

华安宝利配置证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十日

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 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
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	48
9	开放式基金份额变动	48
10	重大事件揭示	48
10.1	基金份额持有人大会决议	48
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4	基金投资策略的改变	48
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	48
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8.2	基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况	50
10.9	其他重大事件	50
11	备查文件目录	52
11.1	备查文件目录	52
11.2	存放地点	52
11.3	查阅方式	52

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安宝利配置证券投资基金	
基金简称	华安宝利配置混合	
基金主代码	040004	
交易代码	040004(前端)	041004(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004 年 8 月 24 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,125,377,923.17 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会，灵活配置资产，并充分提高基金资产的使用效率，在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。
投资策略	基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析，采用积极的投资组合策略，保留可控制的风险，规避或降低无法控制的风险，发现和捕捉市场机会以实现基金的投资目标。
业绩比较基准	35%×天相转债指数收益率+30%×天相 280 指数收益率+30%×天相国债全价指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等)，但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为：利率风险,政策风险，经济周期风险，信用风险，再投资风险，上市公司经营风险，新产品创新带来的风险，购买力风险，流动性风险，现金管理风险，技术风险，管理风险，巨额赎回风险等。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	陆志俊
	联系电话	021-38969999	95559
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号

	—32层	
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	中国（上海）长宁区仙霞路18 号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	朱学华	任德奇

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.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、 32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、 32 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	650,012,274.51
本期利润	100,595,327.34
加权平均基金份额本期利润	0.0413
本期加权平均净值利润率	3.34%
本期基金份额净值增长率	2.61%
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	543,165,832.34
期末可供分配基金份额利润	0.2556
期末基金资产净值	2,668,543,755.51
期末基金份额净值	1.256
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1,846.91%

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（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润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）。

3.2 基金净值表现

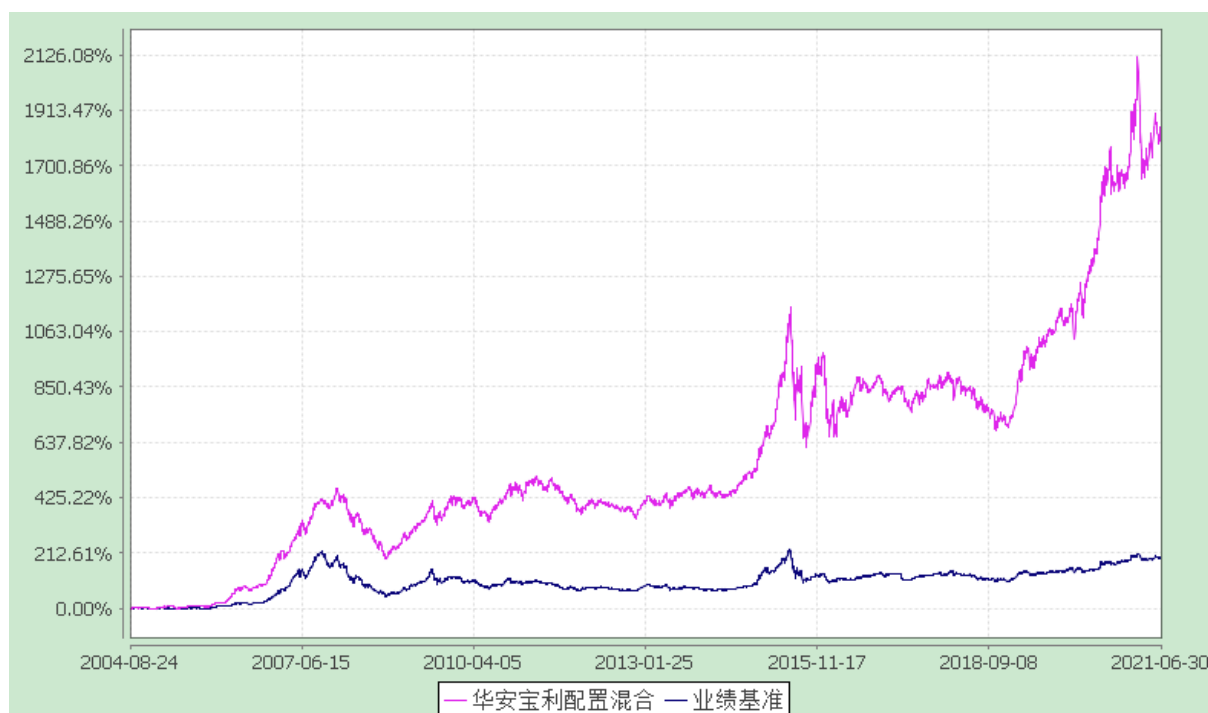
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.10%	0.82%	-0.39%	0.36%	-1.71%	0.46%
过去三个月	7.81%	1.08%	3.14%	0.39%	4.67%	0.69%
过去六个月	2.61%	1.56%	2.34%	0.53%	0.27%	1.03%
过去一年	23.67%	1.43%	13.24%	0.58%	10.43%	0.85%
过去三年	118.35%	1.26%	32.71%	0.58%	85.64%	0.68%
自基金合同生效起至今	1,846.91%	1.32%	197.63%	0.82%	1,649.28%	0.50%

