

中银大健康股票型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

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。

基金托管人交通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 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
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
9 开放式基金份额变动	49
10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
11 备查文件目录	51
11.1 备查文件目录	51
11.2 存放地点	51
11.3 查阅方式	51

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银大健康股票型证券投资基金	
基金简称	中银大健康股票	
基金主代码	009414	
交易代码	009414	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年5月27日	
基金管理人	中银基金管理有限公司	
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	420,120,243.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中银大健康股票 A	中银大健康股票 C
下属分级基金的交易代码	009414	010321
报告期末下属分级基金的份额总额	411,063,051.46 份	9,057,191.91 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过精选投资于大健康主题相关证券，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的资产配置策略主要依托于本基金管理人的大类资产配置体系，对股票、债券、现金等主要大类资产的表现进行预测，进而确定本基金对股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的投资比例。本基金管理人的大类资产配置体系以定性和定量相结合的方法，对宏观发展政策驱动力、宏观经济驱动力、宏观价格驱动力、流动性政策驱动力、资产主体经营驱动力、市场参与度驱动力和境外因素驱动力七个因素进行综合考量，在风险与收益相匹配的原则下，力求取得中长期的绝对和相对收益。本基金定义的大健康产业是与国民健康状况提升、改善和恢复直接或间接相关产业的统称，不仅包括身体健康，还包括生活健康、身心健康、健康服务、健康养老等。本基金将重点投资于满足基金管理人以下分析标准的公司：公司经营稳健，盈利能力较强或具有较好的盈利预期；财务状况运行良好，资产负债结构相对合理，财务风险较小；公司治理结构合理、管理团队相对稳定、管理规范、具有清晰的长期愿景与企业文化、信息透明。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中证健康产业指数收益率×75%+恒生指数收益率×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，将面临需承担汇率风险、境外市场风险以及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。

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	中银基金管理有限公司		交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	欧阳向军	陆志俊
	联系电话	021-38834999	95559
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话	021-38834788 400-888-5566	95559	
传真	021-68873488	021-62701216	
注册地址	上海市银城中路200号中银大厦45层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号	
办公地址	上海市银城中路200号中银大厦10层、11层、26层、45层	中国（上海）长宁区仙霞路18号	
邮政编码	200120	200336	
法定代表人	章砚	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	http://www.bocim.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 200 号 26 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中银基金管理有限公司	上海市银城中路 200 号中银大厦 10 层、11 层、26 层、45 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 日至 2021 年 6 月 30 日）	
	中银大健康股票 A	中银大健康股票 C
本期已实现收益	150,728,706.13	1,540,455.46
本期利润	94,499,538.62	1,199,973.05
加权平均基金份额本期利润	0.1863	0.1973
本期加权平均净值利润率	13.83%	14.56%
本期基金份额净值增长率	13.86%	13.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	中银大健康股票 A	中银大健康股票 C
期末可供分配利润	183,959,464.65	4,020,302.15
期末可供分配基金份额利润	0.4475	0.4439
期末基金资产净值	595,022,516.11	13,077,494.06
期末基金份额净值	1.4475	1.4439
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	中银大健康股票 A	中银大健康股票 C

基金份额累计净值增长率	44.75%	19.38%
-------------	--------	--------

注：1、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。

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。期末可供分配收益，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果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（已实现部分扣除未实现部分）。

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

中银大健康股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.70%	1.26%	-2.47%	0.67%	1.77%	0.59%
过去三个月	12.73%	1.27%	1.87%	0.72%	10.86%	0.55%
过去六个月	13.86%	1.45%	2.60%	0.94%	11.26%	0.51%
过去一年	37.69%	1.47%	5.70%	1.03%	31.99%	0.44%
自基金合同生效日起	44.75%	1.41%	11.46%	1.01%	33.29%	0.40%

中银大健康股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.73%	1.26%	-2.47%	0.67%	1.74%	0.59%
过去三个月	12.62%	1.27%	1.87%	0.72%	10.75%	0.55%
过去六个月	13.64%	1.45%	2.60%	0.94%	11.04%	0.51%
自基金合同生效日起	19.38%	1.39%	0.67%	0.89%	18.71%	0.50%

