

# 中银证券新能源灵活配置混合型证券投资 基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中银证券新能源混合	
场内简称	-	
基金主代码	005571	
前端交易代码	-	
后端交易代码	-	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2018 年 8 月 2 日	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	29,401,106.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中银证券新能源混合 A	中银证券新能源混合 C
下属分级基金的场 内简称	-	-
下属分级基金的交 易代码	005571	005572
下属分级基金的前 端交易代码	-	-
下属分级基金的后 端交易代码	-	-
报告期末下属分级 基金的份额总额	20,910,466.60 份	8,490,639.68 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过精选与新能源主题相关证券，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产长期稳定增值。
------	---

投资策略	本基金通过大类资产配置策略、股票投资策略、债券类资产投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略，以实现基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	中证新能源产业指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中银国际证券股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵向雷	张燕
	联系电话	021-20328000	0755-83199084
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-61195566, 400-620-8888	95555
传真		021-50372474	0755-83195201

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

## § 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(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	中银证券新能源混合 A	中银证券新能源混合 C
本期已实现收益	1,958,063.04	522,857.07
本期利润	2,432,691.22	-45,576.53
加权平均基金份额本期利润	0.1213	-0.0077
本期基金份额净值增长率	6.04%	5.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	期末可供分配基金份额利润	0.0219

期末基金资产净值	21,368,734.29	8,651,311.17
期末基金份额净值	1.0219	1.0189

注:1、本基金合同于 2018 年 8 月 2 日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

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、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;

4、期末可供分配利润是指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。

### 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

中银证券新能源混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.74%	1.05%	0.08%	0.70%	-0.82%	0.35%
过去三个月	-11.66%	1.53%	-5.71%	0.96%	-5.95%	0.57%
过去六个月	6.04%	1.60%	8.59%	0.96%	-2.55%	0.64%
自基金合同生	2.19%	1.30%	3.30%	0.89%	-1.11%	0.41%

中银证券新能源混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.76%	1.05%	0.08%	0.70%	-0.84%	0.35%
过去三个月	-11.74%	1.53%	-5.71%	0.96%	-6.03%	0.57%
过去六个月	5.86%	1.60%	8.59%	0.96%	-2.73%	0.64%
自基金合同生	1.89%	1.30%	3.30%	0.89%	-1.41%	0.41%

注:本基金成立于 2018 年 8 月 2 日,本基金的业绩比较基准=中证新能源产业指数收益率\*50%+中证全债指数收益率\*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

中银证券新能源混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中银证券新能源混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2018 年 8 月 2 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

2、按照基金合同约定，自基金成立日起 6 个月为建仓期，截止本报告期末，基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年，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

中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银国际证券”)经中国证监会批准于  
第 6 页 共 28 页

2002年2月28日在上海成立，注册资本25亿元人民币。股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、上海金融发展投资基金(有限合伙)、云南省投资控股集团有限公司、江西铜业股份有限公司、凯瑞富海实业投资有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、上海祥众投资合伙企业(有限合伙)、江苏洋河酒厂股份有限公司、上海郝乾企业管理中心(有限合伙)、江西铜业集团财务有限公司、达濠市政建设有限公司、万兴投资发展有限公司。中银国际证券的经营经营范围包括：证券经纪、证券投资咨询、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券自营、证券资产管理、证券投资基金代销、融资融券、代销金融产品、公开募集证券投资基金管理业务、为期货公司提供中间介绍业务。截至2019年6月30日，本管理人共管理十七只证券投资基金，包括：中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券保本1号混合型证券投资基金)、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张燕	本基金基金经理	2018年8月24日	-	7	张燕，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2011年7月至2015年5月任职新华基金管理有限公司研究部，担任基金经理助理兼研究员；2015年5月至2016年11月任职中欧基金管理有限公司事业部策略十组，担任基金经理；2016年11月至2017年10月任职中国人寿养老保险股份有限公司投资中心，担任高级权益投资经理。2017

					年 10 月加盟中银国际证券股份有限公司，历任中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注:1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券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《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，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

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、研究与交易部交易室异常交易监控与报告管理办法等公平交易相关制度体系。公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法所规范的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时涵盖包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，公司未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公



