
中融融安灵活配置混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人:中融基金管理有限公司

基金托管人:南京银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 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、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。本中期报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年1月1日起至2020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
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	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	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
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	59
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	59
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	59
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	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61

§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
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.....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
§12 备查文件目录.....	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中融融安灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中融融安混合
基金主代码	001014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年02月17日
基金管理人	中融基金管理有限公司
基金托管人	南京银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	104,557,369.18份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对股票、债券等金融资产的动态灵活配置,合理控制风险并保持组合良好流动性的前提下,实现基金资产的长期稳定增值,力求为投资者获取超额回报。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1. 大类资产配置策略 2. 债券投资策略 3. 股票投资策略 4. 中小企业私募债券投资策略 5. 权证投资策略 6. 资产支持证券的投资策略
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金。

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	中融基金管理有限公司	南京银行股份有限公司
信息披露	姓名	曹健
		王峰

露负责人	联系电话	010-56517129	021-24198808
	电子邮箱	caojian@zrfunds.com.cn	wangf@njcbtn.com
客户服务电话		400-160-6000; 010-5651729 9	95302
传真		010-56517001	025-86776189
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3 202、3203B	江苏省南京市玄武区中山路2 88号
办公地址		北京市朝阳区望京东园四区2 号中航资本大厦17楼	江苏省南京市玄武区中山路2 88号15楼
邮政编码		100102	210008
法定代表人		王瑶	胡升荣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.zrfunds.com.cn/
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中融基金管理有限公司	北京市朝阳区望京东园四区2号中航 资本大厦17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（2020年01月01日- 2020年06月30日）
本期已实现收益	-848,865.22
本期利润	3,143,837.75
加权平均基金份额本期利润	0.0282
本期加权平均净值利润率	2.96%

本期基金份额净值增长率	3.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2020年06月30日）
期末可供分配利润	-11,347,732.29
期末可供分配基金份额利润	-0.1085
期末基金资产净值	105,272,671.89
期末基金份额净值	1.0068
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2020年06月30日）
基金份额累计净值增长率	-0.42%

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

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

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.57%	0.86%	3.72%	0.45%	5.85%	0.41%
过去三个月	13.25%	0.95%	6.67%	0.45%	6.58%	0.50%
过去六个月	3.65%	1.55%	2.64%	0.75%	1.01%	0.80%
过去一年	11.06%	1.20%	7.54%	0.60%	3.52%	0.60%
过去三年	-2.47%	0.90%	15.33%	0.63%	-17.80%	0.27%
自基金合同生效起至今	-0.42%	0.85%	19.36%	0.60%	-19.78%	0.25%

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中融融安灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年02月17日-2020年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为中融基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由中融国际信托有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金11.5亿元人民币。截至2020年6月30日，中融基金管理有限公司共管理55只基金，包括中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金、中融中证银行指数分级证券投资基金、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金、中融中证煤炭指数分级证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融稳健添利债券型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融融裕双利债券型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融融信双盈债券型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融上海清算所银行间1-3年高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融鑫思路灵活

配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金（FOF）、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融策略优选混合型证券投资基金、中融聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒鑫纯债债券型证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融睿祥纯债债券型证券投资基金、中融恒安纯债债券型证券投资基金、中融智选对冲策略3个月定期开放混合型证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金、中融1-5年国开行债券指数证券投资基金、中融盈泽中短债债券型证券投资基金。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯琪	中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金的基	2020-05-07	-	8	冯琪女士，中国国籍，毕业于香港大学经济学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限8年。2012年6月至2016年4月在泰康资产管理（香港）有限公司权益投资部任研究员职位；2016年9月至2017年11月在

	金经理。				溪源资本有限公司投资部任基金经理助理职位。2018年1月加入中融基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理。
解静	本基金的基金经理	2017-02-16	2020-05-07	10	解静女士，中国国籍，毕业于牛津大学计算机专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限10年。2008年2月至2008年9月曾就职于摩根士丹利（伦敦）任技术分析师；2008年9月至2010年4月曾就职于莫尼塔投资发展有限公司任机构销售；2010年4月至2013年2月就职国泰君安证券，任研究所策略分析师。2013年3月加入中融基金管理有限公司，曾任权益投资部基金经理。

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

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

2020年初在公共卫生事件的冲击下，全球流动性进入超级宽松周期。回顾上半年的A股市场，流动性的宽松几乎战胜了一切盈利、政治层面的负面扰动，医药、科技等新经济板块持续强劲，表明在无风险利率下行环境下资金对成长确定性给出的溢价不断提升。虽然临近美国大选，中美问题进一步复杂化，但是国内经济领先于海外市场复苏，企业盈利预期改善等多方面因素支持市场继续向好，理财资金和外资持续流入亦是大势所趋，我们保持对权益市场的积极看法，组合延续均衡配置的思路，在重点配置的消费、医药、互联网、基建新能源等板块中优选个股，淡化择时，陪伴最优秀的公司共同成长。

同时，创新科技企业加速在科创板、创业板上市，我们持续关注新上市企业的投资机会，基金策略坚持积极参与打新。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融融安混合基金份额净值为1.0068元，本报告期内，基金份额净值增长率为3.65%，同期业绩比较基准收益率为2.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，基金认为流动性的宽松仍将持续，同时企业盈利亦将随着经济的复苏而改善，部分龙头公司在疫情之后还有望受益于行业整合带来的集中度提升，中报之后，

我们认为市场的关注重点将转向企业盈利层面，伴随着经济复苏能够兑现盈利及盈利持续性强的企业是基金长期配置的重点。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金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。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。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和基金合同的约定，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。

本基金管理人设立估值委员会，成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 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

本报告期内，南京银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中融融安灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计

算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支、利润分配等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期未进行利润分配。

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

本报告期内，由中融基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中融融安灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中融融安灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	852,224.58	20,568,168.01
结算备付金		1,057,545.11	301,186.53
存出保证金		61,363.71	46,157.27
交易性金融资产	6.4.7.2	104,264,172.54	89,464,043.82
其中：股票投资		98,835,960.54	84,290,834.22
基金投资		-	-
债券投资		5,428,212.00	5,173,209.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		25,424.19	-
应收利息	6.4.7.5	173,339.77	139,927.42

应收股利		-	-
应收申购款		303,315.24	1,365,148.31
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	11,782.48
资产总计		106,737,385.14	111,896,413.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019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		-	15,966,050.07
应付赎回款		987,732.02	202,548.50
应付管理人报酬		68,543.79	42,175.35
应付托管费		21,419.93	13,179.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	327,471.80	165,389.54
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	59,545.71	19,775.37
负债合计		1,464,713.25	16,409,118.62
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.8	104,557,369.18	98,312,479.96
未分配利润	6.4.7.9	715,302.71	-2,825,184.74
所有者权益合计		105,272,671.89	95,487,295.22
负债和所有者权益总计		106,737,385.14	111,896,413.84

