

中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：中国国际金融股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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
3.3 其他指标	9
§ 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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	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	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
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	中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划	
基金简称	集合-中金进取回报	
基金主代码	920008	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 月 24 日	
基金管理人	中国国际金融股份有限公司	
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	583,811,950.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	集合-中金进取回报 A	集合-中金进取回报 C
下属分级基金的交易代码	920008	920928
报告期末下属分级基金的份额总额	439,015,476.63 份	144,796,474.13 份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券等大类资产中充分挖掘市场轮动机会、利用潜在投资价值，力求实现集合计划资产的持续稳定增值。
投资策略	依靠对大类资产配置和趋势研判的丰富实践与投资能力，结合系统化策略模型体系以及严格的风险预算机制，长期获取优异的绝对回报。大类资产配置层面，主要基于风险平价理念、长期资本市场预期收益和周期性动态资产配置确定资产摆布，在此基础上依赖短期战术配置模型调整权益敞口、债券久期等获取交易收益。大类资产内部，主要挖掘相对市场指数的超额收益。其中，股票资产内部主要通过风格、行业配置模型以及定性和定量相结合的选股策略获取超额收益；债券内部通过对不同类型、期限、评级以及信用个体的研判挖掘超额收益。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为中债新综合全价指数收益率×55%+中证 800 指数收益率×35%+恒生指数收益率×5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后) ×5%
风险收益特征	本集合计划为灵活配置混合型集合资产管理计划，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。

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	中国国际金融股份有限公司	中国建设银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	宋璐芳	李申
	联系电话	010-65051166	021-60637102
	电子邮箱	songlf@cicc.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话	010-65050105	021-60637111	
传真	010-65058035	021-60635778	
注册地址	北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层	北京市西城区金融大街 25 号	
办公地址	北京朝阳区建国门外大街 1 号国贸 3 期 B 座 42 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼	
邮政编码	100004	100033	
法定代表人	沈如军	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.cicc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	集合-中金进取回报 A	集合-中金进取回报 C
本期已实现收益	-64,692,635.72	-13,298,579.68
本期利润	-70,277,145.38	-15,525,641.64
加权平均基金份额本期利润	-0.1422	-0.1338
本期加权平均净值利润率	-10.84%	-10.28%
本期基金份额净值增长率	-4.81%	-8.81%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	118,932,189.69	38,905,902.00
期末可供分配基金份额利润	0.2709	0.2687
期末基金资产净值	557,947,666.32	183,702,376.13
期末基金份额净值	1.2709	1.2687
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-1.66%	-8.81%

注：①所述集合计划业绩指标不包括持有人交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

集合-中金进取回报 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.01%	0.28%	-0.52%	0.30%	-1.49%	-0.02%
过去三个月	-0.24%	0.36%	2.01%	0.34%	-2.25%	0.02%
过去六个月	-4.81%	0.78%	1.48%	0.47%	-6.29%	0.31%
自基金合同生效起至今	-1.66%	0.80%	2.95%	0.46%	-4.61%	0.34%

集合-中金进取回报 C

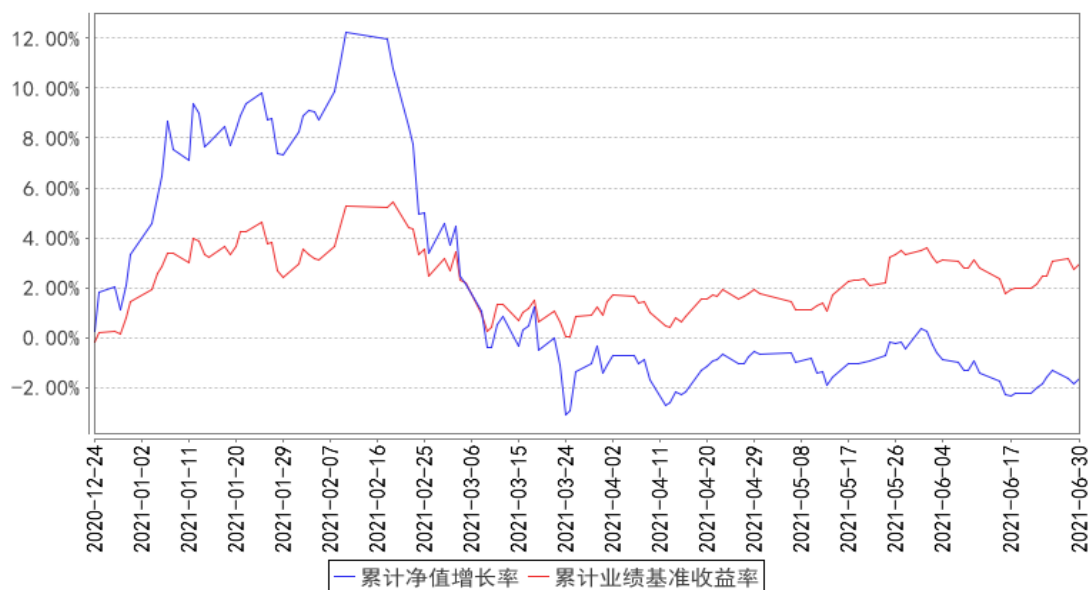
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.04%	0.28%	-0.52%	0.30%	-1.52%	-0.02%
过去三个月	-0.34%	0.36%	2.01%	0.34%	-2.35%	0.02%
自基金合同生效起至今	-8.81%	0.72%	-0.38%	0.46%	-8.43%	0.26%

注：1、本基金基金合同于 2020 年 12 月 24 日生效。截至本报告期末，基金合同生效未满一年；

2、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。

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

集合-中金进取回报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



集合-中金进取回报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：2020年12月24日至2021年1月14日期间，中金进取回报集合计划C类基金份额为零。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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

中国国际金融股份有限公司是中国第一家中外合资投资银行，面向国内外机构及个人客户提供综合化、一站式的全方位投资银行服务，公司成立日期：1995年7月31日，住所为北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层。

中金公司自2002年开始经营资产管理业务，以全方位投资银行平台优势为依托，参照国际行业标准与国内监管要求，致力于打造多资产、多策略、跨市场的综合性资管机构。中金公司资产管理业务牌照齐全、产品丰富。拥有全国社保基金管理人、企业年金投资管理人、职业年金投资管理人、保险资金投资管理人、境内集合/单一资产管理计划、合格境内机构投资者（QDII）集合/单一资产管理、人民币合格境内机构投资者（RQDII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）、合格境外机构投资者（QFII）等多项业务资格，并在香港设立了独立的资产管理子公司，拥有香港Type4证券咨询牌照和Type9资产管理牌照。

