

# 中金精选股票型集合资产管理计划 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：中国国际金融股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>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 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	41

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	41
7.12 投资组合报告附注 .....	41
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	43
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	45
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>45</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	45
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>45</b>
12.1 备查文件目录 .....	45
12.2 存放地点 .....	45
12.3 查阅方式 .....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金精选股票型集合资产管理计划	
基金简称	集合-中金精选	
基金主代码	920002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 8 月 4 日	
基金管理人	中国国际金融股份有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	222,322,325.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金精选 A 类份额	中金精选 C 类份额
下属分级基金的交易代码	920002	920922
报告期末下属分级基金的份额总额	211,829,839.07 份	10,492,486.17 份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合立足于通过筛选中长期高质量的成长股，在控制一定风险的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本集合计划致力于通过寻找中长期高质量的成长标的来为投资者创造价值，管理人认为唯一能够对抗经济周期的并不是所谓的防御，而是持续的高成长，管理人致力于寻找具备高护城河的成长股，整体组合偏好制造业、消费领域具备核心竞争优势的企业，通过量化护城河深度来为企业定价。为应对系统性风险，本集合计划会在满足证监会相关规定的基础上，择机配置部分股指期货对冲市场风险。债券方面，本集合计划主要配置具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券逆回购、银行存款等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*90%+中证全债指数收益率*5%+活期存款利率*5% 主要基于本组合投资策略为寻找具备中期核心竞争力的高质量成长标的，管理人认为沪深 300 指数成分股聚集了中国高竞争力的一批企业，具有较好的代表性。如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称，或今后法律法规发生变化，或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本管理人可依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，经履行适当程序，调整业绩比较基准并及时公告，而无需召开

	集合计划份额持有人大会。
风险收益特征	本集合计划为股票型集合资产管理计划，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划、混合型基金、混合型集合资产管理计划。

### 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		中国国际金融股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	宋璐芳	许俊
	联系电话	010-65051166	010-66594319
	电子邮箱	songlf@cicc.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		010-65051166	95566
传真		010-65058035	010-66594942
注册地址		北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京朝阳区建国门外大街 1 号国贸 3 期 B 座 42 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100004	100818
法定代表人		沈如军	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cicc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	中金精选 A 类份额	中金精选 C 类份额
本期已实现收益	74,146,706.52	2,567,899.81
本期利润	-4,448,561.98	-391,318.97
加权平均基金份	-0.0202	-0.0390

额本期利润		
本期加权平均净值利润率	-0.89%	-1.73%
本期基金份额净值增长率	-1.41%	-1.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	385,243,431.92	12,668,563.73
期末可供分配基金份额利润	1.8186	1.2074
期末基金资产净值	469,693,784.57	23,161,049.90
期末基金份额净值	2.2173	2.2074
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	17.31%	14.17%

注：①所述集合计划业绩指标不包括持有人交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益。

③对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 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

中金精选 A 类份额

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.98%	0.96%	-1.80%	0.72%	-1.18%	0.24%

过去三个月	-0.41%	0.95%	3.22%	0.88%	-3.63%	0.07%
过去六个月	-1.41%	1.15%	0.44%	1.18%	-1.85%	-0.03%
自基金合同生效起 至今	17.31%	1.08%	8.84%	1.07%	8.47%	0.01%

## 中金精选 C 类份额

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.02%	0.96%	-1.80%	0.72%	-1.22%	0.24%
过去三个月	-0.54%	0.95%	3.22%	0.88%	-3.76%	0.07%
过去六个月	-1.66%	1.15%	0.44%	1.18%	-2.10%	-0.03%
自基金合同生效起 至今	14.17%	1.09%	9.81%	1.08%	4.36%	0.01%

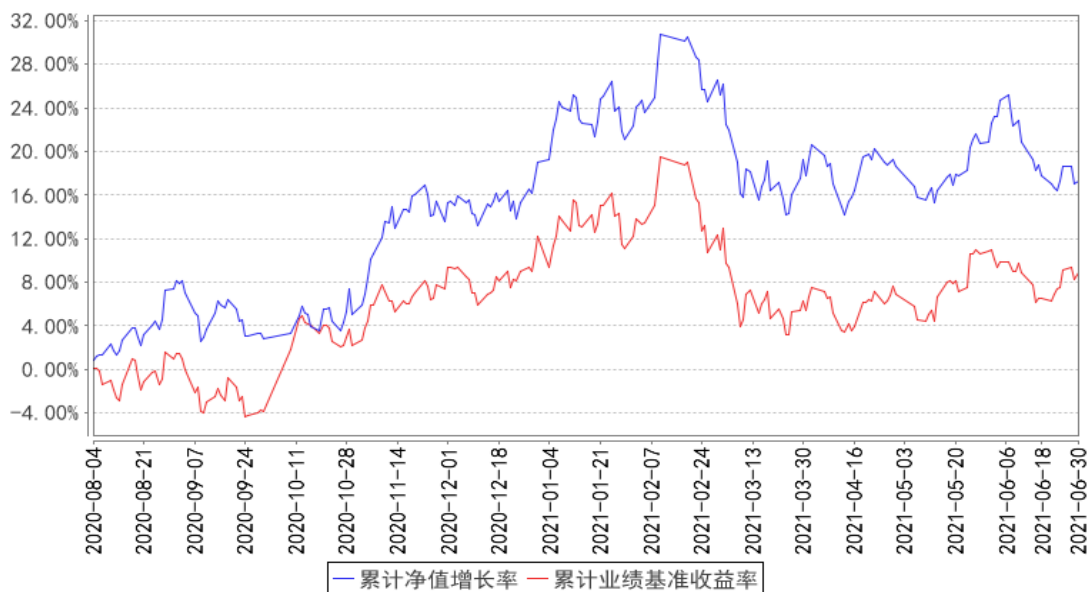
注：1、本基金基金合同于 2020 年 8 月 4 日生效。截至本报告期末，基金合同生效未满一年；

