

光大保德信新机遇混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 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 2021 年 3 月 30 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
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.....	7
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	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
6 中期财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	22
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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	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的情况	51
9 开放式基金份额变动	51
10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	52
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.9 其他重大事件	54
11 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	55
12.3 查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信新机遇混合型证券投资基金
基金简称	光大保德信新机遇混合
基金主代码	010676
交易代码	010676
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 30 日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	406,534,510.01 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过分析宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究，并通过定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。具体包括以下几个方面：</p> <p>（1）宏观经济运行的变化和国家的宏观调控政策将对证券市场产生深刻影响。本基金通过综合国内外宏观经济状况、国家财政政策、央行货币政策、物价水平变化趋势等因素，构建宏观经济分析平台；</p> <p>（2）运用历史数据并结合基金管理人内部的定性和定量分析模型，确定影响各类资产收益水平的先行指标，将上一步的宏观经济分析结果量化为对先行指标的影响，进而判断对各类资产收益的影响；</p> <p>（3）结合上述宏观经济对各类资产未来收益影响的分析结果和本基金投资组合的风险预算管理，确定各类资产的投资比重。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>“新机遇”是指根据宏观经济结构转型、产业结构变化、科技发展方向等，分析各行业所处发展阶段、产业竞争格局、发展趋势等因素，筛选未来有望受益程度较高或持续提升的行业，精选符合经济转型升级方向并具备良好发展潜力的公司，把握经济发展过程中所蕴涵的投资机遇。具体分为行业配置策略和个股选择策略：</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>本基金将通过自上而下的分析方式，寻找各行业在经济发展进程中的新机遇，具体包括以下几个方面：</p> <p>1) 定量分析</p> <p>利用行业的估值、业绩等多个方面指标进行分析，如行业相对估值水平（行业估值/市场估值）、行业相对利润增长率（行业利润增长率/市场利润增长率）、行业 PEG（行业估值/行业利润增长率）等。</p> <p>2) 定性分析</p>

从宏观经济运行特征、经济景气周期、行业周期轮动特征以及产业结构变化趋势等多个维度分析，同时结合行业自身的竞争格局、技术进步、政策条件等因素，把握不同行业的景气度变化情况和趋势，从而筛选未来有持续向好发展的行业。

（2）个股选择策略

本基金将通过自下而上的研究方式，结合定性和定量分析，关注上市公司在不同行业周期和自身发展阶段下的新机遇，深入挖掘上市公司的投资价值，精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。具体包括以下几个方面：

1) 定量分析

本基金结合与上市公司经营有关的重要定量指标，对上市公司的价值进行深入挖掘，为个股选择提供依据。具体的定量指标包括：

盈利增长指标：公司是否具有较强的盈利能力，主要分析指标包括净资产收益率（ROE）、毛利率、净利率、盈利增长率（ ΔE ）等；

成长指标：公司是否具有成长性，主要分析指标包括营业收入增长率、主营业务利润增长率、净利润增长率等；

估值指标：公司估值水平是否合理，可供选择的估值方法包括市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、自由现金流贴现模型（FCFF）或股利贴现模型（DDM）等；

运营效率指标：公司是否具有较高的运营效率，主要分析指标包括总资产周转率、存货周转率、应收账款周转率等；

财务结构指标：公司财务结构是否合理，主要分析指标包括资产负债率（D/A）、流动比率、速动比率等。

2) 定性分析

本基金认为股票价格的合理区间并非完全由其财务数据决定，还必须结合企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性等因素，给予股票一定的折溢价水平，并最终决定股票合理的价格区间。根据上述定性定量分析的结果，本基金进一步从价值和成长两个纬度对备选股票进行评估。对于价值被低估且成长性良好的股票，本基金将重点关注；对于价值被高估但成长性良好，或价值被低估但成长性较差的股票，本基金将通过深入的调研和缜密的分析，有选择地进行投资；对于价值被高估且成长性较差的股票，本基金不予考虑投资。

（3）港股通标的股票投资策略

本基金关注互联互通机制下港股市场投资机会，将重点关注以下几个方面：

1) 基金管理人的研究团队重点覆盖的行业中，精选港股通中有代表性的行业龙头公司；

2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；

3) 与 A 股同类公司相比具有估值优势的公司。

3、债券投资策略

本基金密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动趋势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合，配置能够提供稳定收益的债券品种。

	<p>4、证券公司短期公司债券投资策略 本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究，分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。</p> <p>5、资产支持证券投资策略 资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p>6、衍生品投资策略 为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、股票期权等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。 本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其理估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。 本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股票期权定价模型，选择估值合理的期权合约。基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。</p> <p>7、其他品种投资策略 法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理。</p>
业绩比较基准	70%×沪深 300 指数收益率+10%×恒生指数收益率+20%×中证全债指数收益率
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金还可投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</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	光大保德信基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名 王许利	李申
	联系电话 (021) 80262888	021-60637102

