上银鑫卓混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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:2023 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2023年08月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023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 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
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遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 20
§7 投资组合报告 43
7.1 期末基金资产组合情况 43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 44
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 45
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 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 本基金投资股指期货的投资政策 49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 49
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 53
§11 影响投资者决策的其他重要信息 55
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 55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 55
§12 备查文件目录 55
12.1 备查文件目录 55
12.2 存放地点 56
12.3 查阅方式 56

§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	217,970,842.58份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	上银鑫卓混合A	上银鑫卓混合C
下属分级基金的交易代码	008244	015745
报告期末下属分级基金的份额总额	217,553,642.40份	417,200.18份

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	姓名	王玲	杨军智

露负责人	联系电话	021-60232799	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		武俊	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(2023年01月01日-2023年06月30日)	
	上银鑫卓混合A	上银鑫卓混合C

本期已实现收益	2,220,020.22	2,404.27
本期利润	-15,263,764.75	-28,945.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0641	-0.1326
本期加权平均净值利润率	-4.99%	-10.58%
本期基金份额净值增长率	-5.40%	-5.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	28,611,280.75	55,895.55
期末可供分配基金份额利润	0.1315	0.1340
期末基金资产净值	261,292,776.85	497,691.89
期末基金份额净值	1.2010	1.1929
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	20.10%	-10.61%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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部分的孰低数（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

上银鑫卓混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.33%	0.72%	0.88%	0.61%	1.45%	0.11%
过去三个月	-7.32%	0.81%	-3.32%	0.58%	-4.00%	0.23%
过去六个月	-5.40%	0.91%	-0.08%	0.59%	-5.32%	0.32%

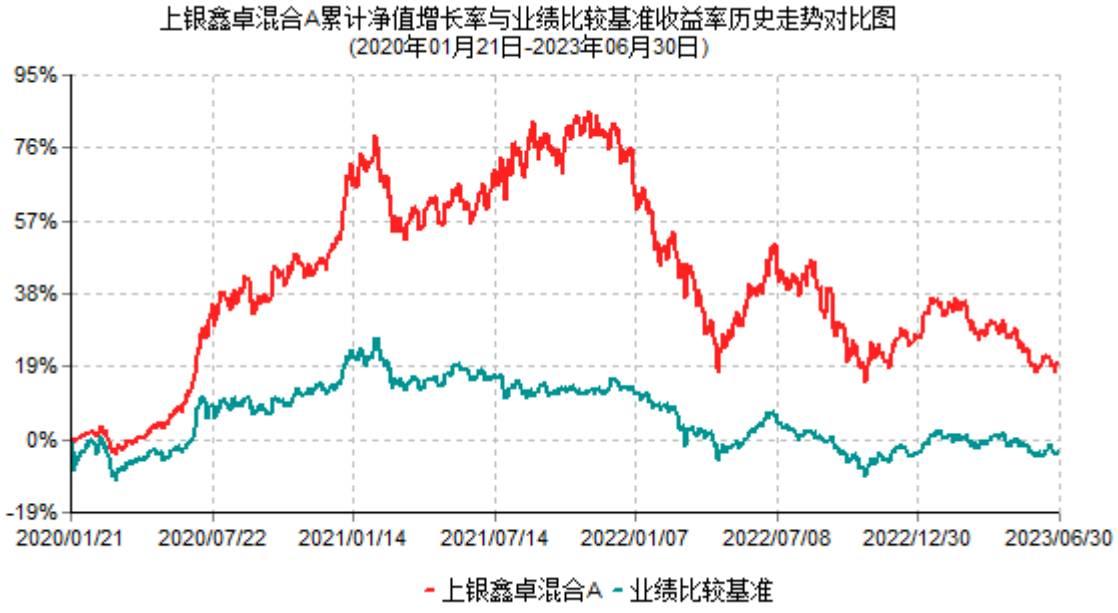
过去一年	-18.10%	1.31%	-9.67%	0.69%	-8.43%	0.62%
过去三年	4.62%	1.42%	-3.56%	0.84%	8.18%	0.58%
自基金合同生效起至今	20.10%	1.35%	-3.46%	0.87%	23.56%	0.48%

