

中海优质成长证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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。本半年度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。

基金托管人交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)根据本基金合同规定，于 2021 年 8 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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 8 |
| 2.4 信息披露方式..... | 8 |
| 2.5 其他相关资料..... | 8 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 9 |
| 3.2 基金净值表现..... | 9 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 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..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |
| 6.4 报表附注..... | 19 |

| | |
|--|-----------|
| §7 投资组合报告 | 45 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 45 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 45 |
| 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..... | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 48 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| 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..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 51 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 51 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 51 |
| §8 基金份额持有人信息 | 53 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 53 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 53 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 53 |
| §9 开放式基金份额变动 | 54 |
| §10 重大事件揭示 | 55 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 55 |
| 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..... | 55 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 55 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 55 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 55 |
| 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..... | 55 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 55 |
| 10.8 其他重大事件..... | 57 |
| §11 备查文件目录 | 59 |
| 11.1 备查文件目录..... | 59 |
| 11.2 存放地点..... | 59 |

11.3 查阅方式.....59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 中海优质成长证券投资基金 |
| 基金简称 | 中海优质成长混合 |
| 基金主代码 | 398001 |
| 前端交易代码 | 398001 |
| 后端交易代码 | 398002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004 年 9 月 28 日 |
| 基金管理人 | 中海基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,568,860,465.40 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于中国证券市场中具有品质保障和发展潜力的持续成长企业所发行的股票和国内依法公开发行上市的债券，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，以获取资本长期增值和股息红利收益的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>品质过滤，成长精选。</p> <p>（一）资产配置</p> <p>本基金由公司投资决策委员会基于如下的分析判断并结合《基金合同》中的投资限制和投资比例限制来确定、调整基金资产中股票、债券和现金的配置比例：</p> <p>1、根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化来把握宏观经济发展对证券市场的影响方向和力度，判断证券市场的发展趋势和风险收益特征；</p> <p>2、根据基金投资者对开放式基金的认识程度，以及基金行业的管理经验，判断基金申购和赎回净现金流量。</p> <p>（二）股票组合的构建</p> <p>1、选股标准</p> <p>本基金投资对象是优质成长企业的权益类证券。优质成长即注重上市公司品质和成长性的结合。主要从三方面考察上市公司的品质：① 财务健康，现金流充沛、业绩真实可靠；② 公司在所属行业内具有比较竞争优势；③ 良好的经营管理能力。同时从如下两个方面考察上市公司的成长性：① 公司应具有较强的潜在获利能力和较高的净利润增长率；② 公司产品或服务的需求总量不断扩大。</p> <p>2、备选股票库的构建</p> <p>备选股票库通过以下两个阶段构建：</p> |

| | |
|---------------|---|
| | <p>第一阶段：品质与历史成长性过滤</p> <p>本基金运用 GOQ 模型（Growth On High Quality Model）对所有上市公司（投资决策委员会禁止投资的股票除外）的品质和历史成长性进行过滤。主要通过经营性现金流、总资产回报率等指标对其财务状况进行评价。通过相对市场份额、超额毛利率等指标对行业竞争优势进行评价。通过净利润增长率等指标对历史成长性进行评价。GOQ 模型根据上述指标对上市公司进行综合评价排序，初步筛选出 300 家左右的上市公司作为股票备选库（I）。</p> <p>第二阶段：成长精选</p> <p>针对第一阶段筛选的股票备选库（I），本基金运用 α 公司评级系统对其进行成长精选。</p> <p>中海 α 公司评级系统由 4 个大的指标分析单元和 50 个具体评分指标构成，其中客观性评分指标 30 个，主观性评分指标 20 个。中海 α 公司评级系统 4 个大的分析单元分别是：企业成长的行业基本情况评价，企业成长的政策等非市场因素评价，企业成长的内在因素深度分析，企业成长的盈利与风险情况评价。</p> <p>中海 α 公司评级系统的设置充分体现了主客观结合的评价原则，评级系统中可量化客观性指标的设置保证了选股过程的客观性和可比性。与一般的主观评级系统相比较，这种主客观结合的指标体系既充分保障了评价结果的全面与客观可比性，又有利于引导研究员对目标公司做更加深入细致的研究，提高评价结果的准确度。</p> <p>本基金运用 α 公司评级系统的评价结果，对备选库（I）中的股票进行进一步精选，形成 150 家左右上市公司的股票备选库（II）。</p> <p>3、股票投资组合的构建</p> <p>基金经理根据内部、外部的研究报告以及自己的综合判断，特别是通过对公司管理团队的考量以及公司竞争力的全面分析，对股票备选库（II）中的股票做出合适的投资判断，在此基础上形成最终的股票投资组合，并进行适时的调整。</p> <p>（三）债券组合的构建</p> <p>本基金可投资国债、金融债和企业债（包括可转债）。本基金根据基金资产总体配置计划，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，建立由不同类型、不同期限债券品种构成的投资组合。</p> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p>沪深 300 指数*75%+上证国债指数*25%</p> |
| <p>风险收益特征</p> | <p>本基金属证券投资基金中的中等风险品种。</p> |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|---|-------------------------|
| 名称 | | 中海基金管理有限公司 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 黄乐军 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 021-38429808 | 95559 |
| | 电子邮箱 | huanglejun@zhfund.com | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-9788、 021-38789788 | 95559 |
| 传真 | | 021-68419525 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 号 |
| 邮政编码 | | 200120 | 200336 |
| 法定代表人 | | 曾杰 | 任德奇 |

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.zhfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|---------------------------------------|
| 注册登记机构 | 中海基金管理有限公司 | 上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 555,153,503.61 |
| 本期利润 | 188,194,284.76 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0607 |
| 本期加权平均净值利润率 | 10.10% |
| 本期基金份额净值增长率 | 9.43% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 390,389,383.14 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1520 |
| 期末基金资产净值 | 1,668,681,464.59 |
| 期末基金份额净值 | 0.6496 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 1,038.19% |

注 1：以上所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（例如，申购、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

注 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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|-----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 0.90% | 1.65% | -1.47% | 0.61% | 2.37% | 1.04% |
| 过去三个月 | 13.96% | 1.32% | 2.87% | 0.73% | 11.09% | 0.59% |
| 过去六个月 | 9.43% | 1.57% | 0.79% | 0.99% | 8.64% | 0.58% |
| 过去一年 | 34.17% | 1.53% | 19.74% | 1.00% | 14.43% | 0.53% |
| 过去三年 | 139.83% | 1.62% | 40.70% | 1.02% | 99.13% | 0.60% |
| 自基金合同生效起至今 | 1,038.19% | 1.60% | 285.55% | 1.26% | 752.64% | 0.34% |