负责人	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-202-888	021-60637111
传真		(021) 80262468	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢, 6层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢(北区3号楼), 6-7层、10层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200010	100033
法定代表人		刘翔	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金中期报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、中国建设银行股份有限公司的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢 (北区 3 号楼), 6-7 层、10 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3月30日(基金合同生效日)至2021年6月30日)
本期已实现收益	6,803,550.78
本期利润	44,472,958.03
加权平均基金份额本期利润	0.1094
本期加权平均净值利润率	10.60%
本期基金份额净值增长率	10.94%
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	6,803,550.78
期末可供分配基金份额利润	0.0167
期末基金资产净值	451,007,468.04
期末基金份额净值	1.1094
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	10.94%
-------------	--------

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

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

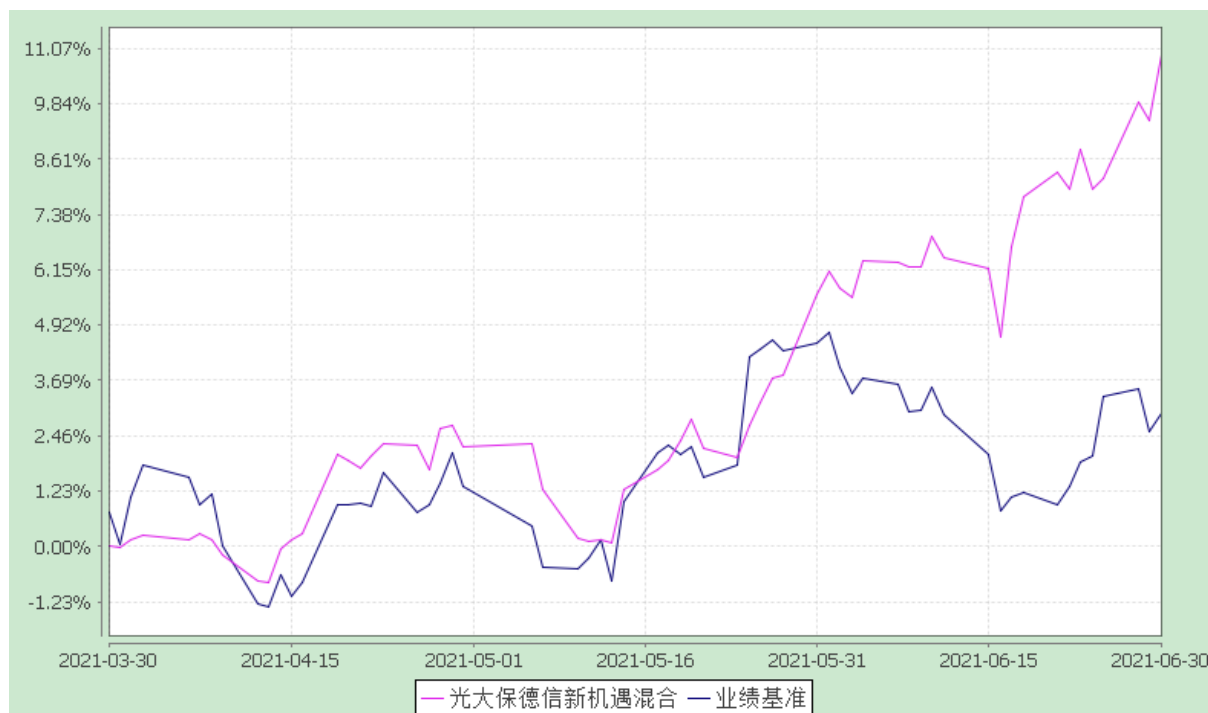
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.05%	0.82%	-1.48%	0.61%	6.53%	0.21%
过去三个月	10.95%	0.68%	2.92%	0.74%	8.03%	-0.06%
自基金合同生效起至今	10.94%	0.67%	2.97%	0.74%	7.97%	-0.07%

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

光大保德信新机遇混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2021年3月30日至2021年6月30日）



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2021 年 3 月 30 日至 2021 年 9 月 29 日。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期内。

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

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 1.6 亿元人民币，两家股东分别持有 55% 和 45% 的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2021 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 60 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金、光大保

德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信安祺债券型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金、光大保德信安诚债券型证券投资基金、光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金、光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中高等级债券型证券投资基金、光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信多策略优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信多策略精选 18 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信超短债债券型证券投资基金、光大保德信晟利债券型证券投资基金、光大保德信安泽债券型证券投资基金、光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信景气先锋混合型证券投资基金、光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信研究精选混合型证券投资基金、光大保德信消费主题股票型证券投资基金、光大保德信裕鑫混合型证券投资基金、光大保德信瑞和混合型证券投资基金、光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信尊裕纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金、光大保德信智能汽车主题股票型证券投资基金、光大保德信锦弘混合型证券投资基金、光大保德信新机遇混合型证券投资基金、光大保德信安阳一年持有期混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
魏晓雪	权益管理总部股票研究团队团队长、基金	2021-03-30	-	14 年	魏晓雪女士毕业于浙江大学金融学专业，2015 年获得复旦大学金融学的硕士学位。2006 年至 2009

