

# 贝莱德中国新视野混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：贝莱德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
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.....	43
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>50</b>
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.....	50
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
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>55</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金	
基金简称	贝莱德中国新视野混合	
基金主代码	013426	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 7 日	
基金管理人	贝莱德基金管理有限公司	
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	5,758,067,107.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	贝莱德中国新视野混合 A	贝莱德中国新视野混合 C
下属分级基金的交易代码	013426	013427
报告期末下属分级基金的份额总额	4,945,829,164.08 份	812,237,943.01 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格风险控制的基础上，通过使用偏向长期投资的总收益策略，从深入的个股研究出发，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>在股票投资层面，本基金采用主动投资管理策略，精选具有核心竞争优势和长期持续稳定增长模式的上市公司。</p> <p>（1）定性分析，主要考虑以下四个方面因素：1）市场容量；2）行业周期；3）公司；4）人员。</p> <p>（2）定量分析，通过量化指标，考察个股的估值水平、上市公司成长性和盈利水平。</p> <p>（3）港股通标的股票投资策略。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。</p> <p>3、资产支持证券投资策略；</p> <p>4、金融衍生品投资策略；</p> <p>5、存托凭证投资策略；</p> <p>6、融资投资策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+一年期定期存款利率（税后）×25%+经人民币汇率调整的恒生指数收益率×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金或投资港股通标的股票，需承担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		贝莱德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈剑	李申
	联系电话	021- 80225022	021-60637102
	电子邮箱	Compliance_FMC@blackrock.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-002-6655	021-60637111
传真		021 - 80225288	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		张弛	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.blackrock.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国建设银行股份有限公司	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

### § 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(2022年1月1日 - 2022年6月30日)	
	贝莱德中国新视野混合 A	贝莱德中国新视野混合 C
本期已实现收益	-729,691,476.25	-121,719,463.32
本期利润	-419,677,208.12	-71,490,868.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0812	-0.0838
本期加权平均净值利润率	-9.39%	-9.72%
本期基金份额净值增长率	-7.42%	-7.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	-720,639,211.36	-121,013,689.50
期末可供分配基金份额利润	-0.1457	-0.1490
期末基金资产净值	4,517,835,933.94	738,940,972.64
期末基金份额净值	0.9135	0.9098
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-8.65%	-9.02%

注：1、上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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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（为期末余额，不是当期发生数）。

4、表中的“期末”指报告期最后一日，即 2022 年 6 月 30 日；“本期”指 2022 年 1 月 1 日- 2022 年 6 月 30 日。

#### 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

贝莱德中国新视野混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	12.35%	1.14%	6.86%	0.81%	5.49%	0.33%
过去三个月	8.79%	1.51%	4.80%	1.07%	3.99%	0.44%
过去六个月	-7.42%	1.40%	-6.21%	1.09%	-1.21%	0.31%

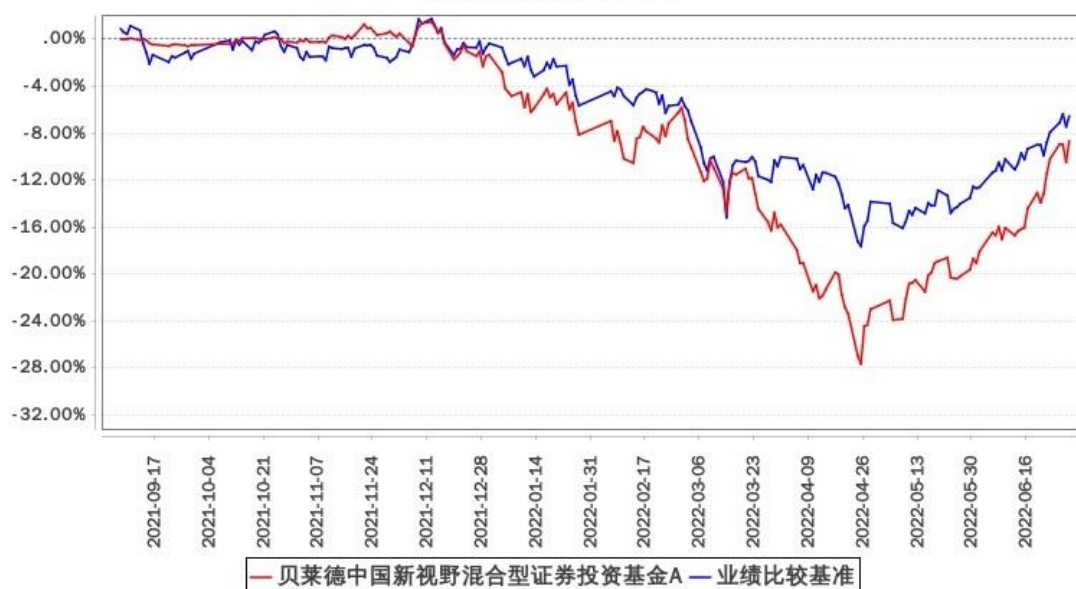
自基金合同生效起至今	-8.65%	1.12%	-6.55%	0.93%	-2.10%	0.19%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

