

博时鑫润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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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.....	4
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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49

7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	54
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	博时鑫润混合	
基金主代码	003950	
交易代码	003950	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 7 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	322,544,634.85 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时鑫润混合 A	博时鑫润混合 C
下属分级基金的交易代码	003950	003951
报告期末下属分级基金的份额总额	27,776,647.40 份	294,767,987.45 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期持续稳定的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、其他资产投资策略三个部分。其中，资产配置策略主要是通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类之间进行相对稳定的适度配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手，根据对市场趋势的判断、宏观经济环境等因素，对成长与价值股的投资比例进行配置。总体而言，成长股与价值股在股票资产中进行相对均衡的配置，适度调整。以控制因风格带来的投资风险，降低组合波动的风险，提高整体收益率。其他资产投资策略有债券投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、存托凭证投资策略，其中，债券投资策略包括期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

### 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	博时基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	孙麒清	胡波
	联系电话	0755-83169999	021-61618888
	电子邮箱	service@bosera.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		95105568	95528
传真		0755-83195140	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	上海市北京东路 689 号
邮政编码		518040	200001
法定代表人		江向阳	郑杨

## 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）	
	博时鑫润混合 A	博时鑫润混合 C
本期已实现收益	2,629,787.02	27,711,469.83
本期利润	1,900,272.50	20,224,743.84
加权平均基金份额本期利润	0.0673	0.0677
本期加权平均净值利润率	4.79%	4.82%
本期基金份额净值增长率	4.99%	4.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	博时鑫润混合 A	博时鑫润混合 C
期末可供分配利润	6,276,797.98	65,892,521.00
期末可供分配基金份额利润	0.2260	0.2235

期末基金资产净值	39,319,335.09	416,504,788.31
期末基金份额净值	1.4156	1.4130
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	博时鑫润混合 A	博时鑫润混合 C
基金份额累计净值增长率	67.74%	67.50%

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

#### 博时鑫润混合 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	0.90%	0.27%	-0.91%	0.41%	1.81%	-0.14%
过去三个月	4.16%	0.32%	2.42%	0.49%	1.74%	-0.17%
过去六个月	4.99%	0.49%	1.47%	0.66%	3.52%	-0.17%
过去一年	24.75%	0.49%	14.21%	0.66%	10.54%	-0.17%
过去三年	58.17%	0.62%	32.81%	0.68%	25.36%	-0.06%
自基金合同生效起至今	67.74%	0.63%	36.63%	0.60%	31.11%	0.03%

#### 博时鑫润混合 C

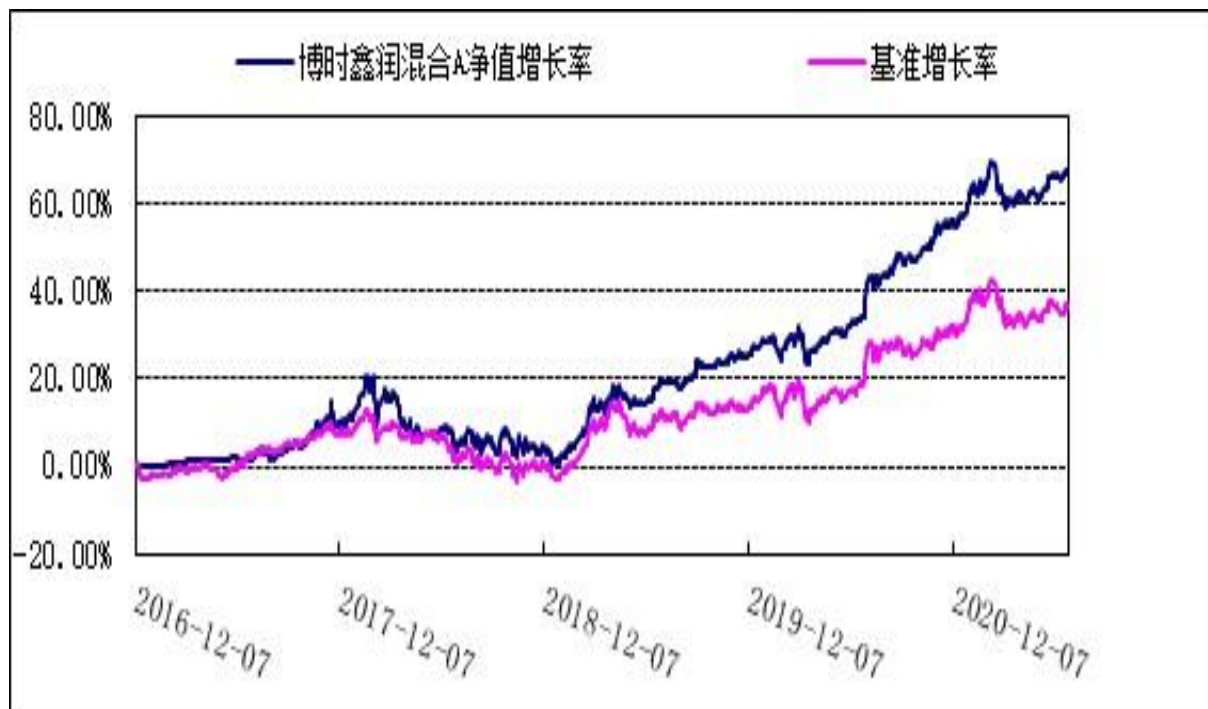
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.89%	0.27%	-0.91%	0.41%	1.80%	-0.14%
过去三个月	4.13%	0.32%	2.42%	0.49%	1.71%	-0.17%
过去六个月	4.93%	0.49%	1.47%	0.66%	3.46%	-0.17%
过去一年	24.61%	0.49%	14.21%	0.66%	10.40%	-0.17%
过去三年	57.68%	0.62%	32.81%	0.68%	24.87%	-0.06%
自基金合同生效起至今	67.50%	0.63%	36.63%	0.60%	30.87%	0.03%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50% + 中证综合债指数收益率×50%。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 50%、50% 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

