

申万菱信价值优利混合型证券投资基金
2021 年中期报告
2021 年 6 月 30 日

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：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。

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

| | |
|--|----|
| 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 6 |
| 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 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..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 12 |
| 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 13 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 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..... | 17 |
| 7 投资组合报告 | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 35 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 36 |
| 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..... | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 40 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 44 |
| 8 基金份额持有人信息 | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 45 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 45 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 46 |
| 9 开放式基金份额变动 | 46 |
| 10 重大事件揭示 | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 46 |
| 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 | 46 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 46 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 46 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 46 |
| 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 | 46 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 46 |
| 10.8 其他重大事件 | 47 |
| 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 47 |
| 12 备查文件目录 | 47 |
| 12.1 备查文件目录 | 47 |
| 12.2 存放地点 | 48 |
| 12.3 查阅方式 | 48 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 基金名称 | 申万菱信价值优利混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 申万菱信价值优利混合 |
| 基金主代码 | 004951 |
| 交易代码 | 004951 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年9月21日 |
| 基金管理人 | 申万菱信基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 112,337,425.14 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金采用数量化的投资方法精选个股，严格按照纪律执行，力争获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金采用数量化技术对投资策略进行优化，将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数的设定体现在数量模型中，坚持以数量化的方式进行投资，充分发挥数量化投资的优势，保持投资策略的一致性与有效性。 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 |

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 | | 申万菱信基金管理有限公司 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 王菲萍 | 罗菲菲 |
| | 联系电话 | 021-23261188 | 010-58560666 |
| | 电子邮箱 | service@swsmu.com | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008808588 | 95568 |
| 传真 | | 021-23261199 | 010-58560798 |
| 注册地址 | | 上海市中山南路100号11层 | 北京市西城区复兴门内大街2号 |
| 办公地址 | | 上海市中山南路100号11层 | 北京市西城区复兴门内大街2号 |
| 邮政编码 | | 200010 | 100031 |
| 法定代表人 | | 刘郎 | 高迎欣 |

注：2021年7月1日起，申万菱信基金管理有限公司法定代表人变更为陈晓升，原法定代表人刘郎达法定退休年龄。

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.swsmu.com |
| 基金中期报告备置地点 | 申万菱信基金管理有限公司 中国民生银行股份有限公司 |

2.5 其他相关资料

| | | |
|--------|--------------|-----------------------|
| 项目 | 名称 | 办公地址 |
| 注册登记机构 | 申万菱信基金管理有限公司 | 上海市中山南路 100 号 10、11 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） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 11,881,374.82 |
| 本期利润 | 1,595,107.20 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0106 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.61% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.26% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 61,001,925.14 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5430 |
| 期末基金资产净值 | 200,630,062.12 |
| 期末基金份额净值 | 1.7860 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 78.59% |

注：1、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。

2、上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认/申购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认/申购或交易基金的各项费用后，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

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标 | ①—③ | ②—④ |
|----|----------|------------|------------|------------|-----|-----|
|----|----------|------------|------------|------------|-----|-----|

| | | ② | | 准差④ | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一个月 | 2.24% | 0.82% | 0.94% | 0.55% | 1.30% | 0.27% |
| 过去三个月 | 6.24% | 0.92% | 6.93% | 0.51% | -0.69% | 0.41% |
| 过去六个月 | 3.26% | 1.35% | 5.84% | 0.75% | -2.58% | 0.60% |
| 过去一年 | 33.37% | 1.31% | 13.04% | 0.93% | 20.33% | 0.38% |
| 过去三年 | 90.65% | 1.31% | 28.24% | 1.10% | 62.41% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 78.59% | 1.26% | 7.70% | 1.08% | 70.89% | 0.18% |

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{benchmark}(0) = 1000;$$

$$\% \text{benchmark}(t) = 75\% * (\text{中证 500 指数}(t) / \text{中证 500 指数}(t-1) - 1) + 25\% * (\text{中证综合债指数}(t) / \text{中证综合债指数}(t-1) - 1);$$

$$\text{benchmark}(t) = (1 + \% \text{benchmark}(t)) * \text{benchmark}(t-1) ;$$

其中 $t=1,2,3,\dots$ 。

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

申万菱信价值优利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 9 月 21 日至 2021 年 6 月 30 日)



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

申万菱信基金管理有限公司(SWS MU Fund Management Co.,Ltd)成立于 2004 年 1 月 15 日,公司总部设在上海,注册资本 1.5 亿元,净资产超过 10 亿元。

申万菱信基金自成立以来,始终将持有人的利益放在首位,秉持“研究至善”的愿景、“长期致胜”的使命,遵循“诚于心、行于矩、敏于变”的企业价值观。近年来,申万菱信基金围绕市场和客户需求,逐渐形成“投资美好生活、创新理财服务”的产品规划;通过努力打造“美好生活”系列权益产品,不断丰富“全市场、宽基指数与增强、主题指数、量化对冲、固收+、另类投资和纯固收”等产品大类,致力于为持有人提供“温暖陪伴”的产品服务,以努力达成“长期致胜”的使命。公司现有开放式公募基金 54 只,资产管理总规模超过 1100 亿元,产品累计分红 144 亿元(数据截至 2021 年 6 月 30 日)。

近年来,申万菱信基金通过建设关键假设平台(Key Assumption Platform),推动“研究数字化”;通过基金经理的风格开发、稳定和优化,推动“投资风格化”;通过风险管理工作的关口前移,加强市场风险管理支持,推动“风控全流程”,从而不断建设申万菱信基金的“机构理性”,以提升投资业绩。此外,申万菱信基金还持续打造卓越战略与产品管理体系(Excellent Strategy & Product)、卓越品牌与客户服务体系(Excellent Branding & Service),提升面向不同类别客户的全方位专业服务水平。

申万菱信基金股东实力雄厚,中央汇金公司控股的申万宏源证券持有公司 67%的股份,日本三菱 UFJ 信托银行持有公司 33%的股份。申万菱信基金拥有公开募集证券投资基金管理人、特定客户资产管理人、合格境内机构投资者(QDII)管理人、保险资金投资管理人等业务资格,并全资设立申万菱信(上海)资产管理有限公司,专门从事特定客户资产管理业务和专项资产管理业务。公司曾多次荣获中国基金业金牛奖、中国明星基金奖、中国金基金奖等多项业内重量级奖项以及东方财富“最佳指数投资团队”等荣誉。

展望未来,申万菱信基金将紧紧依托双方股东优势,不断深化体制机制改革,以更加市场化的导向推动专业队伍的全方位发展,努力将公司打造成为一家优秀乃至卓越的资产管理机构。

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 | | |
| 俞诚 | 本基金 基金经 | 2020-04-15 | - | 11 年 | 俞诚先生,经济学学士、2009 年起从事金融相关工作,2009 年 08 |

| | | | | |
|--|---|--|--|--|
| | 理 | | | 月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任产品与金融工程总部金融工程师、数量研究员，申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信价值优享混合型证券投资基金、申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)基金经理，现任申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金、申万菱信量化驱动混合型证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、申万菱信价值优利混合型证券投资基金、申万菱信创业板量化精选股票型证券投资基金基金经理。 |
|--|---|--|--|--|

注：1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2.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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，信息披露及时、准确、完整；本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开；没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为，并通过稳健经营、规范运作、

规避风险，保护了基金持有人的合法权益。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易办法》，通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本公司建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；另外，公司还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部，实行了集中交易制度和公平的交易分配制度：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事前审核，确保交易得到公平和公允的执行。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后