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

华安宝利配置证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2004 年 8 月 24 日至 2021 年 6 月 30 日)



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2021 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 163 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,256.69 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
陈媛	本基金的基金	2018-11-12	-	13 年	硕士研究生，13 年基金行业从业

	经理				经验。2008 年 4 月上海交通大学应届毕业生加入华安基金, 历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2018 年 2 月起, 担任华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月至 2019 年 8 月同时担任华安行业轮动股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起, 同时担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月起, 同时担任华安优质生活混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起, 同时担任华安新兴消费混合型证券投资基金的基金经理。
--	----	--	--	--	---

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、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，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义

对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

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 年上半年市场大幅震荡。期间上证综指涨 3.4%，中小板综和创业板综分别涨 5.19% 和 14.1%，沪深 300 涨 0.24%，大小指数分化极其显著。从中信行业来看，新能源、钢铁、煤炭、电子、汽车、医药、有色等科技成长表现较好，非银、家电、食品、军工、农业等表现落后，且一二季度的行业

表现差异较大。

我们在上半年减少了家电的配置，增加了医美、银行、财富管理等行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.256 元，本报告期份额净值增长率为 2.61%，同期业绩比较基准增长率为 2.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对经济判断：经济大概率已经走过最好的时点，随着海外消费复苏从实物消费延伸至服务消费，对我国出口的拉动效应逐渐减弱，投资方面基建与地产的贡献度也都在下降，而消费一直恢复较另外两驾马车更加滞后，其主要原因是居民收入的降速以及为应对不确定性增加的预防性储蓄，所以消费对经济的拉动作用相对较弱，经济恢复的速率边际趋缓。

股市展望：我们认为下半年要更加谨慎，经济下行带来的基本面低于预期风险在逐步加大。2 季度市场整体震荡向上的重要原因之一是流动性的持续宽松，全球央行对通胀保持了相当高的容忍态度，美债长端利率持续下行。往未来两个季度看，流动性继续边际宽松的概率不大，而美债短端利率的上行已经在反应加息预期本身，而此刻长端下行更多的是反应经济预期的趋弱，本身并不是一个利于权益资产表现的组合。所以下半年要密切关注基本面波动，尽量避免基本面低于预期带来的双杀。

操作思路：近期消费类行业大幅下跌，高景气行业也出现剧烈波动，我们认为与互联网、教育监管政策相关，市场在担忧民生类行业的盈利性前景以及商业模式带来的高毛利的可持续性。我们认为在市场情绪裹挟之下要避免做出错误的判断，更适合从朴素的逻辑出发，相信人民群众追求美好生活的愿望不会消失，消费升级仍是重要的经济驱动力，能够提供差异化服务和产品的优质公司仍会拥有良好的发展前景。现在时点更应该着眼长期，寻找优质公司的错杀机会。在市场风格波动之外，我们认为随着基数效应减退，经济本身又进入低波动状态，增长重新变得稀缺，有确定性增长的行业和公司能够重新获得关注，但景气度的变化方向是短期最重要的影响要素之一。计划降低整体组合与经济的相关性，3 个方向：一是本身渗透率正在快速提升过程中，能够对冲经济下行压力的行业；二是本身与经济相关性较低的必选消费品；三是虽然也与经济正相关，但短期与疫情相关性更大的线下消费场景类公司，随着疫苗注射推进和疫情消退，有望出现 ROE 拐点，但此类公司

受疫情影响较为显著，需要更严格的进行合理性测算。

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，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，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

