

中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置 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：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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
1.2 目录.....	3
§ 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.....	6
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
3.3 其他指标.....	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	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	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	49
§ 8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.4 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情况.....	51
§ 9 开放式基金份额变动.....	51
§ 10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§ 12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中银证券科技创新3年封闭混合
场内简称	BOCI 科创 扩位简称：中银证券科技创新
基金主代码	501095
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年3月12日
基金管理人	中银国际证券股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	884,675,264.70份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020年7月8日

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>封闭运作期内，本基金在投资股票时，将根据市场整体估值水平评估系统性风险，同时根据个股估值水平（中证800指数的市净率P/B）决定股票资产的投资比例。</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方式，密切关注科技创新前沿，挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。针对科创板，本基金将从上市公司的成长性、科技研发能力、公司治理结构、估值水平等方面对科技创新主题的上市公司进行综合评价。</p> <p>本基金所指科技创新主题相关证券主要是指坚持面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求的科技创新，主要投资于包括符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高，属于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业，属于互联网、大数据、云计算、人工智能和制造业深度融合等方面的科技创新上市公司。</p>
业绩比较基准	<p>封闭运作期内，本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率*55%+中债综合全价指数收益率*45%</p> <p>封闭运作期届满转型后，本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴</p>

	产业成份指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金封闭运作期内将参与科创板发行人战略配售股票投资，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。

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	中银国际证券股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	亓磊
	联系电话	021-20328000
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com
客户服务电话	021-61195566, 400-620-8888	95599
传真	021-50372474	010-68121816
注册地址	上海市浦东新区银城中路200号 中银大厦39F	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	上海市浦东新区银城中路200号 中银大厦39F	北京市西城区复兴门内大街28号 凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	宁敏	谷澍

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	www.bocifunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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-2021年6月30日)
本期已实现收益	-64,779,909.14
本期利润	-34,739,496.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0393
本期加权平均净值利润率	-3.69%
本期基金份额净值增长率	-3.40%
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	42,187,048.12
期末可供分配基金份额利润	0.0477
期末基金资产净值	988,090,842.56
期末基金份额净值	1.1169
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	11.69%

注：1. 本基金合同生效日为2020年3月12日；

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；

3. 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；

4. 期末可供分配利润，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。

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	5.18%	1.18%	2.56%	0.77%	2.62%	0.41%
过去三个月	13.53%	1.12%	10.87%	0.83%	2.66%	0.29%
过去六个月	-3.40%	1.41%	7.21%	1.12%	-10.61%	0.29%
过去一年	1.99%	1.45%	22.18%	1.01%	-20.19%	0.44%
自基金合同生效起至今	11.69%	1.38%	33.43%	0.98%	-21.74%	0.40%

注：业绩比较基准=中国战略新兴产业成份指数收益率*55%+中债综合全价指数收益率*45%。

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

中银证券科技创新3年封闭混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 本基金合同于2020年3月12日生效；

2. 按照基金合同约定，自基金成立日起6个月为建仓期，截止本报告期末，基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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

中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银国际证券”)经中国证监会批准于2002年2月28日在上海成立，注册资本27.78亿元人民币。前十名股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、上海金融发展投资基金(有限合伙)、云南省投资控股集团有限公司、江西铜业股份有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、江苏洋河酒厂股份有限公司、上海祥众投资合伙企业(有限合伙)、信泰人寿保险股份有限公司—传统产品、井冈山郝乾企业管理中心(有限合伙)。截至2021年6月30日，本管理人共管理32只证券投资基金，包括：中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券保本1号混合型证券投资基金)、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券

型证券投资基金、中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金（原中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金）、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金、中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券中证500交易型开放式指数证券投资基金、中银证券安沛债券型证券投资基金、中银证券中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券汇远一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安泰债券型证券投资基金、中银证券优选行业龙头混合型证券投资基金、中银证券安汇三年定期开放债券型证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券鑫瑞6个月持有期混合型证券投资基金、中银证券精选行业股票型证券投资基金、中银证券汇福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券均衡成长混合型证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
张少华	本基金的基金经理	2021年6月8日	-	21年	张少华，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。1999年7月至2003年12月任职于申银万国证券股份有限公司，历任研究员、研究员（中级）、经理助理；2004年1月至2019年10月任职于申万菱信基金管理有限公司，历任风险管理部经理、副总监、总监，投资管理部基金经理、副总监、总监，公司副总经理；2019年10月加入中银国际证券股份有限公司，现任资产管理板块副总经理兼基金管理部总经理及中银证券优选行业龙头混合型证券投资基金、中银证券精选行业股票型证券投资基金、中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
阳桦	本基金	2020年3月12日	2021年	10年	阳桦，硕士研究生，已于2021年6

	基金经 理		6月8日		月离职。2008年7月至2009年6月任职于富邦证券(上海代表处),担任行业研究员;2009年7月至2010年6月任职于中山证券有限责任公司,担任行业研究员;2010年6月加入中银国际证券股份有限公司,担任行业研究员、投资经理,曾任中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券中证500交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。
吴文 钊	本基金 基金经 理	2020年3月12日	2021年 1月18 日	12年	吴文钊,硕士研究生,中国国籍,已离职。2008年2月至2010年2月任职于恒泰证券股份有限公司,担任行业研究员;2010年3月至2011年1月任职于东海证券有限责任公司,担任行业研究员;2011年2月至2015年4月任职于国金证券股份有限公司,担任行业研究员;2015年5月加入中银国际证券股份有限公司,曾任中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券鑫瑞6个月持有期混合型证券投资基金基金经理。

