

# 工银瑞信新生利混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
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	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
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 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信新生利混合型证券投资基金
基金简称	工银新生利混合
基金主代码	002000
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 29 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	423,727,175.76 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上，通过“自上而下”的资产配置及动态调整策略，将基金资产在各类型证券上进行灵活配置。在市场上涨阶段中，增加权益类资产配置比例；在市场下行周期中，增加固定收益类资产配置比例，最终力求实现基金资产组合收益的最大化，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的分析方法进行股票投资。基金管理人在行业分析的基础上，选择治理结构完善、经营稳健、业绩优良、具有可持续增长前景或价值被低估的上市公司股票，以合理价格买入并进行中长期投资。本基金股票投资具体包括行业分析与配置、公司财务状况评价、价值评估及股票选择与组合优化等过程。
业绩比较基准	30%×沪深 300 指数收益率+70%×中债综合财富（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，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		工银瑞信基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳	罗菲菲
	联系电话	400-811-9999	010-58560666

电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话	400-811-9999	95568
传真	010-66583158	010-58560798
注册地址	北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	100033	100031
法定代表人	赵桂才	高迎欣

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人或基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	工银瑞信基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 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-2021年6月30日)
本期已实现收益	26,656,934.83
本期利润	38,467,538.02
加权平均基金份额本期利润	0.1030
本期加权平均净值利润率	7.68%
本期基金份额净值增长率	7.20%
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	122,474,287.34
期末可供分配基金份额利润	0.2890
期末基金资产净值	592,589,075.49
期末基金份额净值	1.399
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	39.90%

注：1、上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、本期已实现收益是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，为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。

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

5、本基金基金合同生效日为 2016 年 12 月 29 日。

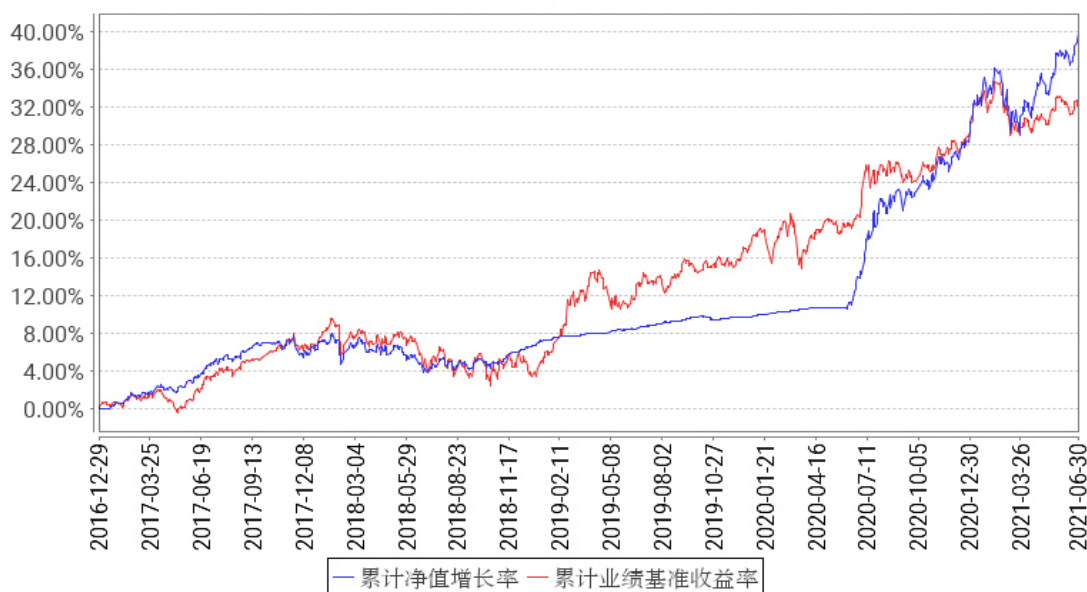
## 3.2 基金净值表现

### 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	1.38%	0.35%	-0.46%	0.25%	1.84%	0.10%
过去三个月	6.31%	0.39%	1.96%	0.29%	4.35%	0.10%
过去六个月	7.20%	0.50%	1.78%	0.40%	5.42%	0.10%
过去一年	22.08%	0.47%	9.62%	0.39%	12.46%	0.08%
过去三年	34.00%	0.29%	25.80%	0.40%	8.20%	-0.11%
自基金合同生效起至今	39.90%	0.27%	32.54%	0.36%	7.36%	-0.09%

### 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

工银新生利混合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、本基金基金合同于 2016 年 12 月 29 日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至报告期末，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%—30%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或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。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

经过十多年的发展，工银瑞信(含子公司)已拥有公募基金、基金公司资管计划、基金子公司资管计划、社保基金境内外委托投资、基本养老保险基金委托投资、保险资金委托投资、企业年