2、上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。

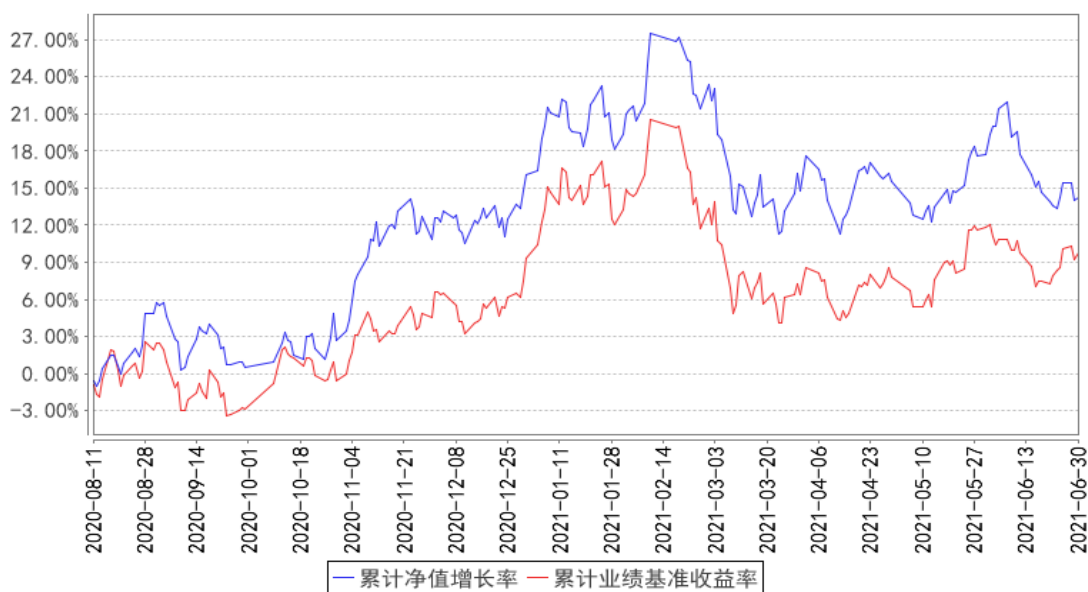


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中金精选A类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



中金精选C类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：2020年8月4日至2020年8月10日期间，中金精选集合计划C类基金份额为零。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中国国际金融股份有限公司是中国第一家中外合资投资银行，面向国内外机构及个人客户提

供综合化、一站式的全方位投资银行服务，公司成立日期：1995 年 7 月 31 日，住所为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层。

中金公司自 2002 年开始经营资产管理业务，以全方位投资银行平台优势为依托，参照国际行业标准与国内监管要求，致力于打造多资产、多策略、跨市场的综合性资管机构。中金公司资产管理业务牌照齐全、产品丰富。拥有全国社保基金管理人、企业年金投资管理人、职业年金投资管理人、保险资金投资管理人、境内集合/单一资产管理计划、合格境内机构投资者（QDII）集合/单一资产管理、人民币合格境内机构投资者（RQDII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）、合格境外机构投资者（QFII）等多项业务资格，并在香港设立了独立的资产管理子公司，拥有香港 Type4 证券咨询牌照和 Type9 资产管理牌照。

中金公司根据《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》的要求，截至 2021 年 6 月 30 日，旗下已有六只大集合产品完成公募化改造，分别为：中金恒瑞债券型集合资产管理计划、中金新锐股票型集合资产管理计划、中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划、中金精选股票型集合资产管理计划、中金汇越量化对冲 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划、中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划。

#### 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		
张翔	本基金的基金经理	2020 年 08 月 04 日	-	11 年	2007 年获武汉大学化学与管理学双学士，2010 年获南京大学经济学硕士。2010.7-2015.4 年就职于长江证券研究部任化工行业首席分析师；2015.5-至今主要任职于中金公司资产管理部，历任投资经理助理、投资经理。