上银鑫卓混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.28%	0.73%	0.88%	0.61%	1.40%	0.12%
过去三个月	-7.45%	0.81%	-3.32%	0.58%	-4.13%	0.23%
过去六个月	-5.68%	0.91%	-0.08%	0.59%	-5.60%	0.32%
过去一年	-18.62%	1.32%	-9.67%	0.69%	-8.95%	0.63%
自基金合同生效起至今	-10.61%	1.34%	-2.14%	0.70%	-8.47%	0.64%

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



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、本基金自2022年5月20日起增加C类基金份额。

§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08月30日正式成立，股东为上海银行股份有限公司，注册资本为3亿元人民币，注册地上海。截至2023年06月30日，公司管理的基金共有51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、上银慧嘉利债券型证券投资基金、上银鑫尚稳健回报6个月持有期混合型证券投资基金、上银慧鼎利债券型证券投资基金、上银中债5-10年国开行债券指数证券投资基金、上银恒泰稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、上银高质量优选9个月持有期混合型证券投资基金、上银慧尚6个月持有期混合型证券投资基金、上银价值增长3个月持有期混合型证券投资基金、上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、上银新能源产业精选混合型发起式证券投资基金、上银聚顺益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、上银恒享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、上银聚恒益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、上银慧享利30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、上银慧信利三个月定期开放债券型证券投资基金、上银慧鑫利债券型证券投资基金、上银聚嘉益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、上银中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、上银聚合益一年定期开放债券型发起式证券投资基金以及上银恒睿养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。

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		
卢扬	权益投研部总监、投资总监、基金经理	2020-08-17	-	17年	硕士研究生，历任中信建投证券研究所分析师，中国国际金融有限公司分析师，上投摩根基金管理有限公司基金经理、行业专家，申万菱信基金管理有限公司权益投资部总经理、基金经理，上海联创永泉资产管理有限公司权益投资总监等职。2020年8月担任上银鑫卓混合型证

					券投资基金基金经理，2020年11月担任上银鑫恒混合型证券投资基金基金经理，2021年7月担任上银鑫尚稳健回报6个月持有期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相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

回顾半年度的市场走势，市场经历了从基于强预期的上涨到基于弱现实的调整，整体呈现出了先扬后抑的走势，上证综指、创业板综指分别上涨3.6%，5.7%，而消费以及基金重仓股权重占比较高的沪深300小幅下跌0.8%。在经济走势略不及预期、流动性宽松的背景下，ChatGPT为代表的数字经济主题表现最为强势，中信30个一级行业中与

ChatGPT关联度最紧密的通信、传媒、计算机涨幅居前，分别大涨45%、43%、32%；与此同时，受益于资产稀缺、以高股息为代表的中特估表现也不错，家电、建筑、石油石化等均录得正收益，而与地产、消费相关的餐饮旅游、房地产、建材、食品饮料等板块领跌。

半年来，我们对组合持续进行调整和优化，我们大幅减仓了年初涨幅较大的白酒、啤酒、定制家具等可选消费，同时逢低加仓了低估值、高股息的运营商、石油、煤炭、国有大行、高速公路等，这些个股都是中国特色估值体系中最为受益的品种，因为它们都具备了高分红、低PB以及管理改善提升ROE的能力，与国际可比公司相比估值都是显著低估，同时经济的复苏也带动它们的下游需求稳定增长，相信随着它们盈利能力的持续改善，将会迎来估值的持续修复，而短期市场追逐成长风格的热点也给我们提供了较好的中长期买点。

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A基金份额净值为1.2010元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.40%，同期业绩比较基准收益率为-0.08%；截至报告期末上银鑫卓混合C基金份额净值为1.1929元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.68%，同期业绩比较基准收益率为-0.08%。

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，考虑到去年上半年的低基数，我们已经度过了经济同比增长最快的时期，后续的投资将更加聚焦于行业竞争格局的演变以及企业自身经营状况的改善，我们将通过对即将公布中期财务报告的分析和研判，针对持仓公司的市场份额变动、竞争格局演变、业绩增长前景以及重点财务指标变动等综合考量，对组合进行持续的优化和调整，力争给基金份额持有人带来更好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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基金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高管、督察长、分管运营高管、投资研究部门负责人、交易部负责人、监察稽核部负责人、风险管理部负责人、基金运营部负责人及相关专业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。

