

博时沪港深价值优选灵活配置混合型证  
券投资基金  
2021 年中期报告  
2021 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

## § 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。

基金托管人中信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>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<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遵规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37

7.12 投资组合报告附注.....	37
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	39
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>39</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8 其他重大事件.....	41
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>42</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.....	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	43
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>43</b>
12.1 备查文件目录.....	43
12.2 存放地点.....	43
12.3 查阅方式.....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	博时沪港深价值优选	
基金主代码	004091	
交易代码	004091	
基金运作方式	契约开放式	
基金合同生效日	2017 年 1 月 25 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	42,001,024.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时沪港深价值优选 A	博时沪港深价值优选 C
下属分级基金的交易代码	004091	004092
报告期末下属分级基金的份额总额	35,768,542.07 份	6,232,482.07 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用价值投资策略对沪港深市场进行投资，把握港股通开放政策带来的投资机会，在控制组合净值波动率的前提下，获取基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略分两个层次：首先是大类资产配置，即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例；其次是个股选择策略和债券投资策略。其中资产配置策略主要是基于对宏观经济周期运行规律的研究予以决策。本基金将通过跟踪宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及国家财政、税收、货币、汇率各项政策，来判断经济周期目前的位置以及未来发展方向。在经济周期各阶段，综合对各类宏观经济指标和市场指标的分析，本基金对大类资产进行配置的策略为：在经济复苏期和繁荣期超配股票资产；在经济衰退期和政策刺激阶段，超配债券等固定收益类资产，力争通过资产配置获得部分超额收益；主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略、资产支持证券的投资策略。金融衍生品投资策略包括权证投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×40%+沪深 300 指数收益率×20%+恒生国企指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险/收益品种。本基金除了投资于 A 股市场优质企业外，还可在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的

	市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
--	---

### 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		博时基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	罗丹丹
	联系电话	0755-83169999	4006800000
	电子邮箱	service@bosera.com	luodandan@citicbank.com
客户服务电话		95105568	95558
传真		0755-83195140	010-85230024
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		518040	100020
法定代表人		江向阳	李庆萍

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）	
	博时沪港深价值优选 A	博时沪港深价值优选 C
本期已实现收益	7,030,026.96	964,549.34
本期利润	1,216,758.98	217,335.04

加权平均基金份额本期利润	0.0288	0.0357
本期加权平均净值利润率	1.80%	2.29%
本期基金份额净值增长率	4.80%	4.55%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	博时沪港深价值优选 A	博时沪港深价值优选 C
期末可供分配利润	14,231,907.98	2,282,493.69
期末可供分配基金份额利润	0.3979	0.3662
期末基金资产净值	58,792,583.04	10,032,114.58
期末基金份额净值	1.6437	1.6096
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	博时沪港深价值优选 A	博时沪港深价值优选 C
基金份额累计净值增长率	64.37%	60.96%

注：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。

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。

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。

## 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

#### 博时沪港深价值优选 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	3.34%	0.93%	-0.58%	0.45%	3.92%	0.48%
过去三个月	6.12%	1.12%	-0.51%	0.51%	6.63%	0.61%
过去六个月	4.80%	1.61%	0.46%	0.71%	4.34%	0.90%
过去一年	30.81%	1.46%	6.24%	0.69%	24.57%	0.77%
过去三年	36.96%	1.30%	14.19%	0.73%	22.77%	0.57%
自基金合同生效起至今	64.37%	1.24%	21.76%	0.69%	42.61%	0.55%

#### 博时沪港深价值优选 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	3.29%	0.93%	-0.58%	0.45%	3.87%	0.48%
过去三个月	5.99%	1.12%	-0.51%	0.51%	6.50%	0.61%
过去六个月	4.55%	1.61%	0.46%	0.71%	4.09%	0.90%
过去一年	30.16%	1.46%	6.24%	0.69%	23.92%	0.77%
过去三年	34.92%	1.30%	14.19%	0.73%	20.73%	0.57%
自基金合同生效起至今	60.96%	1.24%	21.76%	0.69%	39.20%	0.55%