中金公司根据《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》的要求，截至2021年6月30日，旗下已有六只大集合产品完成公募化改造，分别为：中金恒瑞债券型集合资产管理计划、中金新锐股票型集合资产管理计划、中金安心回报灵活

配置混合型集合资产管理计划、中金精选股票型集合资产管理计划、中金汇越量化对冲 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划、中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划。

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		
李飞	本基金的基金经理	2020 年 12 月 24 日	-	6 年	李飞：2008 年获华中科技大学经济学学士和文学学士，2010 年获法国北方高等商学院理学硕士，2010 年—2015 年担任国家外汇管理局高级经理，负责全球资产配置工作；2016 年—2017 年担任中邮创业基金 QDII 投资经理，负责港股组合投资管理工作；2017 年—2018 年担任鹏扬基金多资产策略部执行总经理，负责股债混合策略投资管理工作；2018 年 6 月加入中金公司资产管理部，担任执行总经理，负责资产配置和 FOF 业务。
马健	本基金的投资助理	2020 年 12 月 24 日	-	3 年	2013 年获清华大学理学学士学位，2018 年获清华大学数学博士学位，2018 年 7 月加入中金公司资产管理部。

注：1. 基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

2. 非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

3. 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. 本集合计划投资经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通

过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

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。

本报告期内，本公司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未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，本集合权益部分仓位维持在中性水平，债券久期维持在中性偏高水平，在市场波动较大的情况下将风险管理列为优先目标。结合对经济周期、权益和债市配置性价比的研判，密切关注企业盈利持续性，平衡好权益市场的估值和盈利成长性，优选个股；同时，考虑到债券配置价值的吸引力，逐步增加债券配置，提升组合平衡性，提高组合静态收益率。对于权益部分，维持中低仓位，提升股债平衡性，结构上行业和风格保持均衡，耐心等待风险出清后可能的机会。对于债券，将久期加至中性偏高水平，赚取收益率下行带来的资本利得。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.2709 元，份额累计净值为 1.9174 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.2687 元，份额累计净值为 1.2687 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-4.81%，同期业绩基准增长率 1.48%。本基金 C 类基金份额净值增长率为-8.81%，同期业绩基准增长率-0.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年上半年，全球经济在遭遇第二轮疫情冲击的背景下复苏进程不断，主要经济体的经济景气度持续抬升，而在此过程中大宗商品价格不断攀升，主要金属价格持续冲高。

大类资产表现层面，股市呈现出宽幅震荡的状况，而债市冲高后逐步回落走出慢牛行情。1) 股市行情表现一波三折，走势大致可以分为三个阶段：农历新年之前，指数上行，市场延续去年以来的“核心资产”一九分化行情，少数股票带动指数上涨，绝大多数股票下跌。农历新年后到 3 月中旬，指数大幅下跌，“核心资产”快速下跌，带动指数下行超过 15%，成长类股票杀跌幅度较大。3 月中旬至 6 月底，指数震荡过程中逐步修复，周期股、核心资产、题材股轮番表现，代表中小盘的中证 500 指数相对沪深 300 指数有显著超额收益，大小盘风格有所逆转。2) 债市表现是收益率在年初冲高后逐步下行，走出慢牛行情。年初，受“永煤事件”影响，央行加大公开市

场投放力度，流动性极度充裕，利率快速回落。而到了一月末，信用债情绪平复叠加债市杠杆率上升触发政策调整，央行操作明显缩量，资金价格大幅调整，利率迅速反弹。此后，随着资金面平稳宽松，叠加对经济、通胀等利空因素的钝化，在机构欠配的驱动下，债市走出慢牛行情，收益率逐步下行。

近期行业政策频发，经济增长也有趋缓迹象，展望未来，需要从短期和中期两方面做好准备。短期而言，观察政策是否再升级。市场在经历大幅波动后，投资者可能会对后市变得“消极”，政策短期是否再升级还有待观察。中期而言，关注宏观层面的趋势性变化。进入二季度，国内宏观经济动能继续放缓，服务性消费恢复缓慢，基建活动见顶迹象明显，地产受拿地及政策等影响，投资有所下滑；仅出口和制造业仍保持较好的增速；社融需求与 PMI 见顶回落迹象。价格方面，在供给受限情况下仍保持高位震荡。接下来，市场将迎来几个关键的政策窗口，如 7 月政治局会议、8 月公布的 7 月经济数据以及 8 月下旬 Jackson Hole 全球央行年会。

落实到账户操作上，这一阶段仍将风险管理列为优先目标，维持中低仓位，提升股债平衡性，结构上行业和风格保持均衡，耐心等待风险出清后可能的机会。考虑到近期资金存量博弈特征明显，交易拥挤放大了市场的脆弱性，我们在股票头寸上保持较为谨慎的配置，降低了组合整体风险，在行业选择上从前期抱团及周期股头寸上逐步向科技与 500 指数切换，同时在长周期国内宏观经济边际走弱与对货币政策稳中趋松的判断下，我们逐步增加债券配置，提升组合平衡性，等待后续更明确的方向和时机。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定及集合计划合同约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。本基金管理人设立了估值委员会，估值委员会负责决定估值运作的基本原则与工作机制、会计政策、估值办法、特殊情况下的估值决策，定期对估值政策与流程进行评价。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。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

报告期内未进行收益分配。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划

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	48,428,522.75	6,973,852.73
结算备付金		24,197,315.63	706,861.46
存出保证金		2,756,644.36	116,569.16
交易性金融资产	6.4.7.2	543,504,611.44	54,935,833.40
其中：股票投资		180,982,611.44	54,933,392.30
基金投资		-	-
债券投资		362,522,000.00	2,441.10

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	120,000,000.00	15,000,000.00
应收证券清算款		10,009,512.33	-
应收利息	6.4.7.5	3,094,145.42	-2,787.44
应收股利		108,888.00	-
应收申购款		290,611.81	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		752,390,251.74	77,730,329.31
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		7.03	2,447,481.86
应付赎回款		7,370,710.79	-
应付管理人报酬		975,149.50	92,396.45
应付托管费		130,019.95	12,319.51
应付销售服务费		61,370.26	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,143,667.77	347,234.18
应交税费		-	263,495.87
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,059,283.99	952,644.49
负债合计		10,740,209.29	4,115,572.36
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	583,811,950.76	55,139,998.85
未分配利润	6.4.7.10	157,838,091.69	18,474,758.10
所有者权益合计		741,650,042.45	73,614,756.95
负债和所有者权益总计		752,390,251.74	77,730,329.31

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 583,811,950.76 份，其中集合-中金进取回报 A 基金份额总额 439,015,476.63 份，基金份额净值 1.2709 元。集合-中金进取回报 C 基金份额总额 144,796,474.13 份，基金份额净值 1.2687 元。

