

---

# 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

## 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:国泰君安证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰君安证券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	6
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	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
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	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	中融沪港深大消费主题	
基金主代码	005142	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年11月16日	
基金管理人	中融基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	77,509,309.34份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中融沪港深大消费主题A	中融沪港深大消费主题C
下属分级基金的交易代码	005142	005143
报告期末下属分级基金的份额总额	39,850,483.29份	37,658,826.05份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于大消费行业中具有持续增长潜力的优质上市公司，以把握中国经济增长以及结构转型带来的消费升级过程中的投资机会，在严格进行风险控制的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 大类资产配置</li> <li>2. 股票投资策略 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 大消费主题的定义</li> <li>(2) 个股投资策略</li> </ol> </li> <li>3. 债券投资策略</li> <li>4. 股指期货投资策略</li> <li>5. 中小企业私募债券投资策略</li> <li>6. 资产支持证券投资策略</li> <li>7. 国债期货投资策略</li> </ol>

业绩比较基准	沪深300指数收益率×10%+恒生指数收益率×40% +上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

### 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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹健
	联系电话	010-56517129
	电子邮箱	caojian@zrfunds.com.cn
客户服务电话	400-160-6000; 010-56517299	(021) 38917599-5
传真	010-56517001	(021) 38677819
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3202、3203B	中国(上海)自由贸易试验区商城路618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	上海市静安区新闸路669号博华广场19楼
邮政编码	100102	200041
法定代表人	王瑶	贺青

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.zrfunds.com.cn/">http://www.zrfunds.com.cn/</a>
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)	
	中融沪港深大消费主题A	中融沪港深大消费主题C
本期已实现收益	554,086.19	818,540.69
本期利润	4,150,713.33	4,266,166.98
加权平均基金份额本期利润	0.0979	0.1068
本期加权平均净值利润率	11.61%	12.72%
本期基金份额净值增长率	13.05%	12.91%
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	-5,667,211.57	-5,569,497.30
期末可供分配基金份额利润	-0.1422	-0.1479
期末基金资产净值	38,844,776.58	36,466,150.40
期末基金份额净值	0.9748	0.9683
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	-2.52%	-3.17%

- 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

中融沪港深大消费主题A

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	17.73%	1.43%	3.25%	0.66%	14.48%	0.77%
过去三个月	29.89%	1.65%	3.10%	0.69%	26.79%	0.96%
过去六个月	13.05%	2.12%	-3.57%	0.85%	16.62%	1.27%
过去一年	22.49%	1.60%	-2.12%	0.67%	24.61%	0.93%
自基金合同生效起至今	-2.52%	1.41%	1.40%	0.61%	-3.92%	0.80%

## 中融沪港深大消费主题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	17.70%	1.43%	3.25%	0.66%	14.45%	0.77%
过去三个月	29.80%	1.65%	3.10%	0.69%	26.70%	0.96%
过去六个月	12.91%	2.12%	-3.57%	0.85%	16.48%	1.27%
过去一年	22.23%	1.60%	-2.12%	0.67%	24.35%	0.93%
自基金合同生效起至今	-3.17%	1.41%	1.40%	0.61%	-4.57%	0.80%

### 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



中融沪港深大消费主题A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11月16日-2020年06月30日)



中融沪港深大消费主题C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11月16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		
甘传琦	中融产业升级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、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2018-02-09	-	9	甘传琦先生，中国国籍，毕业于北京大学金融学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限9年。2010年7月至2017年3月历任博时基金管理有限公司研究员、高级研究员、基金经理助理。2017年4月加入中融基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理。
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金经理。	2019-11-29	-	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。

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。回顾上半年的股票市场，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，我们保持对中港两地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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融沪港深大消费主题A基金份额净值为0.9748元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为13.05%，同期业绩比较基准收益率为-3.57%；截至报告期末中融沪港深大消费主题C基金份额净值为0.9683元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.91%，同期业绩比较基准收益率为-3.57%。

