

上银鑫卓混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人:上银基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年08月28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2020年01月21日（基金合同生效日）起至2020年06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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
§6 中期财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49

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情况	49
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
§12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上银鑫卓混合型证券投资基金
基金简称	上银鑫卓混合
基金主代码	008244
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年01月21日
基金管理人	上银基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	137,265,603.05份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，把握市场发展趋势，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”的大类资产配置策略和“自下而上”选股策略相结合的方法进行资产配置和组合风险管理。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×30%
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与货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上银基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王玲	杨军智
	联系电话	021-60238966	010-60834299
	电子邮箱	ling.wang@boscam.com.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		021-60231999	010-60836588
传真		021-60232779	010-60834004

注册地址	上海市浦东新区秀浦路2388号3幢528室	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦9层	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层
邮政编码	200122	100125
法定代表人	汪明	张佑君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.boscam.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上银基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦9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（2020年01月21日（基金合同生效日）－2020年06月30日）
本期已实现收益	27,535,779.38
本期利润	42,150,339.55
加权平均基金份额本期利润	0.0910
本期加权平均净值利润率	8.98%
本期基金份额净值增长率	14.80%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2020年06月30日）
期末可供分配利润	12,780,220.20
期末可供分配基金份额利润	0.0931
期末基金资产净值	157,578,812.81
期末基金份额净值	1.1480
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2020年06月30日）
基金份额累计净值增长率	14.80%

注：1、本基金合同生效日为2020年1月21日，自基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。

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、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孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.30%	0.86%	5.04%	0.62%	4.26%	0.24%
过去三个月	17.20%	0.71%	8.62%	0.63%	8.58%	0.08%
自基金合同生效起至今	14.80%	0.71%	0.10%	1.10%	14.70%	-0.39%

注：本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×30%。

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

上银鑫卓混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金合同生效日为2020年1月21日，建仓期为2020年1月21日至2020年7月20日，目前本基金仍处于建仓期；截至本报告期末，基金合同生效不满一年。

§ 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

上银基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2013年8月30日正式成立。公司由上海银行股份有限公司与中国机械工业集团有限公司出资设立，注册资本为3亿元人民币，注册地上海。截至2020年6月30日，公司管理的基金共有20只，分别是：上银慧财宝货币市场基金、上银新兴价值成长混合型证券投资基金、上银慧添利债券型证券投资基金、上银慧盈利货币市场基金、上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金、上银慧增利货币市场基金、上银聚增富定期开放债券型发起式证券投资基金、上银慧佳盈债券型证券投资基金、上银聚鸿益三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、上银慧祥利债券型证券投资基金、上银中债1-3年农发行债券指数证券投资基金、上银未来生活灵活配置混合型证券投资基金、上银政策性金融债债券型证券投资基金、上银鑫卓混合型证券投资基金、上银慧永利中短期债券型证券投资基金、上银慧丰利债券型证券投资基金、上银可转债精选债券型证券投资基金、上银中债1-3年国开行债券指数证券投资基金、上银聚永益一年定期开放债券型发起式证券投资基金以及上银聚德益一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

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		
程子旭	基金经理	2020-01-21	2020-05-12	10年	硕士研究生，历任兴全基金基金经理助理等职。2019年8月至2020年5月担任上银未来生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020年1月至2020年5月担任上银鑫卓混合型证券投资基金基金经理。
赵治烨	投资副总监、基金经理	2020-01-21	-	9年	本科，历任中国银河证券北京中关村大街营业部理财分析师，上银基金投资研究部副总监等职。2015年5月担任上银新兴价值成长混合型证券投资基金基金经理，2017年3月担任上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年7月担任上银未来生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020年1月担任上银鑫卓混合型证券投资基金基金经理，2020年5月担任上银可转债精选债券型证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的约定，无违法违规、未履行基金合同承诺或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