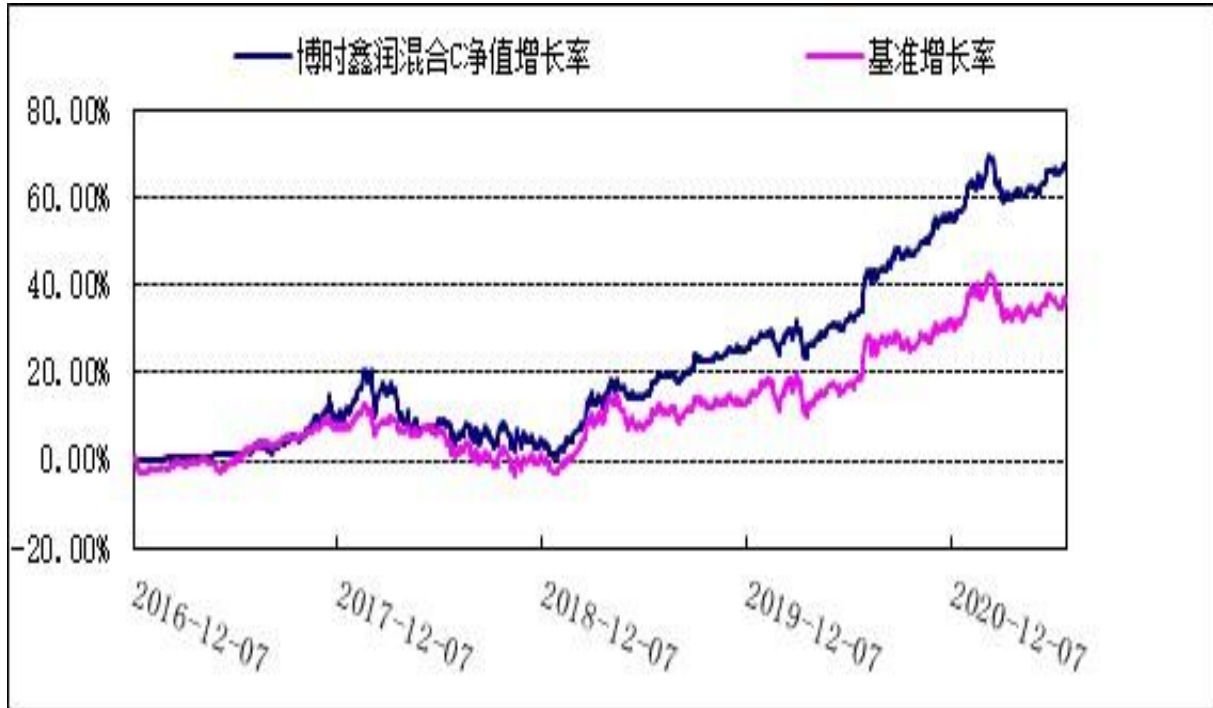
博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016 年 12 月 7 日至 2021 年 6 月 30 日)

#### 博时鑫润混合 A



#### 博时鑫润混合 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		
程卓	基金经理	2020-06-04	-	8.8	程卓先生，硕士。2008 年起先后在招商银行总行、诺安基金工作。2017 年加入博时基金管理有限公司。历任博

				<p>时安恒 18 个月定期开放债券型证券投资基金 (2018 年 4 月 2 日-2018 年 6 月 16 日)、博时安诚 18 个月定期开放债券型证券投资基金 (2018 年 5 月 28 日-2019 年 1 月 23 日)、博时聚源纯债债券型证券投资基金 (2018 年 3 月 15 日-2019 年 3 月 19 日)、博时汇享纯债债券型证券投资基金 (2018 年 3 月 15 日-2019 年 3 月 19 日)、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金 (2018 年 3 月 15 日-2019 年 8 月 22 日)、博时富宁纯债债券型证券投资基金 (2018 年 3 月 15 日-2021 年 2 月 5 日)、博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 (2018 年 4 月 23 日-2021 年 2 月 5 日)、博时富永纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 (2018 年 12 月 19 日-2021 年 2 月 5 日)、博时裕嘉纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 (2019 年 3 月 11 日-2021 年 2 月 5 日)、博时悦楚纯债债券型证券投资基金 (2019 年 6 月 4 日-2021 年 2 月 5 日) 的基金经理。现任博时富嘉纯债债券型证券投资基金 (2018 年 3 月 15 日一至今)、博时安誉 18 个月定期开放债券型证券投资基金 (2018 年 3 月 15 日一至今)、博时民泽纯债债券型证券投资基金 (2018 年 3 月 15 日一至今)、博时臻选纯债债券型证券投资基金 (2018 年 3 月 15 日一至今)、博时智臻纯债债券型证券投资基金 (2018 年 3 月 15 日一至今)、博时安泰 18 个月定期开放债券型证券投</p>
--	--	--	--	---

					资基金(2018年3月15日一至今)、博时景兴纯债债券型证券投资基金(2018年3月15日一至今)、博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)(2018年4月23日一至今)、博时安诚3个月定期开放债券型证券投资基金(2019年1月23日一至今)、博时富元纯债债券型证券投资基金(2019年2月25日一至今)、博时富诚纯债债券型证券投资基金(2019年3月4日一至今)、博时裕盈纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2019年3月11日一至今)、博时裕顺纯债债券型证券投资基金(2019年8月19日一至今)、博时安祺6个月定期开放债券型证券投资基金(2019年8月22日一至今)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2020年6月4日一至今)的基金经理。
李睿	高级研究员兼基金经理助理	2020-09-17	-	6.0	2015年7月博士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。曾任固定收益总部研究员,任固定收益总部高级研究员。现任固定收益总部高级研究员兼基金经理助理。

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,由于证券市场波动等原因,本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况,基金管理人在规定期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

### 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

上半年宏观景气度冲顶后逐步开始走弱，由于发达经济体成为疫情后的加杠杆主力，外需支撑国内基本面的韧性，国内继续紧信用的政策导向，严格约束地方城投平台和地产的加杠杆行为，而银行间流动性保持充裕，形成“宽货币、紧信用”的格局。这一格局下，企业盈利状况保持较为乐观，而市场的实际无风险利率下行，形成股债双牛的市场走势。

