淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:淳厚基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 30 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。

基金托管人光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月27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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 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 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 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 13
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 13
§6 中期财务会计报告(未经审计) 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 47
7.1 期末基金资产组合情况 47
7.2 报告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 53
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 57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 57
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 58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 58

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 58
§9 开放式基金份额变动 59
§10 重大事件揭示 59
10.1 基金份额持有人大会决议 59
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 59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 59
10.4 基金投资策略的改变 59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 59
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 59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 60
10.8 其他重大事件 61
§11 影响投资者决策的其他重要信息 62
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 62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 62
§12 备查文件目录 62
12.1 备查文件目录 62
12.2 存放地点 62
12.3 查阅方式 63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金
基金简称	淳厚欣颐
基金主代码	010551
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月22日
基金管理人	淳厚基金管理有限公司
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	560,457,886.99份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对企业基本面全面、深入的研究，持续挖掘具有长期发展潜力和估值优势的上市公司，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、衍生品投资策略；6、融资业务的投资策略
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%＋经人民币汇率调整的中证港股通综合指数收益率×20%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，其预期风险收益水平低于股票型证券投资基金、高于债券型证券投资基金、货币市场基金。 本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	淳厚基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	谢芳	石立平
	联系电话	021-60607066	010-63639180
	电子邮箱	xiefang@purekindfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4000009738	95595
传真		021-60607060	010-63639132
注册地址		上海市虹口区临潼路170号607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		上海市浦东新区丁香路778号丁香国际大厦西塔7F	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		200135	100033
法定代表人		邢媛	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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.purekindfund.com/
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区丁香路778号丁香国际大厦西塔7F

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	淳厚基金管理有限公司	上海市浦东新区丁香路778号丁香国际大厦西塔7F

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 （2021年01月01日- 2021年06月30日）
本期已实现收益	37,940,681.09

本期利润	66,960,734.39
加权平均基金份额本期利润	0.1211
本期加权平均净值利润率	11.37%
本期基金份额净值增长率	11.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 （2021年06月30日）
期末可供分配利润	38,057,135.29
期末可供分配基金份额利润	0.0679
期末基金资产净值	634,758,459.74
期末基金份额净值	1.1326
3.1.3 累计期末指标	报告期末 （2021年06月30日）
基金份额累计净值增长率	13.26%

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

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

3、期末可供分配利润，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	0.68%	0.69%	-1.09%	0.51%	1.77%	0.18%
过去三个月	9.33%	0.82%	2.06%	0.62%	7.27%	0.20%
过去六个月	11.99%	1.00%	1.67%	0.86%	10.32%	0.14%
自基金合同生效起至今	13.26%	0.97%	4.13%	0.85%	9.13%	0.12%

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

注：1）本基金合同于2020年12月22日生效，至报告期末未满1年。

2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至本报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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

淳厚基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2018】1618号文批准，于2018年11月3日成立，是由六位资深专业人士发起设立的公募基金管理公司。公司注册地上海，注册资本金为1亿元人民币。公司于2019年2月1日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。

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		
薛莉丽	基金经理	2020-12-22	-	14年	上海财经大学经济学硕士。曾任兴业证券证券投资部（权益自营部）投资经理、总经理助理、部门副总监。2019年加入淳厚基金，现任淳厚基金权益投资部总监、淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理、淳厚信睿核心精选混合型证券投资基金基金经理、淳厚欣享一年持有期混合型证券投资基金基金经理、淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金经理、淳厚益加增强债券型证券投资基金基金经理、淳厚鑫淳一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
王晓明	基金经理	2021-01-08	-	9年	复旦大学金融学硕士，曾任兴业证券研究所研究员、未来益财投资管理（上海）有限公司高级研究员、长江证券（上海）资产管理有限公司权益研究部总经理助理、高级研究员。2019年加入淳厚基金，现任淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金《基金合同》等法律文件和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，力争为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，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