贝莱德中国新视野混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	12.29%	1.14%	6.86%	0.81%	5.43%	0.33%
过去三个月	8.65%	1.51%	4.80%	1.07%	3.85%	0.44%
过去六个月	-7.64%	1.40%	-6.21%	1.09%	-1.43%	0.31%
自基金合同生效起至今	-9.02%	1.12%	-6.55%	0.93%	-2.47%	0.19%

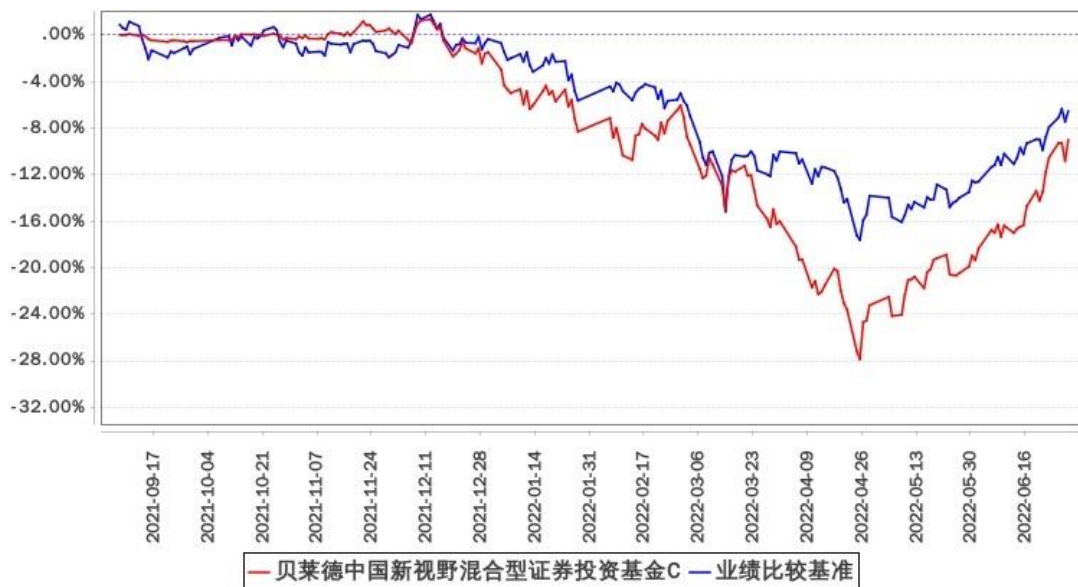
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

贝莱德中国新视野混合型证券投资基金A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





贝莱德中国新视野混合型证券投资基金C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金的基金合同于 2021 年 9 月 7 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。  
 2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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

贝莱德基金管理有限公司成立于 2020 年 9 月 10 日，是国内首家外资全资控股的公募基金管理人。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准设立贝莱德基金管理有限公司的批复》（证监许可[2020]1917 号）批准，由贝莱德金融管理公司（BlackRock Financial Management, Inc.）出资成立。截至报告期末，公司旗下发行并管理了 2 只公开募集证券投资基金：贝莱德中国新视野混合型证券投资基金、贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
唐华	基金经理	2021 年 9 月 7 日	-	17	新加坡南洋理工大学工商管理硕士，特许金融分析师（CFA）。曾担任贝莱德投资管理（上海）有限公司投研董事、英国施罗德集团上海代表处首席代表、中原证券股份有限公司资产管理总部研究总监兼 A 股投资经理、香港鲍尔太平有限公司上海代表处资深研究员、东方证券股份有限公司策略研究员。
单秀丽	基金经理	2021 年 9 月 7 日	-	6	美国里海大学理学硕士学位，金融风险管理师（FRM）资格。曾担任贝莱德投资管理（上海）有限公司投资经理，贝莱德资本管理公司（威明顿，美国）量化风控/收益分析师。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金基金合同的约定，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，本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