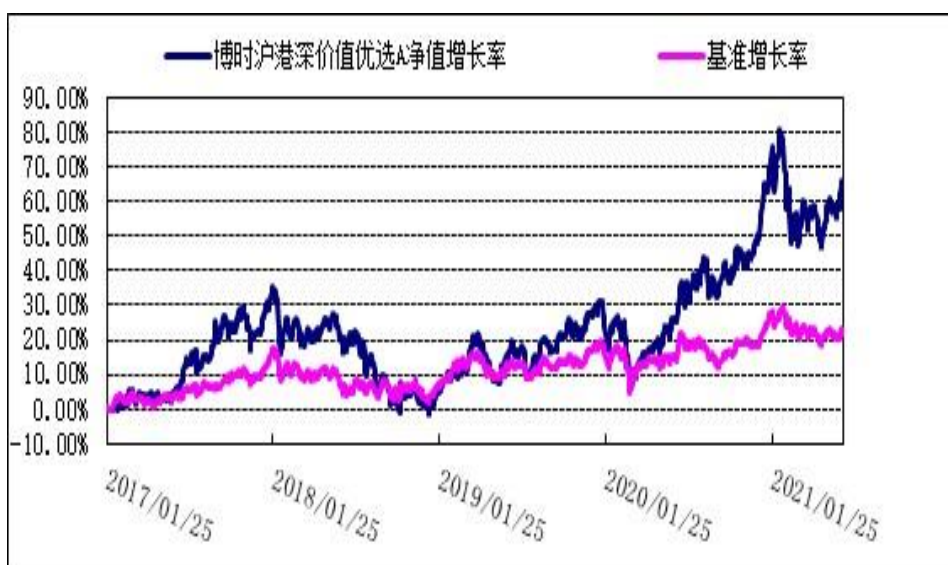
注：本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率×40%+沪深 300 指数收益率×20%+恒生国企指数收益率×40%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 40%、20%和 40%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

### 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

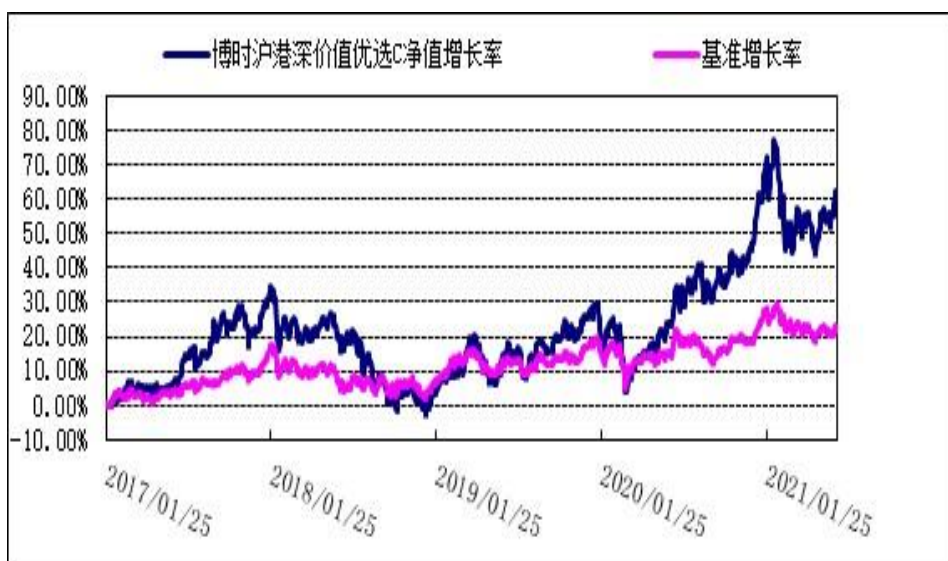
博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 1 月 25 日至 2021 年 6 月 30 日)

