

中银益利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：中银基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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..... | 7 |
| 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 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..... | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 13 |
| 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真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| 7 投资组合报告 | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 38 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 39 |
| 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..... | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 41 |
| 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..... | 44 |
| 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 | 47 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 47 |
| 10.8 其他重大事件 | 49 |
| 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 49 |
| 12 备查文件目录 | 50 |
| 12.1 备查文件目录 | 50 |
| 12.2 存放地点 | 50 |
| 12.3 查阅方式 | 50 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|----------------|
| 基金名称 | 中银益利灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中银益利混合 | |
| 基金主代码 | 002616 | |
| 交易代码 | 002616 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年4月25日 | |
| 基金管理人 | 中银基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 280,247,619.01 份 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中银益利混合 A | 中银益利混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002616 | 002617 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 272,340,854.79 份 | 7,906,764.22 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金在严格风险控制的前提下，通过科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及个券精选策略，结合大类资产配置策略，追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，定性分析与定量分析贯穿于大类资产配置、行业配置和个股筛选中，构建投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40% |
| 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高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|--------------------------------|------------------------|
| 名称 | | 中银基金管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 欧阳向军 | 张燕 |
| | 联系电话 | 021-38834999 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | clientservice@bocim.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 021-38834788 400-888-5566 | 95555 |
| 传真 | | 021-68873488 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | | 上海市银城中路200号中银大厦45层 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 办公地址 | | 上海市银城中路200号中银大厦10层、11层、26层、45层 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | | 200120 | 518040 |
| 法定代表人 | | 章砚 | 缪建民 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.bocim.com |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路 200 号 26 楼 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|---------------------------------------|
| 注册登记机构 | 中银基金管理有限公司 | 上海市银城中路 200 号中银大厦 10 层、11 层、26 层、45 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） | |
|---------------|--------------------------------------|---------------|
| | 中银益利混合 A | 中银益利混合 C |
| 本期已实现收益 | 12,205,913.53 | 2,557,976.38 |
| 本期利润 | -6,463,097.79 | -694,266.25 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0191 | -0.0117 |
| 本期加权平均净值利润率 | -1.37% | -0.84% |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.71% | -0.71% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) | |
| | 中银益利混合 A | 中银益利混合 C |
| 期末可供分配利润 | 103,332,292.73 | 2,974,187.66 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3794 | 0.3762 |
| 期末基金资产净值 | 380,071,488.65 | 11,007,414.14 |
| 期末基金份额净值 | 1.396 | 1.392 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) | |
| | 中银益利混合 A | 中银益利混合 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 54.38% | 53.95% |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配收益，采用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（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银益利混合 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 | -0.07% | 0.36% | -1.22% | 0.48% | 1.15% | -0.12% |
| 过去三个月 | 2.57% | 0.40% | 2.33% | 0.59% | 0.24% | -0.19% |
| 过去六个月 | -0.71% | 0.57% | 0.65% | 0.79% | -1.36% | -0.22% |
| 过去一年 | 12.14% | 0.50% | 15.09% | 0.80% | -2.95% | -0.30% |
| 过去三年 | 43.35% | 0.42% | 31.41% | 0.81% | 11.94% | -0.39% |
| 自基金合同生效日起 | 54.38% | 0.33% | 38.91% | 0.70% | 15.47% | -0.37% |

中银益利混合 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 | -0.07% | 0.38% | -1.22% | 0.48% | 1.15% | -0.10% |
| 过去三个月 | 2.58% | 0.41% | 2.33% | 0.59% | 0.25% | -0.18% |
| 过去六个月 | -0.71% | 0.58% | 0.65% | 0.79% | -1.36% | -0.21% |
| 过去一年 | 12.00% | 0.51% | 15.09% | 0.80% | -3.09% | -0.29% |
| 过去三年 | 42.95% | 0.43% | 31.41% | 0.81% | 11.54% | -0.38% |
| 自基金合同生效日起 | 53.95% | 0.33% | 38.91% | 0.70% | 15.04% | -0.37% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银益利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4月25日至2021年6月30日)

中银益利混合 A



中银益利混合 C



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为中银基金管理有限公司，由中国银行股份有限公司和贝莱德投资管理有限公司两大全球著名领先金融品牌强强联合组建的中外合资基金管理公司，致力于长期参与中国基金业的发展，努力成为国内领先的基金管理公司。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等 142 只开放式证券投资基金，同时管理着多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 杨成 | 基金经理 | 2016-04-25 | - | 15 | 中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），管理学硕士。曾任信诚基金固定收益分析师，上投摩根基金管理有限公司基金经理。2015 年加入中银基金管理有限公司，2015 年 9 月至今任中银新趋势基金基金经理，2016 年 4 月至今任中银益利基金基金经理，2016 年 5 月至 2019 年 4 月任中银合利基金基金经理，2016 年 8 月至今任中银丰利基金基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 9 月任中银尊享基金基金经理，2016 年 12 月至今任中银锦利基金基金经理，2021 年 3 月至今任中银顺宁回报基金基金经理，2021 年 7 月至今任中银睿丰回报基金基金经理。具备基金从业资格。 |

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理

和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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

1. 宏观经济分析

国外经济方面，上半年全球发达国家疫情总体好转，二季度印度疫情爆发带动东南亚和英国疫情反复，截止 6 月末，美、英、中、印度和巴西全部完成疫苗接种占比分别为 45%、47%、16%、4%、12%。美国消费继续复苏，通胀走高，就业伴随疫苗接种总体恢复，6 月失业率较 2020 年 12 月下降 0.8 个百分点至 5.9%，6 月制造业 PMI 较 2020 年 12 月上行 0.1 个百分点至 60.6，6 月服务业 PMI 较 2020 年 12 月上升 2.4 个百分点至 60.1。美联储维持利率水平和资产购买规模不变，上调 IOER 和 ONRRP 利率，下半年就业恢复后美联储可能明确 QE taper 信号。欧元区继续复苏，6 月失业率较 2020 年末回落 0.4 个百分点至 7.7%，6 月制造业 PMI 较 2020 年末上升 8.2 个百分点至 63.4，6 月服务业 PMI 较 2020 年末上升 11.9 个百分点至 58.3，欧央行 6 月议息会议上提出加快 PEPP 购买步伐。日本央行维持基准利率不变，经济恢复速度放缓，通缩问题有所好转，6 月 CPI 同比较 2020 年末回升 1.4 个百分点至 0.2%，6 月制造业 PMI 较 2020 年末上行 2.4 个百分点至 52.4。综合来看，全球经济下半年复苏进度边际放缓，主要经济体央行货币政策有边际收紧压力，但货币政策退出宽松力度预计总体较为温和。