3.2.2 自基金转型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

中银大健康股票型证券投资基金

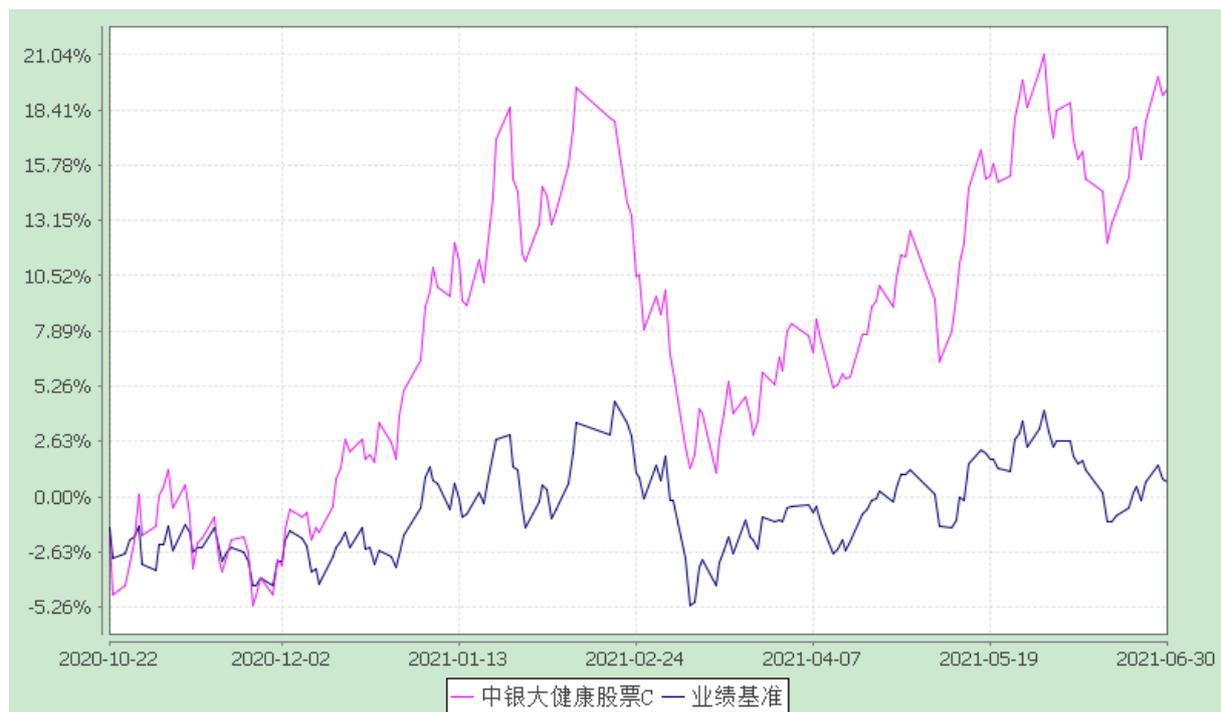
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2020年5月27日至2021年6月30日）

中银大健康股票 A



中银大健康股票 C



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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

本基金管理人为中银基金管理有限公司，由中国银行股份有限公司和贝莱德投资管理有限公司两大全球著名领先金融品牌强强联合组建的中外合资基金管理公司，致力于长期参与中国基金业的发展，努力成为国内领先的基金管理公司。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等 142 只开放式证券投资基金，同时管理着多个私募资产管理计划。

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		
刘潇	基金经理	2020-05-27	-	12	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），理学硕士。曾任平安资产管理行业研究员。2012 年加入中银基金管理有限公司，曾任研究员。2018 年 6 月至今任中银医疗保健基金基金经理，2019 年 11 月至今任中银创新医疗基金经理，2020 年 5 月至今任中银大健康基金基金经理。具备基金从业资格。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，无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

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各

投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生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超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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

一、宏观经济、行情回顾与运作分析

1. 宏观经济分析

国外经济方面，上半年全球发达国家疫情总体好转，二季度印度疫情爆发带动东南亚和英国疫情反复，截止 6 月末，美、英、中、印度和巴西全部完成疫苗接种占比分别为 45%、47%、16%、4%、12%。美国消费继续复苏，通胀走高，就业伴随疫苗接种总体恢复，6 月失业率较 2020 年 12 月下降 0.8 个百分点至 5.9%，6 月制造业 PMI 较 2020 年 12 月上行 0.1 个百分点至 60.6，6 月服务业 PMI 较 2020 年 12 月上升 2.4 个百分点至 60.1。美联储维持利率水平和资产购买规模不变，上调 IOER 和 ONRRP 利率，下半年就业恢复后美联储可能明确 QE taper 信号。欧元区继续复苏，6 月失业率较 2020 年末回落 0.4 个百分点至 7.7%，6 月制造业 PMI 较 2020 年末上升 8.2 个百分点至 63.4，6 月服务业 PMI 较 2020 年末上升 11.9 个百分点至 58.3，欧央行 6 月议息会议上提出加快 PEPP 购买步伐。日本央行维持基准利率不变，经济恢复速度放缓，通缩问题有所好转，6 月 CPI 同比较 2020 年末回升 1.4 个百分点至 0.2%，6 月制造业 PMI 较 2020 年末上行 2.4 个百分点至 52.4。综合来看，全球经济下半年复苏进度边际放缓，主要经济体央行货币政策有边际收紧压力，但货币政策退出宽松力度预计总体较为温和。

国内经济方面，生产数据快速修复后有所转弱，经济结构性分化持续，出口维持高位，地产投资高位回落，而制造业和消费继续缓慢恢复，经济下行压力逐步体现，通胀预期回落。具体来看，上半年领先指标中采制造业 PMI 持续位于荣枯线上方窄幅震荡，6 月值较 2020 年末走低 1 个百分点至 50.9，同步指标工业增加值 1-6 月累计同比增长 15.9%，较 2020 年末上升 13.1 个百分点。从经济增长动力来看，出口总体偏强，消费投资继续改善：1-6 月美元计价累计出口增速较 2020 年末回升 35 个百分点至 38.6% 左右，6 月社会消费品零售总额增速较 2020 年末回升 7.5 个百分点至 12.1%，制造业、房地产、基建投资均缓慢改善，1-6 月固定资产投资增速较 2020 年末回升 9.7 个百分点至 12.6% 的水平。通胀方面，CPI 震荡上行，6 月同比增速从 2020 年末的 0.2% 上升 0.9 个百分点至 1.1%，

