

# 上银新兴价值成长混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2021 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年08月26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01月01日起至2021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	10
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	11
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	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	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	47
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	49
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	49
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	49
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	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51

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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	54
§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	上银新兴价值成长混合型证券投资基金
基金简称	上银新兴价值成长混合
基金主代码	000520
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年05月06日
基金管理人	上银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	348,950,942.60份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过在股票、固定收益证券、现金等资产的积极灵活配置，顺应经济结构调整和产业升级发展的趋势，关注新兴产业和传统产业升级换代带来的投资机会，同时把握传统产业低估的投资机会，重点关注具有成长和价值的优质上市公司，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金管理人将分析影响公司持续发展的内外部因素，采用自上而下和自下而上相结合的研究方法，分析公司的外部环境和内部经营，精选新兴产业中的优质上市公司和传统产业中具备新成长动力和价值低估的上市公司股票。同时，将结合宏观经济环境和金融市场运行情况，动态调整股票、债券等大类资产配置。
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率+50%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型基金产品，在开放式基金中，其预期风险和收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于风险较高、收益较高的基金产品。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玲	李申
	联系电话	021-60232799	021-60637102
	电子邮箱	ling.wang@boscam.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		021-60231999	021-60637111
传真		021-60232779	021-60635778
注册地址		上海市浦东新区秀浦路2388号3幢528室	北京市西城区金融大街25号
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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200122	100033
法定代表人		汪明	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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
---------------	-----

	(2021年01月01日- 2021年06月30日)
本期已实现收益	60,992,018.58
本期利润	21,648,294.45
加权平均基金份额本期利润	0.0711
本期加权平均净值利润率	4.41%
本期基金份额净值增长率	5.68%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	133,646,896.82
期末可供分配基金份额利润	0.3830
期末基金资产净值	505,299,582.95
期末基金份额净值	1.448
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	275.13%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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）。

3、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	-2.74%	0.54%	-0.94%	0.41%	-1.80%	0.13%
过去三个月	-1.55%	0.71%	2.23%	0.49%	-3.78%	0.22%
过去六个月	5.68%	0.88%	1.21%	0.66%	4.47%	0.22%

过去一年	47.44%	0.99%	13.98%	0.67%	33.46%	0.32%
过去三年	99.31%	1.19%	31.90%	0.68%	67.41%	0.51%
自基金合同生效起至今	275.13%	1.60%	119.87%	0.90%	155.26%	0.70%

注：本基金在2015年7月30日前（转型前）的业绩比较基准为80%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率，自2015年7月30日起（转型后）的业绩比较基准为50%×沪深300指数收益率+50%×上证国债指数收益率。

### 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

上银新兴价值成长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

(2014年05月06日-2021年06月30日)



注：1、本基金合同生效日为2014年5月6日，自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时资产配置比例符合基金合同约定。

2、本基金转型日期为2015年7月30日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验



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2021年06月30日，公司管理的基金共有32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、上银聚德益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、上银中证500指数增强型证券投资基金、上银聚远盈42个月定期开放债券型证券投资基金、上银内需增长股票型证券投资基金、上银核心成长混合型证券投资基金、上银鑫恒混合型证券投资基金、上银聚远鑫87个月定期开放债券型证券投资基金、上银慧恒收益增强债券型证券投资基金、上银医疗健康混合型证券投资基金、上银慧兴盈债券型证券投资基金、上银丰益混合型证券投资基金、上银科技驱动双周定期可赎回混合型证券投资基金以及上银慧嘉利债券型证券投资基金。

#### 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		
赵治焯	投资副总监、 基金经理	2015- 05-13	-	9.5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5月担任上银可转债精选债券型证券投资基金基金经理，2020年8月担任上银内需增长股票型证券投资基金基金经理，2021年6月担任上银科技驱动双周定期可赎回混合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的公平交易管理制度，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

报告期内，我们面临的宏观环境颇为复杂。尽管疫苗接种加速，然而新冠疫情仍在部分地区零星出现。“三驾马车”之中，出口强劲，然而消费复苏乏力。物价方面，CPI较为温和，然而PPI大幅上涨。美债收益率在年初快速走高之后又显著回落。另一方面，流动性依然是较为充裕的。股票市场上的分化亦很明显，周期股和成长股涨幅较大，消费股和金融股则表现不佳。本基金在“以合理价格买入优秀公司”的投资理念指导下，

