

中金量化多策略灵活配置混合型证券投资  
基金  
2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
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.....	17
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	54
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	55
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	59
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>61</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	61

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中金量化多策略
基金主代码	003582
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 10 日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	166,831,222.54 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在严格控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金的量化选股模型在注重基本面研究的同时，结合多种统计量化策略，主要包括多因子模型和统计套利模型等多种量化策略。本基金在股票投资过程中将保持模型选股并构建股票投资组合的投资策略，强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险，力争基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型证券投资基金，高于债券型证券投资基金和货币市场基金。

### 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		中金基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李虹	李申
	联系电话	010-63211122	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-868-1166	021-60637111
传真		010-66159121	021-60635778
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100004	100033

法定代表人	楚钢	田国立
-------	----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	19,788,860.50
本期利润	27,500,777.90
加权平均基金份额本期利润	0.1688
本期加权平均净值利润率	15.29%
本期基金份额净值增长率	15.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	22,572,277.11
期末可供分配基金份额利润	0.1353
期末基金资产净值	199,104,355.91
期末基金份额净值	1.193
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	38.06%

注：1、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；

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数；

#### 3.2 基金净值表现

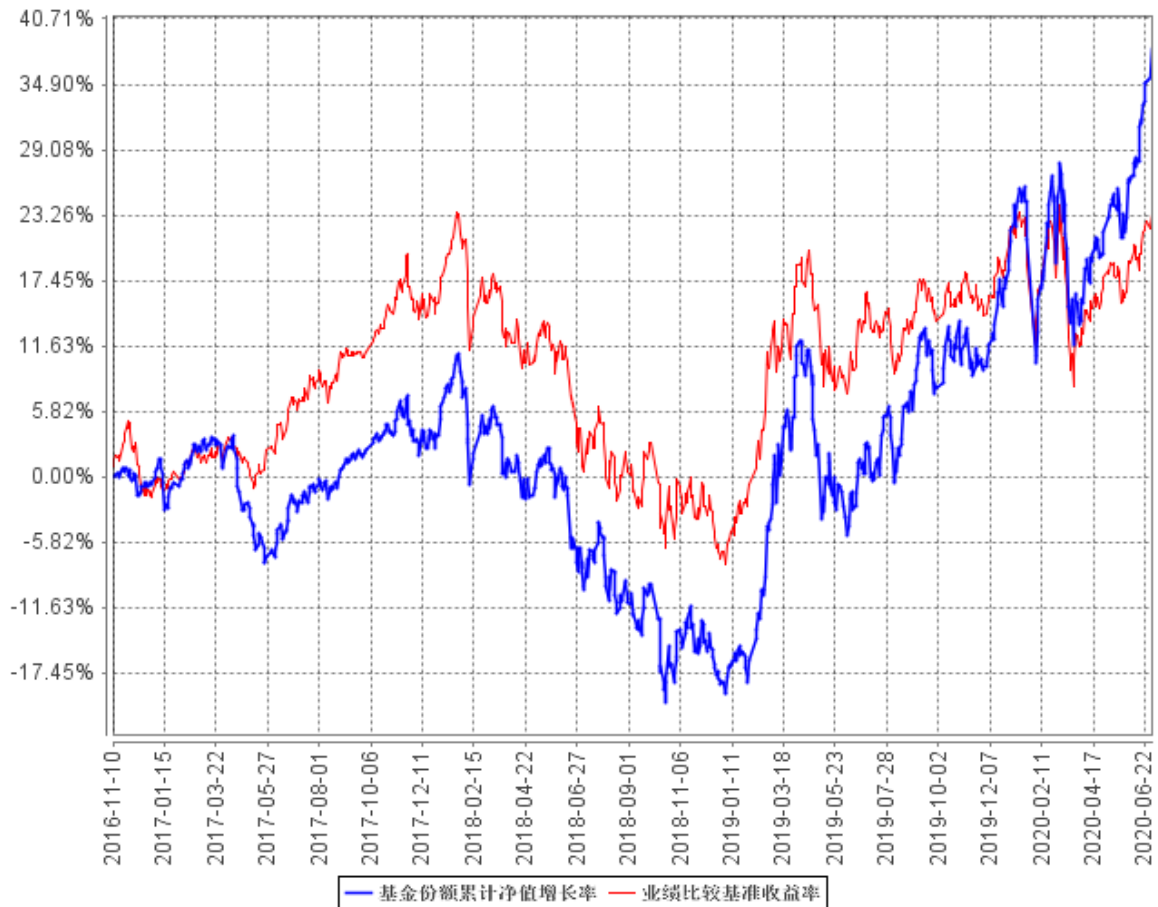
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	12.26%	0.90%	5.93%	0.71%	6.33%	0.19%
过去三个月	20.94%	0.98%	10.20%	0.72%	10.74%	0.26%
过去六个月	15.90%	1.60%	2.06%	1.21%	13.84%	0.39%
过去一年	37.65%	1.33%	8.49%	0.97%	29.16%	0.36%
过去三年	40.88%	1.22%	15.34%	1.00%	25.54%	0.22%
自基金合同生效起至今	38.06%	1.13%	23.34%	0.93%	14.72%	0.20%



### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 4 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司共管理 32 只开放式基金，证券投资基金管理规模 320.30 亿元。

#### 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		
刘重晋	本基金基金经理	2017 年 8 月 2 日	-	9 年	刘重晋先生，理学博士。历任松河投资咨询（深圳）有限公司副总经理、量化研究员。2017 年 4 月加入中金基金管理有限公司，现任量化公募投资部基金经理。
闫雯雯	本基金基金经理助理	2017 年 8 月 24 日	-	12 年	闫雯雯女士，管理学硕士。曾任泰康资产管理有限公司国际投资部、信用评估部研究员，现任中金基金管理有限公司固定收益研究主管。

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。

2、证券从业的含义遵从《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

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等相关法律法规和基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高

效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年中国及全球经济受新冠疫情的冲击，经济增速普遍大幅下滑，当下新冠疫情海外蔓延态势不减，权益市场抱团盈利确定性较高的必选消费及中长期行业景气度较高的科技板块。一季度，由于国内外疫情的影响，海外及 A 股市场都发生了大幅度的波动，市场整体有一定幅度下跌。二季度内，由于疫情趋于平稳，伴随对应经济支持政策，A 股市场整体呈现上涨行情。上半年，沪深 300 指数由 4096 上涨 1.64%至 4163 点，中证 500 指数由 5267 点上涨 11.33%至 5864.42 点。