注 1：“自基金合同生效起至今”指 2004 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日。

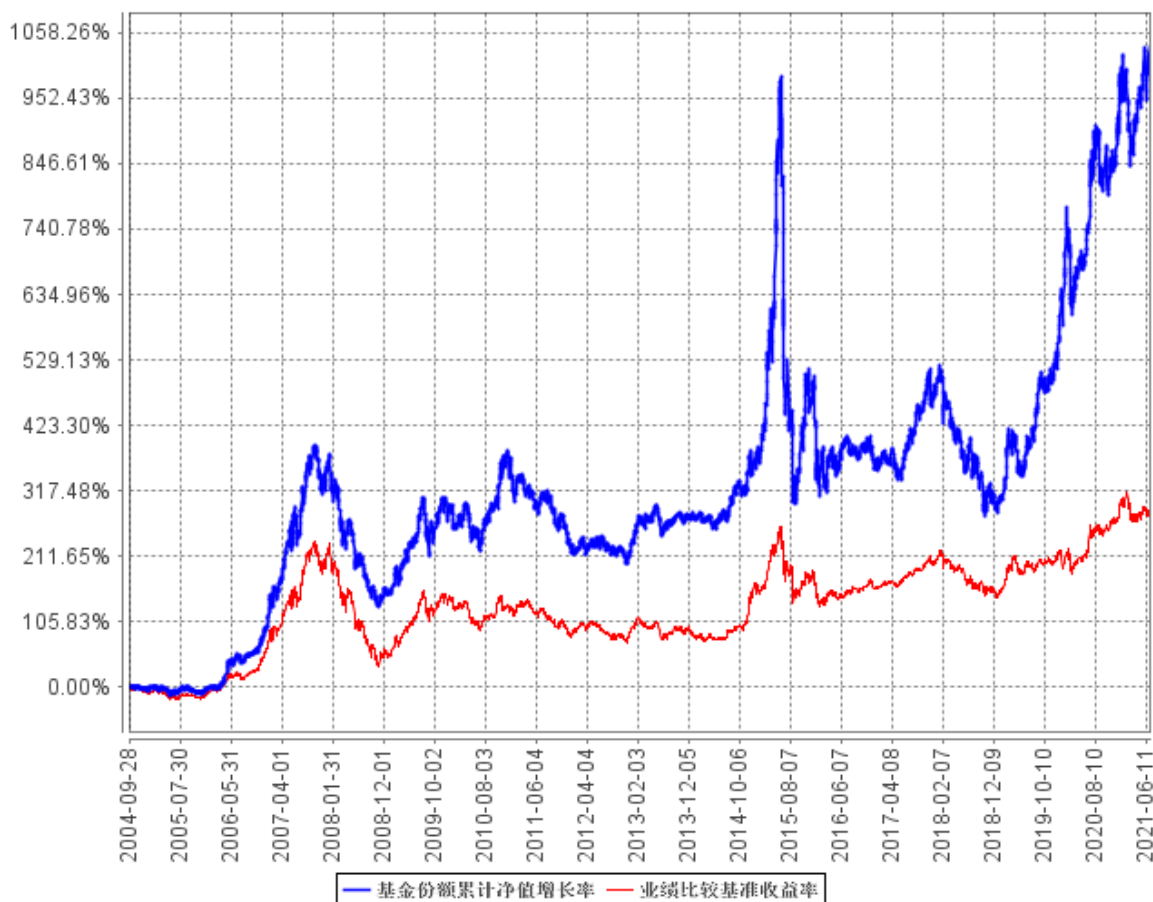
注 2：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数*75%+上证国债指数*25%，我们选取市场认同度很高的沪深 300 指数、上证国债指数作为计算业绩基准指数的基础指数。本基金投资股票的比例为

30%-95%，在一般市场状况下，本基金股票投资比例会控制在 75%左右，债券投资比例控制在 25%左右。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例来确定本基金业绩基准指数加权的权重，以使业绩比较更加合理。

本基金业绩基准指数每日按照 75%、25%的比例对基础指数进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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

基金管理人自 2004 年 3 月 18 日成立以来，始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行基金管理人的责任和义务，依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系，为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务。截至 2021 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 30 只。

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 | | |
| 许定晴 | 权益投资部总经理、权益投资总监、本基金基金经理、中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海魅力长三角灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券 | 2020 年 3 月 7 日 | - | 18 年 | 许定晴女士，苏州大学金融学专业硕士。曾任国联证券股份有限公司研究员。2004 年 3 月进入本公司工作，历任分析师、高级分析师、基金经理助理、研究总监、代理投资总监、投资副总监，现任权益投资部总经理、权益投资总监。2010 年 3 月至 2012 年 7 月任中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2011 年 12 月至 2015 年 4 月任中海能源策略混合型证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2016 年 7 月任中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 7 月至 2018 年 4 月任中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 11 月至 2019 年 6 月任中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 11 月至 2019 年 9 月任中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金经理，2016 年 7 月至今 |

| | | | | |
|--|----------|--|--|--|
| | 投资基金基金经理 | | | 任中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 3 月至今任中海优质成长证券投资基金基金经理，2020 年 3 月至今任中海魅力长三角灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 5 月至今任中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|----------|--|--|--|

注 1：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

注 2：证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度，公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度，要求公司各组合研究成果共享，投资交易指令统一下达至交易室，由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易，使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实；同时，根据公司制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数组合外）的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易，由公司对相关交易价格进行事前审核，风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，进行了相关的假设检验，对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析，并针对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期，公司根据制度要求，对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析，对于出现的公司制度中规定的异常交易，均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况，公司均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年国内经济继续维持向好态势，经济增长动能较高。制造业领域延续了去年的高景气趋势，上中游原材料企业随着 PPI 的快速拉升出现明显修复，猪价下跌导致 CPI 较为温和。货物进出口增势明显，贸易结构继续改善。政府多次强调做好大宗商品保供稳价工作，力求保持经济平稳运行。市场风险偏好受海外市场 TAPER 进程预期的影响较大，但国内货币政策“稳字当头”，一定程度缓解了市场对流动性收紧的担忧。全球疫苗接种进度的快速推进也给经济复苏带来了信心。从 A 股市场表现来看，风格转换频繁，表现最为抢眼的是新能源车产业链、医美、上游能源和材料以及半导体板块。

截止报告期末本基金行业配置主要集中在医药生物、电子、建筑装饰、机械设备和计算机板块，配置较为均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值 0.6496 元（累计净值 4.5366 元）。报告期内本基金净值增长率为 9.43%，高于业绩比较基准 8.64 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年宏观经济增速将会有所回落，出口、消费和投资方面都面临一定的压力，海外 TAPER 预期以及疫情的起伏依旧影响着风险偏好，国内政策在二季度已经提前做好适度宽松的准备。但此次疫情中中国产业特别是制造业表现出极强的韧性和优势，国家转型和改革的决心坚定。证券市场的资源配置功能大大提升，众多上市公司中符合国家战略发展导向的企业必将借助资本市场的力量脱颖而出。我们将持续寻找优质成长公司和风险收益比适当的标的，保障投资者利益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司分管运营副总担任估值委员会主任委员，其他委员有风

风险控制总监、监察稽核负责人、基金会计负责人、相关基金经理等。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值委员会会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中证指数有限公司以及中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供证券交易所及银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关规定，本基金本报告期内未发生利润分配。

§ 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

2021 年上半年度，基金托管人在中海优质成长证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2021 年上半年度，中海基金管理有限公司在中海优质成长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。