	<p>经理</p>			<p>年在鹏远（北京）管理咨询有限公司上海分公司（原凯基管理咨询）担任研究员；2009 年 10 月加入光大保德信基金管理有限公司，担任高级研究员，现任总经理助理、权益管理总部权益投资团队基金经理、股票研究团队团队长，2012 年 11 月至 2014 年 2 月担任光大保德信行业轮动混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 2 月至今担任光大保德信新增长混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 5 月至 2017 年 1 月担任光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金的基金经理，2020 年 3 月至今担任光大保德信研究精选混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 4 月至 2021 年 7 月担任光大保德信消费主题股票型证券投资基金的基金经理，2020 年 5 月至今担任光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 2 月至今担任光大保德信智能汽车主题股票型证券投资基金的基金经理，2021 年 3 月至今担任光大保德信新机遇混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	-----------	--	--	--

注：对基金的首任基金经理，其任职日期按基金合同生效日填写，离任日期为公司决定确定的解聘日期。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有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

为充分保护持有人利益，确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待，本基金管理人从投研制度设计、组织结构设计、工作流程制定、技术系统建设和完善、公平交易执行效果评估等各方面出发，建设形成了有效的公平交易执行体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年年初至今，全球尤其海外经济体先经历了疫情显著缓和（1 月上旬至 2 月第三周），又出现了第三波疫情反弹（2 月第三周开始至今）两个阶段。但我们观察到，伴随疫苗的普及，如美国日均接种从 2 月第四周的 150 万剂左右上行至 3 月第四周的 250 万剂，百日计划也从 1 亿上调为 2 亿，全球经济体都在或快或慢得走入疫情后期阶段。3 月中国 PMI 为 51.9，属于正常略偏高区间，高于 2 月的 50.6、1 月的 51.3，只略低于作为本轮目前高点的 2020 年 11 月的 52.1。地产销售仍表现平稳，3 月 30 城商品房成交日均 57 万方，同比增长 80.8%，相较 19 年同期增长 14.5%。其中一二线城市销售景气度显著偏高，导致地产调控政策频出。1-2 月中国出口增速达 60.6%，周边国家和地区出口增速亦偏高，显示年初外需偏强。

2021 年第二季度，全球第三波疫情拐点初现。5 月起全球疫情逐步好转，周度日均新增确诊病例降至 51.1 万例，较 4 月最后一周下降 38%。进入 6 月后全球防疫形势整体延续改善。截止 6 月第四周，周度日均新增确诊病例已降至 37 万例；但 Delta 变异毒株的强传染性已导致多国疫情反复，英国、以色列的反弹尤其引发关注。截至 6 月 27 日，英美德法完全接种人数占比分别为 48%，46%，35% 和 29%。中国共计接种 11.9 亿剂次，列全球第一。2021 年二季度，经济仍维持较好的景气度。6 月 PMI 为 50.9，略低于 5 月的 51.0，年内 PMI 的最高点为 3 月的 51.9。南方八省日均耗煤量截至 6 月第三周录得 204 万吨，环比上月末增长 4.9%，这一绝对量和环比增速至少不弱于季节性。从发电耗煤量来看，工业部门依然表现稳定。另一个相对比较稳定的领域是房地产销售。截至 6 月 29 日，全国 30 城商品房日均成交录得 58.6 万方，高于 5 月的 57.2 万方。结构端三线城市有所回落，但一线城市销售增速仍韧性明显。韩国、越南出口 6 月仍比较稳定，国内出口可能包含着区域疫情的扰动，即 5-6 月的广深疫情对盐田港等港口运营带来一定影响。汽车芯片短缺影响汽车产销，汽车制造业两个指数连续两个月位于收缩区间。从 GDP 口径看，2021 年一季度工业恢复到 2019 年同期的

116%，批发零售、住宿餐饮却分别是 2019 年同期的 110%、97%。从社零口径看，4 月社零的两年平均增速为 4.3%，低于工业增加值的 6.8%和出口的 16.8%。消费恢复相对偏慢。展望未来宏观环境，考虑到 PPI 高位运行，且再逐步向下游转移，内需复苏有所放缓等因素，我们对国内下半年经济和企业盈利预期相对谨慎，但同时对政策调整预期相对逐渐转向乐观。

2021 年 2 月，大类资产开启一轮比较典型的“复苏交易”：大宗商品加速上行，海外主要经济体利率加速上行，主要市场股票估值承压、成长类资产加速调整。2021 年一季度股票市场主要指数均呈现了不同程度的下跌，偏成长风格下跌幅度更大。期间以创业板指为代表的成长风格下跌了 7%，以上证 50 为代表的大市值权重指数下跌了 2.8%。沪深 300、上证综指及中小板指分别实现了-3.1%、-0.90%及-4.3%的收益率。2021 年二季度以科创板和创业板为代表的成长风格带领股票市场大幅反弹。期间创业板指数上涨了 26%，科创 50 指数上涨了 27%，以上证 50 为代表的大市值权重指数下跌了 1.15%。沪深 300、上证综指及中小综指分别实现了 3.48%、4.34%及 9.87%的收益率。