本基金仍然采用量化选股的投资策略，在不同的维度上进行投资组合的构建，利用基本面指标、技术面指标及情绪面指标等综合确定组合权重。今年以来，由于市场波动加大，模型加强了风险暴露的控制，同时对于主板及科创板的新股申购积极参与，力图进一步获取收益。接下来，我们会密切监控市场变化以及策略表现，积极应对，在控制风险的同时尽可能获得更好的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.193 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.90%，业绩比较基准收益率为 2.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一季度，经济修复仍在途中。国内来看，地产、基建投资持续回升，地产销售端也在不断回暖。上半年由于疫情影响，项目开工缓慢，伴随国内疫情的控制，下半年稳增长政策下，基建作为主要抓手，有望进一步发力。工业品价格持续反弹，也预示着经济的持续修复。外需来看，目前在逐步好转。欧美经济已经复工，尽管复工后海外新增病例又创新高，但欧美稳增长的迫切性决定复工复产是主基调。当下经济仍处于修复期，货币政策延续宽松的格局，有利于经济的修复。宏观流动性的充裕有利于推动资金向股市微观流动性传导，权益市场流动性格局较好有望推动 A 股估值上升。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，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，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会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。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的基金管理人于 2020 年 6 月 18 日发布《中金基金管理有限公司关于中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第一次分红公告》，收益分配基准日为 2020 年 6 月 12 日，本次基金每 10 份基金份额发放现金红利 0.5600 元。

具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金实施利润分配 8,990,090.63 元。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	2,400,982.94	1,111,528.36
结算备付金		3,122,429.60	1,403,507.90
存出保证金		80,933.54	63,673.53
交易性金融资产	6.4.6.2	196,118,693.90	179,657,754.42
其中：股票投资		180,606,376.40	170,107,632.82
基金投资		-	-
债券投资		15,512,317.50	9,550,121.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
应收证券清算款		986,037.43	1,441,927.59
应收利息	6.4.6.5	425,418.10	192,531.15
应收股利		-	-
应收申购款		10,467.29	2,995.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		203,144,962.80	183,873,918.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 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	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,100,000.00	1,600,000.00
应付证券清算款		794,357.37	1,389,244.19
应付赎回款		672,656.06	3,838.15
应付管理人报酬		232,611.81	219,380.62
应付托管费		38,768.64	36,563.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	1,111,114.18	700,482.27
应交税费		0.57	-

应付利息		-	-135.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	91,098.26	79,002.55
负债合计		4,040,606.89	4,028,375.56
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.6.9	166,831,222.54	166,575,645.09
未分配利润	6.4.6.10	32,273,133.37	13,269,897.80
所有者权益合计		199,104,355.91	179,845,542.89
负债和所有者权益总计		203,144,962.80	183,873,918.45

报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.193 元，基金份额总额 166,831,222.54 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		32,845,150.02	32,990,863.54
1.利息收入		312,819.21	144,011.08
其中：存款利息收入	6.4.6.11	26,768.55	17,810.36
债券利息收入		286,050.66	126,170.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	30.30
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,811,694.65	27,185,586.61
其中：股票投资收益	6.4.6.12	23,414,178.44	25,586,483.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	42,892.06	9,153.93
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-	-
衍生工具收益	6.4.6.15	-	-180.00
股利收益	6.4.6.16	1,354,624.15	1,590,129.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	7,711,917.40	5,660,827.93
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	8,718.76	437.92
<b>减：二、费用</b>		5,344,372.12	3,957,267.50
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	1,344,094.72	1,121,714.06
2. 托管费	6.4.9.2.2	224,015.77	186,952.37

3. 销售服务费	6.4.9.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.6.19	3,593,743.74	2,520,569.91
5. 利息支出		79,129.36	62,258.11
其中：卖出回购金融资产支出		79,129.36	62,258.11
6. 税金及附加		0.21	0.71
7. 其他费用	6.4.6.20	103,388.32	65,772.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		27,500,777.90	29,033,596.04
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		27,500,777.90	29,033,596.04

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	166,575,645.09	13,269,897.80	179,845,542.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,500,777.90	27,500,777.90
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）	255,577.45	492,548.30	748,125.75
其中：1. 基金申购款	7,132,562.12	955,123.76	8,087,685.88
2. 基金赎回款	-6,876,984.67	-462,575.46	-7,339,560.13
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）	-	-8,990,090.63	-8,990,090.63
五、期末所有者权益（基金净值）	166,831,222.54	32,273,133.37	199,104,355.91
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		



	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	156,039,802.60	-28,543,525.69	127,496,276.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	29,033,596.04	29,033,596.04
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)	14,078.33	-1,726.26	12,352.07
其中：1.基金申购款	85,089.73	1,200.10	86,289.83
2.基金赎回款	-71,011.40	-2,926.36	-73,937.76
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)	156,053,880.93	488,344.09	156,542,225.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

          孙菁                                          张纳                                          白娜            
 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

中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2016 年 6 月 27 日证监许可 [2016] 1415 号《关于准予中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式混合型证券投资基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称：“建设银行”）。

本基金通过中金基金管理有限公司直销中心、中金基金网上直销平台、中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）及北京肯特瑞财富投资管理有限公司等共同销售，自 2016 年 11

月 2 日起至 2016 年 11 月 7 日止。经向中国证监会备案,《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 10 日正式生效,合同生效日基金实收份额为 200,107,412.33 份,发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转换债券)、次级债、短期融资券、中期票据等)、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日及 2017 年 6 月 30 日的财务状况、自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 差错更正的说明

本基金本报告期间未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部 国家税务总局 证监会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 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《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 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 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 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(2) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称“营改增”）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称“管理人”）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(3) 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、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续

暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。

(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) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 6.4.6 重要财务报表项目的说明

### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	2,400,982.94
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：	2,400,982.94

### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	167,083,286.28	180,606,376.40	13,523,090.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	10,565,835.70	10,506,317.50
	银行间市场	5,028,860.00	5,006,000.00
	合计	15,594,695.70	15,512,317.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	182,677,981.98	196,118,693.90	13,440,711.92

### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.6.4 买入返售金融资产

##### 6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	453.32
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	1,405.10
应收债券利息	423,523.18
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	36.50
合计	425,418.10

#### 6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,110,951.68
银行间市场应付交易费用	162.50
合计	1,111,114.18

#### 6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,535.14
应付证券出借违约金	-
预提费用	88,563.12
合计	91,098.26

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	166,575,645.09	166,575,645.09
本期申购	7,132,562.12	7,132,562.12
本期赎回(以“-”号填列)	-6,876,984.67	-6,876,984.67
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	166,831,222.54	166,831,222.54

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.6.10 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	11,783,651.00	1,486,246.80	13,269,897.80
本期利润	19,788,860.50	7,711,917.40	27,500,777.90
本期基金份额交易产生的变动数	-10,143.76	502,692.06	492,548.30
其中：基金申购款	813,776.03	141,347.73	955,123.76
基金赎回款	-823,919.79	361,344.33	-462,575.46
本期已分配利润	-8,990,090.63	-	-8,990,090.63
本期末	22,572,277.11	9,700,856.26	32,273,133.37

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,599.47
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	20,608.71
其他	560.37
合计	26,768.55

#### 6.4.6.12 股票投资收益

##### 6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,360,688,984.69
减：卖出股票成本总额	1,337,274,806.25
买卖股票差价收入	23,414,178.44

#### 6.4.6.13 债券投资收益

##### 6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6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	42,892.06
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	42,892.06

##### 6.4.6.13.2 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1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	15,990,853.08
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	15,500,860.80

减：应收利息总额	447,100.22
----------	------------

### 6.4.6.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.6.14 贵金属投资收益

#### 6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.4.6.15 衍生工具收益

#### 6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

#### 6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无投资其他衍生工具。

### 6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,354,624.15
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	1,354,624.15