#### 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，基金认为港股市场仍有持续上涨的动力，主要的支撑因素有三点：一是南下资金和海外资金的持续流入；二是优质股票的供给增加，今年的中概股回归和生物医药板块的IPO给投资者带来了不错的赚钱效应；三是市场整体的估值水平相对于社会环境的改善是明显偏低的。

我们将跟随资本市场一起加深对中国科技板块的学习，从而发掘中国新经济中更多的投资价值。

#### 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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在中融沪港深大消费主体灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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等方面进行了认真的复核，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。

#### 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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,077,911.32	8,361,772.46
结算备付金		43,374.77	25,725.15
存出保证金		57,899.45	116,898.38
交易性金融资产	6.4.7.2	68,621,771.31	72,376,650.72

其中：股票投资		68,621,771.31	72,376,650.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		442,174.98	1,590,787.20
应收利息	6.4.7.5	3,429.18	2,365.49
应收股利		188,789.61	6,474.60
应收申购款		474,210.07	23,959.35
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		76,909,560.69	82,504,633.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年06月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		243,552.01	195,017.30
应付赎回款		1,110,263.44	630,513.27
应付管理人报酬		86,330.89	104,322.73
应付托管费		14,388.47	17,387.11
应付销售服务费		5,604.90	7,024.55
应付交易费用	6.4.7.6	87,928.50	117,704.51
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	50,565.50	150,076.65
负债合计		1,598,633.71	1,222,046.12
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.8	77,509,309.34	94,518,724.82
未分配利润	6.4.7.9	-2,198,382.36	-13,236,137.59
所有者权益合计		75,310,926.98	81,282,587.23
负债和所有者权益总计		76,909,560.69	82,504,633.35

报告截止日2020年6月30日，基金份额总额77,509,309.34份，其中A类基金份额的份额总额为39,850,483.29份，份额净值0.9748元；C类基金份额的份额总额为37,658,826.05份，份额净值0.9683元。

## 6.2 利润表

会计主体：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

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
<b>一、收入</b>		9,726,806.35	12,499,632.33
1. 利息收入		67,884.57	213,130.51
其中：存款利息收入	6.4.7.10	67,884.57	213,130.51
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,591,039.29	1,311,593.17



其中：股票投资收益	6.4.7.11	2,267,229.02	472,290.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.12	323,810.27	839,302.80
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.13	7,044,253.43	10,966,039.99
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.14	23,629.06	8,868.66
<b>减：二、费用</b>		1,309,926.04	1,950,747.53
1. 管理人报酬		519,622.62	953,742.73
2. 托管费		86,603.74	158,957.16
3. 销售服务费		33,590.51	65,188.52
4. 交易费用	6.4.7.15	620,383.13	699,313.61
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	6.4.7.16	49,726.04	73,545.51
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		8,416,880.31	10,548,884.80
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		8,416,880.31	10,548,884.80

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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)	94,518,724.82	-13,236,137.59	81,282,587.23
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	8,416,880.31	8,416,880.31
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)	-17,009,415.48	2,620,874.92	-14,388,540.56
其中：1. 基金申购款	15,163,964.23	-2,323,786.35	12,840,177.88
2. 基金赎回 款	-32,173,379.71	4,944,661.27	-27,228,718.44
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)	77,509,309.34	-2,198,382.36	75,310,926.98
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)	182,347,280.63	-47,206,017.68	135,141,262.95
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	10,548,884.80	10,548,884.80
三、本期基金份额交	-39,727,107.93	7,277,413.64	-32,449,694.29

易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	2,631,619.85	-498,551.92	2,133,067.93
2. 基金赎回款	-42,358,727.78	7,775,965.56	-34,582,762.22
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(基金净值)	142,620,172.70	-29,379,719.24	113,240,453.46

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

中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”),系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〔2017〕1531号文《关于准予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注册的批复》的注册,由中融基金管理有限公司于2017年10月23日至2017年11月10日向社会公开募集,基金合同于2017年11月16日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集规模为298,956,669.34份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为中融基金管理有限公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

