

中金安心回报灵活配置混合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：华夏银行股份有限公司

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。

基金托管人华夏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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
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	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	43

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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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.....	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划	
基金简称	中金安心回报	
基金主代码	920011	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 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	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	739,828,554.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额
下属分级基金的交易代码	920011	920921
报告期末下属分级基金的份额总额	447,619,669.71 份	292,208,885.10 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	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券等大类资产中充分挖掘市场轮动机会、利用潜在投资价值，力求实现集合计划资产的持续稳定增值。
投资策略	依靠对大类资产配置和趋势研判的丰富实践与投资能力，结合系统化策略模型体系以及严格的风险预算机制，长期获取优异的绝对回报。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为中债新综合全价指数收益率×65%+中证 800 指数收益率×25%+恒生指数收益率×5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%
风险收益特征	本集合计划为混合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，低于股票型基金、股票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	华夏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	宋璐芳	郑鹏
	联系电话	010-65051166	010-85238667
	电子邮箱	songlf@cicc.com.cn	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		010-65051166	95577
传真		010-65058035	010-85238680

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	北京市东城区建国门内大街 22 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	北京市东城区建国门内大街 22 号
邮政编码	100004	100005
法定代表人	沈如军	李民吉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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)	
	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额
本期已实现收益	72,622,319.16	40,680,917.75
本期利润	4,867,429.44	2,366,192.95
加权平均基金份额本期利润	0.0083	0.0067
本期加权平均净值利润率	0.59%	0.48%
本期基金份额净值增长率	-1.00%	-1.19%
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	110,085,318.27
	171,414,371.14	

期末可供分配基金份额利润	0.3829	0.3767
期末基金资产净值	619,034,040.85	402,294,203.37
期末基金份额净值	1.3829	1.3767
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	16.81%	12.45%

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

中金安心回报 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	-0.90%	0.16%	-0.40%	0.22%	-0.50%	-0.06%
过去三个月	0.34%	0.19%	1.58%	0.25%	-1.24%	-0.06%
过去六个月	-1.00%	0.55%	1.34%	0.35%	-2.34%	0.20%
过去一年	9.97%	0.62%	6.55%	0.35%	3.42%	0.27%
自基金合同生效起至今	16.81%	0.60%	7.38%	0.34%	9.43%	0.26%

