

# 中银高质量发展机遇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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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

|  |    |
|--|----|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                       | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| <b>2 基金简介</b> .....                          | 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.....                              | 5  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                 | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 6  |
| <b>4 管理人报告</b> .....                         | 7  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 7  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....              | 8  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 8  |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 9  |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 11 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....       | 11 |
| <b>5 托管人报告</b> .....                         | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....                  | 11 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 11 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....       | 11 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | 11 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 11 |
| 6.2 利润表.....                                 | 13 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 14 |
| 6.4 报表附注.....                                | 15 |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | 34 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 34 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 35 |
| 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.....       | 35 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 40 |
| 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.....      | 40 |
| 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.....   | 40 |
| 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.....   | 40 |
| 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.....      | 40 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 40 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 41 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 41 |
| <b>8 基金份额持有人信息</b> .....                     | 42 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 42 |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 42        |
| 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 ..... | 42        |
| <b>9 开放式基金份额变动</b> .....                | <b>42</b> |
| <b>10 重大事件揭示</b> .....                  | <b>43</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 43        |
| 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 .....  | 43        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 43        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 43        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 43        |
| 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 .....     | 43        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 43        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 44        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....          | <b>45</b> |
| <b>12 备查文件目录</b> .....                  | <b>45</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 45        |
| 12.2 存放地点 .....                         | 46        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 46        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 中银高质量发展机遇混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 中银高质量发展机遇混合        |
| 基金主代码      | 009026             |
| 交易代码       | 009026             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2020年3月25日         |
| 基金管理人      | 中银基金管理有限公司         |
| 基金托管人      | 兴业银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 87,022,324.21 份    |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金主要通过精选投资于高质量发展机遇主题相关证券，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略   | 本基金的资产配置策略主要依托于本基金管理人 的大类资产配置体系，对股票、债券、商品、房地产、现金等主要大类资产的表现进行预测，进而确定本基金对股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的投资比例。                      |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*75%+中债综合全价(总值)指数收益率*20%+恒生指数收益率(经人民币汇率折算)*5%   |
| 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。本基金将投资港股通标的股票，将面临需承担汇率风险、境外市场风险以及港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                          | 基金托管人               |
|-------------|------|--------------------------------|---------------------|
| 名称          |      | 中银基金管理有限公司                     | 兴业银行股份有限公司          |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 欧阳向军                           | 吴玉婷                 |
|             | 联系电话 | 021-38834999                   | 021-52629999-212052 |
|             | 电子邮箱 | clientservice@bocim.com        | xywyt@cib.com.cn    |
| 客户服务电话      |      | 021-38834788 400-888-5566      | 95561               |
| 传真          |      | 021-68873488                   | 021-62159217        |
| 注册地址        |      | 上海市银城中路200号中银大厦45层             | 福州市湖东路154号          |
| 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 | 上海市银城路167号兴业大厦4楼    |
| 邮政编码        |      | 200120                         | 200120              |
| 法定代表人       |      | 章砚                             | 吕家进                 |

### 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 | 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） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 34,636,112.09                        |
| 本期利润          | 9,430,828.36                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0988                               |
| 本期加权平均净值利润率   | 6.36%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 7.36%                                |
| 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      | 48,879,243.31                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.5617                               |
| 期末基金资产净值      | 135,901,567.52                       |
| 期末基金份额净值      | 1.5617                               |
| 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   | 56.17%                               |

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

| 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 | -0.43%   | 0.87%       | -1.50%     | 0.62%         | 1.07% | 0.25% |
| 过去三个月 | 4.29%    | 1.01%       | 2.75%      | 0.76%         | 1.54% | 0.25% |

|           |        |       |        |       |        |       |
|-----------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去六个月     | 7.36%  | 1.53% | 0.73%  | 1.02% | 6.63%  | 0.51% |
| 过去一年      | 44.52% | 1.39% | 19.42% | 1.03% | 25.10% | 0.36% |
| 自基金合同生效日起 | 56.17% | 1.25% | 32.84% | 0.98% | 23.33% | 0.27% |

### 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

中银高质量发展机遇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  
 (2020年3月25日至2021年6月30日)



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 |        |   |
| 王睿 | 基金经理 | 2020-03-25      | -    | 15     | 中银基金管理有限公司高级助理副总裁（SAVP），经济学硕士。曾任华宝兴业基金研究员、交银施罗德基金投资经理。2018 年加入中银基金管理有限公司，2018 年 11 月至今任中银新经济基金经理，2019 年 9 月至今任中银价值基金基金经理，2020 年 3 月至今任中银高质量发展基金基金经理。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，未发现有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，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。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，上半年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。二季度 GDP 同比上涨 3.2%，比一季度高 10 个百分点，彰显出韧性和潜力。从供给端看，工业生产和服务业生产双双反弹，但前者修复幅度明显快于后者。从需求端看，三驾马车动力稍显不足。从物价看，CPI 呈现前高后低、高位回落态势，工业领域陷入持续通缩，6 月有所好转。从就业看，全国城镇调查失业率连续两个月小幅下降。从金融环境看，信贷社融处历史同期高位，宽信用成效显著。从金融市场看，人民币汇率整体贬值，债券市场收益率先降后升。

国外经济方面，上半年受到新冠疫情影响，中国和其他主要发达国家因社交隔离、停工等原因经济大幅负增长，国内在 5 月后逐步复工后生产、交通、消费、PMI 等高频指标也逐步改善。新兴市场国家成为疫情重点，同时美国进入二次爆发阶段，风险点在于美国疫情二次爆发的影响广度是否会造成复工进度的逆转。政策方面，美联储及美国财政部的救助政策逐项落地，失业保险、薪资补助、小企业贷款等援助有助于改善就业和缓解企业信用风险，关注后续是否有进一步的援助计划。综合来看，二季度全球经济深度衰退已成定局，三四季度全球将迎来温和的爬坡式复苏。

#### 2. 市场回顾

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。分行业看，受益于高端制造业如军工、半导体、新能源汽车，以及上游出于涨价通道类资源品表现较好，消费和价值风格表现相对落后。

#### 3. 运行分析

上半年股票市场存在结构性机会，本基金保持高于基准的仓位，采取行业均衡、精选个股策略，

通过自上而下的行业轮动和自下而上的选股策略，增配了科技、周期成长、先进制造等行业获取了超越基准的回报，未来我们仍将坚持恪守安全边际，通过长期持有优质成长股，努力为持有人创造稳健、可持续的收益。