6.2 利润表

会计主体：中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划

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
一、收入		-72,417,032.09
1. 利息收入		5,622,884.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	610,907.88
债券利息收入		3,992,631.95
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,019,344.94
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-71,283,776.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-73,943,859.49
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	598,924.75
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-492,276.12
股利收益	6.4.7.16	2,553,434.14
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,811,571.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,055,431.48
减：二、费用		13,385,754.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,905,510.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	787,401.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	277,174.41
4. 交易费用	6.4.7.19	6,274,341.51
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		17,814.71
7. 其他费用	6.4.7.20	123,512.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-85,802,787.02
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-85,802,787.02

注：本基金基金合同于 2020 年 12 月 24 日生效。截至本报告期末，基金合同生效未满一年，本报告的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划

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)	55,139,998.85	18,474,758.10	73,614,756.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-85,802,787.02	-85,802,787.02
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)	528,671,951.91	225,166,120.61	753,838,072.52
其中：1. 基金申购款	767,899,213.60	300,361,611.52	1,068,260,825.12
2. 基金赎回款	-239,227,261.69	-75,195,490.91	-314,422,752.60
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)	583,811,950.76	157,838,091.69	741,650,042.45

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：徐翌成 主管会计工作负责人：赵阳光 会计机构负责人：赵阳光

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划由中金配置集合资产管理计划变更而来。中金配置集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2009 年 5 月 19 日经中国证监会证监许可[2009]416 号文核准设立，自 2009 年 7 月 6 日起开始募集，于 2009 年 8 月 12 日结束募集工作，并于 2009 年 8 月 17 日正式成立。根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告

(2018) 39 号) 的规定, 中金配置集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准, 自 2020 年 12 月 24 日起, 《中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效, 原《中金配置集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

本基金存续期自基金合同生效日起, 不得超过 3 年。本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具, 包括股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等)、股指期货、国债期货、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具等, 以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种, 管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。集合计划的投资组合比例为: 股票资产占集合计划资产比例为 15%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%); 每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。同业存单占集合计划资产比例不超过 20%。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制, 管理人在履行适当程序后, 可以调整上述投资品种的投资比例。

本集合计划的业绩比较基准为中债新综合全价指数收益率*55%+中证 800 指数收益率*35%+恒生指数收益率×5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%。

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颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会、中国基金业协会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表按照 6.4.2 所述的编制基础编制, 真实、完整地反映了按该编制基础列报的

本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。本基金目前持有的分类为以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。其他金融资产划分为贷款和应收款项。

(2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。其他金融负债主要包括各类应付款项。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债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。贷款及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。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；贷款和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。

满足以下条件之一的金融资产，予以最终确认：(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；(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。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金

融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额总额所对应的金额。申购、赎回及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日确认。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算确认。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回及红利再投资等事项导致本基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于本基金申购确认日或本基金赎回确认日确认，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额，并扣除适用情况下代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

资产支持证券利息收入按证券票面价值与预期收益率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

公允价值变动净收益/（损失）核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日每万份收益计提红利基金红利收入；其他类型基金于除权日按基金管理公司公布的收益分配方案计算确认。

分红收益按宣告的分红比例计算的金额确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

投资交易时发生的交易费用于交易日确认并作为基金费用计入当期损益。

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

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金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；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金净值不能低于面值即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(5) 由于本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额收取销售服务费，各类份额对应的可供分配利润将有所不同；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(7) 在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，无需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则并参照中国证监会允许的证券投资基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

本基金目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款,主要税项列示如下:

(1) 根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》,2018年1月1日起,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,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税;对资管产品在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分别按照资管产品管理人所在地适用的税率,计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(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,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

(4) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	48,428,522.75
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	48,428,522.75

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	184,485,887.44	180,982,611.44	-3,503,276.00	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	362,939,788.18	362,522,000.00	-417,788.18
	合计	362,939,788.18	362,522,000.00	-417,788.18
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	547,425,675.62	543,504,611.44	-3,921,064.18	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	80,732,350.00	-	-	
其中：国债期货投资	80,732,350.00	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	

权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	80,732,350.00	-	-	-

注：1：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的国债期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
T2109	10 年期国债期货 2109 合约	70.00	68,901,000.00	158,450.00
TF2109	5 年期国债期货 2109 合约	12.00	12,013,800.00	24,000.00
减：可抵销期货暂收款				182,450.00
股指期货投资净额				-

注 2：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	120,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	120,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

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	27,850.31
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	9,574.19
应收债券利息	3,046,125.08
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	10,393.64

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	202.20
合计	3,094,145.42

注：其他为应收保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：无。

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	1,133,267.77
银行间市场应付交易费用	10,400.00
合计	1,143,667.77

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	17,996.34
应付证券出借违约金	-
预提费用	88,643.16
代扣代缴个人所得税	952,644.49
合计	1,059,283.99

注：代扣代缴个人所得税为原中金股票策略集合资产管理计划在以前年度派发股息红利及债券利息时代扣代缴的个人所得税。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

集合-中金进取回报 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	55,139,998.85	55,139,998.85
本期申购	611,273,575.61	611,273,575.61
本期赎回(以“-”号填列)	-227,398,097.83	-227,398,097.83
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-

本期末	439,015,476.63	439,015,476.63
-----	----------------	----------------

集合-中金进取回报 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	156,625,637.99	156,625,637.99
本期赎回(以“-”号填列)	-11,829,163.86	-11,829,163.86
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	144,796,474.13	144,796,474.13

6.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

集合-中金进取回报 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,476,303.12	998,454.98	18,474,758.10
本期利润	-64,692,635.72	-5,584,509.66	-70,277,145.38
本期基金份额 交易产生的变 动数	167,471,646.56	3,262,930.41	170,734,576.97
其中:基金申 购款	238,232,901.11	4,058,791.32	242,291,692.43
基金赎 回款	-70,761,254.55	-795,860.91	-71,557,115.46
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	120,255,313.96	-1,323,124.27	118,932,189.69

集合-中金进取回报 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效 日	-	-	-
本期利润	-13,298,579.68	-2,227,061.96	-15,525,641.64
本期基金份额 交易产生的变 动数	52,538,782.65	1,892,760.99	54,431,543.64
其中:基金申 购款	56,204,094.28	1,865,824.81	58,069,919.09
基金赎 回款	-3,665,311.63	26,936.18	-3,638,375.45

本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,240,202.97	-334,300.97	38,905,902.00

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		419,237.50
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		189,379.13
其他		2,291.25
合计		610,907.88

注：此处其他列示的是存出保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额		1,916,425,644.87
减：卖出股票成本总额		1,990,369,504.36
买卖股票差价收入		-73,943,859.49

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

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		641,999,671.65
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		636,327,100.56
减：应收利息总额		5,073,646.34
买卖债券差价收入		598,924.75