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

2021 年上半年度，由中海基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中海优质成长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：中海优质成长证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 128,543,055.58 | 197,013,227.42 |
| 结算备付金 | | 5,501,489.17 | 7,448,315.86 |
| 存出保证金 | | 1,811,773.04 | 1,482,691.67 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,540,605,905.95 | 2,617,667,334.51 |
| 其中：股票投资 | | 1,540,012,905.95 | 2,617,667,334.51 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 593,000.00 | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 56,008,802.88 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 22,053.97 | 82,487.49 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 851,773.58 | 4,008,643.49 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,677,336,051.29 | 2,883,711,503.32 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 960.14 | 31,587,618.78 |
| 应付赎回款 | | 3,017,175.41 | 4,897,756.42 |
| 应付管理人报酬 | | 2,022,088.67 | 3,873,038.12 |
| 应付托管费 | | 337,014.77 | 645,506.38 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 2,645,578.97 | 3,698,610.05 |
| 应交税费 | | 1.87 | - |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 631,766.87 | 981,693.82 |
| 负债合计 | | 8,654,586.70 | 45,684,223.57 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,032,075,623.72 | 1,920,732,114.58 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 636,605,840.87 | 917,295,165.17 |
| 所有者权益合计 | | 1,668,681,464.59 | 2,838,027,279.75 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,677,336,051.29 | 2,883,711,503.32 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6496 元，基金份额总额 2,568,860,465.40 份。

6.2 利润表

会计主体：中海优质成长证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 216,463,332.57 | 538,193,059.67 |
| 1.利息收入 | | 1,014,063.52 | 1,801,545.41 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 852,518.03 | 861,596.28 |
| 债券利息收入 | | 537.03 | 939,949.13 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 161,008.46 | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 580,560,174.52 | 355,213,517.09 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 575,321,467.44 | 348,514,033.35 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 988.39 | -157,365.00 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 5,237,718.69 | 6,856,848.74 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -366,959,218.85 | 180,465,486.31 |
| 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 | 1,848,313.38 | 712,510.86 |
| 减：二、费用 | | 28,269,047.81 | 24,502,626.05 |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 13,869,837.04 | 14,634,586.53 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 2,311,639.51 | 2,439,097.75 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 11,969,487.11 | 7,310,788.83 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 0.20 | 179.04 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 118,083.95 | 117,973.90 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 188,194,284.76 | 513,690,433.62 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 188,194,284.76 | 513,690,433.62 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海优质成长证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
|--|---------------------------------------|-----------------|-------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,920,732,114.58 | 917,295,165.17 | 2,838,027,279.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 188,194,284.76 | 188,194,284.76 |
| 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） | -888,656,490.86 | -468,883,609.06 | -1,357,540,099.92 |
| 其中：1.基金申购款 | 150,273,465.27 | 74,655,427.06 | 224,928,892.33 |
| 2.基金赎回款 | -1,038,929,956.13 | -543,539,036.12 | -1,582,468,992.25 |
| 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） | 1,032,075,623.72 | 636,605,840.87 | 1,668,681,464.59 |

| 项目 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|-----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,122,076,715.75 | 450,533,839.19 | 1,572,610,554.94 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 513,690,433.62 | 513,690,433.62 |
| 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) | 326,883,563.65 | 237,985,064.10 | 564,868,627.75 |
| 其中：1.基金申购款 | 732,048,427.47 | 505,384,854.16 | 1,237,433,281.63 |
| 2.基金赎回款 | -405,164,863.82 | -267,399,790.06 | -672,564,653.88 |
| 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) | - | -236,215,924.66 | -236,215,924.66 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,448,960,279.40 | 965,993,412.25 | 2,414,953,691.65 |

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：

曾杰

李俊

周琳

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中海优质成长证券投资基金(以下简称“本基金”)原名国联优质成长证券投资基金,由国联基金管理有限公司(现已更名为“中海基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及有关法规规定,经中国证券监督管理委员会证监基金字[2004]92号《关于同意国联优质成长证券投资基金设立的批复》核准募集设立。经国联基金管理有限公司股东会2006年第一次、第二次临时会议决议和修改后章程的规定,并经中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]90号“关于同意国联基金管理有限公司股权转让、增加注册资本、修改公司章程和变更公司名称的批复”批准,名称变更为中海基金管理有限公司;另经中海基金管理有限公司第一届董事会第十六次会议审议通过,并经各基金托管人同意及中国证券监督管理委员会

员会基金监管部核准，将管理的开放式基金名称进行相应变更，原“国联优质成长证券投资基金”更名为“中海优质成长证券投资基金”。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为中海基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司；有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案；基金合同于 2004 年 9 月 28 日生效，该日的基金份额总额为 1,017,619,728.79 份，经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公 W[2004]B152 号验资报告予以验证。

本基金于 2007 年 10 月 19 日(拆分日)进行了基金份额拆分。当日，本基金拆分前基金份额净值为 2.4891 元，精确到小数点后第 9 位为 2.489131393 元，基金份额总额为 1,480,631,490.88 份，本基金管理人按照 1:2.489131393 的拆分比例对本基金的份额进行了拆分。实施拆分后，拆分日基金份额净值调整为 1.0000 元，拆分后基金份额总额为 3,685,486,326.68 份，基金份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位后的部分截去，截去部分所代表的资产归基金资产所有。

本基金投资的标的物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、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中，投资的重点是中国证券市场中具有品质保障和发展潜力的持续成长类公司。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数*75%+上证国债指数*25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金在本报告期内的会计报表遵循了企业会计准则及其他有关规定。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金在本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 128,543,055.58 |
| 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 | - |
| 合计： | 128,543,055.58 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 | | |
|-------------------|-------------------|------------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 1,236,115,945.19 | 1,540,012,905.95 | 303,896,960.76 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 593,000.00 | 593,000.00 |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | 593,000.00 | 593,000.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 1,236,708,945.19 | 1,540,605,905.95 | 303,896,960.76 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 19,037.57 |
| 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 | 2,228.04 |
| 应收债券利息 | 54.59 |
| 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 | 733.77 |
| 合计 | 22,053.97 |

6.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 2,645,578.97 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 2,645,578.97 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 250,000.00 |
| 应付赎回费 | 7,562.31 |
| 应付证券出借违约金 | - |

| | |
|----------|------------|
| 其他 | 267,825.61 |
| 应付上海股票税金 | 7,200.00 |
| 预提费用 | 99,178.95 |
| 合计 | 631,766.87 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 4,780,744,886.52 | 1,920,732,114.58 |
| 本期申购 | 374,035,340.90 | 150,273,465.27 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,585,919,762.02 | -1,038,929,956.13 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 2,568,860,465.40 | 1,032,075,623.72 |