报告截止日2020-06-30，基金份额总额104,557,369.18份，份额净值1.0068元。

6.2 利润表

会计主体：中融融安灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年06月30日
一、收入		4,778,940.93	164,213.48
1. 利息收入		131,590.28	3,948.78
其中：存款利息收入	6.4.7.10	27,852.49	2,185.76
债券利息收入		103,737.79	1,707.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	55.51
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		578,765.99	36,871.91
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-155,784.52	31,799.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-30,887.57	-1,148.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	765,438.08	6,220.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	3,992,702.97	123,228.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	75,881.69	164.53
减：二、费用		1,635,103.18	35,632.10
1. 管理人报酬		421,945.06	9,522.68
2. 托管费		131,857.81	1,983.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	1,012,974.27	566.06
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.18	68,326.04	23,559.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,143,837.75	128,581.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,143,837.75	128,581.38

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中融融安灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年06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）	98,312,479.96	-2,825,184.74	95,487,295.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,143,837.75	3,143,837.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值	6,244,889.22	396,649.70	6,641,538.92

变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	42,097,433.57	-1,572,827.59	40,524,605.98
2. 基金赎回款	-35,852,544.35	1,969,477.29	-33,883,067.06
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)	104,557,369.18	715,302.71	105,272,671.89
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,891,463.21	-280,210.77	1,611,252.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	128,581.38	128,581.38
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)	-361,724.20	8,578.51	-353,145.69
其中: 1. 基金申购款	57,871.50	-3,090.97	54,780.53
2. 基金赎回款	-419,595.70	11,669.48	-407,926.22
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	1,529,739.01	-143,050.88	1,386,688.13

(基金净值)			
--------	--	--	--

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：

王瑶

黎峰

李同庆

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中融融安灵活配置混合型证券投资基金是由原中融融安保本混合型证券投资基金(以下简称“中融融安保本基金”)转型而来。中融融安保本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[2015]63号文《关于准予中融融安保本混合型证券投资基金注册的批复》批准,由基金发起人中融融基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融融安保本混合型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2015年2月12日募集成立。本基金的基金管理人为中融融基金管理有限公司,基金托管人为南京银行股份有限公司。

本基金募集期为2015年1月13日至2015年2月10日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,募集资金总额为人民币583,193,767.89元,有效认购户数为4,164户。其中,认购资金在募集期间产生的利息共计人民币162,619.15元,折合基金份额162,619.15份,按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据原《中融融安保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,中融融安保本基金的保本周期为两年。中融融安保本基金第一个保本周期自基金合同生效日(即2015年2月12日)起至两年后的对应日止,如该对应日为非工作日或该公历年不存在该对应日,则顺延至下一个工作日,即2017年2月13日。中融融安保本基金保本周期届满时,在符合保本基金存续条件下,继续存续并转入下一保本周期。因未能符合保本基金存续条件,将按照《中融融安保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非保本的混合型基金,即“中融融安灵活配置混合型证券投资基金”。

根据《中融融安保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及中融融安灵活配置混合型证券投资基金转型后运作相关业务规则的公告》,中融融安保本基金因未能符合保本基金存续条件,自2017年2月17日起转型为中融融安灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),并相应修改基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等。原《中融融安保本混合型证券投资基金基金合同》失效,《中融融安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同日起生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为中融融基金管理有限公司,基金托管人为南京银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中融融安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具（包括国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中小企业私募债券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为0-95%；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；本基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为 $50\% \times$ 上证国债指数收益率 $+50\% \times$ 沪深300指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2020年06月30日的财务状况以及2020年半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、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号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、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。

6、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，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 2020年06月30日
活期存款	852,224.58
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	852,224.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	91,786,848.97	98,835,960.54	7,049,111.57	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	5,468,781.95	5,428,212.00	-40,569.95
	银行间市场	-	-	-

	合计	5,468,781.95	5,428,212.00	-40,569.95
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	97,255,630.92	104,264,172.54	7,008,541.62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	126.13
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	475.90
应收债券利息	172,710.04
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	27.70
合计	173,339.77

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	327,471.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	327,471.80

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	519.67
应付证券出借违约金	-
预提费用	59,026.04
合计	59,545.71

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,312,479.96	98,312,479.96
本期申购	42,097,433.57	42,097,433.57
本期赎回（以“-”号填列）	-35,852,544.35	-35,852,544.35
本期末	104,557,369.18	104,557,369.18

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-10,303,709.42	7,478,524.68	-2,825,184.74
本期利润	-848,865.22	3,992,702.97	3,143,837.75
本期基金份额交易产生的变动数	-195,157.65	591,807.35	396,649.70
其中：基金申购款	-3,822,958.38	2,250,130.79	-1,572,827.59
基金赎回款	3,627,800.73	-1,658,323.44	1,969,477.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,347,732.29	12,063,035.00	715,302.71

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	21,843.96
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	5,623.30
其他	385.23
合计	27,852.49

6.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	380,595,197.37
减：卖出股票成本总额	380,750,981.89
买卖股票差价收入	-155,784.52

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
----	-------------------------------

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-30,887.57
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	-30,887.57

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	6,623,233.91
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,427,839.82
减：应收利息总额	226,281.66
买卖债券差价收入	-30,887.57

6.4.7.13 衍生工具收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	765,438.08
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	765,438.08

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	3,992,702.97
——股票投资	4,032,660.45
——债券投资	-39,957.48
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,992,702.97

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	75,881.69
合计	75,881.69

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	1,012,974.27
银行间市场交易费用	-
合计	1,012,974.27

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	9,944.48
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
帐户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	68,326.04

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

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
南京银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中融基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2020年01月01日至202 0年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至201 9年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	421,945.06	9,522.68
其中：支付销售机构的客户维护费	172,799.81	3,277.62

① 支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×R的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付；

② 基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×R/当年天数；R为本基金的管理费率，2019年10月30日起，本基金的管理费由1.20%年费率降至0.80%年费率。

③ 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目；

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年06月30日

当期发生的基金应支付的托管费	131,857.81	1,983.96
----------------	------------	----------

① 支付基金托管人的基金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；

② 基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/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

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
南京银行股份有限公司	852,224.58	21,843.96	520,899.02	1,973.84

本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
128115	巨星转债	2020-06-24	2020-07-16	新债未上市	100.00	100.00	121	12,100.00	12,100.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601880	大连港	2020-06-22	重大事项	1.72	2020-07-08	1.89	77,400	135,434.36	133,128.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了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。

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	12,100.00	-
未评级	-	-
合计	12,100.00	-