注：1. 基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

2. 非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

3. 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. 本集合计划投资经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金秉持基于竞争优势的策略，买入护城河较深且具备安全边际的公司长期持有。在报告期内，我们维持了仓位和结构的稳定性，重点集中在具备成本优势的制造业、品牌和渠道优势突出的消费公司以及通过对供应链进行改造进而提升效率的部分公司。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 2.2173 元，份额累计净值为 6.3613 元，本基金 C 类基金份额净值为 2.2074 元，份额累计净值为 2.2074 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-1.41% 本基金 C 类基金份额净值增长率为-1.66% 同期业绩基准增长率 0.44%

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去的半年，市场波动异常巨大，从我们的角度，我们秉持不去预判市场的风格，立足于公司的长期成长，努力通过对高质量的经营进行评估定价。站在这个时点，我们认为市场下跌是风险释放最好的方式，因此我们在未来一段时间重点的精力将围绕对具备竞争优势的公司且中长期

能看到持续拓展的公司进行深入研究，重心依然是：品牌消费公司、具备长期经验积累的子行业、具备成本优势且具备持续拓展的制造业、具备网络效应及转换成本的科技公司。此外，我们通过对供应链的研究理解，接下来我们会从供应链的角度对相关公司进行重新评估，试图抽象出企业在运营中的核心要素，并依托上述要点来对公司的能力边界进行重新界定。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定及集合计划合同约定，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。本基金管理人设立了估值委员会，估值委员会负责决定估值运作的基本原则与工作机制、会计政策、估值办法、特殊情况下的估值决策，定期对估值政策与流程进行评价。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行收益分配。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中金精选股票型集合资产管理计划（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金

份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中金精选股票型集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	65,392,004.83	73,496,963.81
结算备付金		-	145,442.71
存出保证金		63,463.55	51,517.68
交易性金融资产	6.4.7.2	440,713,597.41	512,856,871.00
其中：股票投资		440,713,597.41	512,856,871.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	29,600,000.00	-
应收证券清算款		116,178.98	293,222.39
应收利息	6.4.7.5	6,483.61	8,062.51
应收股利		-	-
应收申购款		23,948.76	29,922.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		535,915,677.14	586,882,003.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		29,600,000.00	-
应付赎回款		1,235,160.11	4,636,040.63
应付管理人报酬		629,744.28	711,945.83
应付托管费		83,965.90	94,926.11
应付销售服务费		9,623.19	12,652.40
应付交易费用	6.4.7.7	27,379.90	66,311.10
应交税费		2,445,239.22	4,906,602.20
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	9,029,730.07	9,101,716.34
负债合计		43,060,842.67	19,530,194.61
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	94,942,838.82	104,459,960.65
未分配利润	6.4.7.10	397,911,995.65	462,891,847.78
所有者权益合计		492,854,834.47	567,351,808.43
负债和所有者权益总计		535,915,677.14	586,882,003.04

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 222,322,325.24 份，其中中金精选 A 类基金份额总额 211,829,839.07 份，基金份额净值 2.2173 人民币。中金精选 C 类基金份额总额 10,492,486.17 份，基金份额净值 2.2074 人民币；

## 6.2 利润表

会计主体：中金精选股票型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		453,474.85
1. 利息收入		138,152.46
其中：存款利息收入	6.4.7.11	123,033.98
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		15,118.48
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		81,422,999.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	77,107,183.03
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-

贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	4,315,816.04
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-81,554,487.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	446,810.60
减：二、费用		5,293,355.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,908,552.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	521,140.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	56,027.54
4. 交易费用	6.4.7.19	420,407.75
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		275,898.34
7. 其他费用	6.4.7.20	111,328.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,839,880.95
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,839,880.95

注：本基金基金合同于 2020 年 8 月 4 日生效。截至本报告期末，基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金精选股票型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	104,459,960.65	462,891,847.78	567,351,808.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,839,880.95	-4,839,880.95
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）	-9,517,121.83	-60,139,971.18	-69,657,093.01
其中：1. 基金申购款	23,429,689.67	65,172,418.84	88,602,108.51

2. 基金赎回款	-32,946,811.50	-125,312,390.02	-158,259,201.52
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）	94,942,838.82	397,911,995.65	492,854,834.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

徐翌成

赵阳光

赵阳光

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中金精选股票型集合资产管理计划(以下简称“本基金”)由中金股票精选集合资产管理计划变更而来。中金股票精选集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划,于 2006 年 6 月 5 日经中国证监会证监许可[2006]100 号文核准设立,自 2006 年 6 月 14 日起开始募集,于 2006 年 7 月 14 日结束募集工作,并于 2006 年 7 月 20 日正式成立。由中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)和中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)作为推广机构,自 2006 年 6 月 14 日至 2006 年 7 月 14 日进行推广。中金股票精选集合资产管理计划于 2006 年 7 月 20 日成立,成立之日集合计划实收份额为 1,663,022,251.25 份(含利息转份额 540,611.22 份),发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所审验并出具验资报告。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》(证监会公告(2018)39 号)的规定,中金精选股票型集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。经中国证监会批准,自 2020 年 8 月 4 日起,《中金精选股票型集合资产管理计划资产管理合同》生效,原《中金股票精选集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本基金自基金合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等)、股指期货、