从长期主义出发，重点持有格局清晰、护城河宽、现金流好、估值合理的企业，对短期业绩表现给予一定的容忍度。我们相信，时间是优质公司的朋友，优质公司的股价能够穿越市场风格的短期波动。在配置方向上，本基金兼顾传统价值领域和新兴成长赛道的均衡投资。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末上银新兴价值成长混合基金份额净值为1.448元，本报告期内，基金份额净值增长率为5.68%，同期业绩比较基准收益率为1.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球疫苗接种率进一步攀升，经济活动恢复正常化之路进一步延续。国内经济从同比增速口径观察大概率还将回落，货币金融环境有望适度宽松，但绝不会大水漫灌。考虑到全球主要经济体的周期错位，下半年的市场可能还将面临较大的波动性，可以把握机会优化投资组合。从长期视野出发，我们相信随着房住不炒、打破刚兑、科技创新等供给侧结构性改革的持续深入推进，权益类资产在居民各类可配置资产中的地位不断突显。而经济社会的发展转型，人口老龄化、生产生活的绿色低碳化、智能化，内循环战略下的进口替代等孕育了大量的投资机会。

#### 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、分管运营副总、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验。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

依据基金合同有关规定，本报告期内本基金向全体份额持有人进行过一次利润分配。权益登记日为2021年6月21日，每10份基金份额派发1.630元，发放红利56,730,014.42元，其中现金分红55,134,291.49元，红利再投资1,595,722.93元。

#### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为56,730,014.42元。

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

本托管人复核审查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。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：上银新兴价值成长混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	45,751,306.11	51,237,456.21
结算备付金		30,248,970.15	348,660.38
存出保证金		88,162.21	50,601.82
交易性金融资产	6.4.7.2	429,617,783.22	305,879,699.87
其中：股票投资		375,385,630.36	301,416,778.49
基金投资		-	-
债券投资		54,232,152.86	4,462,921.38
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		670,333.48	258,878.50
应收利息	6.4.7.5	55,100.11	16,215.74
应收股利		-	-
应收申购款		115,881.23	7,694.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		506,547,536.51	357,799,207.11
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 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		-	-

应付赎回款		206,232.41	121,323.76
应付管理人报酬		683,088.90	495,633.46
应付托管费		113,848.16	82,605.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	159,829.35	112,191.88
应交税费		263.04	34.84
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,691.70	170,142.15
负债合计		1,247,953.56	981,931.66
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	348,950,942.60	233,952,417.64
未分配利润	6.4.7.10	156,348,640.35	122,864,857.81
所有者权益合计		505,299,582.95	356,817,275.45
负债和所有者权益总计		506,547,536.51	357,799,207.11

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.448元，基金份额总额348,950,942.60份。

## 6.2 利润表

会计主体：上银新兴价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021年01月01日至 2021年06月30日	2020年01月01日至2020年06月30日
<b>一、收入</b>		26,638,986.21	8,803,818.63
1. 利息收入		205,484.09	125,626.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	170,619.86	111,464.87
债券利息收入		34,864.23	14,161.25
资产支持证券利息		-	-

收入			
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		65,540,143.43	25,189,071.37
其中：股票投资收益	6.4.7.12	59,338,935.74	19,504,957.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	24,252.95	2,250,642.19
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	6,176,954.74	3,433,471.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-39,343,724.13	-16,735,500.69
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	237,082.82	224,621.83
<b>减：二、费用</b>		4,990,691.76	2,777,800.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	3,624,251.78	1,973,180.35
2. 托管费	6.4.10.2. 2	604,042.03	328,863.37
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	674,385.29	388,613.15
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		62.75	25.31

7. 其他费用	6.4.7.20	87,949.91	87,118.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,648,294.45	6,026,018.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,648,294.45	6,026,018.38

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上银新兴价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021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）	233,952,417.64	122,864,857.81	356,817,275.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,648,294.45	21,648,294.45
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）	114,998,524.96	68,565,502.51	183,564,027.47
其中：1. 基金申购款	152,935,639.68	91,217,516.97	244,153,156.65
2. 基金赎回款	-37,937,114.72	-22,652,014.46	-60,589,129.18
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）	-	-56,730,014.42	-56,730,014.42
五、期末所有者权益（基金净值）	348,950,942.60	156,348,640.35	505,299,582.95