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》相关规定及公司内部《公平交易管理制度》，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易的公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在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，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年是很不寻常的一段时期，新冠疫情的爆发对经济活动和资本市场造成了重大冲击，但在全中国上下的共同努力下，国内疫情逐步得到有效控制，复工复产复商复市稳步推进，各项经济数据大幅改善，政策层面始终维持积极宽松的态度，市场风险偏好显著提升。本基金坚持“以合理的价格买入优秀的公司”这一长期投资理念，重点关注医药、消费和金融等板块，既注重投资组合的成长性，同时兼顾行业配置的均衡，取得了基金净值的合理增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末上银鑫卓混合基金份额净值为1.1480元，本报告期内，基金份额净值增长率为14.80%，同期业绩比较基准收益率为0.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内宏观经济有望进一步复苏，宏观政策仍将积极有为，以稳中求进为总基调。以国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进的新发展格局，将会更加清晰。不确定性主要来自海外，一方面是海外疫情的控制情况，另一方面是美国大选前后国际关系的演变。来自海外的不确定性可能在某些时点上对风险偏好构成一定压制，但我们认为在基本面持续改善和政策环境偏松的大背景下，权益类资产是较为受益的资产类别，权益市场具备良好的投资机会。消费、医药、金融和科技行业仍然拥有一批优质的上市公司，可以通过稳健的经营为股东创造持续的回报，本基金将持续挖掘和关注其中的佼佼者，并结合市场波动和估值变化动态优化投资组合，稳扎稳打合理追求。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《上银基金管理有限公司估值业务管理制度》、《上银基金管理有限公司估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员包括分管投资副总、督察长、分管运营总监、基金运营部负责人、基金会计代表、投资总监、基金经理或投资经理及监察稽核部代表等相关专业人士组成。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后或基金资产在采用新投资策略和新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值委员会修订相关估值方法，以确保其持续适用。涉及估值政策的变更均须经估值委员会决议批准后执行。

在每个估值日，本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值，确定证券投资基金的份额净值。基金管理人对基金资产进行估值后，将估值结果发送基金托管人。基金托管人则按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

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。截止本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无需实施利润分配。

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

本报告期内，本基金未出现《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万需要在本报告中予以披露的情形。

§ 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

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对上银鑫卓混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，上银基金管理有限公司在上银鑫卓混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由上银基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关上银鑫卓混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：上银鑫卓混合型证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年06月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	18,875,788.51
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	145,757,651.03
其中：股票投资		144,127,310.23
基金投资		—
债券投资		1,630,340.80
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		—

应收利息	6.4.7.5	13,355.91
应收股利		—
应收申购款		258,374.20
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		164,905,169.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30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		—
应付赎回款		6,935,487.44
应付管理人报酬		258,623.85
应付托管费		25,862.40
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	—
应交税费		16.28
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.8	106,366.87
负债合计		7,326,356.84
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	137,265,603.05
未分配利润	6.4.7.10	20,313,209.76
所有者权益合计		157,578,812.81
负债和所有者权益总计		164,905,169.65

注：1、报告截止日2020年06月30日，基金份额净值1.1480元，基金份额总额137,265,603.05份。

2、本基金合同生效日为2020年01月21日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的资产负债表无同期可比数据。

6.2 利润表

会计主体：上银鑫卓混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日
一、收入		46,876,476.54
1. 利息收入		1,940,922.91
其中：存款利息收入	6.4.7.11	995,647.76
债券利息收入		1,605.45
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		943,669.70
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		29,181,617.71
其中：股票投资收益	6.4.7.12	26,479,034.80
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-64,213.48
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
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	2,766,796.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,614,560.17
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	1,139,375.75
减：二、费用		4,726,136.99

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,098,007.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	309,800.78
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.19	1,228,967.00
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 税金及附加		2.89
7. 其他费用	6.4.7.20	89,359.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		42,150,339.55
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		42,150,339.55

注：本基金合同生效日为2020年01月21日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的利润表无同期可比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上银鑫卓混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06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）	562,949,591.94	—	562,949,591.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	42,150,339.55	42,150,339.55
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）	-425,683,988.89	-21,837,129.79	-447,521,118.68
其中：1. 基金申购款	1,782,113.16	127,413.17	1,909,526.33

2. 基金赎回款	-427,466,102.05	-21,964,542.96	-449,430,645.01
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）	137,265,603.05	20,313,209.76	157,578,812.81

