

# 国金量化添利定期开放债券型发起式证券 投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 30 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 29 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已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 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>5</b>
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.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
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.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	19
4.10 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.....	19
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>20</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	20
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>21</b>
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>24</b>
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>59</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	59
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	59
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.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	77

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 .....	77
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 .....	78
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 .....	78
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 .....	78
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	78
8.11 投资组合报告附注 .....	78
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>81</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	81
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的情况 .....	81
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品 情况 .....	81
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	81
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>83</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>84</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	84
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 .....	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	84
11.4 基金投资策略的改变 .....	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	84
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 .....	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	84
11.8 其他重大事件 .....	85
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>90</b>
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 .....	90
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	90
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>91</b>
13.1 备查文件目录 .....	91
13.2 存放地点 .....	91
13.3 查阅方式 .....	91

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	国金量化添利
场内简称	-
基金主代码	006189
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 2 日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	99,977,493.27 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注：无

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金在封闭期和开放期采取不同的投资策略。</p> <p>1、封闭期投资策略</p> <p>（1）债券投资策略</p> <p>债券类资产投资主要用于提高非股票资产的收益率，基金管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。</p> <p>在债券投资方面，基金管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。</p> <p>1) 可转换债券投资策略</p> <p>本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证券的估值与价格变化的研究，采用买入低转换溢价率的债券并持有的投资策略，密切关注可转换债券市场与股票市场之间的互动关系，选择恰当的时机进行套利，获得超额收益。</p> <p>2) 资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投</p>

	<p>资，以降低流动性风险。</p> <p>3) 中小企业私募债策略</p> <p>由于中小企业私募债券整体流动性相对较差，且整体信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。</p> <p>(2) 股票投资策略</p> <p>本基金股票部分以“量化投资”为主要投资策略，“阿尔法多因子选股模型”进行股票选择并据此构建股票投资组合。在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。</p> <p>1) 本基金股票部分的构建主要采用阿尔法多因子选股模型。根据对中国证券市场运行特征的长期研究，利用长期积累并最新扩展的大量因子信息，引入先进的因子筛选技术，动态捕捉市场热点，快速适应新的市场环境，对全市场股票进行筛选，增大组合的超市场收益。本基金在股票投资过程中，强调投资纪律，降低随意性投资带来的风险，力争实现基金资产长期稳定增值。</p> <p>2) 统计套利策略</p> <p>本基金通过对大量股票数据的回溯研究，用量化统计分析工具找出市场内部个股之间的稳定性关系，将套利建立在对历史数据进行统计分析的基础之上，估计相关变量的概率分布，尝试以较高的成功概率进行套利。</p> <p>3) 事件驱动套利策略</p> <p>本基金通过挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的时间以及对过往事件的数据检测，获取时间影响所带来的超额投资回报。</p> <p>4) 投资组合优化</p> <p>本基金根据量化风险模型对投资组合进行优化，调整个股权重，在控制风险的前提下追求收益最大化。</p> <p>5) 国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将以套期保值为目的，按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>6) 权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基</p>
--	---

	<p>本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略主要包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p>
业绩比较基准	中债总全价指数收益率×80%+中证 500 指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。

注：无

### 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		国金基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王珏	吴玉婷
	联系电话	010-88005756	021-52629999
	电子邮箱	wangjue@gfund.com	xywyt@cib.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95561
传真		010-88005666	021-62535823
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	福州市湖东路 154 号
办公地址		北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层	上海市银城路 167 号
邮政编码		100089	200041
法定代表人		尹庆军	高建平

### 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层



### § 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 11 月 2 日 (基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	5,908,868.97	6,408,063.52	682,120.98
本期利润	2,481,840.54	7,561,190.43	677,162.15
加权平均基金份额本期利润	0.0098	0.0625	0.0045
本期加权平均净值利润率	0.93%	6.05%	0.45%
本期基金份额净值增长率	2.11%	6.42%	0.45%
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	1,845,830.09	1,305,234.29	677,162.15
期末可供分配基金份额利润	0.0185	0.0120	0.0045
期末基金资产净值	101,823,323.36	111,540,307.32	150,688,762.15
期末基金份额净值	1.0185	1.0267	1.0045
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	9.16%	6.90%	0.45%

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. 期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3. 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。

#### 3.2 基金净值表现

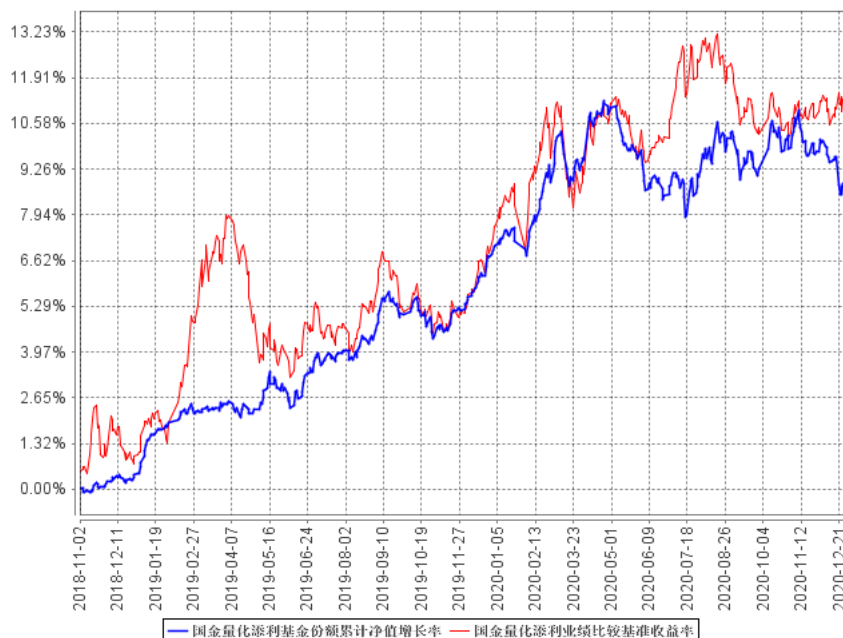
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-0.11%	0.23%	1.45%	0.24%	-1.56%	-0.01%
过去六个月	0.37%	0.23%	1.08%	0.27%	-0.71%	-0.04%
过去一年	2.11%	0.22%	4.30%	0.30%	-2.19%	-0.08%
自基金合同生效起至今	9.16%	0.17%	11.87%	0.29%	-2.71%	-0.12%

注：本基金的业绩比较基准为：中债总全价指数收益率×80%+中证 500 指数收益率×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

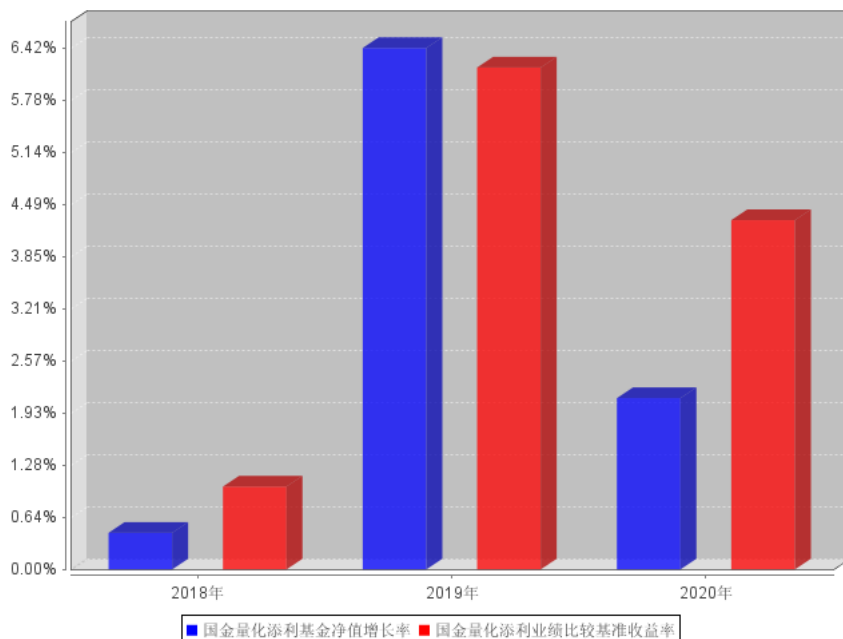
国金量化添利基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日为 2018 年 11 月 2 日，图示期为 2018 年 11 月 2 日至 2020 年 12 月 31 日。

### 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

国金量化添利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对比图



注：本基金合同生效日为 2018 年 11 月 2 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

注：无

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合 计	备注
2020	0.30	2,660,759.79	328,849.08	2,989,608.87	
2019	0.42	2,161,328.64	2,310,247.80	4,471,576.44	
2018	-	-	-	-	
合计	0.72	4,822,088.43	2,639,096.88	7,461,185.31	

## § 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

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，股权比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。截至2020年12月31日，国金基金管理有限公司共管理23只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金上证50指数增强证券投资基金（LOF）、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金民丰回报6个月定期开放混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金标普中国A股低波红利指数增强证券投资基金（LOF）、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宫雪	本基金基金经理,国金鑫新灵活配置（LOF）、国金300指数增强、国金上证50指数增强（LOF）、国金鑫瑞	2020年6月29日	-	12	宫雪女士,中国科学院博士。2008年7月至2011年12月在博时基金管理有限公司股票投资部,任产业分析师;2012年2月至今在国金基金管理有限公司,历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指