分析评估上，风险管理部在每个季度和每年度的《公平交易执行报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控与报告办法》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期，未发生我司旗下投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况以及其他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 年上半年，全球经济企稳回升。美债收益率上行，市场对核心资产 1-2 个季度内难有超额收益形成了一致预期。在今年春节期间，美债利率上行提高贴现率中枢，机构抱团市场风格瓦解，基金重仓方向出现普遍回调。事实上，全球经济是在波折中复苏。国外疫情还是有所反复，延缓经济复苏速度，但是不影响复苏方向。随着经济复苏、PPI 上行，商品价格上行带来周期行业投资机会，疫情反复带来医药、出口行业投资机会。当前 A 股总体估值并不高，面临的主要矛盾仍是部分领域估值高企的结构性问题，而非总体性的。抱团之外的资产值得深入挖掘，顺周期与中小盘风格是风格切换当中值得深入挖掘的方向。2021 年上半年，上证指数上涨 3.4%，深证成份指数上涨 4.78%，沪深 300 指数上涨 0.24%，而中证 500 指数上涨 6.93%，中小板指数上涨 3.66%，创业板指数上涨 17.22%，显示小盘风格占优。

本基金采用的量化模型仍然秉持以合理价格买入优质成长公司的主要选股逻辑。未来，本基金将力争控制跟踪误差和偏离度在基金合同的允许范围内，最大化的提升基金风险收益比率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内净值表现为 3.26%，同期业绩基准表现为 5.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年流动性充裕，下半年随着经济复苏，股市结构性机会可能转向周期行业。全球经济是在波折中复苏。国外疫情还是有所反复，延缓经济复苏速度。充裕的流动性推动股价上涨，尤其是受疫情影响较小的互联网、医药、消费等板块。随着疫情缓解、经济恢复，商品价格上行带来周期行业投资机会。下半年流动性将边际收紧，财政政策有望发力，股市的结构性机会将可能转向周期性行业。

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、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，上述各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人按照有关法规确定的原则进行估值，将导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，即就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性征求本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所的意见。本基金聘请的会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人设立资产估值委员会，负责根据法规要求，尽可能科学、合理地制定估值政策，审议批准估值程序，并在特定状态下就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性进行确认，以保护基金份额持有人的利益。

资产估值委员会由本基金管理人分管基金运营的副总经理，督察长，分管基金投资的副总经理，基金运营部、监察稽核部、风险管理部负责人组成。其中，分管基金运营的副总经理张丽红女士，拥有 17 年的基金行业运营、财务管理相关经验；督察长王菲萍女士，拥有 17 年的基金行业合规管理经验；分管基金投资的副总经理周小波先生，拥有 15 年的证券基金投资研究管理相关经验；基金运营部负责人严嘉惠先生，拥有 14 年的基金会计经验；法律合规与审计部（原名“监察稽核部”）总监何一鸣先生，拥有 8 年的基金行业合规管理经验；风险管理部负责人葛诚亮先生，拥有 10 年的基金行业风险管理经验。

基金经理不参与决定本基金估值的程序。本公司已与中央国债登记结算有限责任公司签订协议，采用其提供的估值数据对银行间债券进行估值；采用中证指数有限公司提供的估值数据对交易所债券进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：申万菱信价值优利混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | - | - |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 13,686,308.29 | 27,118,271.08 |
| 结算备付金 | | 374,176.43 | 725,412.70 |
| 存出保证金 | | 173,058.55 | 233,637.07 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 189,032,083.01 | 271,056,275.71 |
| 其中：股票投资 | | 189,000,183.01 | 270,825,335.81 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 31,900.00 | 230,939.90 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |

| | | | |
|-------------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 1,120,746.03 | 517,575.70 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 1,729.37 | 3,700.70 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 3,441.16 | 515.23 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 204,391,542.84 | 299,655,388.19 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负 债: | | - | - |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 3,020,937.29 | - |
| 应付赎回款 | | 352.15 | 8,141,159.68 |
| 应付管理人报酬 | | 186,389.65 | 309,402.54 |
| 应付托管费 | | 15,532.46 | 25,783.56 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 452,478.42 | 543,839.01 |
| 应交税费 | | 0.09 | 0.74 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 85,790.66 | 173,540.30 |
| 负债合计 | | 3,761,480.72 | 9,193,725.83 |
| 所有者权益: | | - | - |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 112,337,425.14 | 167,934,644.57 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 88,292,636.98 | 122,527,017.79 |
| 所有者权益合计 | | 200,630,062.12 | 290,461,662.36 |
| 负债和所有者权益总计 | | 204,391,542.84 | 299,655,388.19 |

注: 报告截止日 2021 年 6 月 30 日, 申万菱信价值优利混合型证券投资基金份额净值 1.7860 元, 基金份额总额 112,337,425.14 份。

6.2 利润表

会计主体: 申万菱信价值优利混合型证券投资基金

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|-----|----|---------|
|----|-----|----|---------|

| | | 2021年1月1日至 2021年6月30日 | 2020年1月1日至2020 年6月30日 |
|----------------------------|----------|--------------------------|--------------------------|
| 一、收入 | | 5,467,744.06 | 25,285,081.70 |
| 1.利息收入 | 7.4.7.11 | 60,025.35 | 70,207.37 |
| 其中：存款利息收入 | | 60,011.15 | 70,207.37 |
| 债券利息收入 | | 14.20 | - |
| 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） | | 15,656,955.69 | 22,660,264.87 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 14,193,742.55 | 20,758,113.04 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 122,188.03 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 1,341,025.11 | 1,902,151.83 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -10,286,267.62 | 2,539,561.45 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 37,030.64 | 15,048.01 |
| 减：二、费用 | | 3,872,636.86 | 2,554,697.57 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,579,598.97 | 1,438,700.72 |
| 2. 托管费 | | 131,633.30 | 119,891.72 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 2,073,506.48 | 907,939.10 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.税金及附加 | | 0.05 | - |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.19 | 87,898.06 | 88,166.03 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,595,107.20 | 22,730,384.13 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,595,107.20 | 22,730,384.13 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信价值优利混合型证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| | |

| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|--|----------------------|----------------|-----------------|
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 167,934,644.57 | 122,527,017.79 | 290,461,662.36 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,595,107.20 | 1,595,107.20 |
| 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） | -55,597,219.43 | -35,829,488.01 | -91,426,707.44 |
| 其中：1.基金申购款 | 44,897,639.27 | 35,129,044.51 | 80,026,683.78 |
| 2.基金赎回款 | -100,494,858.70 | -70,958,532.52 | -171,453,391.22 |
| 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） | 112,337,425.14 | 88,292,636.98 | 200,630,062.12 |
| 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） | 227,543,836.97 | 46,197,285.95 | 273,741,122.92 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 22,730,384.13 | 22,730,384.13 |
| 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） | -74,721,744.48 | -17,108,325.23 | -91,830,069.71 |
| 其中：1.基金申购款 | 20,872,494.76 | 4,381,838.65 | 25,254,333.41 |
| 2.基金赎回款 | -95,594,239.24 | -21,490,163.88 | -117,084,403.12 |
| 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） | 152,822,092.49 | 51,819,344.85 | 204,641,437.34 |

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：汪涛，主管会计工作负责人：张丽红，会计机构负责人：严嘉惠

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

申万菱信价值优利混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]848号《关于准予申万菱信价值优利混合型证券投资基金注册的批复》核准,由申万菱信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万菱信价值优利混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 225,857,451.27 元。经向中国证监会备案,《申万菱信价值优利混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 225,886,769.96 份基金份额,其中认购资金利息折合 29,318.69 份基金份额。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《申万菱信价值优利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票)、权证、股指期货、国债期货、股票期权、债券(含国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、地方政府债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单及现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资业务。基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例不低于 50%;其中,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金,存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 \times 75%+中证综合债指数收益率 \times 25%。