注：卖出债券成交总额中扣除了债券投资收益中增值税的影响。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
国债期货投资收益	1,493,800.00
股指期货投资收益	-1,986,076.12

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,553,434.14
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	2,553,434.14

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-8,131,367.43
股票投资	-7,713,586.89
债券投资	-417,780.54
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	182,450.00
权证投资	-
期货投资	182,450.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-137,345.81
合计	-7,811,571.62

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	1,055,431.48
合计	1,055,431.48

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	6,207,620.83
银行间市场交易费用	16,200.00
其他	50,520.68
合计	6,274,341.51

注：此处其他列示的是期货交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	16,268.91
账户维护费	27,900.00
合计	123,512.07

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或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

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
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人

中国中金财富证券有限公司（“中金财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构
----------------------	------------------

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中金公司	4,040,695,312.03	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
中金公司	2,476.11	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
中金公司	10,511,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
-------	----------------------------

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	3,779,233.19	100.00	1,133,267.77	100.00

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,905,510.80
其中：支付销售机构的客户维护费	2,088,098.72

注：支付基金管理人中金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日计提并按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

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
当期发生的基金应支付的托管费	787,401.43

注：支付托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日计提并按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.2%/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		
	集合-中金进取回报 A	集合-中金进取回报 C	合计
中金财富	-	240,247.74	240,247.74
中金公司	-	35,842.73	35,842.73
合计	-	276,090.47	276,090.47

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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**

注：无

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	48,428,522.75	419,237.50

注：本基金的银行存款由托管行中国建设银行保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

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

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

注：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本基金管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了由风险管理部、内部审计部、法律合规部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理部、内部审计部、法律合规部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。此外，业务部门也建立了自身的内部控制机制，主要由授权体系和业务后台部门信息监控机制组成。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放于中国银行，该行为本基金的基金托管人，与该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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地

调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。流动性风险一般存在两种形式：资产变现风险和现金流风险。

(1) 资产变现风险

资产变现风险是指由于基金持有的某个券种的头寸相对于市场正常的交易量过大，或由于停牌造成交易无法在当前的市场价格下成交。本基金管理人应用定量方法对各持仓品种的变现能力进行测算和分析，以对资产变现风险进行管理。

(2) 现金流风险

现金流风险是指基金因现金流不足导致无法应对正常基金支付义务的风险。本基金管理人对基金每日和每周净赎回比例进行测算和分析，以对该风险进行跟踪和管理。此外，本基金管理人建立了现金头寸控制机制，以确保赎回款项的及时支付。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申购、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金

投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等，受市场利率变动影响较小。

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	48,428,522.75	-	-	-	48,428,522.75
结算备付金	24,197,315.63	-	-	-	24,197,315.63
存出保证金	2,756,644.36	-	-	-	2,756,644.36
交易性金融资产	-	-	362,522,000.00	180,982,611.44	543,504,611.44
买入返售金融资产	120,000,000.00	-	-	-	120,000,000.00
应收利息	-	-	-	3,094,145.42	3,094,145.42
应收股利	-	-	-	108,888.00	108,888.00
应收申购款	-	-	-	290,611.81	290,611.81
应收证券清算款	-	-	-	10,009,512.33	10,009,512.33
资产总计	195,382,482.74	-	362,522,000.00	194,485,769.00	752,390,251.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,370,710.79	7,370,710.79
应付管理人报酬	-	-	-	975,149.50	975,149.50
应付托管费	-	-	-	130,019.95	130,019.95
应付证券清算款	-	-	-	7.03	7.03
应付销售服务费	-	-	-	61,370.26	61,370.26
应付交易费用	-	-	-	1,143,667.77	1,143,667.77
其他负债	-	-	-	1,059,283.99	1,059,283.99
负债总计	-	-	-	10,740,209.29	10,740,209.29
利率敏感度缺口	195,382,482.74	-	362,522,000.00	183,745,559.71	741,650,042.45
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	6,973,852.73	-	-	-	6,973,852.73
结算备付金	706,861.46	-	-	-	706,861.46
存出保证金	116,569.16	-	-	-	116,569.16
交易性金融资产	2,441.10	-	-	54,933,392.30	54,935,833.40
买入返售金融资产	15,000,000.00	-	-	-	15,000,000.00
应收利息	-	-	-	-2,787.44	-2,787.44
资产总计	22,799,724.45	-	-	54,930,604.86	77,730,329.31
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	92,396.45	92,396.45
应付托管费	-	-	-	12,319.51	12,319.51
应付证券清算款	-	-	-	2,447,481.86	2,447,481.86

应付交易费用	-	-	-	347,234.18	347,234.18
应交税费	-	-	-	263,495.87	263,495.87
其他负债	-	-	-	952,644.49	952,644.49
负债总计	-	-	-	4,115,572.36	4,115,572.36
利率敏感度缺口	22,799,724.45	-	-	-50,815,032.50	73,614,756.95

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	10,930,150.00	-
	市场利率上升 25 个基点	-10,930,150.00	-

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	31,866,721.09	-	31,866,721.09
资产合计	-	31,866,721.09	-	31,866,721.09

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	-	31,866,721.09	-	31,866,721.09
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
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	-		
	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	港币相对人民币升 值 5%	1,593,336.05	-
	港币相对人民币贬 值 5%	-1,593,336.05	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的债券等资产损失的可能性。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人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进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	180,982,611.44	24.40	54,933,392.30	74.62
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	180,982,611.44	24.40	54,933,392.30	74.62

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升5%	9,049,130.57	2,746,669.62
	业绩比较基准下降5%	-9,049,130.57	-2,746,669.62

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

下表按公允价值三个层次列示了以公允价值计量的金融资产于 2021 年 6 月 30 日的账面价值。于 2021 年 6 月 30 日，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中属于第一层次的余额为人民币 180982611.44 元，属于第二层次的余额为人民币 362522000.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 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证券，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，本基金分别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证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 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。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	180,982,611.44	24.05
	其中：股票	180,982,611.44	24.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	362,522,000.00	48.18
	其中：债券	362,522,000.00	48.18
	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	120,000,000.00	15.95
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	72,625,838.38	9.65
8	其他各项资产	16,259,801.92	2.16
9	合计	752,390,251.74	100.00

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	1,005,348.00	0.14
B	采矿业	13,700,313.00	1.85
C	制造业	99,527,159.77	13.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,465,036.00	0.47
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,205,622.50	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	933,380.80	0.13
J	金融业	16,317,439.28	2.20
K	房地产业	3,803,652.00	0.51
L	租赁和商务服务业	1,339,043.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	1,628,536.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	3,190,360.00	0.43
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	149,115,890.35	20.11