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遵规守信、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 半年度财务会计报告（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：2023年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	29,171,978.57	31,904,863.06
结算备付金		69,680.77	69,331.83
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	247,281,009.35	286,204,803.12
其中：股票投资		247,213,147.95	286,133,930.88
基金投资		-	-
债券投资		67,861.40	70,872.24
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-

应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,850.19	11,570.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		276,528,518.88	318,190,568.36
负债和净资产	**附注号**	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		14,164,541.66	40,541.43
应付管理人报酬		341,660.07	403,712.46
应付托管费		34,166.00	40,371.25
应付销售服务费		218.17	51.97
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.32	1.36
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	197,462.92	170,010.24
负债合计		14,738,050.14	654,688.71
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	217,970,842.58	250,107,434.09
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	43,819,626.16	67,428,445.56
净资产合计		261,790,468.74	317,535,879.65
负债和净资产总计		276,528,518.88	318,190,568.36

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额总额217,970,842.58份，其中上银鑫卓混合型证券投资基金A类基金份额净值1.2010元，基金份额217,553,642.40份；上银鑫卓混合型证券投资基金C类基金份额净值1.1929元，基金份额417,200.18份。

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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		-12,701,997.07	-78,134,689.49
1.利息收入		153,405.15	385,845.83
其中：存款利息收入	6.4.7.9	153,405.15	385,845.83
债券利息收入		-	-
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）		4,654,231.51	-73,171,698.46
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,376,474.47	-74,986,452.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	688.45	1,875.12
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	6,030,017.53	1,812,879.40
以摊余成本计量的		-	-

金融资产终止确认产生的收益			
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-17,515,134.87	-5,357,758.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,501.14	8,921.98
减：二、营业总支出		2,590,713.31	3,270,310.32
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	2,280,071.71	2,896,369.39
2．托管费	6.4.10.2.2	228,007.21	289,636.93
3．销售服务费	6.4.10.2.3	810.82	0.76
4. 投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7．税金及附加		0.71	0.68
8．其他费用	6.4.7.19	81,822.86	84,302.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,292,710.38	-81,404,999.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,292,710.38	-81,404,999.81
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-15,292,710.38	-81,404,999.81

6.3 净资产（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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	250,107,434.09	-	67,428,445.56	317,535,879.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	250,107,434.09	-	67,428,445.56	317,535,879.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-32,136,591.51	-	-23,608,819.40	-55,745,410.91
（一）、综合收益总额	-	-	-15,292,710.38	-15,292,710.38
（二）、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）	-32,136,591.51	-	-8,316,109.02	-40,452,700.53
其中：1.基金申购款	2,958,488.84	-	841,846.98	3,800,335.82
2.基金赎回款	-35,095,080.35	-	-9,157,956.00	-44,253,036.35
（三）、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）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	217,970,842.58	-	43,819,626.16	261,790,468.74
项 目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	272,490,771.76	-	208,045,049.77	480,535,821.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	272,490,771.76	-	208,045,049.77	480,535,821.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-412,716.98	-	-81,113,170.32	-81,525,887.30
（一）、综合收益总额	-	-	-81,404,999.81	-81,404,999.81
（二）、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	-412,716.98	-	291,829.49	-120,887.49

列）				
其中：1.基金申购款	10,575,604.16	-	5,122,659.94	15,698,264.10
2.基金赎回款	-10,988,321.14	-	-4,830,830.45	-15,819,151.59
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	272,078,054.78	-	126,931,879.45	399,009,934.23

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:

尉迟平	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《关于上银鑫卓混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自2022年5月20日起增加收取销售服务费的C类份额，并对本基金的基金合同作相应修改。在本基金增加收取销售服务费的C类份额后，原有的基金份额将全部自动转换为本基金A类份额。对投资者收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；对投资者不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

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的股票）、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、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×70%+中债综合全价指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

本基金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和《资产管理产品相关会计处理规定》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

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》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2023年6月30日的财务状况、2023年1月1日至2023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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、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》、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。

自2018年1月1日起，资管产品管理人 (以下称管理人) 运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018年1月1日 (含) 以后，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。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。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，其股息红利所得暂减按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。