注：本基金合同生效日为2020年01月21日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的所有者权益变动表无同期可比数据。

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：

刘小鹏

衣宏伟

刘漠

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

上银鑫卓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”)《关于准予上银鑫卓混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2019]1763号文)批准,由上银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规及《上银鑫卓混合型证券投资基金基金合同》、《上银鑫卓混合型证券投资基金招募说明书》和《上银鑫卓混合型证券投资基金基金份额发售公告》的规定组织基金发售募集,基金合同于2020年1月21日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为562,949,591.94份基金份额。本基金的基金管理人为上银基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司。

本基金自2019年12月23日至2020年1月17日止期间公开发售。本基金首次向社会公开发售募集且扣除认购费用后的有效认购资金人民币562,949,591.94元,折合562,949,591.94份基金份额,划入基金份额持有人账户。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《上银鑫卓混合型证券投资基金基金合同》和《上银鑫卓混合型证券投资基金招募说明书》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,包括国内依法公开发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、债券(包括国债、央行票据、金

融债、企业债、公司债、可转债（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债、短期融资券、中期票据、超短期融资券等）、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、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它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为60%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者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。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率 \times 70%+中债综合全价指数收益率 \times 30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2020年6月30日的财务状况、自2020年1月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2020年1月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持

有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。
- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。
- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回

款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《上银鑫卓混合型证券投资基金合同》的规定，基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权。

6.4.4.12 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
活期存款	7,663,993.58
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	11,211,794.93
合计	18,875,788.51

注：其他存款是指存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		129,404,483.52	144,127,310.23	14,722,826.71
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,738,607.34	1,630,340.80	-108,266.54
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,738,607.34	1,630,340.80	-108,266.54
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		131,143,090.86	145,757,651.03	14,614,560.17

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 2020年06月30日
应收活期存款利息	6,330.85
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	4,546.02

应收结算备付金利息	-
应收债券利息	2,478.85
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	0.19
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	13,355.91

注：应收其他存款利息是指存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金所产生的应收利息。

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

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	17,407.81
预提费用	88,959.06
合计	106,366.87

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	562,949,591.94	562,949,591.94

本期申购	1,782,113.16	1,782,113.16
本期赎回（以“-”号填列）	-427,466,102.05	-427,466,102.05
本期末	137,265,603.05	137,265,603.05

注：1、本基金自2019年12月23日至2020年1月17日止公开发售，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币562,691,096.32元，募集期间产生孳生利息为人民币258,495.62元，以上实收基金（本息）合计为人民币562,949,591.94元，折合562,949,591.94份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《上银鑫卓混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2020年1月21日（基金合同生效日）至2020年4月9日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购、赎回、转换和定期定额投资业务自2020年4月10日起开始办理。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	27,535,779.38	14,614,560.17	42,150,339.55
本期基金份额交易产生的变动数	-14,755,559.18	-7,081,570.61	-21,837,129.79
其中：基金申购款	90,091.79	37,321.38	127,413.17
基金赎回款	-14,845,650.97	-7,118,891.99	-21,964,542.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,780,220.20	7,532,989.56	20,313,209.76

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日
活期存款利息收入	323,469.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	672,178.50
结算备付金利息收入	-
其他	0.19

合计	995,647.76
----	------------

注：1、其他存款利息收入是指存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

2、其他为直销申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日
卖出股票成交总额	432,601,675.21
减：卖出股票成本总额	406,122,640.41
买卖股票差价收入	26,479,034.80

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 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06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	-64,213.48
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	-64,213.48

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 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,019,197.70

减：卖出债券（、 债转股及债券到期 兑付）成本总额	1,081,980.91
减：应收利息总额	1,430.27
买卖债券差价收入	-64,213.48

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金自2020年1月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日止期间未持有资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金自2020年1月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日止期间未持有贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金自2020年1月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日止期间未持有衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30 日
股票投资产生的股利收益	2,766,796.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,766,796.39

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	14,614,560.17
——股票投资	14,722,826.71

——债券投资	-108,266.54
——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	14,614,560.17

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日
基金赎回费收入	1,139,375.75
合计	1,139,375.75