PPI 快速上行后高位震荡，6 月同比增速从 2020 年末的-0.4%上升 9.2 个百分点至 8.8%。

2. 市场回顾

股票市场方面，上半年上证综指上涨 3.40%，代表大盘股表现的沪深 300 指数上涨 0.24%，中小板综合指数上涨 5.19%，创业板综合指数上涨 14.13%，风格上仍是科技成长表现较好。

3. 运行分析

上半年股票市场先扬后抑，总体出现一定程度上涨，本基金业绩表现好于比较基准。策略上，我们对于大众消费品行业由于基数原因景气度偏低，创新药、半导体、新能源与相关上游行业景气度较高，我们在组合上增加了创新药、科研器械耗材、半导体等科技相关行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 13.86%，同期业绩比较基准收益率为 2.60%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 13.64%，同期业绩比较基准收益率为 2.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着中报季的到来，医药、消费行业的持续稳定成长性仍然值得期待，部分消费品公司的估值水平跌到历史较低水平，我们看好业绩期确定性增长公司的估值切换的行情，生物医药 CDMO、半导体、新能源等高端制造出口行业还在景气高点，下半年关注海外供应链恢复进度和行业景气度的变化。

医药、消费、科技行业是国内经济主要的增长动能，强大的内需驱动同时，中国疫情控制较好带来了制造业加速出海与海外市场份额的提升，科技创新与消费升级成为行业成长的主要方向，我们时刻把握行业脉动，跟随行业的企业，赚取成长收益。作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由研究部、风险管理部、基金运营部及投资相关部门的相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉

尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场环境相适应的估值方法，基金运营部应征询会计师事务所、基金托管人的相关意见。公司按特殊流程改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，应就基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见，会计师事务所应对公司所采用的相关估值模型、假设、参数及输入的适当性发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.6.2 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.6.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本报告期末 A 类基金份额可供分配利润为 183,959,464.65 元，C 类基金份额可供分配利润为 4,020,302.15 元。本基金本报告期末未进行利润分配。

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

本基金在报告期内未出现连续二十个工作日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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——交通银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、

准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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：中银大健康股票型证券投资基金

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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	18,559,108.69	59,784,732.02
结算备付金		7,863,174.35	1,422,160.83
存出保证金		4,167,969.09	1,748,925.57
交易性金融资产	6.4.7.2	580,495,698.87	858,040,663.47
其中：股票投资		540,363,698.87	806,385,994.17
基金投资		-	-
债券投资		40,132,000.00	51,654,669.30
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		5,155,409.13	13,010,670.47
应收利息	6.4.7.5	1,203,100.73	595,748.27
应收股利		123,967.16	74,407.88
应收申购款		920,301.81	298,873.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		618,488,729.83	934,976,182.24
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		3,494,781.41	1,455,784.37
应付赎回款		4,060,369.18	11,254,262.43
应付管理人报酬		756,074.77	1,235,357.08
应付托管费		126,012.47	205,892.87
应付销售服务费		3,957.85	1,080.96
应付交易费用	6.4.7.7	1,838,019.22	1,594,683.03
应交税费		0.98	25.49

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	109,503.78	208,853.20
负债合计		10,388,719.66	15,955,939.43
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	420,120,243.37	722,903,497.38
未分配利润	6.4.7.10	187,979,766.80	196,116,745.43
所有者权益合计		608,100,010.17	919,020,242.81
负债和所有者权益总计		618,488,729.83	934,976,182.24

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4474 元，基金份额总额 420,120,243.37 份，其中 A 类基金份额净值 1.4475 元，份额总额 411,063,051.46 份；C 类基金份额净值 1.4439 元，份额总额 9,057,191.91 份。

6.2 利润表

会计主体：中银大健康股票型证券投资基金

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 5 月 27 日（基 金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		110,774,236.91	100,193,870.59
1.利息收入		913,906.78	1,226,690.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	122,640.25	757,536.08
债券利息收入		791,266.53	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	469,154.57
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		165,986,544.55	1,882,136.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	162,301,024.47	550,238.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	208,576.39	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	3,476,943.69	1,331,898.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-56,569,649.92	97,084,951.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	443,435.50	91.69
减：二、费用		15,074,725.24	4,597,082.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2	5,181,382.41	2,628,910.12
2. 托管费	6.4.10.2	863,563.75	438,151.68
3. 销售服务费		16,212.28	-
4. 交易费用	6.4.7.18	8,876,168.44	1,491,941.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		2.91	-
7. 其他费用	6.4.7.19	137,395.45	38,078.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		95,699,511.67	95,596,788.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		95,699,511.67	95,596,788.35

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银大健康股票型证券投资基金

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）	722,903,497.38	196,116,745.43	919,020,242.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	95,699,511.67	95,699,511.67
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）	-302,783,254.01	-103,836,490.30	-406,619,744.31
其中：1.基金申购款	86,150,696.13	30,168,242.55	116,318,938.68
2.基金赎回款	-388,933,950.14	-134,004,732.85	-522,938,682.99
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）	420,120,243.37	187,979,766.80	608,100,010.17
项目	上年度可比期间 2020 年 5 月 27 日（基金合同生效日）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）	1,863,493,495.67	-	1,863,493,495.67

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	95,596,788.35	95,596,788.35
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）	1,863,493,495.67	95,596,788.35	1,959,090,284.02

