合计	121,295.94

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

无。

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
汇安基金管理有限责任公司（“汇安基金”）	基金管理人、基金登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人、基金销售机构
何斌	基金管理人的股东
秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东
戴新华	基金管理人的股东
刘强	基金管理人的股东
郭兆强	基金管理人的股东
尹喜杰	基金管理人的股东
王福德	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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6月16日(基金合同生效日) 至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,643,860.64	1,363,186.86
其中：支付销售机构的客户维护费	3,205,117.66	510,283.81

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6	上年度可比期间 2020年6月16日(基金合同生效日)
----	------------------------	--------------------------------

	月 30 日	至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,152,514.72	181,758.25

注：支付基金托管人中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资产投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

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 6 月 16 日(基金合同生效日)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
光大银行	2,039,360.95	38,686.46	376,611,262.07	271,006.54

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

无。

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
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	-
688383	新益昌	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 28 日	新股流通受限	19.58	106.24	2,701	52,885.58	286,954.24	-
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	818	38,715.94	206,103.28	-
301006	迈拓股份	2021 年 5 月 31 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	14.42	24.89	5,051	72,835.42	125,719.39	-
688667	菱电电控	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股流通受限	75.42	103.88	1,191	89,825.22	123,721.08	-
688661	和林微纳	2021 年 3 月 19 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
688639	华恒生物	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月	新股流通	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	-

		日	月 22 日	受限						
688628	优利德	2021 年 1 月 22 日	2021 年 8 月 2 日	新股 流通 受限	19.11	32.62	2,789	53,297.79	90,977.18	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 1 日	新股 流通 受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
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	925	30,728.50	80,937.50	-
688636	智明达	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	新股 流通 受限	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
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	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股 流通 受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
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	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股 流通 受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股 未上 市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
688655	迅捷兴	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股 流通 受限	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 1 日	新股 流通	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-

		日	月 6 日	受限						
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
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	360	10,180.80	41,655.60	-
688565	力源科技	2021 年 5 月 6 日	2021 年 11 月 15 日	新股流通受限	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-
688367	工大高科	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 28 日	新股流通受限	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
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	-
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	-
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	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月	新股流通	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-

		日	月 27 日	受限						
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	1,162	7,982.94	14,025.34	-
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	-
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	-
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	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
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	-
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	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月	新股流通	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-

		日	月 24 日	受限						
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	-
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	-
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	-
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	-
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	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
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	-
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	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月	新股流通	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

		日	月 29 日	受限						
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	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股 流通 受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
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	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股 流通 受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
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	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股 流通 受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
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	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
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	-
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	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 9 日	新股 流通	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

		日	月 17 日	受限						
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	-
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	-
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	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股 流通 受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
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	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股 流通 受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股 流通 受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
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	-
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	-
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	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 9 日	新股 流通	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

		日	月 20	受限						
			日							

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

4、以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收

益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

本基金在日常经营活动中涉及的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，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立董事会领导下的风险管理体系，包括董事会的下设的风险控制委员会、总经理下设的风险管理委员会、督察长、合规风控部以及各个业务部门组成。