	灵活、国金红利增强、国金量化多因子、国金量化多策略基金经理,创新投资部总经理				数投资事业部总经理、量化投资事业三部总经理兼产品中心代总经理;现任创新投资部总经理。
尹海峰	本基金基金经理,国金惠丰 39 个月定开基金基金经理,研究部总经理	2019 年 2 月 12 日	-	9	尹海峰先生,中央财经大学硕士。2011 年 7 月至 2016 年 6 月历任中债资信评估有限责任公司信用评级部任研究员,泰康资产管理有限责任公司信用评估部担任信用评估研究总监、信用评估研究高级经理。2016 年 6 月 6 日加入国金基金管理有限公司,历任固定收益部信用研究主管;现任研究部总经理。
徐艳芳	本基金基金经理,国金及第中短债、国金民丰回报、国金众赢货币、国金惠鑫短债、国金惠宁中短期利率债基金经理,固定收益投资部总经理	2018 年 11 月 2 日	2020 年 10 月 21 日	12	徐艳芳女士,清华大学硕士。2005 年 10 月至 2012 年 6 月历任皓天财经公关公司财经咨询师、英大泰和财产保险股份有限公司投资经理。2012 年 6 月加入国金基金管理有限公司,历任投资研究部基金经理;现任固定收益投资部总经理兼基金经理。
杨雨龙	本基金基金经理,国金量化多因子、国金鑫瑞灵活、国金量化多策略、国	2018 年 11 月 2 日	2020 年 6 月 19 日	11	杨雨龙先生,北京大学硕士。2007 年 7 月至 2009 年 9 月在招商银行股份有限公司计划财务部任管理会计,2009 年 10 月至 2011 年 9 月在博时基金管

	金民丰汇报基金经理, 量化投资事业二部总经理				理有限公司交易部任股票交易员, 2011 年 10 月至 2014 年 7 月在兴业证券股份有限公司研究所任金融工程高级分析师, 2014 年 7 月至 2017 年 6 月在摩根士丹利华鑫基金管理有限公司任量化投资部副总监、基金经理。2017 年 6 月加入国金基金管理有限公司, 任量化投资事业二部总经理。
马芳	本基金基金经理, 国金量化多策略, 国金量化多因子基金经理, 量化投资事业部副总经理	2020 年 9 月 3 日	-	4	马芳女士, 中国人民大学硕士, 2003 年 7 月至 2016 年 5 月历任华泰贝通网络科技有限公司担任 IT 事业部测试工程师, 奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证券交易系统自动化测试部经理, 北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理, 2016 年 5 月加入国金基金管理有限公司, 历任量化投资运营中心副总经理, 产品中心副总经理, 量化投资事业部副总经理。

注: (1) 任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期, 首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写; (2) 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注: 截至本报告期末, 不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

截至本报告期末, 不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况, 故本项不适用。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 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

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规，制定了《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。该公平交易管理方法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行（集中竞价及非集中竞价交易）、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

第一，明确公平交易的原则：（1）信息获取公平原则，不同投资组合经理可公平获得研究成果；（2）交易机会公平原则，不同投资组合经理可获得公平交易执行的机会。

第二，对公募基金和私募资产管理计划等不同类型业务，公司分别设立独立的投资人员；研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持；设立独立的基金交易部，实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；设立独立的合规风控部，对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、预警、报告等。

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的执行情况进行审核。（2）产品开发：风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标，在投资交易系统中完成风控参数设置，确保做好公平交易的事前控制。（3）研究与投资：投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为，其中，投资组合经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作，并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理，以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。（4）交易执行：交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度，合规风控部利用投资交易系统等对交易执行进行实时监控，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（5）事后分析：合规风控部利用公平交易系统对不同投资组合之间的同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。（6）报告备案：合规风控部根据实时

监控及事后分析的结果撰写定期报告，并由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。（7）信息披露环节：信息披露部门在各投资组合的定期报告中，至少披露公司整体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。（8）反馈完善：根据事后分析报告及信息披露结果，公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善，以确保公平交易的执行日臻完善。（9）监督检查：合规风控部监察稽核人员根据法规规定及公司公平交易制度规定，监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况，并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况，故本项不适用。

#### 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，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现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的 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 年债券市场在新冠疫情和政策应对的过程中走势波折，呈现出牛熊切换的格局。年初逆周期政策发力，债券市场持续盘整；春节之后受国内疫情影响，避险情绪升温及货币政策继续宽松，4 月份之前债券市场收益率持续下台阶；5 月份开始政策转向边际收紧，债市牛熊转换，回吐前期盈利，至 7 月之前基本面利空因素持续释放；下半年以 11 月份永煤事件为分水岭，11 月份之前债券市场面临同业存单提价、股市走强，地方债放量等利空因素继续利空；11 月中旬永煤超预期违约后，债券市场尤其是信用债市场流动性显著趋紧，相机决策下央行紧货币政策有所放松，政策切换速度放缓，叠加海外资金和配置资金提前进场布局，结构性存款压降接近尾声，利率债



收益率进入下行通道。

本基金固收组合采取稳健操作，严格管控流动性风险和信用风险，通过配置部分短久期中等级信用债匹配封闭期限贡献基础性收益，在 2 季度和 4 季度依靠利率债活跃券和高等级中长期信用债品种，通过杠杆调整和波段交易积极把握市场机会，推动组合收益获得提升。

本基金权益组合投资方面，2020 年上半年市场风格主线是大盘蓝筹股弱于中小盘成长股，市场波动方面第二季度弱于第一季度。组合在分散投资、量化精选的基础上，运用基于 A 股自身特点开发的量化多因子选股模型进行选股投资，着重量化的方法精选高成长性的公司。本基金自 6 月下旬起对投资策略进行了调整，新策略以基本面因子为基础，利用机器学习方法构建的多周期预测模型，通过预测因子和挖掘个股阿尔法等途径获取选股收益。报告期内持股分散，基本维持高仓位运作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金单位份额净值 1.0185 元，累计单位净值 1.0905 元。本报告期内本基金份额净值收益率为 2.11%，同期业绩比较基准收益率为 4.30%。

#### 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，在后疫情时代，在海外经济开始复苏的环境下，国内经济基本面将继续处于修复区间，但修复的斜率在变缓。从政策面看，货币政策预计将整体收紧，但政策切换节奏预计较慢，不急转弯仍是主基调，资金利率重定价仍在持续，央行对资金面的管控出现新的变化；从信用上看，2021 年政府债发行相比去年预计将有所减少，信贷管控亦较严格，预计社融增速将会出现明显回落。从债市策略上看，全年来看债市依然是震荡行情，上半年面临基本面和通胀的逆风，下半年债市逐步走强的概率较大，需要把握经济数据、资金面带来的预期差。

随着新型冠状病毒疫苗在世界范围内投入使用，疫情得到进一步的控制，有望重启全球经济。随着国内产业结构优化的逐渐深入、优胜劣汰机制提升资源配置效率，个股分化将是中长期趋势，龙头企业和优质成长企业将持续受益。量化选股策略的一些长效因子的有效性将会得到回归。

#### 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，本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法、合规性等进行了监察稽核，通过实时监控、定期检查、专项稽核、日常不定期抽查等方式，及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况，并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层、董事会以及监管部门。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

(1) 进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况不断细化制度流程，及时拟定了相关管理制度，并对原有制度体系进行了持续的更新和完善，截至报告出具日，本基金管理人共制订规章制度 134 项，涵盖公司主要业务范围。

(2) 强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规，将相关规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中，同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式，提高全体员工的合规守法意识。

(3) 有计划地开展监察稽核工作。本报告期内，本基金管理人根据年度监察稽核工作计划、通过日常监察与专项稽核相结合的方式，开展各项监察稽核工作，包括对基金销售、宣传材料、合同、反洗钱工作、基金投资运作、交易（包括公平交易）等方面进行稽核，对于稽核中发现的问题会通过监察稽核报告的形式，及时将潜在风险通报部门负责人、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。通过日常监察与专项稽核的方式，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化内部控制流程，提高了业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管行代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值委员会的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金每 10 份基金份额分红 0.30 元。

#### **4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

无

#### **4.10 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**

本报告期内，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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	安永华明（2021）审字第 61004823_A16 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	国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金的财务报表，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，后附的国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 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。
形成审计意见的基础	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，我们独立于国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金，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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国金量化添利定期开放债券型</p>

	<p>发起式证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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。</p> <p>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:</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 评价管理层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。</p> <p>(4) 对管理层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,就可能导致对国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金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计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金</p>

	<p>不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、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。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊 马剑英
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
审计报告日期	2021 年 3 月 30 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国金量化添利定期开放债券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	2,707,296.08	543,060.28
结算备付金		3,509,749.17	966,174.71
存出保证金		134,520.29	17,986.39
交易性金融资产	7.4.7.2	150,822,219.70	135,191,860.61
其中：股票投资		18,148,172.00	10,533,087.71
基金投资		-	-
债券投资		132,674,047.70	124,658,772.90
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	2,860,729.53	2,767,698.11
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		160,034,514.77	139,486,780.10
<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		57,354,520.92	27,600,000.00
应付证券清算款		360,745.66	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		53,589.72	47,627.53
应付托管费		10,717.93	9,525.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	226,181.76	76,341.42
应交税费		13,514.21	18,499.75
应付利息		12,921.21	2,340.33



应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	179,000.00	192,138.23
负债合计		58,211,191.41	27,946,472.78
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	99,977,493.27	108,641,890.03
未分配利润	7.4.7.10	1,845,830.09	2,898,417.29
所有者权益合计		101,823,323.36	111,540,307.32
负债和所有者权益总计		160,034,514.77	139,486,780.10