金、职业年金、养老金产品等多项产品管理人资格和 QDII、QFII、RQFII 等多项业务资格，成为国内业务资格全面、产品种类丰富、经营业绩优秀、资产管理规模领先、业务发展均衡的基金管理公司之一。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司旗下管理工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信文体产业股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信前沿医疗股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、工银瑞信科技创新 6 个月定期开放混合型证券投资基金、工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信圆丰三年持有期混合型证券投资基金、工银瑞信战略远见混合型证券投资基金、工银瑞信中证科技龙头 ETF 基金、工银瑞信创业板两年定期开放混合型证券投资基金等逾 180 只公募基金。

公司始终坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

#### 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		
李敏	固定收益部副总监，本基金的基金经理	2016 年 12 月 29 日	-	14 年	先后在中国泛海控股集团担任投资经理，在中诚信国际信用评级有限责任公司担任高级分析师，在平安证券有限责任公司担任高级业务总监；2010 年加入工银瑞信，现任固定收益部副总监；2013 年 10 月 10 日至 2019 年 10 月 10 日，担任工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2014 年 7 月 30 日至 2017 年 2 月 6 日，担任工银保本 2 号混合型发起式基金（自 2016 年 2 月 19 日起，变更为工银瑞信优质精选混合型证券投资基金）基金经理；2015 年 5 月 26 日至 2017 年 4 月 26 日，担任工银双债增强债券型基金（自 2016

					<p>年 9 月 26 日起, 变更为工银瑞信双债增强债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理; 2015 年 5 月 26 日至 2018 年 3 月 7 日, 担任工银保本混合型基金 (自 2018 年 2 月 9 日起, 变更为工银瑞信灵活配置混合型基金) 基金经理; 2016 年 10 月 27 日至 2018 年 3 月 20 日, 担任工银瑞信恒丰纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 11 月 15 日至 2018 年 5 月 3 日, 担任工银瑞信恒泰纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 11 月 22 日至 2018 年 2 月 23 日, 担任工银瑞信新得益混合型基金基金经理; 2016 年 12 月 7 日至 2019 年 1 月 15 日, 担任工银瑞信新得润混合型基金基金经理; 2016 年 12 月 29 日至 2018 年 2 月 23 日, 担任工银瑞信新增利混合型基金基金经理; 2016 年 12 月 29 日至 2018 年 7 月 27 日, 担任工银瑞信新增益混合型基金基金经理; 2016 年 12 月 29 日至 2018 年 7 月 27 日, 担任工银瑞信银和利混合型基金基金经理; 2016 年 12 月 29 日至今, 担任工银瑞信新生利混合型基金基金经理; 2017 年 3 月 23 日至 2018 年 7 月 27 日, 担任工银瑞信新得利混合型基金基金经理; 2017 年 5 月 24 日至 2018 年 6 月 12 日, 担任工银瑞信瑞利两年封闭式债券型证券投资基金基金经理; 2019 年 11 月 18 日至今, 担任工银瑞信目标收益一年定期开放债券型投资基金基金经理; 2020 年 1 月 9 日至今, 担任工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金基金经理; 2020 年 1 月 15 日至今, 担任工银瑞信新增益混合型基金基金经理; 2020 年 1 月 15 日至今, 担任工银瑞信新得利混合型基金基金经理; 2020 年 2 月 17 日至今, 担任工银瑞信瑞盈 18 个月定期开放债券型投资基金基金经理; 2020 年 2 月 17 日至今, 担任工银瑞信聚福混合型基金基金经理。</p>
李昱	本基金的基金经理	2018 年 2 月 23 日	-	14 年	<p>曾先后在中投证券担任研究员, 在华安基金担任高级研究员、小组负责人, 在中信产业基金从事二级市场投研; 2017 年加入工银瑞信, 现任养老金投资中心基金经理。</p>

					<p>2018年1月23日至2020年7月3日，担任工银瑞信添福债券型证券投资基金基金经理；2018年1月23日至今，担任工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018年1月23日至今，担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018年2月23日至2021年1月18日，担任工银瑞信双债增强债券型证券投资基金（LOF）基金经理；2018年2月23日至2019年8月14日，担任工银瑞信新增益混合型证券投资基金基金经理；2018年2月23日至今，担任工银瑞信新生利混合型证券投资基金基金经理；2018年2月23日至2019年1月15日，担任工银瑞信新得润混合型证券投资基金基金经理；2018年3月6日至今，担任工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年1月24日至2019年10月31日，担任工银瑞信聚盈混合型证券投资基金基金经理；2020年2月17日至2021年3月2日，担任工银瑞信瑞盈18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；2020年2月17日至今，担任工银瑞信聚福混合型证券投资基金基金经理；2020年12月21日至今，担任工银瑞信高质量成长混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《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，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3日内、5日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时间进行了具体分析。经分析，本报告期未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 6 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 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 年上半年权益资产波动上行，结构变化较大。二季度以来市场对通胀担忧有所减弱，市场主线重新回到成长股上，兼具景气度和长期逻辑的电动车、半导体和 CXO 板块表现出色。上半年沪深 300 上涨 0.24%，Wind 全 A 上涨 5.45%，创业板指数上涨 17.22%。