从行业分布来看，一季度表现最好的行业为农业、医药及计算机，单季度分别录得了 16%、8%和 2.9%以上的涨幅。石油石化、家电及非银、煤炭等行业跌幅较大，其中石油石化行业跌幅超过 16%。二季度表现最好的行业为餐饮旅游、医药和食品饮料，单季度分别录得了 49%、31%和 30%以上的涨幅。建筑、石油石化、纺织服装和煤炭行业在二季度录得行业负增长，其中建筑行业的跌幅在 3%以上。二季度表现最好的行业为以电力设备、电子为代表的成长性行业。其中，电力设备行业更是实现了超过 14%以上的涨幅。表现较弱的为以农业、家电、地产为代表的偏消费服务性或消费需求性行业，其中农业行业的季度跌幅在 8%以上。

新机遇基金 2021 年 3 月发行，基本发在了市场情绪的冰点，募集结束后进行了快速建仓策略。封闭期的三个月中，仓位基本维持在 50%上下，个股选择能力非常突出，挖掘了较多市场偏冷门的优秀公司，所以业绩表现较为优异。封闭期结束后，由于申赎放开，仓位迅速提升至 90%水平。现持仓结构以消费为底仓，成长为主线，成长配置偏向于三大方向：以电动车为代表的未来汽车电动化&智能化趋势，以及涉及到出行应用的各个方面；伴随 5G、云计算、软件等科技的发展，对于工业端的应用和改造；以及已上升至国家战略的自主可控发展方向，以及中国制造向中国品牌的升级。本基金在个股选择上始终坚持综合评估企业的盈利能力、成长性和估值水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为 10.94%，业绩比较基准收益率为 2.97%。

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 2021 年下半年及未来更长的 2-3 年，我们依然坚持认为从长期视角来看，权益资产的结构

性低估资产依然存在，市场参与者结构愈发成熟，优质资产的稀缺性依然在，大的投资机会不断涌现，权益资产在大类资产配置中依然非常值得重视。但必须提出的是，相较于前两年，权益市场回报已然非常丰厚，我们必须正视“均值回归”的投资规律，在 2021 年降低收益率预期，且随时准备应对各种变化。

通过多年投资及研究方面的培训与锻炼，从基金管理者角度，我本人已逐步形成了相对完整的投资理念和框架。我个人的投资理念为“行稳以致远”，希望以相对完备，不断进化的投资框架追求业绩的可持续性以及稳定性。投资框架主要包括“战略”和“战术”两个层面。

从战略层面看，站在 2021 年中期的时点，流动性及政策面较 2021 年上半年有所缓解，2021 年 7 月 15 日央行已执行全面降准，释放了近 1 万亿的流动性。但从宏观经济及企业盈利基本面看，下半年压力会大于 2021 年上半年。今年多数企业会面临较为复杂及综合的成本压力，具体为：大宗商品价格的上涨，芯片短缺，海运运能短缺以及运价大幅上涨，汇率升值以及往复的新冠疫情对生产、流通的影响。所以从今年中报开始，投资者将会看到企业毛利率、净利率的下滑，因此，下半年的盈利压力会显著高于上半年。同时考虑到市场结构性的估值泡沫，我们判断 2021 年下半年依然会是个相对艰辛的年份，投资者需要降低收益率预期。但基于流动性层面考虑，以及中国企业超群的竞争力，我们认为对 2021 年的股票市场不必过于悲观。

从战术投资方法来说，近两年来，我个人投资关注的方向越来越稳定，因此产品管理的换手率也在显著降低，投资视角越来越基于大市场空间，确定性非常强，可以关注 3 年以上维度的重要社会变革方向以及产业发展趋势中寻觅商机。从自上而下角度，我们未来依然看好三大确定性的产业趋势，分别为：5G 以及科技技术的发展及应用，尤其对于工业企业的改造；汽车的电动化及智能化趋势；自主可控深入各个行业，尤其在科技领域，以及中国制造向中国品牌的升级。

具体而言，在 5G 产业的发展中，近两年为 5G 手机发展元年，但我们认为对于 5G 的应用值得花费更多的研究。5G 有很多性能适用于工业控制，高带宽、低时延等功能都有利于工业制造。任正非先生曾在 2020 年 5 月的访谈中表示，差不多一半的工业制造，比如飞机制造等工厂，是完全可以 5G 来做自动化和人工智能管理的，未来 5G 还会向高精密制造的自动化上发展。阿里巴巴近期推出的“犀牛制造平台”也正印证了这个趋势，我们非常看好 5G 产业对于工业端及汽车行业的改造。时至今日，5G 发展的路还有很长，科技发展的技术水平也很丰富，我们非常关注这部分对于工业企业的改造，而且通常在被改造的过程中，很多公司估值是非常便宜的，这将成为我们重点挖掘的方向之一。

伴随海外主流车企对于电动车的态度更为明确，我们认为汽车的电动化是不可逆的产业趋势。但同时，更为重要的是汽车的智能化。新能源汽车发展的核心绝不是简单的能源动力转换，而是在