公司致力于实行全面、系统的风险管理，通过制定系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司奉行分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，构建由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人；第二道监控防线由合规风控部构成，对公司运营过程中产生的或潜在的各项风险进行有效管理，并就内部控制及风险管理制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；第三道防线是由总经理及其下设的风险管理委员会构成，总经理负责公司日常经营管理中的风险管理工作。总经理下设风险管理委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控；第四道监控防线由董事会及其下设公司风险控制委员会构成。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险管理制度的有效执行。董事会下设公司风险控制委员会，协助董事会确立公司风险取向，风险总量、风险限额，制定和调整公司风险管理战略、原则、政策和指导方针，并确保其得到有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资或资产支持证券投资（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 1.12%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.86%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 787,819,080.36 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	49,786,323.22	-	-	-	49,786,323.22
结算备付金	8,815,986.99	-	-	-	8,815,986.99
交易性金融资产	-	-	-	801,509,060.17	801,509,060.17
应收利息	-	-	-	11,504.80	11,504.80
应收申购款	-	-	-	40,932.45	40,932.45
资产总计	58,602,310.21	-	-	801,561,497.42	860,163,807.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,394,975.04	8,394,975.04
应付管理人报酬	-	-	-	1,101,422.00	1,101,422.00
应付托管费	-	-	-	146,856.26	146,856.26
应付销售服务费	-	-	-	7,375.48	7,375.48
其他负债	-	-	-	260,889.75	260,889.75
负债总计	-	-	-	9,911,518.53	9,911,518.53
利率敏感度缺口	58,602,310.21	-	-	791,649,978.89	850,252,289.10
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	96,816,845.98	-	-	-	96,816,845.98
结算备付金	70,266,475.84	-	-	-	70,266,475.84
交易性金融资产	19,758,000.00	-	-	-1,615,410,459.66	1,635,168,459.66
应收利息	-	-	-	136,642.56	136,642.56
应收申购款	-	-	-	550,670.46	550,670.46
资产总计	186,841,321.82	-	-	-1,616,097,772.68	1,802,939,094.50
负债					
应付赎回	-	-	-	32,386,762.87	32,386,762.87

款					
应付管理人报酬	-	-	-	2,339,352.39	2,339,352.39
应付托管费	-	-	-	311,913.64	311,913.64
应付销售服务费	-	-	-	16,975.01	16,975.01
其他负债	-	-	-	251,062.63	251,062.63
负债总计	-	-	-	35,306,066.54	35,306,066.54
利率敏感度缺口	186,841,321.82	-	-	-1,580,791,706.14	1,767,633,027.96

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.12%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观

环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于本基金定义的核心资产主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	801,509,060.17	94.27	1,615,410,459.66	91.39
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	801,509,060.17	94.27	1,615,410,459.66	91.39

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外其他变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	41,469,976.09	-
沪深 300 指数下降 5%	-41,469,976.09	-	

注：于 2020 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

§ 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	801,509,060.17	93.18
	其中：股票	801,509,060.17	93.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	58,602,310.21	6.81
8	其他各项资产	52,437.25	0.01
9	合计	860,163,807.63	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	141,319.10	0.02
B	采矿业	87,243.59	0.01
C	制造业	555,581,078.53	65.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,191,152.30	0.61
E	建筑业	61,656.03	0.01
F	批发和零售业	419,933.99	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	15,995,528.76	1.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,295,360.07	3.92
J	金融业	103,257,300.30	12.14
K	房地产业	8,438,095.90	0.99
L	租赁和商务服务业	18,071,464.36	2.13
M	科学研究和技术服务业	25,680,938.86	3.02

N	水利、环境和公共设施管理业	120,306.35	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	7,732,000.00	0.91
R	文化、体育和娱乐业	27,419,420.00	3.22
S	综合	-	-
	合计	801,509,060.17	94.27

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	20,000	41,134,000.00	4.84
2	000858	五粮液	111,500	33,214,735.00	3.91
3	300059	东方财富	997,680	32,713,927.20	3.85
4	600036	招商银行	600,000	32,514,000.00	3.82
5	300750	宁德时代	60,000	32,088,000.00	3.77
6	600276	恒瑞医药	421,560	28,653,433.20	3.37
7	300413	芒果超媒	399,700	27,419,420.00	3.22
8	000001	平安银行	1,134,600	25,664,652.00	3.02
9	300887	谱尼测试	285,878	25,554,634.42	3.01
10	300633	开立医疗	711,800	22,478,644.00	2.64
11	600690	海尔智家	809,600	20,976,736.00	2.47
12	000651	格力电器	400,000	20,840,000.00	2.45
13	002832	比音勒芬	800,000	20,472,000.00	2.41
14	601012	隆基股份	224,000	19,900,160.00	2.34
15	002444	巨星科技	567,217	19,330,755.36	2.27
16	603501	韦尔股份	60,000	19,320,000.00	2.27
17	300760	迈瑞医疗	40,100	19,250,005.00	2.26
18	603298	杭叉集团	1,045,500	18,965,370.00	2.23
19	603986	兆易创新	100,000	18,790,000.00	2.21
20	601888	中国中免	60,000	18,006,000.00	2.12
21	002960	青鸟消防	661,348	17,300,863.68	2.03
22	002624	完美世界	704,050	16,833,835.50	1.98
23	000513	丽珠集团	330,802	16,546,716.04	1.95