国内经济方面，生产数据快速修复后有所转弱，经济结构性分化持续，出口维持高位，地产投资高位回落，而制造业和消费继续缓慢恢复，经济下行压力逐步体现，通胀预期回落。具体来看，上半年领先指标中采制造业 PMI 持续位于荣枯线上方窄幅震荡，6 月值较 2020 年末走低 1 个百分点

至 50.9，同步指标工业增加值 1-6 月累计同比增长 15.9%，较 2020 年末上升 13.1 个百分点。从经济增长动力来看，出口总体偏强，消费投资继续改善：1-6 月美元计价累计出口增速较 2020 年末回升 35 个百分点至 38.6%左右，6 月社会消费品零售总额增速较 2020 年末回升 7.5 个百分点至 12.1%，制造业、房地产、基建投资均缓慢改善，1-6 月固定资产投资增速较 2020 年末回升 9.7 个百分点至 12.6%的水平。通胀方面，CPI 震荡上行，6 月同比增速从 2020 年末的 0.2% 上升 0.9 个百分点至 1.1%，PPI 快速上行后高位震荡，6 月同比增速从 2020 年末的 -0.4% 上升 9.2 个百分点至 8.8%。

2. 市场回顾

整体来看，上半年各类型债券均出现小幅上涨。其中，一季度，中债总全价指数上涨 0.24%，中债银行间国债全价指数上涨 0.63%，中债企业债总全价指数上涨 0.22%。其中，一季度，10 年期国债收益率从 3.14% 上行 5bp 至 3.19%，10 年期金融债（国开）收益率从 3.53% 上行 4 个 bp 至 3.57%；二季度，10 年期国债收益率从 3.19% 下行 11bp 至 3.08%，10 年期金融债（国开）收益率从 3.57% 下行 8 个 bp 至 3.49%。货币市场方面，上半年央行保持流动性合理充裕，银行间资金面总体宽松，仅出现时点性紧张。其中，一季度，银行间 1 天回购加权平均利率均值在 2.05% 左右，较上季度均值上行 35bp，银行间 7 天回购利率均值在 2.41% 左右，较上季度均值下行 9bp；二季度，银行间 1 天回购加权平均利率均值在 2.03% 左右，较上季度均值下行 2bp，银行间 7 天回购利率均值在 2.25% 左右，较上季度均值下行 16bp。

可转债方面，上半年转债整体小幅上涨，期间随权益市场波动较大，中证转债指数上涨 4.04%。一月底至二月初转债市场估值出现明显压缩，提供较好的配置机会，此后估值修复带动转债上涨，并维持震荡至二季度，其中新能源、周期等板块景气度走高，部分热点行业转债标的表现较好，总体而言转债市场内部分化较大，个券方面，小康转债、维格转债、蓝晓转债、联泰转债、星源转 2 等涨幅较大，分别上涨 334%、203%、102%、99%、93%，其中大部分与锂电新能源车等高景气度行业相关。

股票市场方面，上半年上证综指上涨 3.40%，代表大盘股表现的沪深 300 指数上涨 0.24%，中小板综合指数上涨 5.19%，创业板综合指数上涨 14.13%，风格上仍是科技成长表现较好。

3. 运行分析

本基金近期大幅降低了茅类资产的占比，增持了新能源上游、半导体、军工等行业景气向上，二季报预期有显著盈利改善的公司。权益市场正在发生剧烈的风格切换，资金从消费、医药、

金融等稳定类资产中出逃，涌向了半导体、新能源中上游、军工等少数几个有共识的行业，结构化行情演绎到极致。本基金仍将积极参与两市新股的网下申购。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-0.71%，同期业绩比较基准收益率为 0.65%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为-0.71%，同期业绩比较基准收益率为 0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，全球经济活动依然受到疫情影响，发达经济复苏斜率面临放缓的压力，新兴经济复苏更为滞后，美联储 QE Taper 的力度预计相对温和。国内经济总量稳健偏弱，结构性问题和不确定性风险是主要扰动因素；宏观政策注重跨周期调节，整体稳健偏积极，更加针对经济结构中偏弱的部分，财政政策更加积极提升政策效能，货币政策稳健偏松，保持流动性合理充裕。

我们对 2021 年下半年债券市场的走势中性偏乐观。宏观经济整边际下行压力，出口和房地产投资面临回落压力，基建保持平稳，制造业和消费继续缓慢修复，疫情反复对经济也存在持续扰动，债券市场对经济数据的敏感度将有所抬高。通胀方面，PPI 同比增速继续维持在较高水平，但受终端需求偏弱的影响，上游价格向下游的传递受阻，CPI 同比增速整体偏低。货币政策整体稳健偏松，更加注重对中小企业和困难行业的助力，边际放松仍有空间，流动性保持合理充裕，资金利率有望保持在低位。从市场结构来看，虽然下半年政府债供给压力有所加大，但在稳健偏松的环境下，债券需求继续形成支撑，包括银行负债改善带动的配置需求、信用风险偏好偏低带来的避险需求以及境外机构持续的增配需求。综合上述分析，预计下半年债券收益率可能呈震荡下行走势。可转债方面，思路仍以自下而上为主择券为主，转债整体估值较高，转债性价比下降，对于溢价率过高标的需适当谨慎。信用债方面，结构性紧信用环境下的整体信用风险有释放的压力，尾部的灰犀牛信用风险仍然需要重点防范。在做好组合流动性管理的基础上，我们将保持适度杠杆和久期，合理分配各类资产，审慎精选信用债和可转债品种，积极把握投资交易机会。我们将坚持从自上而下的角度预判市场走势，并从自下而上的角度严防信用风险。权益方面，预计伴随着地产与出口的回落叠加基数走高效应，经济总量及企业盈利将逐季下行，同时预计货币政策将维持中性偏松的整体基调，市场大概率呈现震荡偏强的格局，中美关系方面关注病毒溯源、新疆、香港等问题的潜在冲击。作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由研究部、风险管理部、基金运

营部及投资相关部门的相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场环境相适应的估值方法，基金运营部应征询会计师事务所、基金托管人的相关意见。公司按特殊流程改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，应就基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见，会计师事务所应对公司所采用的相关估值模型、假设、参数及输入的适当性发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.6.2 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.6.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本报告期末中银益利混合 A 可供分配利润为 103,332,292.73 元，中银益利混合 C 可供分配利润为 2,974,187.66 元。本基金本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