注:1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期,离任日期为根据公司确定的解聘日期;首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:无

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》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基

金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、研究与交易部交易室异常交易监控与报告管理办法等公平交易相关制度体系。公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法所规范的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时涵盖包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，公司未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年的上半年，沪深300指数冲高、回落、震荡。市场以春节为分界点，之前在以“茅指数”为代表的各行业龙头股带领下一路高歌猛进，行情至春节戛然而止。春节之后指数快速回落，一个月跌幅在20%左右，调整在3月中下旬企稳震荡至今。指数如此快速的下跌在历史上也比较罕见，20%的跌幅在过去指数调整的历史上也属靠前。七月是中国的大日子，市场在之前也出现了调整，很多博弈的资金认为在此之前市场风险很小，抓紧时间抢跑是很多资金五六月份操作的心态。而最终展现的行情是结构化的。二季度，成长风格表现突出，如半导体行业、新能源及新能源车产业链、双创指数、生物医药等表现较好。结构性行情不但表现在不同的行业之间，在部分行业内也较为明显的存在。比如白酒，茅、五、泸等高端白酒反弹乏力，而次高端白酒股价绝大

部分在二季度接近或创出年内新高。机构核心持仓股也是如此，在五六月愈发分化，三月以来大幅反弹的核心资产大多处于高度景气行业，业绩预期上调或稳定。相反，业绩可能存在瑕疵的前期基金重仓股表现平平。

报告期内，本基金维持相对稳定的权益仓位，并对持仓行业进行了优化调整，及时应对风险事件，维护持有人利益，努力提升组合投资收益。权益配置方面，坚持围绕科技创新相关主题进行行业配置，自下而上挖掘具备核心竞争力和长期成长性个股，以把握经济增长和产业升级下的投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.1169元；本报告期基金份额净值增长率为-3.40%，业绩比较基准收益率为7.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于春节后的调整不是由于A股上市公司基本面恶化导致的，在一轮跌幅可观的调整之后，后续维持震荡态势的可能性大，稳中求进，市场有望底部逐步提高。后续再要大跌，可能触发的原因国外如美联储正式结束宽松货币政策、国内如房价、通胀持续超预期干扰到央行的政策取向等。基金经理将紧紧围绕科技创新主题进行投资，基金经理战略性看好诸如新能源、新能源汽车、半导体产业、生物医药、消费电子等方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了中银国际证券股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。由公司领导担任主席，成员由资产管理板块负责人、基金管理部、信评与投资监督部、运营管理总部、内控与法律合规部、风险管理部等部门负责人组成。估值委员会成员均具有专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间

同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—中银国际证券股份有限公司2021年1月1日至2021年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中银国际证券股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中银国际证券股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银证券科技创新3年封闭运作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	上年度末
----	-----	-----	------

		2021年6月30日	2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	163,861,216.05	34,178,578.73
结算备付金		43,475,751.36	12,888,274.47
存出保证金		471,690.51	706,765.14
交易性金融资产	6.4.7.2	777,833,821.88	808,541,666.25
其中：股票投资		777,571,821.88	808,541,666.25
基金投资		-	-
债券投资		262,000.00	-
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	-	160,000,000.00
应收证券清算款		7,523,086.18	32,966,305.42
应收利息	6.4.7.5	38,147.48	-16,433.87
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		993,203,713.46	1,049,265,156.14
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		-	-
应付证券清算款		3,552,105.73	24,270,113.98
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		927,425.45	1,039,822.33
应付托管费		154,570.92	173,303.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	379,589.85	771,577.32
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	99,178.95	180,000.00
负债合计		5,112,870.90	26,434,817.36
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	884,675,264.70	884,675,264.70
未分配利润	6.4.7.10	103,415,577.86	138,155,074.08
所有者权益合计		988,090,842.56	1,022,830,338.78

负债和所有者权益总计		993,203,713.46	1,049,265,156.14
------------	--	----------------	------------------

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额净值1.1169元，基金份额总额884,675,264.70份。

6.2 利润表

会计主体：中银证券科技创新3年封闭运作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3月12日（基金合 同生效日）至2020年6月 30日
一、收入		-25,664,658.21	90,614,558.06
1. 利息收入		1,132,696.15	928,785.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	674,419.17	925,292.51
债券利息收入		1,553.77	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		456,723.21	3,493.15
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-56,837,767.28	6,309,686.59
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-57,481,978.00	3,907,876.21
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,525,660.72	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,169,871.44	2,401,810.38
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	30,040,412.92	83,375,435.12
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	-	650.69
减：二、费用		11,752,263.61	6,472,273.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,601,696.64	3,205,483.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	933,616.15	534,247.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,101,404.30	2,656,359.27

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		5.06	-
7. 其他费用	6.4.7.20	115,541.46	76,183.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-37,416,921.82	84,142,284.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-37,416,921.82	84,142,284.18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银证券科技创新3年封闭运作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）	884,675,264.70	138,155,074.08	1,022,830,338.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-34,739,496.22	-34,739,496.22
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	884,675,264.70	103,415,577.86	988,090,842.56
项目	上年度可比期间 2020年3月12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)	884,675,264.70	-	884,675,264.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	84,142,284.18	84,142,284.18
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)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	884,675,264.70	84,142,284.18	968,817,548.88