本报告期不进行收益分配。

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

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 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，基金托管人在华安宝利配置证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，华安基金管理有限公司在华安宝利配置证券投资基金投资运作、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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安宝利配置证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安宝利配置证券投资基金

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	462,710,574.07	467,659,254.04
结算备付金		-	8,180,278.64
存出保证金		862,798.10	1,087,697.07
交易性金融资产	6.4.7.2	2,210,797,303.16	4,019,106,866.40
其中：股票投资		1,882,579,932.64	3,513,436,517.33
基金投资		-	-
债券投资		328,217,370.52	505,670,349.07
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		200,847.17	-
应收利息	6.4.7.5	4,618,629.54	8,163,311.82
应收股利		-	-
应收申购款		2,081,088.57	2,262,834.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,681,271,240.61	4,506,460,242.26
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		-	8,876,220.10
应付赎回款		6,764,981.90	7,013,878.10
应付管理人报酬		2,614,653.99	4,456,236.24
应付托管费		544,719.56	928,382.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,414,244.40	3,891,029.42
应交税费		77.09	10.52
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	388,808.16	491,885.61
负债合计		12,727,485.10	25,657,642.54
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	2,125,377,923.17	3,659,487,326.21
未分配利润	6.4.7.10	543,165,832.34	821,315,273.51
所有者权益合计		2,668,543,755.51	4,480,802,599.72
负债和所有者权益总计		2,681,271,240.61	4,506,460,242.26

注：报告截至日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.256 元，基金份额总额 2,125,377,923.17 份。

6.2 利润表

会计主体：华安宝利配置证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		127,391,361.61	751,073,219.77
1.利息收入		5,046,996.46	5,600,030.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,343,158.02	1,540,631.27
债券利息收入		3,703,838.44	4,059,399.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		668,922,034.88	126,864,011.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	661,590,194.57	103,379,983.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-338,021.91	-1,159,326.30

资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.14	7,669,862.22	24,643,354.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-549,416,947.17	617,916,498.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,839,277.44	692,678.85
减：二、费用		26,796,034.27	24,177,410.94
1. 管理人报酬		18,046,782.93	15,522,097.45
2. 托管费		3,759,746.43	3,233,770.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	4,853,817.01	5,291,838.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		23.77	231.07
7. 其他费用	6.4.7.18	135,664.13	129,473.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		100,595,327.34	726,895,808.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		100,595,327.34	726,895,808.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安宝利配置证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,659,487,326.21	821,315,273.51	4,480,802,599.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	100,595,327.34	100,595,327.34
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）	-1,534,109,403.04	-378,744,768.51	-1,912,854,171.55
其中：1.基金申购款	350,607,468.69	86,930,806.12	437,538,274.81
2.基金赎回款	-1,884,716,871.73	-465,675,574.63	-2,350,392,446.36
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）	-	-	-

填列)			
五、期末所有者权益（基金净值）	2,125,377,923.17	543,165,832.34	2,668,543,755.51
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,880,819,297.73	202,553,160.27	2,083,372,458.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	726,895,808.83	726,895,808.83
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）	1,992,672,127.41	544,021,329.47	2,536,693,456.88
其中：1.基金申购款	2,519,273,193.50	632,778,920.36	3,152,052,113.86
2.基金赎回款	-526,601,066.09	-88,757,590.89	-615,358,656.98
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）	-	-939,850,827.84	-939,850,827.84
五、期末所有者权益（基金净值）	3,873,491,425.14	533,619,470.73	4,407,110,895.87

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：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安宝利配置证券投资基金(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”)证监基金字[2004]第 97 号《关于同意华安宝利配置证券投资基金设立的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宝利配置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 1,130,461,912.15 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2004)第 161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安宝利配置证券投资基金基金合同》于 2004 年 8 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,130,480,770.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,857.93 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和最新发布的《华安宝利配置证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行的、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的目标比例为 45%，最低比例为 10%，最高比例为 70%(其中所对应的基础股票的投资比例不超过基金资产净值的 20%)；除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的目标比例为 30%，最低比例为 10%，最高比例为 65%；除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的目标比例为 20%，最低比例为 10%，最高比例为 65%。本基金的业绩比较基准为：天相转债指数收益率×35%+天相 280 指数收益率×30%+天相国债全价指数收益率×30%+金融同业存款利率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2021 年 8 月 25 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》、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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