#### 4. 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 4.29%，同期业绩比较基准收益率为 2.75%。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 7.36%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为货币政策将更加强调灵活适度 and 结构性宽松，平衡稳增长和防风险；财政政策将继续发挥稳定经济的关键作用，我们认为市场流动性仍然宽松，随着经济下行，企业盈利寻底仍需要时间，我们将精选长期空间较大的成长股和受益于碳中和的周期成长类公司做为三季度配置方向。我们对 2021 年下半年权益市场的走势保持谨慎乐观。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，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。

本报告期末可供分配利润为 48,879,243.31 元，暂未进行收益分配。

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

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：中银高质量发展机遇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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-----|-----|------------------------|--------------------------|
| 资产： |     | -                      | -                        |

|                   |            |                                |                                  |
|-------------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 银行存款              | 6.4.7.1    | 6,379,872.29                   | 10,983,826.91                    |
| 结算备付金             |            | 158,714.48                     | 391,818.15                       |
| 存出保证金             |            | 61,530.73                      | 217,086.06                       |
| 交易性金融资产           | 6.4.7.2    | 129,504,174.15                 | 144,491,784.21                   |
| 其中：股票投资           |            | 120,694,225.57                 | 134,836,678.51                   |
| 基金投资              |            | -                              | -                                |
| 债券投资              |            | 8,809,948.58                   | 9,655,105.70                     |
| 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           |            | 938,089.03                     | 3,211,017.54                     |
| 应收利息              | 6.4.7.5    | 176,750.91                     | 93,223.48                        |
| 应收股利              |            | -                              | -                                |
| 应收申购款             |            | 42,174.44                      | 102,225.02                       |
| 递延所得税资产           |            | -                              | -                                |
| 其他资产              | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>       |            | <b>137,261,306.03</b>          | <b>159,490,981.37</b>            |
| <b>负债和所有者权益</b>   | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>        |            | -                              | -                                |
| 短期借款              |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债            | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款         |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款           |            | -                              | 3,518,668.96                     |
| 应付赎回款             |            | 956,582.36                     | 2,307,122.48                     |
| 应付管理人报酬           |            | 176,797.36                     | 194,373.49                       |
| 应付托管费             |            | 29,466.24                      | 32,395.56                        |
| 应付销售服务费           |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用            | 6.4.7.7    | 112,754.68                     | 283,067.78                       |
| 应交税费              |            | 1.10                           | 6.39                             |
| 应付利息              |            | -                              | -                                |
| 应付利润              |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债           |            | -                              | -                                |
| 其他负债              | 6.4.7.8    | 84,136.77                      | 154,567.06                       |
| <b>负债合计</b>       |            | <b>1,359,738.51</b>            | <b>6,490,201.72</b>              |
| <b>所有者权益：</b>     |            | -                              | -                                |
| 实收基金              | 6.4.7.9    | 87,022,324.21                  | 105,175,214.77                   |
| 未分配利润             | 6.4.7.10   | 48,879,243.31                  | 47,825,564.88                    |
| <b>所有者权益合计</b>    |            | <b>135,901,567.52</b>          | <b>153,000,779.65</b>            |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |            | <b>137,261,306.03</b>          | <b>159,490,981.37</b>            |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5617 元，基金份额总额 87,022,324.21 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中银高质量发展机遇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<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 3 月 25 日（基<br>金合同生效日）至 2020<br>年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>                |          | <b>11,421,981.81</b>                     | <b>34,190,570.09</b>  |
| 1.利息收入                     |          | 114,497.77                               | 1,169,529.88  |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11 | 23,579.78                                | 240,983.12  |
| 债券利息收入                     |          | 90,917.99                                | 243,552.56  |
| 资产支持证券利息收入                 |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入                 |          | -  | 684,994.20  |
| 证券出借利息收入                   |          | -  | -   |
| 其他利息收入                     |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | 36,392,437.10                            | 8,839,309.59  |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12 | 35,289,446.70                            | 7,836,667.31  |
| 基金投资收益                     |          | -  | -   |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13 | 212,759.59                               | -   |
| 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 | 890,230.81                               | 1,002,642.28  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16 | -25,205,283.73                           | 23,848,030.22   |
| 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 | 120,330.67                               | 333,700.40  |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>1,991,153.45</b>                      | <b>2,795,877.77</b>   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2 | 1,102,680.25                             | 1,715,448.31  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2 | 183,780.01                               | 285,908.02  |
| 3. 销售服务费                   |          | -  | -   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 613,985.63                               | 739,075.28  |
| 5. 利息支出                    |          | -  | -   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -  | -   |
| 6.税金及附加                    |          | 1.10                                     | 8.98  |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 90,706.46                                | 55,437.18   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>9,430,828.36</b>                      | <b>31,394,692.32</b>  |
| 减：所得税费用                    |          | -  | -   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>9,430,828.36</b>                      | <b>31,394,692.32</b>  |

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：中银高质量发展机遇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<br>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）                        | 105,175,214.77                                       | 47,825,564.88  | 153,000,779.65 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 9,430,828.36   | 9,430,828.36   |
| 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）      | -18,152,890.56                                       | -8,377,149.93  | -26,530,040.49 |
| 其中：1.基金申购款                             | 44,986,010.88  | 27,404,762.02  | 72,390,772.90  |
| 2.基金赎回款                                | -63,138,901.44                                       | -35,781,911.95 | -98,920,813.39 |
| 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）                        | 87,022,324.21  | 48,879,243.31  | 135,901,567.52 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）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）                        | 441,036,253.25                                       | -              | 441,036,253.25 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 31,394,692.32  | 31,394,692.32  |
| 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）      | -93,090,896.09                                       | -3,356,026.60  | -96,446,922.69 |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,368,526.66   | 80,977.84      | 2,449,504.50   |
| 2.基金赎回款                                | -95,459,422.75                                       | -3,437,004.44  | -98,896,427.19 |
| 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）                        | 347,945,357.16                                       | 28,038,665.72  | 375,984,022.88 |