### 6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	7,711,917.40
——股票投资	7,808,205.40
——债券投资	-96,288.00
——资产支持证券投资	-
——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	7,711,917.40

#### 6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	2,962.97
转换费收入	5,755.79
合计	8,718.76

#### 6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	3,593,418.74
银行间市场交易费用	325.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
股指期货交易费用	-
合计	3,593,743.74

#### 6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	5,225.20
帐户维护费	18,600.00
其他	-
合计	103,388.32

## 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

## 6.4.8 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
建设银行	基金托管人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（“中金财富证券”，原“中国中投证券有限责任公司”）	基金管理人股东的一级全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.9.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	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 成交总额的比例
中金公司	-	-	99,300.00	0.37%

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 6.4.9.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期与上年度可比期间无关联方权证交易。

### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间均无应付关联方的佣金。

## 6.4.9.2 关联方报酬

### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,344,094.72	1,121,714.06
其中：支付销售机构的客户维护费	644.74	54.43

注：支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数。

### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	224,015.77	186,952.37

注：支付基金托管人建设银行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。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。

### 6.4.9.2.3 销售服务费

本基金本报告期无销售服务费。

## 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期本基金未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.9.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金在本期及上期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人无运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.9.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.9.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	2,400,982.94	5,599.47	1,165,360.79	2,845.17

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中金公司	688100	威胜信息	网下新股发行	8,326	114,732.28
中金公司	688158	优刻得	网下新股发行	5,865	194,893.95
中金公司	688266	泽璟制药	网下新股发行	9,886	333,751.36
中金公司	688200	华峰测控	网下新股发行	1,260	135,336.60
中金公司	300825	阿尔特	网下新股发行	1,642	10,081.88
中金公司	688222	成都先导	网下新股发行	5,534	113,557.68
中金公司	688365	光云科技	网下新股发行	8,249	89,089.20
中金公司	300831	派瑞股份	网下新股发行	1,716	6,829.68
中金公司	688505	复旦张江	网下新股发行	9,135	81,758.25
中金公司	688520	神州细胞	网下新股发行	4,803	123,148.92

注：本基金上年度可比期未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

## 6.4.10 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2020年6月18日	-	2020年6月18日	0.5600	1,200,739.45	7,789,351.18	8,990,090.63	
合计	-	-	-	0.5600	1,200,739.45	7,789,351.18	8,990,090.63	

## 6.4.11 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.11.1 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
688277	天智航	2020年6月24日	2020年7月7日	新股流 通受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股流 通受限	11.33	11.33	8,284	93,857.72	93,857.72	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股流 通受限	36.18	36.18	2,358	85,312.44	85,312.44	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股流 通受限	15.50	15.50	5,286	81,933.00	81,933.00	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股流 通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流 通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流 通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月	新股流 通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-

		日	8 日								
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47		-
688398	赛特新材	2020 年 2 月 3 日	2020 年 8 月 11 日	新股流通受限	24.12	54.47	3,246	78,293.52	176,809.62		-
688516	奥特维	2020 年 5 月 14 日	2020 年 11 月 23 日	新股流通受限	23.28	43.10	3,440	80,083.20	148,264.00		-
688178	万德斯	2020 年 1 月 6 日	2020 年 7 月 14 日	新股流通受限	25.20	39.90	3,493	88,023.60	139,370.70		-
002500	山西证券	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 10 日	增发流通受限	5.00	6.54	58,350	291,750.00	381,609.00		-

## 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 年 6 月 11 日	2020 年 7 月 16 日	新债未上市	100.00	100.00	672	67,200.00	67,200.00	-
128112	歌尔转 2	2020 年 6 月 11 日	2020 年 7 月 13 日	新债未上市	100.00	100.00	458	45,800.00	45,800.00	-

## 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603157	*ST 拉夏	2020 年 6 月 30 日	实行退市风险警示	3.06	2020 年 7 月 1 日	4.88	100	488.26	306.00	-

### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

### 6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.12 金融工具风险及管理

### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述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对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制控制在合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

### 6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

**6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

**6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

**6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

**6.4.12.2.4 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6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	113,000.00	-
未评级	-	-
合计	113,000.00	-

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

**6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

**6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

**6.4.12.3 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。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，针对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性风险预警及危机的处理、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性风险指标进行监控。

**6.4.12.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析****6.4.12.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

#### 6.4.12.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,400,982.94	-	-	-	2,400,982.94
结算备付金	3,122,429.60	-	-	-	3,122,429.60
存出保证金	80,933.54	-	-	-	80,933.54
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	180,606,376.40	180,606,376.40
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	15,195,261.00	-	317,056.50	-	15,512,317.50
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	986,037.43	986,037.43
应收利息	-	-	-	425,418.10	425,418.10
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	10,467.29	10,467.29
资产总计	20,799,607.08	-	317,056.50	182,028,299.22	203,144,962.80
负债					
卖出回购金融资产款	1,100,000.00	-	-	-	1,100,000.00
应付证券清算款	-	-	-	794,357.37	794,357.37
应付赎回款	-	-	-	672,656.06	672,656.06
应付管理人报酬	-	-	-	232,611.81	232,611.81
应付托管费	-	-	-	38,768.64	38,768.64
应付交易费用	-	-	-	1,111,114.18	1,111,114.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.57	0.57
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	91,098.26	91,098.26
负债总计	1,100,000.00	-	-	2,940,606.89	4,040,606.89
利率敏感度缺口	19,699,607.08	-	317,056.50	179,087,692.33	199,104,355.91
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	1,111,528.36	-	-	-	1,111,528.36
结算备付金	1,403,507.90	-	-	-	1,403,507.90
存出保证金	63,673.53	-	-	-	63,673.53
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	170,107,632.82	170,107,632.82
交易性金融资产-债券投资	9,550,121.60	-	-	-	9,550,121.60
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,441,927.59	1,441,927.59
应收利息	-	-	-	192,531.15	192,531.15
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,995.50	2,995.50
资产总计	12,128,831.39	-	-	171,745,087.06	183,873,918.45
负债					
卖出回购金融资产款	1,600,000.00	-	-	-	1,600,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1,389,244.19	1,389,244.19
应付赎回款	-	-	-	3,838.15	3,838.15
应付管理人报酬	-	-	-	219,380.62	219,380.62
应付托管费	-	-	-	36,563.45	36,563.45
应付交易费用	-	-	-	700,482.27	700,482.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-135.67	-135.67
其他负债	-	-	-	79,002.55	79,002.55
负债总计	1,600,000.00	-	-	2,428,375.56	4,028,375.56
利率敏感度缺口	10,528,831.39	-	-	169,316,711.50	179,845,542.89

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。

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	13,645.99	6,599.69
市场利率上升 25 个基点	-13,645.99	-6,599.69	

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.12.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 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	180,606,376.40	90.71	170,107,632.82	94.59
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	15,512,317.50	7.79	9,550,121.60	5.31
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	196,118,693.90	98.50	179,657,754.42	99.90

#### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	12,015,011.82	10,050,745.36
	业绩比较基准下降 5%	-12,015,011.82	-10,050,745.36