本基金 2021 年上半年度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 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外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	462,710,574.07
定期存款	-
其他存款	-
合计	462,710,574.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,167,926,587.25	1,882,579,932.64	714,653,345.39
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	13,935,141.70	17,740,370.52
	银行间市场	309,957,610.00	310,477,000.00
	合计	323,892,751.70	328,217,370.52
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,491,819,338.95	2,210,797,303.16	718,977,964.21

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

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	80,980.78
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	-
应收债券利息	4,537,299.29
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	349.47
合计	4,618,629.54

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

交易所市场应付交易费用	2,414,244.40
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,414,244.40

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	22,769.06
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	56,531.73
其他	250,000.00
合计	388,808.16

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,659,487,326.21	3,659,487,326.21
本期申购	350,607,468.69	350,607,468.69
本期赎回（以“-”号填列）	-1,884,716,871.73	-1,884,716,871.73
本期末	2,125,377,923.17	2,125,377,923.17

注：申购含转入份额，赎回含转出份额。

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	46,822,853.96	774,492,419.55	821,315,273.51
本期利润	650,012,274.51	-549,416,947.17	100,595,327.34
本期基金份额交易产生的变动数	-147,394,101.25	-231,350,667.26	-378,744,768.51
其中：基金申购款	63,175,394.84	23,755,411.28	86,930,806.12
基金赎回款	-210,569,496.09	-255,106,078.54	-465,675,574.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	549,441,027.22	-6,275,194.88	543,165,832.34

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,326,147.31
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	8,217.95
其他	8,792.76
合计	1,343,158.02

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,171,853,481.65
减：卖出股票成本总额	1,510,263,287.08
买卖股票差价收入	661,590,194.57

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	511,417,267.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	503,281,930.00
减：应收利息总额	8,473,359.47
买卖债券差价收入	-338,021.91

6.4.7.14 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	7,669,862.22
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	7,669,862.22

6.4.7.15 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	-549,416,947.17
——股票投资	-554,206,888.62
——债券投资	4,789,941.45
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-549,416,947.17

6.4.7.16 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	2,736,575.39
转换费收入	102,702.05
合计	2,839,277.44

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.17 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	4,851,767.01
银行间市场交易费用	2,050.00
合计	4,853,817.01

6.4.7.18 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	56,531.73
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,025.03
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	135,664.13

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

根据本基金管理人于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经基金管理人股东会第六十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可【2021】669 号文核准，基金管理人股东上海锦江国际投资管理有限公司将其持有的公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	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

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期和上年度可比期间均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1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,046,782.93	15,522,097.45
其中：支付销售机构的客户维护费	3,314,843.90	2,154,230.81

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%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：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.2% / 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月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,759,746.43	3,233,770.31

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末和上年度末均无投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	462,710,574.07	1,326,147.31	599,073,748.95	1,503,831.96

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安	605005	合兴股份	网下申购	634.00	4,044.92
国泰君安	688070	纵横股份	网下申购	2,407.00	56,024.85
国泰君安	688677	海泰新光	网下申购	1,768.00	63,539.80
国泰君安	605089	味知香	网下申购	370.00	10,556.10
国泰君安	605180	华生科技	网下申购	384.00	8,593.92
国泰君安	688395	正弦电气	网下申购	1,627.00	26,080.40
国泰君安	605319	无锡振华	网下申购	764.00	8,572.08
国泰君安	301009	可靠股份	网下申购	8,007.00	100,407.78
国泰君安	688276	百克生物	网下申购	3,486.00	127,349.68
国泰君安	688087	英科再生	网下申购	2,469.00	54,490.34
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本报告期不进行收益分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688161	威高骨科	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	36.22	82.27	3,069.00	111,159.18	252,486.63	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	853.00	40,372.49	214,921.88	-
688619	罗普特	2021-02-08	2021-08-23	新股限售	19.31	26.74	5,856.00	113,079.36	156,589.44	-
688687	凯因科技	2021-01-29	2021-08-09	新股限售	18.98	27.98	5,354.00	101,618.92	149,804.92	-
688621	阳光诺和	2021-06-11	2021-12-21	新股限售	26.89	63.99	1,485.00	39,931.65	95,025.15	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	925.00	30,728.50	80,937.50	-
688359	三孚新科	2021-05-14	2021-11-22	新股限售	11.03	26.35	2,213.00	24,409.39	58,312.55	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	601.00	29,202.59	54,324.39	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	-
688659	元琛科技	2021-03-24	2021-10-08	新股限售	6.50	10.46	3,671.00	23,861.50	38,398.66	-
688395	正弦电气	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	15.95	22.37	1,627.00	25,950.65	36,395.99	-
688067	爱威科技	2021-06-07	2021-12-16	新股限售	14.71	24.83	1,259.00	18,519.89	31,260.97	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股限售	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股限售	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-