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：

宁敏

沈锋

戴景义

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]1347号《关于准予中银证券安睿定期开放债券型证券投资基金注册的批复》和证监许可[2020]73号《关于准予中银证券安睿定期开放债券型证券投资基金变更注册的批复》核准,由中银国际证券股份有限公司(原“中银国际证券有限责任公司”,于2017年12月29日更名)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币884,390,443.83

元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第152号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2020年3月12日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为884,675,264.70份基金份额，其中认购资金利息折合284,820.87份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，具体封闭运作期为基金合同生效日(含基金合同生效日)起至三年后的年度对日前一日止。在封闭运作期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回。封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将其持有的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金(LOF)，基金名称调整为“中银证券科技创新混合型证券投资基金(LOF)”，并接受场外、场内的申购、赎回申请。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，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(含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、中央银行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券及非金融企业债务融资工具等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款(包含协议存款、通知存款、定期存款)、货币市场工具、股指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)。

封闭运作期内，本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%-100%，封闭运作期届满转为开放式运作后，本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%。封闭运作期内，本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率*55%+中债综合全价指数收益率*45%。封闭运作期届满转型后，本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司于2021年8月29日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中

国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年1月1日至2021年6月30日止期间的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基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 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	163,861,216.05
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	163,861,216.05

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	716,343,292.14	777,571,821.88	61,228,529.74

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	262,000.00	262,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	262,000.00	262,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		716,605,292.14	777,833,821.88	61,228,529.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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

注：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

注：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	29,456.97
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	8,481.06
应收债券利息	18.38
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	191.07
合计	38,147.48

6.4.7.6 其他资产

注：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	379,589.85
银行间市场应付交易费用	-
合计	379,589.85

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	-
预提费用	99,178.95
合计	99,178.95

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	884,675,264.70	884,675,264.70
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	884,675,264.70	884,675,264.70

注：1. 本基金自2020年2月27日至2020年3月11日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币884,390,443.83元。根据《中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币284,820.87元，在本基金成立后，折算为284,820.87份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金自2020年3月12日基金合同生效后的前三年为封闭运作期，具体封闭运作期为基金合同生效日（含基金合同生效日）起至三年后的年度对日前一日止。在封闭运作期内，本基金

不接受基金份额的申购和赎回。封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将其持有的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。

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	106,966,957.26	31,188,116.82	138,155,074.08
本期利润	-64,779,909.14	30,040,412.92	-34,739,496.22
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,187,048.12	61,228,529.74	103,415,577.86

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	533,549.71
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	136,443.32
其他	4,426.14
合计	674,419.17

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-57,481,978.00
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-57,481,978.00

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,929,522,812.17
减：卖出股票成本总额	1,987,004,790.17
买卖股票差价收入	-57,481,978.00

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,525,660.72
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-2,525,660.72

6.4.7.13.2 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	7,057,700.93
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,576,141.20
减：应收利息总额	7,220.45
买卖债券差价收入	-2,525,660.72

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：报告期内本基金无资产支持证券投资。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 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	3,169,871.44
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	3,169,871.44

6.4.7.17 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	30,040,412.92
股票投资	30,040,412.92
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	30,040,412.92

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 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	5,101,404.30
银行间市场交易费用	-
合计	5,101,404.30

6.4.7.20 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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	7,362.51
账户维护费	9,000.00
合计	115,541.46

6.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银国际证券股份有限公司（“中银证券”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年3月12日（基金合同生效日）至 2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
中银证券	3,850,125,387.47	100.00	2,304,579,481.48	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年3月12日（基金合同生效日）至 2020年6月30日	
-------	----------------------------	--	---	--

	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
中银证券	9,718,658.94	100.00	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年3月12日（基金合同生效日） 至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
中银证券	3,450,000,000.00	100.00	25,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中银证券	2,815,588.55	100.00	379,589.85	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020年3月12日（基金合同生效日）至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中银证券	1,685,338.78	100.00	532,083.90	100.00

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年3月12日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,601,696.64	3,205,483.48
其中：支付销售机构的客户维护费	2,212,096.57	1,287,186.55

注：支付基金管理人中银证券的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

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3月12日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	933,616.15	534,247.24

注：支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未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。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未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。

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自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间内未运用自有资金投资本基金。

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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年3月12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
中国农业银行	163,861,216.05	533,549.71	117,559,796.53	870,204.75

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

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
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-

300931	通用 电梯	2021年 1月13 日	2021年 7月21 日	新股流 通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300933	中辰 股份	2021年 1月15 日	2021年 7月22 日	新股流 通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易 购	2021年 1月20 日	2021年 7月27 日	新股流 通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极 光	2021年 1月27 日	2021年 8月3 日	新股流 通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识 科技	2021年 2月2 日	2021年 8月9 日	新股流 通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞 生物	2021年 2月2 日	2021年 8月9 日	新股流 通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖 智控	2021年 2月3 日	2021年 8月10 日	新股流 通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡 龙	2021年 2月3 日	2021年 8月10 日	新股流 通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中 生态	2021年 2月18 日	2021年 8月25 日	新股流 通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固 特	2021年 2月24 日	2021年 9月3 日	新股流 通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉 安防	2021年 3月3 日	2021年 9月13 日	新股流 通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕 科技	2021年 3月11 日	2021年 9月22 日	新股流 通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨 家化	2021年 3月16 日	2021年 9月24 日	新股流 通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力 股份	2021年 3月16 日	2021年 9月27 日	新股流 通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300958	建工 修复	2021年 3月18 日	2021年 9月29 日	新股流 通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