#### 6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	180,606,376.40	88.91
	其中：股票	180,606,376.40	88.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,512,317.50	7.64
	其中：债券	15,512,317.50	7.64
	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	5,523,412.54	2.72
8	其他各项资产	1,502,856.36	0.74
9	合计	203,144,962.80	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	839,727.45	0.42
B	采矿业	2,938,766.93	1.48
C	制造业	123,569,505.68	62.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,873,081.32	1.95
E	建筑业	1,176,241.30	0.59
F	批发和零售业	12,609,953.80	6.33
G	交通运输、仓储和邮政业	2,965,648.45	1.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,041,658.16	6.05
J	金融业	6,064,061.50	3.05
K	房地产业	5,343,178.93	2.68
L	租赁和商务服务业	3,324,332.06	1.67
M	科学研究和技术服务业	1,469,811.00	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	139,370.70	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,626,037.00	1.32
R	文化、体育和娱乐业	1,625,002.12	0.82
S	综合	-	-
	合计	180,606,376.40	90.71

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600809	山西汾酒	25,100	3,639,500.00	1.83
2	000799	酒鬼酒	39,400	3,014,494.00	1.51
3	002568	百润股份	65,100	2,950,332.00	1.48
4	002415	海康威视	94,200	2,858,970.00	1.44
5	600201	生物股份	97,700	2,719,968.00	1.37
6	600519	贵州茅台	1,800	2,633,184.00	1.32
7	000858	五粮液	15,200	2,601,024.00	1.31
8	002304	洋河股份	24,300	2,554,902.00	1.28
9	000513	丽珠集团	47,600	2,285,276.00	1.15
10	002223	鱼跃医疗	60,400	2,198,560.00	1.10
11	603233	大参林	26,640	2,163,700.80	1.09
12	000661	长春高新	4,900	2,132,970.00	1.07
13	002001	新和成	67,459	1,963,056.90	0.99
14	603658	安图生物	11,900	1,933,036.00	0.97
15	600882	妙可蓝多	51,900	1,883,451.00	0.95
16	600298	安琪酵母	31,300	1,548,724.00	0.78
17	601888	中国中免	9,100	1,401,673.00	0.70
18	002439	启明星辰	33,100	1,392,517.00	0.70
19	002273	水晶光电	80,900	1,386,626.00	0.70
20	300088	长信科技	122,500	1,372,000.00	0.69
21	002555	三七互娱	28,700	1,343,160.00	0.67
22	002557	洽洽食品	24,600	1,333,074.00	0.67
23	002353	杰瑞股份	42,630	1,321,530.00	0.66
24	603444	吉比特	2,400	1,317,624.00	0.66
25	300482	万孚生物	12,400	1,289,600.00	0.65

26	600998	九州通	69,199	1,288,485.38	0.65
27	002688	金河生物	187,800	1,273,284.00	0.64
28	603939	益丰药房	13,300	1,210,300.00	0.61
29	300497	富祥药业	61,300	1,199,641.00	0.60
30	600383	金地集团	86,956	1,191,297.20	0.60
31	600138	中青旅	120,570	1,190,025.90	0.60
32	603605	珀莱雅	6,500	1,170,130.00	0.59
33	600885	宏发股份	29,135	1,168,896.20	0.59
34	603456	九洲药业	43,000	1,165,300.00	0.59
35	300558	贝达药业	8,300	1,161,834.00	0.58
36	600276	恒瑞医药	12,520	1,155,596.00	0.58
37	600845	宝信软件	19,500	1,152,060.00	0.58
38	002661	克明面业	49,500	1,147,410.00	0.58
39	002847	盐津铺子	12,000	1,142,640.00	0.57
40	603866	桃李面包	22,400	1,139,936.00	0.57
41	002216	三全食品	47,000	1,123,300.00	0.56
42	002019	亿帆医药	48,800	1,120,936.00	0.56
43	002174	游族网络	42,900	1,118,832.00	0.56
44	603707	健友股份	17,300	1,117,061.00	0.56
45	600380	健康元	68,200	1,107,568.00	0.56
46	600486	扬农化工	13,341	1,100,632.50	0.55
47	603719	良品铺子	15,000	1,100,400.00	0.55
48	601799	星宇股份	8,593	1,091,311.00	0.55
49	002078	太阳纸业	114,200	1,087,184.00	0.55
50	300115	长盈精密	46,400	1,060,240.00	0.53
51	600908	无锡银行	213,500	1,048,285.00	0.53
52	600153	建发股份	127,500	1,032,750.00	0.52
53	002640	跨境通	158,900	1,031,261.00	0.52
54	002080	中材科技	65,500	1,015,250.00	0.51
55	000750	国海证券	233,500	1,013,390.00	0.51
56	300433	蓝思科技	35,600	998,224.00	0.50
57	002241	歌尔股份	33,200	974,752.00	0.49
58	000090	天健集团	140,900	973,619.00	0.49
59	601966	玲珑轮胎	48,001	969,620.20	0.49
60	600875	东方电气	109,533	969,367.05	0.49
61	300628	亿联网络	14,200	969,292.00	0.49
62	300133	华策影视	133,300	966,425.00	0.49
63	000738	航发控制	70,800	966,420.00	0.49
64	600060	海信视像	79,500	965,925.00	0.49

65	000800	一汽轿车	89,800	964,452.00	0.48
66	600745	闻泰科技	7,600	957,220.00	0.48
67	603816	顾家家居	21,200	954,212.00	0.48
68	000598	兴蓉环境	206,100	948,060.00	0.48
69	300529	健帆生物	13,640	947,980.00	0.48
70	000778	新兴铸管	275,400	944,622.00	0.47
71	601975	招商南油	393,400	940,226.00	0.47
72	002583	海能达	123,600	938,124.00	0.47
73	000930	中粮科技	136,800	934,344.00	0.47
74	300677	英科医疗	7,300	932,940.00	0.47
75	300639	凯普生物	17,800	924,354.00	0.46
76	600763	通策医疗	5,500	917,235.00	0.46
77	002444	巨星科技	76,800	912,384.00	0.46
78	002064	华峰氨纶	179,900	912,093.00	0.46
79	600125	铁龙物流	163,400	911,772.00	0.46
80	002244	滨江集团	213,300	910,791.00	0.46
81	603486	科沃斯	30,100	909,321.00	0.46
82	600639	浦东金桥	56,900	909,262.00	0.46
83	000807	云铝股份	208,200	907,752.00	0.46
84	601958	金钼股份	146,400	904,752.00	0.45
85	603882	金域医学	10,100	903,950.00	0.45
86	002434	万里扬	103,800	900,984.00	0.45
87	688139	海尔生物	16,059	900,267.54	0.45
88	601717	郑煤机	152,300	897,047.00	0.45
89	603368	柳药股份	39,080	896,886.00	0.45
90	600751	海航科技	284,400	890,172.00	0.45
91	600511	国药股份	21,800	886,606.00	0.45
92	300017	网宿科技	104,000	882,960.00	0.44
93	002500	山西证券	134,450	879,303.00	0.44
94	000718	苏宁环球	283,950	877,405.50	0.44
95	600901	江苏租赁	166,500	867,465.00	0.44
96	002416	爱施德	120,000	861,600.00	0.43
97	600657	信达地产	207,600	855,312.00	0.43
98	000600	建投能源	168,000	855,120.00	0.43
99	603799	华友钴业	22,000	854,920.00	0.43
100	601012	隆基股份	20,800	847,184.00	0.43
101	601016	节能风电	398,300	844,396.00	0.42
102	002916	深南电路	5,040	844,300.80	0.42
103	600183	生益科技	28,687	839,668.49	0.42