(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 2023年06月30日
活期存款	7,770,232.05
等于：本金	7,766,348.30
加：应计利息	3,883.75
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	21,401,746.52
等于：本金	21,396,146.59
加：应计利息	5,599.93
减：坏账准备	-
合计	29,171,978.57

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 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		249,220,643.28	-	247,213,147.95	-2,007,495.33
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	60,000.00	331.40	67,861.40	7,530.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	60,000.00	331.40	67,861.40	7,530.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		249,280,643.28	331.40	247,281,009.35	-1,999,965.33

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期内无按预期信用损失一般模型计提的减值准备。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.06

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
其他应付	115,640.00
合计	197,462.92

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 上银鑫卓混合A

金额单位：人民币元

项目 (上银鑫卓混合A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	250,049,350.87	250,049,350.87
本期申购	2,308,967.61	2,308,967.61
本期赎回（以“-”号填列）	-34,804,676.08	-34,804,676.08
本期末	217,553,642.40	217,553,642.40

6.4.7.7.2 上银鑫卓混合C

金额单位：人民币元

项目 (上银鑫卓混合C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,083.22	58,083.22
本期申购	649,521.23	649,521.23
本期赎回（以“-”号填列）	-290,404.27	-290,404.27
本期末	417,200.18	417,200.18

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 上银鑫卓混合A

单位：人民币元

项目 (上银鑫卓混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	30,463,980.20	36,949,090.55	67,413,070.75
本期利润	2,220,020.22	-17,483,784.97	-15,263,764.75
本期基金份额交易产生的变动数	-4,072,719.67	-4,337,451.88	-8,410,171.55
其中：基金申购款	280,188.78	381,620.70	661,809.48
基金赎回款	-4,352,908.45	-4,719,072.58	-9,071,981.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,611,280.75	15,127,853.70	43,739,134.45

6.4.7.8.2 上银鑫卓混合C

单位：人民币元

项目 (上银鑫卓混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	7,439.47	7,935.34	15,374.81
本期利润	2,404.27	-31,349.90	-28,945.63
本期基金份额交易产生的变动数	46,051.81	48,010.72	94,062.53
其中：基金申购款	82,474.44	97,563.06	180,037.50
基金赎回款	-36,422.63	-49,552.34	-85,974.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,895.55	24,596.16	80,491.71

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	20,350.35
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	132,705.86
结算备付金利息收入	348.94
其他	-
合计	153,405.15

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利息收入；

2. 结算备付金利息收入为期货保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	287,788,199.46
减：卖出股票成本总额	288,429,519.85
减：交易费用	735,154.08
买卖股票差价收入	-1,376,474.47

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	231.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	457.07
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	688.45

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,464.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,000.00
减：应计利息总额	5.26
减：交易费用	2.00
买卖债券差价收入	457.07

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未产生资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内未持有衍生工具。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	6,030,017.53
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	6,030,017.53

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日

1.交易性金融资产	-17,515,134.87
——股票投资	-17,514,890.67
——债券投资	-244.20
——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	-17,515,134.87

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	5,499.05
转换费收入	2.09
合计	5,501.14

6.4.7.18 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

合计	81,822.86

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

为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案：上银基金管理有限公司决定自 2023 年 7 月 31 日起，调低本基金管理费率：管理费率由1.5%下调至1.2%，并对基金合同等相关文件有关条款进行修订。除此之外，截至资产负债表日，本基金并无其他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

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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额	成交金额	占当期股票成交总额

		的比例		的比例
中信证券	554,811,827.05	100.00%	1,042,188,019.31	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比区间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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
中信证券	3,464.33	100.00%	106,833.20	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过回购交易。

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 2023年01月01日至2023年06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
中信证券	443,984.90	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总

		量的比例		额的比例
中信证券	834,140.31	100.00%	-	-

注：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。

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,280,071.71	2,896,369.39
其中：支付销售机构的客户维护费	989,585.58	1,172,098.95

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1.50%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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	228,007.21	289,636.93

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

名称	上银鑫卓混合A	上银鑫卓混合C	合计
上银基金	0.00	3.33	3.33
合计	0.00	3.33	3.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	上银鑫卓混合A	上银鑫卓混合C	合计
上银基金	0.00	0.76	0.76
合计	0.00	0.76	0.76