本基金报告期内维持较高的股票仓位，均衡配置了医药、科技、消费、制造业公司，降低了周期股的配置比例，增加了科技类公司配置比例。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 7.20%，业绩比较基准收益率为 1.78%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年国内流动性显著收紧的概率较小，权益资产整体风险相对可控。但高景气行业公司的估值在经历了 2 年的大幅提升后，目前已处于较高的水平，未来 2-3 年预期回报率可能显著降低，波动可能会显著加大。但中长期，我们坚信优质的公司能带来持续的回报，重点寻找两个方面的投资机会：国民消费的升级和消费习惯的变化，以及制造业全球竞争力的持续提升。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

(1) 职责分工

估值小组成员为 4 人，分别来自公司运作部、固定收益部（或研究部）、风险管理部、法律合规部，组长由运作部负责人担任。

各部门负责人推荐各部门成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部分管副总批准同意。

(2) 专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信新生利混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	21,587,814.88	53,054,025.32
结算备付金		345,372.29	183,880.90
存出保证金		47,056.98	131,096.34
交易性金融资产	6.4.7.2	566,728,818.64	499,912,827.60
其中：股票投资		178,369,853.88	164,000,243.20
基金投资		-	-
债券投资		388,358,964.76	325,881,584.40
资产支持证券投资		-	10,031,000.00
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		22,556.43	1,208,963.81
应收利息	6.4.7.5	4,322,391.72	4,469,854.70
应收股利		-	-
应收申购款		23,468.11	28,577.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		593,077,479.05	558,989,225.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		17,818.50	1,018,289.45
应付管理人报酬		233,771.41	218,885.81
应付托管费		46,754.29	43,777.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	44,414.49	32,647.23
应交税费		48,049.23	21,122.99
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	97,595.64	191,131.44
负债合计		488,403.56	1,525,854.08
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	423,727,175.76	427,296,076.66
未分配利润	6.4.7.10	168,861,899.73	130,167,295.07
所有者权益合计		592,589,075.49	557,463,371.73
负债和所有者权益总计		593,077,479.05	558,989,225.81

注：1、本基金基金合同生效日为 2016 年 12 月 29 日。

2、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.399 元，基金份额总额为 423,727,175.76 份。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信新生利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		40,745,590.21	17,909,943.92
1. 利息收入		6,523,102.73	3,679,122.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	95,967.54	477,014.59
债券利息收入		6,208,630.85	3,071,938.03
资产支持证券利息收入		218,504.34	6,775.35
买入返售金融资产收入		-	123,394.03

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,824,860.13	737,101.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,925,760.37	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,182,962.57	384,806.10
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,082,062.33	352,295.50
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,810,603.19	13,492,192.38
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	587,024.16	1,527.94
减：二、费用		2,278,052.19	1,316,960.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,243,953.68	972,137.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	248,790.76	117,437.80
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	245,146.77	105,488.43
5. 利息支出		407,543.47	1,611.44
其中：卖出回购金融资产支出		407,543.47	1,611.44
6. 税金及附加		20,204.63	10,315.69
7. 其他费用	6.4.7.20	112,412.88	109,969.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,467,538.02	16,592,983.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,467,538.02	16,592,983.83

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 12 月 29 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信新生利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计



一、期初所有者权益(基金净值)	427,296,076.66	130,167,295.07	557,463,371.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,467,538.02	38,467,538.02
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)	-3,568,900.90	227,066.64	-3,341,834.26
其中：1. 基金申购款	193,783,588.53	66,093,119.44	259,876,707.97
2. 基金赎回款	-197,352,489.43	-65,866,052.80	-263,218,542.23
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)	423,727,175.76	168,861,899.73	592,589,075.49
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)	195,208,932.50	19,200,249.35	214,409,181.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,592,983.83	16,592,983.83
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)	237,738,527.06	27,205,222.99	264,943,750.05
其中：1. 基金申购款	237,966,125.74	27,229,868.00	265,195,993.74
2. 基金赎回款	-227,598.68	-24,645.01	-252,243.69
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）	432,947,459.56	62,998,456.17	495,945,915.73