项 目	上年度可比期间 2020年01月01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)	262,296,748.11	89,792,885.93	352,089,634.04
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	6,026,018.38	6,026,018.38
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	-73,289,355.20	-22,732,998.76	-96,022,353.96
其中: 1. 基金申购款	3,324,350.95	993,720.66	4,318,071.61
2. 基金赎回 款	-76,613,706.15	-23,726,719.42	-100,340,425.57
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)	189,007,392.91	73,085,905.55	262,093,298.46

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

陈士琛

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

上银新兴价值成长混合型证券投资基金(原“上银新兴价值成长股票型证券投资基金”) (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”) 《关于核准上银新兴价值成长股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013] 1599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《上银新兴价值成长股票型证券投资基金基金合同》、《上银新兴价值成长股票型证券投资基金招募说明书》发售，基金合同于2014年5月6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235,995,074.51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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》等相关法律法规及《上银新兴价值成长股票型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人协商一致，自2015年7月30日起，本基金名称变更为“上银新兴价值成长混合型证券投资基金”，基金类别变更为“混合型”，同时相应修改基金合同和托管协议相关表述。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上银新兴价值成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要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（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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）。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%；权证投资占基金资产净值的0%-3%；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，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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×50%+上证国债指数收益率×50%。

#### 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要求，真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况、自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。

#### 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一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间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 2021年06月30日
活期存款	45,751,306.11
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	45,751,306.11

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		347,043,612.14	375,385,630.36	28,342,018.22
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	53,900,978.15	54,232,152.86	331,174.71
	银行间市场	-	-	-
	合计	53,900,978.15	54,232,152.86	331,174.71
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		400,944,590.29	429,617,783.22	28,673,192.93

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	4,774.78
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	6,687.88
应收债券利息	43,597.75
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	39.70
合计	55,100.11

注：其他为应收存出保证金利息

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	159,829.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	159,829.35

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	389.14
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
合计	84,691.70

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	233,952,417.64	233,952,417.64
本期申购	152,935,639.68	152,935,639.68
本期赎回（以“-”号填列）	-37,937,114.72	-37,937,114.72
本期末	348,950,942.60	348,950,942.60

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	74,665,640.86	48,199,216.95	122,864,857.81
本期利润	60,992,018.58	-39,343,724.13	21,648,294.45
本期基金份额交易产生的变动数	54,719,251.80	13,846,250.71	68,565,502.51
其中：基金申购款	70,434,617.95	20,782,899.02	91,217,516.97
基金赎回款	-15,715,366.15	-6,936,648.31	-22,652,014.46
本期已分配利润	-56,730,014.42	-	-56,730,014.42
本期末	133,646,896.82	22,701,743.53	156,348,640.35

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	138,697.38
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	31,329.14
其他	593.34
合计	170,619.86

注：其他为存出保证金利息收入。

## 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
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	229,856,575.95
减：卖出股票成本总额	170,517,640.21
买卖股票差价收入	59,338,935.74

## 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01月01日至2021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	24,252.95
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	24,252.95

## 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01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,892,932.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,864,723.39
减：应收利息总额	3,956.16
买卖债券差价收入	24,252.95

## 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益



本基金本报告期内未持有资产支持证券。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内未持有贵金属。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未持有衍生工具。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	6,176,954.74
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	6,176,954.74

#### 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01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-39,343,724.13
——股票投资	-39,608,281.44
——债券投资	264,557.31
——资产支持证券投资	-
——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	-39,343,724.13
----	----------------

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	236,029.57
转换费收入	1,053.25
合计	237,082.82

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	674,385.29
银行间市场交易费用	-
合计	674,385.29

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,647.35
合计	87,949.91

#### 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
中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)	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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 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01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,624,251.78	1,973,180.35
其中：支付销售机构的客户维护费	125,745.76	58,570.17

注：支付基金管理人上银基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/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01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	604,042.03	328,863.37

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值的0.25%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×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比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 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至	上年度可比期间 2020年01月01日至
----	--------------------	-------------------------

	2021年06月30日	2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	175,930,094.05	175,930,094.05
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	175,930,094.05	175,930,094.05
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	50.42%	93.08%