本基金募集期为2017年10月23日至2017年11月10日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,本基金共募集有效净认购资金人民币298,912,471.64元,折合298,912,471.64份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份额(其中:A类基金份额为109,314,268.35份;C类基金份额为189,598,203.29份)。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币44,197.70元,折合44,197.70份中融沪港深大消费主题灵活配置基金份额(其中:A类基金份额为18,161.11份;C类基金份额为26,036.59

份), 以上收到的实收基金共计人民币298,956,669.34元, 折合298,956,669.34份中融沪港深大消费主题灵活配置混合型基金份额, 有效认购户数为6806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《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》和基金合同等有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、权证、股指期货、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、公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券、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、同业存单、货币市场工具、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)

本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 $\times$ 10%+恒生指数收益率 $\times$ 40%+上证国债指数收益率 $\times$ 50%。

#### 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	7,077,911.32
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	7,077,911.32

##### 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	56,985,406.91	68,621,771.31	11,636,364.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-

	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	56,985,406.91	68,621,771.31	11,636,364.40

#### 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

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	3,254.94
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	116.55
应收债券利息	-
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	57.69
合计	3,429.18

#### 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	87,928.50
银行间市场应付交易费用	-
合计	87,928.50

#### 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	839.46
应付证券出借违约金	-
预提费用	49,726.04
合计	50,565.50

#### 6.4.7.8 实收基金

##### 6.4.7.8.1 中融沪港深大消费主题A

金额单位：人民币元

项目 (中融沪港深大消费主题A)	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	47,254,156.32	47,254,156.32
本期申购	6,820,273.28	6,820,273.28
本期赎回(以“-”号填列)	-14,223,946.31	-14,223,946.31
本期末	39,850,483.29	39,850,483.29

##### 6.4.7.8.2 中融沪港深大消费主题C

金额单位：人民币元

项目 (中融沪港深大消费主题C)	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	47,264,568.50	47,264,568.50
本期申购	8,343,690.95	8,343,690.95
本期赎回(以“-”号填列)	-17,949,433.40	-17,949,433.40



本期末	37,658,826.05	37,658,826.05
-----	---------------	---------------

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

##### 6.4.7.9.1 中融沪港深大消费主题A

单位：人民币元

项目 (中融沪港深大消费主题A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,381,443.13	876,840.44	-6,504,602.69
本期利润	554,086.19	3,596,627.14	4,150,713.33
本期基金份额交易产生的变动数	1,160,145.37	188,037.28	1,348,182.65
其中：基金申购款	-1,040,049.11	22,088.21	-1,017,960.90
基金赎回款	2,200,194.48	165,949.07	2,366,143.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,667,211.57	4,661,504.86	-1,005,706.71

##### 6.4.7.9.2 中融沪港深大消费主题C

单位：人民币元

项目 (中融沪港深大消费主题C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,604,910.52	873,375.62	-6,731,534.90
本期利润	818,540.69	3,447,626.29	4,266,166.98
本期基金份额交易产生的变动数	1,216,872.53	55,819.74	1,272,692.27
其中：基金申购款	-1,346,572.90	40,747.45	-1,305,825.45
基金赎回款	2,563,445.43	15,072.29	2,578,517.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,569,497.30	4,376,821.65	-1,192,675.65

## 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	60,393.64
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	6,061.35
其他	1,429.58
合计	67,884.57

## 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	184,560,814.30
减：卖出股票成本总额	182,293,585.28
买卖股票差价收入	2,267,229.02

## 6.4.7.12 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	323,810.27
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	323,810.27

## 6.4.7.13 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	7,044,253.43

——股票投资	7,044,253.43
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	7,044,253.43

## 6.4.7.14 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	23,629.06
合计	23,629.06

## 6.4.7.15 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	620,383.13
银行间市场交易费用	-
合计	620,383.13

## 6.4.7.16 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	-
合计	49,726.04

#### 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
国泰君安证券股份有限公司	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

金额单位：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	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例

国泰君安 证券股份 有限公司	0.00	0.00%	295,979,402.55	71.42%
----------------------	------	-------	----------------	--------

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日			
	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
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06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
国泰君安证券股份有限公司	162,383.60	68.20%	71,622.03	64.37%