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 12 月 29 日。

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：

<u>赵桂才</u>	<u>郝炜</u>	<u>关亚君</u>
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

工银瑞信新生利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[2015]1674 号《关于准予工银瑞信新生利混合型证券投资基金注册的批复》注册，由工银瑞信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《工银瑞信新生利混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 200,033,940.31 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(2016)第 1684 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《工银瑞信新生利混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,049,941.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 16,001.19 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

### 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》、《工银瑞信新生利混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财

务状况以及 2021 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 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

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

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

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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	21,587,814.88
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	21,587,814.88

##### 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		133,883,758.75	178,369,853.88	44,486,095.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	197,105,314.80	198,219,564.76	1,114,249.96
	银行间市场	189,262,092.44	190,139,400.00	877,307.56
	合计	386,367,407.24	388,358,964.76	1,991,557.52
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		520,251,165.99	566,728,818.64	46,477,652.65

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	4,777.72
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	155.40
应收债券利息	4,317,437.50
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	21.10
合计	4,322,391.72

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

## 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	43,864.49
银行间市场应付交易费用	550.00
合计	44,414.49

## 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	27.37
应付证券出借违约金	-
预提审计费	28,760.90
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	9,300.00
合计	97,595.64

## 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	427,296,076.66	427,296,076.66
本期申购	193,783,588.53	193,783,588.53
本期赎回（以“-”号填列）	-197,352,489.43	-197,352,489.43
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	423,727,175.76	423,727,175.76

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	92,821,806.30	37,345,488.77	130,167,295.07
本期利润	26,656,934.83	11,810,603.19	38,467,538.02
本期基金份额交易产生的变动数	2,995,546.21	-2,768,479.57	227,066.64
其中：基金申购款	50,622,859.13	15,470,260.31	66,093,119.44
基金赎回款	-47,627,312.92	-18,238,739.88	-65,866,052.80
本期已分配利润	-	-	-

本期末	122,474,287.34	46,387,612.39	168,861,899.73
-----	----------------	---------------	----------------

#### 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	88,276.55
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	7,184.44
其他	506.55
合计	95,967.54

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	21,925,760.37
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	21,925,760.37

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	93,213,367.10
减：卖出股票成本总额	71,287,606.73
买卖股票差价收入	21,925,760.37

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,182,962.57
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	-1,182,962.57

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	105,865,791.85
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	105,339,314.94
减：应收利息总额	1,709,439.48
买卖债券差价收入	-1,182,962.57

## 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	10,314,038.36
减：卖出资产支持证券成本总额	10,000,000.00
减：应收利息总额	314,038.36
资产支持证券投资收益	-



**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,082,062.33
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,082,062.33

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	11,810,603.19

股票投资	8,245,399.26
债券投资	3,596,203.93
资产支持证券投资	-31,000.00
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	11,810,603.19

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	562,817.94
基金转换费收入	24,206.22
合计	587,024.16

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	243,521.77
银行间市场交易费用	1,625.00
合计	245,146.77

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	28,760.90
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	5,544.61
合计	112,412.88

### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的重大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，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司	基金托管人
中国工商银行股份有限公司	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

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 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	1,243,953.68	972,137.46
其中：支付销售机构的客户维护费	2,041.56	382.47

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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	248,790.76	117,437.80

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年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
中国民生银行股份有限公司	21,587,814.88	88,276.55	16,151,855.53	476,025.04

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688161	威高骨科	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	36.22	82.27	3,069	111,159.18	252,486.63	-

688613	奥精医疗	2021年5月13日	2021年11月22日	新股锁定	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	-
688625	呈和科技	2021年5月31日	2021年12月7日	新股锁定	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
688656	浩欧博	2021年1月6日	2021年7月13日	新股锁定	35.26	72.60	1,371	48,341.46	99,534.60	-
688319	欧林生物	2021年5月31日	2021年12月8日	新股锁定	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
688628	优利德	2021年1月22日	2021年8月2日	新股锁定	19.11	32.62	2,789	53,297.79	90,977.18	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	251.96	291	13,773.03	73,320.36	-
688117	圣诺生物	2021年5月26日	2021年12月3日	新股锁定	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
688350	富森科技	2021年1月21日	2021年7月28日	新股锁定	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
688328	深科达	2021年3月1日	2021年9月9日	新股锁定	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.50	453	15,048.66	39,637.50	-
688565	力源科技	2021年5月6日	2021年11月	新股锁定	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-