300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股限售	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-01-25	新股限售	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股限售	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-02-02	新股限售	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-02-07	新股限售	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-02-03	新股限售	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-00-11	新股限售	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-02-30	新股限售	13.75	32.98	275.00	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-00-11	新股限售	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股限售	8.67	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股限售	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股限售	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-01-01	新股限售	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-01-11	新股限售	6.79	26.81	301.00	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-00-26	新股限售	8.42	13.60	593.00	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股限售	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-

300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股限售	12.10	19.29	410.00	4,961.00	7,908.90	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312.00	2,436.72	6,845.28	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	782.00	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股限售	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股限售	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股限售	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股限售	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股限售	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234.00	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	8.86	555.00	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股限售	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-

301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029.00	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926.00	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	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995.00	44,255.70	44,255.70	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	配债未上市	100.00	100.00	2.00	200.00	200.00	-

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只进行主动投资的配置型证券投资基金，属于偏低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过挖掘存在于各相关证券市场以及不同金融工具之间的投资机会，灵活配置资产，并充分提高基金资产的使用效率，在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行交通银行，与该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。

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，有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大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，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资

金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

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	462,710,574.07	-	-	-	462,710,574.07
存出保证金	862,798.10	-	-	-	862,798.10
交易性金融资产	328,217,370.52	-	-	1,882,579,932.64	2,210,797,303.16
应收证券清算款	-	-	-	200,847.17	200,847.17
应收利息	-	-	-	4,618,629.54	4,618,629.54
应收申购款	-	-	-	2,081,088.57	2,081,088.57
资产总计	791,790,742.69	-	-	1,889,480,497.92	2,681,271,240.61
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	6,764,981.90	6,764,981.90
应付管理人报酬	-	-	-	2,614,653.99	2,614,653.99
应付托管费	-	-	-	544,719.56	544,719.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,414,244.40	2,414,244.40
应交税费	-	-	-	77.09	77.09
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	388,808.16	388,808.16
负债总计	-	-	-	12,727,485.10	12,727,485.10
利率敏感度缺口	791,790,742.69	-	-	1,876,753,012.82	2,668,543,755.51
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	467,659,254.04	-	-	-	467,659,254.04

结算备付金	8,180,278.64	-	-	-	8,180,278.64
存出保证金	1,087,697.07	-	-	-	1,087,697.07
交易性金融资产	475,283,349.07	30,387,000.00	-	3,513,436,517.33	4,019,106,866.40
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	8,163,311.82	8,163,311.82
应收申购款	-	-	-	2,262,834.29	2,262,834.29
资产总计	952,210,578.82	30,387,000.00	-	3,523,862,663.44	4,506,460,242.26
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	8,876,220.10	8,876,220.10
应付赎回款	-	-	-	7,013,878.10	7,013,878.10
应付管理人报酬	-	-	-	4,456,236.24	4,456,236.24
应付托管费	-	-	-	928,382.55	928,382.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,891,029.42	3,891,029.42
应交税费	-	-	-	10.52	10.52
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	491,885.61	491,885.61
负债总计	-	-	-	25,657,642.54	25,657,642.54
利率敏感度缺口	952,210,578.82	30,387,000.00	-	3,498,205,020.90	4,480,802,599.72

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率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

于 2021 年 6 月 30 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 12.30%(2020 年 12 月 31 日：11.29%)，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。

本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会，灵活配置资产，并充分提高基金资产的使用效率，在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。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。本基金投资组合中可转换债券及其对应的基础股票投资比例为基金资产净值的 10%-70%，除可转换债券外的其它债券投资比例为基金资产净值的 10%-65%，除可转换债券所对应基础股票外的其它股票投资比例为基金资产净值的 10%-65%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,882,579,932.64	70.55	3,513,436,517.33	78.41
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	1,882,579,932.64	70.55	3,513,436,517.33	78.41