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日
交易所市场交易费用	1,228,967.00
银行间市场交易费用	-
合计	1,228,967.00

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日
审计费用	23,410.62
信息披露费	65,548.44
其他	400.00
合计	89,359.06

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，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

本报告期内，与本基金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
上银基金管理有限公司（以下简称“上银基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金直销机构
中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

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 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交

		总额的比例
中信证券	964,352,185.81	100.00%

注：本基金合同生效日为2020年01月21日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年，无上年度同期可比数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
中信证券	3,842,041.40	100.00%

注：本基金合同生效日为2020年01月21日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年，无上年度同期可比数据。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中信证券	2,610,000,000.00	100.00%

注：本基金合同生效日为2020年01月21日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年，无上年度同期可比数据。

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 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期	期末应付佣金余额	占期末应

		佣金总量的比例		付佣金总额的比例
中信证券	778,614.88	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认，包含经手费、证管费、结算费及风险金等一级费用。

2、本基金合同生效日为2020年01月21日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年，无上年度同期可比数据。

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 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,098,007.26
其中：支付销售机构的客户维护费	1,339,605.09

注：支付基金管理人上银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	309,800.78

注：支付基金托管人中信证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金自2020年1月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日止期间无通过关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金自2020年1月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日止期间本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方不存在投资本基金的情况。

6.4.10.5 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 2020年01月21日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中信证券 活期存款	7,663,993.58	323,469.07

注：1. 本基金托管户的银行存款由基金托管人中信证券股份有限公司存放在交通银行北京三元支行，按银行活期利率计息。

2. 本基金证券资金户的存款为本基金存放于中信证券股份有限公司基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。2020年1月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日止期间获得的利息收入为人民币672,178.50元，2020年6月30日末券商资金账户余额为11,211,794.93元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金自2020年1月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日止期间未通过关联方购买其承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未向全体份额持有人实施过利润分配。

6.4.12 期末（2020年06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
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股待上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股待上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股待上市	16.42	16.42	5,408	88,799.36	88,799.36	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股待上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股待上市	36.18	36.18	2,311	83,611.98	83,611.98	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股待上市	6.94	6.94	1,420	9,854.80	9,854.80	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股待上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股待上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股待上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
688312	燕麦科技	2020-05-29	2020-12-08	科创板新股限售锁定	19.68	52.03	7,390	145,435.20	384,501.70	-
688520	神州细胞	2020-06-11	2020-12-22	科创板新股限售锁定	25.64	72.43	6,724	172,403.36	487,019.32	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2020年6月30日，本基金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

截止本报告期末2020年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末2020年6月30日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；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。风险管理部向督察长负责。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

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，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建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

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 2020年06月30日
AAA	—
AAA以下	1,630,340.80
未评级	—
合计	1,630,340.80

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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，另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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持大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，除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能及时变现。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资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；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2020年6月30日，本基金所持有的金融负债无固定到期日或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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金主要投资于在国内依法公开发行上市的股票，基金组合资产中的主要标的属于《公开募集证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“流动性新规”）中定义的7个工作日可变现资产的范围，基金管理人每日对基金组合资产中的7个工作日可变现资产的可变价值进行审慎评估和测算，通过证券出入池以及持续研究跟踪，及时发现并调整流动性不再符合本基金流动性管理要求的个别证券，保证该基金每日净赎回申请不超过基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值。本基金主动投资于流动性新规中定义的流动性受限资产的市值不超过基金的资产净值的15%。本基金根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》和流动性新规的要求严格执行开放式基金资金头寸管理的相关规定，每日保持不低于5%的现金和到期日在一年以内的政府债券（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等），以备支付基金份额持有人的赎回款。报告期内本基金组合资产的流动性和变现能力较强，流动性风险较小。

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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金根据所持有资产和负债的按摊余成本法确定的公允价值，并按合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年06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	18,875,788.51	-	-	-	18,875,788.51
交易性	1,630,340.80	-	-	144,127,310.23	145,757,651.03