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

中银高质量发展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[2020]220 号文《关于准予中银高质量发展混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人中银基金管理有限公司于 2020 年 3 月 2 日至 2020 年 3 月 20 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2020)验字第 61062100\_B05 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 3 月 25 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 440,865,599.37 元；在募集期间产生的利息为人民币 170,653.88 元，折合 170,653.88 份基金份额。以上实收基金（本息）合计为人民币 441,036,253.25 元，折合 441,036,253.25 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为中银基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的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、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、央行票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、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相关规定）。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*75%+恒生指数收益率（经人民币汇率折算）\*5%+中债综合全价（总值）指数收益率\*20%。

### 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 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品



管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 6,379,872.29           |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 6,379,872.29           |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                |              |
|---------------|------------------------|----------------|--------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动       |
| 股票            | 121,167,294.49         | 120,694,225.57 | -473,068.92  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -            |
| 债券            | 交易所市场                  | 8,781,011.44   | 8,809,948.58 |
|               | 银行间市场                  | -              | -            |
|               | 合计                     | 8,781,011.44   | 8,809,948.58 |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -            |
| 基金            | -                      | -              | -            |
| 其他            | -                      | -              | -            |
| 合计            | 129,948,305.93         | 129,504,174.15 | -444,131.78  |

#### 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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,036.49               |
| 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  | 71.40                  |
| 应收债券利息     | 175,615.19             |
| 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    | 0.13       |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -          |
| 应收出借证券利息   | -          |
| 其他         | 27.70      |
| 合计         | 176,750.91 |

#### 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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 112,754.68             |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 112,754.68             |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 293.61                 |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付账户维护费     | 4,500.00               |
| 应付信息披露费     | 59,507.37              |
| 应付审计费       | 19,835.79              |
| 合计          | 84,136.77              |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 105,175,214.77                        | 105,175,214.77 |
| 本期申购          | 44,986,010.88                         | 44,986,010.88  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -63,138,901.44                        | -63,138,901.44 |
| 本期末           | 87,022,324.21                         | 87,022,324.21  |

#### 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           | 42,618,721.97  | 5,206,842.91   | 47,825,564.88  |
| 本期利润           | 34,636,112.09  | -25,205,283.73 | 9,430,828.36   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -10,159,233.96 | 1,782,084.03   | -8,377,149.93  |
| 其中：基金申购款       | 26,144,165.03  | 1,260,596.99   | 27,404,762.02  |
| 基金赎回款          | -36,303,398.99 | 521,487.04     | -35,781,911.95 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 67,095,600.10  | -18,216,356.79 | 48,879,243.31  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 19,160.15                  |
| 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 | 2,910.22                   |
| 其他        | 1,509.41                   |
| 合计        | 23,579.78                  |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 208,526,395.54             |
| 减：卖出股票成本总额 | 173,236,948.84             |
| 买卖股票差价收入   | 35,289,446.70              |

#### 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<br>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   | 3,108,509.42               |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,864,696.32               |
| 减：应收利息总额               | 31,053.51                  |
| 买卖债券差价收入               | 212,759.59                 |

##### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 890,230.81                 |
| 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            | 890,230.81                 |

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | -25,205,283.73             |
| ——股票投资                     | -25,076,687.17             |
| ——债券投资                     | -128,596.56                |
| ——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<br>预估增值税 | -                          |
| 合计                         | -25,205,283.73             |

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 108,148.87                 |
| 转换费收入   | 12,181.80                  |
| 合计      | 120,330.67                 |

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.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 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 | 613,985.63                      |
| 银行间市场交易费用 | -                               |
| 合计        | 613,985.63                      |

**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    | 2,363.30             |
| 银行间账户维护费 | 9,000.00             |
| 合计       | 90,706.46            |

**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，本基金无需要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**

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 基金托管人、基金销售机构        |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 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<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年3月25日（基金合同生<br>效日）至2020年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,102,680.25                   | 1,715,448.31                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 308,978.99                     | 1,004,896.36                                  |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年3月25日（基金合同生<br>效日）至2020年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 183,780.01                     | 285,908.02                                    |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

**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**

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。

**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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2020年3月25日（基金合同生效日）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     |
| 兴业银行股份有限公司 | 6,379,872.29               | 19,160.15 | 67,341,743.21                             | 216,043.28 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，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 | 183      | 4,501.80  | 29,829.00  | -  |
| 688383               | 新益昌  | 2021-04-21 | 2021-10-28 | 新股锁定期内 | 19.58 | 106.24 | 1,959    | 38,357.22 | 208,124.16 | -  |
| 688217               | 睿昂基因 | 2021-05-07 | 2021-11-17 | 新股锁定期内 | 18.42 | 58.40  | 1,040    | 19,156.80 | 60,736.00  | -  |
| 688239               | 航宇科技 | 2021-06-25 | 2021-07-05 | 新股未上   | 11.48 | 11.48  | 4,926    | 56,550.48 | 56,550.48  | -  |



|        |      |            |            |        |       |        |       |           |           |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
|        |      |            |            | 市      |       |        |       |           |           |   |
| 301018 | 申菱环境 | 2021-06-28 | 2021-07-07 | 新股未上市  | 8.29  | 8.29   | 6,800 | 56,372.00 | 56,372.00 | - |
| 688350 | 富淼科技 | 2021-01-21 | 2021-07-28 | 新股锁定期内 | 13.58 | 22.44  | 2,297 | 31,193.26 | 51,544.68 | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021-06-23 | 2021-07-05 | 新股未上市  | 8.86  | 8.86   | 4,887 | 43,298.82 | 43,298.82 | - |
| 688499 | 利元亨  | 2021-06-23 | 2021-07-01 | 新股未上市  | 38.85 | 38.85  | 992   | 38,539.20 | 38,539.20 | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021-06-30 | 2021-07-09 | 新股未上市  | 21.96 | 21.96  | 1,333 | 29,272.68 | 29,272.68 | - |
| 300957 | 贝泰妮  | 2021-03-18 | 2021-09-27 | 新股锁定期内 | 47.33 | 251.96 | 105   | 4,969.65  | 26,455.80 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股未上市  | 9.46  | 9.46   | 2,616 | 24,747.36 | 24,747.36 | - |
| 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 | - |
| 300953 | 震裕科技 | 2021-03-11 | 2021-09-22 | 新股锁定期内 | 28.77 | 99.85  | 161   | 4,631.97  | 16,075.85 | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021-04-15 | 2021-10-26 | 新股锁定期内 | 33.22 | 87.50  | 176   | 5,846.72  | 15,400.00 | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021-06-22 | 2021-12-30 | 新股锁定期内 | 7.64  | 38.83  | 382   | 2,918.48  | 14,833.06 | - |
| 300982 | 苏文电能 | 2021-04-19 | 2021-10-27 | 新股锁定期内 | 15.83 | 45.29  | 317   | 5,018.11  | 14,356.93 | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021-04-08 | 2021-10-15 | 新股锁定期内 | 28.28 | 115.71 | 123   | 3,478.44  | 14,232.33 | - |
| 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 | - |
| 30093  | 药易   | 2021-0     | 2021-0     | 新股     | 12.25 | 53.71  | 244   | 2,989.    | 13,105    | - |