注：其中本期申购含红利再投资、转换入份额；本期赎回含转换出份额。

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 | -8,960,589.45 | 926,255,754.62 | 917,295,165.17 |
| 本期利润 | 555,153,503.61 | -366,959,218.85 | 188,194,284.76 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -155,803,531.02 | -313,080,078.04 | -468,883,609.06 |
| 其中：基金申购款 | 31,258,547.12 | 43,396,879.94 | 74,655,427.06 |
| 基金赎回款 | -187,062,078.14 | -356,476,957.98 | -543,539,036.12 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 390,389,383.14 | 246,216,457.73 | 636,605,840.87 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| | 活期存款利息收入 |
| 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 | 45,751.54 |
| 其他 | 14,870.56 |
| 合计 | 852,518.03 |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 575,321,467.44 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | 575,321,467.44 |

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 4,612,427,008.60 |
| 减：卖出股票成本总额 | 4,037,105,541.16 |
| 买卖股票差价收入 | 575,321,467.44 |

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金在本报告期无股票投资收益—证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 988.39 |
| 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 | 988.39 |
|----|--------|

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 2,946,472.50 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,945,000.00 |
| 减：应收利息总额 | 484.11 |
| 买卖债券差价收入 | 988.39 |

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—申购差价收入。

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

注：本基金在本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金在本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 5,237,718.69 |
| 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 | 5,237,718.69 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|----------------------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | -366,959,218.85 |
| ——股票投资 | -366,959,218.85 |
| ——债券投资 | - |
| ——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 | -366,959,218.85 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 1,716,143.96 |

| | |
|----------|--------------|
| 转出基金补偿收入 | 132,169.42 |
| 合计 | 1,848,313.38 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 11,969,487.11 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 交易基金产生的费用 | - |
| 其中：申购费 | - |
| 赎回费 | - |
| 合计 | 11,969,487.11 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 39,671.58 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 帐户服务费 | 18,000.00 |
| 银行费用 | 905.00 |
| 合计 | 118,083.95 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|---------------|
| 中海基金管理有限公司（“中海基金”） | 基金管理人、直销机构 |
| 交通银行股份有限公司 | 基金托管人、代销机构 |
| 国联证券股份有限公司（“国联证券”） | 基金管理人的股东、代销机构 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|-------|----------------------------|----------------------|---------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 例 |
| 国联证券 | 1,015,101,645.07 | 12.80% | 562,636,336.50 | 11.75% |

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | |
|-------|----------------------------|----------------|----------|------------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量 的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金 总额的比例 |

| | | | | |
|-------|---------------------------------|------------|------------|--------------|
| 国联证券 | 945,371.38 | 14.26% | 334,188.13 | 12.63% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 国联证券 | 523,985.84 | 12.01% | 448,367.06 | 25.53% |

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月 30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 13,869,837.04 | 14,634,586.53 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5,492,908.85 | 4,286,064.06 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$ （H 为每日应支付的基金管理费，E 为前一日的基金资产净值）

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,311,639.51 | 2,439,097.75 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|------------|----------------------------|------------|---------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 交通银行股份有限公司 | 128,543,055.58 | 791,895.93 | 589,722,873.03 | 813,323.73 |

注：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年半年度获得的利息收入为人民币45,751.54元(2020年半年度：人民币31,577.07元)，2021年6月末结算备付金余额为人民币5,501,489.17元(2020年6月末：人民币3,112,953.32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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与认购关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