金融资产					
应收利息	-	-	-	13,355.91	13,355.91
应收申购款	-	-	-	258,374.20	258,374.20
资产总计	20,506,129.31	-	-	144,399,040.34	164,905,169.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,935,487.44	6,935,487.44
应付管理人报酬	-	-	-	258,623.85	258,623.85
应付托管费	-	-	-	25,862.40	25,862.40
应交税费	-	-	-	16.28	16.28
其他负债	-	-	-	106,366.87	106,366.87
负债总计	-	-	-	7,326,356.84	7,326,356.84
利率敏感度缺口	20,506,129.31	-	-	137,072,683.50	157,578,812.81

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券均为可转债，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

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的波动风险。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

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

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 2020年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	144,127,310.23	91.46
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
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	144,127,310.23	91.46

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
	本基金持有的股票涨跌幅与业绩比较基准中的股票指数的涨跌幅一致	
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：人民币元）
		本期末 2020年06月30日
	业绩比较基准上升5%	7,206,365.51
	业绩比较基准下降5%	-7,206,365.51

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	144,127,310.23	87.40
	其中：股票	144,127,310.23	87.40
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,630,340.80	0.99
	其中：债券	1,630,340.80	0.99
	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	18,875,788.51	11.45
8	其他各项资产	271,730.11	0.16
9	合计	164,905,169.65	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,039,730.00	2.56
B	采矿业	—	—
C	制造业	90,574,130.70	57.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	8,437,642.80	5.35

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	855,366.10	0.54
J	金融业	29,843,310.31	18.94
K	房地产业	8,485,198.00	5.38
L	租赁和商务服务业	1,879,166.00	1.19
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	144,127,310.23	91.46

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	600036	招商银行	310,000	10,453,200.00	6.63
2	601318	中国平安	143,799	10,267,248.60	6.52
3	600519	贵州茅台	6,500	9,508,720.00	6.03
4	002142	宁波银行	347,273	9,122,861.71	5.79
5	600048	保利地产	574,100	8,485,198.00	5.38
6	002415	海康威视	270,194	8,200,387.90	5.20
7	000333	美的集团	136,440	8,157,747.60	5.18
8	000661	长春高新	17,100	7,443,630.00	4.72
9	603233	大参林	90,240	7,329,292.80	4.65

10	002007	华兰生物	136,100	6,819,971.00	4.33
11	002821	凯莱英	27,500	6,682,500.00	4.24
12	300122	智飞生物	62,600	6,269,390.00	3.98
13	300760	迈瑞医疗	19,600	5,991,720.00	3.80
14	002271	东方雨虹	136,100	5,529,743.00	3.51
15	002714	牧原股份	49,265	4,039,730.00	2.56
16	300529	健帆生物	52,768	3,667,376.00	2.33
17	002557	洽洽食品	50,200	2,720,338.00	1.73
18	603866	桃李面包	52,000	2,646,280.00	1.68
19	600741	华域汽车	111,700	2,322,243.00	1.47
20	600031	三一重工	121,100	2,271,836.00	1.44
21	600585	海螺水泥	40,500	2,142,855.00	1.36
22	300750	宁德时代	11,200	1,952,832.00	1.24
23	601888	中国中免	12,200	1,879,166.00	1.19
24	000596	古井贡酒	10,500	1,577,520.00	1.00
25	603708	家家悦	22,500	1,108,350.00	0.70
26	603605	珀莱雅	5,900	1,062,118.00	0.67
27	600132	重庆啤酒	13,800	1,007,400.00	0.64
28	002555	三七互娱	18,100	847,080.00	0.54
29	002705	新宝股份	22,600	824,448.00	0.52
30	603208	江山欧派	8,420	820,108.00	0.52
31	688139	海尔生物	14,171	794,426.26	0.50
32	603517	绝味食品	10,600	749,844.00	0.48
33	688520	神州细胞	6,724	487,019.32	0.31
34	688312	燕麦科技	7,390	384,501.70	0.24
35	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.07
36	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.06
37	688377	迪威尔	5,408	88,799.36	0.06
38	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.05
39	688027	国盾量子	2,311	83,611.98	0.05
40	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.02