基金管理人制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循"时间优先、价格优先、比例分配"的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循"价格优先、比例分配"的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现异常交易行为。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年上半年，全球经济在低基数的效应下呈现出恢复性增长。同时，为了应对疫情影响，各国仍普遍延续了宽松的货币政策和积极的财政政策，使得整体需求的增速快于供给的恢复，带来大宗商品出现了较大幅度的上涨，阶段性通胀压力有所显现。

上半年 主要权重指数沪深300上涨0.24%，中证500上涨6.53%，上证50出现3.9%下跌。其中一季度在通胀压力升温国内外流动性收缩预期的影响下，市场呈现宽幅震荡态势；进入二季度后，伴随着经济增速回落和国内外长期国债利率逐步下行，市场呈现较丰富的结构性机会。从行业来看，上游化工、钢铁、煤炭、有色等资源品表现较好；成长属性的新能源、半导体、医药在二季度呈现明显超额收益；表现较弱的板块包括传统中游制造业和大消费及金融地产板块。港股整体表现不如A股，恒生科技股指数上半年下跌3.21%，国企指数下跌0.7%。

本基金始终坚持自下而上选择优质股票，以合理估值买入并持有的投资策略。总体上在上半年取得了符合预期的回报，在组合层面我们一直以来坚持均衡配置思路，坚持行业均衡、估值均衡，六月份之后A股的结构分化更加显著，行业均衡配置策略在六月以后面临一定的压力。我们在坚持均衡配置的基础上，加大自下而上的个股挖掘力，努力平衡好组合的风险和收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末淳厚欣颐基金份额净值为1.1326元，本报告期内，基金份额净值增长率为11.99%，同期业绩比较基准收益率为1.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为宏观经济基本稳定，货币政策和财政政策仍会较为宽松，A股、港股市场总体估值合理，市场仍存在投资机会。但目前市场结构分化巨大，部分行业的结构性风险有所加大，市场阶段性过度放大了短期行业景气度效应，淡化了对中长期商业模式和竞争格局的研判。下一阶段我们仍将谨慎应对后疫情时代市场可能出现的变化，比如行业政策调整等，同时维持自下而上个股挖掘的优势，争取为投资人创造更多价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

报告期内，本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会主任委员由分管运营的副总担任，常务副主任委员由运营保障部负责人担任，专业委员若干名，由投资部、研究部、监察稽核部、财富管理部等部门负责人或其指定人员组成。

估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理可列席公司估值委员会，不介入基金日常估值业务，但可参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，但不能参与表决，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在淳厚欣颐一年持有期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《淳厚欣颐一年持有期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 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	130,379,671.77	77,944,980.69
结算备付金		10,022,037.64	100,000,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	502,721,048.31	173,768,082.66
其中：股票投资		469,721,048.31	173,768,082.66
基金投资		-	-
债券投资		33,000,000.00	-

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	-	210,000,210.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	764,534.70	21,092.17
应收股利		130,276.83	-
应收申购款		69,441.97	130,088.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		644,087,011.22	561,864,454.16
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		8,368,444.73	19,320,066.26
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		769,269.23	196,866.06
应付托管费		102,569.25	26,248.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	88,268.27	-
负债合计		9,328,551.48	19,543,181.14

所有者权益：			
实收基金	6.4.7.8	560,457,886.99	536,285,699.12
未分配利润	6.4.7.9	74,300,572.75	6,035,573.90
所有者权益合计		634,758,459.74	542,321,273.02
负债和所有者权益总计		644,087,011.22	561,864,454.16

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值为人民币1.1326元，基金份额总额560,457,886.99份。

6.2 利润表

会计主体：淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
一、收入		75,064,082.67
1.利息收入		1,119,665.14
其中：存款利息收入	6.4.7.10	630,986.55
债券利息收入		271,890.06
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		216,788.53
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		44,924,364.23
其中：股票投资收益	6.4.7.11	41,351,838.43
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	635,155.29
资产支持证券投资收益	6.4.7.12.3	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	2,937,370.51