#### 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 1.4156 元，份额累计净值为 1.6185 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.4130 元，份额累计净值为 1.6160 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 4.99%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 4.93%，同期业绩基准增长率为 1.47%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，下半年经济景气度相比上半年有环比回落压力，但在出口的支撑下依旧将保持一定韧性。紧信用的政策风格还会延续，但流动性环境可能会在边际出现一定变化。从资产价格来看，无论权益市场的估值、还是债券市场对无风险收益率的定价，都暗含了对流动性比较乐观的预期，这一点在下半年可能出现的变化需要引起重视。权益上，我们认为机构重仓的各类高估值“茅”类标的依旧面临估值的回归过程，低估值、顺周期、以及符合十四五规划的高端制造业、芯片、新能源车等会有机会，其中 2 季度新能源车、芯片等已经出现比较明显的估值拔高过程，我们倾向于等待市场给予更好的估值介入机会。债券上，在当前宽货币紧信用的环境下收益率预计很难出现大幅的调整，我们会在市场波动中择机增加对组合久期的配置。

#### 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

本基金管理人于 2021 年 3 月 13 日发布公告，以 2021 年 3 月 5 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.6500 元人民币，

本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.6440 元人民币。

#### 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《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、托管协议的规定，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，本托管人依照《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、托管协议的规定，对博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由博时基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：博时鑫润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	3,551,456.22	3,227,348.85
结算备付金		9,382,721.48	5,500,476.19
存出保证金		21,696.97	38,158.46
交易性金融资产	6.4.3.2	313,963,320.25	321,371,172.96
其中：股票投资		145,114,504.55	175,628,578.76
基金投资		-	-
债券投资		168,848,815.70	145,742,594.20
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	126,800,000.00	140,000,000.00
应收证券清算款		982,703.06	818,357.43
应收利息	6.4.3.5	1,422,125.99	1,591,837.11
应收股利		-	-

应收申购款		85,835.92	59,347.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		456,209,859.89	472,606,698.89
<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		-	-
应付赎回款		20,631.14	36,901.31
应付管理人报酬		187,336.26	181,705.92
应付托管费		37,467.29	36,341.20
应付销售服务费		34,206.62	33,145.11
应付交易费用	6.4.3.7	10,215.59	4,788.18
应交税费		4,751.74	3,007.42
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	91,127.85	169,300.00
负债合计		385,736.49	465,189.14
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.3.9	322,544,634.85	334,596,640.39
未分配利润	6.4.3.10	133,279,488.55	137,544,869.36
所有者权益合计		455,824,123.40	472,141,509.75
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>456,209,859.89</b>	<b>472,606,698.89</b>

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 322,544,634.85 份。其中 A 类基金份额净值 1.4156 元，基金份额总额 27,776,647.40 份；C 类基金份额净值 1.4130 元，基金份额总额 294,767,987.45 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时鑫润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>		<b>23,953,002.87</b>	<b>11,307,430.01</b>
1. 利息收入		3,705,081.56	1,481,050.03
其中：存款利息收入	6.4.3.11	185,368.61	140,309.29

债券利息收入		2,403,321.05	770,460.26
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,116,391.90	570,280.48
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		28,459,531.69	11,699,216.80
其中：股票投资收益	6.4.3.12	27,396,910.10	9,705,274.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13.1	-36,585.18	340,688.89
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	1,099,206.77	1,653,253.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-8,216,240.51	-1,874,985.20
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	4,630.13	2,148.38
<b>减：二、费用</b>		1,827,986.53	990,727.51
1. 管理人报酬		1,141,014.26	557,204.79
2. 托管费		228,202.86	111,441.06
3. 销售服务费		208,507.95	109,970.63
4. 交易费用	6.4.3.18	144,147.29	103,005.66
5. 利息支出		-	8,077.49
其中：卖出回购金融资产支出		-	8,077.49
6. 税金及附加		2,520.40	474.43
7. 其他费用	6.4.3.19	103,593.77	100,553.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		22,125,016.34	10,316,702.50
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		22,125,016.34	10,316,702.50

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时鑫润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	334,596,640.39	137,544,869.36	472,141,509.75



金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,125,016.34	22,125,016.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-12,052,005.54	-5,999,373.53	-18,051,379.07
其中:1.基金申购款	33,918,508.98	13,962,558.86	47,881,067.84
2.基金赎回款	-45,970,514.52	-19,961,932.39	-65,932,446.91
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)	-	-20,391,023.62	-20,391,023.62
五、期末所有者权益(基金净值)	322,544,634.85	133,279,488.55	455,824,123.40
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)	197,551,452.22	34,306,835.23	231,858,287.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,316,702.50	10,316,702.50
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)	130,767,664.74	22,669,789.59	153,437,454.33
其中:1.基金申购款	171,941,794.64	30,129,738.44	202,071,533.08
2.基金赎回款	-41,174,129.90	-7,459,948.85	-48,634,078.75
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)	-	-5,514,260.01	-5,514,260.01
五、期末所有者权益(基金净值)	328,319,116.96	61,779,067.31	390,098,184.27

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: 佘方方

## 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[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	3,551,456.22
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	3,551,456.22	

#### 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	101,209,345.75	145,114,504.55	43,905,158.80
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	64,115,710.55	64,950,815.70
	银行间市场	103,441,250.86	103,898,000.00
	合计	167,556,961.41	168,848,815.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	268,766,307.16	313,963,320.25	45,197,013.09

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	126,800,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	126,800,000.00	-

##### 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	3,506.65
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	4,222.20
应收债券利息	1,381,913.46
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	32,473.98
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	9.70
合计	1,422,125.99

**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	10,215.59
银行间市场应付交易费用	-
合计	10,215.59

**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	4.99
应付证券出借违约金	-
预提费用	91,122.86
合计	91,127.85

**6.4.3.9 实收基金**
**博时鑫润混合 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	27,436,780.48	27,436,780.48
本期申购	1,917,096.10	1,917,096.10
本期赎回（以“-”号填列）	-1,577,229.18	-1,577,229.18
本期末	27,776,647.40	27,776,647.40