|        |      |            |            |        |       |       |     |           |           |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 7      | 购    | 1-20       | 7-27       | 锁定期内   |       |       |     | 00        | .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 | - |
| 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 | - |
| 300955 | 嘉亨家化 | 2021-03-16 | 2021-09-24 | 新股锁定期内 | 16.53 | 46.07 | 232 | 3,834.96  | 10,688.24 | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021-04-19 | 2021-10-27 | 新股锁定期内 | 48.59 | 90.39 | 108 | 5,247.72  | 9,762.12  | - |
| 301002 | 崧盛股份 | 2021-05-27 | 2021-12-07 | 新股锁定期内 | 18.71 | 57.62 | 169 | 3,161.99  | 9,737.78  | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021-03-29 | 2021-10-11 | 新股锁定期内 | 3.40  | 16.37 | 576 | 1,958.40  | 9,429.12  | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021-03-03 | 2021-09-13 | 新股锁定期内 | 11.72 | 27.08 | 337 | 3,949.64  | 9,125.96  | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021-03-31 | 2021-10-11 | 新股锁定期内 | 8.24  | 31.54 | 286 | 2,356.64  | 9,020.44  | - |
| 300945 | 曼卡龙  | 2021-02-03 | 2021-08-10 | 新股锁定期内 | 4.56  | 18.88 | 474 | 2,161.44  | 8,949.12  | - |
| 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  | - |
| 301016 | 雷尔伟  | 2021-06-23 | 2021-12-30 | 新股锁定期内 | 13.75 | 32.98 | 267 | 3,671.25  | 8,805.66  | - |
| 300956 | 英力股份 | 2021-03-16 | 2021-09-27 | 新股锁定期内 | 12.85 | 25.80 | 341 | 4,381.85  | 8,797.80  | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021-03-23 | 2021-09-30 | 新股锁定期内 | 8.48  | 22.07 | 394 | 3,341.12  | 8,695.58  | - |

|        |      |            |            |        |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 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 | - |
| 300958 | 建工修复 | 2021-03-18 | 2021-09-29 | 新股锁定期内 | 8.53  | 27.22 | 300 | 2,559.00 | 8,166.00 | - |
| 300987 | 川网传媒 | 2021-04-28 | 2021-11-11 | 新股锁定期内 | 6.79  | 26.81 | 301 | 2,043.79 | 8,069.81 | - |
| 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 | - |
| 300968 | 格林精密 | 2021-04-06 | 2021-10-15 | 新股锁定期内 | 6.87  | 12.07 | 595 | 4,087.65 | 7,181.65 | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021-04-15 | 2021-10-26 | 新股锁定期内 | 8.42  | 13.60 | 508 | 4,277.36 | 6,908.80 | - |
| 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 | - |
| 300991 | 创益通  | 2021-05-12 | 2021-11-22 | 新股锁定期内 | 13.06 | 26.51 | 254 | 3,317.24 | 6,733.54 | - |
| 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 | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021-04-14 | 2021-10-21 | 新股锁定期内 | 5.48  | 13.03 | 492 | 2,696.16 | 6,410.76 | - |
| 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 | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021-04-02 | 2021-10-13 | 新股锁定期内 | 4.54  | 11.54 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78 | - |
| 300972 | 万辰生物 | 2021-04-08 | 2021-10-19 | 新股锁定期内 | 7.19  | 12.65 | 430 | 3,091.70 | 5,439.50 | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021-03-22 | 2021-09-29 | 新股锁定   | 12.08 | 23.06 | 234 | 2,826.72 | 5,396.04 | - |

|                             |      |            |            |        |        |        |          |           |           |    |
|-----------------------------|------|------------|------------|--------|--------|--------|----------|-----------|-----------|----|
|                             |      |            |            | 期内     |        |        |          |           |           |    |
| 300986                      | 志特新材 | 2021-04-21 | 2021-11-01 | 新股锁定期内 | 14.79  | 30.57  | 172      | 2,543.88  | 5,258.04  | -  |
| 301017                      | 漱玉平民 | 2021-06-23 | 2022-01-05 | 新股锁定期内 | 8.86   | 8.86   | 544      | 4,819.84  | 4,819.84  | -  |
| 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  | -  |
| 300985                      | 致远新能 | 2021-04-21 | 2021-11-02 | 新股锁定期内 | 24.90  | 24.81  | 121      | 3,012.90  | 3,002.01  | -  |
| <b>6.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b> |      |            |            |        |        |        |          |           |           |    |
| 证券代码                        | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量(单位：张) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 113050                      | 南银转债 | 2021-06-17 | 2021-07-01 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 410      | 41,000.00 | 41,000.00 | -  |

**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****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，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

**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 0.22%(2020 年 12 月 31 日：0.34%)。

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 | 上年末 |
|--------|-----|-----|
|--------|-----|-----|

|        | 2021年6月30日   | 2020年12月31日  |
|--------|--------------|--------------|
| A-1    | -            | -            |
| A-1 以下 | -            | -            |
| 未评级    | 8,512,000.00 | 9,132,112.80 |
| 合计     | 8,512,000.00 | 9,132,112.80 |

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 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<br>2021年6月30日 | 上年末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 135,512.10        | 446,822.90         |
| AAA 以下 | 162,436.48        | 76,170.00          |
| 未评级    | -                 | -                  |
| 合计     | 297,948.58        | 522,992.90         |