本财务报表由本基金的基金管理人申万菱信基金管理有限公司于 2021 年 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投

资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本报告期，本基金未发生会计差错更正事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局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 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。

(e)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。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 13,686,308.29 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 13,686,308.29 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | |
|----|------------------------|----------------|--------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 179,896,750.97 | 189,000,183.01 | 9,103,432.04 |

| | | | |
|---------------|----------------|----------------|--------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 31,900.00 | 31,900.00 |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | 31,900.00 | 31,900.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 179,928,650.97 | 189,032,083.01 | 9,103,432.04 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,481.89 |
| 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 | 167.90 |
| 应收债券利息 | 1.68 |
| 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 | 77.90 |
| 合计 | 1,729.37 |

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 452,478.42 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 452,478.42 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 0.28 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 85,790.38 |
| 合计 | 85,790.66 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 167,934,644.57 | 167,934,644.57 |
| 本期申购 | 44,897,639.27 | 44,897,639.27 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -100,494,858.70 | -100,494,858.70 |
| 本期末 | 112,337,425.14 | 112,337,425.14 |

注：本期申购含转换转入份额，本期赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 79,125,490.46 | 43,401,527.33 | 122,527,017.79 |
| 本期利润 | 11,881,374.82 | -10,286,267.62 | 1,595,107.20 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -30,004,940.14 | -5,824,547.87 | -35,829,488.01 |
| 其中：基金申购款 | 24,775,685.64 | 10,353,358.87 | 35,129,044.51 |
| 基金赎回款 | -54,780,625.78 | -16,177,906.74 | -70,958,532.52 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 61,001,925.14 | 27,290,711.84 | 88,292,636.98 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 51,044.98 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 7,257.38 |
| 其他 | 1,708.79 |
| 合计 | 60,011.15 |

6.4.7.12 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 | 711,266,909.94 |
| 减：卖出股票成本总额 | 697,073,167.39 |
| 买卖股票差价收入 | 14,193,742.55 |

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 253,333.60 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 131,000.00 |
| 减：应收利息总额 | 145.57 |
| 买卖债券差价收入 | 122,188.03 |

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 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 | 1,341,025.11 |
| 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 | 1,341,025.11 |

6.4.7.16 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 | -10,286,267.62 |
| ——股票投资 | -10,186,327.72 |
| ——债券投资 | -99,939.90 |
| ——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 | -10,286,267.62 |

6.4.7.17 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 | 25,617.94 |
| 转换费收入 | 11,412.70 |
| 合计 | 37,030.64 |

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中不低于赎回费部分的 50% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 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 | 2,073,506.48 |
| 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 | 2,073,506.48 |

6.4.7.19 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 | 26,283.01 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 2,107.68 |
| 合计 | 87,898.06 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------------|---------------------------|
| 申万菱信基金管理有限公司 | 基金管理人 基金销售机构 基金注册 登记机构 |
| 申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源”） | 基金管理人的股东 基金代销机构 |
| 三菱 UFJ 信托银行株式会社 | 基金管理人的股东 |
| 中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”） | 基金托管人 |
| 申万菱信（上海）资产管理有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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 |
| 申万宏源 | 1,330,373,174.84 | 100.00% | 551,847,459.04 | 100.00% |

6.4.10.1.2 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 |
| 申万宏源 | 1,227,391.93 | 100.00% | 452,478.42 | 100.00% |
| 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 |
| 申万宏源 | 509,203.23 | 100.00% | 268,139.09 | 100.00% |

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

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

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月 30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,579,598.97 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,690.47 | 75,721.40 |

注：支付基金管理人申万菱信的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 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 | 131,633.30 | 119,891.72 |