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	29,020,053.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-
减：二、费用		8,103,348.28
1．管理人报酬		4,382,363.41
2．托管费		584,315.06
3．销售服务费		-
4．交易费用	6.4.7.16	3,048,399.25
5．利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6．税金及附加		2.29
7．其他费用	6.4.7.17	88,268.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		66,960,734.39
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		66,960,734.39

注.本基金合同生效日为2020年12月22日，故无上年度可比区间数据，下同。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	536,285,699.12	6,035,573.90	542,321,273.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	66,960,734.39	66,960,734.39
三、本期基金份额交	24,172,187.87	1,304,264.46	25,476,452.33

易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	24,172,187.87	1,304,264.46	25,476,452.33
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）	560,457,886.99	74,300,572.75	634,758,459.74

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:

邢媛	董卫军	董卫军
————————	————————	————————
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

淳厚欣颐一年持有期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] 2733号《关于准予淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准，由基金发起人淳厚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》("基金合同")发起，于2020年12月22日募集成立。本基金的基金管理人为淳厚基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。本基金募集期为自2020年12月01日至2020年12月18日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，本基金共募集有效净认购资金，532,284,605.47元，折合532,284,605.47份淳厚欣颐基金份额。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币149,809.52元，折合149,809.52份淳厚欣颐基金份额，以上收到的实收基金共计人民币532,434,414.99元，折合532,434,414.99份淳厚欣颐基金份额，有效认购户数为8,844户。按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《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》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、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、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%＋经人民币汇率调整的中证港股通综合指数收益率×20%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，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年上半年的经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等，其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资

产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值；

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 利息收入

① 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

② 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

③ 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

(2) 投资收益

① 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

② 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

③ 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

④ 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金的基金托管费按《基金合同》约定的方法进行计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。 其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）本基金每一基金份额享有同等分配权；

（5）当日申购的基金份额自下一交易日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个交易日起，不享有基金的收益分配权益；

（6）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入

免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	5,010,809.86
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	125,368,861.91
合计	130,379,671.77

注：其他存款本期期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		434,198,526.56	469,721,048.31	35,522,521.75
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	32,950,354.90	33,000,000.00	49,645.10
	银行间市场	-	-	-
	合计	32,950,354.90	33,000,000.00	49,645.10
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		467,148,881.46	502,721,048.31	35,572,166.85

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	1,004.62
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	19,617.07
应收结算备付金利息	63,570.54
应收债券利息	680,342.47
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	764,534.70

注：应收其他存款利息为应收券商保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	13,884.51
预提费用-信息披露费	74,383.76
合计	88,268.27

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	536,285,699.12	536,285,699.12
本期申购	24,172,187.87	24,172,187.87
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	560,457,886.99	560,457,886.99

注：（1）本基金募集期为2020年12月1日至2020年12月18日。"淳厚欣颐"已收到首次募集的有效净认购金额为人民币532,284,605.47元，折合532,284,605.47份"淳厚欣颐"基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币149,809.52元，折合149,809.52份"淳厚欣颐"基金份额。以上"淳厚欣颐"收到的实收基金共计人民币532,434,414.99元，折合532,434,414.99份"淳厚欣颐"基金份额。

（2）申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

（3）根据《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》、《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告》的相关规定，本基金于2020年12月22日(基金合同生效日)至2020年12月23日期间暂不向投资人开放基金交易。申购和赎回业务自2020年12月24日起开始办理。

6.4.7.9 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	-517,353.28	6,552,927.18	6,035,573.90

本期利润	37,940,681.09	29,020,053.30	66,960,734.39
本期基金份额交易产生的变动数	633,807.48	670,456.98	1,304,264.46
其中：基金申购款	633,807.48	670,456.98	1,304,264.46
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,057,135.29	36,243,437.46	74,300,572.75

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	16,307.71
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	466,385.69
结算备付金利息收入	148,293.15
其他	-
合计	630,986.55

注：其他存款利息收入为券商保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	962,490,740.46
减：卖出股票成本总额	921,138,902.03
买卖股票差价收入	41,351,838.43

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期

	2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	635,155.29
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	635,155.29

