

---

**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 年年度报告**

2020 年 12 月 31 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:2021 年 03 月 27 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。本年度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据本基金合同规定，于2021年3月23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。

本报告中的财务资料经审计，上会会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2020年1月1日起至2020年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	27
§8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
8.3 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	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
8.6 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	66
8.7 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	66
8.8 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	66
8.9 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	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66

8.12 投资组合报告附注.....	66
§9 基金份额持有人信息.....	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
9.3 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.....	68
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	68
§10 开放式基金份额变动.....	69
§11 重大事件揭示.....	69
11.1 基金份额持有人大会决议.....	69
11.2 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.....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
11.4 基金投资策略的改变.....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
11.8 其他重大事件.....	71
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
12.1 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.....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
§13 备查文件目录.....	75
13.1 备查文件目录.....	75
13.2 存放地点.....	75
13.3 查阅方式.....	75

## § 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	97,710,197.52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	31,849,322.36份	65,860,875.16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	周妹云
	联系电话	010-56517000
	电子邮箱	zhoumeiyun@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号楼17层1701号01室	上海市静安区新闻路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
登载基金年度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>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
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号楼17层1701号01室

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2020年		2019年		2018年	
	中融沪港 深大消费 主题A	中融沪港 深大消费 主题C	中融沪港 深大消费 主题A	中融沪港 深大消费 主题C	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	9,079,77 9.53	8,515,21 8.49	3,464,32 5.64	3,499,33 0.71	-20,828, 652.42	-28,062, 971.69
本期利润	6,505,03 2.25	8,675,17 6.74	8,037,89 8.28	8,997,52 9.96	-22,421, 092.92	-30,716, 984.22
加权平均 基金份额 本期利润	0.1587	0.2038	0.1184	0.1276	-0.2475	-0.2472
本期加权 平均净值 利润率	16.89%	21.64%	14.75%	15.98%	-28.04%	-27.78%
本期基金 份额净值 增长率	21.71%	21.92%	16.13%	15.91%	-25.53%	-25.77%
3.1.2 期末 数据和指 标	2020年末		2019年末		2018年末	
期末可供 分配利润	1,344,90 6.40	2,517,11 4.23	-7,381,4 43.13	-7,604,9 10.52	-22,363, 048.53	-24,842, 969.15
期末可供 分配基金 份额利润	0.0422	0.0382	-0.1562	-0.1609	-0.2575	-0.2601
期末基金 资产净值	33,426,2 26.91	68,862,7 17.12	40,749,5 53.63	40,533,0 33.60	64,470,1 75.25	70,671,0 87.70
期末基金 份额净值	1.0495	1.0456	0.8623	0.8576	0.7425	0.7399

3.1.3 累计 期末指标	2020年末		2019年末		2018年末	
基金份额 累计净值 增长率	4.95%	4.56%	-13.77%	-14.24%	-25.75%	-26.01%

- 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 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
过去三个月	5.23%	0.85%	7.82%	0.46%	-2.59%	0.39%
过去六个月	7.66%	1.52%	7.48%	0.54%	0.18%	0.98%
过去一年	21.71%	1.83%	3.64%	0.71%	18.07%	1.12%
过去三年	5.26%	1.46%	7.42%	0.61%	-2.16%	0.85%
自基金合同 生效起至今	4.95%	1.43%	8.98%	0.60%	-4.03%	0.83%

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
过去三个月	5.66%	0.85%	7.82%	0.46%	-2.16%	0.39%
过去六个月	7.98%	1.52%	7.48%	0.54%	0.50%	0.98%
过去一年	21.92%	1.83%	3.64%	0.71%	18.28%	1.12%

过去三年	4.90%	1.46%	7.42%	0.61%	-2.52%	0.85%
自基金合同生效起至今	4.56%	1.43%	8.98%	0.60%	-4.42%	0.83%