## 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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部相关公平交易制度等规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金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 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

今年一季度，市场风格延续了 2021 年下半年以来频繁切换的特征，在稳增长、成长赛道、困境复苏等方向来回切换。从去年年底以来，国内政策稳增长预期强烈导致市场风格偏向价值，成长板块回调明显，尤其是 3 月中旬国务院金融稳定发展委员会专题会议召开之后，A 股市场风格再次发生剧烈变化，明显切换到基建、地产等稳增长主题上，进一步扰动了资金面并导致成长股表现承压。此外，整体权益市场亦受海外宏观因素影响，波动加剧：俄乌事件导致全球投资者风险偏好下降、美联储加息以及鹰派的缩表预期也对国内股市表现带来扰动。

4 月份受各地散发疫情以及疫情管控影响，以长三角地区为中心的各地物流受阻、供应链断裂，制造业、消费全线下行，对我国经济发展带来较大冲击：经济增长压力明显，生产端工业增

加值和服务业生产指数均呈同比下降趋势，消费需求及地产投资同比下降达两位数，社融总量及结构均不佳，各大股指全线下跌，A 股市场表现低迷。

5 月份伴随着政治局会议传递出积极的稳预期信号、美联储 5 月加息落地叠加上海疫情 防控拐点出现，市场对于经济下行的担忧开始缓解。进入 6 月份后，上海全面复工复产加上各项经济扶持政策集中落地，助力经济环比修复，投资者信心得到提振。加息靴子落地后海外因素对 A 股的压力不断减轻，市场流动性边际向好。受益于此，A 股市场自 4 月底开始呈现 V 型走势，迎来了较好的修复性行情。从行业层面来看，汽车、食品饮料、电力设备等涨幅较大，计算机、房地产板块跌幅较大。

本基金于去年三季度发行，今年一季度完成建仓。截止到本报告期末，组合仓位处于中等偏上水平。组合行业布局思路为短期向疫后复苏倾斜，长期坚守成长赛道，从板块来看主要布局于：受益于全球能源格局变革、增长确定性较高的光伏以及电池产业链、受益于国产替代以及持续需求旺盛的半导体、前期受疫情冲击较大有望伴随经济好转而恢复的大消费板块、以及受益于多重超预期政策刺激的汽车及零部件板块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，A 类基金份额净值 0.9135 元，本报告期净值增长率-7.42%，业绩比较基准收益率-6.21%；C 类基金份额净值 0.9098 元，本报告期净值增长率-7.64%，业绩比较基准收益率-6.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从近期公布的宏观数据来看，受制于房地产、疫情、高温等，7 月社融数据低于预期、主要经济数据增速回落，经济仍然具有较大承压。7 月政治局会议再次巩固稳中求进基调，加强政策落实。明确货币、财政政策保持宽松、积极。往后看，我们认为随着疫情管控政策继续常态化，散发疫情对线下活动仍会有些扰动，但对经济影响会逐步回落。此外，我们也会密切关注后续政策能否带动房地产景气度改善，将成为主导年底经济走势的核心因素之一。从海外来看，7 月 FOMC 加息 75 基点后，美联储基准利率上沿已经触及 6 月 FOMC 会议中给出的 2.5% 的中性利率。虽然美国出现连续两个季度环比的负增长进入技术性衰退，但是从近期公布的出口以及就业数据来看，美国经济仍具有一定韧性，抑制通胀仍是美联储当前的第一要务，加息的节奏紧盯通胀水平。我们认为，在当前的持续加息周期下，美国通胀下半年有望下行，因此有可能出现“上半年超预期加息、下半年超预期宽松”的局面。

市场层面，下半年大概率仍将延续目前的震荡状况。在市场流动性较为宽松、经济增长亮点

较少的情况下，A 股较难出现大的市场行情，更多的是一些结构性机会。我们仍持续看好成长赛道，认为其长期成长逻辑不变；服务消费估值相对合理，疫后有望迎来复苏反弹。此外，上游成本有望随着俄乌事件边际消退、全球经济转弱、资金成本上升而下修，因此二季度全年来看可能是基本面的底部，下半年盈利改善可期。