电动平台上对于智能化发展的技术支持，是汽车运行和生产方式的历史性变革。未来，随着汽车通信技术的发展和互联网的接入，作为兼具场景和移动特点的终端，汽车的场景应用将被充分挖掘，在能源革命和智能化的驱动下将有望成为继智能手机后的另一个智能终端，重新定义人们的价值习惯和生活状态，使汽车出行更加安全、舒适、智能，也使人、车、交通环境之间的关系更加紧密。汽车作为一种由移动平台组成的全新互联生态系统，将通过为消费者提供新兴的及个性化的服务成为人们生活中不可或缺的一部分。在这个海内外共振的重要产业趋势下，我们作为基金管理人员也绝不会缺席这场盛宴，只是在个股选择上，我们相对更为重视未来空间更大的智能化，而非市场共识较深的电池产业链。

自主可控已经成为国家级别的战略方向，重要性不言而喻，且绝不仅仅限于科技板块。从去年疫情的发展我们可以看到，从科技到消费到医药都出现了自主可控的身影。同时，在经济发展的进程中，我们相信未来一定会看到我们成为“中国制造向中国创造、中国速度向中国质量、中国产品向中国品牌”三大转变的制造强国。

同时，由于长期孕育不断成长的大市值公司，我们对于消费板块的关注始终未有减弱，中国消费市场的深度及广度、爆发力是全球其他市场难以企及的，我们将以龙头方向为主线，在不断地变化中寻找超越行业 alpha 的个股。年中开始，A 股的消费板块开始出现了较大回撤，开始正式进入估值消化阶段，我们认为，从中长期来看，消费板块的长期投资逻辑及愿景毫无变化，依然非常具有吸引力，因此，在这轮回调中，我们将会加大对于消费板块的研究和配置。

综上所述，新机遇基金长期持仓结构就是以消费为底仓，以三大重要的战略成长方向为主线，且在股价涨跌的过程中，考虑估值波动而不断调整持仓比重。在基金的操作中，我们会加大自下而上的选股方式，始终坚持综合评估企业的盈利能力、成长性和估值水平。

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，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需

采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会二分之一以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经验，并具有广泛的代表性。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况，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

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基

金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信新机遇混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
资产：		-
银行存款	6.4.7.1	15,406,957.52
结算备付金		5,988,534.78
存出保证金		58,909.03
交易性金融资产	6.4.7.2	313,560,819.96
其中：股票投资		297,752,819.96
基金投资		-
债券投资		15,808,000.00
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	123,000,000.00
应收证券清算款		917,827.30
应收利息	6.4.7.5	209,481.11
应收股利		76,725.61
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		459,219,255.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
负 债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		7,131,704.19
应付赎回款		-
应付管理人报酬		536,478.94
应付托管费		89,413.15
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	407,186.59
应交税费		0.34

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	47,004.06
负债合计		8,211,787.27
所有者权益：		-
实收基金	6.4.7.9	406,534,510.01
未分配利润	6.4.7.10	44,472,958.03
所有者权益合计		451,007,468.04
负债和所有者权益总计		459,219,255.31

注：报表截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1094 元，基金份额总额 406,534,510.01 份。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信新机遇混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		47,001,115.01
1.利息收入		1,009,488.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	73,865.84
债券利息收入		50,508.80
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		885,114.00
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,322,219.12
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,377,780.45
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	944,438.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	37,669,407.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-
减：二、费用		2,528,156.98
1. 管理人报酬		1,586,679.69

2. 托管费		264,446.60
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	623,329.48
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		0.04
7. 其他费用	6.4.7.21	53,701.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		44,472,958.03
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		44,472,958.03

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信新机遇混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 30 日（基金合同生效日）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）	406,534,510.01	-	406,534,510.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,472,958.03	44,472,958.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	406,534,510.01	44,472,958.03	451,007,468.04

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：

基金管理人负责人：刘翔，主管会计工作负责人：贺敬哲，会计机构负责人：王永万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

光大保德信新机遇混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]2899 号《关于准予光大保德信新机遇混合型证券投资基金注册的批复》核准,由光大保德信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信新机遇混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 406,435,075.36 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0276 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《光大保德信新机遇混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 406,534,510.01 份,其中认购资金利息折合 99,434.65 份基金份额。本基金的基金管理人为光大保德信基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信新机遇混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准/注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、公司债、证券公司短期公司债券、企业债、地方政府债、次级债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中期票据、央行票据及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的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%。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:70%×沪深 300 指数收益率+10%×恒生指数收益率+20%×中证全债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《光大保德信新机遇混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金

行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 3 月 30 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 3 月 30 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 30 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金

持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调

整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或者票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<

证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、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。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	15,406,957.52
定期存款	-
其他存款	-
合计	15,406,957.52

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	260,099,972.71	297,752,819.96	37,652,847.25

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	5,796,000.00	5,796,000.00	0.00
	银行间市场	9,995,440.00	10,012,000.00	16,560.00
	合计	15,791,440.00	15,808,000.00	16,560.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		275,891,412.71	313,560,819.96	37,669,407.25

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	123,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	123,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期内未持有买断式回购交易。

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	2,206.27
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	2,693.55
应收债券利息	183,750.19
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	20,805.48
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	25.62
合计	209,481.11

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

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	407,011.59
银行间市场应付交易费用	175.00
合计	407,186.59

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提审计费	20,144.73
预提信息披露费	26,859.33
合计	47,004.06

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	406,534,510.01	406,534,510.01
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	406,534,510.01	406,534,510.01