### 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

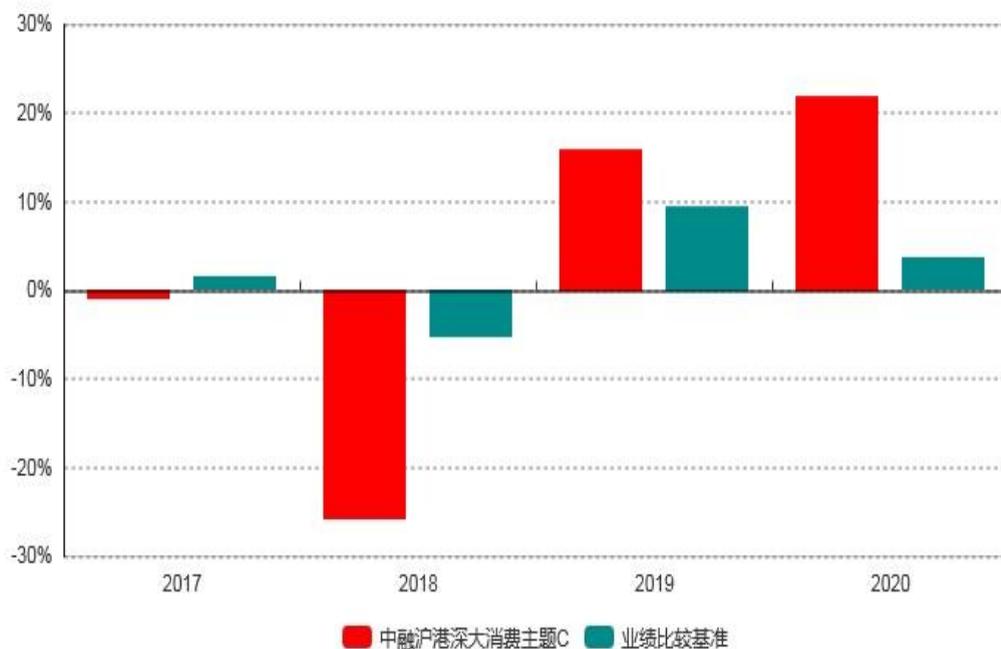


中融沪港深大消费主题C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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7.5亿元人民币。截至2020年12月31日，中融基金管理有限公司共管理61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、中融中证银行指数证券投资基金（LOF）、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、中融聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、中融价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金、中融成长优选混合型证券投资基金、中融景瑞一年持有期混合型证券投资基金、中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯琪	中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融医疗健康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。
陈荔	中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融鑫起点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	2020-09-01	-	5	陈荔女士，中国国籍，毕业于罗彻斯特大学金融学专业，研究生、硕士学历，已取得基金从业资格，证券从业年限5年。2015年7月至2016年5月，任中国中投证券有限责任公司研究

	融安二号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、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。				总部助理研究员；2016年5月加入中融基金，现任权益投资部基金经理。
甘传琦	中融产业升级灵活配置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、中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金、中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金、中融成长优选混合型证券投资基金的基金经理及权益投资部副总经理。	2018-02-09	2020-09-01	10	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10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，现任权益投资部副总经理。

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。

## 4.2 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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理办法》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理办法要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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，全球主要股指大多经历了大幅上涨，但香港市场因为受到疫情的影响更为严重和中美关系的双重压制成为了例外，恒生指数在全球主要市场中表现靠后。同时，港股内部表现分化，新经济优于传统周期，科技、消费优于恒生指数，恒生小型指数好于中型及大型指数。宏观经济的周期性波动导致企业盈利的分化，9月份恒指调整前，香港主要指数仍旧偏向金融地产，此类周期性板块受累于经济结构的调整，故表现不佳。2020年上半年，本基金重点布局了互联网和消费，当时多数公司的估值处于历史均值以下、合理偏低的位置，故而能享受到流动性宽松带来的估值提升；但是7月份以后我们对流动性边际收紧的判断过于谨慎，因此加大了顺周期、低估值等大金融板块的配置，同时在新能源领域的配置相对不足，所以下半年的整体表现相对不佳。2020年底，虽然国内疫情出现了超预期的反复，但我们认为大规模再次爆发的概率极低，随着全球范围

内疫苗接种的推进，全球经济活动都将逐步恢复，香港本地经济也将走出低谷，我们亦开始关注本地服务业的恢复和相关的投资机会。回顾全年，本基金的表现跑赢了业绩比较基准。

#### 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1.0495元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为21.71%，同期业绩比较基准收益率为3.64%；截至报告期末中融沪港深大消费主题C基金份额净值为1.0456元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为21.92%，同期业绩比较基准收益率为3.64%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2021年，考虑到中美博弈有边际缓和，香港政治和经济环境也都日渐稳定，此前压制港股估值的利空因素正在消退。同时南下资金的持续流入，也让我们更加看好港股市场在新一年的表现。2021年，我们仍将会重点关注大消费方向及互联网龙头公司。虽然经过前期的强势表现后，消费和科技的整体估值并不低，但是具备核心竞争力和不可替代性的优秀公司，仍旧具有中长期的配置价值。年初市场已经呈现出流动性溢出带来的普涨行情，但是后续个股会面临分化加剧的格局，我们的策略将坚持从长期收益出发，拉长视角、配置有核心竞争优势、有成长性、有确定性的好公司，同时也会更加关注细分领域的龙头公司。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中，一切从合规运作、保障基金份额持有人的利益出发，由督察长领导法律合规部及风险管理部对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，推动公司内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议，并跟踪改进落实情况。本报告期内，公司内部控制体系运行顺利，本基金运作没有出现违法违规行为。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