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

#### 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

本报告期末及上年度报告期末本基金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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行活期存款	45,751,306.11	138,697.38	35,591,597.75	110,100.74

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2021年1月1日至2021年6月30日止期间获得的利息收入为人民币3,618.76元，2021年6月30日末结算备付金余额为227,845.15元。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方购买其承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 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

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息 日	每10份基 金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式发 放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2021-06-21	2021- 06-21	1.630	55,134,291.49	1,595,722.93	56,730,014.42	-
合计			1.630	55,134,291.49	1,595,722.93	56,730,014.42	-

## 6.4.12 期末（2021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
688680	海优 新材	2021-0 1-15	2021-0 7-22	科创板 打新限 售	69.94	243.14	2,026	141,698.44	492,601.64	-
688079	美迪 凯	2021-0 2-23	2021-0 9-02	科创板 打新限 售	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
688625	呈和 科技	2021-0 5-31	2021-1 2-07	科创板 打新限 售	16.48	49.80	2,672	44,034.56	133,065.60	-
688201	信安 世纪	2021-0 4-13	2021-1 0-21	科创板 打新限 售	26.78	47.46	2,129	57,014.62	101,042.34	-
688656	浩欧 博	2021-0 1-06	2021-0 7-13	科创板 打新限 售	35.26	72.51	1,371	48,341.46	99,411.21	-
688499	利元 亨	2021-0 6-23	2022-0 1-03	科创板 打新限 售	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利 集团	2021-0 4-15	2021-1 0-26	创业板 打新限 售	33.22	105.33	786	26,110.92	82,789.38	-
688217	睿昂 基因	2021-0 5-07	2021-1 1-17	科创板 打新限 售	18.42	78.01	1,040	19,156.80	81,130.40	-
688468	科美 诊断	2021-0 3-31	2021-1 0-11	科创板 打新限	7.15	19.50	3,919	28,020.85	76,420.50	-

				售						
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	创业板打新限售	47.33	252.43	283	13,394.39	71,437.69	-
688191	智洋创新	2021-03-30	2021-10-08	科创板打新限售	11.38	20.10	3,203	36,450.14	64,380.30	-
688260	昀冢科技	2021-03-25	2021-10-08	科创板打新限售	9.63	19.43	2,990	28,793.70	58,095.70	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	创业板打新限售	28.28	145.09	360	10,180.80	52,232.40	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	创业板打新限售	7.64	54.81	462	3,529.68	25,322.22	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	创业板打新限售	12.54	31.22	801	10,044.54	25,007.22	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	创业板打新限售	28.77	99.89	240	6,904.80	23,973.60	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	创业板打新限售	21.31	49.91	399	8,502.69	19,914.09	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	创业板打新限售	6.87	14.98	1,162	7,982.94	17,406.76	-
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	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	创业板打新限售	9.19	49.61	329	3,023.51	16,321.69	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	15.83	50.96	317	5,018.11	16,154.32	-

300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	创业板打新限售	4.94	17.26	928	4,584.32	16,017.28	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	24.69	31.70	492	12,147.48	15,596.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	创业板打新限售	18.71	76.32	201	3,760.71	15,340.32	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	创业板打新限售	12.76	43.35	307	3,917.32	13,308.45	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	创业板打新限售	12.25	53.66	244	2,989.00	13,093.04	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	创业板打新限售	3.40	22.13	576	1,958.40	12,746.88	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	创业板打新限售	5.31	28.49	443	2,352.33	12,621.07	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	创业板打新限售	13.75	41.07	275	3,781.25	11,294.25	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	创业板打新限售	8.24	39.27	286	2,356.64	11,231.22	-
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	创业板打新限售	16.53	46.05	232	3,834.96	10,683.60	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	创业板打新限售	6.79	34.76	301	2,043.79	10,462.76	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	创业板打新限售	8.42	16.77	593	4,993.06	9,944.61	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	创业板打新限售	14.79	37.24	264	3,904.56	9,831.36	-