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	6,803,550.78	37,669,407.25	44,472,958.03
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,803,550.78	37,669,407.25	44,472,958.03

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月30日（基金合同生效日）至2021年6月30日
活期存款利息收入	57,388.73
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	16,221.25
其他	255.86
合计	73,865.84

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月30日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出股票成交总额	120,179,419.38
减：卖出股票成本总额	112,801,638.93
买卖股票差价收入	7,377,780.45

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内未投资债券。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内未投资贵金属。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内未投资衍生工具。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月30日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	944,438.67
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	944,438.67

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年3月30日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1.交易性金融资产	37,669,407.25
——股票投资	37,652,847.25
——债券投资	16,560.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	37,669,407.25

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月30日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	623,154.48
银行间市场交易费用	175.00
合计	623,329.48

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月30日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	20,144.73
信息披露费	26,859.33
证券出借违约金	-
银行汇划费用	5,937.11
帐户维护费	360.00
其他	400.00
合计	53,701.17

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金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
光大保德信基金管理有限公司(简称"光大保德信")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(简称"中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月30日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,586,679.69
其中：支付销售机构的客户维护费	712,532.21

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月30日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	264,446.60

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5

个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期无应支付的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月30日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	15,406,957.52	57,388.73

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期没有进行利润分配。

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	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本	期末估值	备注

				限类型				总额	总额	
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股流通受限	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股流通受限	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股流通受限	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股流通受限	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股流通受限	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-

688314	康拓医疗	2021-05-11	2021-11-18	新股流通受限	17.34	74.48	1,085.00	18,813.90	80,810.80	-
688625	呈和科技	2021-05-31	2021-12-07	新股流通受限	16.48	42.63	2,672.00	44,034.56	113,907.36	-
688690	纳微科技	2021-06-16	2021-12-23	新股流通受限	8.07	79.89	3,477.00	28,059.39	277,777.53	-
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
113626	伯特转债	2021-06-29	2021-07-21	老股东配债	100.00	100.00	7,960.00	796,000.00	796,000.00	-

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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内部管理制度和流程来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理工作委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理工作委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理工作委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

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，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基

金资产净值的比例为 0.18%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

本基金本报告期末无重大流动性风险。

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

利率风险是指基金的财务状况和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、清算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售证券等。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

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	15,406,957.52	-	-	-	-	-	15,406,957.52
结算备付金	5,988,534.7	-	-	-	-	-	5,988,534.7

	8						8
存出保证金	58,909.03	-	-	-	-	-	58,909.03
交易性金融资产	5,000,000.00	-	10,808,000.00	-	-	297,752,819.96	313,560,819.96
买入返售金融资产	123,000.00	-	-	-	-	-	123,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	917,827.30	917,827.30
应收股利	-	-	-	-	-	76,725.61	76,725.61
应收利息	-	-	-	-	-	209,481.11	209,481.11
资产总计	149,454,401.33	-	10,808,000.00	-	-	298,956,853.98	459,219,255.31
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,131,704.19	7,131,704.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	536,478.94	536,478.94
应付托管费	-	-	-	-	-	89,413.15	89,413.15
应付交易费用	-	-	-	-	-	407,186.59	407,186.59
其他负债	-	-	-	-	-	47,004.06	47,004.06
应交税费	-	-	-	-	-	0.34	0.34
负债总计	-	-	-	-	-	8,211,787.27	8,211,787.27
利率敏感度缺口	149,454,401.33	-	10,808,000.00	-	-	290,745,066.71	451,007,468.04

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末持有的交易性固定收益类投资比例较低，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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每

日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	39,508,822.56	39,508,822.56
资产合计	-	39,508,822.56	39,508,822.56

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币汇率以外的其他市场变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021年6月30日
	港币相对人民币升值 1%	增加约 379,506.83
	港币相对人民币贬值 1%	减少约 379,506.83

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场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，所面临的最大市场价格风险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。本基金的基金管理人每日对投资组合的行业和个券的集中度进行监控，并定期分析其相对业绩比较基准的偏离度。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，通过压力测试来评估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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	297,752,819.96	66.02
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	796,000.00	0.18
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	298,548,819.96	66.20

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与其过去一年的整体水平保持一致。	
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 2021 年 6 月 30 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 2,386,216.49
	业绩比较基准下降 1%	减少约 2,386,216.49

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	297,752,819.96	64.84
	其中：股票	297,752,819.96	64.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,808,000.00	3.44

	其中：债券	15,808,000.00	3.44
	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	123,000,000.00	26.78
	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	21,395,492.30	4.66
8	其他各项资产	1,262,943.05	0.28
9	合计	459,219,255.31	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为人民币 39,508,822.56 元，占期末净值比例 8.76%。

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	-	-
C	制造业	212,375,783.06	47.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	16,793,980.00	3.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,347,407.83	2.07
J	金融业	34,721.10	0.01
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	19,665,800.00	4.36
N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	258,243,997.40	57.26

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	18,866,581.92	4.18
医疗保健	10,554,102.72	2.34
可选消费	10,088,137.92	2.24
合计	39,508,822.56	8.76