41	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
42	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
43	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
44	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.01
45	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
46	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
47	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	33,234,118.00	21.09
2	601318	中国平安	30,916,165.89	19.62
3	000333	美的集团	26,003,974.79	16.50
4	600519	贵州茅台	24,701,947.56	15.68
5	000002	万 科 A	19,087,187.00	12.11
6	600048	保利地产	18,079,314.00	11.47
7	002142	宁波银行	18,071,697.48	11.47
8	002120	韵达股份	17,599,362.30	11.17
9	002415	海康威视	16,981,575.97	10.78
10	002372	伟星新材	14,620,334.99	9.28
11	601668	中国建筑	14,115,496.80	8.96
12	603816	顾家家居	13,831,602.35	8.78
13	000786	北新建材	13,274,877.56	8.42
14	600406	国电南瑞	13,021,737.22	8.26
15	002867	周大生	12,835,324.60	8.15
16	600009	上海机场	11,705,128.61	7.43
17	600886	国投电力	11,672,056.00	7.41
18	000858	五 粮 液	11,558,287.00	7.33

19	002271	东方雨虹	10,649,783.00	6.76
20	002008	大族激光	10,505,806.00	6.67
21	002007	华兰生物	10,209,595.45	6.48
22	603233	大参林	10,151,457.70	6.44
23	000661	长春高新	10,026,595.00	6.36
24	300122	智飞生物	10,023,940.95	6.36
25	002821	凯莱英	10,011,307.00	6.35
26	300760	迈瑞医疗	9,977,802.76	6.33
27	603700	宁水集团	9,566,271.00	6.07
28	600438	通威股份	8,800,515.00	5.58
29	603886	元祖股份	8,469,855.03	5.37
30	603180	金牌厨柜	8,180,663.00	5.19
31	002714	牧原股份	6,715,684.00	4.26
32	600176	中国巨石	5,753,300.00	3.65
33	000001	平安银行	5,726,600.00	3.63
34	000651	格力电器	5,700,549.00	3.62
35	300498	温氏股份	5,650,642.00	3.59
36	300059	东方财富	5,649,297.27	3.59
37	000848	承德露露	5,431,053.16	3.45
38	600570	恒生电子	5,346,146.00	3.39
39	300529	健帆生物	5,207,771.06	3.30
40	600741	华域汽车	5,034,575.00	3.19
41	600585	海螺水泥	4,988,000.00	3.17
42	603866	桃李面包	4,974,345.00	3.16
43	600031	三一重工	4,947,752.00	3.14
44	002557	洽洽食品	4,885,102.00	3.10
45	300750	宁德时代	3,245,503.00	2.06

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	24,758,789.50	15.71
2	600519	贵州茅台	22,987,925.40	14.59
3	000333	美的集团	20,134,739.55	12.78
4	601318	中国平安	19,487,293.00	12.37
5	000002	万 科 A	18,673,554.00	11.85
6	002120	韵达股份	18,316,529.80	11.62
7	002372	伟星新材	16,885,546.25	10.72
8	603816	顾家家居	14,145,005.10	8.98
9	000858	五 粮 液	14,075,423.40	8.93
10	002867	周大生	14,005,712.58	8.89
11	601668	中国建筑	13,955,704.80	8.86
12	000786	北新建材	13,606,424.04	8.63
13	600406	国电南瑞	13,354,044.15	8.47
14	603700	宁水集团	12,682,924.90	8.05
15	600009	上海机场	12,614,537.00	8.01
16	600886	国投电力	11,795,250.84	7.49
17	603180	金牌厨柜	9,915,671.10	6.29
18	002142	宁波银行	9,102,733.00	5.78
19	002008	大族激光	8,680,649.00	5.51
20	603886	元祖股份	8,635,146.00	5.48
21	600048	保利地产	8,417,350.00	5.34
22	002415	海康威视	7,789,629.20	4.94
23	600438	通威股份	7,663,855.00	4.86
24	300059	东方财富	6,671,272.00	4.23
25	603233	大参林	6,312,166.60	4.01
26	002821	凯莱英	5,853,144.00	3.71
27	600570	恒生电子	5,828,791.60	3.70
28	002007	华兰生物	5,802,625.00	3.68
29	000661	长春高新	5,766,613.19	3.66