300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	创业板打新限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-01-24	创业板打新限售	12.10	23.23	410	4,961.00	9,524.30	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-02-27	创业板打新限售	7.81	28.93	312	2,436.72	9,026.16	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	4.56	18.87	474	2,161.44	8,944.38	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	创业板打新限售	4.31	13.10	672	2,896.32	8,803.20	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	创业板打新限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-01-22	创业板打新限售	13.06	34.14	254	3,317.24	8,671.56	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	创业板打新限售	8.41	39.12	219	1,841.79	8,567.28	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-00-21	创业板打新限售	5.48	17.07	492	2,696.16	8,398.44	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-00-15	创业板打新限售	18.24	33.37	245	4,468.80	8,175.65	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	创业板打新限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-00-29	创业板打新限售	24.90	27.29	295	7,345.50	8,050.55	-
300926	博俊科技	2020-02-29	2021-07-07	创业板打新限售	10.76	22.16	359	3,862.84	7,955.44	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	创业板打新限售	13.11	24.47	322	4,221.42	7,879.34	-

300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	创业板打新限售	12.13	27.74	283	3,432.79	7,850.42	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	创业板打新限售	4.54	15.34	507	2,301.78	7,777.38	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	创业板打新限售	14.20	44.02	175	2,485.00	7,703.50	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	创业板打新限售	7.19	16.20	430	3,091.70	6,966.00	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	创业板打新限售	13.39	30.08	217	2,905.63	6,527.36	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	9.79	23.00	255	2,496.45	5,865.00	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	创业板打新限售	5.29	19.12	303	1,602.87	5,793.36	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	创业板打新限售	6.02	28.50	201	1,210.02	5,728.50	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	创业板打新限售	14.72	28.81	191	2,811.52	5,502.71	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	创业板打新限售	8.05	32.12	170	1,368.50	5,460.40	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	创业板打新限售	13.87	29.53	183	2,538.21	5,403.99	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	创业板打新限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	创业板打新限售	7.83	22.62	218	1,706.94	4,931.16	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

				售						
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	创业板打新限售	24.60	163.00	494	12,152.40	80,522.00	-
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	2021-06-21	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	1,660	166,000.00	166,000.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2021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2021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2021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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末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。本基金的活期存款存放在本基金的托管人建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大，违约风险可能性很小。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

本基金于本报告期末及上年度末均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及上年度末均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及上年度末均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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	44,139,443.00	-
AAA以下	10,092,709.86	4,462,921.38
未评级	-	-
合计	54,232,152.86	4,462,921.38

注：2020年12月31日的信用评级结果按照2020年12月31日评级列示。

#### 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及上年度末均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及上年度末均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，本基金所持有的全部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。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0 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	45,751,306.11	-	-	-	45,751,306.11
结算备付金	30,248,970.15	-	-	-	30,248,970.15
存出保证金	88,162.21	-	-	-	88,162.21
交易性金融资产	54,232,152.86	-	-	375,385,630.36	429,617,783.22
应收证券清算款	-	-	-	670,333.48	670,333.48
应收利息	-	-	-	55,100.11	55,100.11
应收申购款	-	-	-	115,881.23	115,881.23
资产总计	130,320,591.33	-	-	376,226,945.18	506,547,536.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	206,232.41	206,232.41
应付管理人报酬	-	-	-	683,088.90	683,088.90
应付托管费	-	-	-	113,848.16	113,848.16
应付交易费用	-	-	-	159,829.35	159,829.35
应交税费	-	-	-	263.04	263.04
其他负债	-	-	-	84,691.70	84,691.70
负债总计	-	-	-	1,247,953.56	1,247,953.56
利率敏感度缺口	130,320,591.33	-	-	374,978,991.62	505,299,582.95
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	51,237,456.21	-	-	-	51,237,456.21
结算备	348,660.38	-	-	-	348,660.38

付金					
存出保证金	50,601.82	-	-	-	50,601.82
交易性金融资产	4,462,921.38	-	-	301,416,778.49	305,879,699.87
应收证券清算款	-	-	-	258,878.50	258,878.50
应收利息	-	-	-	16,215.74	16,215.74
应收申购款	-	-	-	7,694.59	7,694.59
资产总计	56,099,639.79	-	-	301,699,567.32	357,799,207.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	121,323.76	121,323.76
应付管理人报酬	-	-	-	495,633.46	495,633.46
应付托管费	-	-	-	82,605.57	82,605.57
应付交易费用	-	-	-	112,191.88	112,191.88
应交税费	-	-	-	34.84	34.84
其他负债	-	-	-	170,142.15	170,142.15
负债总计	-	-	-	981,931.66	981,931.66
利率敏感度缺口	56,099,639.79	-	-	300,717,635.66	356,817,275.45