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 31,226	增加约 36,759
	业绩比较基准下降 5%	减少约 31,226	减少约 36,759

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,882,579,932.64	70.21
	其中：股票	1,882,579,932.64	70.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	328,217,370.52	12.24
	其中：债券	328,217,370.52	12.24
	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	462,710,574.07	17.26
8	其他各项资产	7,763,363.38	0.29

9	合计	2,681,271,240.61	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	999,629.38	0.04
B	采矿业	10,512.39	0.00
C	制造业	1,217,918,155.76	45.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	36,301.73	0.00
F	批发和零售业	383,959.82	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	34,603.55	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,302,796.47	0.20
J	金融业	411,484,806.20	15.42
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	244,818,058.68	9.17
M	科学研究和技术服务业	772,012.17	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	777,061.61	0.03
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	12,752.46	0.00
	合计	1,882,579,932.64	70.55

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

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	603345	安井食品	1,019,245	258,908,614.90	9.70
2	000858	五粮液	729,200	217,221,388.00	8.14

3	601888	中国中免	679,890	204,034,989.00	7.65
4	600519	贵州茅台	98,059	201,677,945.30	7.56
5	300896	爱美客	170,538	134,534,017.44	5.04
6	603187	海容冷链	2,933,427	125,785,349.76	4.71
7	300059	东方财富	3,037,424	99,597,132.96	3.73
8	002142	宁波银行	2,188,640	85,291,300.80	3.20
9	000001	平安银行	3,390,371	76,690,192.02	2.87
10	600690	海尔智家	2,167,220	56,152,670.20	2.10
11	688363	华熙生物	198,647	55,196,055.42	2.07
12	601012	隆基股份	613,158	54,472,956.72	2.04
13	600000	浦发银行	5,148,200	51,482,000.00	1.93
14	300791	仙乐健康	824,600	45,682,840.00	1.71
15	300662	科锐国际	671,686	40,717,605.32	1.53
16	601838	成都银行	2,991,700	37,815,088.00	1.42
17	600919	江苏银行	4,260,816	30,251,793.60	1.13
18	300285	国瓷材料	433,300	21,123,375.00	0.79
19	002475	立讯精密	387,465	17,823,390.00	0.67
20	600908	无锡银行	2,531,000	14,679,800.00	0.55
21	601229	上海银行	1,629,900	13,365,180.00	0.50
22	603899	晨光文具	100,700	8,515,192.00	0.32
23	000333	美的集团	85,151	6,077,226.87	0.23
24	300957	贝泰妮	8,523	2,298,784.18	0.09
25	601995	中金公司	35,643	2,192,044.50	0.08
26	688561	奇安信	23,563	2,175,100.53	0.08
27	300866	安克创新	9,451	1,582,758.97	0.06
28	300888	稳健医疗	10,265	1,268,959.30	0.05
29	688256	寒武纪	8,962	1,238,548.40	0.05
30	688521	芯原股份	13,200	1,029,204.00	0.04
31	300979	华利集团	9,246	1,028,699.40	0.04
32	002714	牧原股份	15,359	934,134.38	0.04
33	300357	我武生物	13,739	880,944.68	0.03
34	000895	双汇发展	26,555	844,449.00	0.03
35	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.03
36	000888	峨眉山 A	88,800	569,208.00	0.02
37	300973	立高食品	3,593	542,770.60	0.02
38	002174	游族网络	29,516	506,789.72	0.02
39	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.02
40	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.01
41	688277	天智航	8,810	316,895.70	0.01
42	688155	先惠技术	2,403	286,197.30	0.01
43	603195	公牛集团	1,359	274,518.00	0.01
44	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.01
45	301009	可靠股份	8,007	265,037.97	0.01
46	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.01