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,859,334.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,217,038.61
减：应收利息总额	7,140.90
买卖债券差价收入	635,155.29

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,937,370.51
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	2,937,370.51

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01月01日至2021年06月30日
1.交易性金融资产	29,020,053.30
——股票投资	28,970,408.20
——债券投资	49,645.10
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	29,020,053.30

6.4.7.16 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	3,048,399.25
银行间市场交易费用	-
合计	3,048,399.25

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日

审计费用	13,884.51
信息披露费	74,383.76
证券出借违约金	-
合计	88,268.27

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
淳厚基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
邢媛	基金管理人股东
李雄厚	基金管理人股东
董卫军	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期末无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,382,363.41
其中：支付销售机构的客户维护费	1,676,789.04

注：（1）支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费＝前一日基金资产净值×1.50%/当年天数；

（2）客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目；

（3）本基金合同日于2020年12月22日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	584,315.06

注：（1）支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/当年天数；

（2）本基金合同日于2020年12月22日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
报告期初持有的基金份额	5,001,638.89
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	5,001,638.89
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.89%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
李雄厚	999,688.58	0.18%	999,688.58	0.19%
邢媛	999,728.42	0.18%	999,728.42	0.19%
董卫军	1,000,524.43	0.18%	1,000,524.43	0.19%

注：

1、上述展示系四舍五入的结果。

2、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定。

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	本期

称	2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	5,010,809.86	16,307.71

注：

（1）本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

（2）本基金合同日于2020年12月22日生效，故无上年度可比期间数据。

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01月01日至2021年06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：张/股）	总金额
光大证券股份有限公司	003042.SZ	中农联合	首次公开发行股票	420	9,055.20
光大证券股份有限公司	605378.SH	野马电池	首次公开发行股票	473	8,334.26
光大证券股份有限公司	605117.SH	德业股份	首次公开发行股票	627	20,527.98
光大证券股份有限公司	605287.SH	德才股份	首次公开发行股票	349	11,014.44

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688007	光峰科技	2021-05-31	2021-12-01	大宗交易流通受限	28.69	38.62	300,000	8,607,000.00	11,586,000.00	-
002372	伟星新材	2021-06-01	2021-12-01	大宗交易流通受限	21.09	19.35	400,000	8,436,000.00	7,740,000.00	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	创业板打新限售	47.33	251.96	380	17,985.40	95,744.80	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	科创板打新限售	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	创业板打新限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021-06-	2021-07-	新股未上	9.46	9.46	2,609	24,681.1	24,681.1	-

		28	06	市				4	4	
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	创业板打新限售	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	创业板打新限售	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	创业板打新限售	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	创业板打新限售	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	创业板打新限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	创业板打新限售	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301002	崧盛股份	2021-05-	2021-12-	创业板打	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.6	-

		27	07	新限售					2	
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	创业板打新限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	创业板打新限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	创业板打新限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	创业板打新限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	创业板打新限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	创业板打新限售	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	创业板打新限售	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
3009	德固	2021	2021	创业	8.41	39.1	219	1,84	8,56	-

50	特	-02-24	-09-03	板打新限售		3		1.79	9.47	
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	创业板打新限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	创业板打新限售	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	创业板打新限售	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	创业板打新限售	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	创业板打新限售	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	创业板打新限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	创业板打新限售	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	创业板打新限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	创业板打新限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	创业板打新限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	创业板打新限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	创业板打新限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	创业板打新限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	创业板打新限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-	2022-01-	创业板打	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

		28	06	新限售						

注：上述流通受限证券所披露可流通日，如晚于报告送出日期，则均为预计日期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的托管行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末本基金未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末本基金未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末本基金未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末本基金未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式