国债期货、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于本基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率\*90%+ 中证全债指数收益率 \*5%+ 活期存款利率\*5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会、中国基金业协会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表按照 6.4.2 所述的编制基础编制，真实、完整地反映了按该编制基础列报的本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

本基金目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

(1) 根据财政部和国家税务总局 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，2018 年 1 月 1 日起，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，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(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照资管产品管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(2) 对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) 对基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

(4) 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，暂免予缴纳印花税、企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	65,392,004.83
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	65,392,004.83

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	374,845,846.25	440,713,597.41	65,867,751.16
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债   交易所市场	-	-	-

券	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		374,845,846.25	440,713,597.41	65,867,751.16

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	29,600,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	29,600,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	6,455.01
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	-
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	28.60
合计	6,483.61

注：其他为应收保证金利息。

## 6.4.7.6 其他资产

注：无。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	27,379.90
银行间市场应付交易费用	-
合计	27,379.90

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,853.43
应付证券出借违约金	-
预提费用	88,643.16
代扣代缴个人所得税	8,938,233.48
合计	9,029,730.07

注：代扣代缴个人所得税为原中金股票精选集合资产管理计划在以前年度派发股息红利及债券利息时代扣代缴的个人所得税。

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 中金精选 A 类份额

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	245,807,120.60	97,996,233.77
本期申购	25,485,544.23	10,160,402.42
本期赎回（以“-”号填列）	-59,462,825.76	-23,706,283.54
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	211,829,839.07	84,450,352.65

## 中金精选 C 类份额

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,463,726.88	6,463,726.88
本期申购	13,269,287.25	13,269,287.25

本期赎回（以“-”号填列）	-9,240,527.96	-9,240,527.96
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	10,492,486.17	10,492,486.17

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

## 中金精选 A 类份额

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	375,251,848.28	79,594,396.15	454,846,244.43
本期利润	74,146,706.52	-78,595,268.50	-4,448,561.98
本期基金份额 交易产生的变 动数	-54,833,342.74	-10,320,907.79	-65,154,250.53
其中：基金申 购款	44,200,865.53	3,901,910.16	48,102,775.69
基金赎 回款	-99,034,208.27	-14,222,817.95	-113,257,026.22
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	394,565,212.06	-9,321,780.14	385,243,431.92

## 中金精选 C 类份额

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,444,730.98	1,600,872.37	8,045,603.35
本期利润	2,567,899.81	-2,959,218.78	-391,318.97
本期基金份额 交易产生的变 动数	4,904,200.50	110,078.85	5,014,279.35
其中：基金申 购款	15,973,634.12	1,096,009.03	17,069,643.15
基金赎 回款	-11,069,433.62	-985,930.18	-12,055,363.80
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	13,916,831.29	-1,248,267.56	12,668,563.73

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	121,144.10

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	1,401.58
其他	488.30
合计	123,033.98

注：其他为存出保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	157,384,605.60
减：卖出股票成本总额	80,277,422.57
买卖股票差价收入	77,107,183.03

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

##### 6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

注：无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,315,816.04
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	4,315,816.04

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-84,288,811.39
股票投资	-84,288,811.39
债券投资	
资产支持证券投资	
基金投资	
贵金属投资	
其他	
2. 衍生工具	
权证投资	
3. 其他	
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-2,734,324.11
合计	-81,554,487.28

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	446,810.60
合计	446,810.60

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	420,407.75
银行间市场交易费用	-
合计	420,407.75

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
审计费用		19,835.79
信息披露费		59,507.37
证券出借违约金		-
银行费用		4,085.80
账户维护费		27,900.00
合计		111,328.96

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（“中金财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
中金公司	249,426,010.44	100.00



**6.4.10.1.2 债券交易**

注：无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

注：无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	232,293.55	100.00	27,379.90	100.00

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	1,394,391.09

注：支付基金管理人中金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，逐日计提并按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	521,140.34

注：支付托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提，逐日计提并按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金精选 A 类份额	中金精选 C 类份额	合计
中国银行	-	21,013.64	21,013.64
中金财富	-	20,762.05	20,762.05
中金公司	-	11,972.80	11,972.80
合计	-	53,748.49	53,748.49

注：支付销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.50% 的年费率计提，按月支付。

A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类资产净值 × 0.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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：无。

##### 6.4.10.4.2 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：无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无

## 6.4.10.5.2 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

注：无

## 6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	65,392,004.83	121,144.10

注：本基金的银行存款由托管行中国银行保管，按同业利率或约定利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：无。