平对待，不存在利益输送的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5% 的情况。

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。

## 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

2019 年上半年，年初贸易战缓和叠加国内政策面出现了一些积极的变化，市场在风险偏好提升的带动下大幅反弹；随后贸易摩擦等使得市场在前期估值明显提升后明显回撤。市场表现上，年初到四月中旬市场普涨，风险偏好明显提升，四月中旬到六月底，市场总体调整明显，但食品饮料为代表的消费板块和金融板块逆势上涨，优质白马股齐创历史新高。上证综指、沪深 300 以及创业板分别上涨 19.45%、27.07%、20.87%，市场呈现了普涨的行情。今年以来，本基金权益仓位较高，结构上主要配置低估值的价值股，行业层面主要集中于新能源汽车、光伏、风电等新能源相关行业。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中银证券新能源混合 A 基金份额净值为 1.0219 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.04%；截至本报告期末中银证券新能源混合 C 基金份额净值为 1.0189 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.86%；同期业绩比较基准收益率为 8.59%。

## 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 2019 年下半年，随着各种内部及外部风险逐步暴露、目前释放较为充分，同时市场整体估值不高，很多板块估值处在历史低分位，而由于资金抱团板块有限导致估值洼地不少，因此我们预计后续市场的表现可期。新能源汽车是未来十年我们认为可行的战略性产业，随着技术进步、越来越多符合消费者需求的消费级新能源汽车的上市，新能源汽车有望从补贴时代逐步进入到消费驱动时代，预计前景广阔。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了中银国际证券股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。由公司领导担任组长，成员由基金管理部、业务营运部、内控与法律合规部、审计部、风险管理部等部门指派人员组成。估值委员会成员均具有专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责

主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述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签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未实施利润分配。

#### 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

报告期内不存在基金持有人数低于 200 人的情形。

报告期内，2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日期间，基金资产净值低于 5000 万。2018 年 12 月 27 日，中银国际证券股份有限公司向中国证券监督管理委员会报送了《关于中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金资产净值低于五千万解决方案的报告》，明确了拓展立体渠道资源、加强与互联网及第三方销售平台合作的解决方案。

## § 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度/年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度/年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		5,288,281.21	14,879,857.75
结算备付金		65,620.86	59,945.60
存出保证金		13,882.67	9,137.34
交易性金融资产		24,560,387.74	20,584,011.38
其中：股票投资		24,560,387.74	20,584,011.38
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		148,194.49	-
应收利息		1,253.47	3,377.93
应收股利		-	-
应收申购款		198,045.10	19.70
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		30,275,665.54	35,536,349.70
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	689,751.93
应付赎回款		77,268.87	9.57
应付管理人报酬		36,402.89	46,313.80
应付托管费		4,853.71	6,175.17
应付销售服务费		2,486.23	1,418.98
应付交易费用		2,988.96	7,382.08
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		131,619.42	178,998.00
负债合计		255,620.08	930,049.53
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		29,401,106.28	35,915,255.43
未分配利润		618,939.18	-1,308,955.26
所有者权益合计		30,020,045.46	34,606,300.17
负债和所有者权益总计		30,275,665.54	35,536,349.70

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 29,401,106.28 份，其中中银证券新能源混合 A 基金份额总额为 20,910,466.60 份，基金份额净值 1.0219 元；中银证券新能源混合 C 基金份额总额为 8,490,639.68 份，基金份额净值 1.0189 元。

## 6.2 利润表

会计主体：中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
一、收入			2,745,293.49
1. 利息收入			23,403.83
其中：存款利息收入			23,403.83
债券利息收入			-
资产支持证券利息收入			-
买入返售金融资产收入			-
其他利息收入			-
2. 投资收益(损失以“-”填列)			2,621,939.04
其中：股票投资收益			2,530,436.79
基金投资收益			-
债券投资收益			-
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		91,502.25
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-93,805.42
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)		193,756.04
减：二、费用		358,178.80
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	206,728.07
2. 托管费	6.4.8.2.2	27,563.71
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	10,913.59
4. 交易费用		63,010.87
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用		49,962.56
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,387,114.69
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,387,114.69

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	35,915,255.43	-1,308,955.26	34,606,300.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,387,114.69	2,387,114.69
三、本期基金份额交易产生的基	-6,514,149.15	-459,220.25	-6,973,369.40