104	000937	冀中能源	275,600	832,312.00	0.42
105	600874	创业环保	124,700	828,008.00	0.42
106	603556	海兴电力	57,100	824,524.00	0.41
107	603056	德邦股份	60,800	822,624.00	0.41
108	300014	亿纬锂能	17,180	822,063.00	0.41
109	600760	中航沈飞	24,900	817,218.00	0.41
110	002624	完美世界	14,000	806,960.00	0.41
111	600549	厦门钨业	68,100	806,304.00	0.40
112	600570	恒生电子	7,480	805,596.00	0.40
113	603256	宏和科技	70,400	805,376.00	0.40
114	300347	泰格医药	7,900	804,852.00	0.40
115	603899	晨光文具	14,700	802,620.00	0.40
116	000157	中联重科	122,700	788,961.00	0.40
117	002841	视源股份	7,900	786,208.00	0.39
118	600066	宇通客车	64,200	783,240.00	0.39
119	601808	中海油服	59,600	783,144.00	0.39
120	002271	东方雨虹	18,900	767,907.00	0.39
121	000712	锦龙股份	61,400	767,500.00	0.39
122	603986	兆易创新	3,200	754,912.00	0.38
123	601615	明阳智能	59,800	744,510.00	0.37
124	002463	沪电股份	29,800	744,404.00	0.37
125	002027	分众传媒	128,400	715,188.00	0.36
126	600022	山东钢铁	536,300	691,827.00	0.35
127	601098	中南传媒	62,200	658,076.00	0.33
128	002050	三花智控	30,010	657,219.00	0.33
129	002705	新宝股份	17,600	642,048.00	0.32
130	600588	用友网络	14,400	635,040.00	0.32
131	600720	祁连山	38,300	622,375.00	0.31
132	603712	七一二	16,100	617,918.00	0.31
133	000672	上峰水泥	26,000	613,860.00	0.31
134	002410	广联达	8,800	613,360.00	0.31
135	600802	福建水泥	56,200	610,332.00	0.31
136	600572	康恩贝	109,400	601,700.00	0.30
137	002567	唐人神	62,700	596,904.00	0.30
138	300459	金科文化	169,000	583,050.00	0.29
139	300122	智飞生物	5,800	580,870.00	0.29
140	000403	双林生物	7,800	578,214.00	0.29
141	300285	国瓷材料	16,900	566,319.00	0.28
142	603258	电魂网络	9,900	550,044.00	0.28

143	000717	韶钢松山	142,000	539,600.00	0.27
144	002714	牧原股份	6,550	537,100.00	0.27
145	002385	大北农	58,100	529,291.00	0.27
146	300031	宝通科技	20,900	523,336.00	0.26
147	002373	千方科技	21,100	506,189.00	0.25
148	603127	昭衍新药	4,700	494,111.00	0.25
149	603259	药明康德	5,100	492,660.00	0.25
150	002601	龙蟠佰利	26,500	490,250.00	0.25
151	002605	姚记科技	12,900	490,200.00	0.25
152	300759	康龙化成	4,900	482,160.00	0.24
153	000977	浪潮信息	12,300	481,914.00	0.24
154	002414	高德红外	16,039	469,621.92	0.24
155	688396	华润微	10,295	447,214.80	0.22
156	603883	老百姓	4,400	440,176.00	0.22
157	300782	卓胜微	1,080	438,231.60	0.22
158	600584	长电科技	13,900	434,653.00	0.22
159	603317	天味食品	7,800	433,524.00	0.22
160	300327	中颖电子	13,350	432,540.00	0.22
161	300373	扬杰科技	12,900	432,408.00	0.22
162	000625	长安汽车	39,200	431,200.00	0.22
163	600811	东方集团	90,800	401,336.00	0.20
164	000876	新希望	13,000	387,400.00	0.19
165	002128	露天煤业	49,759	385,632.25	0.19
166	002839	张家港行	64,000	368,640.00	0.19
167	600748	上实发展	69,393	354,598.23	0.18
168	603920	世运电路	13,300	329,707.00	0.17
169	300476	胜宏科技	13,700	329,485.00	0.17
170	603228	景旺电子	9,320	327,970.80	0.16
171	000050	深天马 A	19,800	304,128.00	0.15
172	603019	中科曙光	7,800	299,520.00	0.15
173	600597	光明乳业	18,000	267,480.00	0.13
174	600999	招商证券	11,700	256,815.00	0.13
175	601066	中信建投	6,300	248,094.00	0.12
176	601688	华泰证券	12,900	242,520.00	0.12
177	000656	金科股份	29,600	241,536.00	0.12
178	002138	顺络电子	9,400	234,530.00	0.12
179	000987	越秀金控	19,600	228,536.00	0.11
180	603027	千禾味业	6,880	217,270.40	0.11
181	600872	中炬高新	3,700	216,561.00	0.11

182	600216	浙江医药	10,700	206,082.00	0.10
183	600795	国电电力	103,600	191,660.00	0.10
184	600027	华电国际	56,000	191,520.00	0.10
185	300274	阳光电源	13,300	191,387.00	0.10
186	002897	意华股份	5,400	184,950.00	0.09
187	300394	天孚通信	3,100	184,605.00	0.09
188	000063	中兴通讯	4,600	184,598.00	0.09
189	300502	新易盛	2,900	183,048.00	0.09
190	603236	移远通信	880	183,040.00	0.09
191	601138	工业富联	11,900	180,285.00	0.09
192	002041	登海种业	14,073	178,023.45	0.09
193	688398	赛特新材	3,246	176,809.62	0.09
194	300673	佩蒂股份	4,500	174,960.00	0.09
195	300002	神州泰岳	27,800	172,082.00	0.09
196	600557	康缘药业	11,800	164,256.00	0.08
197	300457	赢合科技	5,100	162,588.00	0.08
198	002475	立讯精密	3,110	159,698.50	0.08
199	002402	和而泰	9,700	157,237.00	0.08
200	603983	丸美股份	1,800	154,854.00	0.08
201	002600	领益智造	14,500	154,135.00	0.08
202	600438	通威股份	8,600	149,468.00	0.08
203	688036	传音控股	2,099	149,029.00	0.07
204	688516	奥特维	3,440	148,264.00	0.07
205	002142	宁波银行	5,400	141,858.00	0.07
206	688178	万德斯	3,493	139,370.70	0.07
207	600195	中牧股份	8,000	129,840.00	0.07
208	300119	瑞普生物	5,800	129,630.00	0.07
209	600598	北大荒	7,700	123,970.00	0.06
210	688200	华峰测控	423	121,083.75	0.06
211	600004	白云机场	7,800	118,872.00	0.06
212	603708	家家悦	2,400	118,224.00	0.06
213	002594	比亚迪	1,600	114,880.00	0.06
214	002791	坚朗五金	1,200	112,908.00	0.06
215	300737	科顺股份	5,700	112,461.00	0.06
216	002409	雅克科技	2,100	109,557.00	0.06
217	002511	中顺洁柔	4,900	109,270.00	0.05
218	002697	红旗连锁	9,900	108,108.00	0.05
219	601933	永辉超市	11,400	106,932.00	0.05
220	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.05