**博时鑫润混合 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	307,159,859.91	307,159,859.91
本期申购	32,001,412.88	32,001,412.88
本期赎回（以“-”号填列）	-44,393,285.34	-44,393,285.34
本期末	294,767,987.45	294,767,987.45

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**
**博时鑫润混合 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	5,407,622.47	5,930,370.42	11,337,992.89
本期利润	2,629,787.02	-729,514.52	1,900,272.50
本期基金份额交易产生的变动数	38,145.20	65,033.81	103,179.01
其中：基金申购款	379,051.23	358,802.34	737,853.57
基金赎回款	-340,906.03	-293,768.53	-634,674.56
本期已分配利润	-1,798,756.71	-	-1,798,756.71
本期末	6,276,797.98	5,265,889.71	11,542,687.69

**博时鑫润混合 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	59,873,278.04	66,333,598.43	126,206,876.47
本期利润	27,711,469.83	-7,486,725.99	20,224,743.84
本期基金份额交易产生的变动数	-3,099,959.96	-3,002,592.58	-6,102,552.54
其中：基金申购款	6,221,400.24	7,003,305.05	13,224,705.29
基金赎回款	-9,321,360.20	-10,005,897.63	-19,327,257.83
本期已分配利润	-18,592,266.91	-	-18,592,266.91
本期末	65,892,521.00	55,844,279.86	121,736,800.86

**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	111,372.52
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	72,596.69
其他	1,399.40
合计	185,368.61

#### 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	64,916,842.53
减：卖出股票成本总额	37,519,932.43
买卖股票差价收入	27,396,910.10

#### 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

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	114,272,750.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	112,283,806.40
减：应收利息总额	2,025,528.93
买卖债券差价收入	-36,585.18

##### 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	1,099,206.77
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	1,099,206.77

#### 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	-8,216,240.51
——股票投资	-9,144,390.88
——债券投资	928,150.37
——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	-8,216,240.51

#### 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	4,428.64
其他收入_转换费收入	201.49
合计	4,630.13

#### 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	143,497.29
银行间市场交易费用	650.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
债券交易费用	30.79
合计	144,147.29

#### 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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,170.91
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,600.00
合计	103,593.77

#### 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、基金注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

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	成交金额	占当期股票成交总额的



		额的比例		比例
招商证券	4,696,791.28	6.62%	-	-

#### 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

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	869,100,000.00	8.48%	-	-

#### 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	3,434.73	6.62%	3,434.73	33.62%
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 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	1,141,014.26	557,204.79
其中：支付销售机构的客户维护费	5,595.40	2,692.92

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 0.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 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	228,202.86	111,441.06

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 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		
	博时鑫润混合 A	博时鑫润混合 C	合计
博时基金	-	206,419.16	206,419.16
合计	-	206,419.16	206,419.16
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		
	博时鑫润混合 A	博时鑫润混合 C	合计
博时基金	-	108,865.19	108,865.19
合计	-	108,865.19	108,865.19

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 0.10% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 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**

无。

**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
浦发银行-活期存款	3,551,456.22	111,372.52	27,369,860.70	100,912.39

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**
**博时鑫润混合 A**

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日 (场外)	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发 放总额	再投资形式发 放总额	利润分配合计	备注
1	2021-03-16	2021-03-16	0.6500	96,276.55	1,702,480.16	1,798,756.71	-
合计			0.6500	96,276.55	1,702,480.16	1,798,756.71	-

**博时鑫润混合 C**

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日 (场外)	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发 放总额	再投资形式发 放总额	利润分配合计	备注
----	-------	-------------	-----------------------	--------------	---------------	--------	----

1	2021-03-16	2021-03-16	0.6440	7,277,048.67	11,315,218.24	18,592,266.91	-
合计			0.6440	7,277,048.67	11,315,218.24	18,592,266.91	-

#### 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

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 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
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	首次公开发行限售	2.65	5.67	907,763.00	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688686	奥普特	2020-12-24	2021-07-01	首次公开发行限售	78.49	451.00	1,398.00	109,729.02	630,498.00	-
688680	海优新材	2021-01-15	2021-07-22	首次公开发行限售	69.94	243.61	2,107.00	147,363.58	513,286.27	-
688383	新益昌	2021-04-21	2021-10-28	首次公开发行限售	19.58	106.24	2,701.00	52,885.58	286,954.24	-
688613	奥精医疗	2021-05-13	2021-11-22	首次公开发行限售	16.43	63.50	2,617.00	42,997.31	166,179.50	-
688201	信安世纪	2021-04-13	2021-10-21	首次公开发行限售	26.78	45.41	2,129.00	57,014.62	96,677.89	-
688216	气派科技	2021-06-15	2021-12-23	首次公开发行限售	14.82	47.64	2,000.00	29,640.00	95,280.00	-
688621	阳光诺和	2021-06-11	2021-12-21	首次公开发行限售	26.89	63.99	1,485.00	39,931.65	95,025.15	-

688329	艾隆科技	2021-03-16	2021-09-29	首次公开发行限售	16.81	50.04	1,846.00	31,031.26	92,373.84	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149.00	83,488.65	83,488.65	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	首次公开发行限售	47.33	251.96	260.00	12,305.80	65,509.60	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2022-01-05	首次公开发行限售	11.48	11.48	4,926.00	56,550.48	56,550.48	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	首次公开发行限售	24.60	163.00	342.00	8,413.20	55,746.00	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
688683	莱尔科技	2021-04-01	2021-10-12	首次公开发行限售	9.51	14.73	3,296.00	31,344.96	48,550.08	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
688395	正弦电气	2021-04-21	2021-10-29	首次公开发行限售	15.95	22.37	1,627.00	25,950.65	36,395.99	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行限售	33.22	87.50	403.00	13,387.66	35,262.50	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	首次公开发行限售	28.28	115.71	264.00	7,465.92	30,547.44	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-

300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	首次公开发行限售	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	首次公开发行限售	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	首次公开发行限售	21.31	49.94	399.00	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	首次公开发行限售	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	首次公开发行限售	48.59	90.39	189.00	9,183.51	17,083.71	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	首次公开发行限售	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	首次公开发行限售	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	首次公开发行限售	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	首次公开发行限售	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	首次公开发行限售	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢	2021-0	2021-1	首次	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-