47	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.01
48	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.01
49	688386	泛亚微透	3,217	188,998.75	0.01
50	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.01
51	688513	苑东生物	3,847	173,307.35	0.01
52	688308	欧科亿	2,457	166,510.89	0.01
53	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.01
54	688619	罗普特	5,856	156,589.44	0.01
55	301006	迈拓股份	5,051	154,055.50	0.01
56	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.01
57	600585	海螺水泥	3,044	124,956.20	0.00
58	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
59	000739	普洛药业	3,800	111,720.00	0.00
60	688551	科威尔	2,211	110,726.88	0.00
61	688316	青云科技	1,428	102,102.00	0.00
62	688678	福立旺	4,198	99,492.60	0.00
63	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.00
64	688633	星球石墨	1,558	87,045.46	0.00
65	300920	润阳科技	2,503	84,301.04	0.00
66	605117	德业股份	627	80,005.20	0.00
67	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.00
68	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
69	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.00
70	300869	康泰医学	862	61,046.84	0.00
71	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.00
72	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
73	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.00
74	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.00
75	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
76	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
77	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
78	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.00
79	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
80	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.00
81	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.00
82	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.00
83	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
84	605337	李子园	788	46,886.00	0.00
85	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
86	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
87	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.00
88	002990	盛视科技	1,224	39,608.64	0.00
89	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.00
90	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.00

91	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.00
92	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
93	300900	广联航空	879	32,857.02	0.00
94	605089	味知香	370	32,197.40	0.00
95	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
96	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
97	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00
98	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
99	603324	盛剑环境	732	26,630.16	0.00
100	000568	泸州老窖	100	23,594.00	0.00
101	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
102	601818	光大银行	6,000	22,680.00	0.00
103	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
104	605378	野马电池	473	21,729.62	0.00
105	300833	浩洋股份	406	21,160.72	0.00
106	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
107	603288	海天味业	156	20,116.20	0.00
108	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
109	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
110	300898	熊猫乳品	496	17,984.96	0.00
111	605208	永茂泰	801	17,485.83	0.00
112	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
113	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
114	300913	兆龙互连	630	16,506.00	0.00
115	300529	健帆生物	190	16,408.40	0.00
116	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
117	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
118	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
119	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
120	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
121	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
122	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
123	300838	浙江力诺	909	14,189.49	0.00
124	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
125	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
126	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
127	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
128	300902	国安达	551	12,981.56	0.00
129	000009	中国宝安	698	12,752.46	0.00
130	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
131	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
132	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
133	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.00
134	003042	中农联合	420	11,839.80	0.00

135	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
136	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
137	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
138	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
139	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
140	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
141	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
142	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
143	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
144	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
145	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
146	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
147	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
148	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
149	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
150	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
151	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
152	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
153	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
154	600845	宝信软件	169	8,602.10	0.00
155	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
156	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
157	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
158	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
159	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
160	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
161	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
162	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
163	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
164	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
165	600009	上海机场	140	6,738.20	0.00
166	002959	小熊电器	100	6,644.00	0.00
167	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
168	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
169	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
170	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
171	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
172	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
173	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
174	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
175	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
176	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
177	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
178	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

179	600859	王府井	100	2,888.00	0.00
180	300840	酷特智能	85	1,247.80	0.00
181	605116	奥锐特	42	588.84	0.00
182	605018	长华股份	40	528.40	0.00
183	601187	厦门银行	29	274.92	0.00
184	300901	中胤时尚	11	185.57	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	600919	江苏银行	75,803,730.77	1.69
2	600000	浦发银行	55,995,514.90	1.25
3	688363	华熙生物	49,668,423.36	1.11
4	002475	立讯精密	46,096,385.60	1.03
5	600887	伊利股份	45,050,340.89	1.01
6	600809	山西汾酒	32,173,685.35	0.72
7	601838	成都银行	30,960,252.98	0.69
8	300285	国瓷材料	21,278,199.35	0.47
9	600908	无锡银行	17,026,678.00	0.38
10	603369	今世缘	16,135,021.00	0.36
11	000596	古井贡酒	16,076,652.00	0.36
12	601229	上海银行	14,106,580.77	0.31
13	601012	隆基股份	2,215,065.60	0.05
14	688819	天能股份	1,186,083.78	0.03
15	688538	和辉光电	994,163.40	0.02
16	300957	贝泰妮	403,393.59	0.01
17	688425	铁建重工	388,259.34	0.01
18	300979	华利集团	307,152.12	0.01
19	300981	中红医疗	291,685.77	0.01
20	688660	电气风电	278,734.72	0.01