后续 A 股市场随着中报和三季度业绩披露期，个股基本面兑现能力的重要性凸显。我们会根据上市公司业绩动态调整组合持仓，重点关注短期业绩确定性较强、且估值未透支长期发展潜力的行业和个股。此外我们也会谨慎寻找布局二、三季度利空出尽、景气周期拐头向上的机会。我们将持续挖掘新的投资机会以实现组合的保值增值，并力争在此基础上控制好回撤。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本报告期内，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，委托基金服务机构对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金管理人及委托的基金服务机构严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，基金份额净值经基金托管人复核无误后由基金管理人对外披露。

#### **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、本基金基金合同的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### **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**

报告期内，本基金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

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，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：贝莱德中国新视野混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,014,034.34	190,739,953.71
结算备付金		560,851,912.08	513,250,905.06
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,206,129,655.35	4,002,309,919.32
其中：股票投资		4,206,129,655.35	3,968,225,919.32
基金投资		-	-
债券投资		-	34,084,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	525,786,257.81	1,561,815,618.00
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,970,476.52	350,441.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-716,481.49
资产总计		5,298,752,336.10	6,267,750,356.33
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		25,510,853.37	-
应付赎回款		8,927,438.77	9,610,528.32
应付管理人报酬		6,099,039.15	8,202,930.96
应付托管费		1,016,506.53	1,367,155.16
应付销售服务费		286,633.74	398,840.57
应付投资顾问费		-	-
应交税费		24,379.00	137,517.48

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	110,578.96	126,019.19
负债合计		41,975,429.52	19,842,991.68
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	5,758,067,107.09	6,333,774,928.89
未分配利润	6.4.7.8	-501,290,200.51	-85,867,564.24
净资产合计		5,256,776,906.58	6,247,907,364.65
负债和净资产总计		5,298,752,336.10	6,267,750,356.33

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 5,758,067,107.09 份，其中 A 类基金份额净值 0.9135 元，基金份额 4,945,829,164.08 份；C 类基金份额净值 0.9098 元，基金份额 812,237,943.01 份。

## 6.2 利润表

会计主体：贝莱德中国新视野混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-443,934,581.05
1.利息收入		8,308,963.10
其中：存款利息收入	6.4.7.9	801,527.61
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		7,507,435.49
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-813,076,008.61
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-831,870,524.81
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	5,278,636.07
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	13,516,625.67
其他投资收益		-745.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	360,242,863.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	589,601.03
<b>减：二、营业总支出</b>		47,233,495.09



1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	38,788,549.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,464,758.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,829,128.72
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		27,033.21
8. 其他费用	6.4.7.16	124,025.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-491,168,076.14</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-491,168,076.14</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-491,168,076.14</b>

注：本基金基金合同于 2021 年 9 月 7 日生效，无上年度可比期间数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：贝莱德中国新视野混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	6,333,774,928.89	-85,867,564.24	6,247,907,364.65
二、本期期初净资产（基金净值）	6,333,774,928.89	-85,867,564.24	6,247,907,364.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-575,707,821.80	-415,422,636.27	-991,130,458.07
（一）、综合收益总额	-	-491,168,076.14	-491,168,076.14
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-575,707,821.80	75,745,439.87	-499,962,381.93
其中：1. 基金申购款	123,806,714.49	-15,257,044.12	108,549,670.37
2. 基金赎回款	-699,514,536.29	91,002,483.99	-608,512,052.30
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少）	-	-	-

以“-”号填列)			
四、本期期末净资产(基金净值)	5,758,067,107.09	-501,290,200.51	5,256,776,906.58

注：本基金基金合同于 2021 年 9 月 7 日生效，无上年度可比期间数据。

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：

张弛	张鹏军	罗元
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

贝莱德中国新视野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[2021]第 2646 号《关于准予贝莱德中国新视野混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由贝莱德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《贝莱德中国新视野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 6,680,197,191.98 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 0853 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《贝莱德中国新视野混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 9 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,681,345,901.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,148,709.13 份基金份额。本基金的基金管理人为贝莱德基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《贝莱德中国新视野混合型证券投资基金基金合同》和《贝莱德中国新视野混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，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；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额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别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德中国新视野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（包括创业板及其他中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、债券（国债、政府债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、国债期货、股指期货、股票期权、存托凭证、信用衍生品、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具，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）。本基金可根据法律法规和基金合同的约定，参与融资融券业务中的融资业务。本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中，港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的 20%，投资于中国新视野主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×70%+一年期定期存款利率（税后）×25%+经人民币汇率调整的恒生指数收益率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人贝莱德基金管理有限公司于 2022 年 8 月 30 日批准报出。