注：根据法律法规以及本基金合同的相关规定，本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-----------------|------------------|--------|-------|--------|--------------|--------------|--------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 600905 | 三峡能源 | 2021 年 6 月 2 日 | 2021 年 12 月 10 日 | 新股流通受限 | 2.65 | 5.67 | 907,763 | 2,405,571.95 | 5,147,016.21 | - |
| 688601 | 力芯微 | 2021 年 6 月 18 日 | 2021 年 12 月 28 日 | 新股流通受限 | 36.48 | 133.69 | 1,174 | 42,827.52 | 156,952.06 | - |
| 688315 | 诺禾致源 | 2021 年 4 月 2 日 | 2021 年 10 月 13 日 | 新股流通受限 | 12.76 | 39.20 | 3,711 | 47,352.36 | 145,471.20 | - |
| 688700 | 东威科技 | 2021 年 6 月 7 日 | 2021 年 12 月 15 日 | 新股流通受限 | 9.41 | 38.46 | 3,049 | 28,691.09 | 117,264.54 | - |
| 688499 | 利元亨 | 2021 年 6 月 23 日 | 2021 年 7 月 1 日 | 新股未上市 | 38.85 | 38.85 | 2,149 | 83,488.65 | 83,488.65 | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021 年 6 月 28 日 | 2022 年 1 月 7 日 | 新股流通受限 | 8.29 | 8.29 | 782 | 6,482.78 | 6,482.78 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|--------------------|-------------------------|----------------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 301018 | 申菱环境 | 2021年 6月28 日 | 2021 年7月 7日 | 新股 未上 市 | 8.29 | 8.29 | 7,029 | 58,270.41 | 58,270.41 | - |
| 688676 | 金盘科技 | 2021年 3月2日 | 2021 年9月 9日 | 新股 流通 受限 | 10.10 | 16.24 | 3,750 | 37,875.00 | 60,900.00 | - |
| 688239 | 航宇科技 | 2021年 6月25 日 | 2021 年7月 5日 | 新股 未上 市 | 11.48 | 11.48 | 4,926 | 56,550.48 | 56,550.48 | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021年 6月30 日 | 2021 年7月 9日 | 新股 未上 市 | 21.96 | 21.96 | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021年 6月28 日 | 2022 年1月 6日 | 新股 流通 受限 | 10.64 | 10.64 | 421 | 4,479.44 | 4,479.44 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021年 6月28 日 | 2021 年7月 6日 | 新股 未上 市 | 10.64 | 10.64 | 3,789 | 40,314.96 | 40,314.96 | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021年 4月8日 | 2021 年10 月15 日 | 新股 流通 受限 | 28.28 | 115.71 | 360 | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 300941 | 创识科技 | 2021年 2月2日 | 2021 年8月 9日 | 新股 流通 受限 | 21.31 | 49.94 | 399 | 8,502.69 | 19,926.06 | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021年 6月22 日 | 2021 年12 月30 日 | 新股 流通 受限 | 7.64 | 38.83 | 462 | 3,529.68 | 17,939.46 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 688226 | 威腾电气 | 2021年6月28日 | 2021年7月7日 | 新股未上市 | 6.42 | 6.42 | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06 | - |
| 300982 | 苏文电能 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 新股流通受限 | 15.83 | 45.29 | 317 | 5,018.11 | 14,356.93 | - |
| 300940 | 南极光 | 2021年1月27日 | 2021年8月3日 | 新股流通受限 | 12.76 | 43.38 | 307 | 3,917.32 | 13,317.66 | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日 | 新股流通受限 | 31.56 | 31.56 | 349 | 11,014.44 | 11,014.44 | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021年3月29日 | 2021年10月11日 | 新股流通受限 | 3.40 | 16.37 | 576 | 1,958.40 | 9,429.12 | - |
| 300945 | 曼卡龙 | 2021年2月3日 | 2021年8月10日 | 新股流通受限 | 4.56 | 18.88 | 474 | 2,161.44 | 8,949.12 | - |
| 300948 | 冠中生态 | 2021年2月18日 | 2021年8月25日 | 新股流通受限 | 13.00 | 27.42 | 324 | 2,808.00 | 8,884.08 | - |
| 300931 | 通用电梯 | 2021年1月13日 | 2021年7月21日 | 新股流通受限 | 4.31 | 13.11 | 672 | 2,896.32 | 8,809.92 | - |
| 300950 | 德固特 | 2021年2月24日 | 2021年9月3日 | 新股流通受限 | 8.41 | 39.13 | 219 | 1,841.79 | 8,569.47 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|--------------------|-------------------------|----------------|-------|-------|-------|----------|----------|---|
| 605162 | 新中港 | 2021年 6月29 日 | 2021 年7月 7日 | 新股 流通 受限 | 6.07 | 6.07 | 1,377 | 8,358.39 | 8,358.39 | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021年 4月21 日 | 2021 年11 月1日 | 新股 流通 受限 | 14.79 | 30.57 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48 | - |
| 300987 | 川网传媒 | 2021年 4月28 日 | 2021 年11 月11 日 | 新股 流通 受限 | 6.79 | 26.81 | 301 | 2,043.79 | 8,069.81 | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021年 4月15 日 | 2021 年10 月26 日 | 新股 流通 受限 | 8.42 | 13.60 | 593 | 4,993.06 | 8,064.80 | - |
| 300993 | 玉马遮阳 | 2021年 5月17 日 | 2021 年11 月24 日 | 新股 流通 受限 | 12.10 | 19.29 | 410 | 4,961.00 | 7,908.90 | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021年 4月21 日 | 2021 年10 月29 日 | 新股 流通 受限 | 24.90 | 24.81 | 295 | 7,345.50 | 7,318.95 | - |
| 300971 | 博亚精工 | 2021年 4月7日 | 2021 年10 月15 日 | 新股 流通 受限 | 18.24 | 28.29 | 245 | 4,468.80 | 6,931.05 | - |
| 300991 | 创益通 | 2021年 5月12 日 | 2021 年11 月22 日 | 新股 流通 受限 | 13.06 | 26.51 | 254 | 3,317.24 | 6,733.54 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|-------------|----------------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| | | | 日 | | | | | | | |
| 300927 | 江天化学 | 2020年12月29日 | 2021年7月7日 | 新股 流通 受限 | 13.39 | 30.10 | 217 | 2,905.63 | 6,531.70 | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021年4月14日 | 2021年10月21日 | 新股 流通 受限 | 5.48 | 13.03 | 492 | 2,696.16 | 6,410.76 | - |
| 301011 | 华立科技 | 2021年6月9日 | 2021年12月17日 | 新股 流通 受限 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021年4月2日 | 2021年10月13日 | 新股 流通 受限 | 4.54 | 11.54 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78 | - |
| 300929 | 华骐环保 | 2021年1月12日 | 2021年7月21日 | 新股 流通 受限 | 13.87 | 29.55 | 183 | 2,538.21 | 5,407.65 | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021年5月17日 | 2021年11月26日 | 新股 流通 受限 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12 | - |
| 301007 | 德迈仕 | 2021年6月4日 | 2021年12月16日 | 新股 流通 受限 | 5.29 | 14.44 | 303 | 1,602.87 | 4,375.32 | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021年6月15日 | 2021年12月 | 新股 流通 | 8.05 | 24.26 | 170 | 1,368.50 | 4,124.20 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|----------|------------------------|---------------------------|----------------|-------|--------|-----|-----------|-----------|---|
| | | 日 | 月 22 | 受限 | | | | | | |
| | | | 日 | | | | | | | |
| 300992 | 泰福 泵业 | 2021 年 5 月 17 日 | 2021 年 11 月 25 日 | 新股 流通 受限 | 9.36 | 20.32 | 200 | 1,872.00 | 4,064.00 | - |
| 301010 | 晶雪 节能 | 2021 年 6 月 9 日 | 2021 年 12 月 20 日 | 新股 流通 受限 | 7.83 | 17.61 | 218 | 1,706.94 | 3,838.98 | - |
| 300919 | 中伟 股份 | 2020 年 12 月 15 日 | 2021 年 7 月 2 日 | 新股 流通 受限 | 24.60 | 163.00 | 610 | 15,006.00 | 99,430.00 | - |

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 |
|----------|----------|-----------------------|----------------------|------------|----------|------------|------------------|------------|------------|----|
| 113049 | 长汽 转债 | 2021 年 6 月 11 日 | 2021 年 7 月 8 日 | 新债未 上市 | 100.00 | 100.00 | 5,930 | 593,000.00 | 593,000.00 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了《中海基金管理有限公司投资决策委员会议事规则》、《中海基金管理有限公司公募基金投资管理团队管理办法》、《中海基金管理有限公司研究部管理办法》、《中海基金管理有限公司基金股票库管理办法》、《中海基金管理有限公司基金债券库管理办法》、《中海基金管理有限公司基金信用债业务运作管理办法》、《中海基金管理有限公司基金流动性风险及巨额赎回管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阈值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风控合规部门、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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人管理的托管户中，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 593,000.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 593,000.00 | 0.00 |

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券均在证券交易所上市或在银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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。

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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量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、结算备付金及债券投资等。

下表所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021年6月30 日 | 1个月以内 | 1-3个 月 | 3个月 -1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|----------------|-----------|------------|------|------------|------------------|------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 128,543,055.58 | - | - | - | - | - | 128,543,055.58 |
| 结算备付金 | 5,501,489.17 | - | - | - | - | - | 5,501,489.17 |
| 存出保证金 | 1,811,773.04 | - | - | - | - | - | 1,811,773.04 |
| 交易性金融资 产 | - | - | - | - | 593,000.00 | 1,540,012,905.95 | 1,540,605,905.95 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 22,053.97 | 22,053.97 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 851,773.58 | 851,773.58 |
| 资产总计 | 135,856,317.79 | - | - | - | 593,000.00 | 1,540,886,733.50 | 1,677,336,051.29 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算 款 | - | - | - | - | - | 960.14 | 960.14 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 3,017,175.41 | 3,017,175.41 |
| 应付管理人报 酬 | - | - | - | - | - | 2,022,088.67 | 2,022,088.67 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 337,014.77 | 337,014.77 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 2,645,578.97 | 2,645,578.97 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 1.87 | 1.87 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 631,766.87 | 631,766.87 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 8,654,586.70 | 8,654,586.70 |
| 利率敏感度缺 口 | 135,856,317.79 | - | - | - | 593,000.00 | 1,532,232,146.80 | 1,668,681,464.59 |
| 上年度末 | 1个月以内 | 1-3个 月 | 3个月 -1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |

| 2020 年 12 月 31 日 | 月 | -1 年 | | | | |
|---------------------|----------------|------|---|---|-------------------|------------------|
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 197,013,227.42 | - | - | - | - | 197,013,227.42 |
| 结算备付金 | 7,448,315.86 | - | - | - | - | 7,448,315.86 |
| 存出保证金 | 1,482,691.67 | - | - | - | - | 1,482,691.67 |
| 交易性金融资产 | | | | | -2,617,667,334.51 | 2,617,667,334.51 |
| 应收证券清算款 | | | | | 56,008,802.88 | 56,008,802.88 |
| 应收利息 | | | | | 82,487.49 | 82,487.49 |
| 应收申购款 | | | | | 4,008,643.49 | 4,008,643.49 |
| 资产总计 | 205,944,234.95 | - | - | - | -2,677,767,268.37 | 2,883,711,503.32 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付证券清算款 | | | | | 31,587,618.78 | 31,587,618.78 |
| 应付赎回款 | | | | | 4,897,756.42 | 4,897,756.42 |
| 应付管理人报酬 | | | | | 3,873,038.12 | 3,873,038.12 |
| 应付托管费 | | | | | 645,506.38 | 645,506.38 |
| 应付交易费用 | | | | | 3,698,610.05 | 3,698,610.05 |
| 其他负债 | | | | | 981,693.82 | 981,693.82 |
| 负债总计 | | | | | 45,684,223.57 | 45,684,223.57 |
| 利率敏感度缺口 | 205,944,234.95 | - | - | - | -2,632,083,044.80 | 2,838,027,279.75 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|-------------|--|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。 | | |
| | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。 | | |
| | 此项影响并未考虑基金管理人为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。 | | |
| | 银行存款、结算备付金、存出保证金均以活期存款利率计息，假定利率仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产（如有）的利息收益和卖出回购金融资产（如有）的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。 | | |
| | 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券。 | | |
| 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 6 月 30 日） | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
| | 利率下降 25 个基点 | 0.00 | 0.00 |
| 利率上升 25 个基点 | 0.00 | 0.00 | |

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有除可转债外的交易性债券投资，2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，银行存款、结算备付金及存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 30-95%，债券和现金的投资比例为 5-70%，其中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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | |
|--------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 1,540,012,905.95 | 92.29 | 2,617,667,334.51 | 92.24 |

| | | | | |
|---------------|------------------|-------|------------------|-------|
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 593,000.00 | 0.04 | - | - |
| 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 | 1,540,605,905.95 | 92.32 | 2,617,667,334.51 | 92.24 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 测算组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。 | | |
| | 假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。 | | |
| | Beta系数是根据报表日持仓资产在过去 100 个交易日收益率与其对应指数收益率回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。 | | |
| | 假定市场无风险利率为一年定期存款利率。 | | |
| 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 6 月 30 日） | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
| | +5% | 57,517,164.02 | 145,372,547.61 |
| | -5% | -57,517,164.02 | -145,372,547.61 |

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

| | | | |
|----|---|----------------------|------------------------|
| 假设 | 假定基金收益率的分布服从正态分布。 | | |
| | 根据基金单位净值收益率在报表日过去 100 个交易日的分布情况。 | | |
| | 以 95%的置信区间计算基金日收益率的绝对 VaR 值（不足 100 个交易日不予计算）。 | | |
| 分析 | 风险价值（单位：人民币元） | 本期末（2021 年 6 月 30 日） | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
| | 收益率绝对 VaR(%) | 2.30 | 2.28 |
| | 合计 | - | - |

注：上述分析衡量了在 95%的置信水平下，所持有的资产组合在资产负债表日后一个交易日内由于市场价格风险所导致的最大潜在损失。

§ 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 | 1,540,012,905.95 | 91.81 |
| | 其中：股票 | 1,540,012,905.95 | 91.81 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 593,000.00 | 0.04 |
| | 其中：债券 | 593,000.00 | 0.04 |
| | 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 | 134,044,544.75 | 7.99 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,685,600.59 | 0.16 |
| 9 | 合计 | 1,677,336,051.29 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|------------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 5,850.78 | 0.00 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,067,265,414.34 | 63.96 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,160,036.60 | 0.31 |
| E | 建筑业 | 141,406,807.77 | 8.47 |
| F | 批发和零售业 | 135,094,755.22 | 8.10 |
| 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 | 71,323,636.59 | 4.27 |
| J | 金融业 | 8,218,455.90 | 0.49 |
| 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 | 145,471.20 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 14,291.73 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|------------------|-------|
| Q | 卫生和社会工作 | 111,378,185.82 | 6.67 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,540,012,905.95 | 92.29 |