#### 博时沪港深价值优选 A



#### 博时沪港深价值优选 C





## § 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

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2021 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 276 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 15482 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 4383 亿元人民币，累计分红逾 1465 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨涛	基金经理	2018-06-22	-	14.9	杨涛先生，硕士。2006 年起先后在瑞士银行集团、成都市绿色地球环保有限公司、建银国际（中国）有限公司、中国投资有限责任公司、里昂证券（原中信证券国际）工作。2017 年加入博时基金管理有限公司。现任博时大中华亚太精选股票证券投资基金（2017 年 11 月 29 日—至今）、博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金（2018 年 6 月 22 日—至今）的基金经理。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

#### 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，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% 的交易共 24 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。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

2021 年 1 季度，港股和 A 股市场在 1 月至 2 月中旬延续了去年的动能，之后因为美债长端利率上行、前期累积涨幅过大等因素，估值较高的核心资产和成长类股票出现了大幅回调。在 2 季度，港股因受到美债长端利率波动及美国通胀预期变化的影响，叠加权重板块（互联网行业）在监管下承压，期间以震荡为主。上半年恒生指数以港币计价上涨 5.86%，但同期港币对人民币汇率下跌 1.14%（从 0.84164 至 0.83208）。因此，上半年恒生指数以人民币计价上涨 4.66%。本基金 A 类、C 类份额在上半年分别上涨 4.80%、4.55%，与港股市场表现相近。

上半年期间，组合主要投资于港股的物业管理、新能源车（整车）、医药（CXO 龙头）、可选消费（运动品牌等）、互联网（社交、游戏、本地生活）、低估值高股息（内房股、内银股）等方向，以及 A 股的白酒（高端白酒）、家电（白电）、新能源车产业链（动力电池龙头）、光伏、工程机械（核心零部件）、软件（SaaS）、电子（苹果产业链）等板块。组合维持以投资港股为主、A 股为辅的风格。上半年维持在较高仓位（90%左右），期间减持了一些连锁餐饮、互联网本地生活标的，增持了物业管理和软件等。从归因分析角度，上半年医药（CXO）、运动服饰、物业管理、电子等板块正贡献较大，连锁餐饮、互联网等板块则负贡献较多。

当前时点，结合对中、美长端利率和短期流动性等宏观因素的判断，对 3 季度及下半年港股市场整体谨慎乐观，在震荡中上行的概率较大。然而，由于恒指盈利增速不断被下调，21 年、22 年 EPS?Positive 增速仅为-5.5%、3.6%（彭博一致预期，港币计价），结构性的机会将大于 beta 行情。同时，随着疫苗接种进度的持续推进，对经济复苏和通胀上行的预期边际增强将有可能对市场短期

带来冲击，类似于 1 季度。从市场风格来看，成长板块内部进一步分化，有高增速匹配、能达到甚至超预期的企业将可以靠盈利增长继续上涨，而基本面不达预期的公司表现将落后。此外，关注金融板块/顺周期行业的阶段性机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.6437 元，份额累计净值为 1.6437 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.6096 元，份额累计净值为 1.6096 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 4.80%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 4.55%，同期业绩基准增长率为 0.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

3 季度及下半年看好的方向包括新能源（新能源车及光伏）、物业管理（全国性龙头）、运动品牌、医药（CXO、平台型创新药企业）、周期（原材料、内银股）等，也关注互联网、连锁餐饮等板块的潜在反转机会。新能源、物业管理、创新药、运动品牌等板块均属于景气度高、长期盈利增速快，增长与估值能匹配的行业。互联网行业近期受国家监管政策升级影响较大，短期估值承压，但是从中长期来看，龙头企业的收入和盈利增速可持续性仍然很强，尤其是未来这些企业的运行做到合规以后，而由 VC/PE 支持的新进入者变少，估值修复的概率较大。A 股方面投资总体维持原有方向，重点投资高端白酒、家电龙头、新能源产业链、医药等。

#### 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，设立了博时基金管理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。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，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公司作出合理解释，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债金融估值中心有限公司签署服务协议，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