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0185 元，基金份额总额 99,977,493.27 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		8,269,481.96	10,316,301.87
1. 利息收入		12,196,848.70	7,621,899.57
其中：存款利息收入	7.4.7.11	77,283.43	81,291.97
债券利息收入		12,034,003.48	7,479,784.11
资产支持证券利息收入		-	59,241.77
买入返售金融资产收入		85,561.79	1,581.72
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-502,466.74	1,541,275.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	10,060,082.81	252,818.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-10,800,990.22	1,163,241.72
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	19,414.79
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-4,300.00	-
股利收益	7.4.7.16	242,740.67	105,800.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-3,427,028.43	1,153,126.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,128.43	-
<b>减：二、费用</b>		5,787,641.42	2,755,111.44
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,324,419.95	628,419.88
2. 托管费	7.4.10.2.2	264,884.01	125,684.00
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	1,247,452.37	319,243.10
5. 利息支出		2,702,059.30	1,454,332.35
其中：卖出回购金融资产支出		2,702,059.30	1,454,332.35
6. 税金及附加		31,144.77	21,018.52
7. 其他费用	7.4.7.20	217,681.02	206,413.59
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,481,840.54	7,561,190.43
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,481,840.54	7,561,190.43

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 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、期初所有者权益（基金净值）	108,641,890.03	2,898,417.29	111,540,307.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,481,840.54	2,481,840.54
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）	-8,664,396.76	-544,818.87	-9,209,215.63
其中：1. 基金申购款	296,451,015.18	16,244,699.81	312,695,714.99
2. 基金赎回款	-305,115,411.94	-16,789,518.68	-321,904,930.62
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）	-	-2,989,608.87	-2,989,608.87
五、期末所有者权益（基金净值）	99,977,493.27	1,845,830.09	101,823,323.36
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 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）	150,011,600.00	677,162.15	150,688,762.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,561,190.43	7,561,190.43
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）	-41,369,709.97	-868,358.85	-42,238,068.82
其中：1. 基金申购款	3,632,590.03	171,194.28	3,803,784.31
2. 基金赎回款	-45,002,300.00	-1,039,553.13	-46,041,853.13
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）	-	-4,471,576.44	-4,471,576.44
五、期末所有者权益（基金净值）	108,641,890.03	2,898,417.29	111,540,307.32

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：

<u>尹庆军</u>	<u>聂武鹏</u>	<u>于晓莲</u>
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

国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称为“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[2018]1033号文的核准，由国金基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2018年11月2日生效。首次募集规模为150,011,600.00份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金主要投资于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）、权证、债券（国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券）、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、债券回购、国债期货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）。

本基金投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但应开放期

流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每次开放期前十五个工作日、开放期及开放期结束后十五个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限。基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。

开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内本基金不受上述 5% 限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债总全价指数收益率×80%+中证 500 指数收益率×20%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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于 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 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。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(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的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量



的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案已公告为准，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

(3) 基金收益分配后基金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；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

#### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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

股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 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	2,707,296.08	543,060.28
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：	2,707,296.08	543,060.28

#### 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	17,641,205.15	18,148,172.00	506,966.85
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	55,070,455.96	53,104,547.70
	银行间市场	80,389,418.94	79,569,500.00
	合计	135,459,874.90	132,674,047.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	153,101,080.05	150,822,219.70	-2,278,860.35
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	10,408,843.11	10,533,087.71	124,244.60
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	67,549,820.62	67,872,882.90
	银行间市场	56,085,028.80	56,785,890.00
	合计	123,634,849.42	124,658,772.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	134,043,692.53	135,191,860.61	1,148,168.08

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 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	417.67	1,555.47
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	1,734.08	479.43
应收债券利息	2,858,511.12	2,765,654.30
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	66.66	8.91
合计	2,860,729.53	2,767,698.11

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度均未持有其他资产。

#### 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	207,665.89	74,214.67
银行间市场应付交易费用	18,515.87	2,126.75
合计	226,181.76	76,341.42

#### 7.4.7.8 其他负债

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
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	179,000.00	192,000.00
应付银行汇划手续费	-	138.23
合计	179,000.00	192,138.23

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	108,641,890.03	108,641,890.03
本期申购	296,451,015.18	296,451,015.18
本期赎回（以“-”号填列）	-305,115,411.94	-305,115,411.94
- 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	99,977,493.27	99,977,493.27

注：申购含红利再投、转换入份额及金额；赎回含转换出份额及金额。

#### 7.4.7.10 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	1,305,234.29	1,593,183.00	2,898,417.29
本期利润	5,908,868.97	-3,427,028.43	2,481,840.54
本期基金份额交易产生的变动数	-1,580,012.36	1,035,193.49	-544,818.87
其中：基金申购款	16,211,363.26	33,336.55	16,244,699.81
基金赎回款	-17,791,375.62	1,001,856.94	-16,789,518.68
本期已分配利润	-2,989,608.87	-	-2,989,608.87
本期末	2,644,482.03	-798,651.94	1,845,830.09

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	39,125.44	45,014.32
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	37,274.44	35,933.30
其他	883.55	344.35
合计	77,283.43	81,291.97

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	461,674,772.40	114,153,436.59
减：卖出股票成本总额	451,614,689.59	113,900,618.03
买卖股票差价收入	10,060,082.81	252,818.56

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1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	-10,800,990.22	1,163,241.72
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	-10,800,990.22	1,163,241.72

**7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1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	1,147,721,137.81	439,895,575.59
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,137,747,959.16	429,739,168.47
减：应收利息总额	20,774,168.87	8,993,165.40
买卖债券差价收入	-10,800,990.22	1,163,241.72

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
卖出资产支持证券成交总额	-	8,080,433.97
减：卖出资产支持证券成本总额	-	8,000,000.00
减：应收利息总额	-	61,019.18
资产支持证券投资收益	-	19,414.79

注：本基金本报告期期间无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。



**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
国债期货投资收益	-4,300.00	-
股指期货-投资收益	-	-

注：本基金于上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	242,740.67	105,800.32
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	242,740.67	105,800.32

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	-3,427,028.43	1,153,126.91
——股票投资	382,722.25	124,244.60
——债券投资	-3,809,750.68	1,028,882.31
——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	-3,427,028.43	1,153,126.91

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	2,128.43	-
合计	2,128.43	-

注：本基金于上年度可比期间无其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	1,219,883.89	311,879.85
银行间市场交易费用	27,550.00	7,363.25
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
国债期货交易费用	18.48	-
合计	1,247,452.37	319,243.10

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
上清所查询服务费	1,200.00	700.00
中债债券账户维护费	18,000.00	15,000.00

上清所账户维护费	18,000.00	15,000.00
银行费用	10,481.02	5,713.59
合计	217,681.02	206,413.59

#### 7.4.7.21 分部报告

无

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
上海国金理益财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	基金托管人

注：下述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

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 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1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,324,419.95	628,419.88
其中：支付销售机构的客户维护费	391,674.08	0.49

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

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1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	264,884.01	125,684.00

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无

#### 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

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2018 年 11 月 2 日）持有的基金份额	-	10,000,600.00
报告期初持有的基金份额	11,852,028.34	10,000,600.00
报告期间申购/买入总份额	307,155.16	1,851,428.34
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	1,455,849.89	-
报告期末持有的基金份额	10,703,333.61	11,852,028.34

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	10.7057%	10.9093%
-------------------------	----------	----------

注：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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总份 额的比例
国金 证券 股份 有限 公司	14,267,097.88	14.2703%	-	-
北 京 千 石 创 富 资 本 管 理 有 限 公 司	-	-	9,999,600.00	9.2042%

注：除基金管理人之外的其他关联方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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1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
兴业银行-活期存款	2,707,296.08	39,125.44	543,060.28	45,014.32

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率或约定的利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无

#### 7.4.11 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 12 月 21 日	-	2020 年 12 月 21 日	0.30	2,660,759.79	328,849.08	2,989,608.87	
合计	-	-		0.30	2,660,759.79	328,849.08	2,989,608.87	

#### 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 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
113044	大秦 转债	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 15 日	新债未 上市	100.00	100.00	510	51,000.00	51,000.00	-
123086	海兰 转债	2020 年 12 月 16 日	2021 年 2 月 8 日	新债未 上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 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

截止本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额

26,054,520.92 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
200207	20 国开 07	2021 年 1 月 4 日	100.11	100,000	10,011,000.00
200212	20 国开 12	2021 年 1 月 4 日	100.57	95,000	9,554,150.00
102000291	20 港兴港 投 MTN002	2021 年 1 月 4 日	97.60	83,000	8,100,800.00
合计				278,000	27,665,950.00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 31,300,000.00 元，于 2021 年 01 月 04 日，2021 年 01 月 05 日，2021 年 01 月 06 日，2021 年 01 月 07 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末参与转融通证券出借业务。

#### 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

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合



运作中的风险进行识别、评估和防控，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

#### 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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的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。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	5,333,390.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	5,333,390.00

注：表中所列示的债券投资为短期融资券、超短期融资券及其他按短期信用评级的债券投资，其中超短期融资券无短期信用评级。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	74,572,722.00	70,246,096.90
AAA 以下	27,897,325.70	28,977,286.00
未评级	-	-
合计	102,470,047.70	99,223,382.90

注：表中所列示的债券投资为除短期融资券、超短期融资券及其他按短期信用评级列示的债券投资、国债、政策性金融债、央行票据以外的债券投资。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级的同业存单投资。

**7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无。

**7.4.13.3.2 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。除附注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

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量受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对于未来现金流影响的风险。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 202 0年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	2,707,296.08	-	-	-	-	-	-2,707,296.08
结 算	3,509,749.17	-	-	-	-	-	-3,509,749.17

备付金							
交易性金融资产	18,008,000.00	216,520.00	10,130,027.70	94,183,500.00	10,136,000.00	18,148,172.00	150,822,219.70
应收利息	-	-	-	-	-	-2,860,729.53	2,860,729.53
存出保证金	134,520.29	-	-	-	-	-	134,520.29
资产总计	24,359,565.54	216,520.00	10,130,027.70	94,183,500.00	10,136,000.00	21,008,901.53	160,034,514.77
负债							
卖出回购金融资产款	57,354,520.92	-	-	-	-	-	-57,354,520.92
应付证券清算款	-	-	-	-	-	360,745.66	360,745.66
应付管理	-	-	-	-	-	53,589.72	53,589.72