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：李道滨，主管会计工作负责人：张家文，会计机构负责人：乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银大健康股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]621 号文《关于准予中银大健康股票型证券投资基金注册的批复》核准，由基金管理人中银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银大健康股票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 1,863,087,472.22 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2020)验字第 61062100-B06 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银大健康股票型证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,863,493,495.67 份基金份额，其中认购资金利息折合 406,023.45 份基金份额。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2020 年 10 月 16 日发布的《关于中银大健康股票型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》以及更新的《中银大健康股票型证券投资基金基金合同》和《中银大健康股票型证券投资基金托管协议》的有关规定，自 2020 年 10 月 16 日起，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金

份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银大健康股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、央行票据、债券回购、协议存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：投资于股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 80%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-20%，投资于医疗保健行业的股票的合计比例不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证健康产业指数收益率×75%+恒生指数收益率×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×15%。

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》、《中银大健康股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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 1 月 1 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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利,由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	18,559,108.69
定期存款	-
其他存款	-
合计	18,559,108.69

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	489,953,740.96	540,363,698.87	50,409,957.91
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	40,301,520.00	40,132,000.00
	合计	40,301,520.00	40,132,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	530,255,260.96	580,495,698.87	50,240,437.91

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,253.86
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	2,617.59
应收债券利息	1,197,764.38
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.74
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	464.16
合计	1,203,100.73

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	1,838,019.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,838,019.22

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	865.43
应付证券出借违约金	-
应付账户维护费	4,500.00
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	44,630.98
合计	109,503.78

6.4.7.9 实收基金

中银大健康股票 A

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	账面金额
上年度末	719,726,889.14	719,726,889.14
本期申购	70,402,837.18	70,402,837.18
本期赎回（以“-”号填列）	-379,066,674.86	-379,066,674.86
本期末	411,063,051.46	411,063,051.46

中银大健康股票 C

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	账面金额
上年度末	3,176,608.24	3,176,608.24
本期申购	15,747,858.95	15,747,858.95
本期赎回（以“-”号填列）	-9,867,275.28	-9,867,275.28
本期末	9,057,191.91	9,057,191.91

6.4.7.10 未分配利润

中银大健康股票 A

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	158,339,101.90	36,918,142.67	195,257,244.57
本期利润	150,728,706.13	-56,229,167.51	94,499,538.62
本期基金份额交易产生的变动数	-108,159,663.34	2,362,344.80	-105,797,318.54
其中：基金申购款	25,577,405.21	-961,207.06	24,616,198.15
基金赎回款	-133,737,068.55	3,323,551.86	-130,413,516.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	200,908,144.69	-16,948,680.04	183,959,464.65

中银大健康股票 C

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	696,590.75	162,910.11	859,500.86
本期利润	1,540,455.46	-340,482.41	1,199,973.05
本期基金份额交易产生的变动数	2,156,280.32	-195,452.08	1,960,828.24
其中：基金申购款	6,036,835.48	-484,791.08	5,552,044.40
基金赎回款	-3,880,555.16	289,339.00	-3,591,216.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,393,326.53	-373,024.38	4,020,302.15

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	58,487.78
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	55,387.59
其他	8,764.88
合计	122,640.25

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,926,736,491.97
减：卖出股票成本总额	2,764,435,467.50
买卖股票差价收入	162,301,024.47

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 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	11,428,627.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,040,580.00
减：应收利息总额	179,471.50
买卖债券差价收入	208,576.39

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 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	3,476,943.69
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	3,476,943.69

6.4.7.16 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	-56,569,649.92
——股票投资	-55,908,160.62
——债券投资	-661,489.30
——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	-56,569,649.92

6.4.7.17 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	426,195.36
转换费收入	17,240.14
合计	443,435.50

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中，A 类基金份额将不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产，C 类基金份额将赎回费收入全额归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中，A 类基金份额将不低于赎回费总额的 50% 归入转出基金的基金资产，C 类基金份额将赎回费收入全额归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 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	8,875,993.44
银行间市场交易费用	175.00
合计	8,876,168.44

6.4.7.19 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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	24,257.10
银行间账户维护费	9,000.00
合计	137,395.45

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

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
中银基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构

注：下述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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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5月27日(基金合同 生效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,181,382.41	2,628,910.12
其中：支付销售机构的客户维护费	2,276,823.92	1,473,765.46

注：支付基金管理人中银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年5月27日(基金合同 生效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	863,563.75	438,151.68

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	中银大健康股票 A	中银大健康股票 C	合计
中银基金管理有限公司	-	398.10	398.10
中国银行	-	3,284.72	3,284.72
合计	-	3,682.82	3,682.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年5月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银大健康股票A	中银大健康股票C	合计
中银基金管理有限公司	-	-	-
中国银行	-	-	-
合计	-	-	-

注：自 2020 年 9 月 7 日起，支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中银基金，再由中银基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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及上年度可比期间均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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年5月27日（基金合同生效日）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	18,559,108.69	58,487.78	582,254,947.45	265,350.72

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

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
300919	中伟股份	2020-12-23	2021-07-02	新股锁定期内	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688686	奥普特	2020-12-24	2021-07-01	新股锁定期内	78.49	451.00	2,330	182,881.70	1,050,830.00	-
688425	铁建重工	2021-06-11	2021-12-22	新股锁定期内	2.87	4.75	76,222	218,757.14	362,054.50	-
688276	百克生物	2021-06-17	2021-12-27	新股锁定期内	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	新股锁定期内	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股锁定	47.33	251.96	388	18,364.04	97,760.48	-