		日	日								
300960	通业科技	2021年 3月22 日	2021年 9月29 日	新股流 通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04		-
300962	中金辐照	2021年 3月29 日	2021年 10月 11日	新股流 通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12		-
300963	中洲特材	2021年 3月30 日	2021年 10月 11日	新股流 通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67		-
300967	晓鸣股份	2021年 4月2 日	2021年 10月 13日	新股流 通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78		-
300968	格林精密	2021年 4月6 日	2021年 10月 15日	新股流 通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34		-
300971	博亚精工	2021年 4月7 日	2021年 10月 15日	新股流 通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05		-
300975	商络电子	2021年 4月14 日	2021年 10月 21日	新股流 通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76		-
300979	华利集团	2021年 4月15 日	2021年 10月 26日	新股流 通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50		-
300981	中红医疗	2021年 4月19 日	2021年 10月 27日	新股流 通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39		-
300985	致远新能	2021年 4月21 日	2021年 10月 29日	新股流 通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95		-
300987	川网传媒	2021年 4月28 日	2021年 11月 11日	新股流 通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81		-
300992	泰福泵业	2021年 5月17 日	2021年 11月 25日	新股流 通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00		-
300995	奇德新材	2021年 5月17 日	2021年 11月 26日	新股流 通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12		-
300996	普联软件	2021年 5月26 日	2021年 12月3 日	新股流 通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43		-
300998	宁波	2021年	2021年	新股流	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32		-

	方正	5月25日	12月2日	通受限						
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688195	腾景科技	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	-

688239	航宇科技	2021年 6月25 日	2021年 7月5 日	新股流 通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688350	富淼科技	2021年 1月21 日	2021年 7月28 日	新股流 通受限	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
688517	金冠电气	2021年 6月10 日	2021年 12月 20日	新股流 通受限	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：张)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
113050	南银转债	2021年 6月17 日	2021年 7月1 日	新债未 上市	100.00	100.00	2,620	262,000.00	262,000.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未有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

本基金主要投资于股票、债券等具有良好流动性的金融工具。与这些金融工具相关的风险，以及本基金的基金管理人对于相关风险采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括管理风险、技术风险及市场风险。本基金在有效控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人在公司风险管理体系的基础上构建明晰基金业务的风险管理组织架构和职能，由董事会及其风险控制委员会、执行委员会、风险管理委员会、风险管理部、基金管理部、中后线部门等相关业务部门构成多层次风险管理框架体系。董事会决定公司风险偏好，并在风险控制委员会的协助下监察公司基金业务的总体风险及管理状况。执行委员会领导公司基金业务的风险管理。风险管理委员会协助执行委员会在董事会授权范围内确定、调整基金业务的业务权限、讨论重大决策以及检查风险管理状况。风险管理部、信评与投资监督部负责监控和报告公司基金业务的风险敞口和限额使用情况。业务主管对各自业务的风险管理负有首要责任。财务、业务营运、稽核、法律及合规等中后线部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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。

本基金债券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

注：截至2021年6月30日，本基金未持有期限在一年以内（含）的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：截至2021年6月30日，本基金未持有期限在一年以内（含）的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：截至2021年6月30日，本基金未持有期限在一年以内（含）的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	262,000.00	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	262,000.00	-

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：截至2021年6月30日，本基金未持有期限大于一年的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：截至2021年6月30日，本基金未持有期限大于一年的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于2021年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：不适用。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自2017年10月1日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年6月30日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2021年6月30日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

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	163,861,216.05	-	-	-	163,861,216.05
结算备付金	43,475,751.36	-	-	-	43,475,751.36
存出保证金	471,690.51	-	-	-	471,690.51
交易性金融资产	262,000.00	-	-	777,571,821.88	777,833,821.88
应收利息	-	-	-	38,147.48	38,147.48
应收证券清算款	-	-	-	7,523,086.18	7,523,086.18
资产总计	208,070,657.92	-	-	785,133,055.54	993,203,713.46
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	927,425.45	927,425.45
应付托管费	-	-	-	154,570.92	154,570.92
应付证券清算款	-	-	-	3,552,105.73	3,552,105.73
应付交易费用	-	-	-	379,589.85	379,589.85
其他负债	-	-	-	99,178.95	99,178.95
负债总计	-	-	-	5,112,870.90	5,112,870.90
利率敏感度缺口	208,070,657.92	-	-	780,020,184.64	988,090,842.56
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	34,178,578.73	-	-	-	34,178,578.73
结算备付金	12,888,274.47	-	-	-	12,888,274.47