注：支付基金托管人中国民生银行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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 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 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 13,686,308.29 | 51,044.98 | 13,747,536.10 | 66,985.50 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 605162 | 新中港 | 2021-06-29 | 2021-07-07 | 新股待上市 | 6.07 | 6.07 | 1,377.00 | 8,358.39 | 8,358.39 | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股待上市 | 31.56 | 31.56 | 349.00 | 11,014.44 | 11,014.44 | - |
| 300614 | 百川畅银 | 2021-05-18 | 2021-11-25 | 限售期股票 | 9.19 | 49.61 | 329.00 | 3,023.51 | 16,321.69 | - |
| 300926 | 博俊科技 | 2020-12-29 | 2021-07-12 | 限售期股票 | 10.76 | 22.16 | 359.00 | 3,862.84 | 7,955.44 | - |
| 300927 | 江天化学 | 2020-12-29 | 2021-07-07 | 限售期股票 | 13.39 | 30.08 | 217.00 | 2,905.63 | 6,527.36 | - |
| 300929 | 华骐环保 | 2021-01-12 | 2021-07-21 | 限售期股票 | 13.87 | 29.53 | 183.00 | 2,538.21 | 5,403.99 | - |
| 300930 | 屹通新材 | 2021-01-13 | 2021-07-21 | 限售期股票 | 13.11 | 24.47 | 322.00 | 4,221.42 | 7,879.34 | - |
| 300931 | 通用电梯 | 2021-01-13 | 2021-07-21 | 限售期股票 | 4.31 | 13.10 | 672.00 | 2,896.32 | 8,803.20 | - |
| 300932 | 三友联众 | 2021-01-15 | 2021-07-22 | 限售期股票 | 24.69 | 31.70 | 438.00 | 10,814.22 | 13,884.60 | - |
| 300933 | 中辰股份 | 2021-01-15 | 2021-07-22 | 限售期股票 | 3.37 | 10.44 | 1,112.00 | 3,747.44 | 11,609.28 | - |
| 300940 | 南极光 | 2021-01-27 | 2021-08-03 | 限售期股票 | 12.76 | 43.35 | 307.00 | 3,917.32 | 13,308.45 | - |
| 300941 | 创识科技 | 2021-02-02 | 2021-08-09 | 限售期股票 | 21.31 | 49.91 | 399.00 | 8,502.69 | 19,914.09 | - |
| 300942 | 易瑞生物 | 2021-02-02 | 2021-08-09 | 限售期股票 | 5.31 | 28.49 | 443.00 | 2,352.33 | 12,621.07 | - |
| 300943 | 春晖智控 | 2021-02-03 | 2021-08-10 | 限售期股票 | 9.79 | 23.00 | 255.00 | 2,496.45 | 5,865.00 | - |
| 300945 | 曼卡龙 | 2021-02-03 | 2021-08-10 | 限售期股票 | 4.56 | 18.87 | 474.00 | 2,161.44 | 8,944.38 | - |
| 300948 | 冠中生态 | 2021-02-18 | 2021-08-25 | 限售期股票 | 8.67 | 27.39 | 324.00 | 2,808.00 | 8,874.36 | - |
| 300950 | 德固特 | 2021-02-24 | 2021-09-03 | 限售期股票 | 8.41 | 39.12 | 219.00 | 1,841.79 | 8,567.28 | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021-03-03 | 2021-09-13 | 限售期股票 | 11.72 | 27.07 | 340.00 | 3,984.80 | 9,203.80 | - |
| 300953 | 震裕科技 | 2021-03-11 | 2021-09-20 | 限售期股票 | 28.77 | 99.89 | 240.00 | 6,904.80 | 23,973.60 | - |
| 300955 | 嘉亨家化 | 2021-03-16 | 2021-09-24 | 限售期股票 | 16.53 | 46.05 | 232.00 | 3,834.96 | 10,683.60 | - |
| 300956 | 英力股份 | 2021-03-16 | 2021-09-27 | 限售期股票 | 12.85 | 25.80 | 371.00 | 4,767.35 | 9,571.80 | - |
| 300957 | 贝泰妮 | 2021-03-18 | 2021-09-27 | 限售期股票 | 47.33 | 252.43 | 194.00 | 9,182.02 | 48,971.42 | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021-03-22 | 2021-09-29 | 限售期股票 | 12.08 | 23.06 | 234.00 | 2,826.72 | 5,396.04 | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021-03-23 | 2021-09-30 | 限售期股票 | 8.48 | 22.07 | 394.00 | 3,341.12 | 8,695.58 | - |
| 300963 | 中洲特材 | 2021-03-30 | 2021-10-11 | 限售期股票 | 12.13 | 27.73 | 283.00 | 3,432.79 | 7,847.59 | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021-03-31 | 2021-10-11 | 限售期股票 | 8.24 | 39.25 | 286.00 | 2,356.64 | 11,225.50 | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021-04-02 | 2021-10-13 | 限售期股票 | 4.54 | 15.34 | 507.00 | 2,301.78 | 7,777.38 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|-------|-------|--------|----------|-----------|------------|---|
| 300968 | 格林精密 | 2021-04-06 | 2021-10-15 | 限售期股票 | 6.87 | 14.98 | 1,123.00 | 7,715.01 | 16,822.54 | - |
| 300971 | 博亚精工 | 2021-04-07 | 2021-10-15 | 限售期股票 | 18.24 | 33.37 | 245.00 | 4,468.80 | 8,175.65 | - |
| 300972 | 万辰生物 | 2021-04-08 | 2021-10-19 | 限售期股票 | 7.19 | 16.20 | 430.00 | 3,091.70 | 6,966.00 | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021-04-08 | 2021-10-15 | 限售期股票 | 28.28 | 145.09 | 264.00 | 7,465.92 | 38,303.76 | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021-04-14 | 2021-10-21 | 限售期股票 | 5.48 | 17.07 | 492.00 | 2,696.16 | 8,398.44 | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021-04-15 | 2021-10-26 | 限售期股票 | 8.42 | 16.77 | 593.00 | 4,993.06 | 9,944.61 | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021-04-15 | 2021-10-26 | 限售期股票 | 33.22 | 105.33 | 375.00 | 12,457.50 | 39,498.75 | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021-04-19 | 2021-10-27 | 限售期股票 | 48.59 | 106.28 | 232.00 | 11,272.88 | 24,656.96 | - |
| 300982 | 苏文电能 | 2021-04-19 | 2021-10-27 | 限售期股票 | 15.83 | 50.96 | 317.00 | 5,018.11 | 16,154.32 | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021-04-21 | 2021-10-29 | 限售期股票 | 24.90 | 27.29 | 274.00 | 6,822.60 | 7,477.46 | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021-04-21 | 2021-11-01 | 限售期股票 | 14.79 | 37.23 | 264.00 | 3,904.56 | 9,828.72 | - |
| 300987 | 川网传媒 | 2021-04-28 | 2021-11-11 | 限售期股票 | 6.79 | 34.76 | 301.00 | 2,043.79 | 10,462.76 | - |
| 300991 | 创益通 | 2021-05-12 | 2021-11-22 | 限售期股票 | 13.06 | 34.14 | 254.00 | 3,317.24 | 8,671.56 | - |
| 300992 | 泰福泵业 | 2021-05-17 | 2021-11-25 | 限售期股票 | 9.36 | 26.89 | 200.00 | 1,872.00 | 5,378.00 | - |
| 300993 | 玉马遮阳 | 2021-05-17 | 2021-11-24 | 限售期股票 | 12.10 | 23.23 | 410.00 | 4,961.00 | 9,524.30 | - |
| 300996 | 普联软件 | 2021-05-26 | 2021-12-03 | 限售期股票 | 20.81 | 50.60 | 231.00 | 4,807.11 | 11,688.60 | - |
| 300997 | 欢乐家 | 2021-05-26 | 2021-12-02 | 限售期股票 | 4.94 | 17.26 | 867.00 | 4,282.98 | 14,964.42 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021-05-25 | 2021-12-02 | 限售期股票 | 6.02 | 28.50 | 201.00 | 1,210.02 | 5,728.50 | - |
| 301002 | 崧盛股份 | 2021-05-27 | 2021-12-07 | 限售期股票 | 18.71 | 76.32 | 201.00 | 3,760.71 | 15,340.32 | - |
| 301007 | 德迈仕 | 2021-06-04 | 2021-12-16 | 限售期股票 | 5.29 | 19.12 | 303.00 | 1,602.87 | 5,793.36 | - |
| 301009 | 可靠股份 | 2021-06-08 | 2021-12-17 | 限售期股票 | 12.54 | 31.22 | 461.00 | 5,780.94 | 14,392.42 | - |
| 301010 | 晶雪节能 | 2021-06-09 | 2021-12-20 | 限售期股票 | 7.83 | 22.61 | 218.00 | 1,706.94 | 4,928.98 | - |
| 301011 | 华立科技 | 2021-06-09 | 2021-12-17 | 限售期股票 | 14.20 | 44.02 | 175.00 | 2,485.00 | 7,703.50 | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021-06-30 | 2021-07-09 | 限售期股票 | 21.96 | 21.96 | 1,925.00 | 42,273.00 | 42,273.00 | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021-06-28 | 2021-07-07 | 新股待上市 | 6.42 | 6.42 | 2,693.00 | 17,289.06 | 17,289.06 | - |
| 688097 | 博众精工 | 2021-04-29 | 2021-11-12 | 限售期股票 | 11.27 | 30.45 | 3,983.00 | 44,888.41 | 121,282.35 | - |
| 688260 | 昀冢科技 | 2021-03-25 | 2021-10-08 | 限售期股票 | 9.63 | 19.43 | 2,990.00 | 28,793.70 | 58,095.70 | - |
| 688316 | 青云科技 | 2021-03-05 | 2021-09-16 | 限售期股票 | 63.70 | 64.98 | 1,396.00 | 88,925.20 | 90,712.08 | - |
| 688663 | 新风光 | 2021-04-06 | 2021-10-13 | 限售期股票 | 14.48 | 20.36 | 3,279.00 | 47,479.92 | 66,760.44 | - |

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|------------|--------|--------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 123117 | 健帆转债 | 2021-06-23 | 2021-07-12 | 未上市转债 | 100.00 | 100.00 | 319.00 | 31,900.00 | 31,900.00 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。

本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本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。

本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务而产生。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行或其他国内大中型商业银行，本基金管理人认为与以上银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成债券等投资品种的交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小，本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过事前检查和控制交易对手信用及交割方式来管理风险。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过对其投资品种的信用等级评估来选择适当的

投资对象来管理。于本期末，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02%（上期末：0.08%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

本基金管理人已经建立涵盖制度、流程、组织架构、制衡机制、风险处置等方面的流动性风险管控体系；建立以压力测试为核心、覆盖全类型产品的基金流动性风险监测与预警制度及风险应对预案。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人已经建立针对公募基金申购赎回状况的监控和预测机制以及建立了巨额赎回审批规程，对于巨额赎回建立严格的流动性评估机制；此外，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对资产的流动性风险，本基金管理人持续监控和预测旗下基金的各项流动性指标，包括组合持仓集中度指标、投资组合在短时间内变现能力的综合指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和流通受限资产的总量控制，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制投资组合的投资流动性风险。

除了上述日常流动性管理机制外，本基金管理人已建立压力测试制度，针对不同类型投资组合建立流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影响。此外，本基金管理人已建立流动性风险应急机制，一旦发生或认为可能发生较大的流动性风险，本基金管理人会立即启动相应的应急流程。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金

的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具、银行存款和结算备付金，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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%。

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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于本期末，除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购证券款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息（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。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果、流动性风险管理措施的实施以及本基金的资产和负债情况，本基金管理人认为本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。