#### 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管理费	519,622.62	953,742.73
其中：支付销售机构的客户维护费	91,849.62	175,338.96

1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值X1.50%/当年天数。

2、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	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年06月30日	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	86,603.74	158,957.16

支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值X0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融沪港深大消费主题A	中融沪港深大消费主题C	合计
中融基金管理有限公司	0.00	1.60	1.60
国泰君安证券股份有限公司	0.00	9,993.26	9,993.26
合计	0.00	9,994.86	9,994.86
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	中融沪港深	中融沪港深大消费	合计

	大消费主题A	主题C	
中融基金管理有限公司	0.00	1.69	1.69
国泰君安证券股份有限公司	0.00	14,803.57	14,803.57
合计	0.00	14,805.26	14,805.26

支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.20%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构代付给销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。C类基金销售服务费的计算公式为：C类基金份额的日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.20%/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

中融沪港深大消费主题A

份额单位：份

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
基金合同生效日（2017年11月16日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	25.09%	13.76%

中融沪港深大消费主题C

份额单位：份

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
----	-----------------------------------	--

基金合同生效日（2017年11月16日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

- (1) 基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付；
- (2) 期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：含转换出份额；
- (3) 对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

#### 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
国泰君安证券股份有限公司	7,077,911.32	60,393.64	24,430,177.08	202,931.59

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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

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

无。

##### 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	7,077,911.32	-	-	-	7,077,911.32
结算备付金	43,374.77	-	-	-	43,374.77
存出保证金	57,899.45	-	-	-	57,899.45
交易性金融资产	-	-	-	68,621,771.31	68,621,771.31
应收证券清算款	-	-	-	442,174.98	442,174.98
应收利息	-	-	-	3,429.18	3,429.18
应收股利	-	-	-	188,789.61	188,789.61
应收申购款	-	-	-	474,210.07	474,210.07
资产总计	7,179,185.54	-	-	69,730,375.15	76,909,560.69
负债					
应付证券清算款	-	-	-	243,552.01	243,552.01
应付赎回款	-	-	-	1,110,263.44	1,110,263.44
应付管理人报酬	-	-	-	86,330.89	86,330.89
应付托管费	-	-	-	14,388.47	14,388.47
应付销售服务费	-	-	-	5,604.90	5,604.90
应付交易费用	-	-	-	87,928.50	87,928.50
其他负债	-	-	-	50,565.50	50,565.50
负债总计	-	-	-	1,598,633.71	1,598,633.71
利率敏感度缺口	7,179,185.54	-	-	68,131,741.44	75,310,926.98
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	8,361,772.46	-	-	-	8,361,772.46
结算备付金	25,725.15	-	-	-	25,725.15
存出保证金	116,898.38	-	-	-	116,898.38
交易性金融资产	-	-	-	72,376,650.72	72,376,650.72
应收证券清算款	-	-	-	1,590,787.20	1,590,787.20
应收利息	-	-	-	2,365.49	2,365.49
应收股利	-	-	-	6,474.60	6,474.60
应收申购款	-	-	-	23,959.35	23,959.35
资产总计	8,504,395.99	-	-	74,000,237.36	82,504,633.35
负债					
应付证券清算款	-	-	-	195,017.30	195,017.30
应付赎回款	-	-	-	630,513.27	630,513.27
应付管理人报酬	-	-	-	104,322.73	104,322.73
应付托管费	-	-	-	17,387.11	17,387.11
应付销售服务费	-	-	-	7,024.55	7,024.55
应付交易费用	-	-	-	117,704.51	117,704.51
其他负债	-	-	-	150,076.65	150,076.65

负债总计	-	-	-	1,222,046.12	1,222,046.12
利率敏感度缺口	8,504,395.99	-	-	72,778,191.24	81,282,587.23

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	58,444,809.51	-	58,444,809.51
应收股利	-	188,789.61	-	188,789.61
应收证券清算款	-	442,174.98	-	442,174.98
资产合计	-	59,075,774.10	-	59,075,774.10
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	-	59,075,774.10	-	59,075,774.10