#### 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》、《贝莱德中国新视野混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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 2022 年上半年度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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和净资产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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下述会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示

为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (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。

### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,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,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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相关交易费用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。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

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。

## 6.4.5 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，金额分别为 190,739,953.71 元、513,250,905.06 元、1,561,815,618.00 元、-716,481.49 元和 350,441.73 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 190,769,207.39 元、513,276,972.51 元、1,561,043,068.33 元、0.00 元和 350,441.73 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 4,002,309,919.32 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 4,002,310,666.37 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 9,610,528.32 元、8,202,930.96 元、1,367,155.16 元、398,840.57 元、6,075.00 元和 19,544.19 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 9,610,528.32 元、8,202,930.96 元、1,367,155.16 元、398,840.57 元、6,075.00 元和 19,544.19 元。



于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪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[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。

对基金通过沪港通/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。基金通过沪港通/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。基金通过沪港通/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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	4,014,034.34
等于：本金	4,012,233.40
加：应计利息	1,800.94
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计：	4,014,034.34

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,907,775,300.77	-	4,206,129,655.35	298,354,354.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,907,775,300.77	-	4,206,129,655.35	298,354,354.58

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	525,786,257.81	-
银行间市场	-	-
合计	525,786,257.81	-

**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从买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,283.92
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,295.04
合计	110,578.96

**6.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

贝莱德中国新视野混合 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,430,613,803.20	5,430,613,803.20
本期申购	88,261,877.77	88,261,877.77
本期赎回（以“-”号填列）	-573,046,516.89	-573,046,516.89
本期末	4,945,829,164.08	4,945,829,164.08

金额单位：人民币元

贝莱德中国新视野混合 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	903,161,125.69	903,161,125.69
本期申购	35,544,836.72	35,544,836.72
本期赎回（以“-”号填列）	-126,468,019.40	-126,468,019.40

本期末	812,237,943.01	812,237,943.01
-----	----------------	----------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

贝莱德中国新视野混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-18,293,612.05	-54,123,978.50	-72,417,590.55
本期利润	-729,691,476.25	310,014,268.13	-419,677,208.12
本期基金份额交易产生的变动数	27,345,876.94	36,755,691.59	64,101,568.53
其中：基金申购款	-4,239,825.98	-6,622,203.80	-10,862,029.78
基金赎回款	31,585,702.92	43,377,895.39	74,963,598.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-720,639,211.36	292,645,981.22	-427,993,230.14

单位：人民币元

贝莱德中国新视野混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,463,335.37	-8,986,638.32	-13,449,973.69
本期利润	-121,719,463.32	50,228,595.30	-71,490,868.02
本期基金份额交易产生的变动数	5,169,109.19	6,474,762.15	11,643,871.34
其中：基金申购款	-1,874,199.89	-2,520,814.45	-4,395,014.34
基金赎回款	7,043,309.08	8,995,576.60	16,038,885.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-121,013,689.50	47,716,719.13	-73,296,970.37

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	74,829.92
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	726,697.69
其他	-
合计	801,527.61

### 6.4.7.10 股票投资收益

#### 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	4,485,774,870.95
减：卖出股票成本总额	5,305,056,997.47
减：交易费用	12,588,398.29
买卖股票差价收入	-831,870,524.81

### 6.4.7.11 债券投资收益

#### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	15,946.88
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	5,262,689.19
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,278,636.07

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	47,953,027.20
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	42,664,000.00
减：应计利息总额	16,747.53
减：交易费用	9,590.48
买卖债券差价收入	5,262,689.19

#### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

### 6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.13 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	13,516,625.67
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	13,516,625.67

**6.4.7.14 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	360,242,863.43
——股票投资	360,242,863.43
——债券投资	-
——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	-
合计	360,242,863.43

**6.4.7.15 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	589,327.21
转换费收入	273.82
合计	589,601.03

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产。

**6.4.7.16 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	49,787.67

信息披露费	59,507.37
律师费	-
账户维护费	13,900.00
持有人大会费用	-
银行费用	830.65
开户费	-
合计	124,025.69

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
贝莱德基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构、注册登记机构