存出保证金	706,765.14	-	-	706,765.14
交易性金融资产	-	-	-808,541,666.25	808,541,666.25
买入返售金融资产	160,000,000.00	-	-	160,000,000.00
应收利息	-	-	-16,433.87	-16,433.87
应收证券清算款	-	-	-32,966,305.42	32,966,305.42
资产总计	207,773,618.34	-	-841,491,537.80	1,049,265,156.14
负债				
应付管理人报酬	-	-	-1,039,822.33	1,039,822.33
应付托管费	-	-	-173,303.73	173,303.73
应付证券清算款	-	-	-24,270,113.98	24,270,113.98
应付交易费用	-	-	-771,577.32	771,577.32
其他负债	-	-	-180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-26,434,817.36	26,434,817.36
利率敏感度缺口	207,773,618.34	-	-815,056,720.44	1,022,830,338.78

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2021年6月30日，本基金持有交易性债券投资占基金资产净值比例为0.03%（2020年12月31日：0.00%），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。

6.4.13.4.3 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。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在注重风险控制的基础上，将严谨的定性分析和规范的定量模型相结合，动态调整稳健资产和风险资产的配置比例；在此基础上精选债券和股票，以实现基金资产的稳健增值。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。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-100%，其中投资于本基金界定的科技创新

主题相关证券占非现金基金资产的比例不低于80%，投资于同业存单的比例不高于基金资产的20%。在封闭期，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；封闭期届满转为开放式运作后，本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%，其中投资于本基金界定的科技创新主题相关证券占非现金基金资产的比例不低于80%。基金持有的现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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VaR(Value at Risk)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	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	777,571,821.88	78.69	808,541,666.25	79.05
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	262,000.00	0.03	-	-
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	777,833,821.88	78.72	808,541,666.25	79.05

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
	相关风险变量的变动	本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升	68,030,054.51	65,747,534.18

	5%		
	业绩比较基准下降		
	5%	-68,030,054.51	-65,747,534.18

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：不适用。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为776,706,847.94元，属于第二层次的余额为1,126,973.94元，无属于第三层次的余额（2020年6月30日属于第一层次的余额为879,978,166.67元，无属于第二层次和第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2020年6月30日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	777,571,821.88	78.29
	其中：股票	777,571,821.88	78.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	262,000.00	0.03
	其中：债券	262,000.00	0.03
	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	207,336,967.41	20.88
8	其他各项资产	8,032,924.17	0.81
9	合计	993,203,713.46	100.00

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

金额单位：人民币元

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	33,198.70	0.00
B	采矿业	398,228.00	0.04
C	制造业	687,936,711.45	69.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	9,014.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,790,675.70	1.60
J	金融业	34,721.10	0.00

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,028,675.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	31,945,456.13	3.23
N	水利、环境和公共设施管理业	17,050.08	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	30,271,498.94	3.06
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	777,571,821.88	78.69

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期无港股通股票投资。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	2,101,077	69,818,788.71	7.07
2	300433	蓝思科技	2,150,095	63,234,293.95	6.40
3	603501	韦尔股份	150,000	48,300,000.00	4.89
4	603986	兆易创新	220,036	41,344,764.40	4.18
5	002466	天齐锂业	585,400	36,306,508.00	3.67
6	002475	立讯精密	724,966	33,348,436.00	3.38
7	300750	宁德时代	61,600	32,943,680.00	3.33
8	603259	药明康德	204,007	31,945,456.13	3.23
9	601012	隆基股份	345,500	30,694,220.00	3.11
10	300014	亿纬锂能	274,200	28,497,606.00	2.88
11	600438	通威股份	633,918	27,429,631.86	2.78
12	000725	京东方A	4,305,900	26,868,816.00	2.72
13	600584	长电科技	700,742	26,403,958.56	2.67
14	600031	三一重工	736,600	21,412,962.00	2.17
15	300760	迈瑞医疗	43,600	20,930,180.00	2.12
16	688519	南亚新材	500,312	18,891,781.12	1.91
17	688396	华润微	156,067	14,205,218.34	1.44
18	300073	当升科技	231,500	13,007,985.00	1.32
19	000739	普洛药业	441,400	12,977,160.00	1.31
20	002241	歌尔股份	299,967	12,820,589.58	1.30
21	002230	科大讯飞	186,650	12,613,807.00	1.28
22	300782	卓胜微	23,180	12,459,250.00	1.26
23	300274	阳光电源	102,200	11,759,132.00	1.19
24	300015	爱尔眼科	164,703	11,690,618.94	1.18

25	688580	伟思医疗	69,659	11,667,882.50	1.18
26	603799	华友钴业	96,900	11,065,980.00	1.12
27	601888	中国中免	36,750	11,028,675.00	1.12
28	300601	康泰生物	70,700	10,534,300.00	1.07
29	002036	联创电子	800,000	10,520,000.00	1.06
30	300347	泰格医药	53,600	10,360,880.00	1.05
31	000938	紫光股份	473,320	10,356,241.60	1.05
32	600763	通策医疗	20,000	8,220,000.00	0.83
33	002821	凯莱英	15,000	5,589,000.00	0.57
34	300633	开立医疗	120,000	3,789,600.00	0.38
35	002459	晶澳科技	45,000	2,205,000.00	0.22
36	688076	诺泰生物	30,000	2,046,300.00	0.21
37	002709	天赐材料	17,000	1,811,860.00	0.18
38	002812	恩捷股份	7,300	1,708,930.00	0.17
39	300496	中科创达	10,000	1,570,600.00	0.16
40	002970	锐明技术	36,100	1,567,101.00	0.16
41	300408	三环集团	32,000	1,357,440.00	0.14
42	000550	江铃汽车	56,800	1,330,824.00	0.13
43	300316	晶盛机电	25,400	1,282,700.00	0.13
44	600104	上汽集团	50,000	1,098,500.00	0.11
45	002541	鸿路钢构	17,400	1,015,290.00	0.10
46	300207	欣旺达	30,000	976,800.00	0.10
47	300124	汇川技术	10,000	742,600.00	0.08
48	688111	金山办公	1,800	710,640.00	0.07
49	300763	锦浪科技	3,400	614,040.00	0.06
50	600570	恒生电子	6,500	606,125.00	0.06
51	300820	英杰电气	10,000	546,900.00	0.06
52	300631	久吾高科	20,000	489,200.00	0.05
53	002386	天原股份	40,000	412,000.00	0.04
54	002192	融捷股份	5,800	398,228.00	0.04
55	002624	完美世界	10,000	239,100.00	0.02
56	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.02
57	688006	杭可科技	2,700	229,500.00	0.02
58	603348	文灿股份	3,000	105,000.00	0.01
59	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
60	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
61	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.01
62	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
63	688655	迅捷兴	3,083	62,893.20	0.01
64	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.01
65	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
66	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.01