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

托管人声明：

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

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并

根据监管要求履行报告义务。

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银益利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 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | - | - |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 6,693,377.75 | 2,920,459.77 |
| 结算备付金 | | 4,292,462.35 | 3,274,063.65 |
| 存出保证金 | | 199,941.28 | 214,576.69 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 410,078,661.29 | 753,436,223.69 |
| 其中：股票投资 | | 133,357,392.89 | 140,503,515.29 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 276,721,268.40 | 612,932,708.40 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 296,806.05 | 227,373.43 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 4,332,389.31 | 5,677,639.52 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,529.40 | 271,391.50 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 425,895,167.43 | 766,021,728.25 |
| 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 30,000,000.00 | 60,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 3,980,727.85 | 119,289.67 |
| 应付赎回款 | | 11,487.89 | 201,481.02 |
| 应付管理人报酬 | | 253,751.02 | 359,346.24 |
| 应付托管费 | | 63,437.78 | 89,836.57 |
| 应付销售服务费 | | 1,758.01 | 16,878.77 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 409,178.41 | 426,137.59 |
| 应交税费 | | 7,580.52 | 17,350.35 |
| 应付利息 | | - | -19,528.76 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 88,343.16 | 169,001.34 |
| 负债合计 | | 34,816,264.64 | 61,379,792.79 |
| 所有者权益： | | - | - |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 280,247,619.01 | 501,574,538.90 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 110,831,283.78 | 203,067,396.56 |
| 所有者权益合计 | | 391,078,902.79 | 704,641,935.46 |
| 负债和所有者权益总计 | | 425,895,167.43 | 766,021,728.25 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.395 元，基金份额总额 280,247,619.01 份，其中 A 类基金份额参考净值 1.396 元，份额总额 272,340,854.79 份；C 类基金份额参考净值 1.392 元，份额总额 7,906,764.22 份。

6.2 利润表

会计主体：中银益利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 |
|------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | -2,634,276.87 | 41,636,005.54 |
| 1.利息收入 | | 6,267,883.83 | 6,966,206.04 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 78,977.28 | 63,598.18 |
| 债券利息收入 | | 6,013,082.34 | 6,421,584.29 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 175,824.21 | 481,023.57 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 13,012,611.85 | 31,492,403.87 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 14,078,287.12 | 30,003,194.69 |
| 基金投资收益 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|----------------------|----------------------|
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -1,785,827.70 | 624,462.12 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 720,152.43 | 864,747.06 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -21,921,253.95 | 3,173,819.76 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 6,481.40 | 3,575.87 |
| 减：二、费用 | | 4,523,087.17 | 5,293,549.16 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2 | 1,657,625.53 | 1,732,576.56 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2 | 414,406.36 | 433,144.18 |
| 3. 销售服务费 | | 41,875.10 | 70,258.39 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 1,530,253.05 | 2,671,568.84 |
| 5. 利息支出 | | 762,583.45 | 266,548.61 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 762,583.45 | 266,548.61 |
| 6.税金及附加 | | 7,995.84 | 10,858.80 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.19 | 108,347.84 | 108,593.78 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -7,157,364.04 | 36,342,456.38 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -7,157,364.04 | 36,342,456.38 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银益利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
|--|---------------------------------------|-----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 501,574,538.90 | 203,067,396.56 | 704,641,935.46 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -7,157,364.04 | -7,157,364.04 |
| 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） | -221,326,919.89 | -85,078,748.74 | -306,405,668.63 |
| 其中：1.基金申购款 | 84,768,033.43 | 32,643,380.77 | 117,411,414.20 |
| 2.基金赎回款 | -306,094,953.32 | -117,722,129.51 | -423,817,082.83 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |

| | | | |
|--|---------------------------------|----------------|-----------------|
| 填列) | | | |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 280,247,619.01 | 110,831,283.78 | 391,078,902.79 |
| 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) | 413,392,043.04 | 95,596,136.14 | 508,988,179.18 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 36,342,456.38 | 36,342,456.38 |
| 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) | 101,412,071.60 | 26,960,737.82 | 128,372,809.42 |
| 其中: 1.基金申购款 | 220,102,914.39 | 59,949,569.69 | 280,052,484.08 |
| 2.基金赎回款 | -118,690,842.79 | -32,988,831.87 | -151,679,674.66 |
| 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) | 514,804,114.64 | 158,899,330.34 | 673,703,444.98 |

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：李道滨，主管会计工作负责人：张家文，会计机构负责人：乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银益利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系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[2016]473号文《关于准予中银益利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2016年4月25日正式生效，首次设立募集规模为544,059,001.03基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司，基金注册登记机构为中银基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证及股指期货等权益类品种，债券等固定收益类品种(包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资

产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具）、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金投资于股票的比例为基金资产的 0%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货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。

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间没有需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免

征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 | 6,693,377.75 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 6,693,377.75 |

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 | | 130,036,228.63 | 133,357,392.89 | 3,321,164.26 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 235,411,324.20 | 236,805,268.40 | 1,393,944.20 |
| | 银行间市场 | 39,925,200.00 | 39,916,000.00 | -9,200.00 |
| | 合计 | 275,336,524.20 | 276,721,268.40 | 1,384,744.20 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 405,372,752.83 | 410,078,661.29 | 4,705,908.46 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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 | 2,332.66 |
| 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 | 1,931.60 |
| 应收债券利息 | 4,328,035.05 |
| 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 | 90.00 |
| 合计 | 4,332,389.31 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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 | 408,753.41 |
| 银行间市场应付交易费用 | 425.00 |
| 合计 | 409,178.41 |

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 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付账户维护费 | 9,000.00 |
| 应付信息披露费 | 59,507.37 |
| 应付审计费 | 19,835.79 |
| 合计 | 88,343.16 |

6.4.7.9 实收基金

中银益利混合 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 | 356,406,001.54 | 356,406,001.54 |
| 本期申购 | 80,757,229.34 | 80,757,229.34 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -164,822,376.09 | -164,822,376.09 |
| 本期末 | 272,340,854.79 | 272,340,854.79 |

中银益利混合 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 | 145,168,537.36 | 145,168,537.36 |
| 本期申购 | 4,010,804.09 | 4,010,804.09 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -141,272,577.23 | -141,272,577.23 |
| 本期末 | 7,906,764.22 | 7,906,764.22 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