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

本基金本报告期内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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	38,788,549.26



其中：支付销售机构的客户维护费	18,792,995.88
-----------------	---------------

注：支付基金管理人贝莱德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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,464,758.21

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 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		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	贝莱德中国新视野混合 A	贝莱德中国新视野混合 C	合计
中国建设银行	-	405,015.35	405,015.35
合计	-	405,015.35	405,015.35

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50%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：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.50%/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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本基金管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

**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**

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	4,014,034.34	74,829.92

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内无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**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2022 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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

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**

本基金本报告期末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**

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通出借业务的证券。

#### 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

本基金为混合型基金，其预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于依法发行上市的股票、港股通标的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具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立，建立了由董事会、公司管理层、风险管理部门和业务职能部门构成的四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会对风险管理的责任包括制定业务战略和风险管理目标、审阅重大事件和决策的风险评估等；管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，确保有效管理所有重大风险，下设风险管理委员会，根据董事会和管理层的授权开展风险管理工作；风险管理部门负责风险评估、报告、监控和管理，主要职责包括制定公司风险管理制度和程序、实施定量和定性的风险评估等；业务职能部门从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施。在业务操作层面，各部门积极配合风险管理部门完成运作风险管理，其他中后台部门包括但不限于财务、合规稽核和运营等部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种相关风险可能造成的影响。从定性分析的角度触发，判断风险的种类、风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度触发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型和日常风险报告等，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，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

存放在本基金的托管人中国建设银行，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 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的固定收益品种占基金资产净值的比例为 0.00%。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2022 年 6 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。

##### 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上述比例限制)。

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%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。于 2022 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### 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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和债券投资等。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	4,014,034.34	-	-	-	4,014,034.34
结算备付金	560,851,912.08	-	-	-	560,851,912.08
存出保证金					
交易性金融资产	-	-	-	4,206,129,655.35	4,206,129,655.35
买入返售金融资产	525,786,257.81	-	-	-	525,786,257.81
应收清算款	-	-	-	-	-
应收申购款				1,970,476.52	1,970,476.52
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,090,652,204.23	-	-	4,208,100,131.87	5,298,752,336.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,927,438.77	8,927,438.77
应付管理人报酬	-	-	-	6,099,039.15	6,099,039.15
应付托管费	-	-	-	1,016,506.53	1,016,506.53
应付销售服务费	-	-	-	286,633.74	286,633.74
应交税费	-	-	-	24,379.00	24,379.00
应付清算款	-	-	-	25,510,853.37	25,510,853.37
其他负债	-	-	-	110,578.96	110,578.96
负债总计	-	-	-	41,975,429.52	41,975,429.52
利率敏感度缺口	1,090,652,204.23	-	-	4,166,124,702.35	5,256,776,906.58
上年度末 2021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	190,739,953.71	-	-	-	190,739,953.71
结算备付金	513,250,905.06	-	-	-	513,250,905.06
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	34,084,000.00	3,968,225,919.32	4,002,309,919.32
买入返售金融	1,561,815,618.00	-	-	-	1,561,815,618.00

资产					
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-716,481.49	-716,481.49
应收申购款	-	-	-	350,441.73	350,441.73
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,265,806,476.77	-34,084,000.00	3,967,859,879.56	6,267,750,356.33	
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,610,528.32	9,610,528.32
应付管理人报酬	-	-	-	8,202,930.96	8,202,930.96
应付托管费	-	-	-	1,367,155.16	1,367,155.16
应付销售服务费	-	-	-	398,840.57	398,840.57
应交税费	-	-	-	137,517.48	137,517.48
应付交易费用	-	-	-	6,075.00	6,075.00
其他负债	-	-	-	119,944.19	119,944.19
负债总计	-	-	-	19,842,991.68	19,842,991.68
利率敏感度缺口	2,265,806,476.77	-34,084,000.00	3,948,016,887.88	6,247,907,364.65	

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，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 2022 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	208,909,695.76	-	208,909,695.76
应收股利	-	-	-	-

资产合计	-	208,909,695.76	-	208,909,695.76
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	-	208,909,695.76	-	208,909,695.76
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
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	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	所有外币相对人民币升值 5%	10,445,484.79	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-10,445,484.79	-