1、根据基金监管法律法规的最新变化，推动公司各部门及时完善与更新制度规范和业务流程，制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度，确保内控制度的适时性、全面性和合法合规性，并加强内部督导，将风险意识贯穿于各岗位与各业务环节。

2、日常监察和专项监察相结合，通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法，加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测，并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查。

3、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》及相关法规

规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

4、规范基金投资业务，保证投资管理工作规范有序、合法合规进行。公司制定了严格规范的投资管理制度和流程机制，以投资决策委员会为最高投资决策机构，投资业务均按照管理制度和业务流程执行。

5、以外聘律师、讲座等多种方式加强合规教育与培训，促进公司合规文化的建设，及时向公司传达基金相关的法律法规；加大了对员工行为的监察稽核力度，从源头上防范合规风险，防范利益输送行为。公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。我们将继续以风险控制为核心，进一步提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金的规范运作，充分保障基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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，本基金管理人应严格按照新准则、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。会计师事务所对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。

#### 4.8 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题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合规守信、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 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字(2021)第1920号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体份额持有人
审计意见	我们审计了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“中融沪港深大消费主题”)财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表,2020年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附中融沪港深大消费主题的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中融沪港深大消费

	<p>主题灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了中融沪港深大消费主题2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和净值变动情况。我们审计了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“中融沪港深大消费主题”)财务报表，包括2020年12月31日的资产负债表，2020年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附中融沪港深大消费主题的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了中融沪港深大消费主题2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中融沪港深大消费主题，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系中融沪港深大消费主题管理人(以下简称“管理人”)根据《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》的规定为其基金份</p>

	<p>额持有人编制的，因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供中融沪港深大消费主题份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。</p>
其他信息	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括中融沪港深大消费主题2020年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理人负责评估中融沪港深大消费主题的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、</p>

	<p>执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理人负责评估中融沪港深大消费主题的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。3、评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。4、对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中融沪港深大消费主题持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审</p>

	计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中融沪港深大消费主题不能持续经营。5、评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与管理人就中融沪港深大消费主题的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	上会会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈大愚	江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼	
审计报告日期	2021-03-23	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	25,042,322.19	8,361,772.46
结算备付金		2,735.36	25,725.15
存出保证金		629,128.24	116,898.38
交易性金融资产	7.4.7.2	79,868,053.35	72,376,650.72
其中：股票投资		79,868,053.35	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,590,787.20
应收利息	7.4.7.5	13,774.68	2,365.49
应收股利		-	6,474.60
应收申购款		33,802.26	23,959.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		105,589,816.08	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12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,134,022.00	195,017.30
应付赎回款		811,138.00	630,513.27
应付管理人报酬		130,989.55	104,322.73
应付托管费		21,831.58	17,387.11
应付销售服务费		11,725.82	7,024.55
应付交易费用	7.4.7.7	90,402.03	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	7.4.7.8	100,763.07	150,076.65
负债合计		3,300,872.05	1,222,046.12
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	97,710,197.52	94,518,724.82
未分配利润	7.4.7.10	4,578,746.51	-13,236,137.59

所有者权益合计		102,288,944.03	81,282,587.23
负债和所有者权益总计		105,589,816.08	82,504,633.35

报告截止日2020年12月31日，基金份额总额97,710,197.52份，其中A类基金份额的份额总额为31,849,322.36份，份额净值1.0495元；C类基金份额的份额总额为65,860,875.16份，份额净值1.0456元。

## 7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
<b>一、收入</b>		17,944,204.21	20,447,498.26
1. 利息收入		299,798.37	325,983.99
其中：存款利息收入	7.4.7.11	299,798.37	321,913.63
债券利息收入		-	4,070.36
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）		19,348,463.51	10,035,811.47
其中：股票投资收益	7.4.7.12	18,716,660.46	8,659,430.70
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	700.00
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-

衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	631,803.05	1,375,680.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-2,414,789.03	10,071,771.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	710,731.36	13,930.91
<b>减：二、费用</b>		2,763,995.22	3,412,070.02
1. 管理人报酬		1,167,874.56	1,664,048.75
2. 托管费		194,645.73	277,341.57
3. 销售服务费		78,927.28	112,825.19
4. 交易费用	7.4.7.20	1,222,547.65	1,207,854.51
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	7.4.7.21	100,000.00	150,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		15,180,208.99	17,035,428.24
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		15,180,208.99	17,035,428.24