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（%）
原材料	-	-
周期性消费品	8,081,826.62	1.09
非周期性消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
房地产	14,795,102.15	1.99
医疗	-	-
工业	-	-

信息科技	-	-
电信服务	8,989,792.32	1.21
公用事业	-	-
合计	31,866,721.09	4.30

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	002415	海康威视	246,048	15,870,096.00	2.14
2	600150	中国船舶	663,689	10,957,505.39	1.48
3	00700	腾讯控股	18,500	8,989,792.32	1.21
4	03319	雅生活服务	266,500	8,570,611.22	1.16
5	000039	中集集团	417,840	7,596,331.20	1.02
6	002460	赣锋锂业	54,600	6,611,514.00	0.89
7	300737	科顺股份	203,900	6,410,616.00	0.86
8	01995	旭辉永升服务	388,000	6,224,490.93	0.84
9	603801	志邦家居	188,886	6,036,796.56	0.81
10	603605	珀莱雅	30,212	5,943,002.52	0.80
11	603899	晨光文具	67,900	5,741,624.00	0.77
12	002271	东方雨虹	100,300	5,548,596.00	0.75
13	600985	淮北矿业	454,100	5,544,561.00	0.75
14	601225	陕西煤业	452,500	5,362,125.00	0.72
15	600036	招商银行	94,200	5,104,698.00	0.69
16	00291	华润啤酒	80,000	4,643,006.40	0.63
17	000001	平安银行	196,900	4,453,878.00	0.60
18	001914	招商积余	221,400	3,803,652.00	0.51
19	002557	洽洽食品	85,872	3,701,083.20	0.50
20	300750	宁德时代	6,800	3,636,640.00	0.49
21	601158	重庆水务	663,800	3,465,036.00	0.47
22	002311	海大集团	42,400	3,459,840.00	0.47
23	06969	思摩尔国际	96,000	3,438,820.22	0.46
24	601658	邮储银行	662,492	3,325,709.84	0.45
25	000661	长春高新	7,900	3,057,300.00	0.41
26	601899	紫金矿业	288,300	2,793,627.00	0.38
27	603707	健友股份	64,900	2,709,575.00	0.37
28	000902	新洋丰	155,100	2,424,213.00	0.33
29	601636	旗滨集团	128,000	2,375,680.00	0.32
30	002034	旺能环境	128,300	2,046,385.00	0.28
31	601166	兴业银行	92,269	1,896,127.95	0.26
32	300783	三只松鼠	36,800	1,742,848.00	0.23
33	300577	开润股份	78,402	1,680,154.86	0.23

34	300308	中际旭创	43,400	1,671,768.00	0.23
35	000568	泸州老窖	7,036	1,660,073.84	0.22
36	603259	药明康德	10,400	1,628,536.00	0.22
37	601398	工商银行	297,297	1,537,025.49	0.21
38	300502	新易盛	46,712	1,459,750.00	0.20
39	002027	分众传媒	142,300	1,339,043.00	0.18
40	603939	益丰药房	22,330	1,252,489.70	0.17
41	603233	大参林	23,680	1,210,284.80	0.16
42	600323	瀚蓝环境	52,500	1,143,975.00	0.15
43	002299	圣农发展	42,100	1,005,348.00	0.14
44	300628	亿联网络	11,369	952,722.20	0.13
45	603881	数据港	25,784	933,380.80	0.13
46	300124	汇川技术	300	22,278.00	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	002415	海康威视	60,791,207.92	82.58
2	600176	中国巨石	51,226,084.36	69.59
3	600519	贵州茅台	46,758,942.90	63.52
4	000568	泸州老窖	43,029,179.07	58.45
5	000858	五粮液	39,729,093.40	53.97
6	601899	紫金矿业	39,255,271.02	53.33
7	002271	东方雨虹	38,891,423.52	52.83
8	601601	中国太保	38,368,383.84	52.12
9	601318	中国平安	35,334,557.05	48
10	600309	万华化学	34,543,237.37	46.92
11	600036	招商银行	34,197,076.98	46.45
12	603899	晨光文具	32,964,574.54	44.78
13	000001	平安银行	32,818,882.19	44.58
14	002460	赣锋锂业	32,574,305.34	44.25
15	603259	药明康德	32,002,666.40	43.47
16	601658	邮储银行	31,464,293.38	42.74
17	600346	恒力石化	31,030,010.28	42.15
18	300083	创世纪	30,039,157.85	40.81
19	002078	太阳纸业	29,804,985.51	40.49
20	601233	桐昆股份	29,510,050.73	40.09
21	600426	华鲁恒升	29,151,620.26	39.6
22	601636	旗滨集团	28,642,059.65	38.91
23	600150	中国船舶	27,360,109.04	37.17
24	300750	宁德时代	27,294,176.00	37.08

25	600486	扬农化工	26,618,503.69	36.16
26	601012	隆基股份	25,605,708.18	34.78
27	300737	科顺股份	25,286,201.00	34.35
28	00700	腾讯控股	24,930,619.20	33.87
29	002812	恩捷股份	22,862,602.94	31.06
30	000902	新洋丰	22,399,875.56	30.43
31	300124	汇川技术	22,268,842.75	30.25
32	002367	康力电梯	22,215,976.09	30.18
33	002027	分众传媒	21,154,689.60	28.74
34	00291	华润啤酒	20,929,295.35	28.43
35	000488	晨鸣纸业	19,848,755.50	26.96
36	002318	久立特材	19,710,068.80	26.77
37	000100	TCL 科技	18,294,063.00	24.85
38	002299	圣农发展	17,300,048.76	23.5
39	600031	三一重工	17,104,293.19	23.23
40	000725	京东方 A	16,522,414.00	22.44
41	601166	兴业银行	16,468,432.00	22.37
42	000039	中集集团	16,416,937.00	22.3
43	002677	浙江美大	16,163,519.44	21.96
44	002475	立讯精密	16,090,572.20	21.86
45	03319	雅生活服务	16,064,195.77	21.82
46	300274	阳光电源	16,048,716.00	21.8
47	002557	洽洽食品	15,480,514.75	21.03
48	002353	杰瑞股份	15,072,792.83	20.48
49	000636	风华高科	14,970,077.00	20.34
50	00005	汇丰控股	14,876,451.75	20.21
51	603218	日月股份	14,314,020.04	19.44
52	300408	三环集团	14,085,856.27	19.13
53	688680	海优新材	13,906,119.64	18.89
54	002884	凌霄泵业	13,489,686.48	18.32
55	000789	万年青	13,447,311.14	18.27
56	02269	药明生物	13,305,641.58	18.07
57	300347	泰格医药	13,194,041.96	17.92
58	688188	柏楚电子	12,911,559.91	17.54
59	300724	捷佳伟创	12,896,032.77	17.52
60	300136	信维通信	12,539,749.60	17.03
61	603801	志邦家居	12,274,860.92	16.67
62	06969	思摩尔国际	11,934,794.42	16.21
63	600585	海螺水泥	11,596,237.00	15.75
64	002236	大华股份	11,482,494.88	15.6
65	000596	古井贡酒	11,300,972.00	15.35
66	600887	伊利股份	11,088,532.88	15.06