221	603290	斯达半导	500	104,900.00	0.05
222	300623	捷捷微电	3,400	102,170.00	0.05
223	603501	韦尔股份	500	100,975.00	0.05
224	002135	东南网架	13,600	99,960.00	0.05
225	601390	中国中铁	19,800	99,396.00	0.05
226	002625	光启技术	13,000	94,250.00	0.05
227	688528	秦川物联	8,284	93,857.72	0.05
228	300257	开山股份	7,100	92,797.00	0.05
229	002352	顺丰控股	1,600	87,520.00	0.04
230	688027	国盾量子	2,358	85,312.44	0.04
231	688600	皖仪科技	5,286	81,933.00	0.04
232	000739	普洛药业	3,200	74,528.00	0.04
233	600563	法拉电子	1,200	74,160.00	0.04
234	603338	浙江鼎力	800	60,616.00	0.03
235	600031	三一重工	3,100	58,156.00	0.03
236	603087	甘李药业	559	56,067.70	0.03
237	603566	普莱柯	1,800	49,842.00	0.03
238	300124	汇川技术	1,300	49,387.00	0.02
239	000034	神州数码	1,900	46,246.00	0.02
240	000703	恒逸石化	4,600	41,998.00	0.02
241	002493	荣盛石化	3,300	40,590.00	0.02
242	688019	安集科技	85	32,696.95	0.02
243	603606	东方电缆	2,200	31,988.00	0.02
244	601001	大同煤业	7,900	30,968.00	0.02
245	600406	国电南瑞	1,500	30,375.00	0.02
246	601865	福莱特	1,500	28,200.00	0.01
247	603218	日月股份	1,500	27,450.00	0.01
248	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
249	300185	通裕重工	13,500	26,460.00	0.01
250	002459	晶澳科技	1,400	26,292.00	0.01
251	600893	航发动力	1,100	25,828.00	0.01
252	600765	中航重机	2,500	25,550.00	0.01
253	688015	交控科技	527	23,309.21	0.01
254	601766	中国中车	4,100	22,837.00	0.01
255	300770	新媒股份	100	22,366.00	0.01
256	300454	深信服	100	20,596.00	0.01
257	002387	维信诺	1,400	19,992.00	0.01
258	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
259	688088	虹软科技	200	17,836.00	0.01

260	300750	宁德时代	100	17,436.00	0.01
261	601000	唐山港	7,500	16,725.00	0.01
262	002912	中新赛克	100	16,359.00	0.01
263	000066	中国长城	1,100	14,520.00	0.01
264	002127	南极电商	650	13,760.50	0.01
265	601816	京沪高铁	2,200	13,706.00	0.01
266	600350	山东高速	2,200	13,508.00	0.01
267	000938	紫光股份	300	12,894.00	0.01
268	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
269	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
270	600026	中远海能	1,800	11,628.00	0.01
271	300166	东方国信	934	11,590.94	0.01
272	300037	新宙邦	200	11,012.00	0.01
273	000507	珠海港	2,100	11,004.00	0.01
274	601598	中国外运	3,400	10,982.00	0.01
275	300559	佳发教育	500	10,610.00	0.01
276	002643	万润股份	600	10,302.00	0.01
277	600352	浙江龙盛	800	10,232.00	0.01
278	002709	天赐材料	300	10,137.00	0.01
279	300036	超图软件	400	10,072.00	0.01
280	603916	苏博特	400	10,060.00	0.01
281	300188	美亚柏科	500	9,915.00	0.00
282	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
283	300010	立思辰	500	9,785.00	0.00
284	300755	华致酒行	300	9,720.00	0.00
285	300348	长亮科技	500	9,500.00	0.00
286	603232	格尔软件	300	9,240.00	0.00
287	601689	拓普集团	300	8,370.00	0.00
288	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
289	300496	中科创达	100	7,770.00	0.00
290	603786	科博达	100	7,535.00	0.00
291	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
292	603239	浙江仙通	500	7,410.00	0.00
293	002507	涪陵榨菜	200	7,202.00	0.00
294	603596	伯特利	200	7,040.00	0.00
295	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
296	000338	潍柴动力	500	6,860.00	0.00
297	600633	浙数文化	700	6,846.00	0.00
298	603809	豪能股份	500	6,635.00	0.00

299	000715	中兴商业	1,100	6,611.00	0.00
300	002869	金溢科技	100	6,608.00	0.00
301	603730	岱美股份	200	6,450.00	0.00
302	600660	福耀玻璃	300	6,261.00	0.00
303	000581	威孚高科	300	6,204.00	0.00
304	002920	德赛西威	100	6,133.00	0.00
305	600037	歌华有线	400	6,080.00	0.00
306	002925	盈趣科技	100	5,794.00	0.00
307	300729	乐歌股份	100	5,277.00	0.00
308	600694	大商股份	200	4,798.00	0.00
309	603180	金牌厨柜	100	4,718.00	0.00
310	600787	中储股份	1,000	4,390.00	0.00
311	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
312	603825	华扬联众	100	3,215.00	0.00
313	002324	普利特	200	3,002.00	0.00
314	603506	南都物业	100	2,977.00	0.00
315	603197	保隆科技	100	2,958.00	0.00
316	002929	润建股份	100	2,879.00	0.00
317	002861	瀛通通讯	100	2,727.00	0.00
318	002979	雷赛智能	100	2,697.00	0.00
319	600143	金发科技	200	2,634.00	0.00
320	002732	燕塘乳业	100	2,168.00	0.00
321	002335	科华恒盛	100	2,109.00	0.00
322	603308	应流股份	100	2,040.00	0.00
323	300443	金雷股份	100	1,945.00	0.00
324	000025	特力A	100	1,833.00	0.00
325	603383	顶点软件	40	1,783.60	0.00
326	300660	江苏雷利	100	1,754.00	0.00
327	002262	恩华药业	100	1,686.00	0.00
328	603598	引力传媒	100	1,657.00	0.00
329	603013	亚普股份	100	1,612.00	0.00
330	603038	华立股份	100	1,556.00	0.00
331	603306	华懋科技	100	1,390.00	0.00
332	002462	嘉事堂	100	1,362.00	0.00
333	002884	凌霄泵业	80	1,352.80	0.00
334	300697	电工合金	100	1,331.00	0.00
335	002755	奥赛康	70	1,323.00	0.00
336	002698	博实股份	100	1,275.00	0.00
337	600837	海通证券	100	1,258.00	0.00