	乐家	5-26	2-02	公开发 行限 售						
301002	崧盛 股份	2021-0 5-27	2021-1 2-07	首次 公开 发行 限售	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才 股份	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股 未上 市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨 家化	2021-0 3-16	2021-0 9-24	首次 公开 发行 限售	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联 软件	2021-0 5-26	2021-1 2-03	首次 公开 发行 限售	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300952	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	首次 公开 发行 限售	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
300966	共同 药业	2021-0 3-31	2021-1 0-11	首次 公开 发行 限售	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡 龙	2021-0 2-03	2021-0 8-10	首次 公开 发行 限售	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中 生态	2021-0 2-18	2021-0 8-25	首次 公开 发行 限售	8.67	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用 电梯	2021-0 1-13	2021-0 7-21	首次 公开 发行 限售	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水 海纳	2021-0 3-23	2021-0 9-30	首次 公开 发行 限售	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固	2021-0 2-24	2021-0 9-03	首次 公开	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-

	特			发行 限售						
605162	新 中 港	2021-0 6-29	2021-0 7-07	新股 未上 市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
300958	建 工 修 复	2021-0 3-18	2021-0 9-29	首次 公开 发行 限售	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
300978	东 箭 科 技	2021-0 4-15	2021-1 0-26	首次 公开 发行 限售	8.42	13.60	593.00	4,993.06	8,064.80	-
300926	博 俊 科 技	2020-1 2-29	2021-0 7-12	首次 公开 发行 限售	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹 通 新 材	2021-0 1-13	2021-0 7-21	首次 公开 发行 限售	13.11	24.48	322.00	4,221.42	7,882.56	-
300971	博 亚 精 工	2021-0 4-07	2021-1 0-15	首次 公开 发行 限售	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	-
300927	江 天 化 学	2020-1 2-29	2021-0 7-07	首次 公开 发行 限售	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
300975	商 络 电 子	2021-0 4-14	2021-1 0-21	首次 公开 发行 限售	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-
300963	中 洲 特 材	2021-0 3-30	2021-1 0-11	首次 公开 发行 限售	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	-
300985	致 远 新 能	2021-0 4-21	2021-1 0-29	首次 公开 发行 限售	24.90	24.81	242.00	6,025.80	6,004.02	-
301011	华 立 科 技	2021-0 6-09	2021-1 2-17	首次 公开 发行	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-



				限售						
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	首次公开发行限售	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	首次公开发行限售	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	首次公开发行限售	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	首次公开发行限售	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	首次公开发行限售	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	首次公开发行限售	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	首次公开发行限售	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	首次公开发行限售	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	首次公开发行限售	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	首次公开发行	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-

				限售						
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-
<b>6.4.8.1.2 受限证券类别：债券</b>										
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
149526	21广金01	2021-06-25	2021-07-07	新债未上市	100.00	100.00	50,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00	-
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	1,280.00	128,000.00	128,000.00	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股份自发行结束之日起12个月内不得转让；所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%(根据中国证监会《〈关于修改上市公司证券发行管理办法的决定〉〈关于修改创业板上市公司证券发行管理暂行办法的决定〉〈关于修改上市公司非公开发行股票实施细则的决定〉的立法说明》，基金持有的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股份，不适用上述减持规则的相关规定)；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。此外，基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

4、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

#### 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，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。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。本基金通过对多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期持续稳定的投资回报。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年末 2020 年 12 月 31 日
A-1	20,058,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	30,000,000.00	23,093,690.40
合计	50,058,000.00	23,093,690.40

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

#### 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	29,133,000.00	59,190,000.00
合计	29,133,000.00	59,190,000.00

#### 6.4.9.2.4 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	上年末 2020 年 12 月 31 日
AAA	64,395,733.90	38,278,798.70
AAA 以下	555,081.80	648,605.10
未评级	24,707,000.00	24,531,500.00
合计	89,657,815.70	63,458,903.80

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的中期票据、地方政府债。

#### 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同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	3,551,456.22	-	-	-	3,551,456.22
结算备付金	9,382,721.48	-	-	-	9,382,721.48
存出保证金	21,696.97	-	-	-	21,696.97
交易性金融资产	81,189,800.00	62,346,052.10	25,312,963.60	145,114,504.55	313,963,320.25
应收证券清算款	-	-	-	982,703.06	982,703.06
买入返售金融资产	126,800,000.00	-	-	-	126,800,000.00
应收利息	-	-	-	1,422,125.99	1,422,125.99
应收申购款	-	-	-	85,835.92	85,835.92
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>220,945,674.67</b>	<b>62,346,052.10</b>	<b>25,312,963.60</b>	<b>147,605,169.52</b>	<b>456,209,859.89</b>
<b>负债</b>					

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	20,631.14	20,631.14
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	187,336.26	187,336.26
应付托管费	-	-	-	37,467.29	37,467.29
应付销售服务费	-	-	-	34,206.62	34,206.62
应交税费	-	-	-	4,751.74	4,751.74
应付交易费用	-	-	-	10,215.59	10,215.59
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	91,127.85	91,127.85
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>385,736.49</b>	<b>385,736.49</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>220,945,674.67</b>	<b>62,346,052.10</b>	<b>25,312,963.60</b>	<b>147,219,433.03</b>	<b>455,824,123.40</b>
<b>上年度末</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>2020 年 12 月 31 日</b>					
<b>资产</b>					
银行存款	3,227,348.85	-	-	-	3,227,348.85
结算备付金	5,500,476.19	-	-	-	5,500,476.19
存出保证金	38,158.46	-	-	-	38,158.46
交易性金融资产	82,283,690.40	38,797,742.20	24,661,161.60	175,628,578.76	321,371,172.96
应收证券清算款	-	-	-	818,357.43	818,357.43
买入返售金融资产	140,000,000.00	-	-	-	140,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,591,837.11	1,591,837.11
应收申购款	-	-	-	59,347.89	59,347.89
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>231,049,673.90</b>	<b>38,797,742.20</b>	<b>24,661,161.60</b>	<b>178,098,121.19</b>	<b>472,606,698.89</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	36,901.31	36,901.31
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	181,705.92	181,705.92
应付托管费	-	-	-	36,341.20	36,341.20
应付销售服务费	-	-	-	33,145.11	33,145.11
应交税费	-	-	-	3,007.42	3,007.42
应付交易费用	-	-	-	4,788.18	4,788.18
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	169,300.00	169,300.00
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>465,189.14</b>	<b>465,189.14</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>231,049,673.90</b>	<b>38,797,742.20</b>	<b>24,661,161.60</b>	<b>177,632,932.05</b>	<b>472,141,509.75</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