人 报 酬							
应付 托 管 费	-	-	-	-	-	10,717.93	10,717.93
应付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	226,181.76	226,181.76
应付 利 息	-	-	-	-	-	12,921.21	12,921.21
应 交 税 费	-	-	-	-	-	13,514.21	13,514.21
其 他 负 债	-	-	-	-	-	179,000.00	179,000.00
负 债 总 计	57,354,520.92	-	-	-	-	856,670.49	58,211,191.41
利 率 敏 感 度 缺 口	-32,994,955.38	216,520.00	10,130,027.70	94,183,500.00	10,136,000.00	20,152,231.04	101,823,323.36
上 年 度 末 201 9 年 12 月	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

31日							
资产							
银行存款	543,060.28	-	-	-	-	-	543,060.28
结算备付金	966,174.71	-	-	-	-	-	966,174.71
交易性金融资产	8,199,000.00	5,333,390.00	34,309,382.90	66,775,000.00	10,042,000.00	10,533,087.71	135,191,860.61
应收利息	-	-	-	-	-	-2,767,698.11	12,767,698.11
存出保证金	17,986.39	-	-	-	-	-	17,986.39
资产总计	9,726,221.38	5,333,390.00	34,309,382.90	66,775,000.00	10,042,000.00	13,300,785.82	139,486,780.10
负债							
卖出回购金融资产款	27,600,000.00	-	-	-	-	-	-27,600,000.00
应	-	-	-	-	-	47,627.53	47,627.53

付 管 理 人 报 酬							
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	9,525.52	9,525.52
应 付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	76,341.42	76,341.42
应 付 利 息	-	-	-	-	-	2,340.33	2,340.33
应 交 税 费	-	-	-	-	-	18,499.75	18,499.75
其 他 负 债	-	-	-	-	-	192,138.23	192,138.23
负 债 总 计	27,600,000.00	-	-	-	-	346,472.78	27,946,472.78
利 率 敏 感 度 缺 口	-17,873,778.62	5,333,390.00	34,309,382.90	66,775,000.00	10,042,000.00	12,954,313.04	111,540,307.32

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日、行权日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；
----	--------------------------

	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减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 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-970,310.52	-1,030,774.85
	-25 个基点	983,482.48	1,045,178.05

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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。本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的证券等，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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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 2020 年 12 月 31 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	18,148,172.00	17.82	10,533,087.71	9.44
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	132,674,047.70	130.30	124,658,772.90	111.76
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	150,822,219.70	148.12	135,191,860.61	121.20
----	----------------	--------	----------------	--------

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数（000905.SH）变化 5%，其他变量不变；		
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。		
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）
	+5%	446,824.64	269,438.11
	-5%	-446,824.64	-269,438.11

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

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 19,587,319.70 元，属于第二层次的余额为人民币 131,234,900.00 元，无属于第三层次的余额。（上年度末：第一层次人民币 10,621,334.61 元，第二层次人民币 124,570,526.00 元，无属于第三层次的余额）

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。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（上年度：无）。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（上年度：无）。

##### 7.4.14.2 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.3 其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.14.4 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2021 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	18,148,172.00	11.34
	其中：股票	18,148,172.00	11.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	132,674,047.70	82.90
	其中：债券	132,674,047.70	82.90
	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	6,217,045.25	3.88
8	其他各项资产	2,995,249.82	1.87
9	合计	160,034,514.77	100.00

### 8.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	33,998.00	0.03
B	采矿业	982,276.00	0.96
C	制造业	9,724,711.00	9.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	302,296.00	0.30
E	建筑业	365,769.00	0.36
F	批发和零售业	250,365.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	462,236.00	0.45
H	住宿和餐饮业	25,765.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,304,223.00	1.28
J	金融业	2,946,775.00	2.89
K	房地产业	509,824.00	0.50
L	租赁和商务服务业	308,794.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	471,366.00	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	86,045.00	0.08

0	居民服务、修理和其他服务业	6,475.00	0.01
P	教育	21,078.00	0.02
Q	卫生和社会工作	267,335.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	74,761.00	0.07
S	综合	4,080.00	0.00
	合计	18,148,172.00	17.82

注：以上行业分类以 2020 年 12 月 31 日的证监会行业分类标准为依据。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	601211	国泰君安	18,500	324,305.00	0.32
2	603259	药明康德	2,000	269,440.00	0.26
3	601328	交通银行	56,500	253,120.00	0.25
4	601318	中国平安	2,700	234,846.00	0.23
5	002594	比亚迪	1,200	233,160.00	0.23
6	000002	万科 A	7,400	212,380.00	0.21
7	601398	工商银行	42,500	212,075.00	0.21
8	600519	贵州茅台	100	199,800.00	0.20
9	600763	通策医疗	700	193,564.00	0.19
10	601668	中国建筑	37,900	188,363.00	0.18
11	601155	新城控股	5,300	184,599.00	0.18
12	600036	招商银行	4,200	184,590.00	0.18
13	601169	北京银行	34,600	167,464.00	0.16
14	002142	宁波银行	4,600	162,564.00	0.16
15	603986	兆易创新	800	158,000.00	0.16
16	601916	浙商银行	37,900	154,632.00	0.15
17	600309	万华化学	1,600	145,664.00	0.14
18	002371	北方华创	800	144,592.00	0.14
19	603866	桃李面包	2,400	141,840.00	0.14
20	601888	中国中免	500	141,225.00	0.14
21	002812	恩捷股份	900	127,602.00	0.13
22	601288	农业银行	39,100	122,774.00	0.12
23	600000	浦发银行	12,400	120,032.00	0.12
24	600985	淮北矿业	10,700	119,733.00	0.12
25	601898	中煤能源	26,400	117,480.00	0.12

26	601088	中国神华	6,000	108,060.00	0.11
27	600028	中国石化	25,000	100,750.00	0.10
28	601225	陕西煤业	10,100	94,334.00	0.09
29	600016	民生银行	17,900	93,080.00	0.09
30	601857	中国石油	21,900	90,885.00	0.09
31	601688	华泰证券	4,900	88,249.00	0.09
32	300760	迈瑞医疗	200	85,200.00	0.08
33	600009	上海机场	1,100	83,226.00	0.08
34	603833	欧派家居	600	80,700.00	0.08
35	600809	山西汾酒	200	75,058.00	0.07
36	601229	上海银行	9,400	73,696.00	0.07
37	002304	洋河股份	300	70,797.00	0.07
38	002352	顺丰控股	800	70,584.00	0.07
39	601985	中国核电	14,200	69,864.00	0.07
40	601117	中国化学	11,800	69,266.00	0.07
41	000333	美的集团	700	68,908.00	0.07
42	600795	国电电力	30,300	68,175.00	0.07
43	000568	泸州老窖	300	67,848.00	0.07
44	601995	中金公司	900	67,743.00	0.07
45	300751	迈为股份	100	67,701.00	0.07
46	300896	爱美客	100	65,502.00	0.06
47	000937	冀中能源	15,300	63,648.00	0.06
48	601727	上海电气	11,700	63,180.00	0.06
49	600031	三一重工	1,800	62,964.00	0.06
50	600570	恒生电子	600	62,940.00	0.06
51	000799	酒鬼酒	400	62,600.00	0.06
52	002709	天赐材料	600	62,280.00	0.06
53	601899	紫金矿业	6,700	62,243.00	0.06
54	600887	伊利股份	1,400	62,118.00	0.06
55	300033	同花顺	500	61,990.00	0.06
56	601601	中国太保	1,600	61,440.00	0.06
57	600690	海尔智家	2,100	61,341.00	0.06
58	600015	华夏银行	9,800	61,250.00	0.06
59	603288	海天味业	300	60,162.00	0.06
60	002821	凯莱英	200	59,828.00	0.06
61	002415	海康威视	1,200	58,212.00	0.06
62	000001	平安银行	3,000	58,020.00	0.06
63	601628	中国人寿	1,500	57,585.00	0.06
64	300782	卓胜微	100	57,054.00	0.06

65	600104	上汽集团	2,300	56,212.00	0.06
66	601998	中信银行	11,000	56,210.00	0.06
67	603799	华友钴业	700	55,510.00	0.05
68	600584	长电科技	1,300	55,341.00	0.05
69	601012	隆基股份	600	55,320.00	0.05
70	601939	建设银行	8,800	55,264.00	0.05
71	601901	方正证券	5,300	54,961.00	0.05
72	002007	华兰生物	1,300	54,912.00	0.05
73	000596	古井贡酒	200	54,400.00	0.05
74	002271	东方雨虹	1,400	54,320.00	0.05
75	601377	兴业证券	6,200	53,816.00	0.05
76	600559	老白干酒	1,700	53,516.00	0.05
77	600436	片仔癀	200	53,502.00	0.05
78	603899	晨光文具	600	53,136.00	0.05
79	300661	圣邦股份	200	52,760.00	0.05
80	603919	金徽酒	1,300	52,637.00	0.05
81	002241	歌尔股份	1,400	52,248.00	0.05
82	300676	华大基因	400	51,424.00	0.05
83	000860	顺鑫农业	700	50,778.00	0.05
84	600508	上海能源	5,000	50,700.00	0.05
85	002460	赣锋锂业	500	50,600.00	0.05
86	300274	阳光电源	700	50,596.00	0.05
87	600170	上海建工	16,800	50,568.00	0.05
88	300677	英科医疗	300	50,445.00	0.05
89	300136	信维通信	1,400	50,232.00	0.05
90	600362	江西铜业	2,500	49,875.00	0.05
91	002801	微光股份	1,400	49,868.00	0.05
92	300888	稳健医疗	300	49,800.00	0.05
93	300454	深信服	200	49,602.00	0.05
94	000651	格力电器	800	49,552.00	0.05
95	601991	大唐发电	20,600	49,234.00	0.05
96	002129	中环股份	1,900	48,450.00	0.05
97	300618	寒锐钴业	500	47,455.00	0.05
98	300841	康华生物	100	46,824.00	0.05
99	603160	汇顶科技	300	46,665.00	0.05
100	000900	现代投资	10,900	46,325.00	0.05
101	300131	英唐智控	5,500	45,980.00	0.05
102	002540	亚太科技	8,800	45,760.00	0.04
103	600183	生益科技	1,600	45,056.00	0.04