24	002415	海康威视	250,137	16,133,836.50	1.90
25	603128	华贸物流	1,134,600	15,986,514.00	1.88
26	002555	三七互娱	661,800	15,896,436.00	1.87
27	603345	安井食品	60,000	15,241,200.00	1.79
28	600882	妙可蓝多	206,400	14,406,720.00	1.69
29	600309	万华化学	132,300	14,396,886.00	1.69
30	002475	立讯精密	300,000	13,800,000.00	1.62
31	002918	蒙娜丽莎	409,500	12,854,205.00	1.51
32	601636	旗滨集团	682,300	12,663,488.00	1.49
33	601166	兴业银行	600,000	12,330,000.00	1.45
34	603818	曲美家居	1,300,000	11,544,000.00	1.36
35	002557	洽洽食品	208,400	8,982,040.00	1.06
36	002340	格林美	945,500	8,840,425.00	1.04
37	300573	兴齐眼药	60,000	8,461,800.00	1.00
38	600048	保利地产	700,000	8,428,000.00	0.99
39	300782	卓胜微	15,000	8,062,500.00	0.95
40	600559	老白干酒	300,000	7,890,000.00	0.93
41	300347	泰格医药	40,000	7,732,000.00	0.91
42	002271	东方雨虹	139,100	7,695,012.00	0.91
43	002920	德赛西威	60,000	6,604,800.00	0.78
44	603290	斯达半导	20,000	6,400,000.00	0.75
45	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.61
46	300957	贝泰妮	8,174	2,204,654.92	0.26
47	688050	爱博医疗	3,520	1,329,785.60	0.16
48	688696	极米科技	1,252	1,041,664.00	0.12
49	300999	金龙鱼	12,114	1,029,205.44	0.12
50	688095	福昕软件	1,981	501,767.49	0.06
51	688660	电气风电	51,238	450,894.40	0.05
52	688606	奥泰生物	2,703	402,747.00	0.05
53	688055	龙腾光电	45,228	355,944.36	0.04
54	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.04
55	688311	盟升电子	4,182	305,286.00	0.04
56	688383	新益昌	2,701	286,954.24	0.03
57	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.03
58	688286	敏芯股份	1,681	234,297.78	0.03
59	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.03
60	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.02
61	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.02
62	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.02

63	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.02
64	688097	博众精工	3,983	132,235.60	0.02
65	301006	迈拓股份	5,051	125,719.39	0.01
66	688667	菱电电控	1,191	123,721.08	0.01
67	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.01
68	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
69	003035	南网能源	11,046	109,797.24	0.01
70	605111	新洁能	609	109,784.43	0.01
71	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.01
72	688560	明冠新材	3,832	92,351.20	0.01
73	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.01
74	300991	创益通	2,535	89,214.50	0.01
75	688607	康众医疗	1,890	87,507.00	0.01
76	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
77	300967	晓鸣股份	5,061	81,674.88	0.01
78	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
79	605358	立昂微	693	80,096.94	0.01
80	605117	德业股份	627	80,005.20	0.01
81	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.01
82	001203	大中矿业	3,808	76,731.20	0.01
83	688636	智明达	918	74,100.96	0.01
84	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.01
85	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.01
86	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
87	300960	通业科技	2,332	57,006.84	0.01
88	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.01
89	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
90	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.01
91	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
92	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.01
93	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.01
94	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.01
95	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
96	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.01
97	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
98	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.01
99	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
100	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
101	688679	通源环境	3,139	41,372.02	0.00