		日	15日								
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14		-
300941	创识科技	2021年 2月2 日	2021年 8月9 日	新股锁 定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06		-
301015	百洋医药	2021年 6月22 日	2021年 12月 30日	新股锁 定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46		-
300932	三友联众	2021年 1月15 日	2021年 7月22 日	新股锁 定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32		-
300982	苏文电能	2021年 4月19 日	2021年 10月 27日	新股锁 定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93		-
300968	格林精密	2021年 4月6 日	2021年 10月 15日	新股锁 定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34		-
300940	南极光	2021年 1月27 日	2021年 8月3 日	新股锁 定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66		-
300614	百川畅银	2021年 5月18 日	2021年 11月 25日	新股锁 定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02		-
300937	药易购	2021年 1月20 日	2021年 7月27 日	新股锁 定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24		-
301013	利和兴	2021年 6月21 日	2021年 12月 29日	新股锁 定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81		-
300942	易瑞生物	2021年 2月2 日	2021年 8月9 日	新股锁 定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36		-
300997	欢乐家	2021年 5月26 日	2021年 12月2 日	新股锁 定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40		-
300933	中辰股份	2021年 1月15 日	2021年 7月22 日	新股锁 定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28		-
301002	崧盛股份	2021年 5月27 日	2021年 12月7 日	新股锁 定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62		-
605287	德才	2021年	2021年	新股未	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44		-

	股份	6月28日	7月6日	上市						
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-



300930	屹通新材	2021年 1月13 日	2021年 7月21 日	新股锁 定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021年 4月21 日	2021年 10月 29日	新股锁 定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
301004	嘉益股份	2021年 6月18 日	2021年 12月 27日	新股锁 定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021年 5月12 日	2021年 11月 22日	新股锁 定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020年 12月29 日	2021年 7月7 日	新股锁 定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021年 4月14 日	2021年 10月 21日	新股锁 定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021年 3月30 日	2021年 10月 11日	新股锁 定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021年 6月9 日	2021年 12月 17日	新股锁 定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021年 2月3 日	2021年 8月10 日	新股锁 定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021年 4月2 日	2021年 10月 13日	新股锁 定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021年 4月8 日	2021年 10月 19日	新股锁 定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021年 1月12 日	2021年 7月21 日	新股锁 定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021年 3月22 日	2021年 9月29 日	新股锁 定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021年 6月23 日	2022年 1月5 日	新股锁 定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
300995	奇德新材	2021年 5月17 日	2021年 11月	新股锁 定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-

		日	26 日							
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁 定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁 定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股锁 定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁 定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股锁 定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁 定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	新股锁 定	24.60	163.00	540	13,284.00	88,020.00	-
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
113050	南银转债	2021 年 6 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	新债未 上市	100.00	100.00	1,450	145,000.00	145,000.00	-

注：以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、信用风险管理团队、内控稽核部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时，对于每一战略环节、业务环节，公司都制定了系统化的风险管理程序，实现风险识别、风险评估、风险处理、风险监控和风险报告的程序化管理，并对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由三大防线共同筑成的风险管理体系。其中：

(1) 各业务部门是风险管理的第一道防线，将管控好风险作为开展业务的前提和保障，落实各项风险管理措施，承担风险管理的第一责任。第一道防线按照法律法规的规定，制定本业务条线的制度和流程，对经营和业务流程中的风险主动识别、评估和控制，收集和报告风险点，针对薄弱环节及时进行完善。通过对业务和产品相关制度、流程、系统的自我评估、自我检查、自我完善、自我培训，履行业务经营过程中的自我风险控制职能。

(2) 风险管理部、信用风险管理团队、法律合规部和内控稽核部是风险管理的第二道防线。第二道防线通过制定风险管理政策、标准和要求，为第一道防线提供风险管理的方法、工具、流程、培训和指导，主动为第一道防线风险管控提供支持，独立监控、评估、报告公司整体及业务条线的风险状况和风险变化情况。监督和检查第一道防线风险管理措施的执行和有效性，为第三道防线开展再检查、再监督和内部控制评价提供基础。法律合规部负责合规风险的宣导培训、合规咨询、审查审核和监督检查等，风险管理部负责对公司的投资风险进行独立评估、监控、检查和报告，内控稽核部负责操作风险和员工异常行为排查的管理和检查。

(3) 稽核团队是风险管理的第三道防线。通过内部独立、客观的监督与评价，采用系统化、

规范化方法，对第一道、第二道防线在风险管理中的履职情况进行审计，对风险管理的效果进行独立客观的监督、审计、评价和报告，促进公司发展战略和经营管理目标的实现。

同时，公司董事会确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对重大事件、重大决策的风险评估意见和风险管理报告进行审议，审批重大风险的解决方案；公司管理层根据董事会的风险管理战略，制定并确保公司风险管理制度得以全面、有效执行，在董事会授权范围内批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案，组织各业务部门开展风险管控工作。