338	000985	大庆华科	100	1,235.00	0.00
339	600449	宁夏建材	100	1,222.00	0.00
340	002322	理工环科	100	1,192.00	0.00
341	002835	同为股份	100	1,120.00	0.00
342	603008	喜临门	100	1,073.00	0.00
343	603303	得邦照明	100	1,072.00	0.00
344	300339	润和软件	100	1,037.00	0.00
345	300437	清水源	100	1,030.00	0.00
346	002082	万邦德	100	1,000.00	0.00
347	002084	海鸥住工	110	995.50	0.00
348	002182	云海金属	100	954.00	0.00
349	300428	四通新材	60	907.20	0.00
350	603959	百利科技	100	880.00	0.00
351	600846	同济科技	100	850.00	0.00
352	002632	道明光学	100	847.00	0.00
353	300743	天地数码	50	844.50	0.00
354	300424	航新科技	60	802.80	0.00
355	603100	川仪股份	100	790.00	0.00
356	002081	金螳螂	100	786.00	0.00
357	601828	美凯龙	74	783.66	0.00
358	002606	大连电瓷	100	783.00	0.00
359	000705	浙江震元	108	770.04	0.00
360	600435	北方导航	100	756.00	0.00
361	603801	志邦家居	28	747.32	0.00
362	000529	广弘控股	100	736.00	0.00
363	603803	瑞斯康达	62	724.16	0.00
364	603577	汇金通	70	718.90	0.00
365	603012	创力集团	100	713.00	0.00
366	600830	香溢融通	100	696.00	0.00
367	000878	云南铜业	63	668.43	0.00
368	600727	鲁北化工	100	664.00	0.00
369	601139	深圳燃气	100	650.00	0.00
370	001696	宗申动力	100	644.00	0.00
371	002696	百洋股份	100	634.00	0.00
371	002743	富煌钢构	100	634.00	0.00
372	603223	恒通股份	48	633.12	0.00
373	600353	旭光电子	100	618.00	0.00
374	603926	铁流股份	50	576.50	0.00
375	300569	天能重工	70	571.20	0.00

376	000655	金岭矿业	100	562.00	0.00
377	002571	德力股份	100	561.00	0.00
378	002357	富临运业	100	551.00	0.00
379	600057	厦门象屿	100	548.00	0.00
380	601222	林洋能源	100	546.00	0.00
381	002443	金洲管道	80	544.80	0.00
382	300231	银信科技	60	534.60	0.00
383	600717	天津港	120	530.40	0.00
384	000601	韶能股份	100	527.00	0.00
385	000012	南玻A	100	502.00	0.00
386	000719	中原传媒	72	501.12	0.00
387	600697	欧亚集团	32	496.64	0.00
388	601969	海南矿业	100	488.00	0.00
389	600335	国机汽车	100	462.00	0.00
390	002160	常铝股份	100	440.00	0.00
391	603681	永冠新材	23	422.05	0.00
392	000933	神火股份	100	415.00	0.00
393	600897	厦门空港	23	411.93	0.00
394	600420	现代制药	42	404.46	0.00
395	600382	广东明珠	61	398.94	0.00
396	600643	爱建集团	50	397.50	0.00
397	002546	新联电子	100	393.00	0.00
398	300164	通源石油	100	387.00	0.00
399	000966	长源电力	100	374.00	0.00
400	600282	南钢股份	100	323.00	0.00
401	600297	广汇汽车	100	319.00	0.00
402	603977	国泰集团	40	310.40	0.00
403	002062	宏润建设	70	307.30	0.00
404	603157	拉夏贝尔	100	306.00	0.00
405	603979	金诚信	28	288.68	0.00
406	601326	秦港股份	100	251.00	0.00
407	600761	安徽合力	26	250.64	0.00
408	600742	一汽富维	30	246.60	0.00
409	600968	海油发展	100	233.00	0.00
410	002368	太极股份	5	218.45	0.00
411	002641	永高股份	30	201.30	0.00
412	000828	东莞控股	24	168.00	0.00
413	600189	吉林森工	50	151.00	0.00
414	600798	宁波海运	50	146.00	0.00



415	002004	华邦健康	24	129.12	0.00
416	002533	金杯电工	20	105.60	0.00
417	000619	海螺型材	15	72.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002463	沪电股份	7,446,061.04	4.14
2	002373	千方科技	6,876,665.00	3.82
3	600809	山西汾酒	6,453,006.00	3.59
4	600763	通策医疗	6,297,057.00	3.50
5	002439	启明星辰	6,106,897.00	3.40
6	300347	泰格医药	6,063,720.00	3.37
7	300285	国瓷材料	6,063,638.29	3.37
8	002601	龙鳞佰利	5,935,824.00	3.30
9	603882	金域医学	5,859,998.00	3.26
10	603444	吉比特	5,816,368.99	3.23
11	601799	星宇股份	5,791,138.00	3.22
12	600570	恒生电子	5,600,885.00	3.11
13	300088	长信科技	5,476,584.00	3.05
14	600885	宏发股份	5,206,942.00	2.90
15	603986	兆易创新	5,191,248.50	2.89
16	601966	玲珑轮胎	5,175,209.52	2.88
17	600657	信达地产	5,163,812.38	2.87
18	002244	滨江集团	5,143,569.00	2.86
19	600557	康缘药业	5,133,481.15	2.85
20	300433	蓝思科技	4,701,968.00	2.61
21	601001	大同煤业	4,672,911.00	2.60
22	603899	晨光文具	4,625,490.00	2.57
23	002353	杰瑞股份	4,553,203.36	2.53
24	002555	三七互娱	4,548,977.00	2.53
25	600183	生益科技	4,503,717.00	2.50
26	601615	明阳智能	4,413,416.77	2.45

27	002241	歌尔股份	4,400,898.00	2.45
28	603939	益丰药房	4,366,600.00	2.43
29	000006	深振业 A	4,356,872.00	2.42
30	600201	生物股份	4,322,050.00	2.40
31	600027	华电国际	4,313,321.00	2.40
32	300274	阳光电源	4,311,262.00	2.40
33	000661	长春高新	4,280,941.00	2.38
34	603883	老百姓	4,276,904.00	2.38
35	600908	无锡银行	4,221,485.67	2.35
36	601012	隆基股份	4,216,240.00	2.34
37	300166	东方国信	4,212,933.28	2.34
38	000937	冀中能源	4,176,703.00	2.32
39	600875	东方电气	4,169,323.77	2.32
40	002416	爱施德	4,115,203.00	2.29
41	600639	浦东金桥	4,108,563.00	2.28
42	601877	正泰电器	4,094,955.00	2.28
43	002568	百润股份	4,084,243.00	2.27
44	603556	海兴电力	4,035,888.38	2.24
45	002273	水晶光电	3,990,471.00	2.22
46	002797	第一创业	3,965,027.60	2.20
47	300418	昆仑万维	3,945,063.39	2.19
48	000799	酒鬼酒	3,938,804.00	2.19
49	603707	健友股份	3,930,349.00	2.19
50	002714	牧原股份	3,917,221.70	2.18
51	300383	光环新网	3,881,770.00	2.16
52	603233	大参林	3,877,954.00	2.16
53	600436	片仔癀	3,855,273.00	2.14
54	002415	海康威视	3,824,720.00	2.13
55	600588	用友网络	3,779,136.10	2.10
56	600808	马钢股份	3,728,621.00	2.07
57	002414	高德红外	3,707,189.16	2.06
58	600745	闻泰科技	3,703,123.00	2.06
59	002387	维信诺	3,692,198.00	2.05
60	600536	中国软件	3,662,461.00	2.04
61	300308	中际旭创	3,658,781.15	2.03
62	603858	步长制药	3,650,398.96	2.03