67	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.01
68	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
69	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
70	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
71	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
72	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
73	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00
74	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
75	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
76	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
77	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
78	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
79	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
80	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
81	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
82	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
83	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
84	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
85	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
86	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
87	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
88	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
89	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
90	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
91	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
92	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
93	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
94	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
95	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
96	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
97	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
98	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
99	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
100	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
101	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
102	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
103	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
104	300963	中洲特材	283	6,364.67	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	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00

109	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
110	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
111	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
112	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
113	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
114	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	000063	中兴通讯	131,531,981.08	12.86
2	603986	兆易创新	58,286,628.33	5.70
3	002384	东山精密	56,420,809.88	5.52
4	601012	隆基股份	50,596,452.63	4.95
5	300618	寒锐钴业	47,615,404.10	4.66
6	688981	中芯国际	45,976,966.68	4.50
7	002241	歌尔股份	45,513,074.71	4.45
8	601231	环旭电子	44,767,547.10	4.38
9	300433	蓝思科技	44,022,098.32	4.30
10	603501	韦尔股份	43,321,270.00	4.24
11	600584	长电科技	42,413,690.20	4.15
12	002236	大华股份	36,569,483.02	3.58
13	002156	通富微电	36,433,832.26	3.56
14	601908	京运通	36,183,296.96	3.54
15	002475	立讯精密	33,360,583.90	3.26
16	600438	通威股份	32,253,271.79	3.15
17	600031	三一重工	31,121,283.11	3.04
18	300363	博腾股份	31,063,275.00	3.04
19	600111	北方稀土	30,303,615.25	2.96
20	002466	天齐锂业	30,011,967.00	2.93
21	002185	华天科技	28,961,623.00	2.83
22	000786	北新建材	28,775,371.00	2.81
23	300014	亿纬锂能	27,527,182.00	2.69
24	600183	生益科技	27,336,534.27	2.67
25	300750	宁德时代	26,379,162.44	2.58
26	000938	紫光股份	25,741,757.60	2.52
27	603259	药明康德	24,190,286.32	2.37
28	002460	赣锋锂业	21,597,594.90	2.11
29	002636	金安国纪	21,216,793.62	2.07
30	300073	当升科技	20,623,355.00	2.02
31	600309	万华化学	20,585,066.00	2.01

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	000063	中兴通讯	106,136,678.14	10.38
2	688981	中芯国际	89,993,015.66	8.80
3	002384	东山精密	69,747,945.25	6.82
4	601231	环旭电子	67,717,038.18	6.62
5	002185	华天科技	64,081,683.44	6.27
6	603986	兆易创新	61,468,321.42	6.01
7	002241	歌尔股份	59,111,774.34	5.78
8	000938	紫光股份	58,860,780.68	5.75
9	600584	长电科技	52,127,458.47	5.10
10	002156	通富微电	52,110,229.57	5.09
11	300476	胜宏科技	49,801,364.14	4.87
12	600703	三安光电	48,174,634.42	4.71
13	601012	隆基股份	45,966,442.24	4.49
14	300618	寒锐钴业	44,394,687.14	4.34
15	300363	博腾股份	36,382,652.00	3.56
16	002236	大华股份	34,278,958.00	3.35
17	300115	长盈精密	33,148,864.74	3.24
18	688599	天合光能	31,657,656.80	3.10
19	600183	生益科技	29,980,000.61	2.93
20	600111	北方稀土	29,432,594.73	2.88
21	601908	京运通	28,113,472.84	2.75
22	000786	北新建材	26,515,036.89	2.59
23	603233	大参林	24,637,949.03	2.41
24	000661	长春高新	22,935,720.97	2.24
25	600276	恒瑞医药	22,625,893.97	2.21
26	300433	蓝思科技	21,642,925.47	2.12
27	002623	亚玛顿	21,199,587.20	2.07

注：“卖出金额”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。

7.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	1,925,994,532.88
卖出股票收入（成交）总额	1,929,522,812.17

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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）	262,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	262,000.00	0.03

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	113050	南银转债	2,620	262,000.00	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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