104	600837	海通证券	3,500	45,010.00	0.04
105	000661	长春高新	100	44,891.00	0.04
106	300122	智飞生物	300	44,373.00	0.04
107	300413	芒果超媒	600	43,500.00	0.04
108	002275	桂林三金	2,900	43,239.00	0.04
109	601226	华电重工	10,200	43,146.00	0.04
110	600199	金种子酒	2,200	42,702.00	0.04
111	600548	深高速	4,800	42,624.00	0.04
112	603444	吉比特	100	42,600.00	0.04
113	000631	顺发恒业	13,900	42,256.00	0.04
114	002050	三花智控	1,700	41,905.00	0.04
115	300408	三环集团	1,100	40,975.00	0.04
116	300037	新宙邦	400	40,560.00	0.04
117	002001	新和成	1,200	40,416.00	0.04
118	600741	华域汽车	1,400	40,348.00	0.04
119	603369	今世缘	700	40,166.00	0.04
120	601799	星宇股份	200	40,100.00	0.04
121	601615	明阳智能	2,100	39,858.00	0.04
122	600600	青岛啤酒	400	39,760.00	0.04
123	002410	广联达	500	39,370.00	0.04
124	002064	华峰氨纶	3,900	39,351.00	0.04
125	600019	宝钢股份	6,500	38,675.00	0.04
126	603005	晶方科技	600	38,616.00	0.04
127	600699	均胜电子	1,500	38,040.00	0.04
128	601238	广汽集团	2,800	37,212.00	0.04
129	000963	华东医药	1,400	37,184.00	0.04
130	002459	晶澳科技	900	36,648.00	0.04
131	300699	光威复材	400	35,620.00	0.03
132	603605	珀莱雅	200	35,600.00	0.03
133	300601	康泰生物	200	34,900.00	0.03
134	000166	申万宏源	6,600	34,848.00	0.03
135	603129	春风动力	200	34,838.00	0.03
136	600406	国电南瑞	1,300	34,541.00	0.03
137	000883	湖北能源	8,900	34,532.00	0.03
138	600845	宝信软件	500	34,490.00	0.03
139	601100	恒立液压	300	33,900.00	0.03
140	002245	蔚蓝锂芯	2,600	33,748.00	0.03
141	603659	璞泰来	300	33,717.00	0.03
142	002475	立讯精密	600	33,672.00	0.03

143	002920	德赛西威	400	33,656.00	0.03
144	600426	华鲁恒升	900	33,570.00	0.03
145	600276	恒瑞医药	300	33,438.00	0.03
146	600779	水井坊	400	33,208.00	0.03
147	002847	盐津铺子	300	33,066.00	0.03
148	300595	欧普康视	400	32,768.00	0.03
149	300863	卡倍亿	300	32,424.00	0.03
150	600563	法拉电子	300	32,265.00	0.03
151	300850	新强联	200	31,978.00	0.03
152	603680	今创集团	2,200	31,680.00	0.03
153	002568	百润股份	300	31,287.00	0.03
154	603026	石大胜华	600	30,246.00	0.03
155	002646	青青稞酒	1,500	30,135.00	0.03
156	002409	雅克科技	500	30,045.00	0.03
157	000039	中集集团	2,000	29,980.00	0.03
158	300015	爱尔眼科	400	29,956.00	0.03
159	000983	山西焦煤	5,300	29,892.00	0.03
160	002507	涪陵榨菜	700	29,610.00	0.03
161	600739	辽宁成大	1,200	29,184.00	0.03
162	300724	捷佳伟创	200	29,120.00	0.03
163	601600	中国铝业	8,000	29,040.00	0.03
164	603658	安图生物	200	29,036.00	0.03
165	002791	坚朗五金	200	28,800.00	0.03
166	600219	南山铝业	9,100	28,756.00	0.03
167	600409	三友化工	2,800	28,700.00	0.03
168	300727	润禾材料	900	28,485.00	0.03
169	300576	容大感光	600	28,290.00	0.03
170	600188	兖州煤业	2,800	28,196.00	0.03
171	601966	玲珑轮胎	800	28,136.00	0.03
172	000830	鲁西化工	2,200	28,116.00	0.03
173	300124	汇川技术	300	27,990.00	0.03
174	300418	昆仑万维	1,400	27,930.00	0.03
175	000516	国际医学	2,200	27,654.00	0.03
176	300872	天阳科技	700	27,482.00	0.03
177	002037	保利联合	4,200	27,384.00	0.03
178	300285	国瓷材料	600	27,066.00	0.03
179	603939	益丰药房	300	27,057.00	0.03
180	300429	强力新材	1,900	26,923.00	0.03
181	601689	拓普集团	700	26,901.00	0.03



182	000783	长江证券	3,200	26,880.00	0.03
183	000550	江铃汽车	1,300	26,832.00	0.03
184	600900	长江电力	1,400	26,824.00	0.03
185	300293	蓝英装备	1,600	26,704.00	0.03
186	600392	盛和资源	3,000	26,670.00	0.03
187	000021	深科技	1,400	26,614.00	0.03
188	300058	蓝色光标	4,400	26,400.00	0.03
188	600486	扬农化工	200	26,400.00	0.03
189	603713	密尔克卫	200	26,198.00	0.03
190	002126	银轮股份	1,900	26,163.00	0.03
191	600754	锦江酒店	500	25,765.00	0.03
192	603806	福斯特	300	25,620.00	0.03
193	300903	科翔股份	600	25,368.00	0.02
194	601658	邮储银行	5,300	25,334.00	0.02
195	002938	鹏鼎控股	500	24,835.00	0.02
196	000729	燕京啤酒	2,900	24,708.00	0.02
197	300012	华测检测	900	24,633.00	0.02
198	300390	天华超净	1,000	24,600.00	0.02
199	002078	太阳纸业	1,700	24,531.00	0.02
200	600966	博汇纸业	1,600	24,048.00	0.02
201	603881	数据港	400	24,044.00	0.02
202	600132	重庆啤酒	200	23,798.00	0.02
203	601360	三六零	1,500	23,565.00	0.02
204	002648	卫星石化	900	23,508.00	0.02
205	603233	大参林	300	23,505.00	0.02
206	000932	华菱钢铁	4,900	23,422.00	0.02
207	002032	苏泊尔	300	23,397.00	0.02
208	000800	一汽解放	2,000	23,360.00	0.02
209	300035	中科电气	1,900	23,275.00	0.02
210	002430	杭氧股份	800	23,272.00	0.02
211	002759	天际股份	1,400	23,268.00	0.02
212	603501	韦尔股份	100	23,110.00	0.02
213	300357	我武生物	300	23,010.00	0.02
214	600801	华新水泥	1,100	22,693.00	0.02
215	000060	中金岭南	4,700	22,654.00	0.02
216	600616	金枫酒业	2,100	22,533.00	0.02
217	601021	春秋航空	400	22,172.00	0.02
218	600305	恒顺醋业	1,000	22,140.00	0.02
219	300792	壹网壹创	200	22,082.00	0.02

220	300628	亿联网络	300	21,936.00	0.02
221	300821	东岳硅材	1,900	21,907.00	0.02
222	300713	英可瑞	1,000	21,650.00	0.02
223	002285	世联行	4,400	21,648.00	0.02
224	300831	派瑞股份	1,100	21,516.00	0.02
225	601198	东兴证券	1,600	21,312.00	0.02
226	603355	莱克电气	700	21,161.00	0.02
227	603816	顾家家居	300	21,153.00	0.02
228	300770	新媒股份	300	21,090.00	0.02
229	002607	中公教育	600	21,078.00	0.02
230	300630	普利制药	500	20,945.00	0.02
231	002747	埃斯顿	700	20,874.00	0.02
232	600161	天坛生物	500	20,850.00	0.02
233	002595	豪迈科技	700	20,755.00	0.02
234	300333	兆日科技	2,200	20,746.00	0.02
235	002318	久立特材	1,900	20,710.00	0.02
236	603127	昭衍新药	200	20,622.00	0.02
237	603195	公牛集团	100	20,529.00	0.02
238	601816	京沪高铁	3,600	20,376.00	0.02
239	300308	中际旭创	400	20,344.00	0.02
240	300549	优德精密	900	20,241.00	0.02
241	603338	浙江鼎力	200	20,238.00	0.02
242	300007	汉威科技	1,300	20,228.00	0.02
243	000960	锡业股份	1,800	20,160.00	0.02
244	002335	科华恒盛	900	20,106.00	0.02
245	600872	中炬高新	300	19,995.00	0.02
246	601677	明泰铝业	1,400	19,796.00	0.02
247	300226	上海钢联	300	19,680.00	0.02
248	603690	至纯科技	500	19,660.00	0.02
249	002311	海大集团	300	19,650.00	0.02
250	000672	上峰水泥	1,000	19,510.00	0.02
251	300853	申昊科技	300	19,497.00	0.02
252	601579	会稽山	1,400	19,376.00	0.02
253	002925	盈趣科技	300	19,299.00	0.02
254	603345	安井食品	100	19,287.00	0.02
255	002726	龙大肉食	1,500	19,200.00	0.02
256	603666	亿嘉和	200	19,178.00	0.02
257	000050	深天马 A	1,300	19,162.00	0.02
258	300573	兴齐眼药	200	19,046.00	0.02