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	30,375,596.98	3,950,436.72	34,326,033.70
2. 基金赎 回款	-36,889,746.13	-4,409,656.97	-41,299,403.10
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)	29,401,106.28	618,939.18	30,020,045.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-财务报表由下列负责人签署:

宁敏

沈锋

戴景义

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

中银证券新能源灵活配置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[2017]2451号《关于准予中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中银国际证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,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465,042,019.84元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0528号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年8月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为465,114,171.67份基金份额,其中认购资金利息折合72,151.83份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费、赎回费和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用,在赎回时收取赎回费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份

额，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，但赎回时收取赎回费，并从本类别基金资产中计提销售服务费，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%，其中投资于基金合同界定的新能源相关证券不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。业绩比较基准为：中证新能源产业指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司于 2019 年 8 月 23 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<年度报告和半年度报告>》、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》、《中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金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一致。

#### 6.4.5 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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

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

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



所得税。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 关联方关系

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

无。

##### 6.4.7.2 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
中银国际证券股份有限公司（“中银证券”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金管理人股东的控股股东、基金销售机构

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
中银证券	48,317,819.77	100.00

###### 6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中银证券	35,334.76	100.00	2,988.96	100.00

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	206,728.07
其中：支付销售机构的客户维护费	64,867.53

注：支付基金管理人中银证券的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	27,563.71

注：支付基金托管行招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.20%/ 当年天数。

##### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期

方名称	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银证券新能源混合 A	中银证券新能源混合 C	合计
中银证券	0.00	8,035.77	8,035.77
中国银行	0.00	2,209.43	2,209.43
招商银行	0.00	325.38	325.38
合计	0.00	10,570.58	10,570.58

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给中银证券,再由中银证券计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.35%。其计算公式为:

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.8.4.2 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

注:报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.8.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	5,288,281.21	22,976.55

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注:本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注:本基金本报告期期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无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。

**6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无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。

**§ 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	24,560,387.74	81.12
	其中：股票	24,560,387.74	81.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,353,902.07	17.68
-	-	-	-
8	其他各项资产	361,375.73	1.19
9	合计	30,275,665.54	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**

金额单位：人民币元

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

B	采矿业	-	-
C	制造业	18,347,542.78	61.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,566,879.96	11.88
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,056,460.00	3.52
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	403,655.00	1.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,185,850.00	3.95
S	综合	-	-
	合计	24,560,387.74	81.81

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期无港股通股票投资。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002407	多氟多	131,187	1,553,254.08	5.17
2	002594	比亚迪	28,190	1,429,796.80	4.76
3	601985	中国核电	248,553	1,381,954.68	4.60
4	300568	星源材质	57,000	1,313,850.00	4.38
5	002701	奥瑞金	257,200	1,201,124.00	4.00
6	300037	新宙邦	53,100	1,106,604.00	3.69
7	600733	北汽蓝谷	131,644	1,087,379.44	3.62
8	600886	XD 国投电	121,742	945,935.34	3.15
9	000591	太阳能	244,135	800,762.80	2.67
10	002074	国轩高科	60,216	789,431.76	2.63

### 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	600733	北汽蓝谷	1,683,846.00	4.87
2	002108	沧州明珠	1,437,215.00	4.15
3	300037	新宙邦	1,353,186.00	3.91
4	300568	星源材质	1,326,070.00	3.83
5	600060	海信电器	1,209,651.00	3.50
6	002701	奥瑞金	1,145,076.00	3.31
7	002407	多氟多	1,080,313.00	3.12
8	600048	保利地产	948,440.00	2.74
9	002462	嘉事堂	841,757.00	2.43
10	000400	许继电气	819,361.43	2.37
11	300073	当升科技	756,788.00	2.19
12	300274	阳光电源	661,766.00	1.91
13	000625	长安汽车	654,188.00	1.89
14	600809	山西汾酒	650,097.00	1.88
15	000892	欢瑞世纪	620,854.00	1.79
16	002709	天赐材料	614,312.00	1.78
17	601288	农业银行	555,397.00	1.60
18	002343	慈文传媒	546,172.00	1.58
19	002707	众信旅游	532,847.00	1.54
20	601985	中国核电	532,606.00	1.54