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在注重严格风险控制的基础上，动态调整资产配置，使风险和预期目标相匹配，并选择符合基金合同约定范围内的投资品种进行投资。同时，本基金充分发挥基金管理人的研究优势，通过对经济发展、社会结构、宏观政策、产业政策和科学技术的跟踪研究，将定性分析和定量模型相结合，根据投资策略或市场环境的变化构建和管理投资组合，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资组合中股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中，港股通标的的



股票最高投资比例不得超过股票资产的 20%，投资于中国新视野主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除国债期货合约和股指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。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，以识别和测算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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	4,206,129,655.35	80.01	3,968,225,919.32	63.51
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	34,084,000.00	0.55
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	4,206,129,655.35	80.01	4,002,309,919.32	64.06

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

**6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具****6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	4,206,129,655.35	3,936,727,695.32
第二层次	-	34,084,000.00
第三层次	-	31,498,224.00
合计	4,206,129,655.35	4,002,309,919.32

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于 2022 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截止资产负债表日，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	4,206,129,655.35	79.38
	其中：股票	4,206,129,655.35	79.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	525,786,257.81	9.92
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	564,865,946.42	10.66
8	其他资产	1,970,476.52	0.04
9	合计	5,298,752,336.10	100.00

注：1、截至本报告期末，本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 208,909,695.76 元，占资产净值比例为 3.97%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

3、本基金本报告期末未持有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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	122,803,307.60	2.34
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,490,140,018.37	66.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	78,988,770.00	1.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,150,253.60	0.99
J	金融业	83,570,904.00	1.59
K	房地产业	143,168,281.02	2.72
L	租赁和商务服务业	26,398,425.00	0.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,997,219,959.59	76.04

### 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（%）
房地产	88,560,782.55	1.68
工业	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
可选消费	95,312,105.66	1.81
能源	-	-
通信服务	-	-
医药卫生	-	-
原材料	-	-
信息技术	25,036,807.55	0.48
主要消费	-	-
合计	208,909,695.76	3.97

注：以上分类采用中证行业分类标准。

## 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688390	固德威	1,252,015	391,893,215.15	7.46
2	688032	禾迈股份	414,519	361,046,049.00	6.87
3	300751	迈为股份	717,063	352,006,226.70	6.70
4	300661	圣邦股份	1,503,240	273,619,744.80	5.21
5	003022	联泓新科	8,040,200	267,175,846.00	5.08
6	600519	贵州茅台	112,401	229,860,045.00	4.37
7	603596	伯特利	2,815,037	225,709,666.66	4.29
8	600460	士兰微	4,274,862	222,292,824.00	4.23
9	300750	宁德时代	300,500	160,467,000.00	3.05
10	600048	保利发展	8,199,787	143,168,281.02	2.72
11	002444	巨星科技	7,458,749	140,522,831.16	2.67
12	300919	中伟股份	1,090,900	135,162,510.00	2.57
13	300896	爱美客	210,900	126,542,109.00	2.41
14	002714	牧原股份	2,221,880	122,803,307.60	2.34
15	03690	美团-W	573,900	95,312,105.66	1.81
16	06098	碧桂园服务	2,963,000	88,560,782.55	1.68
17	605111	新洁能	672,160	84,564,449.60	1.61
18	000568	泸州老窖	342,318	84,395,079.72	1.61
19	601128	常熟银行	10,938,600	83,570,904.00	1.59
20	600009	上海机场	1,393,100	78,988,770.00	1.50
21	300769	德方纳米	178,700	73,031,116.00	1.39
22	300628	亿联网络	765,781	58,314,223.15	1.11
23	600309	万华化学	578,557	56,114,243.43	1.07
24	603290	斯达半导	138,800	53,562,920.00	1.02
25	002410	广联达	957,940	52,150,253.60	0.99
26	600366	宁波韵升	3,956,200	49,848,120.00	0.95
27	300760	迈瑞医疗	142,800	44,724,960.00	0.85
28	300171	东富龙	1,291,400	43,791,374.00	0.83
29	601633	长城汽车	860,800	31,884,032.00	0.61
30	002027	分众传媒	3,922,500	26,398,425.00	0.50
31	02382	舜宇光学科技	228,900	25,036,807.55	0.48
32	000301	东方盛虹	1,396,300	23,611,433.00	0.45