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 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 688363 | 华熙生物 | 482,049 | 133,942,135.14 | 8.03 |
| 2 | 000516 | 国际医学 | 5,921,222 | 111,378,185.82 | 6.67 |
| 3 | 688050 | 爱博医疗 | 251,363 | 94,959,914.14 | 5.69 |
| 4 | 000928 | 中钢国际 | 8,504,072 | 80,873,724.72 | 4.85 |
| 5 | 300751 | 迈为股份 | 161,340 | 73,361,298.00 | 4.40 |
| 6 | 300316 | 晶盛机电 | 1,265,300 | 63,897,650.00 | 3.83 |
| 7 | 300712 | 永福股份 | 1,378,936 | 60,507,711.68 | 3.63 |
| 8 | 000963 | 华东医药 | 1,290,020 | 59,353,820.20 | 3.56 |
| 9 | 600859 | 王府井 | 1,858,203 | 53,664,902.64 | 3.22 |
| 10 | 300390 | 天华超净 | 1,112,960 | 53,455,468.80 | 3.20 |
| 11 | 300001 | 特锐德 | 1,618,512 | 48,733,396.32 | 2.92 |
| 12 | 601633 | 长城汽车 | 1,035,300 | 45,128,727.00 | 2.70 |
| 13 | 000932 | 华菱钢铁 | 6,802,872 | 44,898,955.20 | 2.69 |
| 14 | 600690 | 海尔智家 | 1,634,817 | 42,358,108.47 | 2.54 |
| 15 | 000938 | 紫光股份 | 1,803,820 | 39,467,581.60 | 2.37 |
| 16 | 603799 | 华友钴业 | 329,200 | 37,594,640.00 | 2.25 |
| 17 | 000683 | 远兴能源 | 7,808,200 | 36,464,294.00 | 2.19 |
| 18 | 688012 | 中微公司 | 211,924 | 35,162,430.08 | 2.11 |
| 19 | 002920 | 德赛西威 | 314,700 | 34,642,176.00 | 2.08 |
| 20 | 603444 | 吉比特 | 64,995 | 34,447,350.00 | 2.06 |
| 21 | 603678 | 火炬电子 | 507,100 | 34,229,250.00 | 2.05 |
| 22 | 002636 | 金安国纪 | 2,103,749 | 34,122,808.78 | 2.04 |
| 23 | 688981 | 中芯国际 | 538,882 | 33,313,685.24 | 2.00 |
| 24 | 688111 | 金山办公 | 84,088 | 33,197,942.40 | 1.99 |
| 25 | 000822 | 山东海化 | 4,235,500 | 33,036,900.00 | 1.98 |
| 26 | 600745 | 闻泰科技 | 335,300 | 32,490,570.00 | 1.95 |
| 27 | 688059 | 华锐精密 | 186,554 | 31,322,416.60 | 1.88 |
| 28 | 600858 | 银座股份 | 3,581,208 | 21,809,556.72 | 1.31 |
| 29 | 300373 | 扬杰科技 | 309,500 | 18,737,130.00 | 1.12 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 30 | 300083 | 创世纪 | 1,653,100 | 18,101,445.00 | 1.08 |
| 31 | 002171 | 楚江新材 | 2,016,100 | 17,600,553.00 | 1.05 |
| 32 | 600196 | 复星医药 | 235,968 | 17,020,371.84 | 1.02 |
| 33 | 688386 | 泛亚微透 | 197,438 | 11,599,482.50 | 0.70 |
| 34 | 601995 | 中金公司 | 132,051 | 8,121,136.50 | 0.49 |
| 35 | 600905 | 三峡能源 | 907,763 | 5,147,016.21 | 0.31 |
| 36 | 688018 | 乐鑫科技 | 9,476 | 2,211,887.92 | 0.13 |
| 37 | 600850 | 电科数字 | 53,000 | 1,426,230.00 | 0.09 |
| 38 | 300896 | 爱美客 | 852 | 672,125.76 | 0.04 |
| 39 | 301015 | 百洋医药 | 4,614 | 251,115.78 | 0.02 |
| 40 | 688601 | 力芯微 | 1,174 | 156,952.06 | 0.01 |
| 41 | 688315 | 诺禾致源 | 3,711 | 145,471.20 | 0.01 |
| 42 | 688700 | 东威科技 | 3,049 | 117,264.54 | 0.01 |
| 43 | 300919 | 中伟股份 | 610 | 99,430.00 | 0.01 |
| 44 | 688499 | 利元亨 | 2,149 | 83,488.65 | 0.01 |
| 45 | 301018 | 申菱环境 | 7,811 | 64,753.19 | 0.00 |
| 46 | 601665 | 齐鲁银行 | 6,731 | 62,598.30 | 0.00 |
| 47 | 688676 | 金盘科技 | 3,750 | 60,900.00 | 0.00 |
| 48 | 688239 | 航宇科技 | 4,926 | 56,550.48 | 0.00 |
| 49 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24 | 0.00 |
| 50 | 301020 | 密封科技 | 4,210 | 44,794.40 | 0.00 |
| 51 | 300973 | 立高食品 | 360 | 41,655.60 | 0.00 |
| 52 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.00 |
| 53 | 001207 | 联科科技 | 682 | 22,581.02 | 0.00 |
| 54 | 300941 | 创识科技 | 399 | 19,926.06 | 0.00 |
| 55 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 56 | 300982 | 苏文电能 | 317 | 14,356.93 | 0.00 |
| 57 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 58 | 300940 | 南极光 | 307 | 13,317.66 | 0.00 |
| 59 | 603171 | 税友股份 | 637 | 12,230.40 | 0.00 |
| 60 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 61 | 300962 | 中金辐照 | 576 | 9,429.12 | 0.00 |
| 62 | 300945 | 曼卡龙 | 474 | 8,949.12 | 0.00 |
| 63 | 300948 | 冠中生态 | 324 | 8,884.08 | 0.00 |
| 64 | 300931 | 通用电梯 | 672 | 8,809.92 | 0.00 |
| 65 | 300950 | 德固特 | 219 | 8,569.47 | 0.00 |
| 66 | 605162 | 新中港 | 1,377 | 8,358.39 | 0.00 |
| 67 | 300986 | 志特新材 | 264 | 8,070.48 | 0.00 |
| 68 | 300987 | 川网传媒 | 301 | 8,069.81 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 69 | 300978 | 东箭科技 | 593 | 8,064.80 | 0.00 |
| 70 | 300993 | 玉马遮阳 | 410 | 7,908.90 | 0.00 |
| 71 | 300985 | 致远新能 | 295 | 7,318.95 | 0.00 |
| 72 | 300971 | 博亚精工 | 245 | 6,931.05 | 0.00 |
| 73 | 300991 | 创益通 | 254 | 6,733.54 | 0.00 |
| 74 | 300927 | 江天化学 | 217 | 6,531.70 | 0.00 |
| 75 | 300975 | 商络电子 | 492 | 6,410.76 | 0.00 |
| 76 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 77 | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 78 | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 79 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 80 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 81 | 301007 | 德迈仕 | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 82 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 83 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 84 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 600859 | 王府井 | 147,253,514.88 | 5.19 |
| 2 | 688111 | 金山办公 | 120,159,225.26 | 4.23 |
| 3 | 688363 | 华熙生物 | 108,104,381.80 | 3.81 |
| 4 | 600988 | 赤峰黄金 | 106,343,428.78 | 3.75 |
| 5 | 002867 | 周大生 | 103,627,527.90 | 3.65 |
| 6 | 603501 | 韦尔股份 | 96,134,002.00 | 3.39 |
| 7 | 002299 | 圣农发展 | 95,539,003.83 | 3.37 |
| 8 | 000928 | 中钢国际 | 90,334,749.34 | 3.18 |
| 9 | 000932 | 华菱钢铁 | 88,380,055.16 | 3.11 |
| 10 | 603678 | 火炬电子 | 87,747,093.45 | 3.09 |
| 11 | 002371 | 北方华创 | 86,986,050.20 | 3.07 |
| 12 | 002402 | 和而泰 | 82,149,786.55 | 2.89 |
| 13 | 601939 | 建设银行 | 75,973,555.36 | 2.68 |
| 14 | 601398 | 工商银行 | 72,526,029.20 | 2.56 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 15 | 688050 | 爱博医疗 | 68,235,644.73 | 2.40 |
| 16 | 300712 | 永福股份 | 66,192,052.44 | 2.33 |
| 17 | 300316 | 晶盛机电 | 59,279,768.84 | 2.09 |
| 18 | 600219 | 南山铝业 | 58,020,489.34 | 2.04 |
| 19 | 002636 | 金安国纪 | 57,696,241.79 | 2.03 |
| 20 | 603359 | 东珠生态 | 48,723,314.11 | 1.72 |