借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因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关于未来现金流的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2021年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	130,379,671.77	-	-	-	130,379,671.77
结算备付金	10,022,037.64	-	-	-	10,022,037.64
交易性金融资产	33,000,000.00	-	-	469,721,048.31	502,721,048.31
应收利息	-	-	-	764,534.70	764,534.70
应收股利	-	-	-	130,276.83	130,276.83
应收申购款	-	-	-	69,441.97	69,441.97
资产总计	173,401,709.41	-	-	470,685,301.81	644,087,011.22
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,368,444.73	8,368,444.73
应付管理人报酬	-	-	-	769,269.23	769,269.23
应付托管费	-	-	-	102,569.25	102,569.25

其他负债	-	-	-	88,268.27	88,268.27
负债总计	-	-	-	9,328,551.48	9,328,551.48
利率敏感度缺口	173,401,709.41	-	-	461,356,750.33	634,758,459.74
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	77,944,980.69	-	-	-	77,944,980.69
结算备付金	100,000,000.00	-	-	-	100,000,000.00
交易性金融资产	-	-	-	173,768,082.66	173,768,082.66
买入返售金融资产	210,000,210.00	-	-	-	210,000,210.00
应收利息	-	-	-	21,092.17	21,092.17
应收申购款	-	-	-	130,088.64	130,088.64
资产总计	387,945,190.69	-	-	173,919,263.47	561,864,454.16
负债					
应付证券清算款	-	-	-	19,320,066.26	19,320,066.26
应付管理人报酬	-	-	-	196,866.06	196,866.06
应付托管费	-	-	-	26,248.82	26,248.82
负债总计	-	-	-	19,543,181.14	19,543,181.14
利率敏感度缺口	387,945,190.69	-	-	154,376,082.33	542,321,273.02

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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

利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	119,104,347.24	-	119,104,347.24
应收股利	-	130,276.83	-	130,276.83
资产合计	-	119,234,624.07	-	119,234,624.07
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	8,368,444.73	-	8,368,444.73
负债合计	-	8,368,444.73	-	8,368,444.73
资产负债表外汇风险敞口净额	-	110,866,179.34	-	110,866,179.34
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	39,612,291.58	-	39,612,291.58
资产合计	-	39,612,291.58	-	39,612,291.58

以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	19,320,066.26	-	19,320,066.26
负债合计	-	19,320,066.26	-	19,320,066.26
资产负债表外汇风险敞口净额	-	20,292,225.32	-	20,292,225.32

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	所有港币均相对人民币升值5%	5,543,308.97	1,014,611.27
	所有港币均相对人民币贬值5%	-5,543,308.97	-1,014,611.27

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

交易性金融资产－股票投资	469,721,048.31	74.00	173,768,082.66	32.04
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	469,721,048.31	74.00	173,768,082.66	32.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察业绩比较基准变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；		
	2、假定业绩比较基准变化5%，其他市场变量不变；		
	3、Beta系数是根据组合在过去一个年度的净值数据和业绩比较基准数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	33,296,916.15	9,658,853.94
	业绩比较基准下降5%	-33,296,916.15	-9,658,853.94

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析，上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

① 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

② 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币449,739,321.68 元，属于第二层次的余额为人民币52,981,726.63 元，无第三层次余额(于2020年12月31日，本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币173,768,082.66元，无属于第二层次、第三层次余额)。

③ 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	469,721,048.31	72.93

	其中：股票	469,721,048.31	72.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	33,000,000.00	5.12
	其中：债券	33,000,000.00	5.12
	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	140,401,709.41	21.80
8	其他各项资产	964,253.50	0.15
9	合计	644,087,011.22	100.00

注：权益投资中通过港股机制的公允价值为119,104,347.24元，占基金总资产比例18.49%。

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	5,439.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	295,911,054.99	46.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	1,146,150.22	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,540,630.40	2.13
J	金融业	24,962,121.10	3.93
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,094,879.10	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,016,000.00	1.42
R	文化、体育和娱乐业	4,902,034.00	0.77
S	综合	-	-
	合计	350,616,701.07	55.24

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	7,267,386.72	1.14
日常消费品	42,671,558.64	6.72
金融	7,825,712.40	1.23
医疗保健	8,744,827.97	1.38
信息技术	14,718,663.12	2.32
电信服务	13,368,530.11	2.11
地产业	24,507,668.28	3.86
合计	119,104,347.24	18.76