假设	除市场利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. 市场利率下降 25 个基点	增加约 83	增加约 69
	2. 市场利率上升 25 个基点	减少约 82	减少约 68

#### 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。

#### 6.4.9.4.3 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	145,114,504.55	31.84	175,628,578.76	37.20
交易性金融资产—债券投资	7,850,015.70	1.72	7,091,203.80	1.50
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-



合计	152,964,520.25	33.56	182,719,782.56	38.70
----	----------------	-------	----------------	-------

注：1. 债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2. 其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下, 期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

#### 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 590	增加约 857
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 590	减少约 857

#### 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 141,677,977.73 元, 属于第二层次的余额为 172,285,342.52 元, 属于第三层次的余额为 0.00 元(上年度末: 第一层次 171,587,161.20 元, 第二层次 149,784,011.76 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	145,114,504.55	31.81
	其中：股票	145,114,504.55	31.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	168,848,815.70	37.01
	其中：债券	168,848,815.70	37.01
	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	126,800,000.00	27.79
	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	12,934,177.70	2.84
8	其他各项资产	2,512,361.94	0.55
9	合计	456,209,859.89	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	38,147.08	0.01
B	采矿业	792,307.91	0.17
C	制造业	94,288,109.36	20.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,149,984.29	1.57
E	建筑业	36,613.67	0.01
F	批发和零售业	859,457.94	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	3,329,181.23	0.73

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,983,969.96	0.65
J	金融业	30,342,825.86	6.66
K	房地产业	5,001,822.00	1.10
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	128,814.57	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	143,572.04	0.03
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	19,698.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	145,114,504.55	31.84

### 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	600519	贵州茅台	5,841	12,013,184.70	2.64
2	002594	比亚迪	32,191	8,079,941.00	1.77
3	689009	九号公司	85,552	7,282,186.24	1.60
4	000568	泸州老窖	30,700	7,243,358.00	1.59
5	000858	五粮液	20,608	6,138,917.12	1.35
6	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	1.13
7	601318	中国平安	75,850	4,875,638.00	1.07
8	000001	平安银行	157,352	3,559,302.24	0.78
9	601166	兴业银行	162,607	3,341,573.85	0.73
10	000002	万科 A	139,800	3,328,638.00	0.73
11	600276	恒瑞医药	47,923	3,257,326.31	0.71
12	600309	万华化学	29,183	3,175,694.06	0.70
13	000651	格力电器	59,760	3,113,496.00	0.68
14	000538	云南白药	26,654	3,084,400.88	0.68
15	002142	宁波银行	77,655	3,026,215.35	0.66
16	000333	美的集团	41,600	2,968,992.00	0.65
17	002415	海康威视	39,900	2,573,550.00	0.56
18	002304	洋河股份	11,200	2,320,640.00	0.51
19	600585	海螺水泥	56,098	2,302,822.90	0.51
20	601658	邮储银行	434,668	2,182,033.36	0.48
21	000596	古井贡酒	8,400	2,011,800.00	0.44
22	600036	招商银行	36,600	1,983,354.00	0.44
23	601816	京沪高铁	354,825	1,877,024.25	0.41
24	600887	伊利股份	49,900	1,837,817.00	0.40
25	002460	赣锋锂业	15,000	1,816,350.00	0.40

26	000063	中兴通讯	49,500	1,644,885.00	0.36
27	600660	福耀玻璃	28,770	1,606,804.50	0.35
28	601995	中金公司	25,043	1,540,144.50	0.34
29	000895	双汇发展	47,700	1,516,860.00	0.33
30	601398	工商银行	291,235	1,505,684.95	0.33
31	000513	丽珠集团	30,055	1,503,351.10	0.33
32	603733	仙鹤股份	37,522	1,425,836.00	0.31
33	002202	金风科技	116,800	1,420,288.00	0.31
34	601939	建设银行	212,599	1,413,783.35	0.31
35	600048	保利地产	115,500	1,390,620.00	0.31
36	601229	上海银行	167,373	1,372,458.60	0.30
37	601211	国泰君安	67,141	1,150,796.74	0.25
38	600900	长江电力	51,696	1,067,005.44	0.23
39	300003	乐普医疗	33,100	1,063,172.00	0.23
40	601006	大秦铁路	157,571	1,036,817.18	0.23
41	000807	云铝股份	83,600	994,840.00	0.22
42	601688	华泰证券	60,701	959,075.80	0.21
43	601601	中国太保	31,388	909,310.36	0.20
44	600886	国投电力	94,592	909,029.12	0.20
45	600741	华域汽车	31,200	819,624.00	0.18
46	000963	华东医药	17,400	800,574.00	0.18
47	688356	键凯科技	2,433	799,240.50	0.18
48	002736	国信证券	73,200	786,900.00	0.17
49	601088	中国神华	40,051	781,795.52	0.17
50	002230	科大讯飞	11,400	770,412.00	0.17
51	688200	华峰测控	1,596	755,434.68	0.17
52	601916	浙商银行	163,078	647,419.66	0.14
53	688686	奥普特	1,398	630,498.00	0.14
54	601077	渝农商行	148,111	590,962.89	0.13
55	688180	君实生物	7,239	587,879.19	0.13
56	300919	中伟股份	3,412	556,156.00	0.12
57	688256	寒武纪	3,998	552,523.60	0.12
58	000338	潍柴动力	30,113	538,119.31	0.12
59	600104	上汽集团	23,505	516,404.85	0.11
60	688680	海优新材	2,107	513,286.27	0.11
61	002001	新和成	17,640	505,915.20	0.11
62	688561	奇安信	5,374	496,073.94	0.11
63	002008	大族激光	12,100	488,719.00	0.11
64	600030	中信证券	18,463	460,467.22	0.10
65	002236	大华股份	21,000	443,100.00	0.10
66	000425	徐工机械	66,000	420,420.00	0.09
67	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.09
68	002624	完美世界	16,950	405,274.50	0.09