259	000403	双林生物	500	19,000.00	0.02
260	000301	东方盛虹	2,000	18,960.00	0.02
261	000951	中国重汽	600	18,876.00	0.02
262	300541	先进数通	1,100	18,854.00	0.02
263	600740	山西焦化	3,200	18,848.00	0.02
264	300675	建科院	1,100	18,810.00	0.02
265	300864	南大环境	200	18,708.00	0.02
266	002372	伟星新材	1,000	18,700.00	0.02
266	300702	天宇股份	200	18,700.00	0.02
267	603236	移远通信	100	18,694.00	0.02
268	300017	网宿科技	2,700	18,603.00	0.02
269	002299	圣农发展	700	18,578.00	0.02
270	300002	神州泰岳	3,600	18,396.00	0.02
271	002818	富森美	1,300	18,369.00	0.02
272	300785	值得买	200	18,176.00	0.02
273	300899	上海凯鑫	400	18,048.00	0.02
274	300298	三诺生物	500	17,900.00	0.02
275	603010	万盛股份	800	17,840.00	0.02
276	603612	索通发展	1,300	17,771.00	0.02
277	300846	首都在线	800	17,752.00	0.02
278	300828	锐新科技	600	17,622.00	0.02
279	300001	特锐德	600	17,616.00	0.02
280	003006	百亚股份	700	17,605.00	0.02
281	300507	苏奥传感	1,600	17,600.00	0.02
282	300010	豆神教育	1,800	17,568.00	0.02
283	300406	九强生物	700	17,514.00	0.02
284	300031	宝通科技	900	17,478.00	0.02
285	300019	硅宝科技	1,000	17,290.00	0.02
286	603801	志邦家居	500	17,255.00	0.02
287	002891	中宠股份	300	17,247.00	0.02
288	300188	美亚柏科	800	17,232.00	0.02
289	300269	联建光电	4,200	17,178.00	0.02
290	603378	亚士创能	400	17,084.00	0.02
291	300873	海晨股份	400	17,064.00	0.02
292	300286	安科瑞	1,100	17,039.00	0.02
293	002436	兴森科技	1,800	17,028.00	0.02
294	300119	瑞普生物	900	16,992.00	0.02
294	300729	乐歌股份	400	16,992.00	0.02
295	605136	丽人丽妆	600	16,962.00	0.02

296	002324	普利特	1,000	16,940.00	0.02
297	300465	高伟达	1,400	16,898.00	0.02
298	601212	白银有色	5,700	16,872.00	0.02
299	603298	杭叉集团	800	16,808.00	0.02
300	002250	联化科技	700	16,793.00	0.02
301	002408	齐翔腾达	2,000	16,720.00	0.02
301	300769	德方纳米	100	16,720.00	0.02
302	300271	华宇软件	700	16,709.00	0.02
303	300047	天源迪科	2,200	16,698.00	0.02
304	002511	中顺洁柔	800	16,696.00	0.02
305	300624	万兴科技	300	16,617.00	0.02
306	601666	平煤股份	2,800	16,604.00	0.02
307	300036	超图软件	900	16,596.00	0.02
308	002158	汉钟精机	1,100	16,588.00	0.02
309	300620	光库科技	400	16,576.00	0.02
310	603985	恒润股份	500	16,505.00	0.02
311	000426	兴业矿业	2,100	16,464.00	0.02
312	300741	华宝股份	300	16,461.00	0.02
313	300151	昌红科技	600	16,452.00	0.02
314	603317	天味食品	200	16,448.00	0.02
315	603348	文灿股份	600	16,440.00	0.02
316	300314	戴维医疗	1,000	16,430.00	0.02
317	300866	安克创新	100	16,426.00	0.02
318	300166	东方国信	1,500	16,425.00	0.02
319	300243	瑞丰高材	1,100	16,346.00	0.02
320	600885	宏发股份	300	16,266.00	0.02
321	300276	三丰智能	3,900	16,263.00	0.02
322	300662	科锐国际	300	16,230.00	0.02
323	600446	金证股份	1,000	16,210.00	0.02
324	002906	华阳集团	600	16,176.00	0.02
325	002155	湖南黄金	1,900	16,169.00	0.02
326	300347	泰格医药	100	16,161.00	0.02
327	300098	高新兴	4,000	16,160.00	0.02
328	002918	蒙娜丽莎	500	16,150.00	0.02
329	603858	步长制药	700	16,149.00	0.02
330	300394	天孚通信	300	15,999.00	0.02
331	003010	若羽臣	500	15,870.00	0.02
332	300303	聚飞光电	3,000	15,840.00	0.02
333	300555	路通视信	1,700	15,776.00	0.02

334	002484	江海股份	1,500	15,750.00	0.02
335	603920	世运电路	600	15,696.00	0.02
336	002368	太极股份	600	15,666.00	0.02
337	002123	梦网集团	1,100	15,653.00	0.02
338	300107	建新股份	2,600	15,626.00	0.02
339	000751	锌业股份	4,400	15,620.00	0.02
340	300612	宣亚国际	800	15,512.00	0.02
341	603043	广州酒家	400	15,492.00	0.02
342	603583	捷昌驱动	200	15,450.00	0.02
343	002317	众生药业	1,400	15,428.00	0.02
344	300252	金信诺	1,600	15,424.00	0.02
345	002714	牧原股份	200	15,420.00	0.02
346	000913	钱江摩托	600	15,354.00	0.02
347	601808	中海油服	1,200	15,324.00	0.02
348	000708	中信特钢	700	15,253.00	0.01
349	300184	力源信息	3,000	15,240.00	0.01
350	300280	紫天科技	300	15,135.00	0.01
351	603515	欧普照明	500	15,105.00	0.01
352	300878	维康药业	300	15,087.00	0.01
353	002283	天润工业	2,800	15,064.00	0.01
354	300597	吉大通信	1,400	15,036.00	0.01
355	603877	太平鸟	500	15,000.00	0.01
356	000559	万向钱潮	2,800	14,980.00	0.01
357	600803	新奥股份	1,100	14,949.00	0.01
358	300399	天利科技	900	14,940.00	0.01
359	300520	科大国创	700	14,938.00	0.01
360	300763	锦浪科技	100	14,900.00	0.01
361	000158	常山北明	2,400	14,880.00	0.01
361	300835	龙磁科技	300	14,880.00	0.01
362	300698	万马科技	900	14,859.00	0.01
363	603429	集友股份	500	14,855.00	0.01
364	000090	天健集团	2,500	14,850.00	0.01
365	300366	创意信息	1,500	14,805.00	0.01
366	300906	日月明	400	14,764.00	0.01
367	002351	漫步者	1,100	14,762.00	0.01
368	300813	泰林生物	300	14,736.00	0.01
369	600282	南钢股份	4,700	14,664.00	0.01
370	300292	吴通控股	3,500	14,595.00	0.01
371	300830	金现代	1,200	14,568.00	0.01

372	300768	迪普科技	400	14,556.00	0.01
373	300442	普丽盛	400	14,540.00	0.01
374	002735	王子新材	400	14,516.00	0.01
375	002773	康弘药业	300	14,445.00	0.01
376	600039	四川路桥	3,200	14,432.00	0.01
377	300669	沪宁股份	400	14,424.00	0.01
378	605058	澳弘电子	600	14,418.00	0.01
379	300836	佰奥智能	300	14,400.00	0.01
380	300353	东土科技	1,600	14,352.00	0.01
381	002884	凌霄泵业	600	14,340.00	0.01
382	300263	隆华科技	2,100	14,301.00	0.01
383	300135	宝利国际	5,500	14,245.00	0.01
384	300481	濮阳惠成	700	14,203.00	0.01
385	300859	西域旅游	700	14,168.00	0.01
385	600339	中油工程	4,600	14,168.00	0.01
386	300170	汉得信息	1,800	14,148.00	0.01
387	300242	佳云科技	2,900	14,094.00	0.01
388	300462	华铭智能	700	14,091.00	0.01
389	600933	爱柯迪	900	14,040.00	0.01
390	300430	诚益通	1,600	13,984.00	0.01
391	300463	迈克生物	300	13,980.00	0.01
392	300061	旗天科技	2,900	13,978.00	0.01
393	300738	奥飞数据	400	13,960.00	0.01
394	603890	春秋电子	1,200	13,944.00	0.01
395	002675	东诚药业	700	13,937.00	0.01
396	300349	金卡智能	1,100	13,915.00	0.01
397	300380	安硕信息	700	13,874.00	0.01
398	000967	盈峰环境	1,700	13,838.00	0.01
399	600808	马钢股份	5,200	13,832.00	0.01
400	300725	药石科技	100	13,800.00	0.01
401	603306	华懋科技	600	13,788.00	0.01
401	603638	艾迪精密	200	13,788.00	0.01
402	600997	开滦股份	2,400	13,776.00	0.01
402	601228	广州港	4,100	13,776.00	0.01
403	002896	中大力德	500	13,755.00	0.01
404	600053	九鼎投资	700	13,685.00	0.01
405	600728	佳都科技	1,800	13,662.00	0.01
405	603979	金诚信	1,100	13,662.00	0.01
406	605018	长华股份	1,100	13,640.00	0.01