于本期末，本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营

活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------------|---------------|--------|----------|-------|------------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 13,686,308.29 | - | - | - | - | - | 13,686,308.29 |
| 结算备付金 | 374,176.43 | - | - | - | - | - | 374,176.43 |
| 存出保证金 | 173,058.55 | - | - | - | - | - | 173,058.55 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | 31,900.00 | 189,000,183.01 | 189,032,083.01 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 1,120,746.03 | 1,120,746.03 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,729.37 | 1,729.37 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 3,441.16 | 3,441.16 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 14,233,543.27 | - | - | - | 31,900.00 | 190,126,099.57 | 204,391,542.84 |
| 负债 | | | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 3,020,937.29 | 3,020,937.29 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 352.15 | 352.15 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 186,389.65 | 186,389.65 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 15,532.46 | 15,532.46 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 452,478.42 | 452,478.42 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 0.09 | 0.09 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 85,790.66 | 85,790.66 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 3,761,480.72 | 3,761,480.72 |
| 利率敏感度缺口 | 14,233,543.27 | - | - | - | 31,900.00 | 186,364,618.85 | 200,630,062.12 |
| 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 27,118,271.08 | - | - | - | - | - | 27,118,271.08 |
| 结算备付金 | 725,412.70 | - | - | - | - | - | 725,412.70 |
| 存出保证金 | 233,637.07 | - | - | - | - | - | 233,637.07 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | 230,939.90 | 270,825,335.81 | 271,056,275.71 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|-----------|---------------|---|---|---|--------------|----------------|
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | 517,575.70 | 517,575.70 |
| 应收利息 | - | - | - | - | 3,700.70 | 3,700.70 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 515.23 | 515.23 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 28,077,320.85 | - | - | - | 230,939.90 | 271,347,127.44 |
| 负债 | | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 8,141,159.68 | 8,141,159.68 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 309,402.54 | 309,402.54 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 25,783.56 | 25,783.56 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 543,839.01 | 543,839.01 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 0.74 | 0.74 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | 173,540.30 | 173,540.30 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 9,193,725.83 | 9,193,725.83 |
| 利率敏感度缺口 | 28,077,320.85 | - | - | - | 230,939.90 | 262,153,401.61 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.02%（上期末：0.08%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

基金的其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金的市场价格风险主要来源于本基金投资的股权和债权工具的未来价格可能受到一般市场波动或是其他影响个别股权工具价值的特定风险影响。由于本基金是一只中高风险的混合型证券投资基金，

股票投资占基金资产的比例不低于 50%，所以存在一定的其他价格风险。

本基金管理人通过采用数量化技术对投资策略进行优化，将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数的设定体现在数量模型中，坚持以数量化的方式进行投资。

此外，本基金管理人在构建基金资产配置和资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差以及运用多种定量的方法对基金进行风险度量，来测试基金的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制，争取将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 189,000,183.01 | 94.20 | 270,825,335.81 | 93.24 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 189,000,183.01 | 94.20 | 270,825,335.81 | 93.24 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 以中证 500 指数为基准衡量其他价格风险 | | |
|----|-----------------------|------------------------------|--------------------------|
| | 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 |
| | 基准上升 5% | 增加约 1,200 | 增加约 1,115 |
| | 基准下降 5% | 减少约 1,200 | 减少约 1,115 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

一、本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公

允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2021 年 6 月 30 日，属于第一层次的公允价值计量为 187,983,767.78 元；属于第二层次的公允价值为 1,048,315.23 元。

(a)第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

(b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

二、其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

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 | 189,000,183.01 | 92.47 |
| | 其中：股票 | 189,000,183.01 | 92.47 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 31,900.00 | 0.02 |
| | 其中：债券 | 31,900.00 | 0.02 |
| | 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 | 14,060,484.72 | 6.88 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,298,975.11 | 0.64 |
| 9 | 合计 | 204,391,542.84 | 100.00 |

注：本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

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 | 249,386.94 | 0.12 |
| B | 采矿业 | 2,573,586.00 | 1.28 |
| C | 制造业 | 115,964,078.25 | 57.80 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,517,168.39 | 1.25 |
| E | 建筑业 | 1,462,634.76 | 0.73 |
| F | 批发和零售业 | 728,968.82 | 0.36 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,708,898.00 | 1.35 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 8,148,256.53 | 4.06 |
| J | 金融业 | 40,013,761.20 | 19.94 |
| K | 房地产业 | 1,317,104.00 | 0.66 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,461,873.00 | 1.23 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,660,292.00 | 2.82 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 136,708.86 | 0.07 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 4,007,886.26 | 2.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,049,580.00 | 0.52 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 189,000,183.01 | 94.20 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