注:以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

1	H00168	青岛啤酒股份	530,000	36,867,800.64	5.81
2	300171	东富龙	850,000	34,552,500.00	5.44
3	600036	招商银行	460,000	24,927,400.00	3.93
4	000921	海信家电	1,500,000	21,555,000.00	3.40
5	H01755	新城悦服务	960,000	18,851,604.48	2.97
6	600885	宏发股份	300,000	18,810,000.00	2.96
7	688300	联瑞新材	300,054	18,603,348.00	2.93
8	002585	双星新材	850,000	17,110,500.00	2.70
9	H03888	金山软件	380,000	14,718,663.12	2.32
10	002415	海康威视	220,000	14,190,000.00	2.24
11	000333	美的集团	178,000	12,703,860.00	2.00
12	600887	伊利股份	340,000	12,522,200.00	1.97
13	H00700	腾讯控股	25,000	12,148,368.00	1.91
14	002508	老板电器	260,000	12,090,000.00	1.90
15	688007	光峰科技	300,000	11,586,000.00	1.83
16	600521	华海药业	550,000	11,484,000.00	1.81
17	600380	健康元	830,000	11,395,900.00	1.80
18	300705	九典制药	270,000	10,273,500.00	1.62
19	603155	新亚强	220,000	10,007,800.00	1.58
20	300143	盈康生命	350,000	9,016,000.00	1.42
21	002507	涪陵榨菜	235,000	8,850,100.00	1.39
22	H01066	威高股份	580,000	8,744,827.97	1.38
23	002402	和而泰	350,000	8,389,500.00	1.32
24	H03908	中金公司	450,000	7,825,712.40	1.23
25	002372	伟星新材	400,000	7,740,000.00	1.22
26	000636	风华高科	250,000	7,555,000.00	1.19
27	688516	奥特维	50,000	7,400,000.00	1.17
28	000733	振华科技	120,000	7,328,400.00	1.15
29	002088	鲁阳节能	300,000	6,897,000.00	1.09
30	603444	吉比特	13,000	6,890,000.00	1.09
31	688508	芯朋微	60,000	6,638,400.00	1.05

32	002223	鱼跃医疗	170,000	6,482,100.00	1.02
33	H02020	安踏体育	40,000	6,084,168.96	0.96
34	H00291	华润啤酒	100,000	5,803,758.00	0.91
35	002946	新乳业	290,000	4,393,500.00	0.69
36	300788	中信出版	89,000	3,272,530.00	0.52
37	H06049	保利物业	65,000	2,850,290.04	0.45
38	603229	奥翔药业	75,000	2,504,250.00	0.39
39	000858	五 粮 液	8,000	2,383,120.00	0.38
40	600519	贵州茅台	1,000	2,056,700.00	0.32
41	002461	珠江啤酒	160,000	1,750,400.00	0.28
42	603103	横店影视	110,700	1,629,504.00	0.26
43	603369	今世缘	30,000	1,624,800.00	0.26
44	H06989	卓越商企服务	200,000	1,409,543.52	0.22
45	H06098	碧桂园服务	20,000	1,396,230.24	0.22
46	H01896	猫眼娱乐	120,000	1,220,162.11	0.19
47	H02331	李宁	15,000	1,183,217.76	0.19
48	603939	益丰药房	20,000	1,121,800.00	0.18
49	603136	天目湖	65,250	1,072,710.00	0.17
50	600690	海尔智家	40,000	1,036,400.00	0.16
51	688076	诺泰生物	15,000	1,023,150.00	0.16
52	603288	海天味业	7,800	1,005,810.00	0.16
53	300957	贝泰妮	380	95,744.80	0.02
54	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.01
55	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
56	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
57	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
58	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
59	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
60	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
61	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
62	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00