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，博时基金管理有限公司在博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，博时基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：博时沪港深价值优选灵活配置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	6.4.3.1	6,928,753.87	6,408,261.80
结算备付金		5,874.32	1,473,951.48
存出保证金		20,599.58	397,922.03
交易性金融资产	6.4.3.2	61,937,669.54	74,746,117.14
其中：股票投资		61,937,669.54	74,746,117.14
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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		505,097.72	501,345.57
应收利息	6.4.3.5	1,550.57	1,852.62
应收股利		101,484.29	-
应收申购款		59,993.18	30,242.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		69,561,023.07	83,559,692.69
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1.62	3,149,569.05
应付赎回款		556,080.84	446,800.82
应付管理人报酬		83,033.63	95,715.24
应付托管费		13,838.94	15,952.51
应付销售服务费		4,214.93	2,718.00
应付交易费用	6.4.3.7	14,863.16	18,681.87
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	64,292.33	124,707.79
负债合计		736,325.45	3,854,145.28
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.3.9	42,001,024.14	50,899,734.16
未分配利润	6.4.3.10	26,823,673.48	28,805,813.25
所有者权益合计		68,824,697.62	79,705,547.41
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>69,561,023.07</b>	<b>83,559,692.69</b>

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 42,001,024.14 份。其中 A 类基金份额净值 1.6437 元，基金份额总额 35,768,542.07 份；C 类基金份额净值 1.6096 元，基金份额总额 6,232,482.07 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		2,322,278.57	3,278,659.24
1. 利息收入		36,783.59	64,182.43
其中：存款利息收入	6.4.3.11	36,783.59	64,182.43
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,816,840.80	1,239,210.21
其中：股票投资收益	6.4.3.12	8,483,936.72	631,255.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13 .1	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13 .2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	332,904.08	607,955.11
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-6,560,482.28	1,961,093.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	29,136.46	14,173.12
<b>减：二、费用</b>		<b>888,184.55</b>	<b>847,167.65</b>

1. 管理人报酬		577,409.20	427,459.35
2. 托管费		96,234.83	71,243.27
3. 销售服务费		23,648.85	38,504.25
4. 交易费用	6.4.3.18	121,212.24	255,220.25
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.19	69,679.43	54,740.53
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,434,094.02	2,431,491.59
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,434,094.02	2,431,491.59

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时沪港深价值优选灵活配置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）	50,899,734.16	28,805,813.25	79,705,547.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,434,094.02	1,434,094.02
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）	-8,898,710.02	-3,416,233.79	-12,314,943.81
其中：1. 基金申购款	13,102,681.38	8,190,525.58	21,293,206.96
2. 基金赎回款	-22,001,391.40	-11,606,759.37	-33,608,150.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	42,001,024.14	26,823,673.48	68,824,697.62
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）	34,248,048.78	9,525,679.63	43,773,728.41
二、本期经营活动产生的	-	2,431,491.59	2,431,491.59

基金净值变动数（本期利润）			
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）	27,564,570.33	3,688,087.64	31,252,657.97
其中：1. 基金申购款	44,046,555.82	7,050,966.98	51,097,522.80
2. 基金赎回款	-16,481,985.49	-3,362,879.34	-19,844,864.83
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）	61,812,619.11	15,645,258.86	77,457,877.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：孙献，会计机构负责人：侣方方

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 6.4.2 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 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	6,928,753.87
定期存款	-

其他存款	-
合计	6,928,753.87

#### 6.4.3.2 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	49,998,567.23	61,937,669.54	11,939,102.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	49,998,567.23	61,937,669.54	11,939,102.31

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.3.5 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	1,395.62
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	121.55
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-

其他	33.40
合计	1,550.57

#### 6.4.3.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.3.7 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	14,863.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	14,863.16

#### 6.4.3.8 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	284.96
应付证券出借违约金	-
预提费用	64,007.37
合计	64,292.33

#### 6.4.3.9 实收基金

##### 博时沪港深价值优选 A

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	账面金额
上年度末	46,570,803.12	46,570,803.12
本期申购	7,885,232.55	7,885,232.55
本期赎回（以“-”号填列）	-18,687,493.60	-18,687,493.60
本期末	35,768,542.07	35,768,542.07