30	000001	平安银行	5,612,000.00	3.56
31	000651	格力电器	5,493,220.00	3.49
32	300122	智飞生物	5,469,455.00	3.47
33	300498	温氏股份	5,338,500.00	3.39
34	002271	东方雨虹	5,322,670.16	3.38
35	300760	迈瑞医疗	5,298,984.00	3.36
36	600176	中国巨石	5,218,900.00	3.31
37	000848	承德露露	5,182,387.05	3.29
38	002714	牧原股份	3,476,058.10	2.21

注：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	535,527,123.93
卖出股票收入（成交）总额	432,601,675.21

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)	1,630,340.80	1.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,630,340.80	1.03

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	113030	东风转债	14,960	1,630,340.80	1.03

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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	—
2	应收证券清算款	—

3	应收股利	—
4	应收利息	13,355.91
5	应收申购款	258,374.20
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	271,730.11

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113030	东风转债	1,630,340.80	1.03

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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
1,562	87,878.11	992,108.49	0.72%	136,273,494.56	99.28%

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	444,439.04	0.32%

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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年01月21日)基金份额总额	562,949,591.94
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,782,113.16
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	427,466,102.05
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	137,265,603.05

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**1、报告期内基金管理人的重大人事变动：**

本基金管理人于2020年1月7日发布《上银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自2020年1月7日起，王玲女士担任公司督察长，总经理刘小鹏先生不再代为履行督察长职务；

本基金管理人于2020年1月20日发布《上银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自2020年1月17日起，黄言先生不再担任公司副总经理；

本基金管理人于2020年2月22日发布《上银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自2020年2月21日起，李湧先生不再担任公司副总经理。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未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	
中信证券	2	964,352,185.81	100.00%	778,614.88	100.00%	-

注：1、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，使用其专用的交易单元作为本基金的交易单元，并由公司管理层批准。

2、本报告期内，本基金无减少租用交易单元；新增租用2个中信证券交易单元。

3、上述佣金包含经手费、证管费、结算费及风险金等一级费用。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	3,842,041.40	100.00%	2,610,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	上银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-01-07
2	上银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-01-20
3	上银鑫卓混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-01-22
4	上银基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	中国证监会规定网站	2020-01-30
5	上银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-02-22
6	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增汇成基金为销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-04-08
7	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增苏宁基金为销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-04-08
8	上银鑫卓混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-04-08
9	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-04-15

	为销售机构及参加费率优惠活动的公告		
10	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中正达广基金为销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-04-15
11	上银基金管理有限公司旗下部分基金2020年第1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-04-22
12	上银鑫卓混合型证券投资基金2020年第1季度报告	中国证监会规定网站	2020-04-22
13	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信证券（华南）为销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-04-30
14	上银鑫卓混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-05-14
15	上银鑫卓混合型证券投资基金更新招募说明书及摘要（2020年第1号）提示性公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-05-14
16	上银鑫卓混合型证券投资基金更新招募说明书（2020年第1号）	中国证监会规定网站	2020-05-14
17	上银鑫卓混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2020年第1号）	中国证监会规定网站	2020-05-14
18	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增联泰基金为销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-05-20
19	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增盈米基金为销售机构及参加费率优惠	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-05-27

	活动的公告		
20	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增陆金所为销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-06-13
21	上银基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-06-17
22	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增同花顺为销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-06-19
23	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增肯特瑞为销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-06-24
24	上银基金管理有限公司旗下部分基金更新招募说明书及摘要提示性公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2020-06-24
25	上银鑫卓混合型证券投资基金更新招募说明书(2020年第2号)	中国证监会规定网站	2020-06-24
26	上银鑫卓混合型证券投资基金更新招募说明书摘要(2020年第2号)	中国证监会规定网站	2020-06-24

§ 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

本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例无达到或超过20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立上银鑫卓混合型证券投资基金的文件
- 2、《上银鑫卓混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《上银鑫卓混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《上银鑫卓混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、报告期内在中国证监会规定报刊上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人，客服电话：021-60231999，公司网址：www.boscam.com.cn。

上银基金管理有限公司
二〇二〇年八月三十一日