63	301015	N百洋	462	17,939.46	0.00
64	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
65	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
66	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
67	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
68	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
69	301013	C利和兴	471	12,768.81	0.00
70	603171	N税友	637	12,230.40	0.00
71	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
72	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
73	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
74	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
75	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
76	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
77	301016	N雷尔伟	275	9,069.50	0.00
78	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
79	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
80	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
81	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
82	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
83	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
84	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
85	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
86	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
87	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
88	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
89	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
90	605011	N杭热	525	4,662.00	0.00
91	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
92	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
93	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00

94	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
95	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
96	603915	国茂股份	1	39.50	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	002415	海康威视	31,240,955.35	5.76
2	600885	宏发股份	30,816,217.40	5.68
3	H00168	青岛啤酒股份	27,770,424.34	5.12
4	H00941	中国移动	23,742,308.97	4.38
5	000157	中联重科	23,507,256.21	4.33
6	003012	东鹏控股	22,690,712.50	4.18
7	600298	安琪酵母	22,462,867.49	4.14
8	H01755	新城悦服务	22,291,104.56	4.11
9	000333	美的集团	19,741,772.00	3.64
10	H00700	腾讯控股	18,870,540.73	3.48
11	002508	老板电器	18,861,771.40	3.48
12	600346	恒力石化	18,561,198.80	3.42
13	603298	杭叉集团	18,456,859.47	3.40
14	688007	光峰科技	18,305,377.19	3.38
15	300171	东富龙	17,476,558.00	3.22
16	002585	双星新材	17,422,077.00	3.21
17	H03888	金山软件	17,406,183.85	3.21
18	600036	招商银行	17,269,361.08	3.18
19	002466	天齐锂业	16,837,570.18	3.10
20	600887	伊利股份	16,303,147.00	3.01
21	688300	联瑞新材	16,156,954.02	2.98
22	603444	吉比特	15,260,498.00	2.81

23	601233	桐昆股份	15,203,974.00	2.80
24	002507	涪陵榨菜	14,768,061.00	2.72
25	H03898	中车时代电气	14,573,205.79	2.69
26	603995	甬金股份	14,083,037.00	2.60
27	000672	上峰水泥	14,067,131.50	2.59
28	H02382	舜宇光学科技	14,035,666.65	2.59
29	601318	中国平安	13,890,793.37	2.56
30	600380	健康元	13,742,503.42	2.53
31	000338	潍柴动力	12,885,542.90	2.38
32	603993	洛阳钼业	12,793,575.00	2.36
33	000915	华特达因	12,229,927.00	2.26
34	H01066	威高股份	11,373,784.48	2.10
35	002088	鲁阳节能	11,263,404.50	2.08
36	688308	欧科亿	11,169,122.01	2.06
37	002661	克明食品	11,032,600.00	2.03
38	000921	海信家电	10,994,049.96	2.03

注：″本期累计买入金额″按买入成交金额（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	600298	安琪酵母	30,364,070.50	5.60
2	H00941	中国移动	24,661,663.60	4.55
3	003012	东鹏控股	24,268,622.75	4.47
4	000157	中联重科	22,813,337.02	4.21
5	603298	杭叉集团	22,132,269.20	4.08
6	601166	兴业银行	17,744,025.89	3.27
7	600885	宏发股份	17,556,156.00	3.24
8	300171	东富龙	17,545,895.00	3.24

9	002508	老板电器	17,474,366.59	3.22
10	600346	恒力石化	16,977,968.00	3.13
11	688308	欧科亿	16,450,083.46	3.03
12	002466	天齐锂业	16,266,703.00	3.00
13	002340	格林美	15,908,371.44	2.93
14	601233	桐昆股份	15,368,754.27	2.83
15	002415	海康威视	15,306,302.80	2.82
16	603915	国茂股份	15,232,478.00	2.81
17	600036	招商银行	15,062,055.53	2.78
18	600409	三友化工	14,724,412.08	2.72
19	H03998	波司登	14,492,112.74	2.67
20	H02382	舜宇光学科技	14,436,879.42	2.66
21	600703	三安光电	14,329,934.00	2.64
22	H01951	锦欣生殖	13,960,046.85	2.57
23	603995	甬金股份	13,848,848.00	2.55
24	H00285	比亚迪电子	13,758,088.00	2.54
25	000672	上峰水泥	13,269,354.91	2.45
26	000338	潍柴动力	12,873,028.00	2.37
27	603993	洛阳钼业	12,843,531.00	2.37
28	300973	立高食品	12,795,972.20	2.36
29	601318	中国平安	12,621,468.89	2.33
30	002756	永兴材料	11,881,623.00	2.19
31	688007	光峰科技	11,683,110.48	2.15
32	H03898	中车时代电气	11,429,788.60	2.11
33	000915	华特达因	11,132,178.00	2.05