中银益利混合 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 | 123,614,655.10 | 21,064,056.34 | 144,678,711.44 |
| 本期利润 | 12,205,913.53 | -18,669,011.32 | -6,463,097.79 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -32,488,275.90 | 2,003,296.11 | -30,484,979.79 |
| 其中：基金申购款 | 29,815,864.79 | 1,218,848.96 | 31,034,713.75 |
| 基金赎回款 | -62,304,140.69 | 784,447.15 | -61,519,693.54 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 103,332,292.73 | 4,398,341.13 | 107,730,633.86 |

中银益利混合 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 | 49,850,424.36 | 8,538,260.76 | 58,388,685.12 |
| 本期利润 | 2,557,976.38 | -3,252,242.63 | -694,266.25 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -49,434,213.08 | -5,159,555.87 | -54,593,768.95 |
| 其中：基金申购款 | 1,428,265.86 | 180,401.16 | 1,608,667.02 |
| 基金赎回款 | -50,862,478.94 | -5,339,957.03 | -56,202,435.97 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,974,187.66 | 126,462.26 | 3,100,649.92 |

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 | 18,209.03 |
| 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 | 55,894.56 |
| 其他 | 4,873.69 |
| 合计 | 78,977.28 |

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 | 497,566,676.11 |

| | |
|------------|----------------|
| 减：卖出股票成本总额 | 483,488,388.99 |
| 买卖股票差价收入 | 14,078,287.12 |

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 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 | 438,731,775.47 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 434,719,843.17 |
| 减：应收利息总额 | 5,797,760.00 |
| 买卖债券差价收入 | -1,785,827.70 |

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

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 | 720,152.43 |
| 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 | 720,152.43 |

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 | -21,921,253.95 |
| ——股票投资 | -25,682,915.92 |
| ——债券投资 | 3,761,661.97 |
| ——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 | -21,921,253.95 |

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 | 6,421.59 |
| 转换费收入 | 59.81 |
| 合计 | 6,481.40 |

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 | 1,529,253.05 |
| 银行间市场交易费用 | 1,000.00 |
| 合计 | 1,530,253.05 |

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 | 19,835.79 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 10,404.68 |
| 银行间账户维护费 | 18,000.00 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 108,347.84 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

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

本会计期间内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|-------------------|
| 中银基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 基金管理人的控股股东、基金销售机构 |
| 中银国际证券股份有限公司（“中银证券”） | 受中国银行重大影响 |

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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 | 1,657,625.53 | 1,732,576.56 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 31,436.00 | 25,634.89 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月 30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 414,406.36 | 433,144.18 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

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 | | |
| | 中银益利混合 A | 中银益利混合 C | 合计 |
| 招商银行 | - | 738.58 | 738.58 |
| 中银基金管理有限公司 | - | 35,513.26 | 35,513.26 |
| 中国银行 | - | 1,125.47 | 1,125.47 |
| 合计 | - | 37,377.31 | 37,377.31 |
| 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 | | |
| | 中银益利混合A | 中银益利混合C | 合计 |
| 中国银行 | - | 728.50 | 728.50 |
| 中银基金管理有限公司 | - | 68,605.61 | 68,605.61 |
| 招商银行 | - | 248.21 | 248.21 |
| 合计 | - | 69,582.32 | 69,582.32 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.1%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的资产净值 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的

证券出借业务。

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

中银益利混合 A

份额单位：份

| 关联方名称 | 中银益利混合A本期末 2021年6月30日 | | 中银益利混合A上年度末 2020年12月31日 | |
|------------------|--------------------------|--------------------------|----------------------------|----------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额占 基金总份额的比例 |
| 中银国际证券股份 有限公司 | 7,999,111.11 | 2.94% | 7,999,111.11 | 2.24% |

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

中银益利混合 C

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金 C 类份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|------------|----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行股份有限公司 | 6,693,377.75 | 18,209.03 | 112,252,909. 39 | 19,562.81 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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 |
| 300919 | 中伟股份 | 2020-12-23 | 2021-07-02 | 新股锁定期内 | 24.60 | 163.00 | 610 | 15,006.00 | 99,430.00 | - |
| 688667 | 菱电电控 | 2021-03-03 | 2021-09-13 | 新股锁定期内 | 75.42 | 103.88 | 1,191 | 89,825.22 | 123,721.08 | - |
| 688201 | 信安世纪 | 2021-04-13 | 2021-10-21 | 新股锁定期内 | 26.78 | 45.41 | 2,129 | 57,014.62 | 96,677.89 | - |
| 688499 | 利元亨 | 2021-06-23 | 2021-07-01 | 新股未上市 | 38.85 | 38.85 | 2,149 | 83,488.65 | 83,488.65 | - |
| 688070 | 纵横股份 | 2021-02-02 | 2021-08-10 | 新股锁定期内 | 23.16 | 34.47 | 2,407 | 55,746.12 | 82,969.29 | - |
| 688113 | 联测科技 | 2021-04-26 | 2021-11-08 | 新股锁定期内 | 19.14 | 49.29 | 1,415 | 27,083.10 | 69,745.35 | - |
| 688533 | 上声电子 | 2021-04-09 | 2021-10-19 | 新股锁定期内 | 7.72 | 19.11 | 3,493 | 26,965.96 | 66,751.23 | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021-06-28 | 2021-07-07 | 新股未上市 | 8.29 | 8.29 | 7,811 | 64,753.19 | 64,753.19 | - |
| 688468 | 科美诊断 | 2021-03-31 | 2021-10-11 | 新股锁定期内 | 7.15 | 16.50 | 3,919 | 28,020.85 | 64,663.50 | - |
| 688239 | 航宇科技 | 2021-06-25 | 2021-07-05 | 新股未上市 | 11.48 | 11.48 | 4,926 | 56,550.48 | 56,550.48 | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021-06-30 | 2021-07-09 | 新股未上市 | 21.96 | 21.96 | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24 | - |
| 688616 | 西力科技 | 2021-03-10 | 2021-09-22 | 新股锁定期内 | 7.35 | 13.78 | 3,918 | 28,797.30 | 53,990.04 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 301017 | 漱玉平民 | 2021-06-23 | 2021-07-05 | 新股未上市 | 8.86 | 8.86 | 4,995 | 44,255.70 | 44,255.70 | - |
| 688565 | 力源科技 | 2021-05-06 | 2021-11-15 | 新股锁定期内 | 9.39 | 14.00 | 2,464 | 23,136.96 | 34,496.00 | - |
| 688067 | 爱威科技 | 2021-06-07 | 2021-12-16 | 新股锁定期内 | 14.71 | 24.83 | 1,259 | 18,519.89 | 31,260.97 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股未上市 | 9.46 | 9.46 | 2,899 | 27,424.54 | 27,424.54 | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021-06-22 | 2021-12-30 | 新股锁定期内 | 7.64 | 38.83 | 462 | 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 | 17,289.06 | 17,289.06 | - |
| 300940 | 南极光 | 2021-01-27 | 2021-08-03 | 新股锁定期内 | 12.76 | 43.38 | 307 | 3,917.32 | 13,317.66 | - |
| 300937 | 药易购 | 2021-01-20 | 2021-07-27 | 新股锁定期内 | 12.25 | 53.71 | 244 | 2,989.00 | 13,105.24 | - |
| 301013 | 利和兴 | 2021-06-21 | 2021-12-29 | 新股锁定期内 | 8.72 | 27.11 | 471 | 4,107.12 | 12,768.81 | - |
| 300942 | 易瑞生物 | 2021-02-02 | 2021-08-09 | 新股锁定期内 | 5.31 | 28.52 | 443 | 2,352.33 | 12,634.36 | - |
| 300933 | 中辰股份 | 2021-01-15 | 2021-07-22 | 新股锁定期内 | 3.37 | 10.44 | 1,112 | 3,747.44 | 11,609.28 | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股未上市 | 31.56 | 31.56 | 349 | 11,014.44 | 11,014.44 | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021-03-03 | 2021-09-13 | 新股锁定期内 | 11.72 | 27.08 | 340 | 3,984.80 | 9,207.20 | - |
| 301016 | 雷尔伟 | 2021-06-23 | 2021-12-30 | 新股锁定期内 | 13.75 | 32.98 | 275 | 3,781.25 | 9,069.50 | - |
| 300945 | 曼卡龙 | 2021-02-03 | 2021-08-10 | 新股锁定 | 4.56 | 18.88 | 474 | 2,161.44 | 8,949.12 | - |