长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管

理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年 06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	852,224.58	-	-	-	852,224.58
结算备付金	1,057,545.11	-	-	-	1,057,545.11
存出保证金	61,363.71	-	-	-	61,363.71

交易性金融资产	5,428,212.00	-	-	98,835,960.54	104,264,172.54
应收证券清算款	-	-	-	25,424.19	25,424.19
应收利息	-	-	-	173,339.77	173,339.77
应收申购款	-	-	-	303,315.24	303,315.24
资产总计	7,399,345.40	-	-	99,338,039.74	106,737,385.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	987,732.02	987,732.02
应付管理人报酬	-	-	-	68,543.79	68,543.79
应付托管费	-	-	-	21,419.93	21,419.93
应付交易费用	-	-	-	327,471.80	327,471.80
其他负债	-	-	-	59,545.71	59,545.71
负债总计	-	-	-	1,464,713.25	1,464,713.25
利率敏感度缺口	7,399,345.40	-	-	97,873,326.49	105,272,671.89
上年度末2019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	20,568,168.01	-	-	-	20,568,168.01
结算备付金	301,186.53	-	-	-	301,186.53
存出保证金	46,157.27	-	-	-	46,157.27
交易性金融资产	5,173,209.60	-	-	84,290,834.22	89,464,043.82
应收利息	-	-	-	139,927.42	139,927.42

应收申购款	-	-	-	1,365,148.31	1,365,148.31
其他资产	-	-	-	11,782.48	11,782.48
资产总计	26,088,721.41	-	-	85,807,692.43	111,896,413.84
负债					
应付证券清算款	-	-	-	15,966,050.07	15,966,050.07
应付赎回款	-	-	-	202,548.50	202,548.50
应付管理人报酬	-	-	-	42,175.35	42,175.35
应付托管费	-	-	-	13,179.79	13,179.79
应付交易费用	-	-	-	165,389.54	165,389.54
其他负债	-	-	-	19,775.37	19,775.37
负债总计	-	-	-	16,409,118.62	16,409,118.62
利率敏感度缺口	26,088,721.41	-	-	69,398,573.81	95,487,295.22

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

利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

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 2020年06月30日		上年度末 2019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	98,835,960.54	93.89	84,290,834.22	88.27
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	5,428,212.00	5.16	5,173,209.60	5.42
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	104,264,172.54	99.04	89,464,043.82	93.69

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；

	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	沪深300指数上升5%	4,654,985.99	2,893,085.87
	沪深300指数下降5%	-4,654,985.99	-2,893,085.87

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 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，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

① 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

② 各层级金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币98,684,464.66元，属于第二层次的余额为人民币5,579,707.88元，无属于第三层次的余额。

③ 公允价值所属层级间的重大变动

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)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃

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。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换。

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	98,835,960.54	92.60
	其中：股票	98,835,960.54	92.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,428,212.00	5.09
	其中：债券	5,428,212.00	5.09
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,909,769.69	1.79
8	其他各项资产	563,442.91	0.53
9	合计	106,737,385.14	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	647,500.00	0.62
B	采矿业	2,656,797.82	2.52

C	制造业	57,652,308.36	54.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,809,179.72	2.67
E	建筑业	1,340,882.40	1.27
F	批发和零售业	3,524,469.08	3.35
G	交通运输、仓储和邮政业	2,937,298.76	2.79
H	住宿和餐饮业	450,457.00	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,735,739.47	12.10
J	金融业	4,898,936.28	4.65
K	房地产业	2,928,071.40	2.78
L	租赁和商务服务业	1,083,374.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	622,440.00	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	784,222.00	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	105,984.00	0.10
Q	卫生和社会工作	1,534,399.00	1.46
R	文化、体育和娱乐业	1,760,178.25	1.67
S	综合	363,723.00	0.35
	合计	98,835,960.54	93.89

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	002555	三七互娱	49,200	2,302,560.00	2.19
2	300014	亿纬锂能	23,741	1,136,006.85	1.08
3	002371	北方华创	6,000	1,025,460.00	0.97
4	600745	闻泰科技	7,900	995,005.00	0.95
5	002129	中环股份	37,900	851,234.00	0.81

6	002821	凯莱英	3,400	826,200.00	0.78
7	002384	东山精密	27,500	823,625.00	0.78
8	600763	通策医疗	4,700	783,819.00	0.74
9	002127	南极电商	35,500	751,535.00	0.71
10	600201	生物股份	26,800	746,112.00	0.71
11	600584	长电科技	23,000	719,210.00	0.68
12	002049	紫光国微	9,500	691,125.00	0.66
13	300383	光环新网	26,400	688,248.00	0.65
14	002439	启明星辰	16,300	685,741.00	0.65
15	300529	健帆生物	9,780	679,710.00	0.65
16	002812	恩捷股份	10,200	671,160.00	0.64
17	300088	长信科技	58,700	657,440.00	0.62
18	300012	华测检测	31,500	622,440.00	0.59
19	600079	人福医药	22,300	607,006.00	0.58
20	002065	东华软件	47,900	599,708.00	0.57
21	600161	天坛生物	13,200	598,356.00	0.57
22	600521	华海药业	17,300	586,989.00	0.56
23	600298	安琪酵母	11,800	583,864.00	0.55
24	002223	鱼跃医疗	16,000	582,400.00	0.55
25	600536	中国软件	7,300	578,160.00	0.55
26	002465	海格通信	44,100	570,654.00	0.54
27	002385	大北农	61,100	556,621.00	0.53
28	601128	常熟银行	74,100	556,491.00	0.53
29	601099	太平洋	173,800	550,946.00	0.52
30	300285	国瓷材料	16,300	546,213.00	0.52
31	002340	格林美	107,400	533,778.00	0.51
32	002075	沙钢股份	42,200	527,500.00	0.50
33	000066	中国长城	39,700	524,040.00	0.50
34	601100	恒立液压	6,500	521,300.00	0.50
35	300168	万达信息	23,000	507,610.00	0.48
36	300315	掌趣科技	68,800	504,304.00	0.48