### 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权	94,518,724.82	-13,236,137.59	81,282,587.23

益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,180,208.99	15,180,208.99
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)	3,191,472.70	2,634,675.11	5,826,147.81
其中: 1. 基金申购款	211,090,825.90	3,100,330.48	214,191,156.38
2. 基金赎回款	-207,899,353.20	-465,655.37	-208,365,008.57
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)	97,710,197.52	4,578,746.51	102,288,944.03
项 目	上年度可比期间		
	2019年01月01日至2019年12月31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)	-	17,035,428.24	17,035,428.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值	-87,828,555.81	16,934,451.85	-70,894,103.96

减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	4,862,006.07	-950,127.57	3,911,878.50
2. 基金赎回款	-92,690,561.88	17,884,579.42	-74,805,982.46
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）	94,518,724.82	-13,236,137.59	81,282,587.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

王瑶

黎峰

李克

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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%。

本基金的财务报表于2021年3月23日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币, 记账本位币单位为元。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等,其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;

(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;

(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基

金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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，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，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### (1) 利息收入

① 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

② 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

③ 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### (2) 投资收益

① 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

② 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

③ 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

④ 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

##### (3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金的基金托管费按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金的基金销售服务费按《基金合同》约定的方法进行计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 由于本基金A类份额不收取销售服务费，而C类份额收取销售服务费，个基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	25,042,322.19	8,361,772.46
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	25,042,322.19	8,361,772.46

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	77,690,731.41	79,868,053.35	2,177,321.94
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	77,690,731.41	79,868,053.35	2,177,321.94
项目	上年度末2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	67,784,539.75	72,376,650.72	4,592,110.97
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	67,784,539.75	72,376,650.72	4,592,110.97

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	12,981.71	2,228.06
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	550.20	115.07
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	242.77	22.36
合计	13,774.68	2,365.49

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	90,402.03	117,704.51
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	90,402.03	117,704.51
----	-----------	------------

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	763.07	76.65
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	100,000.00	150,000.00
合计	100,763.07	150,076.65

## 7.4.7.9 实收基金

## 7.4.7.9.1 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12月31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	36,129,087.57	36,129,087.57
本期赎回(以“-”号填列)	-51,533,921.53	-51,533,921.53
本期末	31,849,322.36	31,849,322.36

## 7.4.7.9.2 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12月31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	174,961,738.33	174,961,738.33
本期赎回(以“-”号填列)	-156,365,431.67	-156,365,431.67
本期末	65,860,875.16	65,860,875.16

本期申购中含转换入份额及金额，本期赎回中含转换出份额及金额。

## 7.4.7.10 未分配利润

## 7.4.7.10.1 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	9,079,779.53	-2,574,747.28	6,505,032.25
本期基金份额交易产生的变动数	-353,430.00	1,929,904.99	1,576,474.99
其中：基金申购款	-3,448,709.07	4,423,863.39	975,154.32
基金赎回款	3,095,279.07	-2,493,958.40	601,320.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,344,906.40	231,998.15	1,576,904.55

## 7.4.7.10.2 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	8,515,218.49	159,958.25	8,675,176.74
本期基金份额交易产生的变动数	1,606,806.26	-548,606.14	1,058,200.12
其中：基金申购款	-510,479.34	2,635,655.50	2,125,176.16
基金赎回款	2,117,285.60	-3,184,261.64	-1,066,976.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,517,114.23	484,727.73	3,001,841.96

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日	上年度可比期间2019年01月

	至2020年12月31日	01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	281,082.74	306,301.88
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	14,925.39	12,772.70
其他	3,790.24	2,839.05
合计	299,798.37	321,913.63

#### 7.4.7.12 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 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
卖出股票成交总额	353,843,843.46	379,709,065.99
减：卖出股票成本总额	335,127,183.00	371,049,635.29
买卖股票差价收入	18,716,660.46	8,659,430.70

#### 7.4.7.13 基金投资收益

无。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31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	-	700.00
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	-	700.00
----	---	--------

## 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	4,347,940.95
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	4,254,574.50
减：应收利息总额	-	92,666.45
买卖债券差价收入	-	700.00

## 7.4.7.15 贵金属投资收益

无。

## 7.4.7.16 衍生工具收益

无。

## 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年12月31日
股票投资产生的股利收益	631,803.05	1,375,680.77
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	631,803.05	1,375,680.77

## 7.4.7.18 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12 月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12 月31日
1. 交易性金融资产	-2,414,789.03	10,071,771.89
——股票投资	-2,414,789.03	10,071,771.89
——债券投资	-	-
——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	-2,414,789.03	10,071,771.89

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	710,731.36	13,930.91
合计	710,731.36	13,930.91