69	002120	韵达股份	28,500	385,605.00	0.08
70	002422	科伦药业	18,900	377,055.00	0.08
71	000401	冀东水泥	30,100	371,735.00	0.08
72	600066	宇通客车	29,717	371,165.33	0.08
73	688777	中控技术	3,766	354,568.90	0.08
74	002007	华兰生物	8,600	315,448.00	0.07
75	688383	新益昌	2,701	286,954.24	0.06
76	002146	荣盛发展	50,100	282,564.00	0.06
77	688606	奥泰生物	1,622	241,678.00	0.05
78	300896	爱美客	290	228,775.20	0.05
79	688095	福昕软件	886	224,414.94	0.05
80	300911	亿田智能	3,083	213,590.24	0.05
81	688079	美迪凯	10,622	208,509.86	0.05
82	300999	金龙鱼	2,211	187,846.56	0.04
83	688093	世华科技	4,595	182,697.20	0.04
84	000999	华润三九	6,769	181,070.75	0.04
85	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.04
86	688378	奥来德	2,411	155,750.60	0.03
87	688418	震有科技	6,178	122,262.62	0.03
88	300918	南山智尚	10,626	110,616.66	0.02
89	300922	天秦装备	2,863	99,718.29	0.02
90	688678	福立旺	4,198	99,492.60	0.02
91	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.02
92	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.02
93	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.02
94	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.02
95	688560	明冠新材	3,832	92,351.20	0.02
96	300950	德固特	2,186	89,334.49	0.02
97	300920	润阳科技	2,503	84,301.04	0.02
98	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
99	300957	贝泰妮	260	65,509.60	0.01
100	300869	康泰医学	862	61,046.84	0.01
101	300943	春晖智控	2,542	59,955.10	0.01
102	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
103	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
104	688683	莱尔科技	3,296	48,550.08	0.01
105	300910	瑞丰新材	446	46,629.30	0.01
106	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
107	300861	美畅股份	525	44,262.75	0.01
108	003026	中晶科技	461	43,384.71	0.01
109	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
110	688679	通源环境	3,139	41,372.02	0.01
111	300867	圣元环保	1,334	40,433.54	0.01

112	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.01
113	003009	中天火箭	623	36,183.84	0.01
114	300871	回盛生物	927	36,153.00	0.01
115	300979	华利集团	403	35,262.50	0.01
116	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
117	300887	谱尼测试	378	33,789.42	0.01
118	300872	天阳科技	871	31,617.30	0.01
119	300973	立高食品	264	30,547.44	0.01
120	300870	欧陆通	478	29,884.56	0.01
121	003031	中瓷电子	542	29,647.40	0.01
122	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
123	605296	神农集团	569	26,856.80	0.01
124	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
125	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.01
126	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
127	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
128	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.00
129	300873	海晨股份	484	20,720.04	0.00
130	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
131	300891	惠云钛业	1,143	19,876.77	0.00
132	300860	锋尚文化	338	19,698.64	0.00
133	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
134	003006	百亚股份	804	19,054.80	0.00
135	605122	四方新材	703	18,770.10	0.00
136	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
137	300864	南大环境	315	17,328.15	0.00
138	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
139	300981	中红医疗	189	17,083.71	0.00
140	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
141	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
142	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
143	300868	杰美特	501	15,335.61	0.00
144	003015	日久光电	1,128	14,551.20	0.00
145	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
146	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
147	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
148	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
149	300907	康平科技	473	13,915.66	0.00
150	605169	洪通燃气	951	13,913.13	0.00
151	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
152	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
153	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
154	300937	药易购	244	13,105.24	0.00

155	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
156	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
157	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
158	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
159	300889	爱克股份	479	11,639.70	0.00
160	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
161	300876	蒙泰高新	350	11,567.50	0.00
162	300879	大叶股份	466	11,267.88	0.00
163	605303	园林股份	610	11,242.30	0.00
164	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
165	003003	天元股份	756	10,765.44	0.00
166	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
167	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
168	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
169	300383	光环新网	700	10,073.00	0.00
170	300882	万胜智能	572	9,981.40	0.00
171	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
172	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
173	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
174	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
175	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
176	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
177	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
178	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
179	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
180	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
181	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
182	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
183	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
184	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
185	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
186	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
187	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
188	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
189	300886	华业香料	191	6,194.13	0.00
190	300985	致远新能	242	6,004.02	0.00
191	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
192	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
193	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
194	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
195	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
196	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
197	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00

198	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
199	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
200	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
201	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
202	300059	东方财富	91	2,983.89	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	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.73
2	600036	招商银行	1,994,370.00	0.42
3	002202	金风科技	999,730.00	0.21
4	000002	万科 A	999,631.00	0.21
5	603733	仙鹤股份	999,459.96	0.21
6	000807	云铝股份	998,817.98	0.21
7	688538	和辉光电	258,878.50	0.05
8	688606	奥泰生物	216,812.74	0.05
9	688680	海优新材	147,363.58	0.03
10	688317	之江生物	143,533.62	0.03
11	300979	华利集团	133,610.84	0.03
12	688083	中望软件	126,119.00	0.03
13	300957	贝泰妮	122,821.35	0.03
14	688183	生益电子	122,349.42	0.03
15	688425	铁建重工	120,026.27	0.03
16	688079	美迪凯	108,238.18	0.02
17	688276	百克生物	104,288.15	0.02
18	688161	威高骨科	102,611.26	0.02
19	688619	罗普特	102,130.59	0.02
20	301009	可靠股份	100,407.78	0.02

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	600519	贵州茅台	5,450,476.00	1.15
2	000568	泸州老窖	3,275,934.00	0.69
3	002594	比亚迪	2,850,217.00	0.60