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，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本报告编制日前一年以内，本基金持有的“韦尔股份”的发行主体上海韦尔半导体股份有限公司于2021年4月28日收到中国证券监督管理委员会上海监管局的《关于上海韦尔半导体股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（沪证监决〔2021〕67号）。上海韦尔半导体股份有限公司于2019年1月17日完成深圳市芯能投资有限公司（以下简称“芯能投资”）、深圳市芯力投资有限公司（以下简称“芯力投资”）100%股权的收购，收购价款合计16.87亿元。其中，芯能投资、芯力投资主要资产分别为其持有的北京豪威科技有限公司6.31%股权、4.24%股权。2019年7月，上海韦尔半导体股份有限公司与兴业银行签订借款合同，借款金额为10亿元，借款期限为2019年7月5日至2024年7月4日，借款用途为用于支付（或置换）芯能投资和芯力投资100%股权的股权并购款。上海韦尔半导体股份有限公司以持有的芯能投资、芯力投资100%股权及芯能投资、芯力投资持有的北京豪威科技有限公司10.55%股权提供质押担保。上述质押资产的账面值约占最近一期经审计总资产37%。上海韦尔半导体股份有限公司对于上述资产质押情况未及时在临时公告中披露，直至2020年4月10日才在2019年年度报告中披露。中国证券监督管理委员会上海监管局决定对其采取出具警示函的监管措施。

本基金管理人将密切跟踪相关进展，在严格遵守法律法规和基金合同基础上进行投资决策。

本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年以内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	471,690.51
2	应收证券清算款	7,523,086.18
3	应收股利	-
4	应收利息	38,147.48
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,032,924.17

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中未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

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
14,126	62,627.44	9,576,937.00	1.08	875,098,327.70	98.92

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	刘素清	9,045,201.00	1.02
2	魏伟	7,001,835.00	0.79
3	龚顺琴	5,992,818.49	0.68
4	曾丽霞	4,999,225.00	0.57
5	陈建燕	4,383,610.00	0.50
6	潘小彦	4,239,664.00	0.48
7	上海宁泉资产管理有 限公司—宁泉致远39 号私募证券投资基金	3,235,263.00	0.37
8	杨智雄	2,986,019.63	0.34
9	邓艳芳	2,985,209.63	0.34
10	陈英	2,979,405.00	0.34

8.3 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	190,274.29	0.0215

8.4 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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发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12日）基金份额总额	884,675,264.70
本报告期期初基金份额总额	884,675,264.70
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	884,675,264.70

§ 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

2021年3月8日，王华先生不再担任公司董事与董事会审计委员会委员职务；刘玉珍女士不再担任公司独立董事与董事会薪酬与提名委员会主任委员、董事会审计委员会委员职务；吴联生先生不再担任公司独立董事与董事会审计委员会主任委员职务；张静女士不再担任公司非职工代表监事职务。选举郭旭扬先生担任公司董事与董事会审计委员会委员职务；选举王宇女士担任公司独立董事与董事会审计委员会委员职务；选举王娴女士担任公司独立董事与董事会薪酬与提名委员会委员职务；选举张丽娜女士担任公司非职工代表监事职务。2021年6月28日，李丹女士辞任公司董事与董事会风险控制委员会委员职务，并选举张静女士担任公司董事与董事会风险控制委员会委员职务。

2021年5月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

一、本报告期内，涉及基金管理人（以下简称“公司”）的合计占公司案件标的总额90%以上的主要诉讼、仲裁事项（含资管计划案件）进展情况如下：

1、公司诉天津顺航海运有限公司质押式证券回购纠纷案

在股票质押式回购交易中，因被告天津顺航海运有限公司未按时提前购回股票或采取履约风险管理措施，且未按时支付利息，故公司作为原告起诉请求被告偿还本金7,000万元及相应利息，并支付违约金等。法院于2018年5月作出民事调解书：被告应偿还公司融资本金，支付截止至实际给付之日的利息及违约金；如其未按时足额履行上述款项给付义务，则继续承担相关责任。公司已申请强制执行。2019年2月，法院裁定受理被告破产清算一案，公司申报债权。2021年4月15日，天津顺航海运有限公司破产管理人向公司发还款项71,009,850元，剩余金额扣除管理人报酬后由破产管理人代管，至破产程序终结后返还。

2-4、公司诉上海刚泰投资咨询股份有限公司质押式证券回购纠纷案等

在股票质押式回购交易中，因被告一（上海刚泰投资咨询股份有限公司）的履约保证比例已低于最低限度，而未按约定提前购回股票或采取履约风险管理措施，故公司作为原告起诉请求被告一刚泰投资向公司支付融资本金7,660万元、应付未付融资利息、违约金等，被告二（刚泰集团有限公司）对相关款项承担连带清偿责任等。2018年11月，公司申请将诉讼请求变更为判令被告一刚泰投资向公司支付违约金160.86万元及律师费，判令被告二刚泰集团承担连带清偿责任等。法院于2019年3月作出民事判决书：被告一刚泰投资应向公司支付违约金160.86万元、律师费19万元等，被告二刚泰集团承担连带清偿责任。公司已申请强制执行。因暂未发现被执行人有其他可供执行财产，故法院裁定终结本次执行程序。公司发现被执行人有可供执行财产的，可以再次申请执行。