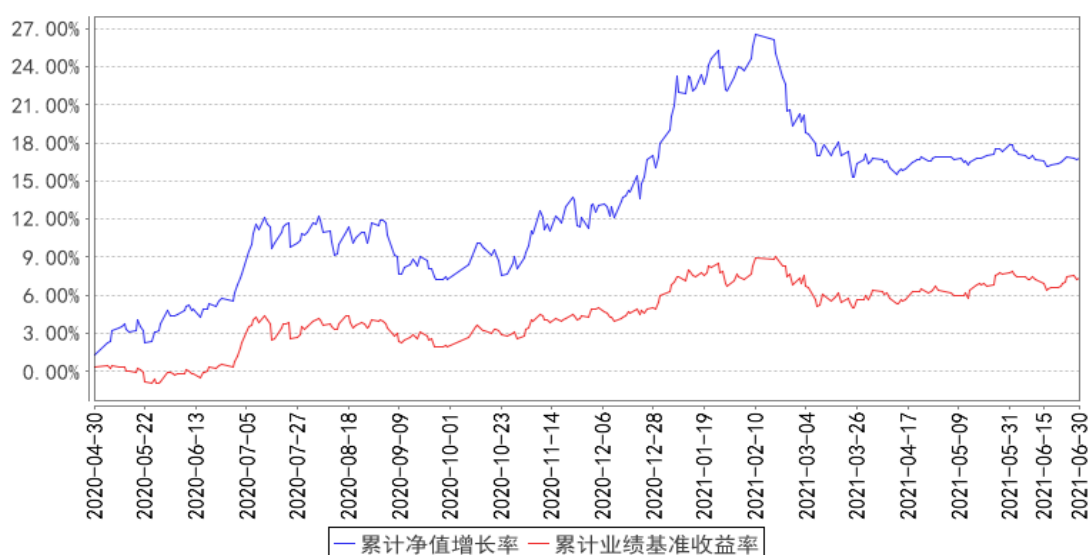
中金安心回报 C 类份额

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	-0.94%	0.16%	-0.40%	0.22%	-0.54%	-0.06%
过去三个月	0.24%	0.19%	1.58%	0.25%	-1.34%	-0.06%
过去六个月	-1.19%	0.55%	1.34%	0.35%	-2.53%	0.20%
过去一年	9.53%	0.62%	6.55%	0.35%	2.98%	0.27%
自基金合同生效起至今	12.45%	0.60%	6.95%	0.34%	5.50%	0.26%

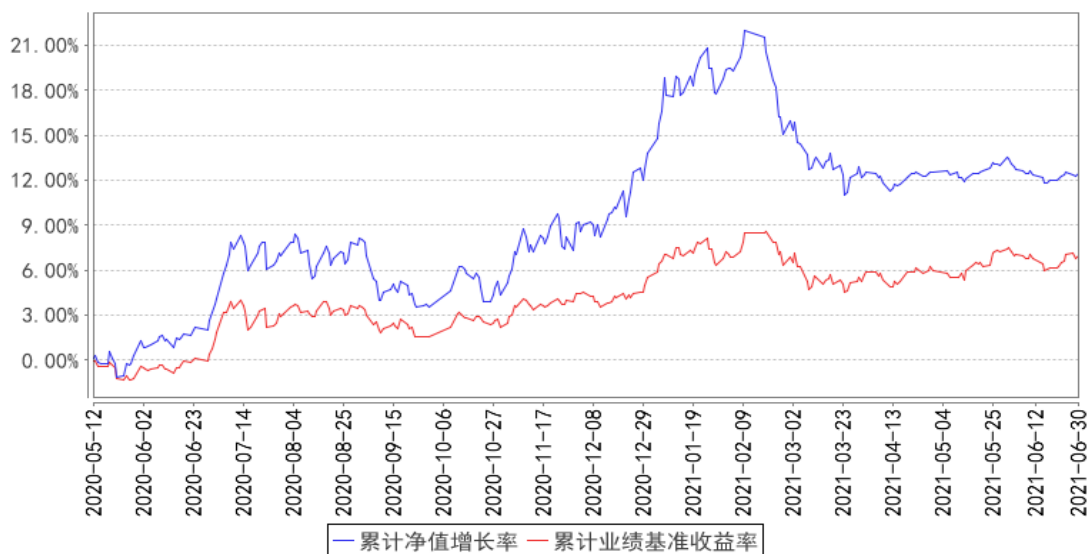
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

中金安心回报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



中金安心回报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4月30日至2020年5月11日期间，中金安心回报集合计划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Type 4证券咨询牌照和Type 9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		
李飞	本基金的基金经理	2020 年 4 月 30 日	-	6 年	2008 年获华中科技大学经济学学士和文学学士，2010 年获法国北方高等商学院理学硕士，2010 年—2015 年担任国家外汇管理局高级经理，负责全球资产配置工作；2016 年—2017 年担任中邮创业基金 QDII 投资经理，负责港股组合投资管理；2017 年—2018 年担任鹏扬基金多资产策略部执行总经理，负责股债混合策略投资管理；2018 年 6 月加入中金公司资产管理部，担任执行总经理，负责资产配置和 FOF 业务。
马健	本基金的投资助理	2020 年 4 月 30 日	-	3 年	2013 年获清华大学理学学士学位，2018 年获清华大学数学博士学位，2018 年 7 月加入中金公司资产管理部。

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

2021 年上半年，本集合权益部分仓位维持在中性水平，债券久期维持在中性偏高水平，在市场波动较大的情况下将风险管理列为优先目标。结合对经济周期、权益和债市配置性价比的研判，密切关注企业盈利持续性，平衡好权益市场的估值和盈利成长性，优选个股；同时，考虑到债券配置价值的吸引力，逐步增加债券配置，提升组合平衡性，提高组合静态收益率。对于权益部分，维持中低仓位，提升股债平衡性，结构上行业和风格保持均衡，耐心等待风险出清后可能的机会。对于债券，将久期加至中性偏高水平，赚取收益率下行带来的资本利得。