37	600426	华鲁恒升	28,000	495,040.00	0.47
38	603444	吉比特	900	494,109.00	0.47
39	002273	水晶光电	28,800	493,632.00	0.47
40	603939	益丰药房	5,420	493,220.00	0.47
41	002074	国轩高科	18,200	488,488.00	0.46
42	603517	绝味食品	6,900	488,106.00	0.46
43	600885	宏发股份	12,000	481,440.00	0.46
44	300207	欣旺达	25,300	478,170.00	0.45
45	000988	华工科技	19,300	471,499.00	0.45
46	600699	均胜电子	19,800	471,438.00	0.45
47	600143	金发科技	35,500	467,535.00	0.44
48	600845	宝信软件	7,900	466,732.00	0.44
49	000513	丽珠集团	9,400	451,294.00	0.43
50	002373	千方科技	18,400	441,416.00	0.42
51	002414	高德红外	14,930	437,150.40	0.42
52	002180	纳思达	13,000	427,830.00	0.41
53	002131	利欧股份	108,200	417,652.00	0.40
54	000750	国海证券	96,200	417,508.00	0.40
55	000636	风华高科	14,300	417,417.00	0.40
56	300418	昆仑万维	16,700	416,832.00	0.40
57	603882	金域医学	4,600	411,700.00	0.39
58	601799	星宇股份	3,200	406,400.00	0.39
59	600895	张江高科	19,800	403,326.00	0.38
60	000975	银泰黄金	25,600	401,408.00	0.38
61	002030	达安基因	14,630	399,106.40	0.38
62	000050	深天马 A	25,800	396,288.00	0.38
63	600801	华新水泥	16,500	391,215.00	0.37
64	603233	大参林	4,800	389,856.00	0.37
65	300316	晶盛机电	15,700	388,418.00	0.37
66	002019	亿帆医药	16,800	385,896.00	0.37
67	000547	航天发展	28,200	385,494.00	0.37

68	300274	阳光电源	26,700	384,213.00	0.36
69	600380	健康元	23,500	381,640.00	0.36
70	002152	广电运通	29,300	379,142.00	0.36
71	000401	冀东水泥	23,600	378,544.00	0.36
72	600410	华胜天成	27,700	376,720.00	0.36
73	600642	申能股份	62,300	368,193.00	0.35
74	002078	太阳纸业	38,600	367,472.00	0.35
75	002572	索菲亚	15,100	364,967.00	0.35
76	600315	上海家化	7,600	364,040.00	0.35
77	601233	桐昆股份	28,500	363,660.00	0.35
78	600859	王府井	7,900	359,845.00	0.34
79	002353	杰瑞股份	11,600	359,600.00	0.34
80	002797	第一创业	51,600	357,072.00	0.34
81	002013	中航机电	45,100	356,290.00	0.34
82	002212	南洋股份	13,400	356,172.00	0.34
83	600486	扬农化工	4,300	354,750.00	0.34
84	002926	华西证券	33,200	352,916.00	0.34
85	300308	中际旭创	5,600	352,800.00	0.34
86	000998	隆平高科	21,000	349,650.00	0.33
87	601231	环旭电子	16,000	349,440.00	0.33
88	002690	美亚光电	6,600	347,160.00	0.33
89	002603	以岭药业	11,000	343,090.00	0.33
90	603659	璞泰来	3,300	339,966.00	0.32
91	002174	游族网络	13,000	339,040.00	0.32
92	600216	浙江医药	17,600	338,976.00	0.32
93	300244	迪安诊断	9,600	338,880.00	0.32
94	603707	健友股份	5,200	335,764.00	0.32
95	600037	歌华有线	21,900	332,880.00	0.32
96	600879	航天电子	51,100	329,084.00	0.31
97	603338	浙江鼎力	4,340	328,841.80	0.31
98	002281	光迅科技	10,000	328,600.00	0.31

99	601872	招商轮船	56,300	328,229.00	0.31
100	002195	二三四五	116,700	327,927.00	0.31
101	000021	深科技	15,000	327,450.00	0.31
102	600511	国药股份	8,000	325,360.00	0.31
103	600884	杉杉股份	27,550	324,814.50	0.31
104	002268	卫士通	14,700	313,698.00	0.30
105	600909	华安证券	45,600	311,448.00	0.30
106	601689	拓普集团	11,000	306,900.00	0.29
106	002028	思源电气	15,000	306,900.00	0.29
108	600779	水井坊	4,900	305,858.00	0.29
109	600325	华发股份	43,200	304,992.00	0.29
110	300001	特锐德	14,500	303,630.00	0.29
111	600827	百联股份	21,000	303,450.00	0.29
112	600728	佳都科技	33,100	301,541.00	0.29
113	000581	威孚高科	14,500	299,860.00	0.28
114	000999	华润三九	10,239	298,876.41	0.28
115	000686	东北证券	35,300	298,285.00	0.28
116	600598	北大荒	18,500	297,850.00	0.28
117	300026	红日药业	53,100	293,112.00	0.28
118	000997	新大陆	18,100	289,238.00	0.27
119	600256	广汇能源	105,800	285,660.00	0.27
120	601168	西部矿业	49,200	285,360.00	0.27
121	600446	金证股份	14,700	285,180.00	0.27
122	002242	九阳股份	7,614	283,773.78	0.27
123	603806	福斯特	5,648	281,891.68	0.27
124	002500	山西证券	43,100	281,874.00	0.27
125	300009	安科生物	15,660	280,314.00	0.27
126	600820	隧道股份	49,300	278,545.00	0.26
127	601966	玲珑轮胎	13,500	272,700.00	0.26
128	600026	中远海能	42,100	271,966.00	0.26
129	600673	东阳光	39,300	271,563.00	0.26

130	600460	士兰微	18,400	270,112.00	0.26
131	002387	维信诺	18,400	262,752.00	0.25
132	002368	太极股份	6,000	262,140.00	0.25
133	300113	顺网科技	10,300	261,620.00	0.25
134	603000	人民网	13,100	259,773.00	0.25
135	603866	桃李面包	5,100	259,539.00	0.25
136	002221	东华能源	29,400	258,426.00	0.25
137	600839	四川长虹	88,300	253,421.00	0.24
138	300166	东方国信	20,400	253,164.00	0.24
139	300296	利亚德	41,600	252,512.00	0.24
140	600528	中铁工业	28,600	252,252.00	0.24
141	002217	合力泰	47,800	250,950.00	0.24
142	002317	众生药业	14,600	250,536.00	0.24
143	600572	康恩贝	45,400	249,700.00	0.24
144	600718	东软集团	21,700	249,550.00	0.24
145	000778	新兴铸管	72,200	247,646.00	0.24
146	600282	南钢股份	76,500	247,095.00	0.23
147	600549	厦门钨业	20,700	245,088.00	0.23
148	600021	上海电力	33,000	244,200.00	0.23
149	600167	联美控股	17,000	243,780.00	0.23
150	600754	锦江酒店	8,700	241,425.00	0.23
151	600567	山鹰纸业	81,100	239,245.00	0.23
152	000729	燕京啤酒	34,300	234,955.00	0.22
153	002920	德赛西威	3,800	233,054.00	0.22
154	000878	云南铜业	21,800	231,298.00	0.22
155	300251	光线传媒	21,200	231,292.00	0.22
156	002709	天赐材料	6,800	229,772.00	0.22
157	000060	中金岭南	61,400	228,408.00	0.22
158	600160	巨化股份	33,100	228,059.00	0.22
159	000877	天山股份	15,100	228,010.00	0.22
160	603228	景旺电子	6,440	226,623.60	0.22