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。而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特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,007,000.00	-
合计	10,007,000.00	-

注：1、表中所列示的债券投资为短期融资券。

2、上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

3、本基金上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	289,630,179.44	173,305,044.40
AAA 以下	38,474,785.32	42,622,540.00
未评级	-	-
合计	328,104,964.76	215,927,584.40

注：1、表中所列示的债券投资为除短期融资券、同业存单、资产支持证券以外的信用债券。

2、上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	10,031,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	10,031,000.00

注：1、上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

2、本基金本期末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。

本基金的收入及经营活动的现金流量受到市场利率变化的影响。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6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	21,587,814.88	-	-	-	-	-	21,587,814.88
结算备付金	345,372.29	-	-	-	-	-	345,372.29
存出保证金	47,056.98	-	-	-	-	-	47,056.98
交易性金融资产	-	-	45,994,000.00	286,236,929.30	56,128,035.46	178,369,853.88	566,728,818.64
应收证券清算款	-	-	-	-	-	22,556.43	22,556.43
应收利息	-	-	-	-	-	4,322,391.72	4,322,391.72
应收申购款	-	-	-	-	-	23,468.11	23,468.11
资产总计	21,980,244.15	-	45,994,000.00	286,236,929.30	56,128,035.46	182,738,270.14	593,077,479.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	17,818.50	17,818.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	233,771.41	233,771.41
应付托管费	-	-	-	-	-	46,754.29	46,754.29
应付交易费用	-	-	-	-	-	44,414.49	44,414.49
应付税费	-	-	-	-	-	48,049.23	48,049.23
其他负债	-	-	-	-	-	97,595.64	97,595.64
负债总计	-	-	-	-	-	488,403.56	488,403.56
利率敏感度缺口	21,980,244.15	-	45,994,000.00	286,236,929.30	56,128,035.46	182,249,866.58	592,589,075.49
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	53,054,025.32	-	-	-	-	-	53,054,025.32
结算备付金	183,880.90	-	-	-	-	-	183,880.90
存出保证金	131,096.34	-	-	-	-	-	131,096.34
交易性金融资产	-	-	45,922,600.00	185,315,984.40	104,674,000.00	164,000,243.20	499,912,827.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,208,963.81	1,208,963.81
应收利息	-	-	-	-	-	4,469,854.00	4,469,854.00

						.70	70
应收申购款	-	-	-	-	-	28,577.14	28,577.14
资产总计	53,369,002.56		45,922,600.00	185,315,984.40	104,674,000.00	169,707,638.85	558,989,225.81
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,018,289.45	1,018,289.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	218,885.81	218,885.81
应付托管费	-	-	-	-	-	43,777.16	43,777.16
应付交易费用	-	-	-	-	-	32,647.23	32,647.23
应付税费	-	-	-	-	-	21,122.99	21,122.99
其他负债	-	-	-	-	-	191,131.44	191,131.44
负债总计	-	-	-	-	-	1,525,854.08	1,525,854.08
利率敏感度缺口	53,369,002.56		45,922,600.00	185,315,984.40	104,674,000.00	168,181,784.77	557,463,371.73

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

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	利率增加 25 基准点	-2,196,444.96	-2,781,947.08
	利率减少 25 基准点	2,221,666.97	2,829,448.73

#### 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

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人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进行风险度量和分析，以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	178,369,853.88	30.10	164,000,243.20	29.42
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	388,358,964.76	65.54	325,881,584.40	58.46
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	10,031,000.00	1.80
合计	566,728,818.64	95.64	499,912,827.60	89.68

注：1、本基金投资于股票资产投资比例为基金资产的 0%—30%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或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。

2、由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月）	

			31 日 )
分析	业绩比较基准增加 5%	34,170,464.76	11,803,065.93
	业绩比较基准减少 5%	-34,170,464.76	-11,803,065.93

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	178,369,853.88	30.08
	其中：股票	178,369,853.88	30.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	388,358,964.76	65.48
	其中：债券	388,358,964.76	65.48
	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	21,933,187.17	3.70
8	其他各项资产	4,415,473.24	0.74
9	合计	593,077,479.05	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 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	11,290.28	0.00
B	采矿业	4,829,496.00	0.81
C	制造业	105,498,656.79	17.80
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	329,215.65	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	7,408,694.20	1.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,090,205.52	2.21
J	金融业	7,051,161.60	1.19
K	房地产业	3,612,463.90	0.61
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	27,040,293.85	4.56
N	水利、环境和公共设施管理业	78,934.33	0.01
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	9,381,050.00	1.58
S	综合	-	-
	合计	178,369,853.88	30.10