项目	上年度末 2019年12月31日			
	美元折 合人民 币	港币折合人民 币	其他币 种折合 人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	61,521,274.6 2	-	61,521,274.6 2
应收股利	-	6,474.60	-	6,474.60
应收证券清算款	-	1,586,657.44	-	1,586,657.44
资产合计	-	63,114,406.6 6	-	63,114,406.6 6
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	-	63,114,406.6 6	-	63,114,406.6 6

#### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	所有港币均相对人民币升值5%	2,953,788.71	3,155,720.33
	所有港币均相对人民币贬值5%	-2,953,788.71	-3,155,720.33

#### 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	68,621,771.31	91.12	72,376,650.72	89.04
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	68,621,771.31	91.12	72,376,650.72	89.04

## 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%	4,078,836.97	2,748,397.12

	沪深300指数下降5%	-4, 078, 836. 97	-2, 748, 397. 12
--	-------------	------------------	------------------

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68,621,771.31元，无属于第二层次、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	68,621,771.31	89.22
	其中：股票	68,621,771.31	89.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	7,121,286.09	9.26
8	其他各项资产	1,166,503.29	1.52
9	合计	76,909,560.69	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

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	435,000.00	0.58
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,611,261.80	11.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	539,616.00	0.72
F	批发和零售业	-	-
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	367,000.00	0.49

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	224,084.00	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,176,961.80	13.51

### 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 (%)
基础材料	4,722,092.02	6.27
消费者非必需品	14,370,274.62	19.08
消费者常用品	4,122,204.04	5.47
金融	7,615,911.96	10.11
医疗保健	7,715,447.51	10.24
工业	356,698.32	0.47
信息技术	13,771,341.15	18.29
电信服务	5,770,839.89	7.66
合计	58,444,809.51	77.6

以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)

### 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	H01772	赣锋锂业	144,200	4,722,092.02	6.27
2	H00981	中芯国际	180,000	4,439,318.40	5.89
3	H00700	腾讯控股	8,800	4,007,882.42	5.32
4	H00268	金蝶国际	210,000	3,456,639.65	4.59
5	H02001	新高教集团	700,000	3,273,768.96	4.35
6	H01128	永利澳门	260,000	3,168,175.30	4.21
7	H02013	微盟集团	330,000	2,932,964.50	3.89
8	H02628	中国人寿	200,000	2,849,932.80	3.78
9	H00853	微创医疗	95,000	2,707,436.16	3.60
10	H01299	友邦保险	40,000	2,641,668.48	3.51
11	H01070	T C L 电子	720,000	2,492,595.07	3.31
12	H01610	中粮肉食	1,000,000	2,338,406.40	3.11
13	H06865	福莱特玻璃	300,000	2,290,907.52	3.04
14	H03908	中金公司	152,800	2,124,310.68	2.82
15	H01066	威高股份	134,245	2,114,050.74	2.81
16	600521	华海药业	55,660	1,888,543.80	2.51
17	H06186	中国飞鹤	125,827	1,783,797.64	2.37
18	300406	九强生物	70,000	1,610,000.00	2.14
19	002409	雅克科技	30,000	1,565,100.00	2.08
20	H00520	呷哺呷哺	200,000	1,395,736.32	1.85
21	H01530	三生制药	150,000	1,345,497.12	1.79
22	H02400	心动公司	44,400	1,208,590.73	1.60
23	002332	仙琚制药	70,000	1,178,800.00	1.57
24	H01873	维亚生物	140,000	1,110,012.29	1.47
25	H01316	耐世特	200,000	971,900.16	1.29
26	300207	欣旺达	44,400	839,160.00	1.11