注：1、支付基金销售机构的C类基金份额按前一日该类基金资产净值的0.60%年费率计提。其计算公式为：日销售服务费＝前一日C类基金份额资产净值×0.60%/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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比区间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人在本报告期内及上年度可比期间均未持有本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度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。

6.4.10.6 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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
中信证券活期存款	7,770,232.05	20,350.35	39,498,478.16	339,867.38

注：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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

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——固定净值型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（2023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

截止本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而受约束的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截止本报告期末，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，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，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

截止本报告期末，本基金未持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

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
- 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和其下属风险管理人员负责，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。本基金的银行存款存放在信用良好的金融机构，与该银行存款相关的信用风险不重大。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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	67,861.40	70,872.24
未评级	-	-
合计	67,861.40	70,872.24

注：2022年12月31日的信用评级结果按2022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。本基金所持证券均可在证券交易所或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。

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，因此账面余额约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投资标的属于《公开募集开放式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、存出保证金等。本基金的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。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	29,171,978.57	-	-	-	29,171,978.57
结算备付金	69,680.77	-	-	-	69,680.77
交易性金融资产	-	67,861.40	-	247,213,147.95	247,281,009.35
应收申购款	-	-	-	5,850.19	5,850.19
资产总计	29,241,659.34	67,861.40	-	247,218,998.14	276,528,518.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,164,541.66	14,164,541.66
应付管理人报酬	-	-	-	341,660.07	341,660.07
应付托管费	-	-	-	34,166.00	34,166.00
应付销售服务费	-	-	-	218.17	218.17
应交税费	-	-	-	1.32	1.32
其他负债	-	-	-	197,462.92	197,462.92
负债总计	-	-	-	14,738,050.14	14,738,050.14
利率敏感度缺	29,241,659.34	67,861.40	-	232,480,948.00	261,790,468.74

口					
上年度末 2022 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	31,904,863.06	-	-	-	31,904,863.06
结算备付金	69,331.83	-	-	-	69,331.83
交易性金融资产	-	70,872.24	-	286,133,930.88	286,204,803.12
应收申购款	-	-	-	11,570.35	11,570.35
资产总计	31,974,194.89	70,872.24	-	286,145,501.23	318,190,568.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	40,541.43	40,541.43
应付管理人报酬	-	-	-	403,712.46	403,712.46
应付托管费	-	-	-	40,371.25	40,371.25
应付销售服务费	-	-	-	51.97	51.97
应交税费	-	-	-	1.36	1.36
其他负债	-	-	-	170,010.24	170,010.24
负债总计	-	-	-	654,688.71	654,688.71
利率敏感度缺口	31,974,194.89	70,872.24	-	285,490,812.52	317,535,879.65

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2023年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为0.03%(2022年12月31日：0.02%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022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

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。

于6月30日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

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 2023年06月30日		上年度末 2022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	247,213,147.95	94.43	286,133,930.88	90.11
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	247,213,147.95	94.43	286,133,930.88	90.11

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		
	本基金持有的股票的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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1.权益性投资的市场价格上升5%	12,360,657.40	14,306,696.54
	2.权益性投资的市场价格下降5%	-12,360,657.40	-14,306,696.54

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

以公允价值计量的资产和负债：公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；第三层次输入值： 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	247,281,009.35	286,194,049.77
第二层次	-	-
第三层次	-	10,753.35

合计	247,281,009.35	286,204,803.12

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、买入返售金融资产、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2023年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	247,213,147.95	89.40
	其中：股票	247,213,147.95	89.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	67,861.40	0.02
	其中：债券	67,861.40	0.02
	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	29,241,659.34	10.57

8	其他各项资产	5,850.19	0.00
9	合计	276,528,518.88	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

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	62,758,102.00	23.97
C	制造业	71,124,215.95	27.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,654,660.00	1.78
E	建筑业	5,417,986.00	2.07
F	批发和零售业	8,626,667.00	3.30
G	交通运输、仓储和邮政业	28,115,178.00	10.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,724,430.00	5.24
J	金融业	48,796,179.00	18.64
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,812,530.00	1.07
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	1,183,200.00	0.45
S	综合	-	-
	合计	247,213,147.95	94.43