##### 博时沪港深价值优选 C

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	账面金额
上年度末	4,328,931.04	4,328,931.04
本期申购	5,217,448.83	5,217,448.83
本期赎回（以“-”号填列）	-3,313,897.80	-3,313,897.80
本期末	6,232,482.07	6,232,482.07

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

**6.4.3.10 未分配利润**
**博时沪港深价值优选 A**

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	10,988,581.78	15,481,175.73	26,469,757.51
本期利润	7,030,026.96	-5,813,267.98	1,216,758.98
本期基金份额交易产生的变动数	-3,786,700.76	-875,774.76	-4,662,475.52
其中：基金申购款	2,212,299.64	2,893,410.93	5,105,710.57
基金赎回款	-5,999,000.40	-3,769,185.69	-9,768,186.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,231,907.98	8,792,132.99	23,024,040.97

**博时沪港深价值优选 C**

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	914,461.12	1,421,594.62	2,336,055.74
本期利润	964,549.34	-747,214.30	217,335.04
本期基金份额交易产生的变动数	403,483.23	842,758.50	1,246,241.73
其中：基金申购款	1,405,564.18	1,679,250.83	3,084,815.01
基金赎回款	-1,002,080.95	-836,492.33	-1,838,573.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,282,493.69	1,517,138.82	3,799,632.51

**6.4.3.11 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	32,935.71
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	3,319.23
其他	528.65
合计	36,783.59

**6.4.3.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	39,931,106.77
减：卖出股票成本总额	31,447,170.05
买卖股票差价收入	8,483,936.72

### 6.4.3.13 债券投资收益

#### 6.4.3.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

#### 6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益

无发生额。

### 6.4.3.14 衍生工具收益

#### 6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

#### 6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

### 6.4.3.15 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	332,904.08
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	332,904.08

### 6.4.3.16 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	-6,560,482.28
——股票投资	-6,560,482.28
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-6,560,482.28

**6.4.3.17 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	20,702.44
转换费收入	8,434.02
合计	29,136.46

**6.4.3.18 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	121,212.24
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	121,212.24

**6.4.3.19 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	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,172.06
中债登账户维护费	9,000.00
合计	69,679.43

**6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明**
**6.4.4.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

**6.4.4.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

**6.4.5 关联方关系**
**6.4.5.1 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未发生变化。

#### 6.4.5.2 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
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人、基金销售机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	1,603,670.00	2.47%	-	-

##### 6.4.6.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.6.1.3 债券交易

无。

##### 6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

##### 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021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
招商证券	1,172.69	2.32%	1,172.69	7.89%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
招商证券	-	-	-	-

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。

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的管理费	577,409.20	427,459.35
其中：支付销售机构的客户维护费	68,264.51	90,887.54

注：支付基金管理人博时基金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 × 1.50% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	96,234.83	71,243.27

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时沪港深价值优选 A	博时沪港深价值优选 C	合计
博时基金	-	3,561.04	3,561.04
中信银行	-	1,887.08	1,887.08
招商证券	-	16.61	16.61
合计	-	5,464.73	5,464.73
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	博时沪港深价值优选 A	博时沪港深价值优选 C	合计
中信银行	-	583.80	583.80



招商证券	-	71.73	71.73
博时基金	-	4,982.76	4,982.76
合计	-	5,638.29	5,638.29

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.6.4 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

##### 6.4.6.4.1 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。

##### 6.4.6.4.2 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。

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

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	
	博时沪港深价值优选 A	博时沪港深价值优选 C	博时沪港深价值优选 A	博时沪港深价值优选 C
期初持有的基金份额	8,254,767.61	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	8,254,767.61	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	8,254,767.61	-	8,254,767.61	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.65%	-	16.17%	-

注：1. 申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

2. 基金管理人博时基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

##### 6.4.6.5.2 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。

#### 6.4.6.6 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
中信银行-活期存款	6,928,753.87	32,935.71	13,743,255.01	56,173.57

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

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

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

##### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险/收益品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现稳定的绝对回报。通过对符合或引领中国经济转型优质企业的深入研究，把握沪港通及后续资本市场开放政策带来的投资机会，在严格控制估值风险及流动性风险的前提下，获取基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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。