| | | | | | | | | | | |
|-----------------------------|------|------------|------------|----------------|-------|--------|----------|----------|----------|----|
| | | | | 期内 | | | | | | |
| 300948 | 冠中生态 | 2021-02-18 | 2021-08-25 | 新股 锁定期 内 | 13.00 | 27.42 | 324 | 2,808.00 | 8,884.08 | - |
| 300950 | 德固特 | 2021-02-24 | 2021-09-03 | 新股 锁定期 内 | 8.41 | 39.13 | 219 | 1,841.79 | 8,569.47 | - |
| 605162 | 新中港 | 2021-06-29 | 2021-07-07 | 新股 未上市 | 6.07 | 6.07 | 1,377 | 8,358.39 | 8,358.39 | - |
| 300930 | 屹通新材 | 2021-01-13 | 2021-07-21 | 新股 锁定期 内 | 13.11 | 24.48 | 322 | 4,221.42 | 7,882.56 | - |
| 301004 | 嘉益股份 | 2021-06-18 | 2021-12-27 | 新股 锁定期 内 | 7.81 | 21.94 | 312 | 2,436.72 | 6,845.28 | - |
| 300927 | 江天化学 | 2020-12-29 | 2021-07-07 | 新股 锁定期 内 | 13.39 | 30.10 | 217 | 2,905.63 | 6,531.70 | - |
| 301011 | 华立科技 | 2021-06-09 | 2021-12-17 | 新股 锁定期 内 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 300943 | 春晖智控 | 2021-02-03 | 2021-08-10 | 新股 锁定期 内 | 9.79 | 23.01 | 255 | 2,496.45 | 5,867.55 | - |
| 300929 | 华骐环保 | 2021-01-12 | 2021-07-21 | 新股 锁定期 内 | 13.87 | 29.55 | 183 | 2,538.21 | 5,407.65 | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021-06-23 | 2022-01-05 | 新股 锁定期 内 | 8.86 | 8.86 | 555 | 4,917.30 | 4,917.30 | - |
| 301007 | 德迈仕 | 2021-06-04 | 2021-12-16 | 新股 锁定期 内 | 5.29 | 14.44 | 303 | 1,602.87 | 4,375.32 | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021-06-15 | 2021-12-22 | 新股 锁定期 内 | 8.05 | 24.26 | 170 | 1,368.50 | 4,124.20 | - |
| 301010 | 晶雪节能 | 2021-06-09 | 2021-12-20 | 新股 锁定期 内 | 7.83 | 17.61 | 218 | 1,706.94 | 3,838.98 | - |
| 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 | 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 |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|-------|--------|--------|-------|------------|------------|---|
| | | | | 型 | | | | | | |
| 113050 | 南银转债 | 2021-06-17 | 2021-07-01 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 1,600 | 160,000.00 | 160,000.00 | - |

注：本基金本于 2021 年 6 月 4 日取得 300948 冠中生态红利金额 17.28 元，送股数量 108 股。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金期末持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 30,000,000.00 元，于 2021 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。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之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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，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。

于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资占基金资产净值的比例为 48.98%(2020 年 12 月 31 日：67.75%)。

本基金固定收益投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 45,258,268.40 | 42,368,708.40 |
| 合计 | 45,258,268.40 | 42,368,708.40 |

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、超短期融资券、中央票据。

6.4.13.2.2 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 | 39,916,000.00 | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |

| | | |
|----|---------------|---|
| 合计 | 39,916,000.00 | - |
|----|---------------|---|

注：本表列示期限在一年以内的同业存单。短期信用评级 A-1 所填列的为主体评级 AAA 的同业存单，短期信用评级 A-1 以下所填列的为主体评级 AAA 以下的同业存单。

6.4.13.2.3 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 | 191,547,000.00 | 477,384,000.00 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | 93,180,000.00 |
| 合计 | 191,547,000.00 | 570,564,000.00 |

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、中央票据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金每个开放日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。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 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。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 2021 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额人民币 30,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息外，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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