#### 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公司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，本基金所承担的全部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，因此账面余额即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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                   | 6,379,872.29  | -     | -          | -              | 6,379,872.29   |
| 结算备付金                  | 158,714.48    | -     | -          | -              | 158,714.48     |
| 存出保证金                  | 61,530.73     | -     | -          | -              | 61,530.73      |
| 交易性金融资产                | 8,512,000.00  | -     | 297,948.58 | 120,694,225.57 | 129,504,174.15 |
| 应收证券清算款                | -             | -     | -          | 938,089.03     | 938,089.03     |
| 应收利息                   | -             | -     | -          | 176,750.91     | 176,750.91     |
| 应收申购款                  | 70.00         | -     | -          | 42,104.44      | 42,174.44      |
| 资产总计                   | 15,112,187.50 | -     | 297,948.58 | 121,851,169.95 | 137,261,306.03 |
| 负债                     |               |       |            |                |                |
| 应付赎回款                  | -             | -     | -          | 956,582.36     | 956,582.36     |
| 应付管理人报酬                | -             | -     | -          | 176,797.36     | 176,797.36     |
| 应付托管费                  | -             | -     | -          | 29,466.24      | 29,466.24      |

|                             |               |            |            |                |                |
|-----------------------------|---------------|------------|------------|----------------|----------------|
| 应付交易费用                      | -             | -          | -          | 112,754.68     | 112,754.68     |
| 应交税费                        | -             | -          | -          | 1.10           | 1.10           |
| 其他负债                        | -             | -          | -          | 84,136.77      | 84,136.77      |
| 负债总计                        | -             | -          | -          | 1,359,738.51   | 1,359,738.51   |
| 利率敏感度缺口                     | 15,112,187.50 | -          | 297,948.58 | 120,491,431.44 | 135,901,567.52 |
| 上年度末<br>2020 年 12 月 31<br>日 | 1 年以内         | 1-5 年      | 5 年以上      | 不计息            | 合计             |
| 资产                          |               |            |            |                |                |
| 银行存款                        | 10,983,826.91 | -          | -          | -              | 10,983,826.91  |
| 结算备付金                       | 391,818.15    | -          | -          | -              | 391,818.15     |
| 存出保证金                       | 217,086.06    | -          | -          | -              | 217,086.06     |
| 交易性金融资产                     | 9,132,112.80  | 446,822.90 | 76,170.00  | 134,836,678.51 | 144,491,784.21 |
| 应收证券清算款                     | -             | -          | -          | 3,211,017.54   | 3,211,017.54   |
| 应收利息                        | -             | -          | -          | 93,223.48      | 93,223.48      |
| 应收申购款                       | 299.96        | -          | -          | 101,925.06     | 102,225.02     |
| 资产总计                        | 20,725,143.88 | 446,822.90 | 76,170.00  | 138,242,844.59 | 159,490,981.37 |
| 负债                          |               |            |            |                |                |
| 应付证券清算款                     | -             | -          | -          | 3,518,668.96   | 3,518,668.96   |
| 应付赎回款                       | -             | -          | -          | 2,307,122.48   | 2,307,122.48   |
| 应付管理人报酬                     | -             | -          | -          | 194,373.49     | 194,373.49     |
| 应付托管费                       | -             | -          | -          | 32,395.56      | 32,395.56      |
| 应付交易费用                      | -             | -          | -          | 283,067.78     | 283,067.78     |
| 应交税费                        | -             | -          | -          | 6.39           | 6.39           |
| 其他负债                        | -             | -          | -          | 154,567.06     | 154,567.06     |
| 负债总计                        | -             | -          | -          | 6,490,201.72   | 6,490,201.72   |
| 利率敏感度缺口                     | 20,725,143.88 | 446,822.90 | 76,170.00  | 131,752,642.87 | 153,000,779.65 |

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 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例低于 10%（2020 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：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。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目                    | 上年度末<br>2020年12月31日 |                     |                     |
|-----------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
|                       | 美元<br>折合人民币         | 港币<br>折合人民币         | 合计                  |
| 以外币计价的资产              |                     |                     |                     |
| 交易性金融资产               | -                   | 3,612,739.70        | 3,612,739.70        |
| 资产合计                  | -                   | <b>3,612,739.70</b> | <b>3,612,739.70</b> |
| 以外币计价的负债              |                     |                     |                     |
| 负债合计                  | -                   | -                   | -                   |
| 资产负债表<br>外汇风险敞<br>口净额 | -                   | <b>3,612,739.70</b> | <b>3,612,739.70</b> |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 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<br>影响金额（单位：人民币万元） |                     |
|--------------|--------------|----------------------------------|---------------------|
|              |              | 本期末<br>2021年6月30日                | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|              | 港币相对人民币升值 5% | -                                | 增加约 18              |
| 港币相对人民币贬值 5% | -            | 减少约 18                           |                     |

#### 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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

#### 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<br>2021年6月30日 |              | 上年度末<br>2020年12月31日 |               |
|----|-------------------|--------------|---------------------|---------------|
|    | 公允价值              | 占基金资产<br>净值比 | 公允价值                | 占基金资产<br>净值比例 |
|    |                   |              |                     |               |

|               |                | 例 (%) |                | (%)   |
|---------------|----------------|-------|----------------|-------|
| 交易性金融资产—股票投资  | 120,694,225.57 | 88.81 | 134,836,678.51 | 88.13 |
| 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            | 120,694,225.57 | 88.81 | 134,836,678.51 | 88.13 |

#### 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<br>2021年6月30日            | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|    | 1. 业绩比较基准上升5%  | 增加约 784                      | 增加约 654             |
|    | 2. 业绩比较基准下降5%  | 减少约 784                      | 减少约 654             |

#### 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         | 120,694,225.57 | 87.93         |
|    | 其中：股票        | 120,694,225.57 | 87.93         |
| 2  | 基金投资         | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资       | 8,809,948.58   | 6.42          |
|    | 其中：债券        | 8,809,948.58   | 6.42          |
|    | 资产支持证券       | -              | -             |
| 4  | 贵金属投资        | -              | -             |
| 5  | 金融衍生品投资      | -              | -             |
| 6  | 买入返售金融资产     | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返 | -              | -             |

|   |              |                |        |
|---|--------------|----------------|--------|
|   | 售金融资产        |                |        |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 6,538,586.77   | 4.76   |
| 8 | 其他各项资产       | 1,218,545.11   | 0.89   |
| 9 | 合计           | 137,261,306.03 | 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         | 1,116,934.28   | 0.82         |
| B  | 采矿业              | 7,763,914.03   | 5.71         |
| C  | 制造业              | 80,721,581.63  | 59.40        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,797,270.00   | 3.53         |
| E  | 建筑业              | 25,371.37      | 0.02         |
| F  | 批发和零售业           | 91,416.84      | 0.07         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 10,564,576.10  | 7.77         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 6,138,050.56   | 4.52         |
| J  | 金融业              | 4,713,778.10   | 3.47         |
| K  | 房地产业             | 2,126,233.00   | 1.56         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 201,414.66     | 0.15         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | 2,433,685.00   | 1.79         |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 120,694,225.57 | 88.81        |