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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有对利率敏感的金融资产与金融负债。因此，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。

##### 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06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	375,385,630.36	74.29	301,416,778.49	84.47
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	375,385,630.36	74.29	301,416,778.49	84.47

##### 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
----	----------------------

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	26,281,107.79	21,222,200.29
	业绩比较基准下降5%	-26,281,107.79	-21,222,200.29

#### 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	375,385,630.36	74.11
	其中：股票	375,385,630.36	74.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	54,232,152.86	10.71
	其中：债券	54,232,152.86	10.71
	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	76,000,276.26	15.00
8	其他各项资产	929,477.03	0.18
9	合计	506,547,536.51	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	19,164.90	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	274,098,068.01	54.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,813,230.63	2.14
E	建筑业	27,168.76	0.01
F	批发和零售业	55,758.08	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	844,136.70	0.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	223,730.77	0.04
J	金融业	77,110,542.50	15.26
K	房地产业	-	-
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	38,587.26	0.01
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	12,155,242.75	2.41
S	综合	-	-
	合计	375,385,630.36	74.29

### 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	895,500	48,527,145.00	9.60
2	000333	美的集团	632,300	45,127,251.00	8.93
3	600519	贵州茅台	21,092	43,379,916.40	8.58

4	601318	中国平安	444,130	28,548,676.40	5.65
5	002372	伟星新材	1,223,051	25,280,464.17	5.00
6	002867	周大生	1,213,725	23,995,343.25	4.75
7	603180	金牌厨柜	446,252	21,281,757.88	4.21
8	002508	老板电器	429,113	19,953,754.50	3.95
9	603886	元祖股份	1,012,101	17,640,920.43	3.49
10	603700	宁水集团	710,110	17,177,560.90	3.40
11	600761	安徽合力	1,245,641	13,776,789.46	2.73
12	300788	中信出版	330,575	12,155,242.75	2.41
13	600900	长江电力	523,266	10,800,210.24	2.14
14	600031	三一重工	367,900	10,694,853.00	2.12
15	002677	浙江美大	539,453	9,861,200.84	1.95
16	002242	九阳股份	292,200	9,493,578.00	1.88
17	603816	顾家家居	109,408	8,455,050.24	1.67
18	300408	三环集团	78,100	3,313,002.00	0.66
19	600309	万华化学	23,400	2,546,388.00	0.50
20	002120	韵达股份	62,390	844,136.70	0.17
21	688680	海优新材	2,026	492,601.64	0.10
22	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.04
23	688625	呈和科技	2,672	133,065.60	0.03
24	688201	信安世纪	2,129	101,042.34	0.02
25	688656	浩欧博	1,371	99,411.21	0.02
26	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
27	300979	华利集团	786	82,789.38	0.02
28	688217	睿昂基因	1,040	81,130.40	0.02
29	300919	中伟股份	494	80,522.00	0.02
30	688468	科美诊断	3,919	76,420.50	0.02
31	300973	立高食品	493	72,847.40	0.01
32	300957	贝泰妮	283	71,437.69	0.01
33	688191	智洋创新	3,203	64,380.30	0.01
34	688260	昀冢科技	2,990	58,095.70	0.01

35	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
36	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
37	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
38	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
39	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
40	300987	川网传媒	704	26,163.64	0.01
41	301015	百洋医药	462	25,322.22	0.01
42	301009	可靠股份	801	25,007.22	0.00
43	300953	震裕科技	240	23,973.60	0.00
44	300971	博亚精工	645	22,279.65	0.00
45	300941	创识科技	399	19,914.09	0.00
46	300968	格林精密	1,220	18,323.16	0.00
47	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
48	300614	百川畅银	329	16,321.69	0.00
49	300982	苏文电能	317	16,154.32	0.00
50	300997	欢乐家	928	16,017.28	0.00
51	300932	三友联众	492	15,596.40	0.00
52	301002	崧盛股份	201	15,340.32	0.00
53	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
54	300940	南极光	307	13,308.45	0.00
55	300937	药易购	244	13,093.04	0.00
56	300962	中金辐照	576	12,746.88	0.00
57	300942	易瑞生物	443	12,621.07	0.00
58	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
59	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
60	301016	雷尔伟	275	11,294.25	0.00
61	300966	共同药业	286	11,231.22	0.00
62	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
63	300955	嘉亨家化	232	10,683.60	0.00
64	300978	东箭科技	593	9,944.61	0.00
65	300986	志特新材	264	9,831.36	0.00