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 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|----------------|----------------|------------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 6,693,377.75 | - | - | - | 6,693,377.75 |
| 结算备付金 | 4,292,462.35 | - | - | - | 4,292,462.35 |
| 存出保证金 | 199,941.28 | - | - | - | 199,941.28 |
| 交易性金融资产 | 100,301,768.40 | 176,259,500.00 | 160,000.00 | 133,357,392.89 | 410,078,661.29 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 296,806.05 | 296,806.05 |
| 应收利息 | - | - | - | 4,332,389.31 | 4,332,389.31 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,529.40 | 1,529.40 |
| 资产总计 | 111,487,549.78 | 176,259,500.00 | 160,000.00 | 137,988,117.65 | 425,895,167.43 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 30,000,000.00 | - | - | - | 30,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 3,980,727.85 | 3,980,727.85 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 11,487.89 | 11,487.89 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 253,751.02 | 253,751.02 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|---------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 应付托管费 | - | - | - | 63,437.78 | 63,437.78 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,758.01 | 1,758.01 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 409,178.41 | 409,178.41 |
| 应交税费 | - | - | - | 7,580.52 | 7,580.52 |
| 其他负债 | - | - | - | 88,343.16 | 88,343.16 |
| 负债总计 | 30,000,000.00 | - | - | 4,816,264.64 | 34,816,264.64 |
| 利率敏感度缺口 | 81,487,549.78 | 176,259,500.00 | 160,000.00 | 133,171,853.01 | 391,078,902.79 |
| 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 2,920,459.77 | - | - | - | 2,920,459.77 |
| 结算备付金 | 3,274,063.65 | - | - | - | 3,274,063.65 |
| 存出保证金 | 214,576.69 | - | - | - | 214,576.69 |
| 交易性金融资产 | 62,412,708.40 | 456,933,000.00 | 93,587,000.00 | 140,503,515.29 | 753,436,223.69 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 227,373.43 | 227,373.43 |
| 应收利息 | - | - | - | 5,677,639.52 | 5,677,639.52 |
| 应收申购款 | 21,000.00 | - | - | 250,391.50 | 271,391.50 |
| 资产总计 | 68,842,808.51 | 456,933,000.00 | 93,587,000.00 | 146,658,919.74 | 766,021,728.25 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 60,000,000.00 | - | - | - | 60,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 119,289.67 | 119,289.67 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 201,481.02 | 201,481.02 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 359,346.24 | 359,346.24 |
| 应付托管费 | - | - | - | 89,836.57 | 89,836.57 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 16,878.77 | 16,878.77 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 426,137.59 | 426,137.59 |
| 应交税费 | - | - | - | 17,350.35 | 17,350.35 |
| 应付利息 | - | - | - | -19,528.76 | -19,528.76 |
| 其他负债 | - | - | - | 169,001.34 | 169,001.34 |
| 负债总计 | 60,000,000.00 | - | - | 1,379,792.79 | 61,379,792.79 |
| 利率敏感度缺口 | 8,842,808.51 | 456,933,000.00 | 93,587,000.00 | 145,279,126.95 | 704,641,935.46 |

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

| | |
|----|---|
| 假设 | 1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；2. 该利率敏感性分 |
|----|---|

| | | | |
|----|---|------------------------|--------------------------|
| | 析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；4. 银行存款、结算备付金、存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。 | | |
| 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 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | 减少约 77 | 减少约 645 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 增加约 77 | 增加约 671 |

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的比例为基金资产的 0%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货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。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，包括特定指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | |
|----|------------------------|-------|--------------------------|-------|
| | 公允价值 | 占基金资产 | 公允价值 | 占基金资产 |
| | | | | |

| | | 净值比例 (%) | | 净值比例 (%) |
|---------------|-----------------------|--------------|-----------------------|--------------|
| 交易性金融资产—股票投资 | 133,357,392.89 | 34.10 | 140,503,515.29 | 19.94 |
| 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 | 133,357,392.89 | 34.10 | 140,503,515.29 | 19.94 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--|------------------------------|---------------------|
| 假设 | 1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。 | | |
| 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 978 | 增加约 1,270 |
| | 2. 业绩比较基准下降5% | 减少约 978 | 减少约 1,270 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