161	002004	华邦健康	41,800	224,884.00	0.21
162	600273	嘉化能源	25,700	224,618.00	0.21
163	002399	海普瑞	8,900	222,856.00	0.21
164	600497	驰宏锌锗	64,700	222,568.00	0.21
165	000090	天健集团	32,100	221,811.00	0.21
166	600862	中航高科	13,100	221,652.00	0.21
167	600466	蓝光发展	41,000	220,990.00	0.21
168	002056	横店东磁	19,600	220,500.00	0.21
169	000960	锡业股份	25,700	219,992.00	0.21
170	600060	海信视像	18,000	218,700.00	0.21
171	002807	江阴银行	55,600	218,508.00	0.21
172	600580	卧龙电驱	19,300	216,932.00	0.21
173	002233	塔牌集团	18,000	216,540.00	0.21
174	600563	法拉电子	3,500	216,300.00	0.21
175	300133	华策影视	29,833	216,289.25	0.21
176	600597	光明乳业	14,400	213,984.00	0.20
177	000402	金融街	32,200	213,808.00	0.20
178	002110	三钢闽光	32,000	213,120.00	0.20
179	000089	深圳机场	27,700	212,182.00	0.20
180	600737	中粮糖业	27,200	211,616.00	0.20
181	000598	兴蓉环境	45,900	211,140.00	0.20
182	000690	宝新能源	44,500	210,040.00	0.20
183	600258	首旅酒店	13,600	209,032.00	0.20
184	002925	盈趣科技	3,600	208,584.00	0.20
185	002048	宁波华翔	13,400	206,896.00	0.20
186	002191	劲嘉股份	23,200	206,712.00	0.20
187	600155	华创阳安	17,200	206,228.00	0.20
188	000970	中科三环	21,000	205,380.00	0.20
189	600967	内蒙一机	19,700	204,683.00	0.19
190	000158	常山北明	19,500	203,580.00	0.19
191	600195	中牧股份	12,500	202,875.00	0.19

192	600376	首开股份	34,400	201,584.00	0.19
193	000830	鲁西化工	27,000	201,420.00	0.19
194	600808	马钢股份	78,000	201,240.00	0.19
195	002038	双鹭药业	15,700	201,117.00	0.19
196	600373	中文传媒	17,000	200,260.00	0.19
197	601333	广深铁路	88,700	199,575.00	0.19
198	600056	中国医药	14,000	198,100.00	0.19
199	600643	爱建集团	24,900	197,955.00	0.19
200	002092	中泰化学	43,600	197,508.00	0.19
201	600039	四川路桥	51,500	196,730.00	0.19
202	000738	航发控制	14,400	196,560.00	0.19
203	603816	顾家家居	4,357	196,108.57	0.19
204	000983	西山煤电	52,000	195,000.00	0.19
205	600120	浙江东方	28,240	194,008.80	0.18
206	000930	中粮科技	28,300	193,289.00	0.18
207	600649	城投控股	32,500	193,050.00	0.18
208	601098	中南传媒	18,200	192,556.00	0.18
209	603712	七一二	5,000	191,900.00	0.18
210	000563	陕国投 A	51,600	191,436.00	0.18
211	300182	捷成股份	47,700	190,323.00	0.18
212	002831	裕同科技	6,900	189,819.00	0.18
213	600633	浙数文化	19,300	188,754.00	0.18
214	601106	中国一重	67,100	188,551.00	0.18
215	601866	中远海发	102,200	188,048.00	0.18
216	000501	鄂武商 A	11,700	183,456.00	0.17
217	600918	中泰证券	14,287	183,445.08	0.17
218	300180	华峰超纤	21,400	183,184.00	0.17
219	002407	多氟多	17,200	183,008.00	0.17
220	000825	太钢不锈	55,000	182,600.00	0.17
221	600392	盛和资源	25,900	182,595.00	0.17
222	000883	湖北能源	51,800	182,336.00	0.17

223	002064	华峰氨纶	35,800	181,506.00	0.17
224	002375	亚厦股份	17,700	180,894.00	0.17
225	002372	伟星新材	15,500	180,265.00	0.17
226	600266	城建发展	35,520	180,086.40	0.17
227	000028	国药一致	4,000	180,040.00	0.17
228	000967	盈峰环境	21,600	178,200.00	0.17
229	600729	重庆百货	5,700	177,954.00	0.17
230	000078	海王生物	42,300	177,237.00	0.17
231	600062	华润双鹤	13,400	177,148.00	0.17
232	000685	中山公用	23,000	177,100.00	0.17
233	002183	怡亚通	33,000	176,880.00	0.17
234	600863	内蒙华电	71,900	176,874.00	0.17
235	000807	云铝股份	40,500	176,580.00	0.17
236	601699	潞安环能	31,500	175,455.00	0.17
237	603077	和邦生物	132,900	175,428.00	0.17
238	600500	中化国际	34,400	174,064.00	0.17
239	000301	东方盛虹	31,300	174,028.00	0.17
240	000012	南玻 A	34,600	173,692.00	0.16
241	600008	首创股份	57,400	172,774.00	0.16
242	000031	大悦城	33,600	171,024.00	0.16
243	000528	柳工	26,800	169,108.00	0.16
244	600388	龙净环保	19,200	168,960.00	0.16
245	002936	郑州银行	49,060	168,766.40	0.16
246	000559	万向钱潮	34,800	168,432.00	0.16
247	601000	唐山港	75,300	167,919.00	0.16
248	002815	崇达技术	8,300	167,909.00	0.16
249	000027	深圳能源	36,160	167,782.40	0.16
250	002583	海能达	22,000	166,980.00	0.16
251	000488	晨鸣纸业	33,800	166,972.00	0.16
252	000006	深振业 A	24,400	166,164.00	0.16
253	600823	世茂股份	36,900	164,943.00	0.16