				期内						
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688662	富信科技	2021-03-25	2021-10-08	新股锁定期内	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-
688636	智明达	2021-03-30	2021-10-08	新股锁定期内	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定期内	33.22	87.50	772	25,645.84	67,550.00	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
688676	金盘科技	2021-03-02	2021-09-09	新股锁定期内	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688260	昀冢科技	2021-03-25	2021-10-08	新股锁定期内	9.63	16.41	2,990	28,793.70	49,065.90	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300894	火星人	2020-12-24	2021-07-01	新股锁定期内	14.07	68.00	628	8,835.96	42,704.00	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股锁定期内	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定期内	48.59	90.39	429	20,845.11	38,777.31	-
688395	正弦电气	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定期内	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
30102	英诺	2021-0	2021-0	新股	9.46	9.46	2,899	27,424	27,424	-

1	激光	6-28	7-06	未上市				.54	.54	
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股锁定期内	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定期内	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定期内	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股锁定期内	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定期内	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股锁定期内	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股锁定期内	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	新股锁定期内	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定期内	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股锁定期内	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定期内	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股锁定期内	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股锁定期内	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定期内	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股锁定期内	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股锁定期内	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定期内	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定期内	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股锁定期内	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定期内	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股锁定期内	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股锁定期内	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股锁定期内	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股锁定期内	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股锁定期内	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-

				期内						
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定期内	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股锁定期内	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定期内	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定期内	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股锁定期内	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股锁定期内	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股锁定期内	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股锁定期内	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股锁定期内	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股锁定期内	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定期内	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股锁定期内	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股锁定期内	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股锁定期内	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
30096	通业	2021-0	2021-0	新股	12.08	23.06	234	2,826.	5,396.	-

0	科技	3-22	9-29	锁定期内				72	04	
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股锁定期内	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股锁定期内	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股锁定期内	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股锁定期内	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股锁定期内	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股锁定期内	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定期内	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项停牌	56.35	2021-07-06	6.15	59,200	2,968,282.60	3,335,920.00	-

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，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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 2021 年 06 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资(2020 年 12 月 31 日：0.13%)。

本基金固定收益投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按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	上年末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	1,224,669.30
未评级	40,132,000.00	50,430,000.00
合计	40,132,000.00	51,654,669.30

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、中央票据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在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在基金每个开放日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。

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。同时，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公司的证券不得超过该证券的 10%。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，因此除附注列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

于 2021 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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因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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,559,108.69	-	-	-	18,559,108.69
结算备付金	7,863,174.35	-	-	-	7,863,174.35
存出保证金	4,167,969.09	-	-	-	4,167,969.09
交易性金融资产	40,132,000.00	-	-	540,363,698.87	580,495,698.87
应收证券清算款	-	-	-	5,155,409.13	5,155,409.13
应收股利	-	-	-	123,967.16	123,967.16
应收利息	-	-	-	1,203,100.73	1,203,100.73
应收申购款	1,519.93	-	-	918,781.88	920,301.81
资产总计	70,723,772.06	-	-	547,764,957.77	618,488,729.83
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,494,781.41	3,494,781.41
应付赎回款	-	-	-	4,060,369.18	4,060,369.18
应付管理人报酬	-	-	-	756,074.77	756,074.77
应付托管费	-	-	-	126,012.47	126,012.47
应付销售服务费	-	-	-	3,957.85	3,957.85
应付交易费用	-	-	-	1,838,019.22	1,838,019.22
应交税费	-	-	-	0.98	0.98
其他负债	-	-	-	109,503.78	109,503.78
负债总计	-	-	-	10,388,719.66	10,388,719.66
利率敏感度缺口	70,723,772.06	-	-	537,376,238.11	608,100,010.17

上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	59,784,732.02	-	-	-	59,784,732.02
结算备付金	1,422,160.83	-	-	-	1,422,160.83
存出保证金	1,748,925.57	-	-	-	1,748,925.57
交易性金融资产	50,430,000.00	-	1,224,669.30	806,385,994.17	858,040,663.47
应收证券清算款	-	-	-	13,010,670.47	13,010,670.47
应收股利	-	-	-	74,407.88	74,407.88
应收申购款	41,793.74	-	-	257,079.99	298,873.73
应收利息	-	-	-	595,748.27	595,748.27
资产总计	113,427,612.16	-	1,224,669.30	820,323,900.78	934,976,182.24
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,455,784.37	1,455,784.37
应付赎回款	-	-	-	11,254,262.43	11,254,262.43
应付管理人报酬	-	-	-	1,235,357.08	1,235,357.08
应付托管费	-	-	-	205,892.87	205,892.87
应付销售服务费	-	-	-	1,080.96	1,080.96
应付交易费用	-	-	-	1,594,683.03	1,594,683.03
应交税费	-	-	-	25.49	25.49
其他负债	-	-	-	208,853.20	208,853.20
负债总计	-	-	-	15,955,939.43	15,955,939.43
利率敏感度缺口	113,427,612.16	-	1,224,669.30	804,367,961.35	919,020,242.81