#### 6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

#### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.9.3 流动性风险

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

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

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以

及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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

于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 6.4.9.4 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。

##### 6.4.9.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	6,928,753.87	-	-	-	6,928,753.87
结算备付金	5,874.32	-	-	-	5,874.32

存出保证金	20,599.58	-	-	-	20,599.58
交易性金融资产	-	-	-	61,937,669.54	61,937,669.54
应收证券清算款	-	-	-	505,097.72	505,097.72
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,550.57	1,550.57
应收申购款	-	-	-	59,993.18	59,993.18
应收股利	-	-	-	101,484.29	101,484.29
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>6,955,227.77</b>	-	-	<b>-62,605,795.30</b>	<b>69,561,023.07</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	556,080.84	556,080.84
应付证券清算款	-	-	-	1.62	1.62
应付管理人报酬	-	-	-	83,033.63	83,033.63
应付托管费	-	-	-	13,838.94	13,838.94
应付销售服务费	-	-	-	4,214.93	4,214.93
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	14,863.16	14,863.16
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	64,292.33	64,292.33
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>736,325.45</b>	<b>736,325.45</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>6,955,227.77</b>	-	-	<b>-61,869,469.85</b>	<b>68,824,697.62</b>
<b>上年度末 2020年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	6,408,261.80	-	-	-	6,408,261.80
结算备付金	1,473,951.48	-	-	-	1,473,951.48
存出保证金	397,922.03	-	-	-	397,922.03
交易性金融资产	-	-	-	74,746,117.14	74,746,117.14
应收证券清算款	-	-	-	501,345.57	501,345.57
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,852.62	1,852.62
应收申购款	-	-	-	30,242.05	30,242.05
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>8,280,135.31</b>	-	-	<b>-75,279,557.38</b>	<b>83,559,692.69</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资	-	-	-	-	-

产款					
应付赎回款				446,800.82	446,800.82
应付证券清算款				3,149,569.05	3,149,569.05
应付管理人报酬				95,715.24	95,715.24
应付托管费				15,952.51	15,952.51
应付销售服务费				2,718.00	2,718.00
应交税费				-	-
应付交易费用				18,681.87	18,681.87
应付利息				-	-
其他负债				124,707.79	124,707.79
<b>负债总计</b>				<b>3,854,145.28</b>	<b>3,854,145.28</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>8,280,135.31</b>			<b>-71,425,412.10</b>	<b>79,705,547.41</b>

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。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资（不包括可转换债券、可交换债券）或资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期：同）。

#### 6.4.9.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	39,045,693.50	39,045,693.50
应收股利	-	101,484.29	101,484.29
资产合计	-	39,147,177.79	39,147,177.79
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	39,147,177.79	39,147,177.79
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	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	45,060,333.37	45,060,333.37
资产合计	-	45,060,333.37	45,060,333.37
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	45,060,333.37	45,060,333.37

#### 6.4.9.4.2.2 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：人民币万元）	
		本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 所有港币均相对人民币升值 5%	增加约 196	增加约 225
	2. 所有港币均相对人民币贬值 5%	减少约 196	减少约 225

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.9.4.3.1 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	61,937,669.54	89.99	74,746,117.14	93.78
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-



合计	61,937,669.54	89.99	74,746,117.14	93.78
----	---------------	-------	---------------	-------

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 138	增加约 662
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 138	减少约 662	

#### 6.4.10 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

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 61,937,669.54 元，属于第二层次的余额为 0.00 元，属于第三层次的余额为 0.00 元（上年度末：第一层次 74,732,921.25 元，第二层次 13,195.89 元，第三层次 0.00 元）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，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）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售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。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

(d) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

(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	61,937,669.54	89.04
	其中：股票	61,937,669.54	89.04
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	6,934,628.19	9.97
8	其他各项资产	688,725.34	0.99
9	合计	69,561,023.07	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 39,045,693.50 元，净值占比 56.73%。

### 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	20,537,646.04	29.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	1,364,000.00	1.98
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	990,330.00	1.44
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,891,976.04	33.26