254	600908	无锡银行	33,200	163,012.00	0.15
255	002155	湖南黄金	20,600	162,328.00	0.15
256	600782	新钢股份	39,700	161,976.00	0.15
257	002440	闰土股份	17,500	159,950.00	0.15
258	002444	巨星科技	13,300	158,004.00	0.15
259	600640	号百控股	7,800	155,610.00	0.15
260	002266	浙富控股	40,200	155,574.00	0.15
261	600138	中青旅	15,700	154,959.00	0.15
262	601608	中信重工	45,000	153,900.00	0.15
263	002701	奥瑞金	36,500	152,935.00	0.15
264	601717	郑煤机	25,900	152,551.00	0.14
265	601958	金钼股份	24,500	151,410.00	0.14
266	600557	康缘药业	10,800	150,336.00	0.14
267	000008	神州高铁	51,000	149,940.00	0.14
268	002745	木林森	9,700	149,477.00	0.14
269	000156	华数传媒	13,700	148,371.00	0.14
270	600073	上海梅林	15,600	148,044.00	0.14
271	000519	中兵红箭	15,700	147,894.00	0.14
272	603885	吉祥航空	16,200	147,420.00	0.14
273	600835	上海机电	8,700	147,291.00	0.14
274	000681	视觉中国	7,900	147,098.00	0.14
275	600409	三友化工	31,400	146,324.00	0.14
276	000758	中色股份	35,000	146,300.00	0.14
277	000887	中鼎股份	18,600	146,010.00	0.14
278	601200	上海环境	12,100	145,200.00	0.14
279	603568	伟明环保	6,240	144,768.00	0.14
280	601228	广州港	47,500	144,400.00	0.14
281	002002	鸿达兴业	39,900	144,039.00	0.14
282	002408	齐翔腾达	23,000	142,830.00	0.14
283	600507	方大特钢	27,500	142,725.00	0.14
284	600765	中航重机	13,900	142,058.00	0.13

285	002244	滨江集团	33,000	140,910.00	0.13
286	000826	启迪环境	18,900	140,238.00	0.13
287	600970	中材国际	26,100	137,808.00	0.13
288	600639	浦东金桥	8,600	137,428.00	0.13
289	600717	天津港	30,720	135,782.40	0.13
290	000813	德展健康	21,900	135,780.00	0.13
291	002839	张家港行	23,300	134,208.00	0.13
292	601880	大连港	77,400	133,128.00	0.13
293	600348	阳泉煤业	30,900	130,398.00	0.12
294	600648	外高桥	9,200	130,088.00	0.12
295	601975	招商南油	54,300	129,777.00	0.12
296	601928	凤凰传媒	18,900	128,520.00	0.12
297	600329	中新药业	7,400	128,168.00	0.12
298	601598	中国外运	39,500	127,585.00	0.12
299	600582	天地科技	42,900	125,697.00	0.12
300	600125	铁龙物流	22,300	124,434.00	0.12
301	600748	上实发展	24,100	123,151.00	0.12
302	601611	中国核建	19,600	121,128.00	0.12
303	000062	深圳华强	8,300	120,682.00	0.11
304	002302	西部建设	12,500	120,000.00	0.11
305	000426	兴业矿业	17,300	119,024.00	0.11
306	002419	天虹股份	12,400	118,420.00	0.11
307	601678	滨化股份	27,900	118,296.00	0.11
308	000761	本钢板材	36,500	116,800.00	0.11
309	000543	皖能电力	28,800	115,776.00	0.11
310	600141	兴发集团	12,800	114,560.00	0.11
311	002544	杰赛科技	8,700	114,405.00	0.11
312	000717	韶钢松山	30,100	114,380.00	0.11
313	603888	新华网	5,100	114,036.00	0.11
314	002128	露天煤业	14,700	113,925.00	0.11
315	600017	日照港	45,700	113,793.00	0.11

316	000718	苏宁环球	36,600	113,094.00	0.11
317	002867	周大生	5,100	113,067.00	0.11
318	300257	开山股份	8,595	112,336.65	0.11
319	000553	安道麦A	12,100	109,142.00	0.10
320	000537	广宇发展	14,700	107,310.00	0.10
321	002653	海思科	4,029	107,211.69	0.10
322	600350	山东高速	17,400	106,836.00	0.10
323	000848	承德露露	15,190	106,330.00	0.10
324	603377	东方时尚	6,400	105,984.00	0.10
325	000869	张裕A	3,100	105,865.00	0.10
326	603328	依顿电子	10,100	105,343.00	0.10
327	603515	欧普照明	3,800	104,006.00	0.10
328	600787	中储股份	23,400	102,726.00	0.10
329	601019	山东出版	16,000	100,000.00	0.09
330	600339	中油工程	43,700	99,199.00	0.09
331	601139	深圳燃气	15,100	98,150.00	0.09
332	002672	东江环保	10,700	96,407.00	0.09
333	000600	建投能源	18,700	95,183.00	0.09
334	002051	中工国际	12,800	93,184.00	0.09
335	600770	综艺股份	19,200	92,160.00	0.09
336	300197	铁汉生态	35,900	91,186.00	0.09
337	601326	秦港股份	36,236	90,952.36	0.09
338	601016	节能风电	42,900	90,948.00	0.09
339	601615	明阳智能	7,100	88,395.00	0.08
340	603056	德邦股份	6,500	87,945.00	0.08
341	002424	贵州百灵	10,500	87,150.00	0.08
342	600985	淮北矿业	11,158	86,920.82	0.08
343	002285	世联行	30,900	86,211.00	0.08
344	600694	大商股份	3,592	86,172.08	0.08
345	603983	丸美股份	1,000	86,030.00	0.08
346	600428	中远海特	27,700	85,316.00	0.08

347	002573	清新环境	15,500	84,630.00	0.08
348	601801	皖新传媒	14,900	82,844.00	0.08
349	000937	冀中能源	27,100	81,842.00	0.08
350	600707	彩虹股份	17,900	81,624.00	0.08
351	600006	东风汽车	20,100	81,003.00	0.08
352	600757	长江传媒	15,300	77,877.00	0.07
353	600098	广州发展	14,100	77,409.00	0.07
354	600623	华谊集团	14,800	76,368.00	0.07
355	601865	福莱特	4,000	75,200.00	0.07
356	600874	创业环保	11,200	74,368.00	0.07
357	603556	海兴电力	5,100	73,644.00	0.07
358	002358	森源电气	14,500	72,355.00	0.07
359	603317	天味食品	1,300	72,254.00	0.07
360	002948	青岛银行	14,000	71,260.00	0.07
361	300199	翰宇药业	11,800	65,608.00	0.06
362	601869	长飞光纤	2,100	64,701.00	0.06
363	603650	彤程新材	2,700	62,829.00	0.06
364	603868	飞科电器	1,200	59,196.00	0.06
365	600903	贵州燃气	5,700	56,088.00	0.05
366	002989	中天精装	980	55,056.40	0.05
367	000025	特力A	3,000	54,990.00	0.05
368	603355	莱克电气	2,100	52,269.00	0.05
369	600335	国机汽车	11,300	52,206.00	0.05
370	603379	三美股份	2,100	45,087.00	0.04
371	603225	新凤鸣	4,500	44,910.00	0.04
372	601811	新华文轩	4,400	44,748.00	0.04
373	601860	紫金银行	10,300	43,569.00	0.04
374	001872	招商港口	2,700	39,285.00	0.04
375	603025	大豪科技	5,000	36,350.00	0.03
376	600917	重庆燃气	4,800	34,272.00	0.03
377	002946	新乳业	1,900	32,965.00	0.03