## 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	688390	固德威	389,956,010.63	6.24
2	601012	隆基股份	266,728,883.25	4.27
3	300751	迈为股份	259,622,154.89	4.16
4	003022	联泓新科	256,452,086.80	4.1
5	688032	禾迈股份	247,232,241.58	3.96
6	600745	闻泰科技	230,417,558.80	3.69
7	300661	圣邦股份	196,384,755.19	3.14
8	300750	宁德时代	184,229,584.97	2.95
9	603993	洛阳钼业	179,173,813.42	2.87
10	002142	宁波银行	175,933,395.24	2.82
11	688223	晶科能源	154,793,134.46	2.48
12	300769	德方纳米	144,886,883.47	2.32
13	605111	新洁能	140,420,536.40	2.25
14	601865	福莱特	138,452,466.43	2.22
15	600048	保利发展	138,331,426.39	2.21
16	300919	中伟股份	136,159,490.64	2.18
17	601899	紫金矿业	128,566,135.00	2.06
18	002714	牧原股份	126,475,835.78	2.02
19	603596	伯特利	113,271,254.91	1.81
20	03690	美团-W	94,472,878.82	1.51

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	337,062,904.62	5.39
2	002475	立讯精密	258,359,575.80	4.14
3	600036	招商银行	256,633,746.73	4.11
4	601012	隆基股份	232,457,624.56	3.72

5	603993	洛阳钼业	164,522,788.59	2.63
6	688223	晶科能源	156,451,231.70	2.5
7	002142	宁波银行	153,772,786.20	2.46
8	000568	泸州老窖	149,632,090.37	2.39
9	601899	紫金矿业	142,227,156.78	2.28
10	002444	巨星科技	135,182,054.25	2.16
11	601865	福莱特	132,613,758.02	2.12
12	601966	玲珑轮胎	121,808,212.52	1.95
13	300750	宁德时代	120,575,762.20	1.93
14	600745	闻泰科技	119,713,023.04	1.92
15	688390	固德威	113,086,788.36	1.81
16	300769	德方纳米	104,854,812.69	1.68
17	688208	道通科技	103,861,464.71	1.66
18	002008	大族激光	101,542,490.18	1.63
19	002541	鸿路钢构	101,430,644.16	1.62
20	000725	京东方 A	88,470,532.00	1.42

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,182,717,870.07
卖出股票收入（成交）总额	4,485,774,870.95

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等。

## 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

本基金投资国债期货将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、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

注：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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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未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（元）
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-



4	应收利息	-
5	应收申购款	1,970,476.52
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,970,476.52

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的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
贝莱德中国新视野混合 A	77,965	63,436.53	127,107,520.22	2.57%	4,818,721,643.86	97.43%
贝莱德中国新视野混合 C	17,607	46,131.54	13,829,092.29	1.70%	798,408,850.72	98.30%
合计	95,572	60,248.47	140,936,612.51	2.45%	5,617,130,494.58	97.55%

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	贝莱德中国新视野混合 A	7,180,293.80	0.15%
	贝莱德中国新视野混合 C	1,068,939.10	0.13%
	合计	8,249,232.90	0.14%

注：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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	贝莱德中国新视野混合 A	贝莱德中国新视野混合 C
基金合同生效日（2021年9月7日）基金份额总额	5,635,009,473.43	1,046,336,427.68
本报告期期初基金份额总额	5,430,613,803.20	903,161,125.69
本报告期基金总申购份额	88,261,877.77	35,544,836.72
减：本报告期基金总赎回份额	573,046,516.89	126,468,019.40
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,945,829,164.08	812,237,943.01

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金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

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本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，为本基金进行审计的机构未发生变化，为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
中信证券（山东）有限责任公司	2	9,668,492,741.02	100.00%	7,859,338.93	100.00%	

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发[2019]14号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的 30%”的分仓规定。

3、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

4、本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券（山东）有限责任公司	47,936,279.67	100.00%	82,659,289,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-1-19
2	贝莱德基金管理有限公司关于贝莱德中国新视野混合型证券投资基金增加销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-2-10
3	贝莱德基金管理有限公司关于旗下部分开放式证券投资基金开通基金转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-3-15
4	贝莱德中国新视野混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-3-31
5	贝莱德中国新视野混合型证券投资	中国证监会规定媒介	2022-4-22

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
	基金 2022 年第 1 季度报告		
6	贝莱德基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金参加建设银行费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-6-16

## § 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

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（[www.blackrock.com.cn](http://www.blackrock.com.cn)）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

贝莱德基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日