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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	603259	药明康德	168,360	26,363,492.40	4.45
2	300750	宁德时代	35,100	18,771,480.00	3.17
3	600570	恒生电子	139,777	13,034,205.25	2.20
4	002415	海康威视	182,200	11,751,900.00	1.98
5	600703	三安光电	313,500	10,047,675.00	1.70
6	300661	圣邦股份	39,000	9,856,470.00	1.66
7	300413	芒果超媒	136,750	9,381,050.00	1.58
8	600887	伊利股份	234,200	8,625,586.00	1.46

9	002430	杭氧股份	245,200	8,481,468.00	1.43
10	000596	古井贡酒	33,200	7,951,400.00	1.34
11	000786	北新建材	188,900	7,414,325.00	1.25
12	002928	华夏航空	490,642	7,408,694.20	1.25
13	600519	贵州茅台	3,500	7,198,450.00	1.21
14	300059	东方财富	215,040	7,051,161.60	1.19
15	600298	安琪酵母	117,300	6,378,774.00	1.08
16	002372	伟星新材	277,948	5,745,185.16	0.97
17	601899	紫金矿业	498,400	4,829,496.00	0.81
18	600048	保利地产	299,200	3,602,368.00	0.61
19	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.11
20	300979	华利集团	4,530	504,007.80	0.09
21	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.07
22	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.04
23	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.04
24	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.04
25	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.03
26	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.03
27	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
28	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.02
29	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.02
30	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.02
31	688560	明冠新材	3,832	92,351.20	0.02
32	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.02
33	300919	中伟股份	540	88,020.00	0.01
34	688217	睿昂基因	1,040	86,736.00	0.01
35	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
36	300957	贝泰妮	291	73,320.36	0.01
37	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.01
38	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.01
39	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.01
40	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
41	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
42	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
43	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
44	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.01
45	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
46	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
47	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
48	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
49	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
50	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00

51	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
52	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
53	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
54	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
55	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
56	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
57	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
58	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
59	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
60	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
61	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
62	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
63	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
64	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
65	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
66	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
67	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
68	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
69	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
70	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
71	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
72	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
73	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
74	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
75	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
76	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
77	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
78	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
79	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
80	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
81	300975	商络电子	517	6,872.51	0.00
82	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
83	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
84	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
85	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
86	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
87	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
88	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
89	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
90	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
91	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
92	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

93	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
94	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
95	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
96	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
97	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
98	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
99	605228	神通科技	17	160.14	0.00
100	003040	楚天龙	1	30.40	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	600703	三安光电	9,890,328.00	1.77
2	300750	宁德时代	7,584,914.52	1.36
3	002430	杭氧股份	7,523,885.00	1.35
4	300661	圣邦股份	7,355,940.00	1.32
5	600298	安琪酵母	7,054,590.00	1.27
6	600570	恒生电子	5,890,680.20	1.06
7	603259	药明康德	5,817,177.00	1.04
8	300413	芒果超媒	5,392,956.00	0.97
9	600048	保利地产	4,502,983.00	0.81
10	601318	中国平安	3,148,229.00	0.56
11	600887	伊利股份	1,838,350.00	0.33
12	002928	华夏航空	1,693,753.50	0.30
13	000596	古井贡酒	1,678,499.00	0.30
14	601899	紫金矿业	1,339,014.00	0.24
15	688538	和辉光电	304,013.30	0.05
16	688819	天能股份	281,664.60	0.05
17	688680	海优新材	187,019.56	0.03
18	688317	之江生物	175,429.98	0.03
19	688660	电气风电	153,119.68	0.03
20	300979	华利集团	150,486.60	0.03

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、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	002938	鹏鼎控股	11,425,902.49	2.05
2	000913	钱江摩托	7,985,895.91	1.43
3	688111	金山办公	7,791,569.07	1.40

4	000830	鲁西化工	6,881,504.00	1.23
5	601318	中国平安	6,240,301.00	1.12
6	601899	紫金矿业	6,057,510.00	1.09
7	600004	白云机场	5,262,935.00	0.94
8	603259	药明康德	4,631,790.00	0.83
9	002372	伟星新材	3,767,255.00	0.68
10	002928	华夏航空	3,695,846.40	0.66
11	600009	上海机场	3,692,598.00	0.66
12	603290	斯达半导	2,968,325.00	0.53
13	300750	宁德时代	2,759,920.00	0.50
14	000596	古井贡酒	1,181,555.00	0.21
15	688521	芯原股份	784,827.77	0.14
16	000786	北新建材	677,900.00	0.12
17	688680	海优新材	598,347.98	0.11
18	688538	和辉光电	517,396.22	0.09
19	688696	极米科技	492,154.00	0.09
20	300957	贝泰妮	454,313.20	0.08