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 | 3,100.00 | 6,375,770.00 | 3.18 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 117,500.00 | 6,367,325.00 | 3.17 |
| 3 | 603259 | 药明康德 | 31,200.00 | 4,885,608.00 | 2.44 |
| 4 | 603659 | 璞泰来 | 35,280.00 | 4,819,248.00 | 2.40 |
| 5 | 600132 | 重庆啤酒 | 22,400.00 | 4,434,080.00 | 2.21 |
| 6 | 300124 | 汇川技术 | 53,450.00 | 3,969,197.00 | 1.98 |
| 7 | 601838 | 成都银行 | 310,900.00 | 3,929,776.00 | 1.96 |
| 8 | 600809 | 山西汾酒 | 8,200.00 | 3,673,600.00 | 1.83 |
| 9 | 601318 | 中国平安 | 55,100.00 | 3,541,828.00 | 1.77 |
| 10 | 601211 | 国泰君安 | 206,000.00 | 3,530,840.00 | 1.76 |
| 11 | 600000 | 浦发银行 | 347,900.00 | 3,479,000.00 | 1.73 |
| 12 | 000333 | 美的集团 | 48,556.00 | 3,465,441.72 | 1.73 |
| 13 | 002311 | 海大集团 | 41,200.00 | 3,361,920.00 | 1.68 |
| 14 | 002812 | 恩捷股份 | 13,500.00 | 3,160,350.00 | 1.58 |
| 15 | 000725 | 京东方 A | 493,400.00 | 3,078,816.00 | 1.53 |
| 16 | 600600 | 青岛啤酒 | 25,400.00 | 2,937,510.00 | 1.46 |
| 17 | 300496 | 中科创达 | 18,400.00 | 2,889,904.00 | 1.44 |
| 18 | 000661 | 长春高新 | 7,300.00 | 2,825,100.00 | 1.41 |
| 19 | 002271 | 东方雨虹 | 50,200.00 | 2,777,064.00 | 1.38 |
| 20 | 600887 | 伊利股份 | 74,300.00 | 2,736,469.00 | 1.36 |
| 21 | 002049 | 紫光国微 | 17,600.00 | 2,713,744.00 | 1.35 |
| 22 | 601919 | 中远海控 | 88,700.00 | 2,708,898.00 | 1.35 |
| 23 | 601377 | 兴业证券 | 276,100.00 | 2,667,126.00 | 1.33 |
| 24 | 000301 | 东方盛虹 | 126,500.00 | 2,643,850.00 | 1.32 |
| 25 | 600438 | 通威股份 | 61,100.00 | 2,643,797.00 | 1.32 |
| 26 | 601328 | 交通银行 | 526,900.00 | 2,581,810.00 | 1.29 |
| 27 | 002179 | 中航光电 | 32,329.00 | 2,554,637.58 | 1.27 |
| 28 | 600019 | 宝钢股份 | 328,300.00 | 2,508,212.00 | 1.25 |
| 29 | 600900 | 长江电力 | 121,325.00 | 2,504,148.00 | 1.25 |
| 30 | 002142 | 宁波银行 | 61,700.00 | 2,404,449.00 | 1.20 |
| 31 | 000568 | 泸州老窖 | 10,000.00 | 2,359,400.00 | 1.18 |
| 32 | 300408 | 三环集团 | 54,000.00 | 2,290,680.00 | 1.14 |
| 33 | 002230 | 科大讯飞 | 32,400.00 | 2,189,592.00 | 1.09 |
| 34 | 601799 | 星宇股份 | 9,500.00 | 2,144,340.00 | 1.07 |
| 35 | 688396 | 华润微 | 23,285.00 | 2,119,400.70 | 1.06 |
| 36 | 600031 | 三一重工 | 72,700.00 | 2,113,389.00 | 1.05 |
| 37 | 002241 | 歌尔股份 | 48,800.00 | 2,085,712.00 | 1.04 |
| 38 | 600085 | 同仁堂 | 50,700.00 | 2,071,095.00 | 1.03 |
| 39 | 603799 | 华友钴业 | 18,000.00 | 2,055,600.00 | 1.02 |
| 40 | 600436 | 片仔癀 | 4,400.00 | 1,972,520.00 | 0.98 |
| 41 | 300015 | 爱尔眼科 | 27,487.00 | 1,951,027.26 | 0.97 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|------------|--------------|------|
| 42 | 601319 | 中国人保 | 294,300.00 | 1,745,199.00 | 0.87 |
| 43 | 002415 | 海康威视 | 26,100.00 | 1,683,450.00 | 0.84 |
| 44 | 600690 | 海尔智家 | 64,608.00 | 1,673,993.28 | 0.83 |
| 45 | 688111 | 金山办公 | 4,207.00 | 1,660,923.60 | 0.83 |
| 46 | 002129 | 中环股份 | 42,800.00 | 1,652,080.00 | 0.82 |
| 47 | 300529 | 健帆生物 | 18,816.00 | 1,624,949.76 | 0.81 |
| 48 | 603986 | 兆易创新 | 8,600.00 | 1,615,940.00 | 0.81 |
| 49 | 002841 | 视源股份 | 12,900.00 | 1,603,341.00 | 0.80 |
| 50 | 603517 | 绝味食品 | 19,000.00 | 1,601,510.00 | 0.80 |
| 51 | 600999 | 招商证券 | 84,090.00 | 1,599,391.80 | 0.80 |
| 52 | 002475 | 立讯精密 | 34,455.00 | 1,584,930.00 | 0.79 |
| 53 | 603501 | 韦尔股份 | 4,900.00 | 1,577,800.00 | 0.79 |
| 54 | 601899 | 紫金矿业 | 161,400.00 | 1,563,966.00 | 0.78 |
| 55 | 002920 | 德赛西威 | 13,200.00 | 1,453,056.00 | 0.72 |
| 56 | 601618 | 中国中冶 | 481,700.00 | 1,435,466.00 | 0.72 |
| 57 | 600309 | 万华化学 | 13,000.00 | 1,414,660.00 | 0.71 |
| 58 | 601601 | 中国太保 | 47,500.00 | 1,376,075.00 | 0.69 |
| 59 | 600111 | 北方稀土 | 65,800.00 | 1,362,060.00 | 0.68 |
| 60 | 300628 | 亿联网络 | 16,000.00 | 1,340,800.00 | 0.67 |
| 61 | 601888 | 中国中免 | 4,400.00 | 1,320,440.00 | 0.66 |
| 62 | 601012 | 隆基股份 | 14,700.00 | 1,305,948.00 | 0.65 |
| 63 | 600845 | 宝信软件 | 24,810.00 | 1,262,829.00 | 0.63 |
| 64 | 600426 | 华鲁恒升 | 40,300.00 | 1,247,285.00 | 0.62 |
| 65 | 000625 | 长安汽车 | 47,000.00 | 1,235,160.00 | 0.62 |
| 66 | 000063 | 中兴通讯 | 37,150.00 | 1,234,494.50 | 0.62 |
| 67 | 600109 | 国金证券 | 95,700.00 | 1,214,433.00 | 0.61 |
| 68 | 600015 | 华夏银行 | 194,900.00 | 1,206,431.00 | 0.60 |
| 69 | 000157 | 中联重科 | 130,415.00 | 1,205,034.60 | 0.60 |
| 70 | 601009 | 南京银行 | 114,200.00 | 1,201,384.00 | 0.60 |
| 71 | 300122 | 智飞生物 | 6,400.00 | 1,195,072.00 | 0.60 |
| 72 | 000069 | 华侨城 A | 160,200.00 | 1,191,888.00 | 0.59 |
| 73 | 002027 | 分众传媒 | 121,300.00 | 1,141,433.00 | 0.57 |
| 74 | 000001 | 平安银行 | 49,300.00 | 1,115,166.00 | 0.56 |
| 75 | 300014 | 亿纬锂能 | 10,600.00 | 1,101,658.00 | 0.55 |
| 76 | 688363 | 华熙生物 | 3,861.00 | 1,072,817.46 | 0.53 |
| 77 | 603882 | 金域医学 | 6,700.00 | 1,070,459.00 | 0.53 |
| 78 | 002493 | 荣盛石化 | 61,750.00 | 1,066,422.50 | 0.53 |
| 79 | 300413 | 芒果超媒 | 15,300.00 | 1,049,580.00 | 0.52 |
| 80 | 601225 | 陕西煤业 | 85,200.00 | 1,009,620.00 | 0.50 |
| 81 | 600763 | 通策医疗 | 2,400.00 | 986,400.00 | 0.49 |
| 82 | 603806 | 福斯特 | 8,500.00 | 893,605.00 | 0.45 |
| 83 | 300012 | 华测检测 | 24,300.00 | 774,684.00 | 0.39 |
| 84 | 300059 | 东方财富 | 23,600.00 | 773,844.00 | 0.39 |
| 85 | 600176 | 中国巨石 | 48,893.00 | 758,330.43 | 0.38 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|------------|------------|------|
| 86 | 600655 | 豫园股份 | 61,400.00 | 711,626.00 | 0.35 |
| 87 | 601066 | 中信建投 | 19,800.00 | 622,314.00 | 0.31 |
| 88 | 600660 | 福耀玻璃 | 11,100.00 | 619,935.00 | 0.31 |
| 89 | 603833 | 欧派家居 | 4,103.00 | 582,461.88 | 0.29 |
| 90 | 300595 | 欧普康视 | 5,500.00 | 569,525.00 | 0.28 |
| 91 | 601169 | 北京银行 | 115,000.00 | 560,050.00 | 0.28 |
| 92 | 002064 | 华峰化学 | 30,200.00 | 428,840.00 | 0.21 |
| 93 | 300953 | 震裕科技 | 2,394.00 | 258,651.90 | 0.13 |
| 94 | 002714 | 牧原股份 | 3,858.00 | 234,643.56 | 0.12 |
| 95 | 600048 | 保利地产 | 10,400.00 | 125,216.00 | 0.06 |
| 96 | 688097 | 博众精工 | 3,983.00 | 121,282.35 | 0.06 |
| 97 | 688314 | 康拓医疗 | 1,085.00 | 114,619.40 | 0.06 |
| 98 | 300896 | 爱美客 | 123.00 | 97,032.24 | 0.05 |
| 99 | 688316 | 青云科技 | 1,396.00 | 90,712.08 | 0.05 |
| 100 | 688663 | 新风光 | 3,279.00 | 66,760.44 | 0.03 |
| 101 | 601665 | 齐鲁银行 | 6,731.00 | 62,598.30 | 0.03 |
| 102 | 688260 | 昀冢科技 | 2,990.00 | 58,095.70 | 0.03 |
| 103 | 300929 | 华骐环保 | 1,827.00 | 54,888.39 | 0.03 |
| 104 | 300957 | 贝泰妮 | 194.00 | 48,971.42 | 0.02 |
| 105 | 688156 | 路德环境 | 2,602.00 | 47,928.84 | 0.02 |
| 106 | 688087 | 英科再生 | 1,925.00 | 42,273.00 | 0.02 |
| 107 | 300919 | 中伟股份 | 247.00 | 40,261.00 | 0.02 |
| 108 | 300979 | 华利集团 | 375.00 | 39,498.75 | 0.02 |
| 109 | 603529 | 爱玛科技 | 679.00 | 39,463.48 | 0.02 |
| 110 | 300973 | 立高食品 | 264.00 | 38,303.76 | 0.02 |
| 111 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230.00 | 34,721.10 | 0.02 |
| 112 | 300981 | 中红医疗 | 232.00 | 24,656.96 | 0.01 |
| 113 | 001207 | 联科科技 | 682.00 | 22,581.02 | 0.01 |
| 114 | 300941 | 创识科技 | 399.00 | 19,914.09 | 0.01 |
| 115 | 688668 | 鼎通科技 | 566.00 | 18,536.50 | 0.01 |
| 116 | 688226 | 威腾电气 | 2,693.00 | 17,289.06 | 0.01 |
| 117 | 300968 | 格林精密 | 1,123.00 | 16,822.54 | 0.01 |
| 118 | 300614 | 百川畅银 | 329.00 | 16,321.69 | 0.01 |
| 119 | 300982 | 苏文电能 | 317.00 | 16,154.32 | 0.01 |
| 120 | 301002 | 崧盛股份 | 201.00 | 15,340.32 | 0.01 |
| 121 | 300997 | 欢乐家 | 867.00 | 14,964.42 | 0.01 |
| 122 | 301009 | 可靠股份 | 461.00 | 14,392.42 | 0.01 |
| 123 | 300932 | 三友联众 | 438.00 | 13,884.60 | 0.01 |
| 124 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754.00 | 13,558.42 | 0.01 |
| 125 | 300940 | 南极光 | 307.00 | 13,308.45 | 0.01 |
| 126 | 300942 | 易瑞生物 | 443.00 | 12,621.07 | 0.01 |
| 127 | 603171 | 税友股份 | 637.00 | 12,230.40 | 0.01 |
| 128 | 300996 | 普联软件 | 231.00 | 11,688.60 | 0.01 |
| 129 | 300933 | 中辰股份 | 1,112.00 | 11,609.28 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|----------|-----------|------|
| 130 | 300966 | 共同药业 | 286.00 | 11,225.50 | 0.01 |
| 131 | 605287 | 德才股份 | 349.00 | 11,014.44 | 0.01 |
| 132 | 300955 | 嘉亨家化 | 232.00 | 10,683.60 | 0.01 |
| 133 | 605259 | 绿田机械 | 295.00 | 10,516.75 | 0.01 |
| 134 | 300987 | 川网传媒 | 301.00 | 10,462.76 | 0.01 |
| 135 | 300978 | 东箭科技 | 593.00 | 9,944.61 | 0.00 |
| 136 | 300986 | 志特新材 | 264.00 | 9,828.72 | 0.00 |
| 137 | 300956 | 英力股份 | 371.00 | 9,571.80 | 0.00 |
| 138 | 300993 | 玉马遮阳 | 410.00 | 9,524.30 | 0.00 |
| 139 | 300952 | 恒辉安防 | 340.00 | 9,203.80 | 0.00 |
| 140 | 300945 | 曼卡龙 | 474.00 | 8,944.38 | 0.00 |
| 141 | 300948 | 冠中生态 | 324.00 | 8,874.36 | 0.00 |
| 142 | 300931 | 通用电梯 | 672.00 | 8,803.20 | 0.00 |
| 143 | 300961 | 深水海纳 | 394.00 | 8,695.58 | 0.00 |
| 144 | 300991 | 创益通 | 254.00 | 8,671.56 | 0.00 |
| 145 | 300950 | 德固特 | 219.00 | 8,567.28 | 0.00 |
| 146 | 300975 | 商络电子 | 492.00 | 8,398.44 | 0.00 |
| 147 | 605162 | 新中港 | 1,377.00 | 8,358.39 | 0.00 |
| 148 | 300971 | 博亚精工 | 245.00 | 8,175.65 | 0.00 |
| 149 | 300926 | 博俊科技 | 359.00 | 7,955.44 | 0.00 |
| 150 | 300930 | 屹通新材 | 322.00 | 7,879.34 | 0.00 |
| 151 | 300963 | 中洲特材 | 283.00 | 7,847.59 | 0.00 |
| 152 | 300967 | 晓鸣股份 | 507.00 | 7,777.38 | 0.00 |
| 153 | 301011 | 华立科技 | 175.00 | 7,703.50 | 0.00 |
| 154 | 300985 | 致远新能 | 274.00 | 7,477.46 | 0.00 |
| 155 | 300972 | 万辰生物 | 430.00 | 6,966.00 | 0.00 |
| 156 | 300927 | 江天化学 | 217.00 | 6,527.36 | 0.00 |
| 157 | 300943 | 春晖智控 | 255.00 | 5,865.00 | 0.00 |
| 158 | 301007 | 德迈仕 | 303.00 | 5,793.36 | 0.00 |
| 159 | 300998 | 宁波方正 | 201.00 | 5,728.50 | 0.00 |
| 160 | 300960 | 通业科技 | 234.00 | 5,396.04 | 0.00 |
| 161 | 300992 | 泰福泵业 | 200.00 | 5,378.00 | 0.00 |
| 162 | 301010 | 晶雪节能 | 218.00 | 4,928.98 | 0.00 |
| 163 | 605011 | 杭州热电 | 525.00 | 4,662.00 | 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 | 600036 | 招商银行 | 25,615,503.00 | 8.82 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 16,434,694.00 | 5.66 |