66	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
67	300993	玉马遮阳	410	9,524.30	0.00
68	301004	嘉益股份	312	9,026.16	0.00
69	300945	曼卡龙	474	8,944.38	0.00
70	300931	通用电梯	672	8,803.20	0.00
71	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
72	300991	创益通	254	8,671.56	0.00
73	300950	德固特	219	8,567.28	0.00
74	300975	商络电子	492	8,398.44	0.00
75	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
76	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
77	300985	致远新能	295	8,050.55	0.00
78	300926	博俊科技	359	7,955.44	0.00
79	300930	屹通新材	322	7,879.34	0.00
80	300963	中洲特材	283	7,850.42	0.00
81	300967	晓鸣股份	507	7,777.38	0.00
82	301011	华立科技	175	7,703.50	0.00
83	300972	万辰生物	430	6,966.00	0.00
84	300927	江天化学	217	6,527.36	0.00
85	300943	春晖智控	255	5,865.00	0.00
86	301007	德迈仕	303	5,793.36	0.00
87	300998	宁波方正	201	5,728.50	0.00
88	300995	奇德新材	191	5,502.71	0.00
89	301012	扬电科技	170	5,460.40	0.00
90	300929	华骐环保	183	5,403.99	0.00
91	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
92	301010	晶雪节能	218	4,931.16	0.00
93	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
94	001201	东瑞股份	108	4,421.52	0.00
95	688655	迅捷兴	26	530.40	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	000333	美的集团	25,603,995.82	7.18
2	600036	招商银行	21,941,789.00	6.15
3	600519	贵州茅台	19,371,963.90	5.43
4	002508	老板电器	18,507,071.00	5.19
5	600761	安徽合力	17,515,390.16	4.91
6	002372	伟星新材	16,737,925.40	4.69
7	600900	长江电力	16,732,675.06	4.69
8	601318	中国平安	16,564,428.79	4.64
9	600025	华能水电	14,302,533.00	4.01
10	002867	周大生	13,571,147.50	3.80
11	603700	宁水集团	12,990,330.80	3.64
12	000002	万科A	12,271,294.99	3.44
13	603180	金牌厨柜	10,961,913.00	3.07
14	600031	三一重工	9,838,308.00	2.76
15	300788	中信出版	9,234,626.44	2.59
16	002677	浙江美大	8,974,644.00	2.52
17	603886	元祖股份	7,969,286.21	2.23
18	002242	九阳股份	6,450,653.00	1.81
19	002381	双箭股份	5,652,478.00	1.58
20	603816	顾家家居	5,200,495.00	1.46

注：买入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。

## 7.4.2 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	600025	华能水电	45,222,638.00	12.67
2	000002	万科A	24,718,597.01	6.93
3	000858	五粮液	22,936,081.07	6.43
4	600036	招商银行	14,422,944.00	4.04
5	600519	贵州茅台	13,430,616.00	3.76
6	002381	双箭股份	12,797,475.00	3.59
7	002415	海康威视	11,734,125.23	3.29
8	002508	老板电器	9,588,451.98	2.69
9	600900	长江电力	6,763,094.00	1.90
10	601318	中国平安	5,583,781.00	1.56
11	002372	伟星新材	5,430,520.64	1.52
12	002677	浙江美大	5,075,784.00	1.42
13	600406	国电南瑞	4,363,330.00	1.22
14	000333	美的集团	3,769,492.00	1.06
15	603886	元祖股份	3,057,853.00	0.86
16	603180	金牌厨柜	2,871,495.00	0.80
17	300408	三环集团	2,255,883.00	0.63
18	300788	中信出版	2,132,251.00	0.60
19	603816	顾家家居	2,115,879.00	0.59
20	603700	宁水集团	1,921,827.00	0.54

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	284,094,773.52
卖出股票收入（成交）总额	229,856,575.95

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	-	-
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)	54,232,152.86	10.73
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	54,232,152.86	10.73

#### 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	113044	大秦转债	427,300	43,973,443.00	8.70
2	127035	濮耐转债	52,950	5,605,816.50	1.11
3	128107	交科转债	41,331	4,486,893.36	0.89
4	113050	南银转债	1,660	166,000.00	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**