### 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  | 002352 | 顺丰控股 | 132,843 | 8,993,471.10 | 6.62 |
| 2  | 601233 | 桐昆股份 | 294,288 | 7,089,397.92 | 5.22 |
| 3  | 002415 | 海康威视 | 109,200 | 7,043,400.00 | 5.18 |
| 4  | 603517 | 绝味食品 | 74,598  | 6,287,865.42 | 4.63 |
| 5  | 002493 | 荣盛石化 | 345,750 | 5,971,102.50 | 4.39 |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 73,500  | 5,245,695.00 | 3.86 |
| 7  | 600900 | 长江电力 | 232,200 | 4,792,608.00 | 3.53 |
| 8  | 601899 | 紫金矿业 | 453,585 | 4,395,238.65 | 3.23 |
| 9  | 002920 | 德赛西威 | 37,700  | 4,150,016.00 | 3.05 |
| 10 | 002271 | 东方雨虹 | 64,822  | 3,585,953.04 | 2.64 |
| 11 | 600486 | 扬农化工 | 31,200  | 3,487,224.00 | 2.57 |
| 12 | 600031 | 三一重工 | 109,400 | 3,180,258.00 | 2.34 |
| 13 | 600456 | 宝钛股份 | 65,900  | 2,827,110.00 | 2.08 |
| 14 | 000902 | 新洋丰  | 177,200 | 2,769,636.00 | 2.04 |
| 15 | 603613 | 国联股份 | 27,375  | 2,736,678.75 | 2.01 |
| 16 | 300408 | 三环集团 | 60,600  | 2,570,652.00 | 1.89 |
| 17 | 600309 | 万华化学 | 23,162  | 2,520,488.84 | 1.85 |
| 18 | 000733 | 振华科技 | 40,400  | 2,467,228.00 | 1.82 |
| 19 | 002607 | 中公教育 | 116,500 | 2,433,685.00 | 1.79 |
| 20 | 600346 | 恒力石化 | 88,400  | 2,319,616.00 | 1.71 |
| 21 | 000002 | 万科A  | 89,300  | 2,126,233.00 | 1.56 |
| 22 | 603993 | 洛阳钼业 | 401,600 | 2,072,256.00 | 1.52 |
| 23 | 600406 | 国电南瑞 | 77,040  | 1,790,409.60 | 1.32 |
| 24 | 600690 | 海尔智家 | 66,500  | 1,723,015.00 | 1.27 |
| 25 | 300558 | 贝达药业 | 15,400  | 1,666,896.00 | 1.23 |
| 26 | 600519 | 贵州茅台 | 800     | 1,645,360.00 | 1.21 |
| 27 | 603501 | 韦尔股份 | 4,800   | 1,545,600.00 | 1.14 |
| 28 | 300454 | 深信服  | 5,900   | 1,530,932.00 | 1.13 |
| 29 | 600030 | 中信证券 | 59,500  | 1,483,930.00 | 1.09 |
| 30 | 000708 | 中信特钢 | 70,536  | 1,469,970.24 | 1.08 |
| 31 | 603799 | 华友钴业 | 12,100  | 1,381,820.00 | 1.02 |
| 32 | 600711 | 盛屯矿业 | 181,826 | 1,296,419.38 | 0.95 |
| 33 | 600111 | 北方稀土 | 61,200  | 1,266,840.00 | 0.93 |
| 34 | 601398 | 工商银行 | 235,400 | 1,217,018.00 | 0.90 |
| 35 | 601939 | 建设银行 | 168,900 | 1,123,185.00 | 0.83 |
| 36 | 002299 | 圣农发展 | 46,300  | 1,105,644.00 | 0.81 |
| 37 | 002444 | 巨星科技 | 29,300  | 998,544.00   | 0.73 |
| 38 | 300003 | 乐普医疗 | 31,000  | 995,720.00   | 0.73 |
| 39 | 000630 | 铜陵有色 | 332,400 | 904,128.00   | 0.67 |
| 40 | 601111 | 中国国航 | 116,200 | 904,036.00   | 0.67 |
| 41 | 300775 | 三角防务 | 23,100  | 882,420.00   | 0.65 |
| 42 | 601318 | 中国平安 | 13,300  | 854,924.00   | 0.63 |
| 43 | 601816 | 京沪高铁 | 126,100 | 667,069.00   | 0.49 |
| 44 | 600305 | 恒顺醋业 | 30,706  | 587,098.72   | 0.43 |