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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	600941	中国移动	147,100	13,724,430.00	5.24
2	601398	工商银行	2,795,600	13,474,792.00	5.15
3	601288	农业银行	3,802,900	13,424,237.00	5.13
4	601088	中国神华	420,500	12,930,375.00	4.94
5	601225	陕西煤业	689,500	12,542,005.00	4.79
6	600887	伊利股份	423,400	11,990,688.00	4.58
7	601857	中国石油	1,600,800	11,957,976.00	4.57
8	600938	中国海油	621,000	11,252,520.00	4.30
9	601939	建设银行	1,731,800	10,841,068.00	4.14
10	000651	格力电器	289,100	10,555,041.00	4.03
11	000333	美的集团	178,100	10,493,652.00	4.01
12	000983	山西焦煤	961,500	8,749,650.00	3.34
13	001965	招商公路	699,300	6,713,280.00	2.56
14	603939	益丰药房	155,680	5,760,160.00	2.20
15	601988	中国银行	1,424,300	5,569,013.00	2.13
16	300124	汇川技术	85,900	5,515,639.00	2.11
17	601006	大秦铁路	741,000	5,505,630.00	2.10
18	601658	邮储银行	1,122,100	5,487,069.00	2.10
19	601668	中国建筑	943,900	5,417,986.00	2.07
20	600377	宁沪高速	531,900	5,228,577.00	2.00
21	600188	兖矿能源	173,500	5,191,120.00	1.98
22	600350	山东高速	777,100	4,950,127.00	1.89
23	600900	长江电力	211,000	4,654,660.00	1.78
24	002154	报 喜 鸟	812,100	4,482,792.00	1.71
25	002032	苏 泊 尔	71,800	3,590,000.00	1.37

26	601766	中国中车	446,600	2,902,900.00	1.11
27	002293	罗莱生活	249,600	2,870,400.00	1.10
28	600546	山煤国际	198,100	2,866,507.00	1.09
29	002027	分众传媒	413,000	2,812,530.00	1.07
30	002050	三花智控	91,900	2,780,894.00	1.06
31	600132	重庆啤酒	28,600	2,635,776.00	1.01
32	601100	恒立液压	40,200	2,586,066.00	0.99
33	002415	海康威视	76,900	2,546,159.00	0.97
34	000932	华菱钢铁	530,500	2,530,485.00	0.97
35	601919	中远海控	262,100	2,463,740.00	0.94
36	600176	中国巨石	167,000	2,364,720.00	0.90
37	601000	唐山港	565,600	1,996,568.00	0.76
38	600398	海澜之家	273,800	1,883,744.00	0.72
39	603816	顾家家居	36,573	1,395,259.95	0.53
40	001872	招商港口	72,800	1,257,256.00	0.48
41	601098	中南传媒	102,000	1,183,200.00	0.45
42	600256	广汇能源	19,600	134,456.00	0.05

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	601398	工商银行	14,161,321.00	4.46
2	601288	农业银行	13,645,382.00	4.30
3	601088	中国神华	11,895,369.00	3.75
4	000983	山西焦煤	11,596,472.49	3.65
5	601225	陕西煤业	11,186,164.00	3.52
6	601939	建设银行	11,170,981.00	3.52
7	600938	中国海油	11,136,937.00	3.51
8	601668	中国建筑	10,715,609.00	3.37

9	000651	格力电器	10,510,169.00	3.31
10	601857	中国石油	10,114,345.00	3.19
11	601658	邮储银行	9,030,767.00	2.84
12	601988	中国银行	8,410,500.00	2.65
13	600256	广汇能源	8,354,598.00	2.63
14	600941	中国移动	7,750,178.00	2.44
15	603939	益丰药房	6,441,628.00	2.03
16	001965	招商公路	6,332,480.00	1.99
17	600188	兖矿能源	6,048,573.00	1.90
18	000933	神火股份	5,977,885.93	1.88
19	600350	山东高速	5,755,246.00	1.81
20	601006	大秦铁路	5,689,569.00	1.79