63	000513	丽珠集团	3,643,136.88	2.03
64	600380	健康元	3,602,110.56	2.00
65	600325	华发股份	3,599,065.00	2.00

#### 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	002463	沪电股份	6,687,324.00	3.72
2	002373	千方科技	6,282,470.89	3.49
3	600763	通策医疗	5,819,915.96	3.24
4	300285	国瓷材料	5,818,396.50	3.24
5	000006	深振业 A	5,701,497.00	3.17
6	002601	龙蟠佰利	5,584,227.00	3.11
7	300347	泰格医药	5,455,768.00	3.03
8	600557	康缘药业	5,411,803.81	3.01
9	603882	金域医学	5,375,497.00	2.99
10	601799	星宇股份	5,130,422.60	2.85
11	600570	恒生电子	5,068,197.60	2.82
12	603444	吉比特	4,989,832.00	2.77
13	603986	兆易创新	4,667,105.40	2.60
14	002439	启明星辰	4,660,299.69	2.59
15	601001	大同煤业	4,604,059.00	2.56
16	300433	蓝思科技	4,498,649.00	2.50
17	300274	阳光电源	4,461,592.00	2.48
18	600657	信达地产	4,330,970.00	2.41
19	600885	宏发股份	4,322,916.49	2.40
20	603883	老百姓	4,196,862.96	2.33
21	300088	长信科技	4,186,093.00	2.33
22	002244	滨江集团	4,156,353.00	2.31
23	600027	华电国际	4,154,502.00	2.31
24	601877	正泰电器	4,033,458.00	2.24
25	603899	晨光文具	4,017,445.00	2.23
26	600436	片仔癀	4,002,501.24	2.23
27	300166	东方国信	3,997,672.00	2.22
28	002797	第一创业	3,979,815.00	2.21
29	601966	玲珑轮胎	3,951,326.94	2.20

30	603858	步长制药	3,929,914.14	2.19
31	000027	深圳能源	3,922,701.00	2.18
32	300418	昆仑万维	3,915,903.60	2.18
33	600809	山西汾酒	3,869,290.00	2.15
34	600466	蓝光发展	3,852,871.79	2.14
35	002387	维信诺	3,838,933.00	2.13
36	601615	明阳智能	3,768,323.00	2.10
37	600183	生益科技	3,753,409.75	2.09
38	002127	南极电商	3,744,972.44	2.08
39	601012	隆基股份	3,739,870.34	2.08
40	002807	江阴银行	3,734,902.00	2.08
41	002241	歌尔股份	3,717,154.00	2.07
42	603338	浙江鼎力	3,706,398.95	2.06
43	002353	杰瑞股份	3,673,412.00	2.04
44	600808	马钢股份	3,650,710.00	2.03
45	300383	光环新网	3,609,351.59	2.01
46	600536	中国软件	3,607,405.00	2.01

### 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	1,339,965,344.43
卖出股票收入（成交）总额	1,360,688,984.69

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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	5,210,056.50	2.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,189,261.00	5.12
	其中：政策性金融债	10,189,261.00	5.12
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）	113,000.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	15,512,317.50	7.79
----	----	---------------	------

## 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	101,740	10,189,261.00	5.12
2	190012	19 付息国债 12	50,000	5,006,000.00	2.51
3	019547	16 国债 19	2,150	204,056.50	0.10
4	128115	巨星转债	672	67,200.00	0.03
5	128112	歌尔转 2	458	45,800.00	0.02

## 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投资。

## 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投资。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末，本基金无股指期货投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期末，本基金无国债期货投资。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末，本基金无国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期末，本基金无国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	80,933.54
2	应收证券清算款	986,037.43
3	应收股利	-
4	应收利息	425,418.10
5	应收申购款	10,467.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,502,856.36

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
227	734,939.31	165,495,217.17	99.20%	1,336,005.37	0.80%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	16,336.94	0.0098%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年11月10日）基金份额总额	200,107,412.33
本报告期期初基金份额总额	166,575,645.09
本报告期基金总申购份额	7,132,562.12
减：本报告期基金总赎回份额	6,876,984.67
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	166,831,222.54

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。



## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

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

2020年5月28日，本基金管理人发布公告，公司产生第三届董事会，由以下九名董事组成：楚钢先生、黄劲峰先生、徐翌成先生、孙菁女士、赵璧先生、汤琰女士、冒大卫先生（独立董事）、王元先生（独立董事）、江勇先生（独立董事）。原第二届董事会成员陈刚先生、李永先生、张春先生（独立董事）不再担任公司董事职务。

2020年6月30日，本基金管理人发布公告，邱延冰先生自2020年6月30日起担任公司副总经理，分管公司投资研究业务；李永先生自同日起不再担任公司副总经理。

#### (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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内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

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

### 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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	1,009,010,435.01	37.44%	737,887.80	37.44%	-
长江证券	2	711,781,870.25	26.41%	520,522.72	26.41%	-
天风证券	2	659,942,908.57	24.49%	482,615.08	24.49%	-
平安证券	2	286,743,127.48	10.64%	209,476.23	10.63%	-

东兴证券	2	27,495,060.39	1.02%	20,107.06	1.02%	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	11,413,105.70	71.13%	382,600,000.00	46.30%	-	-
长江证券	4,342,200.60	27.06%	210,900,000.00	25.52%	-	-
天风证券	115,986.50	0.72%	182,700,000.00	22.11%	-	-
平安证券	175,072.80	1.09%	42,400,000.00	5.13%	-	-
东兴证券	-	-	7,800,000.00	0.94%	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 11 日
2	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 11 日
3	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 18 日
4	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 18 日
5	中金基金管理有限公司关于旗下 28 只基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 18 日
6	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同、托管协议	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 18 日
7	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 18 日
8	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书及其摘要（2020 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 21 日
9	关于 2020 年春节假期延长及休市的相关通知	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 31 日
10	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 2 月 12 日
11	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 3 月 21 日
12	中金基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 3 月 21 日
13	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 4 日
14	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 21 日

	告		
15	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告及其摘要	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 21 日
16	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 22 日
17	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 22 日
18	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 23 日
19	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 28 日
20	中金基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 5 月 28 日
21	中金基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、定投申购限额的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 6 月 10 日
22	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 6 月 11 日
23	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 6 月 18 日
24	中金基金管理有限公司关于中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第一次分红公告	中国证监会规定媒介	2020 年 6 月 18 日
25	中金基金管理有限公司副总经理变更公告	中国证监会规定媒介	2020 年 6 月 30 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	110,000,000.00	5,427,312.78	0.00	115,427,312.78	69.19%

#### 产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形。如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，从而可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在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、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、本基金申请募集注册的法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照；
- 7、报告期内本基金在指定媒介上发布的各项公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件和复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日