67	000651	格力电器	11,050,641.00	15.01
68	600522	中天科技	10,436,806.00	14.18
69	601398	工商银行	10,223,939.62	13.89
70	300059	东方财富	9,934,916.65	13.5
71	600985	淮北矿业	9,811,472.16	13.33
72	000830	鲁西化工	9,680,697.00	13.15
73	01995	旭辉永升服务	9,448,186.80	12.83
74	002601	龙佰集团	9,294,035.00	12.63
75	600315	上海家化	8,710,459.37	11.83
76	002847	盐津铺子	8,549,471.00	11.61
77	001914	招商积余	8,463,567.00	11.5
78	603605	珀莱雅	8,435,039.16	11.46
79	603806	福斯特	8,398,042.19	11.41
80	002918	蒙娜丽莎	8,305,419.75	11.28
81	600276	恒瑞医药	8,196,932.40	11.13
82	603378	亚士创能	8,014,921.00	10.89
83	600141	兴发集团	8,012,809.00	10.88
84	300628	亿联网络	7,908,890.91	10.74
85	002025	航天电器	7,688,364.80	10.44
86	300747	锐科激光	7,632,703.34	10.37
87	601225	陕西煤业	7,488,902.00	10.17
88	601882	海天精工	7,472,079.00	10.15
89	600754	锦江酒店	7,305,355.51	9.92
90	300015	爱尔眼科	7,261,552.08	9.86
91	000157	中联重科	7,245,184.28	9.84
92	600497	驰宏锌锗	6,996,877.80	9.5
93	600438	通威股份	6,899,066.00	9.37
94	601857	中国石油	6,742,757.00	9.16
95	000661	长春高新	6,675,976.99	9.07
96	603737	三棵树	6,646,019.00	9.03
97	03690	美团-W	6,616,832.71	8.99
98	002311	海大集团	6,565,947.00	8.92
99	600132	重庆啤酒	6,522,145.61	8.86
100	002697	红旗连锁	6,509,155.04	8.84
101	601966	玲珑轮胎	6,477,706.38	8.8
102	300577	开润股份	6,314,853.71	8.58
103	601818	光大银行	6,123,213.00	8.32
104	000860	顺鑫农业	6,108,653.00	8.3
105	600741	华域汽车	6,068,428.00	8.24
106	300558	贝达药业	6,056,428.15	8.23
107	300725	药石科技	5,991,509.94	8.14
108	601158	重庆水务	5,909,192.00	8.03

109	601989	中国重工	5,718,548.00	7.77
110	000708	中信特钢	5,673,509.00	7.71
111	300122	智飞生物	5,664,107.80	7.69
112	600685	中船防务	5,485,627.00	7.45
113	600563	法拉电子	5,132,671.00	6.97
114	603707	健友股份	5,122,881.60	6.96
115	600372	中航电子	5,004,560.99	6.8
116	601100	恒立液压	4,710,687.00	6.4
117	002003	伟星股份	4,627,201.00	6.29
118	003012	东鹏控股	4,430,350.00	6.02
119	000333	美的集团	3,976,953.78	5.4
120	002106	莱宝高科	3,932,368.00	5.34
121	300783	三只松鼠	3,896,463.64	5.29
122	002340	格林美	3,849,938.00	5.23
123	002043	兔宝宝	3,780,009.52	5.13
124	002385	大北农	3,756,000.00	5.1
125	002709	天赐材料	3,725,096.00	5.06
126	603208	江山欧派	3,664,522.20	4.98
127	002034	旺能环境	3,638,567.11	4.94
128	002139	拓邦股份	3,566,776.39	4.85
129	002430	杭氧股份	3,459,708.34	4.7
130	300308	中际旭创	3,448,911.00	4.69
131	600872	中炬高新	3,383,474.00	4.6
132	002821	凯莱英	3,273,842.00	4.45
133	000703	恒逸石化	3,256,475.00	4.42
134	000069	华侨城A	3,225,409.47	4.38
135	02039	中集集团	3,120,404.95	4.24
136	600030	中信证券	3,104,296.00	4.22
137	002064	华峰化学	3,096,543.00	4.21
138	603233	大参林	3,078,033.00	4.18
139	600963	岳阳林纸	3,060,000.00	4.16
140	603939	益丰药房	3,025,813.00	4.11
141	002597	金禾实业	3,002,042.00	4.08
142	002182	云海金属	2,920,481.00	3.97
143	300502	新易盛	2,877,878.06	3.91
144	601928	凤凰传媒	2,737,189.00	3.72
145	601098	中南传媒	2,704,901.00	3.67
146	002241	歌尔股份	2,689,410.00	3.65
147	06049	保利物业	2,644,145.37	3.59
148	06098	碧桂园服务	2,632,156.90	3.58
149	002938	鹏鼎控股	2,617,401.00	3.56
150	002001	新和成	2,455,731.00	3.34

151	300420	五洋停车	2,450,879.00	3.33
152	002588	史丹利	2,422,382.94	3.29
153	000783	长江证券	2,418,755.00	3.29
154	603708	家家悦	2,337,719.00	3.18
155	01308	海丰国际	2,202,575.13	2.99
156	603298	杭叉集团	2,184,013.40	2.97
157	600028	中国石化	2,183,741.00	2.97
158	603915	国茂股份	2,177,185.00	2.96
159	603606	东方电缆	2,092,696.05	2.84
160	300829	金丹科技	1,999,697.00	2.72
161	601021	春秋航空	1,983,549.00	2.69
162	600323	瀚蓝环境	1,925,860.00	2.62
163	688179	阿拉丁	1,747,519.34	2.37
164	603290	斯达半导	1,702,284.00	2.31
165	603881	数据港	1,647,575.56	2.24
166	002568	百润股份	1,644,956.00	2.23
167	688017	绿的谐波	1,621,605.00	2.2
168	01398	工商银行	1,584,696.04	2.15
169	603799	华友钴业	1,573,828.00	2.14
170	002409	雅克科技	1,560,042.00	2.12
171	603489	八方股份	1,507,432.00	2.05