### 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（%）
电信业务	6,243,775.22	9.07
房地产	3,588,644.55	5.21
非日常生活消费品	12,093,117.89	17.57
工业	3,154,914.53	4.58
金融	4,954,820.06	7.20
日常消费品	652,350.72	0.95
信息技术	2,249,237.05	3.27
医疗保健	5,663,171.43	8.23
原材料	445,662.05	0.65
合计	39,045,693.50	56.73

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	0700	腾讯控股	12,849	6,243,775.22	9.07
2	600519	贵州茅台	2,300	4,730,410.00	6.87
3	300750	宁德时代	7,600	4,064,480.00	5.91
4	2020	安踏体育	26,000	3,954,709.83	5.75
5	2359	药明康德	24,840	3,747,265.62	5.44
6	3690	美团-W	11,500	3,065,881.97	4.45
7	000333	美的集团	37,500	2,676,375.00	3.89
8	6098	碧桂园服务	36,000	2,513,214.43	3.65
9	000651	格力电器	43,000	2,240,300.00	3.26
10	601012	隆基股份	19,600	1,741,264.00	2.53

11	002475	立讯精密	37,499	1,724,954.00	2.51
12	601100	恒立液压	18,000	1,546,560.00	2.25
13	3380	龙光集团	148,000	1,430,977.90	2.08
14	002410	广联达	20,000	1,364,000.00	1.98
15	1211	比亚迪股份	6,500	1,255,858.34	1.82
16	2333	长城汽车	60,000	1,253,112.48	1.82
17	0939	建设银行	240,000	1,220,162.11	1.77
18	0241	阿里健康	80,000	1,146,273.41	1.67
19	6049	保利物业	25,000	1,096,265.40	1.59
20	1209	华润万象生活	24,000	1,061,401.25	1.54
21	6862	海底捞	30,000	1,020,962.16	1.48
22	2382	舜宇光学科技	5,000	1,020,962.16	1.48
23	601888	中国中免	3,300	990,330.00	1.44
24	1398	工商银行	254,000	963,748.34	1.40
25	0388	香港交易所	2,500	962,716.56	1.40
26	0200	新濠国际发展	75,000	889,909.56	1.29
27	2269	药明生物	6,500	769,632.40	1.12
28	6886	HTSC	80,000	758,856.96	1.10
29	3888	金山软件	17,000	658,466.51	0.96
30	000858	五粮液	2,200	655,358.00	0.95
31	2313	申洲国际	4,000	652,683.55	0.95
32	1876	百威亚太	32,000	652,350.72	0.95
33	1995	旭辉永升服务	40,000	641,700.10	0.93
34	3968	招商银行	11,000	606,378.30	0.88
35	600276	恒瑞医药	8,880	603,573.60	0.88
36	2013	微盟集团	40,000	569,808.38	0.83
37	002959	小熊电器	7,800	518,232.00	0.75
38	0914	海螺水泥	13,000	445,662.05	0.65
39	2318	中国平安	7,000	442,957.79	0.64
40	001207	联科科技	682	22,581.02	0.03
41	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02

## 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	1211	比亚迪股份	2,316,664.18	2.91
2	0241	阿里健康	2,187,897.13	2.74
3	2333	长城汽车	2,138,948.25	2.68
4	002410	广联达	1,608,763.00	2.02
5	2382	舜宇光学科技	1,350,125.96	1.69

6	6098	碧桂园服务	1,268,127.98	1.59
7	1995	旭辉永升服务	1,220,553.17	1.53
8	2359	药明康德	1,214,748.29	1.52
9	2013	微盟集团	1,200,187.62	1.51
10	2269	药明生物	984,930.66	1.24
11	601888	中国中免	961,333.00	1.21
12	0388	香港交易所	954,633.47	1.20
13	1209	华润万象生活	905,240.48	1.14
14	601012	隆基股份	753,520.00	0.95
15	0700	腾讯控股	748,464.04	0.94
16	601100	恒立液压	669,283.00	0.84
17	3888	金山软件	654,022.22	0.82
18	000858	五粮液	642,337.00	0.81
19	2313	申洲国际	618,730.25	0.78
20	3968	招商银行	613,051.92	0.77