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例低于 10%（2020 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和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（2020 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

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	-	79,947,258.86	79,947,258.86
资产合计	-	79,947,258.86	79,947,258.86
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	79,947,258.86	79,947,258.86
项目	上年度末 2020年12月31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			
资产合计	-	60,138,776.55	60,138,776.55
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	60,138,776.55	60,138,776.55

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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年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	540,363,698.	88.86	806,385,994.1	87.74

	87		7	
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	540,363,698.87	88.86	806,385,994.17	87.74

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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：人民币万元）	
		本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	增加约 3,817	-
	2. 业绩比较基准下降5%	减少约 3,817	-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	540,363,698.87	87.37
	其中：股票	540,363,698.87	87.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,132,000.00	6.49
	其中：债券	40,132,000.00	6.49
	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	26,422,283.04	4.27
8	其他各项资产	11,570,747.92	1.87
9	合计	618,488,729.83	100.00

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务，本基金报告期末未投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	317,222,691.02	52.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	33,931.72	0.01
F	批发和零售业	44,554,630.35	7.33
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,051,694.00	0.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,393,376.02	1.71
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	31,746,980.24	5.22
N	水利、环境和公共设施管理业	44,553.97	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,918,333.00	0.48
Q	卫生和社会工作	50,391,217.92	8.29
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	460,416,440.01	75.71

7.2.2 报告期末按行业分类的港股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（%）
------	-----------	--------------

必需性消费(HS)	1,625,052.24	0.27
非必需性消费(HS)	23,865,858.35	3.92
工业(HS)	5,265,668.51	0.87
医疗保健业(HS)	43,602,430.48	7.17
资讯科技业(HS)	5,588,249.28	0.92
合计	79,947,258.86	13.15

注：采用与香港交易所一致的行业分类标准。

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	000538	云南白药	327,495	37,897,721.40	6.23
2	300347	泰格医药	184,400	35,644,520.00	5.86
3	688029	南微医学	113,068	35,242,164.92	5.80
4	603259	药明康德	182,300	28,546,357.00	4.69
5	603233	大参林	481,795	24,624,542.45	4.05
6	600196	复星医药	276,565	19,948,633.45	3.28
7	000513	丽珠集团	308,273	15,419,815.46	2.54
8	600276	恒瑞医药	172,974	11,757,042.78	1.93
9	600887	伊利股份	316,400	11,653,012.00	1.92
10	00853	微创医疗(一百)	195,000	11,301,102.54	1.86
11	300171	东富龙	269,300	10,947,045.00	1.80
12	300003	乐普医疗	331,067	10,633,872.04	1.75
13	601607	上海医药	476,600	10,070,558.00	1.66
14	600976	健民集团	168,100	9,749,800.00	1.60
15	300142	沃森生物	158,000	9,748,600.00	1.60
16	300558	贝达药业	88,100	9,535,944.00	1.57
17	600570	恒生电子	101,799	9,492,756.75	1.56
18	01521	方达控股	1,344,000	9,226,103.04	1.52
19	002390	信邦制药	864,100	9,055,768.00	1.49
20	01999	敏华控股	574,800	8,924,697.04	1.47
21	00570	中国中药	1,894,000	8,384,104.65	1.38
22	02020	安踏体育	50,000	7,605,211.20	1.25
23	02331	李宁	93,000	7,335,950.11	1.21
24	688266	泽璟制药	100,924	7,136,336.04	1.17
25	600380	健康元	499,700	6,860,881.00	1.13
26	688005	容百科技	56,498	6,847,557.60	1.13
27	000858	五粮液	22,929	6,830,319.81	1.12
28	002594	比亚迪	26,100	6,551,100.00	1.08
29	603882	金域医学	39,200	6,262,984.00	1.03
30	300122	智飞生物	31,900	5,956,687.00	0.98
31	688520	神州细胞	116,691	5,796,041.97	0.95

32	603899	晨光文具	68,000	5,750,080.00	0.95
33	603369	今世缘	105,600	5,719,296.00	0.94
34	300294	博雅生物	156,100	5,643,015.00	0.93
35	00700	腾讯控股	11,500	5,588,249.28	0.92
36	300015	爱尔眼科	78,054	5,540,272.92	0.91
37	300973	立高食品	34,760	5,373,655.60	0.88
38	01108	洛阳玻璃股份	618,000	5,265,668.51	0.87
39	01093	石药集团	528,643	4,944,175.53	0.81
40	300049	福瑞股份	402,600	4,750,680.00	0.78
41	003016	欣贺股份	294,500	4,714,945.00	0.78
42	603020	爱普股份	246,300	4,598,421.00	0.76
43	688050	爱博医疗	10,613	4,009,379.14	0.66
44	300653	正海生物	49,500	3,875,850.00	0.64
45	601567	三星医疗	171,800	3,659,340.00	0.60
46	06078	海吉亚医疗	41,800	3,547,656.29	0.58
47	01099	国药控股	179,600	3,452,100.22	0.57
48	600460	士兰微	59,200	3,335,920.00	0.55
49	000739	普洛药业	110,200	3,239,880.00	0.53
50	600216	浙江医药	190,800	3,054,708.00	0.50
51	600258	首旅酒店	127,900	3,051,694.00	0.50
52	000596	古井贡酒	12,500	2,993,750.00	0.49
53	600161	天坛生物	86,300	2,955,775.00	0.49
54	002044	美年健康	323,100	2,943,441.00	0.48
55	002304	洋河股份	14,200	2,942,240.00	0.48
56	002607	中公教育	139,700	2,918,333.00	0.48
57	300014	亿纬锂能	27,700	2,878,861.00	0.47
58	688166	博瑞医药	68,341	2,857,337.21	0.47
59	600521	华海药业	136,100	2,841,768.00	0.47
60	002223	鱼跃医疗	65,600	2,501,328.00	0.41
61	688131	皓元医药	6,925	2,397,365.75	0.39
62	01513	丽珠医药	61,400	1,954,181.48	0.32
63	688180	君实生物	22,458	1,823,814.18	0.30
64	00291	华润啤酒	28,000	1,625,052.24	0.27
65	300078	思创医惠	217,379	1,608,604.60	0.26
66	688289	圣湘生物	15,898	1,581,056.10	0.26
67	300363	博腾股份	15,200	1,278,624.00	0.21
68	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.17
69	688088	虹软科技	15,253	850,354.75	0.14
70	688133	泰坦科技	2,527	803,257.49	0.13
71	01548	金斯瑞生物科技	28,000	789,810.34	0.13
72	300896	爱美客	851	671,336.88	0.11
73	600559	老白干酒	20,100	528,630.00	0.09
74	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.07
75	688425	铁建重工	76,222	362,054.50	0.06