|    |        |       |        |            |      |
|----|--------|-------|--------|------------|------|
| 45 | 002179 | 中航光电  | 6,900  | 545,238.00 | 0.40 |
| 46 | 000723 | 美锦能源  | 64,800 | 489,888.00 | 0.36 |
| 47 | 000338 | 潍柴动力  | 26,700 | 477,129.00 | 0.35 |
| 48 | 002675 | 东诚药业  | 18,300 | 385,581.00 | 0.28 |
| 49 | 688690 | 纳微科技  | 3,268  | 383,990.00 | 0.28 |
| 50 | 000878 | 云南铜业  | 25,100 | 322,033.00 | 0.24 |
| 51 | 002078 | 太阳纸业  | 15,900 | 212,265.00 | 0.16 |
| 52 | 688383 | 新益昌   | 1,959  | 208,124.16 | 0.15 |
| 53 | 300298 | 三诺生物  | 5,600  | 175,392.00 | 0.13 |
| 54 | 688029 | 南微医学  | 478    | 148,987.82 | 0.11 |
| 55 | 002266 | 浙富控股  | 23,900 | 119,261.00 | 0.09 |
| 56 | 603313 | 梦百合   | 3,800  | 114,190.00 | 0.08 |
| 57 | 688217 | 睿昂基因  | 1,040  | 60,736.00  | 0.04 |
| 58 | 002315 | 焦点科技  | 3,300  | 59,730.00  | 0.04 |
| 59 | 688239 | 航宇科技  | 4,926  | 56,550.48  | 0.04 |
| 60 | 000888 | 峨眉山 A | 8,800  | 56,408.00  | 0.04 |
| 61 | 301018 | 申菱环境  | 6,800  | 56,372.00  | 0.04 |
| 62 | 688350 | 富淼科技  | 2,297  | 51,544.68  | 0.04 |
| 63 | 301017 | 漱玉平民  | 5,431  | 48,118.66  | 0.04 |
| 64 | 688499 | 利元亨   | 992    | 38,539.20  | 0.03 |
| 65 | 601528 | 瑞丰银行  | 2,230  | 34,721.10  | 0.03 |
| 66 | 300919 | 中伟股份  | 183    | 29,829.00  | 0.02 |
| 67 | 688087 | 英科再生  | 1,333  | 29,272.68  | 0.02 |
| 68 | 300957 | 贝泰妮   | 105    | 26,455.80  | 0.02 |
| 69 | 301021 | 英诺激光  | 2,616  | 24,747.36  | 0.02 |
| 70 | 001207 | 联科科技  | 682    | 22,581.02  | 0.02 |
| 71 | 688226 | 威腾电气  | 2,693  | 17,289.06  | 0.01 |
| 72 | 300953 | 震裕科技  | 161    | 16,075.85  | 0.01 |
| 73 | 300979 | 华利集团  | 176    | 15,400.00  | 0.01 |
| 74 | 301015 | 百洋医药  | 382    | 14,833.06  | 0.01 |
| 75 | 300982 | 苏文电能  | 317    | 14,356.93  | 0.01 |
| 76 | 300973 | 立高食品  | 123    | 14,232.33  | 0.01 |
| 77 | 001208 | 华菱线缆  | 1,754  | 13,558.42  | 0.01 |
| 78 | 300940 | 南极光   | 307    | 13,317.66  | 0.01 |
| 79 | 300937 | 药易购   | 244    | 13,105.24  | 0.01 |
| 80 | 301013 | 利和兴   | 471    | 12,768.81  | 0.01 |
| 81 | 300942 | 易瑞生物  | 443    | 12,634.36  | 0.01 |
| 82 | 603171 | 税友股份  | 637    | 12,230.40  | 0.01 |
| 83 | 605287 | 德才股份  | 349    | 11,014.44  | 0.01 |
| 84 | 300955 | 嘉亨家化  | 232    | 10,688.24  | 0.01 |
| 85 | 300981 | 中红医疗  | 108    | 9,762.12   | 0.01 |
| 86 | 301002 | 崧盛股份  | 169    | 9,737.78   | 0.01 |
| 87 | 300962 | 中金辐照  | 576    | 9,429.12   | 0.01 |
| 88 | 300952 | 恒辉安防  | 337    | 9,125.96   | 0.01 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 89  | 300966 | 共同药业 | 286 | 9,020.44 | 0.01 |
| 90  | 300945 | 曼卡龙  | 474 | 8,949.12 | 0.01 |
| 91  | 300948 | 冠中生态 | 324 | 8,884.08 | 0.01 |
| 92  | 301016 | 雷尔伟  | 267 | 8,805.66 | 0.01 |
| 93  | 300956 | 英力股份 | 341 | 8,797.80 | 0.01 |
| 94  | 300961 | 深水海纳 | 394 | 8,695.58 | 0.01 |
| 95  | 300950 | 德固特  | 219 | 8,569.47 | 0.01 |
| 96  | 300958 | 建工修复 | 300 | 8,166.00 | 0.01 |
| 97  | 300987 | 川网传媒 | 301 | 8,069.81 | 0.01 |
| 98  | 300930 | 屹通新材 | 322 | 7,882.56 | 0.01 |
| 99  | 300968 | 格林精密 | 595 | 7,181.65 | 0.01 |
| 100 | 300978 | 东箭科技 | 508 | 6,908.80 | 0.01 |
| 101 | 301004 | 嘉益股份 | 312 | 6,845.28 | 0.01 |
| 102 | 300991 | 创益通  | 254 | 6,733.54 | 0.00 |
| 103 | 300927 | 江天化学 | 217 | 6,531.70 | 0.00 |
| 104 | 300975 | 商络电子 | 492 | 6,410.76 | 0.00 |
| 105 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 106 | 300943 | 春晖智控 | 255 | 5,867.55 | 0.00 |
| 107 | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 108 | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50 | 0.00 |
| 109 | 300960 | 通业科技 | 234 | 5,396.04 | 0.00 |
| 110 | 300986 | 志特新材 | 172 | 5,258.04 | 0.00 |
| 111 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 112 | 301007 | 德迈仕  | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 113 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 114 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 0.00 |
| 115 | 300985 | 致远新能 | 121 | 3,002.01 | 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 | 7,621,558.12 | 4.98            |
| 2  | 000333 | 美的集团 | 7,357,442.00 | 4.81            |
| 3  | 601233 | 桐昆股份 | 6,900,776.48 | 4.51            |
| 4  | 601398 | 工商银行 | 5,475,768.00 | 3.58            |
| 5  | 600486 | 扬农化工 | 5,379,112.00 | 3.52            |
| 6  | 002493 | 荣盛石化 | 5,274,092.79 | 3.45            |
| 7  | 600406 | 国电南瑞 | 5,084,843.99 | 3.32            |
| 8  | 600031 | 三一重工 | 4,706,394.81 | 3.08            |
| 9  | 600309 | 万华化学 | 4,671,440.00 | 3.05            |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 10 | 000708 | 中信特钢  | 3,950,355.35 | 2.58 |
| 11 | 000733 | 振华科技  | 3,843,700.00 | 2.51 |
| 12 | 002920 | 德赛西威  | 3,666,756.63 | 2.40 |
| 13 | 601899 | 紫金矿业  | 3,609,229.30 | 2.36 |
| 14 | 000902 | 新洋丰   | 3,536,184.72 | 2.31 |
| 15 | 300408 | 三环集团  | 3,466,085.00 | 2.27 |
| 16 | 002607 | 中公教育  | 3,280,308.00 | 2.14 |
| 17 | 002179 | 中航光电  | 3,193,697.00 | 2.09 |
| 18 | 600346 | 恒力石化  | 3,148,938.00 | 2.06 |
| 19 | 002318 | 久立特材  | 3,120,491.60 | 2.04 |
| 20 | 000002 | 万 科 A | 2,796,324.00 | 1.83 |