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	288,431,722.60	6.44

2	601888	中国中免	246,768,534.06	5.51
3	603345	安井食品	158,968,090.68	3.55
4	603369	今世缘	148,987,474.45	3.33
5	000858	五粮液	147,902,658.25	3.30
6	001914	招商积余	121,228,696.58	2.71
7	600690	海尔智家	107,559,436.68	2.40
8	603517	绝味食品	93,559,489.22	2.09
9	600887	伊利股份	91,226,278.87	2.04
10	002475	立讯精密	90,595,242.13	2.02
11	600519	贵州茅台	87,375,283.42	1.95
12	002127	南极电商	83,804,442.66	1.87
13	300896	爱美客	63,194,102.51	1.41
14	601012	隆基股份	57,488,795.40	1.28
15	603317	天味食品	53,509,222.04	1.19
16	600919	江苏银行	53,083,258.21	1.18
17	002507	涪陵榨菜	47,251,133.46	1.05
18	000568	泸州老窖	35,207,032.48	0.79
19	300662	科锐国际	33,359,609.30	0.74
20	002304	洋河股份	30,240,415.96	0.67

注：本项“卖出金额”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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	433,613,591.01
卖出股票的收入（成交）总额	2,171,853,481.65

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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	2,004,000.00	0.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	310,477,000.00	11.63
	其中：政策性金融债	310,477,000.00	11.63
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）	15,736,370.52	0.59
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	328,217,370.52	12.30

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	200409	20 农发 09	1,200,000	120,228,000.00	4.51
2	210201	21 国开 01	1,000,000	100,060,000.00	3.75
3	210401	21 农发 01	500,000	50,105,000.00	1.88
4	200314	20 进出 14	400,000	40,084,000.00	1.50
5	123113	仙乐转债	64,380	7,882,687.20	0.30

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投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2020 年 10 月 16 日，宁波银行因授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2020〕48 号）给予罚款人民币 30 万元的行政处罚，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分。2021 年 6 月 10 日，宁波银行因代理销售保险不规范，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2021〕36 号）给予罚款人民币 25 万元的行政处罚，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

2020 年 10 月 16 日，平安银行因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违法违规事项，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2020〕66 号）给予合计罚款人民币 100 万元的行政处罚。2021 年 5 月 28 日，平安银行因利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险等违法违规事项，被中国银保监会云南监管局（云银保监罚决字〔2021〕34 号）给予罚款人民币 210 万元的行政处罚。

报告期内，本基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	862,798.10
2	应收证券清算款	200,847.17
3	应收股利	-
4	应收利息	4,618,629.54
5	应收申购款	2,081,088.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	7,763,363.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128136	立讯转债	1,057,695.80	0.04

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

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
145,551	14,602.29	361,414,268.66	17.00%	1,763,963,654.51	83.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	247,605.91	0.01%
------------------	------------	-------

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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004 年 8 月 24 日）基金份额总额	1,130,480,770.08
本报告期期初基金份额总额	3,659,487,326.21
本报告期基金总申购份额	350,607,468.69
减：本报告期基金总赎回份额	1,884,716,871.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,125,377,923.17

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2021 年 2 月 6 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，杨牧云先生新任本基金管理人的督察长。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	955,333,879.95	36.85%	889,702.35	36.85%	-
中信证券	1	625,806,568.53	24.14%	582,822.15	24.14%	-
长城证券	1	489,120,561.70	18.87%	455,528.01	18.87%	-
东莞证券	1	229,933,426.31	8.87%	214,136.68	8.87%	-
中金财富证券	1	147,194,204.47	5.68%	137,080.89	5.68%	-
中信建投	1	128,789,928.06	4.97%	119,942.39	4.97%	-
申万宏源	1	16,139,629.60	0.62%	15,031.93	0.62%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

（1）内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

（2）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

（3）具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

（4）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易

单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

10.8.2 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		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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	1,495.01	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(合兴股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-12
2	华安宝利配置证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-21

3	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(纵横股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-03
4	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-06
5	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(海泰新光)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-19
6	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-09
7	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加盛京银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-20
8	关于旗下部分基金参加盈米基金费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-24
9	华安宝利配置证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-30
10	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（味知香）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-20
11	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（华生科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-21
12	华安宝利配置证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-21
13	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（正弦电气）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-22
14	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（无锡振华）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-05-31
15	华安宝利配置证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-05-31
16	华安宝利配置证券投资基金更新的招募说明书（2021 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-05-31
17	关于终止苏州财路基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2021-06-07

		定媒介	
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（可靠股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-09
19	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（百克生物）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-18

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》
- 2、《华安宝利配置证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安宝利配置证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安宝利配置证券投资基金设立的文件
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日