27	H01765	希望教育	300,000	726,184.80	0.96
28	H00425	敏实集团	34,000	684,805.97	0.91
29	H02018	瑞声科技	15,000	651,511.08	0.87
30	H03690	美团点评-W	3,600	565,273.21	0.75
31	H00302	中手游	170,000	554,366.74	0.74
32	002375	亚厦股份	52,800	539,616.00	0.72
33	H01890	中国科培	80,000	455,989.25	0.61
34	H03759	康龙化成	6,000	438,451.20	0.58
35	002299	圣农发展	15,000	435,000.00	0.58
36	H01896	猫眼娱乐	40,000	431,874.43	0.57
37	002317	众生药业	22,400	384,384.00	0.51
38	300119	瑞普生物	17,000	379,950.00	0.50
39	603558	健盛集团	43,200	372,384.00	0.49
40	300609	汇纳科技	10,000	367,000.00	0.49
41	H03319	雅生活服务	10,000	356,698.32	0.47
42	002398	垒知集团	21,200	224,084.00	0.30
43	603187	海容冷链	6,000	218,820.00	0.29
44	H06068	睿见教育	70,000	203,971.15	0.27
45	000661	长春高新	400	174,120.00	0.23

#### 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	H01772	赣锋锂业	5,967,106.16	7.34
2	H00700	腾讯控股	5,503,380.88	6.77
3	H00981	中芯国际	5,312,751.96	6.54
4	H03888	金山软件	4,315,835.86	5.31
5	H06865	福莱特玻璃	4,180,124.92	5.14
6	H06186	中国飞鹤	4,162,369.32	5.12

7	H00520	呷哺呷哺	4,123,715.14	5.07
8	H00522	ASM PACIFIC	3,901,078.27	4.80
9	H02883	中海油田服务	3,805,323.07	4.68
10	H01093	石药集团	3,469,857.68	4.27
11	H02338	潍柴动力	3,409,443.58	4.19
12	H01128	永利澳门	3,408,778.32	4.19
13	H00268	金蝶国际	3,385,669.32	4.17
14	H01299	友邦保险	3,321,024.71	4.09
15	H00425	敏实集团	3,298,099.33	4.06
16	H00763	中兴通讯	3,274,914.50	4.03
17	H02628	中国人寿	3,254,929.03	4.00
18	H03323	中国建材	2,816,844.45	3.47
19	H01211	比亚迪股份	2,759,701.05	3.40
20	H02013	微盟集团	2,745,092.88	3.38
21	H02001	新高教集团	2,742,912.20	3.37
22	H01610	中粮肉食	2,587,643.17	3.18
23	H03690	美团点评-W	2,421,129.51	2.98
24	H01896	猫眼娱乐	2,348,942.21	2.89
25	300146	汤臣倍健	2,339,749.00	2.88
26	002409	雅克科技	2,250,967.00	2.77
27	H01070	TCL电子	2,242,705.88	2.76
28	H00288	万洲国际	2,165,962.55	2.66
29	H00914	海螺水泥	2,159,467.03	2.66
30	002714	牧原股份	2,138,487.80	2.63
31	H00853	微创医疗	2,119,838.09	2.61
32	H03993	洛阳钼业	2,080,545.30	2.56
33	H02588	中银航空租赁	2,001,690.95	2.46
34	603558	健盛集团	1,993,325.00	2.45
35	300010	立思辰	1,955,000.00	2.41
36	H00338	上海石油化工股份	1,947,675.73	2.40
37	H01066	威高股份	1,939,670.22	2.39

38	H02689	玖龙纸业	1,840,404.25	2.26
39	H03908	中金公司	1,782,803.91	2.19
40	H02018	瑞声科技	1,712,871.68	2.11
41	H01347	华虹半导体	1,710,050.63	2.10
42	H00799	IGG	1,671,931.05	2.06

“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	H03888	金山软件	9,060,617.52	11.15
2	H03690	美团点评-W	7,832,606.96	9.64
3	H01299	友邦保险	7,559,504.65	9.30
4	H03323	中国建材	6,551,709.06	8.06
5	H00700	腾讯控股	6,187,643.20	7.61
6	H02338	潍柴动力	5,390,800.32	6.63
7	H02628	中国人寿	4,813,112.24	5.92
8	H00175	吉利汽车	4,503,039.95	5.54
9	H01177	中国生物制药	4,494,898.53	5.53
10	H00027	银河娱乐	4,004,301.70	4.93
11	H00981	中芯国际	3,786,240.25	4.66
12	H00520	呷哺呷哺	3,407,034.34	4.19
13	H00880	澳博控股	3,333,886.57	4.10
14	H01776	广发证券	3,281,146.30	4.04
15	H01093	石药集团	3,268,265.33	4.02
16	H06865	福莱特玻璃	3,057,343.84	3.76
17	H01548	金斯瑞生物科技	3,042,226.88	3.74
18	600984	建设机械	3,019,812.60	3.72
19	H06186	中国飞鹤	3,006,736.05	3.70
20	H01833	平安好医生	2,948,116.30	3.63