4	000858	五粮液	2,538,553.65	0.54
5	600905	三峡能源	1,929,250.20	0.41
6	601166	兴业银行	1,789,216.00	0.38
7	600276	恒瑞医药	1,701,724.20	0.36
8	000333	美的集团	1,661,548.00	0.35
9	600309	万华化学	1,630,671.00	0.35
10	000538	云南白药	1,576,788.00	0.33
11	000001	平安银行	1,479,299.00	0.31
12	002142	宁波银行	1,398,273.00	0.30
13	000002	万科 A	1,379,511.00	0.29
14	600585	海螺水泥	1,275,575.00	0.27
15	601658	邮储银行	1,120,182.00	0.24
16	000895	双汇发展	978,802.00	0.21
17	002415	海康威视	959,596.00	0.20
18	002304	洋河股份	948,042.00	0.20
19	600887	伊利股份	940,806.00	0.20
20	000596	古井贡酒	857,609.00	0.18

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	16,150,249.10
卖出股票的收入（成交）总额	64,916,842.53

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

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	74,717,000.00	16.39
	其中：政策性金融债	54,707,000.00	12.00
4	企业债券	37,090,800.00	8.14
5	企业短期融资券	20,058,000.00	4.40
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,850,015.70	1.72
8	同业存单	29,133,000.00	6.39
9	其他	-	-
10	合计	168,848,815.70	37.04

## 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	200406	20 农发 06	300,000	30,000,000.00	6.58
2	112103030	21 农业银行 CD030	300,000	29,133,000.00	6.39
3	042100115	21 长电 CP002	200,000	20,058,000.00	4.40
4	200210	20 国开 10	200,000	19,352,000.00	4.25
5	175965	21 国投 01	100,000	10,048,000.00	2.20

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除 20 农发 06(200406)、21 农业银行 CD030(112103030)、20 国开 10(200210)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 6 月 15 日，因存在一、项目调查审查不尽职；二、未能通过有效的内控措施发现并纠正员工违规保管客户物品的行为的违规行为，中国银保监会浙江监管局对中国农业发展银行浙江省分行处以罚款的处罚。

主要违规事实：2021 年 1 月 19 日，因存在 1、发生重要信息系统突发事件未报告 2、制卡数据违规明文留存 3、生产网络、分行无线互联网络保护不当 4、数据安全较粗放，存在数据泄露风险 5、网络信息系统存在较多漏洞 6、互联网门户网站泄露敏感信息等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司处以罚款的处罚。

主要违规事实：2021 年 1 月 15 日，因存在项目融资业务管理严重违反审慎经营规则的违规行为，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对国家开发银行北京分行处以罚款的行政处罚。

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	21,696.97
2	应收证券清算款	982,703.06
3	应收股利	-
4	应收利息	1,422,125.99
5	应收申购款	85,835.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,512,361.94

### 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	132015	18 中油 EB	3,067,500.00	0.67

2	110053	苏银转债	2,455,112.80	0.54
3	132018	G 三峡 EB1	737,536.80	0.16
4	132014	18 中化 EB	139,775.40	0.03
5	113545	金能转债	131,730.80	0.03
6	127025	冀东转债	96,273.00	0.02
7	113021	中信转债	82,344.60	0.02
8	132022	20 广版 EB	70,189.00	0.02
9	128085	鸿达转债	69,669.60	0.02
10	128081	海亮转债	56,855.00	0.01
11	110062	烽火转债	46,824.80	0.01
12	110060	天路转债	45,519.60	0.01
13	128057	博彦转债	38,179.60	0.01
14	113025	明泰转债	33,737.40	0.01
15	110061	川投转债	32,747.50	0.01
16	113528	长城转债	27,758.40	0.01
17	113030	东风转债	25,364.40	0.01
18	113534	鼎胜转债	24,093.60	0.01
19	110057	现代转债	23,480.10	0.01
20	110055	伊力转债	21,148.60	0.00
21	128100	搜特转债	20,337.50	0.00
22	113026	核能转债	20,088.70	0.00
23	128064	司尔转债	14,421.60	0.00
24	128062	亚药转债	13,696.90	0.00
25	123023	迪森转债	12,863.50	0.00
26	113024	核建转债	12,296.40	0.00
27	123022	长信转债	8,865.60	0.00
28	110052	贵广转债	8,096.80	0.00
29	113034	滨化转债	1,728.20	0.00
30	127023	华菱转 2	1,325.60	0.00
31	110067	华安转债	1,074.20	0.00
32	127006	敖东转债	1,014.70	0.00

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	1.13	首次公开发行限售

#### 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
博时鑫润混合 A	430	64,596.85	26,846,380.20	96.65%	930,267.20	3.35%
博时鑫润混合 C	716	411,687.13	292,258,146.10	99.15%	2,509,841.35	0.85%
合计	1,114	289,537.37	319,104,526.30	98.93%	3,440,108.55	1.07%

### 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	博时鑫润混合 A	13,264.58	0.05%
	博时鑫润混合 C	9.94	0.00%
	合计	13,274.52	0.00%

### 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

- 1、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。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时鑫润混合 A	博时鑫润混合 C
基金合同生效日(2016年12月7日)基金份额总额	200,346,178.87	86,615.66
本报告期期初基金份额总额	27,436,780.48	307,159,859.91
本报告期基金总申购份额	1,917,096.10	32,001,412.88
减：本报告期基金总赎回份额	1,577,229.18	44,393,285.34
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	27,776,647.40	294,767,987.45

## § 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	
华泰证券	2	66,212,060.19	93.38%	48,422.85	93.38%	-
招商证券	2	4,696,791.28	6.62%	3,434.73	6.62%	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，本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、个股分析的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
华泰证券	30,082,780.01	100.00%	9,380,700,000.00	91.52%	-	-
招商证券	-	-	869,100,000.00	8.48%	-	-

### 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	博时鑫润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	博时鑫润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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
9	博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金分红公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-13

		网站	
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-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
11	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
12	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
13	博时鑫润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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时鑫润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 博时鑫润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 报告期内博时鑫润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