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	300887	谱尼测试	220,000.00	19,665,800.00	4.36
2	300790	宇瞳光学	500,000.00	16,965,000.00	3.76
3	688233	神工股份	300,076.00	16,204,104.00	3.59
4	688155	先惠技术	120,000.00	14,292,000.00	3.17
5	600885	宏发股份	220,000.00	13,794,000.00	3.06
6	002724	海洋王	1,000,000.00	13,610,000.00	3.02
7	603596	伯特利	360,000.00	12,870,000.00	2.85
8	300661	圣邦股份	50,000.00	12,636,500.00	2.80
9	603690	至纯科技	300,000.00	12,123,000.00	2.69
10	300681	英搏尔	330,000.00	11,810,700.00	2.62
11	688005	容百科技	90,000.00	10,908,000.00	2.42
12	002559	亚威股份	1,600,000.00	10,672,000.00	2.37
13	H01066	威高股份	700,000.00	10,554,102.72	2.34
14	603960	克来机电	300,000.00	9,930,000.00	2.20
15	H00700	腾讯控股	20,000.00	9,718,694.40	2.15
16	600570	恒生电子	100,000.00	9,325,000.00	2.07
17	600176	中国巨石	600,000.00	9,306,000.00	2.06
18	H00981	中芯国际	460,000.00	9,147,887.52	2.03
19	603599	广信股份	300,000.00	9,024,000.00	2.00
20	601111	中国国航	1,100,000.00	8,558,000.00	1.90

21	002250	联化科技	300,000.00	8,370,000.00	1.86
22	600115	中国东航	1,600,000.00	8,128,000.00	1.80
23	H01691	J S 环球生活	440,000.00	7,999,617.12	1.77
24	688006	杭可科技	80,000.00	6,800,000.00	1.51
25	300616	尚品宅配	70,000.00	6,195,700.00	1.37
26	300316	晶盛机电	110,000.00	5,555,000.00	1.23
27	300604	长川科技	80,000.00	5,456,800.00	1.21
28	603197	保隆科技	150,000.00	4,933,500.00	1.09
29	H02333	长城汽车	100,000.00	2,088,520.80	0.46
30	688690	纳微科技	3,477.00	277,777.53	0.06
31	688161	威高骨科	2,465.00	261,413.25	0.06
32	688625	呈和科技	2,672.00	113,907.36	0.03
33	603713	密尔克卫	1,000.00	107,980.00	0.02
34	688314	康拓医疗	1,085.00	80,810.80	0.02
35	688087	英科再生	2,469.00	54,219.24	0.01
36	601528	瑞丰银行	2,230.00	34,721.10	0.01
37	301021	英诺激光	2,899.00	27,424.54	0.01
38	001207	联科科技	682.00	22,581.02	0.01
39	688226	威腾电气	2,693.00	17,289.06	0.00
40	001208	华菱线缆	1,754.00	13,558.42	0.00
41	300614	百川畅银	329.00	13,285.02	0.00
42	603171	税友股份	637.00	12,230.40	0.00
43	300997	欢乐家	928.00	12,110.40	0.00
44	301002	崧盛股份	201.00	11,581.62	0.00
45	300996	普联软件	241.00	10,177.43	0.00
46	605162	新中港	1,377.00	8,358.39	0.00
47	301011	华立科技	175.00	5,922.00	0.00
48	605011	杭州热电	525.00	4,662.00	0.00
49	301007	德迈仕	303.00	4,375.32	0.00
50	300998	宁波方正	201.00	4,285.32	0.00
51	601567	三星医疗	200.00	4,260.00	0.00
52	301012	扬电科技	170.00	4,124.20	0.00
53	301010	晶雪节能	218.00	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300790	宇瞳光学	13,210,743.40	2.93

2	00700	腾讯控股	12,824,555.14	2.84
3	002714	牧原股份	12,680,447.00	2.81
4	002724	海洋王	12,651,908.00	2.81
5	600885	宏发股份	12,363,159.44	2.74
6	688233	神工股份	12,158,935.38	2.70
7	300887	谱尼测试	12,025,806.22	2.67
8	688155	先惠技术	11,393,107.18	2.53
9	01066	威高股份	11,291,654.72	2.50
10	600988	赤峰黄金	11,264,447.00	2.50
11	300681	英搏尔	11,141,734.00	2.47
12	002559	亚威股份	10,748,099.50	2.38
13	603596	伯特利	10,570,808.00	2.34
14	688017	绿的谐波	9,940,035.34	2.20
15	601111	中国国航	9,899,202.00	2.19
16	00981	中芯国际	9,886,289.79	2.19
17	300661	圣邦股份	9,618,605.00	2.13
18	600176	中国巨石	9,563,140.00	2.12
19	603690	至纯科技	9,346,456.00	2.07
20	000661	长春高新	9,186,699.00	2.04
21	603960	克来机电	9,085,988.00	2.01