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 | 133,357,392.89 | 31.31 |
| | 其中：股票 | 133,357,392.89 | 31.31 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 276,721,268.40 | 64.97 |
| | 其中：债券 | 276,721,268.40 | 64.97 |
| | 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 | 10,985,840.10 | 2.58 |
| 8 | 其他各项资产 | 4,830,666.04 | 1.13 |
| 9 | 合计 | 425,895,167.43 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务，本基金报告期末未投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 18,987,961.88 | 4.86 |
| C | 制造业 | 79,545,088.88 | 20.34 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,300,507.75 | 3.15 |
| E | 建筑业 | 11,014.44 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 89,166.82 | 0.02 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 108,908.29 | 0.03 |
| J | 金融业 | 9,925,285.10 | 2.54 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 7,832,610.00 | 2.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 48,787.73 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 4,508,062.00 | 1.15 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 133,357,392.89 | 34.10 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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 | 600900 | 长江电力 | 595,324 | 12,287,487.36 | 3.14 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 4,000 | 8,226,800.00 | 2.10 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 123,800 | 7,985,100.00 | 2.04 |
| 4 | 300751 | 迈为股份 | 17,396 | 7,909,961.20 | 2.02 |
| 5 | 601888 | 中国中免 | 26,100 | 7,832,610.00 | 2.00 |
| 6 | 002192 | 融捷股份 | 104,200 | 7,154,372.00 | 1.83 |
| 7 | 600276 | 恒瑞医药 | 102,281 | 6,952,039.57 | 1.78 |
| 8 | 603901 | 永创智能 | 336,612 | 6,069,114.36 | 1.55 |
| 9 | 300059 | 东方财富 | 182,600 | 5,987,454.00 | 1.53 |
| 10 | 300122 | 智飞生物 | 32,000 | 5,975,360.00 | 1.53 |
| 11 | 300054 | 鼎龙股份 | 325,900 | 5,947,675.00 | 1.52 |
| 12 | 000858 | 五粮液 | 19,600 | 5,838,644.00 | 1.49 |
| 13 | 002460 | 赣锋锂业 | 44,798 | 5,424,589.82 | 1.39 |
| 14 | 002607 | 中公教育 | 215,800 | 4,508,062.00 | 1.15 |
| 15 | 600219 | 南山铝业 | 1,137,400 | 4,094,640.00 | 1.05 |
| 16 | 000975 | 银泰黄金 | 428,800 | 4,077,888.00 | 1.04 |
| 17 | 603267 | 鸿远电子 | 31,200 | 3,991,104.00 | 1.02 |
| 18 | 600123 | 兰花科创 | 508,700 | 3,937,338.00 | 1.01 |
| 19 | 600030 | 中信证券 | 156,500 | 3,903,110.00 | 1.00 |
| 20 | 000651 | 格力电器 | 74,200 | 3,865,820.00 | 0.99 |
| 21 | 601899 | 紫金矿业 | 394,052 | 3,818,363.88 | 0.98 |
| 22 | 002651 | 利君股份 | 314,500 | 3,802,305.00 | 0.97 |
| 23 | 000538 | 云南白药 | 20,800 | 2,406,976.00 | 0.62 |
| 24 | 688667 | 菱电电控 | 1,191 | 123,721.08 | 0.03 |
| 25 | 300919 | 中伟股份 | 610 | 99,430.00 | 0.03 |
| 26 | 688201 | 信安世纪 | 2,129 | 96,677.89 | 0.02 |
| 27 | 688499 | 利元亨 | 2,149 | 83,488.65 | 0.02 |
| 28 | 688070 | 纵横股份 | 2,407 | 82,969.29 | 0.02 |
| 29 | 688113 | 联测科技 | 1,415 | 69,745.35 | 0.02 |
| 30 | 688533 | 上声电子 | 3,493 | 66,751.23 | 0.02 |
| 31 | 301018 | 申菱环境 | 7,811 | 64,753.19 | 0.02 |
| 32 | 688468 | 科美诊断 | 3,919 | 64,663.50 | 0.02 |
| 33 | 688239 | 航宇科技 | 4,926 | 56,550.48 | 0.01 |
| 34 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24 | 0.01 |
| 35 | 688616 | 西力科技 | 3,918 | 53,990.04 | 0.01 |
| 36 | 301017 | 漱玉平民 | 5,550 | 49,173.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 37 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.01 |
| 38 | 688565 | 力源科技 | 2,464 | 34,496.00 | 0.01 |
| 39 | 688067 | 爱威科技 | 1,259 | 31,260.97 | 0.01 |
| 40 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.01 |
| 41 | 001207 | 联科科技 | 682 | 22,581.02 | 0.01 |
| 42 | 301015 | 百洋医药 | 462 | 17,939.46 | 0.00 |
| 43 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 44 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 45 | 300940 | 南极光 | 307 | 13,317.66 | 0.00 |
| 46 | 300937 | 药易购 | 244 | 13,105.24 | 0.00 |
| 47 | 301013 | 利和兴 | 471 | 12,768.81 | 0.00 |
| 48 | 300942 | 易瑞生物 | 443 | 12,634.36 | 0.00 |
| 49 | 603171 | 税友股份 | 637 | 12,230.40 | 0.00 |
| 50 | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 51 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 52 | 300952 | 恒辉安防 | 340 | 9,207.20 | 0.00 |
| 53 | 301016 | 雷尔伟 | 275 | 9,069.50 | 0.00 |
| 54 | 300945 | 曼卡龙 | 474 | 8,949.12 | 0.00 |
| 55 | 300948 | 冠中生态 | 324 | 8,884.08 | 0.00 |
| 56 | 300950 | 德固特 | 219 | 8,569.47 | 0.00 |
| 57 | 605162 | 新中港 | 1,377 | 8,358.39 | 0.00 |
| 58 | 300930 | 屹通新材 | 322 | 7,882.56 | 0.00 |
| 59 | 301004 | 嘉益股份 | 312 | 6,845.28 | 0.00 |
| 60 | 300927 | 江天化学 | 217 | 6,531.70 | 0.00 |
| 61 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 62 | 300943 | 春晖智控 | 255 | 5,867.55 | 0.00 |
| 63 | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 64 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 65 | 301007 | 德迈仕 | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 66 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 67 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 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 | 600900 | 长江电力 | 24,999,838.52 | 3.55 |
| 2 | 601899 | 紫金矿业 | 23,312,710.47 | 3.31 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 18,855,361.00 | 2.68 |
| 4 | 600893 | 航发动力 | 18,090,059.82 | 2.57 |
| 5 | 601888 | 中国中免 | 17,834,171.10 | 2.53 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 6 | 000001 | 平安银行 | 14,994,640.75 | 2.13 |
| 7 | 002460 | 赣锋锂业 | 14,986,079.34 | 2.13 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 13,376,971.00 | 1.90 |
| 9 | 300122 | 智飞生物 | 13,216,169.00 | 1.88 |
| 10 | 601233 | 桐昆股份 | 12,770,221.00 | 1.81 |
| 11 | 600570 | 恒生电子 | 12,074,366.50 | 1.71 |
| 12 | 600309 | 万华化学 | 12,053,476.00 | 1.71 |
| 13 | 002415 | 海康威视 | 11,906,585.00 | 1.69 |
| 14 | 002192 | 融捷股份 | 11,874,181.00 | 1.69 |
| 15 | 000651 | 格力电器 | 11,639,729.00 | 1.65 |
| 16 | 000807 | 云铝股份 | 10,950,191.00 | 1.55 |
| 17 | 600862 | 中航高科 | 10,848,146.88 | 1.54 |
| 18 | 600760 | 中航沈飞 | 10,636,455.00 | 1.51 |
| 19 | 000538 | 云南白药 | 10,281,754.00 | 1.46 |
| 20 | 600123 | 兰花科创 | 10,159,064.00 | 1.44 |

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 600900 | 长江电力 | 30,093,486.57 | 4.27 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 23,593,188.00 | 3.35 |
| 3 | 603993 | 洛阳钼业 | 17,618,923.00 | 2.50 |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 17,443,380.28 | 2.48 |
| 5 | 000538 | 云南白药 | 16,296,160.08 | 2.31 |
| 6 | 002352 | 顺丰控股 | 15,558,644.08 | 2.21 |
| 7 | 000001 | 平安银行 | 14,678,417.27 | 2.08 |
| 8 | 300751 | 迈为股份 | 14,361,121.00 | 2.04 |
| 9 | 600893 | 航发动力 | 14,257,921.56 | 2.02 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 13,780,984.00 | 1.96 |
| 11 | 600570 | 恒生电子 | 11,706,721.00 | 1.66 |
| 12 | 600309 | 万华化学 | 11,433,260.00 | 1.62 |
| 13 | 601233 | 桐昆股份 | 11,406,516.00 | 1.62 |
| 14 | 000002 | 万科 A | 11,103,425.00 | 1.58 |
| 15 | 601888 | 中国中免 | 10,836,327.00 | 1.54 |
| 16 | 000807 | 云铝股份 | 10,713,509.00 | 1.52 |
| 17 | 600276 | 恒瑞医药 | 10,316,369.60 | 1.46 |
| 18 | 601318 | 中国平安 | 9,893,590.70 | 1.40 |
| 19 | 002460 | 赣锋锂业 | 9,426,807.00 | 1.34 |
| 20 | 300558 | 贝达药业 | 9,365,205.00 | 1.33 |