## 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
交易所市场交易费用	1,222,547.65	1,207,854.51

银行间市场交易费用	-	-
合计	1,222,547.65	1,207,854.51

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
审计费用	20,000.00	30,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
合计	100,000.00	150,000.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
中融（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司
中融国际信托有限公司	基金管理人股东
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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31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	184,305.00	0.03%	295,979,402.55	41.51%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 7.4.10.1.5 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12月31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	134.78	0.03%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总

		量的比例		额的比例
国泰君安证券股份有限公司	162,383.60	38.01%	-	-

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,167,874.56	1,664,048.75
其中：支付销售机构的客户维护费	207,652.11	300,011.17

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 X 1.50% / 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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	194,645.73	277,341.57

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 X 0.25% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.3 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12月31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
国泰君安证券股份有限公司	0.00	16,487.51	16,487.51
中融基金管理有限公司	0.00	18,007.34	18,007.34
合计	-	34,494.85	34,494.85
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12月31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	3.53	3.53
国泰君安证券股份有限公司	0.00	27,393.61	27,393.61
合计	0.00	27,397.14	27,397.14

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 X 0.20%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年12月31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	31.40%	21.16%

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12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年12月31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。

## 7.4.10.4.2 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。

## 7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31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	25,042,322.19	281,082.74	8,361,772.46	306,301.88

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。

## 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 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。

## 7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,042,322.19	-	-	-	25,042,322.19
结算备付金	2,735.36	-	-	-	2,735.36
存出保证金	629,128.24	-	-	-	629,128.24
交易性金融资产	-	-	-	79,868,053.35	79,868,053.35
应收利息	-	-	-	13,774.68	13,774.68
应收申购款	-	-	-	33,802.26	33,802.26
资产总计	25,674,185.79	-	-	79,915,630.29	105,589,816.08
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,134,022.00	2,134,022.00
应付赎回款	-	-	-	811,138.00	811,138.00

应付管理人报酬	-	-	-	130,989.55	130,989.55
应付托管费	-	-	-	21,831.58	21,831.58
应付销售服务费	-	-	-	11,725.82	11,725.82
应付交易费用	-	-	-	90,402.03	90,402.03
其他负债	-	-	-	100,763.07	100,763.07
负债总计	-	-	-	3,300,872.05	3,300,872.05
利率敏感度缺口	25,674,185.79	-	-	76,614,758.24	102,288,944.03
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	-	77,861,413.35	-	77,861,413.35
资产合计	-	77,861,413.35	-	77,861,413.35
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	1,582,930.15	-	1,582,930.15
负债合计	-	1,582,930.15	-	1,582,930.15
资产负债表外汇风险敞口净额	-	76,278,483.20	-	76,278,483.20
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	-	61,521,274.62	-	61,521,274.62
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	-	63,114,406.66	-	63,114,406.66
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	-	63,114,406.66	-	63,114,406.66

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	所有港币均相对人民币升值5%	3,813,924.16	3,155,720.33
	所有港币均相对人民币贬值5%	-3,813,924.16	-3,155,720.33

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2020年12月31日		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	79,868,053.35	78.08	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	79,868,053.35	78.08	72,376,650.72	89.04

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2019年12月31日
	沪深300指数上升5%	5,280,456.56	2,748,397.12
	沪深300指数下降5%	-5,280,456.56	-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。

#### 7.4.14 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79,868,053.35元，无属于第二层次和第三层次的余额。(2019年12月31日：属于第一层次的余额为人民币71,588,850.72元，属于第二层次的余额为人民币787,800.00元，无属于第三层次的余额)。

###### ③ 公允价值所属层级间的重大变动

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

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

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 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	79,868,053.35	75.64
	其中：股票	79,868,053.35	75.64
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	25,045,057.55	23.72
8	其他各项资产	676,705.18	0.64
9	合计	105,589,816.08	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,693,912.00	1.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	312,728.00	0.31
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	-	-
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	2,006,640.00	1.96

### 8.2.2 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	1,278,148.17	1.25
消费者非必需品	28,673,560.46	28.03
消费者常用品	5,511,774.11	5.39
能源	2,046,111.01	2
金融	18,225,608.99	17.82
医疗保健	1,445,180.04	1.41
信息技术	10,386,073.26	10.15
电信服务	7,829,793.75	7.65
地产业	2,465,163.56	2.41
合计	77,861,413.35	76.12