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688017	绿的谐波	13,316,345.12	2.95
2	002714	牧原股份	11,337,096.20	2.51
3	688559	海目星	9,879,373.31	2.19
4	600988	赤峰黄金	9,328,203.41	2.07
5	000661	长春高新	8,793,156.00	1.95
6	002791	坚朗五金	8,665,156.00	1.92
7	600029	南方航空	7,816,722.00	1.73
8	688158	优刻得	7,785,275.64	1.73
9	603337	杰克股份	7,617,184.00	1.69
10	601966	玲珑轮胎	5,425,459.00	1.20
11	002466	天齐锂业	4,983,905.36	1.11
12	300450	先导智能	4,970,259.00	1.10
13	002050	三花智控	3,963,632.00	0.88
14	688005	容百科技	3,344,877.01	0.74
15	00700	腾讯控股	2,450,004.49	0.54
16	300887	谱尼测试	1,816,074.40	0.40
17	600885	宏发股份	1,682,559.00	0.37

18	002724	海洋王	1,265,082.00	0.28
19	688131	皓元医药	649,757.25	0.14
20	688076	诺泰生物	388,752.00	0.09

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	372,901,611.64
卖出股票的收入（成交）总额	120,179,419.38

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	5,000,000.00	1.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,012,000.00	2.22
	其中：政策性金融债	10,012,000.00	2.22
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）	796,000.00	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,808,000.00	3.51

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	210301	21 进出 01	100,000	10,012,000.00	2.22
2	019640	20 国债 10	50,000	5,000,000.00	1.11
3	113626	伯特转债	7,960	796,000.00	0.18

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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报告编制日前一年受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	58,909.03
2	应收证券清算款	917,827.30
3	应收股利	76,725.61
4	应收利息	209,481.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,262,943.05

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
5,614	72,414.41	701,794.78	0.17%	405,832,715.23	99.83%

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	1,013,351.79	0.25%

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：本基金的基金经理未持有本基金的份额。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年3月30日）基金份额总额	406,534,510.01
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	406,534,510.01

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，经公司十届十三次董事会会议审议通过，自 2021 年 2 月 2 日起，梅雷军先生正式离任公司副总经理、首席运营总监兼首席信息官，自 2021 年 2 月 26 日起，贺敬哲先生正式担任公司副总经理兼首席信息官。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.7 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，本基金的基金管理人和基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
上海证券	1	10,690,081.70	2.18%	9,741.62	2.39%	-
东兴证券	1	21,238,842.29	4.33%	15,107.19	3.71%	-
华泰证券	2	26,612,947.03	5.42%	18,929.70	4.65%	-
西南证券	1	32,027,275.77	6.52%	29,187.33	7.17%	-
招商证券	1	35,350,026.93	7.20%	32,214.30	7.91%	-
中金公司	1	44,335,306.03	9.03%	40,403.54	9.93%	-
海通证券	1	50,781,284.62	10.34%	46,276.28	11.37%	-
东北证券	2	68,470,128.06	13.94%	35,009.97	8.60%	-
长江证券	1	69,986,034.46	14.25%	63,778.78	15.67%	-
安信证券	1	131,566,941.25	26.79%	116,362.88	28.59%	-

注：（1）本报告期内本基金新增上海证券、东兴证券、西南证券、招商证券、中金公司、海通证券、长江证券、安信证券各1个交易单元，华泰证券、东北证券各2个交易单元。

（2）专用交易单元的选择标准和程序

A. 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；
 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
 经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；
 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，
 并能为本基金提供全面的信息服务；
 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；
 对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

B. 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照A中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构，并报本管理人董事会批准。

经董事会批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

10.8.2 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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
上海证券	-	-	221,000,000.00	8.96%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	204,800,000.00	8.31%	-	-
西南证券	-	-	180,300,000.00	7.31%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	791,000,000.00	32.08%	-	-

东北证券	5,000,000.00	100.00%	526,000,000.00	21.34%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	542,300,000.00	22.00%	-	-

10.9 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	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2021-02-26
2	光大保德信新机遇混合型证券投资基金基金产品资料概要	同上	2021-02-26
3	光大保德信新机遇混合型证券投资基金基金份额发售公告	同上	2021-02-26
4	光大保德信新机遇混合型证券投资基金基金合同	同上	2021-02-26
5	光大保德信新机遇混合型证券投资基金托管协议	同上	2021-02-26
6	光大保德信新机遇混合型证券投资基金招募说明书	同上	2021-02-26
7	关于光大保德信新机遇混合型证券投资基金调整募集期限的公告	同上	2021-03-16
8	光大保德信新机遇混合型证券投资基金新增部分发售机构的公告	同上	2021-03-16
9	光大保德信新机遇混合型证券投资基金新增部分发售机构的公告	同上	2021-03-17
10	光大保德信新机遇混合型证券投资基金基金合同生效公告	同上	2021-03-31
11	光大保德信基金管理有限公司关于对通过网上直销平台（包括移动终端平台）进行光大保德信新机遇混合型证券投资基金的申购、定期定额投资和基金转换实行费率优惠的公告	同上	2021-06-25
12	光大保德信新机遇混合型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	同上	2021-06-25

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

本基金本报告期不存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形。

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、中国证监会批准光大保德信新机遇混合型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信新机遇混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信新机遇混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信新机遇混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信新机遇混合型证券投资基金法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、报告期内光大保德信新机遇混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 层。

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。客户服务中心电话：4008-202-888，021-80262888。公司网址：www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日