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	600176	中国巨石	44,961,435.59	61.08
2	600519	贵州茅台	43,711,353.87	59.38
3	002415	海康威视	43,156,986.00	58.63
4	000568	泸州老窖	41,820,422.32	56.81
5	000858	五粮液	39,251,334.05	53.32
6	601601	中国太保	39,215,191.98	53.27
7	601899	紫金矿业	37,788,042.33	51.33
8	601318	中国平安	35,875,478.55	48.73
9	002271	东方雨虹	35,229,721.54	47.86
10	600309	万华化学	33,984,278.96	46.17
11	300083	创世纪	32,201,832.98	43.74
12	603259	药明康德	31,295,500.45	42.51
13	600036	招商银行	30,510,009.83	41.45
14	601658	邮储银行	28,325,682.00	38.48
15	000001	平安银行	28,224,688.80	38.34
16	002078	太阳纸业	28,018,910.88	38.06

17	601636	旗滨集团	27,751,474.16	37.70
18	601233	桐昆股份	27,328,564.20	37.12
19	600346	恒力石化	27,094,935.54	36.81
20	002460	赣锋锂业	27,074,730.40	36.78
21	300750	宁德时代	26,796,230.90	36.40
22	600426	华鲁恒升	26,531,701.03	36.04
23	002812	恩捷股份	25,413,587.00	34.52
24	601012	隆基股份	24,254,118.98	32.95
25	000488	晨鸣纸业	23,736,626.28	32.24
26	603899	晨光文具	23,508,504.00	31.93
27	600486	扬农化工	22,736,335.64	30.89
28	300124	汇川技术	21,534,902.24	29.25
29	002367	康力电梯	21,117,379.51	28.69
30	300737	科顺股份	20,212,045.94	27.46
31	600031	三一重工	19,338,791.50	26.27
32	002027	分众传媒	19,070,227.00	25.91
33	000902	新洋丰	18,810,156.00	25.55
34	002318	久立特材	18,067,250.86	24.54
35	000100	TCL 科技	17,186,063.00	23.35
36	002677	浙江美大	16,576,060.44	22.52
37	601166	兴业银行	16,130,422.00	21.91
38	000725	京东方 A	16,017,751.00	21.76
39	600150	中国船舶	15,575,391.84	21.16
40	002299	圣农发展	15,422,660.91	20.95
41	00700	腾讯控股	14,887,130.31	20.22
42	00291	华润啤酒	14,577,484.85	19.80
43	002475	立讯精密	14,343,867.99	19.49
44	000636	风华高科	14,294,130.64	19.42
45	300408	三环集团	14,139,163.00	19.21
46	00005	汇丰控股	14,083,208.18	19.13
47	688680	海优新材	13,195,731.82	17.93
48	300724	捷佳伟创	13,142,834.00	17.85
49	688188	柏楚电子	13,059,570.29	17.74
50	300274	阳光电源	13,023,720.60	17.69
51	02269	药明生物	12,971,995.02	17.62
52	002884	凌霄泵业	12,915,915.31	17.55
53	603218	日月股份	12,552,481.69	17.05
54	002353	杰瑞股份	12,427,025.74	16.88
55	000789	万年青	12,414,342.84	16.86
56	000830	鲁西化工	12,238,974.00	16.63
57	300347	泰格医药	12,061,061.77	16.38
58	000596	古井贡酒	11,145,181.00	15.14

59	000651	格力电器	10,893,342.58	14.80
60	002557	洽洽食品	10,886,891.16	14.79
61	002236	大华股份	10,862,752.50	14.76
62	600585	海螺水泥	10,786,540.00	14.65
63	600522	中天科技	10,519,050.00	14.29
64	300136	信维通信	10,514,254.07	14.28
65	600887	伊利股份	10,390,942.00	14.12
66	000039	中集集团	9,733,987.00	13.22
67	300059	东方财富	9,631,900.01	13.08
68	601398	工商银行	9,007,582.00	12.24
69	600276	恒瑞医药	8,906,847.04	12.10
70	603378	亚士创能	8,525,300.00	11.58
71	603806	福斯特	8,266,260.75	11.23
72	002918	蒙娜丽莎	8,241,459.08	11.20
73	600141	兴发集团	7,970,099.44	10.83
74	600754	锦江酒店	7,797,333.00	10.59
75	300628	亿联网络	7,776,432.00	10.56
76	000157	中联重科	7,754,093.64	10.53
77	002025	航天电器	7,715,603.00	10.48
78	600315	上海家化	7,632,719.00	10.37
79	601882	海天精工	7,629,579.00	10.36
80	002601	龙佰集团	7,610,328.51	10.34
81	03319	雅生活服务	7,388,367.11	10.04
82	300015	爱尔眼科	7,182,769.00	9.76
83	002847	盐津铺子	7,174,397.12	9.75
84	603737	三棵树	7,168,626.26	9.74
85	03690	美团-W	7,047,115.92	9.57
86	600132	重庆啤酒	6,970,601.00	9.47
87	601966	玲珑轮胎	6,968,334.89	9.47
88	300747	锐科激光	6,864,574.00	9.32
89	06969	思摩尔国际	6,459,741.70	8.78
90	601857	中国石油	6,459,103.00	8.77
91	601100	恒立液压	6,415,353.78	8.71
92	300725	药石科技	6,401,310.80	8.70
93	002697	红旗连锁	6,250,506.56	8.49
94	601818	光大银行	6,064,757.00	8.24
95	300122	智飞生物	6,044,096.00	8.21
96	600741	华域汽车	5,999,542.00	8.15
97	600497	驰宏锌锗	5,992,896.00	8.14
98	300558	贝达药业	5,883,382.00	7.99
99	000708	中信特钢	5,684,454.22	7.72
100	601989	中国重工	5,629,523.00	7.65