以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

### 8.3 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	H02628	中国人寿	486,000	6,994,533.38	6.84
2	H01070	TCL 电子	1,177,000	5,755,445.73	5.63
3	H01928	金沙中国有限公司	192,800	5,525,231.94	5.40
4	H01336	新华保险	216,900	5,522,189.41	5.40
5	H02013	微盟集团	457,000	5,361,734.95	5.24
6	H00168	青岛啤酒股份	78,000	5,330,611.10	5.21
7	H00700	腾讯控股	10,000	4,746,849.60	4.64
8	H03888	金山软件	101,000	4,250,282.00	4.16
9	H00868	信义玻璃	214,000	3,899,402.28	3.81
10	H01478	丘钛科技	342,000	3,782,229.16	3.70
11	H00200	新濠国际发展	290,000	3,680,660.05	3.60
12	H00762	中国联通	730,000	2,734,067.54	2.67
13	H01128	永利澳门	236,800	2,594,890.58	2.54
14	H02669	中海物业	725,000	2,465,163.56	2.41
15	H01658	邮储银行	553,000	2,038,569.91	1.99
16	H00966	中国太平	163,000	1,917,878.73	1.87
17	H06855	亚盛医药-B	44,600	1,445,180.04	1.41
18	002466	天齐锂业	36,800	1,445,136.00	1.41
19	H01772	赣锋锂业	16,400	1,278,148.17	1.25
20	H03669	永达汽车	115,000	1,240,829.85	1.21
21	H00175	吉利汽车	48,000	1,070,566.08	1.05

22	H02883	中海油田服务	190,000	1,049,020.10	1.03
23	H00011	恒生银行	8,900	1,001,492.69	0.98
24	H00883	中国海洋石油	165,000	997,090.91	0.97
25	H01316	耐世特	125,000	876,357.65	0.86
26	H09923	移卡	24,000	759,495.94	0.74
27	H02328	中国财险	152,000	750,944.87	0.73
28	H01860	汇量科技	86,000	348,876.61	0.34
29	002803	吉宏股份	9,700	312,728.00	0.31
30	000568	泸州老窖	1,100	248,776.00	0.24
31	H03690	美团-W	1,000	247,947.14	0.24
32	H01112	H & H 国际控股	7,500	181,163.01	0.18
33	H00354	中国软件国际	2,000	14,560.37	0.01

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	H03888	金山软件	11,346,592.58	13.96
2	H02628	中国人寿	11,088,787.09	13.64
3	H00700	腾讯控股	9,025,311.41	11.10
4	H01070	TCL 电子	8,564,543.93	10.54
5	H06186	中国飞鹤	7,984,059.95	9.82
6	H02013	微盟集团	7,798,197.62	9.59
7	H01772	赣锋锂业	7,703,857.79	9.48
8	H01336	新华保险	6,902,257.82	8.49
9	H01128	永利澳门	6,780,479.08	8.34

10	H02357	中航科工	5,800,083.86	7.14
11	H01928	金沙中国有限公司	5,658,161.78	6.96
12	H00520	呷哺呷哺	5,569,791.48	6.85
13	H00168	青岛啤酒股份	5,522,285.71	6.79
14	H03323	中国建材	5,494,668.78	6.76
15	H00981	中芯国际	5,312,751.96	6.54
16	H00868	信义玻璃	4,949,270.24	6.09
17	H01211	比亚迪股份	4,930,372.08	6.07
18	H02883	中海油田服务	4,805,228.74	5.91
19	H00200	新濠国际发展	4,769,701.85	5.87
20	H02196	复星医药	4,557,957.08	5.61
21	H06865	福莱特玻璃	4,464,708.86	5.49
22	H01478	丘钛科技	4,397,776.95	5.41
23	H00268	金蝶国际	4,106,099.97	5.05
24	H01658	邮储银行	3,916,271.23	4.82
25	H00522	ASM PACIFIC	3,901,078.27	4.80
26	H01066	威高股份	3,784,933.04	4.66
27	H01918	融创中国	3,767,816.62	4.64
28	H02338	潍柴动力	3,630,200.23	4.47
29	H01896	猫眼娱乐	3,504,732.51	4.31
30	H01093	石药集团	3,469,857.68	4.27
31	H01299	友邦保险	3,321,024.71	4.09
32	H00425	敏实集团	3,298,099.33	4.06
33	H00763	中兴通讯	3,274,914.50	4.03