注：″本期累计卖出金额″按卖出成交金额（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	1,188,121,459.48

卖出股票收入（成交）总额	962,490,740.46

注：″买入股票成本″或″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

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	33,000,000.00	5.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	33,000,000.00	5.20

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	019640	20国债10	330,000	33,000,000.00	5.20

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资前十大证券中招商银行的发行人招商银行股份有限公司于2021年5月17日因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则被中国银行保险监督管理委员会处以罚款7170万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	130,276.83
4	应收利息	764,534.70
5	应收申购款	69,441.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	964,253.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
9,365	59,846.01	27,003,484.61	4.820%	533,454,402.38	95.180%

注：上表展示的比例系四舍五入后的结果。

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	7,499,463.56	1.340%

注：上表展示的比例系四舍五入后的结果。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年12月22日)基金份额总额	532,434,414.99
本报告期期初基金份额总额	536,285,699.12
本报告期基金总申购份额	24,172,187.87
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	560,457,886.99

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

本基金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

1、基金管理人的重大人事变动： 本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：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，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

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

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	
光大证券	2	730,538,970.64	34.08%	546,160.29	34.46%	-
湘财证券	2	1,080,585,584.76	50.41%	791,184.84	49.92%	-
兴业证券	2	332,647,639.89	15.51%	247,714.86	15.62%	-

注：1.根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2.本报告期内，本基金新增光大证券上海、光大证券深圳及兴业证券上海、兴业证券深圳交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
光大证券	33,359,443.94	77.66%	1,031,000,000.00	85.99%	-	-	-	-
湘财证券	9,462,623.75	22.03%	138,000,000.00	11.51%	-	-	-	-
兴业证	133,188.0	0.31%	30,000,000.0	2.50%	-	-	-	-

券	0		0					

注：1.根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2. 本报告期内，本基金新增光大证券上海、光大证券深圳及兴业证券上海、兴业证券深圳交易单元。

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	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、公司官网	2021-01-08
2	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司官网	2021-01-12
3	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金招募说明书更新（2021年第1期）	公司官网	2021-01-12
4	淳厚基金管理有限公司关于修订淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金合同和托管协议的公告	《中国证券报》、公司官网	2021-02-02
5	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金合同更新	公司官网	2021-02-02
6	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金托管协议更新	公司官网	2021-02-02
7	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司官网	2021-02-03
8	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金招募说明书更新（2021年第2期）	公司官网	2021-02-03
9	淳厚基金管理有限公司关于在销售机构开通旗下部分基金定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、公司官网	2021-03-10
10	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《中国证券报》、公司官网	2021-03-30
11	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金	《中国证券报》、公司官网	2021-04-02

	重大关联交易事项的公告		
12	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《中国证券报》、公司官网	2021-04-13
13	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金2021年第一季度报告	公司官网	2021-04-21
14	淳厚基金管理有限公司旗下基金2021年1季度报告提示性公告	《中国证券报》	2021-04-21
15	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《中国证券报》、公司官网	2021-06-29

§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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准设立淳厚基金管理有限公司的文件；

2、中国证券监督管理委员会批准淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金设立的文件；

3、《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；

4、《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；

5、《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

淳厚基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区丁香路778号丁香国际西塔7楼

12.3 查阅方式

上述文件可在淳厚基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到淳厚基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人淳厚基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-000-9738

网址： http://www.purekindfund.com/

淳厚基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日