## 6.4.11 利润分配情况

注：无。

## 6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	首次非公开发行限售	9.19	40.38	158	1,452.02	6,380.04	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	首次非公开发行限售	13.39	30.10	100	1,339.00	3,010.00	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月20日	首次非公开发行限售	13.87	29.55	90	1,248.30	2,659.50	-
300931	通用电气	2021年	2021年	首次非	4.31	13.11	218	939.58	2,857.98	-

	梯	1月13日	7月21日	公开发 行限售							
300932	三友联 众	2021年 1月15日	2021年 7月22日	首次非 公开发 行限售	24.69	31.71	201	4,962.69	6,373.71		-
300933	中辰股 份	2021年 1月15日	2021年 7月22日	首次非 公开发 行限售	3.37	10.44	606	2,042.22	6,326.64		-
300940	南极光	2021年 1月27日	2021年 8月3日	首次非 公开发 行限售	12.76	43.38	139	1,773.64	6,029.82		-
300941	创识科 技	2021年 2月2日	2021年 8月9日	首次非 公开发 行限售	21.31	49.94	258	5,497.98	12,884.52		-
300942	易瑞生 物	2021年 2月2日	2021年 8月9日	首次非 公开发 行限售	5.31	28.52	243	1,290.33	6,930.36		-
300943	春晖智 控	2021年 2月3日	2021年 8月10日	首次非 公开发 行限售	9.79	23.01	151	1,478.29	3,474.51		-
300945	曼卡龙	2021年 2月3日	2021年 8月10日	首次非 公开发 行限售	4.56	18.88	218	994.08	4,115.84		-
300950	德固特	2021年 2月24日	2021年 9月3日	首次非 公开发 行限售	8.41	39.13	103	866.23	4,030.39		-
300953	震裕科 技	2021年 3月11日	2021年 9月22日	首次非 公开发 行限售	28.77	99.85	91	2,618.07	9,086.35		-
300955	嘉亨家 化	2021年 3月16日	2021年 9月24日	首次非 公开发 行限售	16.53	46.07	113	1,867.89	5,205.91		-
300956	英力股 份	2021年 3月16日	2021年 9月27日	首次非 公开发 行限售	12.85	25.80	194	2,492.90	5,005.20		-
300957	贝泰妮	2021年 3月18日	2021年 9月27日	首次非 公开发 行限售	47.33	251.96	382	18,080.06	96,248.72		-
300960	通业科 技	2021年 3月22日	2021年 9月29日	首次非 公开发 行限售	12.08	23.06	126	1,522.08	2,905.56		-
300961	深水海 纳	2021年 3月23日	2021年 9月30日	首次非 公开发 行限售	8.48	22.07	222	1,882.56	4,899.54		-

300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	首次非公开发行限售	12.13	22.49	138	1,673.94	3,103.62	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	首次非公开发行限售	4.54	11.54	230	1,044.20	2,654.20	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	首次非公开发行限售	6.87	12.07	579	3,977.73	6,988.53	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	首次非公开发行限售	18.24	28.29	105	1,915.20	2,970.45	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	首次非公开发行限售	7.19	12.65	119	855.61	1,505.35	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	首次非公开发行限售	33.22	87.50	630	20,928.60	55,125.00	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	首次非公开发行限售	48.59	90.39	324	15,743.16	29,286.36	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	首次非公开发行限售	24.90	24.81	170	4,233.00	4,217.70	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	首次非公开发行限售	14.79	30.57	135	1,996.65	4,126.95	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	首次非公开发行限售	13.06	26.51	119	1,554.14	3,154.69	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	首次非公开发行限售	9.36	20.32	91	851.76	1,849.12	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	首次非公开发行限售	14.72	23.32	74	1,089.28	1,725.68	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	首次非公开发行限售	20.81	42.23	103	2,143.43	4,349.69	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	首次非公开发行限售	6.02	21.32	100	602.00	2,132.00	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	首次非公开发	18.71	57.62	96	1,796.16	5,531.52	-