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 3 | 601601 | 中国太保 | 13,198,948.80 | 4.54 |
| 4 | 600438 | 通威股份 | 13,079,065.00 | 4.50 |
| 5 | 000001 | 平安银行 | 11,897,072.00 | 4.10 |
| 6 | 600809 | 山西汾酒 | 11,203,409.00 | 3.86 |
| 7 | 000725 | 京东方 A | 11,073,199.00 | 3.81 |
| 8 | 002142 | 宁波银行 | 9,924,921.56 | 3.42 |
| 9 | 002236 | 大华股份 | 9,251,600.00 | 3.19 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 9,106,505.00 | 3.14 |
| 11 | 600690 | 海尔智家 | 8,930,825.28 | 3.07 |
| 12 | 000100 | TCL 科技 | 8,783,264.00 | 3.02 |
| 13 | 300033 | 同花顺 | 8,319,250.00 | 2.86 |
| 14 | 601166 | 兴业银行 | 8,288,305.00 | 2.85 |
| 15 | 600176 | 中国巨石 | 8,239,778.68 | 2.84 |
| 16 | 600887 | 伊利股份 | 8,236,539.00 | 2.84 |
| 17 | 000333 | 美的集团 | 8,222,758.38 | 2.83 |
| 18 | 002493 | 荣盛石化 | 8,160,432.00 | 2.81 |
| 19 | 601012 | 隆基股份 | 7,746,899.96 | 2.67 |
| 20 | 600519 | 贵州茅台 | 7,741,612.00 | 2.67 |
| 21 | 002841 | 视源股份 | 7,024,756.00 | 2.42 |
| 22 | 600030 | 中信证券 | 6,988,756.00 | 2.41 |
| 23 | 601888 | 中国中免 | 6,867,909.00 | 2.36 |
| 24 | 600926 | 杭州银行 | 6,744,238.40 | 2.32 |
| 25 | 000703 | 恒逸石化 | 6,664,479.00 | 2.29 |
| 26 | 601231 | 环旭电子 | 6,542,358.00 | 2.25 |
| 27 | 601899 | 紫金矿业 | 6,311,367.00 | 2.17 |
| 28 | 000338 | 潍柴动力 | 6,294,799.00 | 2.17 |
| 29 | 300408 | 三环集团 | 6,281,342.70 | 2.16 |
| 30 | 600309 | 万华化学 | 6,219,481.00 | 2.14 |
| 31 | 002007 | 华兰生物 | 6,109,709.00 | 2.10 |
| 32 | 601838 | 成都银行 | 5,946,927.00 | 2.05 |
| 33 | 002179 | 中航光电 | 5,867,230.50 | 2.02 |
| 34 | 002812 | 恩捷股份 | 5,828,598.00 | 2.01 |