21	H01211	比亚迪股份	2,902,907.89	3.57
22	H01810	小米集团—W	2,870,264.41	3.53
23	002714	牧原股份	2,684,401.00	3.30
24	603558	健盛集团	2,614,158.00	3.22
25	H00522	ASM PACIFIC	2,610,993.27	3.21
26	H00763	中兴通讯	2,582,155.15	3.18
27	300146	汤臣倍健	2,543,284.00	3.13
28	H00914	海螺水泥	2,361,741.02	2.91
29	H02883	中海油田服务	2,331,689.97	2.87
30	601658	邮储银行	2,185,958.00	2.69
31	H00425	敏实集团	2,111,825.32	2.60
32	H00338	上海石油化工股份	2,043,801.58	2.51
33	H01772	赣锋锂业	1,965,442.31	2.42
34	H02689	玖龙纸业	1,934,272.66	2.38
35	H00288	万洲国际	1,904,766.30	2.34
36	H02238	广汽集团	1,897,088.30	2.33
37	H02007	碧桂园	1,867,602.28	2.30
38	H02588	中银航空租赁	1,808,427.13	2.22
39	H01347	华虹半导体	1,730,010.03	2.13
40	H00799	IGG	1,716,794.34	2.11
41	300207	欣旺达	1,658,566.00	2.04
42	300010	立思辰	1,648,032.00	2.03

“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	171,494,452.44
卖出股票收入（成交）总额	184,560,814.30

“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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

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，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现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，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情景。

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	57,899.45
2	应收证券清算款	442,174.98
3	应收股利	188,789.61
4	应收利息	3,429.18



5	应收申购款	474,210.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,166,503.29

#### 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

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
中融 沪港 深大 消费 主题A	1,822	21,871.83	10,100,110.16	25.35%	29,750,373.13	74.65%
中融 沪港 深大 消费 主题C	2,206	17,071.09	-	-	37,658,826.05	100.00%

合计	4,028	19,242.63	10,100,110.16	13.03%	67,409,199.18	86.97%
----	-------	-----------	---------------	--------	---------------	--------

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中融沪港深大消费主题A	38,410.36	0.10%
	中融沪港深大消费主题C	1,214.22	0.00%
	合计	39,624.58	0.05%

## 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。

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,200.02	12.90%	10,000,200.02	12.90%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-

基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,200.02	12.90%	10,000,200.02	12.90%	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中融沪港深大消费主题 A	中融沪港深大消费主题 C
基金合同生效日(2017年11月16日)基金份额总额	109,332,429.46	189,624,239.88
本报告期期初基金份额总额	47,254,156.32	47,264,568.50
本报告期基金总申购份额	6,820,273.28	8,343,690.95
减：本报告期基金总赎回份额	14,223,946.31	17,949,433.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	39,850,483.29	37,658,826.05

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	
万联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	356,055,266.74	100.00%	223,211.02	100.00%	-

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。

## 10.8 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暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-21
3	中融基金管理有限公司关于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暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-31
4	中融基金管理有限公司关于因2020年春节假期延长调整旗下基金相关业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-31
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	中融基金管理有限公司关于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暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-09
11	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
12	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	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22

	优惠活动的公告		
13	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
14	中融基金管理有限公司关于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暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-24
15	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券华南股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-06
16	中融基金管理有限公司关于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暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-23
17	中融基金管理有限公司关于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暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-24
18	中融基金管理有限公司关于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暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-24
19	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-30

## § 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沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的文件

(2) 《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基金合同》

(3) 《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招募说明书》

(4) 《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