101	000860	顺鑫农业	5,505,436.00	7.48
102	603801	志邦家居	5,503,651.40	7.48
103	600438	通威股份	5,017,841.00	6.82
104	600685	中船防务	4,984,682.00	6.77
105	000333	美的集团	4,799,247.08	6.52
106	600563	法拉电子	4,671,104.73	6.35
107	600985	淮北矿业	4,638,415.00	6.30
108	600372	中航电子	4,534,278.55	6.16
109	002430	杭氧股份	4,524,874.84	6.15
110	002003	伟星股份	4,491,691.00	6.10
111	002821	凯莱英	4,378,848.21	5.95
112	003012	东鹏控股	4,365,955.00	5.93
113	300577	开润股份	4,291,532.22	5.83
114	002311	海大集团	4,190,662.00	5.69
115	000069	华侨城 A	3,818,491.00	5.19
116	002106	莱宝高科	3,815,832.96	5.18
117	002064	华峰化学	3,754,772.00	5.10
118	002043	兔宝宝	3,648,818.00	4.96
119	603208	江山欧派	3,617,778.44	4.91
120	002340	格林美	3,611,126.00	4.91
121	002709	天赐材料	3,563,201.01	4.84
122	001914	招商积余	3,520,782.00	4.78
123	002139	拓邦股份	3,505,961.48	4.76
124	600963	岳阳林纸	3,490,699.00	4.74
125	002385	大北农	3,423,741.00	4.65
126	600872	中炬高新	3,196,088.00	4.34
127	000661	长春高新	3,182,800.24	4.32
128	600030	中信证券	3,140,830.00	4.27
129	000703	恒逸石化	2,955,657.00	4.02
130	603605	珀莱雅	2,936,402.00	3.99
131	603489	八方股份	2,885,168.00	3.92
132	002597	金禾实业	2,870,807.00	3.90
133	601928	凤凰传媒	2,780,552.00	3.78
134	601098	中南传媒	2,771,865.00	3.77
135	002182	云海金属	2,763,841.00	3.75
136	02039	中集集团	2,536,634.55	3.45
137	002938	鹏鼎控股	2,531,812.00	3.44
138	000783	长江证券	2,514,968.00	3.42
139	01995	旭辉永升服务	2,491,662.89	3.38
140	601158	重庆水务	2,424,268.00	3.29
141	01308	海丰国际	2,405,144.81	3.27
142	002241	歌尔股份	2,372,055.22	3.22

143	06098	碧桂园服务	2,371,037.03	3.22
144	603707	健友股份	2,309,864.00	3.14
145	300420	五洋停车	2,306,853.00	3.13
146	002568	百润股份	2,295,280.31	3.12
147	002001	新和成	2,286,444.00	3.11
148	002588	史丹利	2,257,245.00	3.07
149	06049	保利物业	2,224,693.63	3.02
150	601021	春秋航空	2,222,113.00	3.02
151	603915	国茂股份	2,161,289.00	2.94
152	603708	家家悦	2,131,692.00	2.90
153	600028	中国石化	2,108,792.70	2.86
154	603290	斯达半导	2,090,632.00	2.84
155	603187	海容冷链	2,090,610.00	2.84
156	603606	东方电缆	2,037,727.00	2.77
157	603298	杭叉集团	2,016,997.00	2.74
158	601225	陕西煤业	1,991,726.00	2.71
159	603799	华友钴业	1,941,300.00	2.64
160	688179	阿拉丁	1,927,468.97	2.62
161	300783	三只松鼠	1,849,810.00	2.51
162	300829	金丹科技	1,820,911.00	2.47
163	300308	中际旭创	1,687,336.00	2.29
164	300782	卓胜微	1,685,651.00	2.29
165	002409	雅克科技	1,656,730.00	2.25
166	601919	中远海控	1,588,984.00	2.16
167	01398	工商银行	1,573,064.04	2.14
168	600406	国电南瑞	1,493,623.00	2.03

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	2,124,132,310.39
卖出股票收入（成交）总额	1,916,425,644.87

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	190,397,000.00	25.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	172,125,000.00	23.21

	其中：政策性金融债	172,125,000.00	23.21
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	362,522,000.00	48.88

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	210205	21 国开 05	1,700,000	172,125,000.00	23.21
2	210009	21 付息国债 09	1,100,000	109,461,000.00	14.76
3	210005	21 付息国债 05	800,000	80,936,000.00	10.91

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-1,986,076.12
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本集合计划将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

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

本集合计划参与国债期货投资用于管理债券组合的久期、流动性和风险水平，以套期保值为主要目的。本集合计划构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、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，在最大限度保证资产安全的基础上，力求实现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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
T2109	T2109	70	68,901,000.00	158,450.00	-
TF2109	TF2109	12	12,013,800.00	24,000.00	-
公允价值变动总额合计(元)					182,450.00
国债期货投资本期收益(元)					1,493,800.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					182,450.00

7.11.3 本期国债期货投资评价

在长周期国内宏观经济边际走弱与对货币政策稳中趋松的判断下，我们逐步增加债券配置，提升组合平衡性，将组合的久期维持在中性偏高的水平。考虑到现券和期货的相对价值，通过配置国债期货来表达我们的久期观点。

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

本集合投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本集合对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及合同的要求。

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
1	存出保证金	2,756,644.36
2	应收证券清算款	10,009,512.33
3	应收股利	108,888.00
4	应收利息	3,094,145.42
5	应收申购款	290,611.81
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,259,801.92

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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，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（%）
集合-中金进取回报 A	4,729	92,834.74	28,258,651.82	6.44	410,727,857.05	93.56
集合-中金进取回报 C	380	381,043.35	110,608,433.21	76.39	34,188,040.92	23.61
合计	5,109	-	138,867,085.03	23.79	444,915,897.97	76.21

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	集合-中金进取回报 A	4,249.09	0.00
	集合-中金进取回报 C	2,302,515.46	1.59
	合计	2,306,764.55	0.40

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	集合-中金进取回报 A	0
	集合-中金进取回报 C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	集合-中金进取回报 A	0
	集合-中金进取回报 C	50~100
	合计	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	集合-中金进取回报 A	集合-中金进取回报 C
基金合同生效日 （2020 年 12 月 24 日）基金份额总额	55,139,998.85	-
本报告期期初基金份 额总额	55,139,998.85	-
本报告期基金总申购 份额	611,273,575.61	156,625,637.99
减：本报告期基金总 赎回份额	227,398,097.83	11,829,163.86
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	439,015,476.63	144,796,474.13

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

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，公司合规总监陈刚先生由于身体原因无法继续履行合规总监职责。为确保公司合规工作不受影响，根据《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》及《中国国际金融股份有限公司章程》的规定，董事会同意：陈刚先生不再担任合规总监职务，自董事会批准并于证券监督管理机构备案及/或批准（如需）之日（以下简称“生效日”）起生效；由公司首席执行官自生效日起代为履行合规总监职责，直至公司聘任新任合规总监为止。

基金托管人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，无涉及本基金管理人资产管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人资产管理业务及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

本报告期内，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

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	
中金公司	2	4,040,695,312.03	100.00%	3,779,233.19	100.00%	-

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
中金公司	2,476.11	100.00%	10,511,000,000.00	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	中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2021年01月06日
2	中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2021年01月13日
3	中国国际金融股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2021年04月13日

§ 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：无

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

- (一) 关于准予中金配置集合资产管理计划合同变更的回函
- (二) 中金中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 中金中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书
- (四) 中金中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议
- (五) 管理人业务资格批复件、营业执照
- (六) 报告期内披露的各项公告

12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街1号国贸3期B座42层。

12.3 查阅方式

投资者可到管理人办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：800-810-8802（固话用户免费） | （010）6505-0105（直线）

公司网址：www.cicc.com

中国国际金融股份有限公司

2021 年 8 月 28 日