		日	日	行限售							
301004	嘉益股份	2021年 6月18 日	2021年 12月25 日	首次非 公开发 行限售	7.81	21.94	128	999.68	2,808.32		-
301007	德迈仕	2021年 6月4日	2021年 12月16 日	首次非 公开发 行限售	5.29	14.44	147	777.63	2,122.68		-
301010	晶雪节能	2021年 6月9日	2021年 12月20 日	首次非 公开发 行限售	7.83	17.61	100	783.00	1,761.00		-
301011	华立科技	2021年 6月9日	2021年 12月17 日	首次非 公开发 行限售	14.20	33.84	78	1,107.60	2,639.52		-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月22 日	首次非 公开发 行限售	8.05	24.26	83	668.15	2,013.58		-
301013	利和兴	2021年 6月21 日	2021年 12月29 日	首次非 公开发 行限售	8.72	27.11	210	1,831.20	5,693.10		-
301015	百洋医药	2021年 6月22 日	2021年 12月30 日	首次非 公开发 行限售	7.64	38.83	199	1,520.36	7,727.17		-
301016	雷尔伟	2021年 6月23 日	2021年 12月30 日	首次非 公开发 行限售	13.75	32.98	108	1,485.00	3,561.84		-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2021年 7月6日	新股未 上市	10.64	10.64	1,326	14,108.64	14,108.64		-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2022年 1月6日	首次非 公开发 行限售	10.64	10.64	148	1,574.72	1,574.72		-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2021年 07月06 日	新股未 上市	9.46	9.46	1,132	10,708.72	10,708.72		-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2022年 1月6日	首次非 公开发 行限售	9.46	9.46	126	1,191.96	1,191.96		-
605162	新中港	2021年 6月29 日	2021年 07月07 日	新股未 上市	6.07	6.07	330	2,003.10	2,003.10		-
688087	英科再生	2021年 6月30 日	2021年 07月09 日	新股未 上市	21.96	21.96	1,189	26,110.44	26,110.44		-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本基金管理人制定了相应的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。

本基金管理人建立了由风险管理部、内部审计部、法律合规部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理部、内部审计部、法律合规部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。此外，业务部门也建立了自身的内部控制机制，主要由授权体系和业务后台部门信息监控机制组成。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放于中国银行，该行为本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。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，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。流动性风险一般存在两种形式：资产变现风险和现金流风险。

#### (1) 资产变现风险

资产变现风险是指由于基金持有的某个券种的头寸相对于市场正常的交易量过大，或由于停牌造成交易无法在当前的市场价格下成交。本基金管理人应用定量方法对各持仓品种的变现能力进行测算和分析，以对资产变现风险进行管理。

#### (2) 现金流风险

现金流风险是指基金因现金流不足导致无法应对正常基金支付义务的风险。本基金管理人对基金每日和每周净赎回比例进行测算和分析，以对该风险进行跟踪和管理。此外，本基金管理人建立了现金头寸控制机制，以确保赎回款项的及时支付。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续



监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申购、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	65,392,004.83	-	-	-	65,392,004.83
存出保证金	63,463.55	-	-	-	63,463.55
交易性金融资产	-	-	-	440,713,597.41	440,713,597.41
买入返售金融资产	29,600,000.00	-	-	-	29,600,000.00
应收利息	-	-	-	6,483.61	6,483.61
应收申购款	-	-	-	23,948.76	23,948.76
应收证券清算款	-	-	-	116,178.98	116,178.98
资产总计	95,055,468.38	-	-	440,860,208.76	535,915,677.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,235,160.11	1,235,160.11
应付管理人报酬	-	-	-	629,744.28	629,744.28
应付托管费	-	-	-	83,965.90	83,965.90

应付证券清算款	-	-	-	29,600,000.00	29,600,000.00
应付销售服务费	-	-	-	9,623.19	9,623.19
应付交易费用	-	-	-	27,379.90	27,379.90
应交税费	-	-	-	2,445,239.22	2,445,239.22
其他负债	-	-	-	9,029,730.07	9,029,730.07
负债总计	-	-	-	43,060,842.67	43,060,842.67
利率敏感度缺口	95,055,468.38	-	-	-397,799,366.09	492,854,834.47
上年度末 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	73,496,963.81	-	-	-	73,496,963.81
结算备付金	145,442.71	-	-	-	145,442.71
存出保证金	51,517.68	-	-	-	51,517.68
交易性金融资产	-	-	-	-512,856,871.00	512,856,871.00
应收利息	-	-	-	8,062.51	8,062.51
应收申购款	-	-	-	29,922.94	29,922.94
应收证券清算款	-	-	-	293,222.39	293,222.39
资产总计	73,693,924.20	-	-	-513,188,078.84	586,882,003.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,636,040.63	4,636,040.63
应付管理人报酬	-	-	-	711,945.83	711,945.83
应付托管费	-	-	-	94,926.11	94,926.11
应付销售服务费	-	-	-	12,652.40	12,652.40
应付交易费用	-	-	-	66,311.10	66,311.10
应交税费	-	-	-	4,906,602.20	4,906,602.20
其他负债	-	-	-	9,101,716.34	9,101,716.34
负债总计	-	-	-	19,530,194.61	19,530,194.61
利率敏感度缺口	73,693,924.20	-	-	-493,657,884.23	567,351,808.43

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定假日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的债券等资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人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进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	440,713,597.41	89.42	512,856,871.00	90.39
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	440,713,597.41	89.42	512,856,871.00	90.39

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升5%	22,035,679.87	25,642,843.55
	业绩比较基准下降5%	-22,035,679.87	-25,642,843.55