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；  
2、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	77,411,818.15
卖出股票收入（成交）总额	93,213,367.10

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	央行票据	-	-
3	金融债券	50,247,000.00	8.48
	其中：政策性金融债	50,247,000.00	8.48
4	企业债券	197,082,450.14	33.26
5	企业短期融资券	10,007,000.00	1.69
6	中期票据	129,885,400.00	21.92
7	可转债（可交换债）	1,137,114.62	0.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	388,358,964.76	65.54

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 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	103000618	20 国新控股 MTN002	300,000	29,751,000.00	5.02
2	102001052	20 宝武集团 MTN001	300,000	29,574,000.00	4.99
3	102001054	20 粤海 MTN001	250,000	24,495,000.00	4.13
4	200215	20 国开 15	200,000	20,278,000.00	3.42
5	175707	21 鲁高 01	200,000	20,218,000.00	3.41

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

## 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

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。



## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	47,056.98
2	应收证券清算款	22,556.43
3	应收股利	-
4	应收利息	4,322,391.72
5	应收申购款	23,468.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,415,473.24

### 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	113013	国君转债	511,029.30	0.09

注：上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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 (%)
613	691,235.20	421,438,872.45	99.46	2,288,303.31	0.54

### 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	95,767.40	0.02

### 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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2016 年 12 月 29 日) 基金份额总额	200,049,941.50
本报告期期初基金份额总额	427,296,076.66
本报告期基金总申购份额	193,783,588.53
减：本报告期基金总赎回份额	197,352,489.43
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	423,727,175.76

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金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：

基金管理人于 2021 年 1 月 16 日发布《工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，朱碧艳女士自 2021 年 1 月 15 日起担任工银瑞信基金管理有限公司董事长、总经理。

基金管理人于 2021 年 2 月 6 日发布《工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，赵桂才先生自 2021 年 2 月 5 日起担任工银瑞信基金管理有限公司董事长，并代任总经理、法

定代表人。

2、基金托管人：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
太平洋证券	2	76,958,544.64	46.95%	54,739.63	46.95%	-
中泰证券	2	42,523,310.40	25.94%	30,247.00	25.94%	-
东方证券	4	37,861,210.23	23.10%	26,931.86	23.10%	-
中信证券	1	6,581,601.05	4.02%	4,681.88	4.02%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择综合实力强、研究能力突出、合规经营的证券公司，向其租用专用交易单元。

(1) 选择标准：

a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。

b) 在证监会最近一期证券公司年度分类结果中，分类级别原则上不得低于 BBB。

c)不符合上述要求的券商、咨询机构，若其特定研究领域有突出优势，可一事一议，报公司审批通过后纳入。

## (2) 选择程序

a)新增证券公司的选定：根据以上标准对证券公司进行考察、选择和确定。在合作之前，证券公司需提供至少两个季度的服务，并在两个季度内与其他已合作证券公司一起参与基金管理人的研究服务评估。根据对其研究服务评估结果决定是否作为新增合作证券公司。

b)签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

## 2. 证券公司的评估、保留和更换程序

(1) 交易单元的租用期限为一年，合同到期前，基金管理人将根据各证券公司在服务期间的综合证券服务质量、费率等情况进行评估。

(2) 对于符合标准的证券公司，与其续约；对于不能达到标准的证券公司，不与其续约，并根据证券公司选择标准和程序，重新选择其他经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

(3) 若证券公司提供的综合证券服务不符合要求，基金管理人有权按照协议约定，提前终止租用其交易单元。

## 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	
	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
太平洋证券	-	-	806,000,000.00	85.45%	-	-
中泰证券	702,311.30	14.94%	126,200,000.00	13.38%	-	-
东方证券	-	-	1,000,000.00	0.11%	-	-
中信证券	-	-	10,000,000.00	1.06%	-	-
申万宏源	4,000,000.00	85.06%	-	-	-	-

## 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	工银瑞信基金管理有限公司关于在基金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2021年1月1日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于在基金直销电子自助交易系统开展费率优	中国证监会规定的媒介	2021年1月5日

	惠活动的公告		
3	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 1 月 16 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于在基金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 1 月 29 日
5	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 2 月 6 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210422-20210630	43,395,950.79	69,061,401.39	8,980,000.00	103,477,352.18	24.42
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中,存在基金规模大幅波动的风险,以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

### 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、中国证监会准予工银瑞信新生利混合型证券投资基金募集申请的注册文件;
- 2、《工银瑞信新生利混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、《工银瑞信新生利混合型证券投资基金托管协议》;
- 4、《工银瑞信新生利混合型证券投资基金招募说明书》;
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照;
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

## 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：[www.icbccs.com.cn](http://www.icbccs.com.cn)

工银瑞信基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日