34	H01873	维亚生物	3,230,853.77	3.97
35	H02001	新高教集团	3,210,271.08	3.95
36	H01810	小米集团-W	3,112,532.47	3.83
37	H02669	中海物业	3,079,637.96	3.79
38	H00175	吉利汽车	3,060,038.94	3.76
39	H06837	海通证券	2,926,587.60	3.60
40	H01610	中粮家佳康	2,911,430.59	3.58
41	H00762	中国联通	2,909,942.72	3.58
42	H00302	中手游	2,906,684.66	3.58
43	H06881	中国银河	2,867,543.43	3.53
44	H00772	阅文集团	2,758,049.03	3.39
45	H03690	美团-W	2,684,650.62	3.30
46	H01316	耐世特	2,651,766.75	3.26
47	002304	洋河股份	2,625,955.00	3.23
48	H01530	三生制药	2,554,235.22	3.14
49	H00853	微创医疗	2,399,102.88	2.95
50	603589	口子窖	2,360,471.00	2.90
51	300146	汤臣倍健	2,339,749.00	2.88
52	000568	泸州老窖	2,266,059.00	2.79
53	002409	雅克科技	2,250,967.00	2.77
54	H00780	同程艺龙	2,214,342.95	2.72
55	H00288	万洲国际	2,165,962.55	2.66
56	H00914	海螺水泥	2,159,467.03	2.66
57	002714	牧原股份	2,138,487.80	2.63
58	H03993	洛阳钼业	2,080,545.30	2.56
59	002466	天齐锂业	2,056,791.00	2.53
60	300406	九强生物	2,019,870.00	2.48
61	H02588	中银航空	2,001,690.95	2.46

		租赁		
62	603558	健盛集团	1,993,325.00	2.45
63	H02018	瑞声科技	1,990,808.63	2.45
64	300010	豆神教育	1,955,000.00	2.41
65	H00338	上海石油 化工股份	1,947,675.73	2.40
66	H00966	中国太平	1,912,328.14	2.35
67	H02400	心动公司	1,882,838.88	2.32
68	H02689	玖龙纸业	1,840,404.25	2.26
69	H03908	中金公司	1,782,803.91	2.19
70	H02318	中国平安	1,781,347.11	2.19
71	000858	五 粮 液	1,773,909.00	2.18
72	H06060	众安在线	1,737,128.37	2.14
73	H01347	华虹半导 体	1,710,050.63	2.10
74	H00799	IGG	1,671,931.05	2.06
75	300677	英科医疗	1,661,377.00	2.04

“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。

#### 8.4.2 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	11,771,191.16	14.48
2	H01299	友邦保险	10,305,592.80	12.68
3	H00981	中芯国际	9,463,724.83	11.64
4	H00700	腾讯控股	9,159,298.63	11.27
5	H06186	中国飞鹤	8,944,249.60	11.00
6	H03323	中国建材	8,749,590.13	10.76
7	H01772	赣锋锂业	8,572,629.86	10.55
8	H03690	美团-W	8,494,790.11	10.45

9	H02628	中国人寿	7,743,615.40	9.53
10	H01211	比亚迪股份	6,663,258.56	8.20
11	H01810	小米集团-W	6,293,525.14	7.74
12	H00520	呷哺呷哺	6,191,783.18	7.62
13	H06865	福莱特玻璃	6,014,636.87	7.40
14	H02338	潍柴动力	5,584,165.83	6.87
15	H02357	中航科工	5,537,426.56	6.81
16	H00268	金蝶国际	5,262,436.44	6.47
17	H00175	吉利汽车	5,149,048.71	6.33
18	H02013	微盟集团	5,133,775.77	6.32
19	H01070	TCL电子	4,702,976.08	5.79
20	H02196	复星医药	4,539,395.55	5.58
21	H01177	中国生物制药	4,494,898.53	5.53
22	H02001	新高教集团	4,144,984.41	5.10
23	H01066	威高股份	4,052,661.13	4.99
24	H00027	银河娱乐	4,004,301.70	4.93
25	300406	九强生物	3,781,781.14	4.65
26	H01128	永利澳门	3,557,321.49	4.38
27	H00853	微创医疗	3,526,970.54	4.34
28	H00880	澳博控股	3,333,886.57	4.10
29	H01776	广发证券	3,281,146.30	4.04
30	H01093	石药集团	3,268,265.33	4.02
31	H01610	中粮家佳康	3,248,795.90	4.00
32	H01918	融创中国	3,085,217.38	3.80

33	H01873	维亚生物	3,074,738.84	3.78
34	H01548	金斯瑞生物科技	3,042,226.88	3.74
35	603558	健盛集团	3,032,334.00	3.73
36	600984	建设机械	3,019,812.60	3.72
37	002304	洋河股份	2,961,276.61	3.64
38	H01833	平安好医生	2,948,116.30	3.63
39	H01896	猫眼娱乐	2,931,321.67	3.61
40	H00425	敏实集团	2,816,876.51	3.47
41	000568	泸州老窖	2,732,606.45	3.36
42	002714	牧原股份	2,684,401.00	3.30
43	002409	雅克科技	2,654,607.00	3.27
44	H00522	ASM PACIFIC	2,610,993.27	3.21
45	300207	欣旺达	2,607,626.00	3.21
46	H00302	中手游	2,599,149.30	3.20
47	H00763	中兴通讯	2,582,155.15	3.18
48	300146	汤臣倍健	2,543,284.00	3.13
49	H03908	中金公司	2,518,795.53	3.10
50	H00914	海螺水泥	2,361,741.02	2.91
51	H00772	阅文集团	2,360,616.72	2.90
52	603589	口子窖	2,351,638.00	2.89
53	H02883	中海油田服务	2,331,689.97	2.87
54	H06837	海通证券	2,315,856.59	2.85
55	601658	邮储银行	2,185,958.00	2.69
56	H06881	中国银河	2,170,097.31	2.67
57	H02400	心动公司	2,123,665.98	2.61
58	H01530	三生制药	2,122,727.88	2.61
59	000858	五粮液	2,067,610.00	2.54