102	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00
103	003012	东鹏控股	2,278	37,905.92	0.00
104	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
105	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
106	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.00
107	003040	楚天龙	1,101	33,470.40	0.00
108	300900	广联航空	879	32,857.02	0.00
109	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00
110	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
111	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00
112	003016	欣贺股份	1,681	26,912.81	0.00
113	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
114	603324	盛剑环境	732	26,630.16	0.00
115	605136	丽人丽妆	867	26,382.81	0.00
116	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
117	605068	明新旭腾	641	23,056.77	0.00
118	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.00
119	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
120	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
121	605389	长龄液压	356	20,890.08	0.00
122	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
123	300884	狄耐克	748	20,106.24	0.00
124	300891	惠云钛业	1,143	19,876.77	0.00
125	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
126	605336	帅丰电器	701	18,856.90	0.00
127	605122	四方新材	703	18,770.10	0.00
128	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
129	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
130	605368	蓝天燃气	1,204	17,217.20	0.00
131	003029	吉大正元	716	17,069.44	0.00
132	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
133	003013	地铁设计	724	16,507.20	0.00
134	300913	兆龙互连	630	16,506.00	0.00
135	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
136	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
137	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
138	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
139	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
140	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00

141	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
142	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
143	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
144	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
145	003001	中岩大地	560	14,112.00	0.00
146	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
147	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
148	605169	洪通燃气	950	13,898.50	0.00
149	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
150	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00
151	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
152	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
153	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
154	300902	国安达	551	12,981.56	0.00
155	605058	澳弘电子	548	12,899.92	0.00
156	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
157	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
158	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
159	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
160	605286	同力日升	597	12,208.65	0.00
161	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
162	003042	中农联合	420	11,839.80	0.00
163	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
164	605228	神通科技	1,217	11,464.14	0.00
165	605303	园林股份	610	11,242.30	0.00
166	605018	长华股份	840	11,096.40	0.00
167	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
168	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
169	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
170	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
171	605277	新亚电子	507	10,662.21	0.00
172	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
173	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
174	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.00
175	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.00
176	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
177	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
178	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
179	300882	万胜智能	572	9,981.40	0.00

180	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
181	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
182	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
183	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
184	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
185	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
186	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
187	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
188	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
189	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
190	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
191	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
192	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
193	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
194	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
195	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
196	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
197	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
198	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
199	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
200	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
201	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
202	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
203	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
204	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
205	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
206	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
207	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
208	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
209	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
210	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	000651	格力电器	34,464,826.28	1.95

2	603298	杭叉集团	31,001,978.28	1.75
3	300896	爱美客	29,610,054.00	1.68
4	601166	兴业银行	29,451,794.26	1.67
5	002594	比亚迪	28,607,799.66	1.62
6	600276	恒瑞医药	25,958,104.14	1.47
7	000703	恒逸石化	24,822,582.56	1.40
8	002027	分众传媒	22,198,485.92	1.26
9	000002	万科 A	21,983,985.32	1.24
10	601012	隆基股份	21,866,227.00	1.24
11	300633	开立医疗	21,701,415.00	1.23
12	300413	芒果超媒	21,652,108.00	1.22
13	603818	曲美家居	21,463,945.64	1.21
14	002832	比音勒芬	18,315,566.60	1.04
15	300887	谱尼测试	17,543,662.20	0.99
16	600690	海尔智家	16,999,209.00	0.96
17	603128	华贸物流	16,937,720.00	0.96
18	000725	京东方 A	16,664,388.00	0.94
19	002340	格林美	16,329,861.00	0.92
20	000513	丽珠集团	15,769,948.10	0.89