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

下表按公允价值三个层次列示了以公允价值计量的金融资产于 2021 年 6 月 30 日的账面价值。

于 2021 年 6 月 30 日，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中属于第一层次的余额为人民币 440312427.17 元，属于第二层次的余额为人民币 401170.24 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，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、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将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	440,713,597.41	82.24
	其中：股票	440,713,597.41	82.24
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	29,600,000.00	5.52
	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	65,392,004.83	12.20
8	其他各项资产	210,074.90	0.04
9	合计	535,915,677.14	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,159.55	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	376,473,468.07	76.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,290.70	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,632,343.51	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	11,454,940.00	2.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,075.81	0.00
J	金融业	14,693,584.55	2.98
K	房地产业	21,521,716.14	4.37
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	13,939.08	0.00
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	11,896,080.00	2.41
S	综合	-	-
	合计	440,713,597.41	89.42

### 7.2.2 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。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	---------	-----------

					(%)
1	002415	海康威视	804,100	51,864,450.00	10.52
2	002250	联化科技	1,746,069	48,715,325.10	9.88
3	000333	美的集团	656,671	46,866,609.27	9.51
4	600519	贵州茅台	22,200	45,658,740.00	9.26
5	600426	华鲁恒升	1,468,344	45,445,246.80	9.22
6	000860	顺鑫农业	926,625	39,085,042.50	7.93
7	000002	万科A	903,894	21,521,716.14	4.37
8	002254	泰和新材	1,049,120	21,265,662.40	4.31
9	600066	宇通客车	1,592,589	19,891,436.61	4.04
10	002078	太阳纸业	1,355,556	18,096,672.60	3.67
11	600036	招商银行	271,145	14,693,347.55	2.98
12	000596	古井贡酒	55,500	13,292,250.00	2.70
13	300144	宋城演艺	708,100	11,896,080.00	2.41
14	600009	上海机场	238,000	11,454,940.00	2.32
15	002422	科伦药业	465,410	9,284,929.50	1.88
16	002557	洽洽食品	201,400	8,680,340.00	1.76
17	000568	泸州老窖	33,800	7,974,772.00	1.62
18	601933	永辉超市	976,850	4,620,500.50	0.94
19	300957	贝泰妮	382	96,248.72	0.02
20	300979	华利集团	630	55,125.00	0.01
21	300981	中红医疗	324	29,286.36	0.01
22	688087	英科再生	1,189	26,110.44	0.01
23	301020	密封科技	1,474	15,683.36	0.00
24	300941	创识科技	258	12,884.52	0.00
25	301021	英诺激光	1,258	11,900.68	0.00
26	300953	震裕科技	91	9,086.35	0.00
27	301015	百洋医药	199	7,727.17	0.00
28	300968	格林精密	579	6,988.53	0.00
29	300942	易瑞生物	243	6,930.36	0.00
30	300614	百川畅银	158	6,380.04	0.00
31	300932	三友联众	201	6,373.71	0.00
32	300933	中辰股份	606	6,326.64	0.00
33	300940	南极光	139	6,029.82	0.00
34	301013	利和兴	210	5,693.10	0.00
35	301002	崧盛股份	96	5,531.52	0.00
36	300955	嘉亨家化	113	5,205.91	0.00
37	300956	英力股份	194	5,005.20	0.00
38	300961	深水海纳	222	4,899.54	0.00
39	300996	普联软件	103	4,349.69	0.00
40	300985	致远新能	170	4,217.70	0.00
41	300986	志特新材	135	4,126.95	0.00

42	300945	曼卡龙	218	4,115.84	0.00
43	300950	德固特	103	4,030.39	0.00
44	301016	雷尔伟	108	3,561.84	0.00
45	300943	春晖智控	151	3,474.51	0.00
46	300991	创益通	119	3,154.69	0.00
47	300963	中洲特材	138	3,103.62	0.00
48	300927	江天化学	100	3,010.00	0.00
49	300971	博亚精工	105	2,970.45	0.00
50	300960	通业科技	126	2,905.56	0.00
51	300931	通用电梯	218	2,857.98	0.00
52	603171	税友股份	148	2,841.60	0.00
53	301004	嘉益股份	128	2,808.32	0.00
54	300929	华骐环保	90	2,659.50	0.00
55	300967	晓鸣股份	230	2,654.20	0.00
56	301011	华立科技	78	2,639.52	0.00
57	300998	宁波方正	100	2,132.00	0.00
58	301007	德迈仕	147	2,122.68	0.00
59	301012	扬电科技	83	2,013.58	0.00
60	605162	新中港	330	2,003.10	0.00
61	300992	泰福泵业	91	1,849.12	0.00
62	301010	晶雪节能	100	1,761.00	0.00
63	300995	奇德新材	74	1,725.68	0.00
64	300972	万辰生物	119	1,505.35	0.00
65	605011	杭州热电	145	1,287.60	0.00
66	601688	华泰证券	15	237.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	29,972,331.40	5.28
2	600426	华鲁恒升	13,540,144.15	2.39
3	000333	美的集团	11,624,449.00	2.05
4	002557	洽洽食品	10,185,219.52	1.80
5	000596	古井贡酒	10,158,792.00	1.79
6	000860	顺鑫农业	8,600,331.00	1.52
7	002254	泰和新材	5,248,285.00	0.93
8	600519	贵州茅台	412,700.00	0.07
9	688538	和辉光电	220,456.15	0.04
10	300979	华利集团	209,286.00	0.04
11	300957	贝泰妮	180,374.63	0.03
12	300981	中红医疗	157,237.24	0.03