407	600079	人福医药	400	13,552.00	0.01
408	300588	熙菱信息	1,400	13,538.00	0.01
409	600017	日照港	4,700	13,536.00	0.01
410	603786	科博达	200	13,524.00	0.01
411	000600	建投能源	2,400	13,464.00	0.01
412	002512	达华智能	3,500	13,440.00	0.01
413	300651	金陵体育	300	13,416.00	0.01
414	000959	首钢股份	3,500	13,405.00	0.01
415	300868	杰美特	300	13,395.00	0.01
416	300162	雷曼光电	1,900	13,319.00	0.01
417	300641	正丹股份	2,500	13,275.00	0.01
418	603568	伟明环保	700	13,251.00	0.01
419	000969	安泰科技	2,000	13,240.00	0.01
420	603358	华达科技	700	13,230.00	0.01
421	000725	京东方 A	2,200	13,200.00	0.01
421	300020	银江股份	1,600	13,200.00	0.01
422	300808	久量股份	800	13,152.00	0.01
423	600674	川投能源	1,300	13,065.00	0.01
424	300798	锦鸡股份	1,200	13,044.00	0.01
425	002815	崇达技术	900	12,996.00	0.01
426	300365	恒华科技	1,300	12,987.00	0.01
427	300052	中青宝	1,400	12,964.00	0.01
427	300220	金运激光	700	12,964.00	0.01
427	300634	彩讯股份	700	12,964.00	0.01
428	600894	广日股份	1,600	12,928.00	0.01
429	002862	实丰文化	1,200	12,840.00	0.01
430	600458	时代新材	1,500	12,765.00	0.01
431	603768	常青股份	800	12,712.00	0.01
432	600307	酒钢宏兴	7,700	12,705.00	0.01
433	002144	宏达高科	1,000	12,700.00	0.01
434	300845	捷安高科	400	12,656.00	0.01
435	300535	达威股份	900	12,645.00	0.01
436	603383	顶点软件	400	12,588.00	0.01
437	002543	万和电气	1,500	12,525.00	0.01
438	300689	澄天伟业	300	12,483.00	0.01
439	300319	麦捷科技	1,400	12,446.00	0.01
440	002757	南兴股份	800	12,432.00	0.01
440	603118	共进股份	1,200	12,432.00	0.01
441	600717	天津港	2,600	12,428.00	0.01

442	601958	金钼股份	2,000	12,420.00	0.01
443	002940	昂利康	300	12,408.00	0.01
443	601326	秦港股份	4,400	12,408.00	0.01
444	300533	冰川网络	500	12,340.00	0.01
445	300553	集智股份	400	12,312.00	0.01
446	603332	苏州龙杰	700	12,306.00	0.01
447	002703	浙江世宝	2,100	12,285.00	0.01
448	300336	新文化	3,800	12,274.00	0.01
449	300564	筑博设计	500	12,250.00	0.01
450	300148	天舟文化	3,500	12,180.00	0.01
451	601968	宝钢包装	1,500	12,150.00	0.01
452	003007	直真科技	400	12,120.00	0.01
453	600575	淮河能源	5,200	12,064.00	0.01
454	300613	富瀚微	100	12,052.00	0.01
455	300759	康龙化成	100	12,040.00	0.01
456	300245	天玑科技	1,300	12,025.00	0.01
457	600582	天地科技	3,900	12,012.00	0.01
458	300277	海联讯	1,300	11,960.00	0.01
458	601106	中国一重	4,000	11,960.00	0.01
459	601003	柳钢股份	2,300	11,937.00	0.01
460	002780	三夫户外	600	11,928.00	0.01
461	603033	三维股份	500	11,905.00	0.01
462	603787	新日股份	400	11,836.00	0.01
463	300594	朗进科技	500	11,835.00	0.01
464	300307	慈星股份	2,300	11,822.00	0.01
465	300857	协创数据	400	11,812.00	0.01
466	300605	恒锋信息	900	11,772.00	0.01
467	300384	三联虹普	800	11,736.00	0.01
468	603719	良品铺子	200	11,734.00	0.01
469	002712	思美传媒	2,400	11,712.00	0.01
470	300071	华谊嘉信	4,900	11,711.00	0.01
471	603095	越剑智能	500	11,705.00	0.01
472	600688	上海石化	3,400	11,696.00	0.01
473	300701	森霸传感	400	11,624.00	0.01
474	000657	中钨高新	1,600	11,600.00	0.01
475	605369	拱东医疗	200	11,550.00	0.01
476	300483	沃施股份	300	11,544.00	0.01
477	002527	新时达	1,900	11,495.00	0.01
478	300812	易天股份	300	11,475.00	0.01



479	603214	爱婴室	500	11,470.00	0.01
480	300637	扬帆新材	1,400	11,452.00	0.01
481	300403	汉宇集团	1,800	11,448.00	0.01
482	300074	华平股份	2,700	11,421.00	0.01
483	002823	凯中精密	1,100	11,418.00	0.01
484	300838	浙江力诺	600	11,400.00	0.01
485	002666	德联集团	2,200	11,374.00	0.01
486	002538	司尔特	1,900	11,343.00	0.01
487	000965	天保基建	3,200	11,328.00	0.01
488	300653	正海生物	200	11,326.00	0.01
489	300710	万隆光电	400	11,288.00	0.01
490	603100	川仪股份	1,000	11,280.00	0.01
491	603121	华培动力	1,000	11,220.00	0.01
492	603040	新坐标	400	11,208.00	0.01
493	600692	亚通股份	1,600	11,200.00	0.01
494	600639	浦东金桥	900	11,160.00	0.01
495	601996	丰林集团	3,700	11,100.00	0.01
496	603717	天域生态	1,300	11,050.00	0.01
497	600058	五矿发展	1,500	10,995.00	0.01
498	600368	五洲交通	3,000	10,980.00	0.01
499	600980	北矿科技	800	10,976.00	0.01
500	002541	鸿路钢构	300	10,959.00	0.01
501	002093	国脉科技	1,500	10,935.00	0.01
501	002955	鸿合科技	500	10,935.00	0.01
501	300530	达志科技	300	10,935.00	0.01
502	002003	伟星股份	1,600	10,912.00	0.01
503	300557	理工光科	400	10,812.00	0.01
504	300476	胜宏科技	500	10,785.00	0.01
505	600790	轻纺城	3,200	10,784.00	0.01
506	300291	华录百纳	2,200	10,758.00	0.01
507	603189	网达软件	600	10,752.00	0.01
508	603286	日盈电子	700	10,661.00	0.01
509	300851	交大思诺	300	10,647.00	0.01
510	600571	信雅达	1,400	10,612.00	0.01
511	000038	深大通	1,100	10,560.00	0.01
512	300420	五洋停车	1,800	10,512.00	0.01
513	000885	城发环境	900	10,494.00	0.01
514	600476	湘邮科技	1,000	10,450.00	0.01
515	002296	辉煌科技	1,500	10,425.00	0.01

516	002577	雷柏科技	900	10,422.00	0.01
517	603918	金桥信息	1,000	10,340.00	0.01
518	300161	华中数控	600	10,338.00	0.01
519	603156	养元饮品	400	10,336.00	0.01
520	603580	艾艾精工	900	10,332.00	0.01
521	300691	联合光电	800	10,320.00	0.01
522	600389	江山股份	500	10,295.00	0.01
523	300570	太辰光	600	10,236.00	0.01
524	002279	久其软件	2,200	10,208.00	0.01
525	300546	雄帝科技	600	10,206.00	0.01
526	603039	泛微网络	100	10,096.00	0.01
527	002937	兴瑞科技	800	10,080.00	0.01
527	603611	诺力股份	700	10,080.00	0.01
528	300745	欣锐科技	500	9,975.00	0.01
529	002968	新大正	200	9,910.00	0.01
530	605178	时空科技	200	9,900.00	0.01
531	603958	哈森股份	1,600	9,856.00	0.01
532	002479	富春环保	1,700	9,758.00	0.01
532	603042	华脉科技	700	9,758.00	0.01
533	603327	福蓉科技	500	9,745.00	0.01
534	605255	天普股份	600	9,660.00	0.01
535	300467	迅游科技	700	9,653.00	0.01
536	600137	浪莎股份	700	9,590.00	0.01
537	603496	恒为科技	600	9,510.00	0.01
538	300789	唐源电气	200	9,504.00	0.01
539	300818	耐普矿机	300	9,450.00	0.01
540	603223	恒通股份	500	9,410.00	0.01
541	603331	百达精工	900	9,360.00	0.01
542	002755	奥赛康	700	9,142.00	0.01
542	603029	天鹅股份	700	9,142.00	0.01
543	002221	东华能源	900	9,126.00	0.01
544	600560	金自天正	1,000	9,040.00	0.01
545	300312	邦讯技术	1,600	9,008.00	0.01
546	600025	华能水电	2,000	8,920.00	0.01
547	603897	长城科技	500	8,910.00	0.01
548	603933	睿能科技	800	8,888.00	0.01
549	300210	森远股份	2,000	8,880.00	0.01
550	600329	中新药业	500	8,760.00	0.01
551	300631	久吾高科	500	8,660.00	0.01

552	003816	中国广核	3,000	8,460.00	0.01
553	300608	思特奇	600	8,268.00	0.01
554	601928	凤凰传媒	1,300	8,229.00	0.01
555	603380	易德龙	400	8,160.00	0.01
556	300816	艾可蓝	100	8,032.00	0.01
557	300560	中富通	500	8,015.00	0.01
558	300871	回盛生物	200	7,986.00	0.01
559	002262	恩华药业	500	7,985.00	0.01
560	300563	神宇股份	300	7,929.00	0.01
561	300163	先锋新材	2,200	7,722.00	0.01
562	603577	汇金通	800	7,416.00	0.01
563	300154	瑞凌股份	1,300	7,410.00	0.01
564	603316	诚邦股份	1,000	7,340.00	0.01
565	300515	三德科技	700	7,301.00	0.01
566	300668	杰恩设计	500	7,265.00	0.01
567	300042	朗科科技	500	7,010.00	0.01
568	300330	华虹计通	700	6,916.00	0.01
569	300539	横河模具	900	6,696.00	0.01
570	300211	亿通科技	1,000	6,610.00	0.01
571	300736	百邦科技	700	6,475.00	0.01
572	300640	德艺文创	800	5,840.00	0.01
573	002953	日丰股份	300	5,799.00	0.01
574	002019	亿帆医药	300	5,679.00	0.01
575	600716	凤凰股份	1,300	5,343.00	0.01
576	001965	招商公路	700	4,823.00	0.00
577	000931	中关村	600	4,134.00	0.00
578	600455	博通股份	200	4,080.00	0.00
579	300264	佳创视讯	1,000	3,850.00	0.00
580	300229	拓尔思	300	2,508.00	0.00