76	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.05
77	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.05
78	300482	万孚生物	3,580	231,590.20	0.04
79	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.03
80	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
81	300957	贝泰妮	388	97,760.48	0.02
82	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
83	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.01
84	688636	智明达	918	74,100.96	0.01
85	300979	华利集团	820	73,017.20	0.01
86	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
87	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.01
88	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
89	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
90	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
91	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.01
92	300981	中红医疗	488	45,436.05	0.01
93	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
94	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.01
95	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
96	301015	百洋医药	714	32,091.78	0.01
97	000650	仁和药业	2,900	31,668.00	0.01
98	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
99	300841	康华生物	100	26,880.00	0.00
100	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
101	300982	苏文电能	470	22,917.28	0.00
102	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
103	301016	雷尔伟	447	16,489.58	0.00
104	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
105	300933	中辰股份	1,488	15,587.36	0.00
106	300997	欢乐家	1,079	14,943.16	0.00
107	300986	志特新材	432	14,835.84	0.00
108	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
109	301013	利和兴	504	13,986.51	0.00
110	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
111	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
112	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
113	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
114	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
115	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
116	300987	川网传媒	404	12,082.69	0.00
117	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
118	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
119	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00

120	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
121	300993	玉马遮阳	497	10,079.55	0.00
122	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
123	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
124	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
125	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
126	300948	冠中生态	328	8,999.72	0.00
127	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
128	300985	致远新能	348	8,850.12	0.00
129	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
130	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
131	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
132	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
133	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
134	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
135	300998	宁波方正	303	7,443.24	0.00
136	688319	欧林生物	198	7,407.18	0.00
137	000423	东阿阿胶	200	7,182.00	0.00
138	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
139	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
140	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
141	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
142	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
143	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
144	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
145	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
146	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
147	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
148	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
149	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
150	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
151	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
152	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
153	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
154	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
155	01066	威高股份	212	3,196.39	0.00
156	300298	三诺生物	100	3,132.00	0.00
157	688269	凯立新材	17	2,371.84	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	000651	格力电器	77,682,760.90	8.45
2	600570	恒生电子	56,296,684.37	6.13
3	000538	云南白药	52,113,598.94	5.67
4	000858	五 粮 液	47,792,489.56	5.20
5	000513	丽珠集团	47,484,260.07	5.17
6	000661	长春高新	46,803,742.00	5.09
7	603233	大参林	38,321,748.72	4.17
8	300347	泰格医药	37,526,394.69	4.08
9	688029	南微医学	35,991,435.56	3.92
10	600276	恒瑞医药	35,127,570.27	3.82
11	600887	伊利股份	34,138,783.00	3.71
12	300253	卫宁健康	33,309,829.90	3.62
13	600079	人福医药	32,692,659.95	3.56
14	002727	一心堂	32,078,906.89	3.49
15	600085	同仁堂	30,244,963.09	3.29
16	601899	紫金矿业	29,657,290.84	3.23
17	300122	智飞生物	29,207,315.18	3.18
18	00700	腾讯控股	28,817,152.18	3.14
19	603259	药明康德	27,659,090.82	3.01
20	002007	华兰生物	27,557,175.00	3.00
21	600196	复星医药	27,184,921.51	2.96
22	01999	敏华控股	25,661,580.69	2.79
23	00780	同程艺龙	23,676,859.28	2.58
24	600258	首旅酒店	23,038,223.23	2.51
25	600519	贵州茅台	22,649,102.91	2.46
26	600031	三一重工	21,630,267.00	2.35
27	600380	健康元	21,462,286.42	2.34
28	002572	索菲亚	21,354,999.24	2.32
29	002064	华峰化学	21,050,542.04	2.29
30	300363	博腾股份	20,688,477.00	2.25
31	002044	美年健康	20,489,551.94	2.23
32	600521	华海药业	19,754,619.96	2.15
33	600763	通策医疗	19,220,863.00	2.09