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 502,025,182.51 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 497,566,676.11 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 45,258,268.40 | 11.57 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 191,387,000.00 | 48.94 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 160,000.00 | 0.04 |
| 8 | 同业存单 | 39,916,000.00 | 10.21 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 276,721,268.40 | 70.76 |

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 | 112110252 | 21 兴业银行 CD252 | 400,000 | 39,916,000.00 | 10.21 |
| 2 | 019640 | 20 国债 10 | 234,310 | 23,431,000.00 | 5.99 |
| 3 | 019649 | 21 国债 01 | 218,120 | 21,827,268.40 | 5.58 |
| 4 | 175482 | 20 银河 G3 | 200,000 | 20,202,000.00 | 5.17 |
| 5 | 175534 | 20 华泰 G8 | 200,000 | 20,154,000.00 | 5.15 |

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

本基金报告期内未参与股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.12.2 本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 | 199,941.28 |
| 2 | 应收证券清算款 | 296,806.05 |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,332,389.31 |
| 5 | 应收申购款 | 1,529.40 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,830,666.04 |

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

本基金前十名股票未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|----------|------------|----------------|----------|---------------|----------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 中银益利混合 A | 346 | 787,112.30 | 264,583,586.48 | 97.1516% | 7,757,268.31 | 2.8484% |
| 中银益利混合 C | 1,148 | 6,887.43 | 2,253,945.25 | 28.5065% | 5,652,818.97 | 71.4935% |
| 合计 | 1,494 | 187,582.07 | 266,837,531.73 | 95.2149% | 13,410,087.28 | 4.7851% |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|----------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 中银益利混合 A | 49,878.70 | 0.0183% |
| | 中银益利混合 C | 6,003.06 | 0.0759% |
| | 合计 | 55,881.76 | 0.0199% |

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例

的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 中银益利混合 A | 0 |
| | 中银益利混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中银益利混合 A | 0 |
| | 中银益利混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中银益利混合 A | 中银益利混合 C |
|--------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016 年 4 月 25 日）基金份额总额 | 525,337,498.71 | 18,721,502.32 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 356,406,001.54 | 145,168,537.36 |
| 本报告期基金总申购份额 | 80,757,229.34 | 4,010,804.09 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 164,822,376.09 | 141,272,577.23 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 272,340,854.79 | 7,906,764.22 |

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

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

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内没有改聘会计师事务所。

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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到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**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 | |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | 238,299,063.66 | 24.00% | 221,573.55 | 24.18% | - |
| 中泰证券 | 1 | 199,265,245.08 | 20.07% | 185,575.94 | 20.25% | - |
| 方正证券 | 1 | 132,978,335.14 | 13.39% | 121,183.69 | 13.23% | - |
| 华泰证券 | 1 | 117,159,689.52 | 11.80% | 106,767.61 | 11.65% | - |
| 国信证券 | 1 | 61,362,038.74 | 6.18% | 55,918.50 | 6.10% | - |
| 中信证券 | 2 | 49,568,474.59 | 4.99% | 46,163.11 | 5.04% | - |
| 兴业证券 | 1 | 46,903,390.69 | 4.72% | 42,743.20 | 4.66% | - |
| 中信建投 | 1 | 45,473,151.15 | 4.58% | 42,349.41 | 4.62% | - |
| 招商证券 | 1 | 23,388,813.00 | 2.36% | 21,781.38 | 2.38% | - |
| 申万宏源证券 | 2 | 22,170,928.65 | 2.23% | 20,204.57 | 2.21% | - |
| 天风证券 | 2 | 21,289,759.84 | 2.14% | 19,826.71 | 2.16% | - |
| 东方证券 | 1 | 19,915,628.81 | 2.01% | 18,547.75 | 2.02% | - |
| 中金公司 | 1 | 14,972,756.98 | 1.51% | 13,644.70 | 1.49% | - |

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）

和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：报告期内退租华信证券上海交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 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 |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 32,785,237.40 | 9.28% | 2,483,400,000.00 | 33.38% | - | - |
| 中泰证券 | 2,944,771.50 | 0.83% | 1,878,400,000.00 | 25.25% | - | - |
| 方正证券 | 105,049.80 | 0.03% | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 60,569,306.85 | 17.14% | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 21,579,897.60 | 6.11% | 970,000,000.00 | 13.04% | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 4,121,327.00 | 1.17% | 1,042,000,000.00 | 14.01% | - | - |
| 招商证券 | 4,248,668.40 | 1.20% | 60,000,000.00 | 0.81% | - | - |
| 申万宏源证券 | 227,068,462.62 | 64.25% | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|----------------|--------|---|---|
| 天风证券 | - | - | 238,000,000.00 | 3.20% | - | - |
| 东方证券 | - | - | 767,000,000.00 | 10.31% | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |

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 | 中银益利灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-01-21 |
| 2 | 中银基金管理有限公司关于新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为旗下部分基金销售机构及参加其费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-04 |
| 3 | 关于中银益利灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购和定期定额投资业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-08 |
| 4 | 中银基金管理有限公司关于开展电子直销平台费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-17 |
| 5 | 中银益利灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-30 |
| 6 | 中银益利灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-04-21 |
| 7 | 中银基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司开通转换业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-04-22 |
| 8 | 中银基金管理有限公司关于调整电子直销平台中国银行借记卡定期定额申购费率的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-04-29 |
| 9 | 中银基金管理有限公司关于新增鼎信汇金(北京)投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定期定额投资及转换业务及参加其费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-05-21 |
| 10 | 中银基金管理有限公司关于新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通定期定额投资及转换业务及参加其费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-05-28 |

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|------------------------|--------|------|------|-------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2021-01-01 至 | 130,15 | 0.00 | 0.00 | 130,151,615 | 46.4416% |

| | | | | | | | |
|---|---|----------------------------|----------------|---------------|----------------|---------------|----------|
| | | 2021-06-30 | 1,615.23 | | | .23 | |
| | 2 | 2021-01-01 至 2021-06-22 | 122,394,686.33 | 0.00 | 122,394,686.33 | 0.00 | 0.0000% |
| | 3 | 2021-06-23 至 2021-06-30 | 0.00 | 79,479,046.24 | 0.00 | 79,479,046.24 | 28.3603% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,存在以下特有风险:(1)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险;(2)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险;(3)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险;(4)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险。 | | | | | | | |

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中银益利灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《中银益利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、《中银益利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
- 4、《中银益利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
- 5、法律意见书;
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照;
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告;
- 9、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人处,供公众查阅。

12.3 查阅方式

投资人在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

二〇二一年八月三十一日