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	000568	泸州老窖	18,119,890.44	5.71
2	603369	今世缘	16,748,289.00	5.27
3	002572	索菲亚	13,689,604.00	4.31
4	601888	中国中免	12,141,627.02	3.82
5	603816	顾家家居	11,328,183.03	3.57
6	600519	贵州茅台	11,116,870.00	3.50
7	002142	宁波银行	10,278,408.00	3.24
8	002484	江海股份	9,566,062.00	3.01
9	600132	重庆啤酒	9,316,399.00	2.93
10	600885	宏发股份	8,777,499.36	2.76
11	002459	晶澳科技	8,529,193.60	2.69
12	600036	招商银行	7,727,810.00	2.43
13	600256	广汇能源	7,413,830.00	2.33

14	002648	卫星化学	7,334,128.95	2.31
15	300750	宁德时代	7,125,129.00	2.24
16	002493	荣盛石化	6,931,118.00	2.18
17	000301	东方盛虹	6,688,470.00	2.11
18	000683	远兴能源	6,049,691.80	1.91
19	603392	万泰生物	5,410,099.00	1.70
20	002415	海康威视	5,228,635.00	1.65

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	267,023,627.59
卖出股票收入（成交）总额	287,788,199.46

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)	67,861.40	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	67,861.40	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	113605	大参转债	600	67,861.40	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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套 期保值操作，由此获得股票组合产生的超额收益。本基金在运用股指期货时，将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险，以改善投资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

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，中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国石油天然气股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或处罚的情况。经分析，上述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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,850.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,850.19

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	113605	大参转债	67,861.40	0.03

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

份额级别	持有人户	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	持有份额	占总份额比例

	数(户)			比例		
上银鑫卓混合A	8,816	24,677.14	18,349,077.89	8.43%	199,204,564.51	91.57%
上银鑫卓混合C	140	2,980.00	0.00	0.00%	417,200.18	100.00%
合计	8,956	24,337.97	18,349,077.89	8.42%	199,621,764.69	91.58%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	上银鑫卓混合A	332,458.46	0.15%
	上银鑫卓混合C	861.74	0.21%
	合计	333,320.20	0.15%

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	上银鑫卓混合A	上银鑫卓混合C
基金合同生效日(2020年01月21日)基金份额总额	562,949,591.94	-
本报告期期初基金份额总额	250,049,350.87	58,083.22
本报告期基金总申购份额	2,308,967.61	649,521.23
减：本报告期基金总赎回份额	34,804,676.08	290,404.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	217,553,642.40	417,200.18

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、基金管理人的重大人事变动

报告期内基金管理人无重大人事变动。

2、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

10.6.1 管理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及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 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	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	554,811,827.05	100.00%	443,984.90	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，选择基金交易单元，并由公司管理层批准。
2、本报告期内，本基金无新增或减少交易单元。

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	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	3,464.33	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更新旗下公募基金风险等级的公告	中国证监会规定网站	2023-01-06
2	上银基金管理有限公司旗下	中国证监会规定报刊和规定	2023-01-20

	基金2022年第4季度报告提示性公告	网站	
3	上银鑫卓混合型证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定网站	2023-01-20
4	上银基金管理有限公司关于终止与民商基金销售（上海）有限公司代销合作的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2023-02-04
5	上银基金管理有限公司关于业务系统维护的公告	中国证监会规定网站	2023-02-10
6	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行同业易管家平台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	2023-02-16
7	上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增开源证券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	2023-03-14
8	上银基金管理有限公司关于上银鑫卓混合型证券投资基金C类基金份额新增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	2023-03-24
9	上银基金管理有限公司关于业务系统维护的公告	中国证监会规定网站	2023-03-30
10	上银基金管理有限公司旗下基金2022年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2023-03-31
11	上银鑫卓混合型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定网站	2023-03-31
12	上银基金管理有限公司旗下基金2023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	2023-04-22
13	上银鑫卓混合型证券投资基	中国证监会规定网站	2023-04-22

	金2023年第1季度报告		
14	上银基金管理有限公司关于业务系统维护的公告	中国证监会规定网站	2023-06-02
15	上银基金管理有限公司关于业务系统维护的公告	中国证监会规定网站	2023-06-16
16	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	2023-06-21
17	上银鑫卓混合型证券投资基金更新招募说明书（2023年第1号）	中国证监会规定网站	2023-06-21
18	上银鑫卓混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（2023年第1号）	中国证监会规定网站	2023-06-21
19	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	2023-06-28

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

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

二〇二三年八月三十一日