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601318	中国平安	42,525,295.68	2.41
2	000858	五粮液	42,514,529.91	2.41
3	000333	美的集团	40,680,661.47	2.30
4	002078	太阳纸业	40,337,296.78	2.28
5	601888	中国中免	39,786,962.59	2.25
6	000725	京东方 A	39,374,250.00	2.23
7	600309	万华化学	38,305,878.20	2.17
8	002648	卫星石化	37,948,789.41	2.15
9	600519	贵州茅台	36,935,010.01	2.09
10	603259	药明康德	36,265,900.35	2.05
11	300059	东方财富	36,075,105.00	2.04

12	600048	保利地产	33,087,831.66	1.87
13	688111	金山办公	31,336,095.02	1.77
14	000651	格力电器	30,782,864.43	1.74
15	300573	兴齐眼药	30,717,590.36	1.74
16	603195	公牛集团	30,562,605.75	1.73
17	603501	韦尔股份	28,842,291.60	1.63
18	300347	泰格医药	28,628,338.00	1.62
19	002594	比亚迪	27,263,215.58	1.54
20	300896	爱美客	26,890,939.26	1.52

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	868,553,596.81
卖出股票收入（成交）总额	1,777,191,636.88

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					-1,619,880.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					0.00

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持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的招商银行的发行主体招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 21 日，因为同业投资提供第三方信用担保等事由受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2021〕16 号）。该主体作为股票发行人，经营稳健，业绩良好，所受处罚不影响发行人的实际经营，经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该主体发行的债券被纳入本基金的实际投资组合。本基金投资的其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,504.80
5	应收申购款	40,932.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,437.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
汇安核心资产混合 A	10,290	67,902.03	30,196,679.04	4.32%	668,515,232.69	95.68%
汇安核心资产混合 C	610	23,325.86	0.00	0.00%	14,228,772.24	100.00%
合计	10,900	65,407.40	30,196,679.04	4.24%	682,744,004.93	95.76%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	汇安核心资产混合 A	98.90	0.0000%
	汇安核心资产混合 C	0.00	0.0000%
	合计	98.90	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	汇安核心资产混合 A	0
	汇安核心资产混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安核心资产混合 A	0
	汇安核心资产混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇安核心资产混 合 A	汇安核心资产混 合 C
基金合同生效日（2020 年 6 月 16 日）基金份额总额	2,306,058,841.15	70,387,247.39
本报告期期初基金份额总额	1,522,293,942.15	33,544,697.98
本报告期基金总申购份额	51,533,833.04	1,999,495.55
减：本报告期基金总赎回份额	875,115,863.46	21,315,421.29
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	698,711,911.73	14,228,772.24

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

本基金管理人 2021 年 1 月 5 日发布公告，邹唯先生任公司副总经理。

本报告期内，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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日(2020 年 6 月 16 日)起至今聘任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华西证券	2	2,632,818,175.80	100.00%	2,107,893.38	100.00%	-

注：(1) 基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和

券商协作表现评价等四个方面。

(2) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
- 2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

(3) 交易单元变更情况

本基金本报告期内无交易单元变更。

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
华西证券	-	-	-	-	-	-

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	汇安基金管理有限责任公司关于变更高级管理人员的公告	规定报刊和/或公司网站	2021年1月5日
2	汇安核心资产混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	规定报刊和/或公司网站	2021年1月22日
3	汇安核心资产混合型证券投资基金 2020 年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2021年3月31日
4	汇安核心资产混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	规定报刊和/或公司网站	2021年4月22日
5	汇安核心资产混合型证券投资基金（2021 年第 1 号）招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2021年5月18日
6	汇安核心资产混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2021年5月18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

本基金本报告期内未存在单一基金份额持有人持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安核心资产混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安核心资产混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安核心资产混合型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安核心资产混合型证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 报告期内在规定报刊及规定网站上披露的各项公告

12.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 13 层

上海市虹口区东大名路 501 白玉兰大厦 36 层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话 010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

2021 年 8 月 31 日