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  | 002271 | 东方雨虹  | 11,259,189.08 | 7.36            |
| 2  | 603517 | 绝味食品  | 9,737,168.91  | 6.36            |
| 3  | 600519 | 贵州茅台  | 8,071,043.82  | 5.28            |
| 4  | 601318 | 中国平安  | 6,692,528.00  | 4.37            |
| 5  | 002841 | 视源股份  | 5,933,504.39  | 3.88            |
| 6  | 000733 | 振华科技  | 5,463,834.41  | 3.57            |
| 7  | 600305 | 恒顺醋业  | 5,393,532.56  | 3.53            |
| 8  | 002064 | 华峰化学  | 4,678,724.95  | 3.06            |
| 9  | 000858 | 五 粮 液 | 4,458,043.00  | 2.91            |
| 10 | 601398 | 工商银行  | 4,439,887.00  | 2.90            |
| 11 | 00388  | 香港交易所 | 4,116,338.27  | 2.69            |
| 12 | 002352 | 顺丰控股  | 3,727,573.00  | 2.44            |
| 13 | 002318 | 久立特材  | 3,693,969.00  | 2.41            |
| 14 | 600893 | 航发动力  | 3,535,676.00  | 2.31            |
| 15 | 002311 | 海大集团  | 3,422,085.08  | 2.24            |
| 16 | 002179 | 中航光电  | 3,396,409.57  | 2.22            |
| 17 | 600406 | 国电南瑞  | 3,263,975.00  | 2.13            |
| 18 | 002299 | 圣农发展  | 3,100,048.14  | 2.03            |
| 19 | 600900 | 长江电力  | 3,093,676.42  | 2.02            |
| 20 | 001914 | 招商积余  | 2,967,148.00  | 1.94            |

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

金额单位：人民币元

|               |                |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 184,171,183.07 |
|---------------|----------------|

|               |                |
|---------------|----------------|
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 208,526,395.54 |
|---------------|----------------|

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      | 8,512,000.00 | 6.26         |
| 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） | 297,948.58   | 0.22         |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 8,809,948.58 | 6.48         |

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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  | 019640 | 20 国债 10 | 85,120 | 8,512,000.00 | 6.26         |
| 2  | 127031 | 洋丰转债     | 1,412  | 162,436.48   | 0.12         |
| 3  | 110079 | 杭银转债     | 830    | 94,512.10    | 0.07         |
| 4  | 113050 | 南银转债     | 410    | 41,000.00    | 0.03         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

### 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。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

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

### 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   | 61,530.73    |
| 2  | 应收证券清算款 | 938,089.03   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 176,750.91   |
| 5  | 应收申购款   | 42,174.44    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,218,545.11 |

### 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

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 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

| 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   |
| 5,136    | 16,943.60 | 33,907,183.43 | 38.9638% | 53,115,140.78 | 61.0362% |

### 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 | 304,222.78 | 0.3496%  |

### 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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0~10              |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2020年3月25日）基金份额总额 | 441,036,253.25 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 105,175,214.77 |
| 本报告期基金总申购份额               | 44,986,010.88  |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 63,138,901.44  |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额              | 87,022,324.21  |

## 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 |    |
| 国信证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 兴业证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国泰君安 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 海通证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中泰证券 | 2      | 240,929,603.50 | 62.15%       | 222,053.83 | 62.09%     | -  |
| 西南证券 | 1      | 52,245,001.66  | 13.48%       | 47,610.74  | 13.31%     | -  |
| 东北证券 | 2      | 50,228,978.17  | 12.96%       | 46,645.75  | 13.04%     | -  |
| 天风证券 | 2      | 14,983,604.87  | 3.87%        | 13,828.43  | 3.87%      | -  |
| 长江证券 | 2      | 12,174,718.50  | 3.14%        | 11,805.24  | 3.30%      | -  |
| 申万宏源 | 2      | 6,985,138.26   | 1.80%        | 6,365.46   | 1.78%      | -  |
| 华泰证券 | 2      | 6,277,639.38   | 1.62%        | 5,846.31   | 1.63%      | -  |
| 国金证券 | 1      | 2,435,733.12   | 0.63%        | 2,219.71   | 0.62%      | -  |
| 东方证券 | 1      | 1,015,255.00   | 0.26%        | 925.20     | 0.26%      | -  |
| 光大证券 | 1      | 381,561.72     | 0.10%        | 355.32     | 0.10%      | -  |

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：无。

### 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 |
| 国信证券 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 兴业证券 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国泰君安 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 海通证券 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券 | 3,187,363.29 | 75.44%       | -    | -            | -    | -            |
| 西南证券 | 22,998.00    | 0.54%        | -    | -            | -    | -            |
| 东北证券 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 天风证券 | 861,707.91   | 20.40%       | -    | -            | -    | -            |
| 长江证券 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 申万宏源 | 152,805.60   | 3.62%        | -    | -            | -    | -            |
| 华泰证券 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国金证券 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东方证券 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 光大证券 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|--|-----------|------------|
| 1  | 中银高质量发展机遇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  | 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 |
| 4  | 中银高质量发展机遇混合型证券投资基金                                       | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-30 |

|    |  |           |            |
|----|--|-----------|------------|
|    | 2020 年年度报告   |           |            |
| 5  | 中银高质量发展机遇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 |
| 6  | 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 |
| 7  | 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 |
| 8  | 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 |
| 9  | 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 |
| 10 | 中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加交通银行股份有限公司为销售机构的公告                                 | 中国证监会规定媒介 | 2021-06-23 |

## 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              | 2021-04-22 至<br>2021-04-28 | 8,417,375.20 | 10,167,349.53 | 3,000,000.00 | 15,584,724.73 | 17.9089% |
| 产品特有风险   |                |                            |              |               |              |               |          |
| <p>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。</p> |                |                            |              |               |              |               |          |

## 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高质量发展机遇混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中银高质量发展机遇混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银高质量发展机遇混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中银高质量发展机遇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。

中银基金管理有限公司  
二〇二一年八月三十一日