13	688317	之江生物	131,648.12	0.02
14	688680	海优新材	115,750.70	0.02
15	300941	创识科技	54,809.32	0.01
16	688626	翔宇医疗	54,152.78	0.01
17	300932	三友联众	49,577.52	0.01
18	688619	罗普特	49,433.60	0.01
19	688667	菱电电控	48,570.48	0.01
20	300985	致远新能	42,105.90	0.01

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002078	太阳纸业	36,411,846.00	6.42
2	600426	华鲁恒升	24,182,445.20	4.26
3	600036	招商银行	22,007,033.24	3.88
4	000568	泸州老窖	18,294,094.07	3.22
5	603589	口子窖	17,531,135.32	3.09
6	601128	常熟银行	8,778,590.00	1.55
7	000333	美的集团	8,536,575.00	1.50
8	002250	联化科技	7,503,438.00	1.32
9	600519	贵州茅台	5,157,136.00	0.91
10	600309	万华化学	2,205,540.59	0.39
11	000860	顺鑫农业	1,552,896.00	0.27
12	300957	贝泰妮	557,140.80	0.10
13	300979	华利集团	516,089.00	0.09
14	300981	中红医疗	373,250.86	0.07
15	688680	海优新材	371,923.57	0.07
16	688538	和辉光电	362,731.07	0.06
17	000596	古井贡酒	244,999.00	0.04
18	688317	之江生物	231,044.44	0.04
19	300863	卡倍亿	175,157.80	0.03
20	300941	创识科技	148,806.00	0.03

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	92,422,960.37
卖出股票收入（成交）总额	159,683,758.37

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用



**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

**7.12 投资组合报告附注**

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

**7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。**

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	63,463.55
2	应收证券清算款	116,178.98
3	应收股利	-
4	应收利息	6,483.61
5	应收申购款	23,948.76
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	210,074.90

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
中金精选 A 类份额	1,863	113,703.62	880,600.79	0.42	210,949,238.28	99.58
中金精选 C 类份额	314	33,415.56	0.00	0.00	10,492,486.17	100.00
合计	2,177	102,123.25	880,600.79	0.40	221,441,724.45	99.60

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持	中金精选 A 类份额	0.00	0
	中金精选 C 类份额	513,448.98	4.89

有本基金			
	合计	513,448.98	0.23

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	中金精选 A 类份额	0
	中金精选 C 类份额	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中金精选 A 类份额	0
	中金精选 C 类份额	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金精选 A 类份额	中金精选 C 类份额
基金合同生效日 (2020 年 8 月 4 日) 基金份额总额	204,128,356.91	-
本报告期期初基金份额总额	245,807,120.60	6,463,726.88
本报告期基金总申购份额	25,485,544.23	13,269,287.25
减：本报告期基金总赎回份额	59,462,825.76	9,240,527.96
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	211,829,839.07	10,492,486.17

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，公司合规总监陈刚先生由于身体原因无法继续履行合规总监职责。为确保公司合规工作不受影响，根据《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》及《中国国际金融股份有限公司章程》的规定，董事会同意：陈刚先生不再担任合规总监职务，自董事会批准并于证券监督管理机构备案及/或批准（如需）之日（以下简称“生效日”）起生效；由公司首席执行官自生效日起代为履行合规总监职责，直至公司聘任新任合规总监为止。

基金托管人未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人资产管理业务、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，基金托管人未涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所为本基金提供审计服务。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人资产管理业务及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	249,426,010.44	100.00%	232,293.55	100.00%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

中金公司	-	-	60,800,000.00	100.00%	-	-
------	---	---	---------------	---------	---	---

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增中国银行股份有限公司为中金精选股票型集合资产管理计划代销机构的公告	中国证监会指定网站	2021年2月25日
2	中国国际金融股份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	2021年04月13日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：无

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 关于准予中金股票精选集合资产管理计划合同变更的回函
- (二) 中金精选股票型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 中金精选股票型集合资产管理计划招募说明书
- (四) 中金精选股票型集合资产管理计划托管协议
- (五) 管理人业务资格批复件、营业执照
- (六) 报告期内披露的各项公告

### 12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸 3 期 B 座 42 层。

### 12.3 查阅方式

投资者可到管理人办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：800-810-8802（固话用户免费） | (010)6505-0105（直线）

公司网址：www.cicc.com

中国国际金融股份有限公司

2021 年 8 月 28 日