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 | 600036 | 招商银行 | 20,783,817.00 | 7.16 |
| 2 | 601012 | 隆基股份 | 17,722,993.57 | 6.10 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 16,932,664.82 | 5.83 |
| 4 | 002271 | 东方雨虹 | 15,714,975.94 | 5.41 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 15,444,684.00 | 5.32 |
| 6 | 300059 | 东方财富 | 14,397,662.03 | 4.96 |

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 7 | 600519 | 贵州茅台 | 13,370,931.80 | 4.60 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 12,068,622.00 | 4.15 |
| 9 | 600438 | 通威股份 | 11,022,871.00 | 3.79 |
| 10 | 601658 | 邮储银行 | 10,947,740.43 | 3.77 |
| 11 | 000001 | 平安银行 | 10,649,051.40 | 3.67 |
| 12 | 300033 | 同花顺 | 10,215,952.66 | 3.52 |
| 13 | 601009 | 南京银行 | 9,757,856.82 | 3.36 |
| 14 | 601601 | 中国太保 | 9,591,626.00 | 3.30 |
| 15 | 002236 | 大华股份 | 9,392,509.92 | 3.23 |
| 16 | 601939 | 建设银行 | 9,293,805.00 | 3.20 |
| 17 | 000333 | 美的集团 | 9,239,368.00 | 3.18 |
| 18 | 600346 | 恒力石化 | 9,170,054.72 | 3.16 |
| 19 | 002032 | 苏泊尔 | 9,158,012.36 | 3.15 |
| 20 | 000100 | TCL 科技 | 9,049,279.47 | 3.12 |
| 21 | 601888 | 中国中免 | 8,646,946.00 | 2.98 |
| 22 | 002555 | 三七互娱 | 8,399,824.93 | 2.89 |
| 23 | 002142 | 宁波银行 | 8,207,976.44 | 2.83 |
| 24 | 601899 | 紫金矿业 | 8,173,460.00 | 2.81 |
| 25 | 002415 | 海康威视 | 7,845,141.00 | 2.70 |
| 26 | 000002 | 万 科 A | 7,412,746.00 | 2.55 |
| 27 | 002475 | 立讯精密 | 7,370,912.39 | 2.54 |
| 28 | 603501 | 韦尔股份 | 7,234,259.10 | 2.49 |
| 29 | 600809 | 山西汾酒 | 7,206,956.08 | 2.48 |
| 30 | 600926 | 杭州银行 | 7,105,360.28 | 2.45 |
| 31 | 000725 | 京东方 A | 7,079,705.00 | 2.44 |
| 32 | 600690 | 海尔智家 | 6,984,394.00 | 2.40 |
| 33 | 000961 | 中南建设 | 6,835,869.60 | 2.35 |
| 34 | 600030 | 中信证券 | 6,641,655.00 | 2.29 |
| 35 | 002241 | 歌尔股份 | 6,465,774.00 | 2.23 |
| 36 | 600176 | 中国巨石 | 6,381,138.39 | 2.20 |
| 37 | 601231 | 环旭电子 | 6,053,981.00 | 2.08 |
| 38 | 002007 | 华兰生物 | 6,041,917.00 | 2.08 |
| 39 | 000895 | 双汇发展 | 5,993,654.00 | 2.06 |
| 40 | 002493 | 荣盛石化 | 5,986,403.00 | 2.06 |
| 41 | 300529 | 健帆生物 | 5,958,639.08 | 2.05 |
| 42 | 002027 | 分众传媒 | 5,916,908.00 | 2.04 |

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

| | |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 625,434,342.31 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 711,266,909.94 |

注：“买入金额”、“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关

交易费用。

7.5 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 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 31,900.00 | 0.02 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 31,900.00 | 0.02 |

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 | 123117 | 健帆转债 | 319.00 | 31,900.00 | 0.02 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十大证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查的情形。

本基金投资的前十大证券的发行主体除招商银行（600036.SH）、成都银行（601838.SH）、国泰君安（601211.SH）外，在报告编制日前一年内，没有收到公开谴责和处罚的情形。

本报告编制日前一年内，招商银行股份有限公司由于为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品等多个违法违规事实而被中国银行保险监督管理委员会处以罚款。

本报告编制日前一年内，成都银行股份有限公司由于未按规定履行客户身份识别义务、与身份不明的客户进行交易而被中国人民银行及其派出机构处以罚款。

本报告编制日前一年内，国泰君安证券股份有限公司由于在信息技术管理方面存在未按规定对信息系统故障进行应急报告，客户信息管控不足、且内部审查未充分遵循业务合规原则等多个违法违规事实而被中国证券监督管理委员会及其派出机构出具警示函。

本基金采用量化模型选股，上述证券为量化模型根据关注的指标批量选择结果，所以不影响基金管理人对该证券的投资决策。

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 173,058.55 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,120,746.03 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,729.37 |
| 5 | 应收申购款 | 3,441.16 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,298,975.11 |

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的情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|---------------|----------------|------------|------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额 比例 | 持有份额 | 占总份额 比例 |
| 324 | 346,720.45 | 111,528,839.19 | 99.28% | 808,585.95 | 0.72% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 19,629.10 | 0.02% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 167,934,644.57 |
| 本报告期基金总申购份额 | 44,897,639.27 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 100,494,858.70 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 112,337,425.14 |

10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内，基金管理人董事、监事和高级管理人员未发生变更。
- 2、本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金聘用毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。

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

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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 | |
| 申万宏源证券 | 2 | 1,330,373,174.84 | 100.00% | 1,227,391.93 | 100.00% | - |

注：交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

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 | 关于申万菱信价值优利混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 《上海证券报》及规定网站 | 2021-01-15 |

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 | 20210101—20210630 | 50,065,407.32 | 0.00 | 0.00 | 50,065,407.32 | 44.57% |
| | 2 | 20210101—20210512 | 36,739,295.28 | 0.00 | 36,739,295.28 | 0.00 | 0.00% |
| | 3 | 20210101—20210106 20210513—20210601 | 38,780,174.83 | 0.00 | 27,300,000.00 | 11,480,174.83 | 10.22% |
| | 4 | 20210607—20210630 | 0.00 | 28,248,829.69 | 0.00 | 28,248,829.69 | 25.15% |
| | 5 | 20210223—20210429 | 27,499,345.21 | 7,992,646.28 | 27,499,345.21 | 7,992,646.28 | 7.11% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如投资者集中赎回，可能会给基金带来流动性冲击。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，保护持有人利益。 | | | | | | | |

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

基金合同；

招募说明书及其更新；

产品资料概要及其更新；

发售公告；

成立公告；

定期报告；

其他临时公告。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：www.swsmu.com。

申万菱信基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日