378	603087	甘李药业	322	32,296.60	0.03
379	601068	中铝国际	8,100	31,671.00	0.03
380	002941	新疆交建	1,700	24,055.00	0.02
381	002957	科瑞技术	1,000	23,900.00	0.02
382	603877	太平鸟	1,513	21,484.60	0.02
383	603256	宏和科技	1,800	20,592.00	0.02
384	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.02
385	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
386	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
387	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
388	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
389	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	002414	高德红外	4,654,072.00	4.87
2	600862	中航高科	4,059,350.00	4.25
3	002244	滨江集团	3,597,904.00	3.77
4	600563	法拉电子	3,542,551.50	3.71
5	601019	山东出版	3,407,870.00	3.57
6	300308	中际旭创	3,316,813.00	3.47
7	601615	明阳智能	3,273,946.00	3.43
8	002004	华邦健康	3,272,005.00	3.43
9	600845	宝信软件	3,250,411.00	3.40
10	300529	健帆生物	3,183,823.00	3.33
11	600757	长江传媒	3,158,572.00	3.31
12	600643	爱建集团	3,150,883.44	3.30
13	002439	启明星辰	3,035,929.67	3.18

14	002064	华峰氨纶	3,016,203.00	3.16
15	600779	水井坊	3,009,103.00	3.15
16	002440	闰土股份	2,998,005.00	3.14
17	300316	晶盛机电	2,965,574.69	3.11
18	300251	光线传媒	2,959,843.00	3.10
19	000581	威孚高科	2,932,055.05	3.07
20	603025	大豪科技	2,912,600.62	3.05
21	603712	七一二	2,839,887.97	2.97
22	002583	海能达	2,835,010.00	2.97
23	600763	通策医疗	2,819,868.00	2.95
24	601100	恒立液压	2,813,933.00	2.95
25	002056	横店东磁	2,808,716.18	2.94
26	000513	丽珠集团	2,798,880.85	2.93
27	300418	昆仑万维	2,786,837.00	2.92
28	300166	东方国信	2,779,666.00	2.91
29	603882	金域医学	2,754,050.35	2.88
30	601233	桐昆股份	2,751,912.00	2.88
31	600426	华鲁恒升	2,686,591.50	2.81
32	600885	宏发股份	2,684,845.00	2.81
33	000878	云南铜业	2,661,921.00	2.79
34	002368	太极股份	2,661,034.00	2.79
35	002444	巨星科技	2,633,566.00	2.76
36	601689	拓普集团	2,629,893.40	2.75
37	002672	东江环保	2,598,635.00	2.72
38	603444	吉比特	2,592,224.00	2.71
39	002701	奥瑞金	2,585,821.00	2.71
40	600062	华润双鹤	2,555,762.00	2.68
41	600273	嘉化能源	2,548,149.00	2.67
42	002078	太阳纸业	2,520,236.00	2.64
43	000028	国药一致	2,516,193.00	2.64
44	603877	太平鸟	2,512,274.17	2.63

45	002372	伟星新材	2,507,097.87	2.63
46	603806	福斯特	2,493,905.94	2.61
47	002815	崇达技术	2,476,533.00	2.59
48	600373	中文传媒	2,451,605.00	2.57
49	601811	新华文轩	2,450,052.93	2.57
50	000718	苏宁环球	2,446,738.00	2.56
51	600770	综艺股份	2,442,643.00	2.56
52	603233	大参林	2,427,835.00	2.54
53	600557	康缘药业	2,420,706.00	2.54
54	600266	城建发展	2,370,288.64	2.48
55	600511	国药股份	2,321,206.18	2.43
56	300088	长信科技	2,316,676.00	2.43
57	000848	承德露露	2,277,933.00	2.39
58	601966	玲珑轮胎	2,273,769.72	2.38
59	002373	千方科技	2,260,671.00	2.37
60	002387	维信诺	2,259,973.00	2.37
61	002653	海思科	2,242,830.46	2.35
62	603816	顾家家居	2,202,362.83	2.31
63	002048	宁波华翔	2,196,994.00	2.30
64	002217	合力泰	2,194,176.68	2.30
65	600582	天地科技	2,143,061.00	2.24
66	002028	思源电气	2,131,671.79	2.23
67	002920	德赛西威	2,124,194.00	2.22
68	601138	工业富联	2,114,218.14	2.21
69	300433	蓝思科技	2,108,149.00	2.21
70	000090	天健集团	2,101,601.20	2.20
71	600428	中远海特	2,097,906.00	2.20
72	601000	唐山港	2,078,385.00	2.18
73	002463	沪电股份	2,074,781.00	2.17
74	300498	温氏股份	2,062,381.00	2.16
75	002714	牧原股份	2,050,699.00	2.15

76	002555	三七互娱	2,048,218.00	2.15
77	601869	长飞光纤	2,045,961.00	2.14
78	002573	清新环境	2,039,284.00	2.14
79	601865	福莱特	2,025,006.13	2.12
80	600348	阳泉煤业	2,022,746.00	2.12
81	600536	中国软件	2,005,469.00	2.10
82	600985	淮北矿业	2,003,117.72	2.10
83	601828	美凯龙	1,993,846.00	2.09
84	601117	中国化学	1,988,807.00	2.08
85	600161	天坛生物	1,981,856.60	2.08
86	601326	秦港股份	1,966,164.48	2.06
87	000006	深振业 A	1,949,319.00	2.04
88	601688	华泰证券	1,933,892.00	2.03

“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	002414	高德红外	4,879,759.79	5.11
2	600563	法拉电子	4,533,804.75	4.75
3	603444	吉比特	4,273,560.00	4.48
4	002444	巨星科技	4,170,505.00	4.37
5	600862	中航高科	3,972,389.00	4.16
6	002004	华邦健康	3,874,467.00	4.06
7	601019	山东出版	3,746,712.00	3.92
8	603233	大参林	3,674,408.00	3.85
9	000028	国药一致	3,644,448.00	3.82
10	000878	云南铜业	3,637,214.24	3.81
11	601615	明阳智能	3,624,348.89	3.80
12	000718	苏宁环球	3,385,234.50	3.55