因上述案件相同原因，刚泰投资出质股票的担保物权实现条件已经具备，公司向法院申请实现其担保物权。法院于2018年12月作出民事裁定书：准许拍卖、变卖被告持有的股票，拍卖、变卖该质押物所得价款优先清偿被告欠付原告的融资本金及逾期利息等。公司已申请强制执行。因股票处置条件尚不成熟，暂未发现被执行人有其他可供执行财产，故法院裁定终结本次执行程序。公司发现被执行人有可供执行财产的，可以再次申请执行。

公司另行向法院起诉，请求判令刚泰集团在刚泰投资欠公司融资本金7,660万元及相关利息等范围内对公司承担连带清偿责任。法院于2019年12月作出民事判决书：刚泰集团应在刚泰投资拖欠原告融资本金、利息、逾期利息等债权范围内，就刚泰投资持有的质押股票清偿之后的不足部分承担连带清偿责任，并承担受理费、保全费等费用。公司已申请强制执行。

5-9、公司诉韩宝琴等融资融券交易纠纷案

涉案五人在公司开立普通账户及信用账户，后申请融资并进行证券交易。后因股票持续跌停，客户信用账户维持担保比例下跌且未采取履约保障措施，公司根据合同采取强制平仓措施未

果，遂向上海金融法院提起诉讼，并申请财产保全。2021年1月，公司就五项案件分别向法院提交变更诉讼请求申请，要求被告向公司偿付融资本金、佣金、利息等合计约人民币39,664万元。案件在审理过程中。

10、广东省融资再担保有限公司诉宜华健康医疗股份有限公司等及第三人（公司）追偿权纠纷案

宜华健康医疗股份有限公司发行公司债券，广东省融资再担保有限公司出具《担保函》，为宜华健康兑付本息义务提供保证担保，公司承销本次债券并作为债券受托管理人。因宜华健康无力偿还本次债券本息，广东再担保于2020年11月代偿2.13亿元。因宜华健康向广东再担保提供反担保措施，因此，广东再担保对宜华健康及反担保方起诉追偿。法院于2021年5月24日作出一审判决：被告宜华健康向原告清偿代偿款2.13亿元及利息、违约金，其他被告对宜华健康上述债务承担连带清偿责任。公司列为第三人，不涉及任何不利赔偿或权利损失。

公司代表资管计划提起的诉讼、仲裁事项：

- 1、公司作为资管计划管理人起诉发行人中国华阳经贸集团有限公司案件（公司已在2019年公司债券报告中披露该诉讼）。法院裁定，被告应向原告偿付本金及相应利息，并承担相应的诉讼费、财产保全申请费、财产保全保险费、律师费等。法院已裁定中止、终结本次执行。
- 2、公司作为资管计划管理人申请对发行人上海云峰（集团）有限公司仲裁案件（公司已在2019年公司债券报告中披露该仲裁）。仲裁庭裁决被申请人应向申请人偿付债券本金、利息、违约金，并承担律师费、差旅费、仲裁费等费用。法院已裁定终结本次执行。
- 3、公司作为资管计划管理人起诉康得新复合材料集团股份有限公司案件（公司已在2019年公司债券报告中披露该诉讼）。法院判决被告向原告偿付本金及相应的利息和违约金等。法院已裁定终结本次执行。公司作为资管计划管理人另诉康得新一案，法院已受理。
- 4、公司作为资管计划管理人申请对辅仁药业集团有限公司仲裁案件（公司已在2019年公司债券报告中披露该诉讼）。仲裁庭裁决被申请人应向申请人偿付债券本金、利息、违约金，并承担律师费、仲裁费。目前处于强制执行阶段。法院已裁定终结本次执行。
- 5、公司作为资管计划管理人申请起诉江苏宏图高科技股份有限公司案件（公司已在2020年公司债券报告中披露该诉讼）。案件在审理过程中。

二、本报告期内，无涉及基金财产的诉讼事项；

三、本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内基金管理人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

未有管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中银证券	2	3,850,125,387.47	100.00%	2,815,588.55	100.00%	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

(1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
中银证券	9,718,658.94	100.00%	3,450,000,000.00	100.00%	-	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.8 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	中银国际证券股份有限公司关于中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	公司官网、中国证券报、上交所	2021年1月18日
2	中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司官网、中国证券报、上交所	2021年1月19日
3	中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2021年第1号)	公司官网、上交所	2021年1月19日
4	中银国际证券股份有限公司旗下基金2020年第4季度报告提示性公告	公司官网、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所、深交所	2021年1月22日

5	中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金2020年第4季度报告	公司官网、上交所	2021年1月22日
6	中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告	公司官网、上交所	2021年3月31日
7	中银国际证券股份有限公司旗下基金2020年年度报告提示性公告	公司官网、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所、深交所	2021年3月31日
8	中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金2021年第1季度报告	公司官网、上交所	2021年4月21日
9	中银国际证券股份有限公司旗下基金2021年第1季度度报告提示性公告	公司官网、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所、深交所	2021年4月21日
10	中银国际证券股份有限公司关于中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	公司官网、中国证券报、上交所	2021年6月8日
11	中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司官网、中国证券报、上交所	2021年6月9日
12	中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2021年第2号)	公司官网、上交所	2021年6月9日

注：全部公告均在公司网站披露，部分公告在公司网站及报纸披露。

§ 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

注：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未有达到或者超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、基金合同

- 3、托管协议
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

除第6项在基金托管人处外，其余文件均在基金管理人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中银国际证券股份有限公司

2021年8月30日