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（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	2331	李宁	3,078,497.03	3.86
2	002271	东方雨虹	2,251,560.82	2.82
3	1995	旭辉永升服务	2,231,598.79	2.80
4	3690	美团-W	2,018,614.26	2.53
5	3888	金山软件	1,922,321.35	2.41
6	2269	药明生物	1,667,563.68	2.09
7	002410	广联达	1,596,841.39	2.00
8	2020	安踏体育	1,541,888.20	1.93
9	6862	海底捞	1,514,001.46	1.90
10	6098	碧桂园服务	1,443,021.39	1.81
11	0700	腾讯控股	1,314,519.03	1.65
12	300285	国瓷材料	1,260,986.00	1.58
13	601100	恒立液压	1,252,317.00	1.57
14	2313	申洲国际	1,249,753.95	1.57
15	603317	天味食品	1,200,481.00	1.51
16	2018	瑞声科技	992,924.59	1.25
17	1211	比亚迪股份	948,811.76	1.19
18	601012	隆基股份	880,800.00	1.11
19	000651	格力电器	864,098.00	1.08
20	1579	颐海国际	850,324.99	1.07

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（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

买入股票的成本（成交）总额	25,199,204.73
卖出股票的收入（成交）总额	39,931,106.77

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除腾讯控股(0700)的发行主体外，没有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。

主要违规事实：2021年3月12日，因存在腾讯控股有限公司收购猿辅导股权案构成未依法申

报违法实施的经营者集中，且本案不具有排除、限制竞争的效果的违规行为，国家市场监督管理总局对腾讯控股有限公司处以罚款的公开处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

**7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资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	20,599.58
2	应收证券清算款	505,097.72
3	应收股利	101,484.29
4	应收利息	1,550.57
5	应收申购款	59,993.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	688,725.34

### 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

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
博时沪港深价值优选 A	2,019	17,715.97	23,917,988.22	66.87%	11,850,553.85	33.13%

博时沪港深价值 优选 C	1,353	4,606.42	82.36	0.00%	6,232,399.71	100.00%
合计	3,292	12,758.51	23,918,070.58	56.95%	18,082,953.56	43.05%

## 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	博时沪港深价值优选 A	742,683.38	2.08%
	博时沪港深价值优选 C	149.30	0.00%
	合计	742,832.68	1.77%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时沪港深价值优选 A	-
	博时沪港深价值优选 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时沪港深价值优选 A	50~100
	博时沪港深价值优选 C	-
	合计	50~100

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时沪港深价值优选 A	博时沪港深价值优选 C
基金合同生效日（2017年1月25日）基金份额总额	166,963,804.69	89,956,557.61
本报告期期初基金份额总额	46,570,803.12	4,328,931.04
本报告期基金总申购份额	7,885,232.55	5,217,448.83
减：本报告期基金总赎回份额	18,687,493.60	3,313,897.80
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	35,768,542.07	6,232,482.07

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。



## 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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于 2021 年 2 月 6 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，高阳先生担任公司总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

## 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	
兴业证券	2	44,029,653.17	67.88%	34,612.21	68.36%	-
招商证券	2	1,603,670.00	2.47%	1,172.69	2.32%	新增 2 个
长江证券	2	19,230,007.88	29.65%	14,846.18	29.32%	新增 2 个

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、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。

2、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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通邮储银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-29
2	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-26
3	博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的交通银行、平安银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
4	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联支付提供的兴业银行、广发银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
5	博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
6	博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
7	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30
8	博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支	证券时报、基金管理人网	2021-03-20

	付提供的交通银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	站、证监会基金电子披露网站	
9	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210310	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210220	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20
11	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-06
12	博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-22

## § 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	2021-01-01~2021-06-30	30,663,220.61	-	15,000,000.00	15,663,220.61	37.29%
产品特有风险							
<p>本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。</p> <p>本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。</p> <p>在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基</p>							

金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

## 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

12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

12.1.2 《博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.1.5 博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本

12.1.6 报告期内博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司  
二〇二一年八月三十一日