60	600521	华海药业	2,053,744.00	2.53
61	H00338	上海石油 化工股份	2,043,801.58	2.51
62	H00780	同程艺龙	2,014,870.00	2.48
63	H01316	耐世特	2,009,993.08	2.47
64	H02689	玖龙纸业	1,934,272.66	2.38
65	H00288	万洲国际	1,904,766.30	2.34
66	H02238	广汽集团	1,897,088.30	2.33
67	H01658	邮储银行	1,877,198.00	2.31
68	H02007	碧桂园	1,867,602.28	2.30
69	H06060	众安在线	1,830,875.42	2.25
70	H02588	中银航空 租赁	1,808,427.13	2.22
71	300888	稳健医疗	1,786,173.00	2.20
72	H01347	华虹半导 体	1,730,010.03	2.13
73	H00799	IGG	1,716,794.34	2.11
74	H02318	中国平安	1,702,258.50	2.09
75	300010	豆神教育	1,648,032.00	2.03
76	002332	仙琚制药	1,646,491.00	2.03
77	H02018	瑞声科技	1,625,883.87	2.00

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

#### 8.4.3 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	345,033,374.66
卖出股票收入（成交）总额	353,843,843.46

“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。

#### 8.5 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。

**8.6 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。

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 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。

**8.11 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。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1** 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。

**8.12.2** 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 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	629,128.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,774.68
5	应收申购款	33,802.26

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	676,705.18

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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	1,984	16,053.09	10,000,200.02	31.40%	21,849,122.34	68.60%
中融沪港深大消费主题C	2,234	29,481.14	49,207,755.14	74.71%	16,653,120.02	25.29%
合计	4,21	23,165.05	59,207,955.16	60.6	38,502,242.36	39.40%

	8		0%	
--	---	--	----	--

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）。

## 9.2 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	175,954.15	0.55%
	中融沪港深大消费主题C	100.04	0.00%
	合计	176,054.19	0.18%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中融沪港深大消费主题A	0
	中融沪港深大消费主题C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中融沪港深大消费主题A	10~50
	中融沪港深大消费主题C	0
	合计	10~50

## 9.4 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	10.23%	10,000,200.02	10.23%	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	10.23%	10,000,200.02	10.23%	-

## § 10 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	36,129,087.57	174,961,738.33
减：本报告期基金总赎回份额	51,533,921.53	156,365,431.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	31,849,322.36	65,860,875.16

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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，中融基金管理有限公司副总裁王启道先生离任。

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，中融基金管理有限公司副总裁易海波先生离任。

本基金管理人于2020年9月18日发布公告，周妹云女士担任中融基金管理有限公司督察长，原督察长曹健先生担任中融基金管理有限公司副总裁。

本基金管理人于2020年11月14日发布公告，田刚先生、罗杰先生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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，未改聘会计师事务所。该审计机构已经连续3年为本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为20,000.00元人民币。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	167,531,832.34	23.97%	105,911.80	23.99%	-
国泰	2	184,305.00	0.03%	134.78	0.03%	-

君安						
太平洋证券	2	531,161,080.78	76.00%	335,391.07	75.98%	-

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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

### 11.8 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	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-31

	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		
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优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22

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	2020-06-29
18	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
19	中融基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-20
20	中融基金管理有限公司旗下部分基金中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-28
21	中融基金管理有限公司基金	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-03

	经理变更公告		
22	中融基金管理有限公司关于北京分公司经营范围及营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-04
23	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	2020-09-18
24	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	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-25
25	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	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-13
26	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	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-22
27	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	2020-11-14
28	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	2020-11-14

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20201111-20201231	0.00	49,207,755.14	0.00	49,207,755.14	50.36%
	2	20201109-20201119	0.00	69,226,722.77	69,226,722.77	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。</p> <p>当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。</p>							

## 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所

### 13.3 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  
二〇二一年三月二十七日