注：本报告期内，累计买入股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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 | 600690 | 海尔智家 | 198,244,552.26 | 6.99 |
| 2 | 600456 | 宝钛股份 | 171,710,552.19 | 6.05 |
| 3 | 603345 | 安井食品 | 155,811,256.21 | 5.49 |
| 4 | 600496 | 精工钢构 | 150,458,006.63 | 5.30 |
| 5 | 000516 | 国际医学 | 130,266,175.06 | 4.59 |
| 6 | 603259 | 药明康德 | 122,221,265.07 | 4.31 |
| 7 | 600893 | 航发动力 | 116,972,192.31 | 4.12 |
| 8 | 300001 | 特锐德 | 113,598,354.70 | 4.00 |
| 9 | 300073 | 当升科技 | 104,601,005.05 | 3.69 |
| 10 | 000596 | 古井贡酒 | 101,560,661.80 | 3.58 |
| 11 | 300316 | 晶盛机电 | 93,047,350.53 | 3.28 |
| 12 | 002402 | 和而泰 | 92,623,272.15 | 3.26 |
| 13 | 600988 | 赤峰黄金 | 91,825,651.12 | 3.24 |
| 14 | 601233 | 桐昆股份 | 91,760,279.18 | 3.23 |
| 15 | 603501 | 韦尔股份 | 90,412,092.39 | 3.19 |
| 16 | 000878 | 云南铜业 | 88,661,254.46 | 3.12 |
| 17 | 002299 | 圣农发展 | 85,889,830.38 | 3.03 |
| 18 | 002867 | 周大生 | 85,698,953.20 | 3.02 |
| 19 | 688111 | 金山办公 | 82,760,156.00 | 2.92 |
| 20 | 600031 | 三一重工 | 80,775,588.54 | 2.85 |
| 21 | 600711 | 盛屯矿业 | 78,370,344.96 | 2.76 |
| 22 | 600859 | 王府井 | 78,245,906.25 | 2.76 |
| 23 | 002126 | 银轮股份 | 77,493,447.19 | 2.73 |
| 24 | 688388 | 嘉元科技 | 77,472,426.19 | 2.73 |
| 25 | 601939 | 建设银行 | 76,624,247.00 | 2.70 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 26 | 601398 | 工商银行 | 73,293,654.52 | 2.58 |
| 27 | 300760 | 迈瑞医疗 | 73,035,981.20 | 2.57 |
| 28 | 300037 | 新宙邦 | 71,677,031.05 | 2.53 |
| 29 | 002371 | 北方华创 | 71,262,914.30 | 2.51 |
| 30 | 603678 | 火炬电子 | 66,542,541.00 | 2.34 |
| 31 | 300034 | 钢研高纳 | 62,328,361.40 | 2.20 |
| 32 | 603596 | 伯特利 | 61,843,813.51 | 2.18 |

注：本报告期内，累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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 | 3,326,410,331.45 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,612,427,008.60 |

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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） | 593,000.00 | 0.04 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 593,000.00 | 0.04 |

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 | 113049 | 长汽转债 | 5,930 | 593,000.00 | 0.04 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

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期受到调查以及处罚的情况的说明**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,811,773.04 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 4 | 应收利息 | 22,053.97 |
| 5 | 应收申购款 | 851,773.58 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,685,600.59 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中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

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|--------------|------------|------------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 94,915 | 27,064.85 | 2,819,697.34 | 0.11% | 2,566,040,768.06 | 99.89% |

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 | 29,673.53 | 0.0012% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2004年9月28日）基金份额总额 | 1,017,619,728.79 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,780,744,886.52 |
| 本报告期基金总申购份额 | 374,035,340.90 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,585,919,762.02 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,568,860,465.40 |

注：报告期间基金总申购份额含红利再投、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

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人于 2021 年 1 月 23 日发布公告，因杨皓鹏总经理离任，由本公司督察长黄乐军先生代为履行本公司总经理一职。

本基金管理人于 2021 年 4 月 23 日发布公告，本公司督察长黄乐军先生不再代为履行总经理职务，由曾杰先生担任本公司总经理。

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受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 | |
| 兴业证券 | 1 | 1,185,721,673.89 | 14.96% | 867,120.69 | 13.08% | - |
| 浙商证券 | 1 | 1,075,128,234.71 | 13.56% | 786,244.20 | 11.86% | - |
| 国联证券 | 2 | 1,015,101,645.07 | 12.80% | 945,371.38 | 14.26% | - |
| 长江证券 | 1 | 916,890,937.59 | 11.57% | 853,902.81 | 12.88% | - |
| 银河证券 | 1 | 852,593,943.02 | 10.75% | 794,021.18 | 11.98% | - |
| 东北证券 | 1 | 806,555,984.50 | 10.17% | 589,838.71 | 8.90% | - |
| 国泰君安 | 1 | 710,276,530.29 | 8.96% | 519,427.31 | 7.84% | - |

| | | | | | | |
|-------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 中信建投 | 2 | 512,275,083.79 | 6.46% | 477,082.82 | 7.20% | - |
| 东方证券 | 1 | 358,510,564.07 | 4.52% | 333,882.30 | 5.04% | - |
| 海通证券 | 2 | 281,494,983.64 | 3.55% | 262,155.94 | 3.96% | - |
| 上海证券 | 1 | 182,327,156.52 | 2.30% | 169,801.19 | 2.56% | - |
| 光大证券 | 1 | 31,134,037.69 | 0.39% | 28,994.58 | 0.44% | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注 1：本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准，具体评分指标分为研究支持和服务支持，研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演、应我方委托完成的课题研究或专项培训等。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单元的所属券商名单；由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判，草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿；报风险管理部审核后确定租用交易单元。

注 2：本报告期内本基金租用券商交易单元的情况未发生变更。

注 3：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

注 4：以上数据由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|-------------|--------|---------|------|------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比 | 成交金额 | 占当期债券回购 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的 |
| | | | | | | |

| | | 例 | | 成交总额 的比例 | | 比例 |
|-------|--------------|---------|---|-------------|---|----|
| 兴业证券 | 2,946,472.50 | 100.00% | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|--------|------------|
| 1 | 中海基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在中国银行股份有限公司部分渠道申购费率和全渠道定投申购费率折扣标准的公告 | 上证报 | 2021年1月4日 |
| 2 | 中海优质成长证券投资基金2020年第4季度报告 | 公司网站 | 2021年1月22日 |
| 3 | 中海基金管理有限公司关于旗下 | 上证报 | 2021年1月26日 |

| | | | |
|----|---|------|-----------------|
| | 部分基金参与宁波银行股份有限公司基金费率优惠活动的公告 | | |
| 4 | 中海基金管理有限公司关于华夏银行股份有限公司暂停本公司旗下部分基金申购业务（包括定期定额投资）费率优惠的公告 | 上证报 | 2021 年 3 月 11 日 |
| 5 | 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与长城国瑞证券有限公司基金申购业务（包括定期定额投资）费率优惠的公告 | 上证报 | 2021 年 3 月 11 日 |
| 6 | 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与安信证券股份有限公司基金申购业务（包括定期定额投资）费率优惠的公告 | 上证报 | 2021 年 3 月 12 日 |
| 7 | 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国金证券股份有限公司基金申购业务（包括定期定额投资）费率优惠的公告 | 上证报 | 2021 年 3 月 24 日 |
| 8 | 中海优质成长证券投资基金 2020 年年度报告 | 公司网站 | 2021 年 3 月 30 日 |
| 9 | 中海基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在中国银行股份有限公司部分渠道申购费率和全渠道定投申购费率折扣标准的公告 | 上证报 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 10 | 中海优质成长证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 公司网站 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 11 | 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告 | 上证报 | 2021 年 5 月 12 日 |
| 12 | 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告 | 上证报 | 2021 年 6 月 30 日 |

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海优质成长证券投资基金的文件
- 2、中海优质成长证券投资基金基金合同
- 3、中海优质成长证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准国联基金管理有限公司更名为中海基金管理有限公司的文件
- 5、中海优质成长证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

11.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

11.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021) 38789788 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日