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	601139	深圳燃气	2,229,405.80	6.44
2	600549	厦门钨业	1,738,193.31	5.02
3	002129	中环股份	1,645,803.00	4.76
4	601985	中国核电	1,420,405.85	4.10
5	002249	大洋电机	1,121,700.00	3.24
6	600089	特变电工	1,030,630.00	2.98
7	000970	中科三环	1,024,687.26	2.96
8	002029	七匹狼	1,022,750.00	2.96
9	600048	保利地产	935,836.30	2.70
10	002074	国轩高科	904,582.43	2.61
11	601222	林洋能源	893,556.00	2.58
12	600809	山西汾酒	890,001.00	2.57
13	002108	沧州明珠	843,049.35	2.44
14	600060	海信电器	815,550.00	2.36
15	600886	XD 国投电	809,874.32	2.34
16	002568	百润股份	764,445.00	2.21

17	600733	北汽蓝谷	629,307.12	1.82
18	000591	太阳能	609,899.05	1.76
19	601288	农业银行	541,996.00	1.57
20	600266	北京城建	468,540.00	1.35

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

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	24,928,782.38
卖出股票收入(成交)总额	23,389,037.39

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货,无相关投资政策。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围未包括国债期货,无相关投资评价。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本报告编制日前一年以内,本基金持有的“太阳能”的发行主体中节能太阳能股份有限公司于 2018 年 8 月 10 日收到中国证券监督管理委员会重庆监管局出具的行政监管措施决定书《关于对中节能太阳能股份有限公司采取出具警示函措施的决定》,公司因“利用募集资金购买理财产品未及时披露”、“募集资金置换相关募投项目先期投入不及时”和“子公司镇江公司收入确认时点不恰当,年末应付账款及存货未进行暂估”等违法违规行为,根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条规定,重庆监管局对公司予以警示,提醒公司切实加强募集资金管理和使用,严格按照企业会计准则规范财务核算工作,依法合规履行信息披露义务。公司于 2019 年 5 月 15 日收到中国证券监督管理委员会重庆证监局《关于对中节能太阳能股份有限公司的监管关注函》(渝证监函(2019)89 号),公司因“子公司违规对外担保”和“应收账款余额较大且增长较快”等违法违规行为,重庆监管局对公司提出“切实加强对子公司的管控”、“对违规担保事项发表书面意见”和“按季度向我局报送应收账款余额分析表”的监管要求。

本基金管理人将密切跟踪相关进展,在严格遵守法律法规和基金合同基础上进行投资决策。

本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年以内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,882.67
2	应收证券清算款	148,194.49
3	应收股利	-
4	应收利息	1,253.47
5	应收申购款	198,045.10
6	其他应收款	-



7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	361,375.73

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
中银证券新能源混合 A	1,990	10,507.77	403,471.93	1.93	20,506,994.67	98.07
中银证券新能源混合 C	955	8,890.72	83,864.48	0.99	8,406,775.20	99.01
合计	2,945	9,983.40	487,336.41	1.66	28,913,769.87	98.34

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	中银证券新能源混合 A	179,928.37	0.8605
	中银证券新能源混合 C	334,094.69	3.9349
	合计	514,023.06	1.7483

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、	中银证券新能源混合 A	0

基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中银证券新能源混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中银证券新能源混合 A	0
	中银证券新能源混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银证券新能源混合 A	中银证券新能源混合 C
基金合同生效日 (2018 年 8 月 2 日) 基金份额总额	58,487,935.33	406,626,236.34
本报告期期初基金份额总额	31,124,928.28	4,790,327.15
本报告期基金总申购份额	19,129,505.29	11,246,091.69
减：本报告期基金总赎回份额	29,343,966.97	7,545,779.16
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	20,910,466.60	8,490,639.68

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

中银国际证券股份有限公司董事会秘书翟增军先生担任公司公募基金管理业务副总经理，熊文龙先生不再担任公司副执行总裁。

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

无。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

#### 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

未有管理人、托管人及其高级管理人员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	
中银证券	2	48,317,819.77	100.00%	35,334.76	100.00%	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中银证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## § 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

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

中银国际证券股份有限公司

2019 年 8 月 26 日