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。本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内有受到中国银行保险监督管理委员会罚款的处罚。经分析，上述处罚事项对证券投资价值未产生实质影响；本基金对证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述情形外，本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内没有受到公开谴责、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	88,162.21
2	应收证券清算款	670,333.48
3	应收股利	-
4	应收利息	55,100.11
5	应收申购款	115,881.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	929,477.03

**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
----	------	------	------	-------

				产净值比例 (%)
1	113044	大秦转债	43,973,443.00	8.70
2	128107	交科转债	4,486,893.36	0.89

### 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
10,293	33,901.77	320,536,738.34	91.86%	28,414,204.26	8.14%

### 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	354,255.99	0.10%

### 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	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年05月06日)基金份额总额	235,995,074.51
本报告期期初基金份额总额	233,952,417.64
本报告期基金总申购份额	152,935,639.68
减：本报告期基金总赎回份额	37,937,114.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	348,950,942.60

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 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2021年3月31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2021年3月29日起，汪天光先生不再担任公司副总经理；

本基金管理人于2021年4月23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2021年4月22日起，尉迟平女士担任公司副总经理。

#### 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

无。

### 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

本基金本报告期审计机构为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。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	
东方财富	1	96,080,777.25	19.00%	89,478.63	23.91%	-
方正证券	1	176,105,704.63	34.83%	111,176.01	29.71%	-
广发证券	2	195,732,490.16	38.72%	139,226.49	37.21%	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	37,638,752.98	7.44%	34,300.40	9.17%	-

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，选择基金交易单元，并由公司管理层批准。

2、本基金本报告期内无新增交易单元，减少租用方正证券1个交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
东方财富	14,739,224.70	24.93%	-	-	-	-	-	-
方正	38,797,759.90	65.63%	-	-	-	-	-	-

证券								
广发 证券	5,578,317.89	9.44%	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商 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	上银新兴价值成长混合型证券投资基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务限额的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2021-01-08
2	上银新兴价值成长混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入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	2021-01-15
3	上银基金管理有限公司关于终止与大泰金石基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2021-01-19
4	上银基金管理有限公司旗下部分基金2020年第4季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2021-01-22
5	上银新兴价值成长混合型证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会规定网站	2021-01-22
6	上银基金管理有限公司关于网上直销平台银联通支付通道部分交易业务暂停的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2021-01-26
7	上银基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公示	中国证监会规定网站	2021-02-05

8	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网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	2021-02-26
9	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行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	2021-03-17
10	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	2021-03-31
11	上银基金管理有限公司旗下部分基金2020年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2021-03-31
12	上银新兴价值成长混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会规定网站	2021-03-31
13	上银基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低认申购金额、最低追加金额、最低定期定额投资金额、最低赎回份额、最低转换份额及账户最低保留份额的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2021-04-06
14	上银基金管理有限公司旗下部分基金2021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	2021-04-22
15	上银新兴价值成长混合型证券投资基金2021年第1季度报告	中国证监会规定网站	2021-04-22
16	上银基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2021-04-23
17	上银基金管理有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要提示性公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2021-05-21

18	上银新兴价值成长混合型证券投资基金更新招募说明书（2021年第1号）	中国证监会规定网站	2021-05-21
19	上银新兴价值成长混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（2021年第1号）	中国证监会规定网站	2021-05-21
20	上银基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告	中国证监会规定网站	2021-06-01
21	上银新兴价值成长混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2021-06-03
22	上银新兴价值成长混合型证券投资基金分红公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2021-06-18

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210630	175,930,094.05	0.00	0.00	175,930,094.05	50.42%
	2	20210309-20210630	0.00	125,627,512.56	0.00	125,627,512.56	36.00%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回或巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动或份额净值尾差风险，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

### 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、中国证监会批准设立上银新兴价值成长股票型证券投资基金的文件



- 2、《上银新兴价值成长股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《上银新兴价值成长股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《上银新兴价值成长股票型证券投资基金招募说明书》
- 5、《上银新兴价值成长混合型证券投资基金基金合同》
- 6、《上银新兴价值成长混合型证券投资基金托管协议》
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 8、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](http://www.boscam.com.cn)。

上银基金管理有限公司  
二〇二一年八月三十一日