13	002244	滨江集团	3,345,402.84	3.50
14	600582	天地科技	3,315,438.00	3.47
15	002701	奥瑞金	3,178,029.60	3.33
16	600845	宝信软件	3,075,624.00	3.22
17	002028	思源电气	3,035,885.00	3.18
18	600757	长江传媒	2,999,592.00	3.14
19	603712	七一二	2,996,396.39	3.14
20	600511	国药股份	2,953,243.00	3.09
21	300529	健帆生物	2,908,877.00	3.05
22	600643	爱建集团	2,885,216.00	3.02
23	600373	中文传媒	2,884,905.70	3.02
24	002372	伟星新材	2,794,928.65	2.93
25	000581	威孚高科	2,787,692.65	2.92
26	002920	德赛西威	2,741,148.00	2.87
27	300251	光线传媒	2,732,207.00	2.86
28	603328	依顿电子	2,709,505.00	2.84
29	002583	海能达	2,665,150.00	2.79
30	300308	中际旭创	2,665,074.00	2.79
31	601233	桐昆股份	2,656,615.40	2.78
32	600745	闻泰科技	2,611,596.00	2.74
33	603501	韦尔股份	2,607,780.52	2.73
34	002440	闰土股份	2,602,112.00	2.73
35	600779	水井坊	2,597,502.23	2.72
36	601100	恒立液压	2,593,875.00	2.72
37	002064	华峰氨纶	2,590,941.00	2.71
38	000513	丽珠集团	2,521,846.34	2.64
39	603025	大豪科技	2,488,819.58	2.61
40	300316	晶盛机电	2,464,791.35	2.58
41	600763	通策医疗	2,453,116.48	2.57
42	603806	福斯特	2,421,367.00	2.54
43	002368	太极股份	2,397,803.00	2.51

44	603882	金域医学	2,381,221.00	2.49
45	600770	综艺股份	2,381,200.22	2.49
46	603877	太平鸟	2,367,142.00	2.48
47	002387	维信诺	2,343,083.00	2.45
48	002056	横店东磁	2,309,246.00	2.42
49	600985	淮北矿业	2,298,669.67	2.41
50	603568	伟明环保	2,289,151.00	2.40
51	002439	启明星辰	2,285,918.00	2.39
52	300433	蓝思科技	2,276,901.31	2.38
53	601811	新华文轩	2,260,749.63	2.37
54	600062	华润双鹤	2,260,075.68	2.37
55	600273	嘉化能源	2,221,864.00	2.33
56	600266	城建发展	2,210,424.80	2.31
57	002672	东江环保	2,210,022.00	2.31
58	002653	海思科	2,192,706.00	2.30
59	000848	承德露露	2,181,683.00	2.28
60	600426	华鲁恒升	2,170,648.00	2.27
61	000090	天健集团	2,157,089.00	2.26
62	300166	东方国信	2,154,603.00	2.26
63	002048	宁波华翔	2,127,442.00	2.23
64	600557	康缘药业	2,119,592.00	2.22
65	300418	昆仑万维	2,115,065.11	2.22
66	300182	捷成股份	2,099,363.00	2.20
67	601865	福莱特	2,085,960.00	2.18
68	601138	工业富联	2,068,771.98	2.17
69	002078	太阳纸业	2,048,900.00	2.15
70	600060	海信视像	2,046,350.48	2.14
71	601336	新华保险	2,046,213.60	2.14
72	002815	崇达技术	2,044,888.70	2.14
73	002463	沪电股份	2,007,970.00	2.10
74	600346	恒力石化	2,004,318.40	2.10

75	002573	清新环境	1,997,884.00	2.09
76	601966	玲珑轮胎	1,981,337.00	2.07
77	601828	美凯龙	1,970,783.67	2.06
78	600885	宏发股份	1,966,236.00	2.06
79	000690	宝新能源	1,958,054.96	2.05
80	601869	长飞光纤	1,949,043.00	2.04
81	300088	长信科技	1,940,834.00	2.03
82	000930	中粮科技	1,940,117.00	2.03
83	601688	华泰证券	1,937,504.00	2.03
84	002690	美亚光电	1,935,834.69	2.03
85	601117	中国化学	1,932,213.00	2.02
86	600428	中远海特	1,916,547.00	2.01
87	002081	金螳螂	1,912,782.00	2.00

“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	391,263,447.76
卖出股票收入（成交）总额	380,595,197.37

“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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,416,112.00	5.14
	其中：政策性金融债	5,416,112.00	5.14
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)	12,100.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,428,212.00	5.16

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	018007	国开1801	54,080	5,416,112.00	5.14
2	128115	巨星转债	121	12,100.00	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券除东山精密(002384)、亿纬锂能(300014)外其他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。 中华人民共和国惠州海关2020年5月18日发布对惠州亿纬锂能股份

有限公司进行处罚、苏州消防大队2020年2月18日发布对苏州东山精密制造股份有限公司进行处罚（苏吴公（消）行罚决字[2016]0050、0051、0052号）、苏州消防大队2019年12月31日发布对苏州东山精密制造股份有限公司进行处罚（苏吴公（消）行罚字[2019]0321、0322、0378、0421、0696号）。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	61,363.71
2	应收证券清算款	25,424.19
3	应收股利	-
4	应收利息	173,339.77
5	应收申购款	303,315.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	563,442.91

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

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，各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

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
20,320	5,145.54	-	-	104,557,369.18	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，本基金基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
- 2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年02月17日)基金份额总额	32,205,421.89
本报告期期初基金份额总额	98,312,479.96
本报告期基金总申购份额	42,097,433.57
减：本报告期基金总赎回份额	35,852,544.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	104,557,369.18

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，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

- (1) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2020年2月7日发布公告，王启道先生因个人原因提出离职，不再担任中融基金管理有限公司副总裁。

本基金管理人于2020年2月13日发布公告，黄言先生担任中融基金管理有限公司常务副总裁。

本基金管理人于2020年4月10日发布公告，易海波先生因个人原因提出离职，不再担任中融基金管理有限公司副总裁。

公司其他高管人员未变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期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会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员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	
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西藏	2	771,109,418.02	100.0	563,907.37	100.00%	-

东方 财富 证券			0%			
中天 证券	1	-	-	-	-	退租1个 交易单 元

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。
- v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	7,444,952.10	100.00%	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-13
2	中融基金管理有限公司关于因2020年春节假期延	中国证监会指定报刊	2020-01-31

	长调整旗下基金相关业务安排的提示性公告	及网站	
3	中融基金管理有限公司关于公司自有资金及高级管理人员投资公司旗下基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-06
4	中融基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-07
5	中融基金管理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	2020-02-13
6	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-21
7	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-17
8	中融基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-10
9	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券股份有限公司为销售机构并开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22
10	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-23
11	中融基金管理有限公司基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-09

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融融安灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 《中融融安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融融安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《中融融安灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(6) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(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或基金托管人的住所

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：中融基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，（010）56517299。

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司
二〇二〇年八月二十八日