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	000538	云南白药	96,315,655.94	10.48
2	600276	恒瑞医药	88,749,965.70	9.66
3	603233	大参林	83,094,962.61	9.04

4	000651	格力电器	77,706,313.35	8.46
5	600887	伊利股份	65,371,067.13	7.11
6	300760	迈瑞医疗	44,487,618.38	4.84
7	000661	长春高新	44,164,461.69	4.81
8	603882	金域医学	44,133,100.68	4.80
9	600570	恒生电子	43,869,656.57	4.77
10	300253	卫宁健康	43,135,837.40	4.69
11	000858	五粮液	42,579,836.37	4.63
12	002727	一心堂	38,856,002.27	4.23
13	600519	贵州茅台	38,679,476.20	4.21
14	600690	海尔智家	37,547,821.50	4.09
15	600079	人福医药	37,254,070.87	4.05
16	300558	贝达药业	36,770,562.69	4.00
17	600196	复星医药	35,868,024.33	3.90
18	000513	丽珠集团	34,516,557.53	3.76
19	603259	药明康德	33,593,893.08	3.66
20	600085	同仁堂	32,790,899.28	3.57
21	601899	紫金矿业	31,453,414.67	3.42
22	00700	腾讯控股	30,763,950.78	3.35
23	300122	智飞生物	30,460,648.20	3.31
24	002415	海康威视	30,034,160.80	3.27
25	600258	首旅酒店	28,557,044.13	3.11
26	002007	华兰生物	26,902,709.33	2.93
27	002044	美年健康	26,826,230.53	2.92
28	01999	敏华控股	25,825,761.49	2.81
29	300725	药石科技	25,485,173.50	2.77
30	01951	锦欣生殖	24,248,673.97	2.64
31	300482	万孚生物	23,461,452.23	2.55
32	600763	通策医疗	22,858,587.60	2.49
33	600031	三一重工	22,652,571.00	2.46
34	00780	同程艺龙	22,303,191.57	2.43
35	300363	博腾股份	21,627,869.00	2.35
36	688029	南微医学	21,595,628.40	2.35
37	002572	索菲亚	20,422,727.69	2.22
38	00853	微创医疗(一百)	20,303,777.93	2.21
39	002064	华峰化学	20,141,496.00	2.19
40	02313	申洲国际	19,829,028.51	2.16
41	601233	桐昆股份	19,177,173.62	2.09

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

买入股票的成本（成交）总额	2,554,321,332.82
卖出股票的收入（成交）总额	2,926,736,491.97

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	40,132,000.00	6.60
	其中：政策性金融债	40,132,000.00	6.60
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,132,000.00	6.60

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	180212	18 国开 12	400,000	40,132,000.00	6.60

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**

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。

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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

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本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,167,969.09
2	应收证券清算款	5,155,409.13
3	应收股利	123,967.16
4	应收利息	1,203,100.73
5	应收申购款	920,301.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,570,747.92

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

由于计算中四舍五入的原因，本报告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

份额级别	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
中银大健康股票 A	16,166	25,427.63	0.00	0.0000%	411,063,051.46	100.0000%
中银大健康股票 C	1,286	7,042.92	0.00	0.0000%	9,057,191.91	100.0000%
合计	17,452	24,072.90	0.00	0.0000%	420,120,243.37	100.0000%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中银大健康股票 A	841,419.07	0.2047%
	中银大健康股票 C	826.79	0.0091%
	合计	842,245.86	0.2005%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银大健康股票 A	中银大健康股票 C
基金合同生效日（2020 年 5 月 27 日）基金份额总额	1,863,493,495.67	-
本报告期期初基金份额总额	719,726,889.14	3,176,608.24
本报告期基金总申购份额	70,402,837.18	15,747,858.95
减：本报告期基金总赎回份额	379,066,674.86	9,867,275.28
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	411,063,051.46	9,057,191.91

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，基金管理人未发生重大人事变动。

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

本报告期内没有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

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内没有改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	2,557,557,671.13	46.74%	2,407,336.40	47.29%	-
申万宏源	2	2,168,742,004.38	39.63%	1,999,371.52	39.27%	-
国金证券	2	745,836,363.60	13.63%	684,280.10	13.44%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问

题的通知》（证监基金字<1998>29 号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号）有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低选择基金专用交易单元并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

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		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
国泰君安	980,001.80	82.12%	-	-	-	-
申万宏源	213,329.51	17.88%	-	-	-	-
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	中银大健康股票型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2021-01-21
2	中银基金管理有限公司关于新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为旗下部分基金销售机构及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-04
3	中银基金管理有限公司关于新增腾安基金销售（深圳）有限公司为旗下部分基金销售机构及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-05
4	中银基金管理有限公司关于开展电子直销平台费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-17
5	中银大健康股票型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-30
6	中银大健康股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
7	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-22
8	中银基金管理有限公司关于调整电子直销平台中国银行借记卡定期定额申购费率的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-29

9	中银基金管理有限公司关于新增鼎信汇金(北京)投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定期定额投资及转换业务及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-21
10	中银基金管理有限公司关于新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通定期定额投资及转换业务及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-28

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中银大健康股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《中银大健康股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银大健康股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《中银大健康股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内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。

11.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地，供公众查阅。

11.3 查阅方式

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

中银基金管理有限公司
二〇二一年八月三十一日