## 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	300338	开元教育	1,655,070.00	1.48
2	300282	三盛教育	1,517,147.00	1.36
3	002621	美吉姆	1,420,945.48	1.27

4	002730	电光科技	1,395,241.20	1.25
5	600576	祥源文化	1,347,091.98	1.21
6	603986	兆易创新	1,334,969.00	1.20
7	600438	通威股份	1,281,966.00	1.15
8	600455	博通股份	1,264,437.00	1.13
9	601515	东风股份	1,150,289.80	1.03
10	600511	国药股份	1,134,946.00	1.02
11	300269	联建光电	1,133,362.00	1.02
12	300122	智飞生物	1,131,636.00	1.01
13	300105	龙源技术	1,048,866.00	0.94
14	603165	荣晟环保	1,043,973.20	0.94
15	600076	康欣新材	1,036,432.00	0.93
16	000633	合金投资	1,027,764.00	0.92
17	600939	重庆建工	987,901.00	0.89
18	600196	复星医药	983,029.00	0.88
19	300654	世纪天鸿	969,721.60	0.87
20	601226	华电重工	968,660.50	0.87

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 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	300338	开元教育	1,797,101.20	1.61
2	300282	三盛教育	1,561,307.60	1.40
3	002621	美吉姆	1,521,523.66	1.36
4	002730	电光科技	1,499,839.63	1.34
5	300464	星徽股份	1,431,509.68	1.28
6	600438	通威股份	1,415,652.76	1.27
7	600576	祥源文化	1,400,095.70	1.26
8	600455	博通股份	1,387,640.30	1.24
9	601515	东风股份	1,297,675.50	1.16
10	603986	兆易创新	1,208,891.50	1.08
11	300269	联建光电	1,185,212.32	1.06
12	603165	荣晟环保	1,174,868.00	1.05
13	300122	智飞生物	1,172,221.60	1.05
14	600511	国药股份	1,164,336.92	1.04

15	000633	合金投资	1,138,503.43	1.02
16	600076	康欣新材	1,090,426.00	0.98
17	300500	启迪设计	1,085,846.72	0.97
18	300105	龙源技术	1,083,083.70	0.97
19	600196	复星医药	1,071,936.79	0.96
20	300654	世纪天鸿	1,032,155.93	0.93

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 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	458,847,051.63
卖出股票收入（成交）总额	461,674,772.40

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,204,000.00	29.66
	其中：政策性金融债	30,204,000.00	29.66
4	企业债券	56,773,400.00	55.76
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	44,205,500.00	43.41
7	可转债（可交换债）	1,491,147.70	1.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	132,674,047.70	130.30

### 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

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	200215	20 国开 15	100,000	10,136,000.00	9.95
2	149240	20 长江 05	100,000	10,123,000.00	9.94
3	200212	20 国开 12	100,000	10,057,000.00	9.88
4	200207	20 国开 07	100,000	10,011,000.00	9.83
5	136185	16 国发 01	100,000	10,008,000.00	9.83

**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**

注：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**

注：本基金本报告期末持有贵金属。

**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**

注：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国债期货交易情况说明****8.10.1 本期国债期货投资政策**

国债期货操作整体谨慎，通过严控持仓规模和持仓期限，有效控制风险。

**8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	报告期内，本基金运用股指期货是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，总体风险可控且符合既定的投资政策和投资目标。
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-4,300.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

**8.10.3 本期国债期货投资评价**

国债期货操作整体谨慎，通过严控持仓规模和持仓期限，有效控制风险。

**8.11 投资组合报告附注****8.11.1 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**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会行政处罚，罚款合计 4880 万元。主要违法违规事实：（一）为违规的政府购买服务项目提供融资；（二）项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；（三）违规变相发放土地储备贷款；（四）设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款；（五）贷款风险分类不准确；（六）向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产；（七）违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量；（八）向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品

品；（九）扶贫贷款存贷挂钩；（十）易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁；（十一）未落实同业业务交易对手名单制监管要求；（十二）以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理；（十三）以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理；（十四）风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务；（十五）未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况；（十六）逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务；（十七）利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表；（十八）违规收取小微企业贷款承诺费；（十九）收取财务顾问费质价不符；（二十）利用银团贷款承诺费浮利分费；（二十一）向检查组提供虚假整改说明材料；（二十二）未如实提供信贷资产转让台账；（二十三）案件信息迟报、瞒报；（二十四）对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位。

上述证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体未出现本期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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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	134,520.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,860,729.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,995,249.82

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128112	歌尔转 2	879,615.00	0.86
2	123033	金力转债	258,507.60	0.25

3	110053	苏银转债	216,520.00	0.21
---	--------	------	------------	------

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无



## § 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

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
395	253,107.58	54,459,148.96	54.47%	45,518,344.31	45.53%

### 9.2 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	973.98	0.0010%

### 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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 9.5 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	10,703,333.61	10.71	10,000,600.00	10.00	3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	10,703,333.61	10.71	10,000,600.00	10.00	3年

注：本基金成立后有 10,000,600.00 份额为发起份额，发起份额为基金管理人固有资金认购，发

起份额承诺的持有期限为 3 年，自 2018 年 11 月 2 日起至 2021 年 11 月 1 日止。2020 年 12 月本基金分红 702,733.61 份额，根据基金合同约定，该分红份额计入发起份额。

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2018年11月2日）基金份额总额	150,011,600.00
本报告期期初基金份额总额	108,641,890.03
本报告期基金总申购份额	296,451,015.18
减:本报告期基金总赎回份额	305,115,411.94
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	99,977,493.27

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

本报告期内，本基金管理人发生重大人事变动。根据国金基金管理有限公司第三届董事会审议通过，索峰先生自 2020 年 2 月 28 日起不再担任公司副总经理，林霄先生自 2020 年 9 月 18 日起担任公司副总经理，于涛先生自 2020 年 10 月 16 日起担任公司副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金权益组合自 2020 年 6 月中下旬起对投资策略进行了调整，新策略以基本面因子为基础，利用机器学习方法构建多周期预测模型，通过预测因子和挖掘个股阿尔法等途径获取选股收益。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000 元人民币。截至本报告期末，该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 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

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无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	
东方证券	1	548,579,823.45	59.59%	401,178.91	59.60%	-

华创证券	1	371,937,630.58	40.41%	271,996.50	40.40%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

（1）基金专用交易席位的选择标准如下：

- ① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③ 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需要；
- ④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；
- ⑤ 交易佣金收取标准合理。

（2）基金专用交易席位的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

### 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

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
东方证券	81,914,494.53	19.99%	44,890,000.00	1.03%	-	-
华创证券	327,836,477.96	80.01%	4,300,300,000.00	98.97%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 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	《国金量化添利定期开放债券型	规定披露媒体和本	2020年1月17日

	发起式证券投资基金 2019 年第 4 季度报告》	基金基金管理人网站	
2	《国金基金管理有限公司关于关闭网上交易平台开户、认购、申购及定投业务的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 2 月 29 日
3	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 2 月 29 日
4	《国金基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 3 月 26 日
5	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年年度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 4 月 17 日
6	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日
7	《关于国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 5 月 12 日
8	《关于国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 20 日
9	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 20 日
10	《关于国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 30 日

11	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020年6月30日
12	《国金基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020年7月21日
13	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年第 2 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020年7月21日
14	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年中期报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020年8月27日
15	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020年8月28日
16	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金产品资料概要（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020年8月28日
17	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020年9月4日
18	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金产品资料概要（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020年9月4日
19	《关于国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020年9月4日
20	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020年9月19日

		站	
21	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2020 年 10 月 17 日
22	《关于国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更的公告》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2020 年 10 月 22 日
23	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年第 3 季度报告》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2020 年 10 月 28 日
24	《国金基金管理有限公司关于大泰金石基金销售有限公司投资者基金份额转托管的公告》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2020 年 10 月 29 日
25	《关于国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务的公告》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2020 年 11 月 26 日
26	《关于国金基金管理有限公司调整旗下部分基金单笔申购最低金额的公告》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2020 年 11 月 28 日
27	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2020 年 12 月 2 日
28	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2020 年 12 月 2 日
29	《国金基金管理有限公司关于提示投资者持续完善身份信息资料的公告》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2020 年 12 月 11 日
30	《国金量化添利定期开放债券型	规定披露媒体和本	2020 年 12 月 18 日



	发起式证券投资基金 2020 年分红公告》	基金基金管理人网站	
31	《国金基金管理有限公司关于浙江金观诚基金销售有限公司、深圳盈信基金销售有限公司和泰诚财富基金销售（大连）有限公司投资者基金份额转托管的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 12 月 24 日
32	《国金基金管理有限公司关于不法分子利用货币基金快速申赎进行诈骗的风险提示》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 12 月 30 日

注：本报告期内，基金管理人在基金封闭期内至少每周公告 1 次基金的份额净值和份额累计净值。

## § 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	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 18 日	46,785,505.88	-	46,785,505.88	0.00	0.00%
	2	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 18 日；2020 年 12 月 2 日至 2020 年 12 月 7 日；2020 年 12 月 10 日至 2020 年 12 月 31 日	40,003,800.00	-	20,000,000.00	20,003,800.00	20.01%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过 20%的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。</p>							

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书；
- 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、报告期内披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。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或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2021 年 3 月 30 日