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 1.3829 元，份额累计净值为 2.4289 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.3767 元，份额累计净值为 1.3767 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-1.00%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-1.19%，同期业绩基准增长率 1.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年上半年，全球经济在遭遇第二轮疫情冲击的背景下复苏进程不断，主要经济体的经济景气度持续抬升，而在此过程中大宗商品价格不断攀升，主要金属价格持续冲高。

大类资产表现层面，股市呈现出宽幅震荡的状况，而债市冲高后逐步回落走出慢牛行情。1) 股市行情表现一波三折，走势大致可以分为三个阶段：农历新年之前，指数上行，市场延续去年以来的“核心资产”一九分化行情，少数股票带动指数上涨，绝大多数股票下跌。农历新年后到 3 月中旬，指数大幅下跌，“核心资产”快速下跌，带动指数下行超过 15%，成长类股票杀跌幅度较大。3 月中旬至 6 月底，指数震荡过程中逐步修复，周期股、核心资产、题材股轮番表现，代表中小盘的中证 500 指数相对沪深 300 指数有显著超额收益，大小盘风格有所逆转。2) 债市表现是收益率在年初冲高后逐步下行，走出慢牛行情。年初，受“永煤事件”影响，央行加大公开市

场投放力度，流动性极度充裕，利率快速回落。而到了一月末，信用债情绪平复叠加债市杠杆率上升触发政策调整，央行操作明显缩量，资金价格大幅调整，利率迅速反弹。此后，随着资金面平稳宽松，叠加对经济、通胀等利空因素的钝化，在机构欠配的驱动下，债市走出慢牛行情，收益率逐步下行。

近期行业政策频发，经济增长也有趋缓迹象，展望未来，需要从短期和中期两方面做好准备。短期而言，观察政策是否再升级。市场在经历大幅波动后，投资者可能会对后市变得“消极”，政策短期是否再升级还有待观察。中期而言，关注宏观层面的趋势性变化。进入二季度，国内宏观经济动能继续放缓，服务性消费恢复缓慢，基建活动见顶迹象明显，地产受拿地及政策等影响，投资有所下滑；仅出口和制造业仍保持较好的增速；社融需求与 PMI 见顶回落迹象。价格方面，在供给受限情况下仍保持高位震荡。接下来，市场将迎来几个关键的政策窗口，如 7 月政治局会议、8 月公布的 7 月经济数据以及 8 月下旬 Jackson Hole 全球央行年会。

落实到账户操作上，这一阶段仍将风险管理列为优先目标，维持中低仓位，提升股债平衡性，结构上行业和风格保持均衡，耐心等待风险出清后可能的机会。考虑到近期资金存量博弈特征明显，交易拥挤放大了市场的脆弱性，我们在股票头寸上保持较为谨慎的配置，降低了组合整体风险，在行业选择上从前期抱团及周期股头寸上逐步向科技与 500 指数切换，同时在长周期国内宏观经济边际走弱与对货币政策稳中趋松的判断下，我们逐步增加债券配置，提升组合平衡性，等待后续更明确的方向和时机。

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

报告期内，本基金托管人严格遵守《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，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害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，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划未进行利润分配。

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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2021 年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：中金安心回报灵活配置混合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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	108,246,438.81	251,482,501.43
结算备付金		52,117,309.73	96,557,379.95
存出保证金		5,482,782.86	41,388,627.13
交易性金融资产	6.4.7.2	803,799,193.59	1,467,753,860.29
其中：股票投资		125,635,693.59	1,414,759,160.29
基金投资		-	-
债券投资		678,163,500.00	52,994,700.00
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	70,000,000.00	200,000,000.00
应收证券清算款		-	50,114,269.99
应收利息	6.4.7.5	6,688,571.89	1,126,982.64
应收股利		75,504.00	102,955.75
应收申购款		399,281.67	4,478,279.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,046,809,082.55	2,113,004,856.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
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		9,992,887.11	24,793,295.99
应付赎回款		13,033,754.20	89,856,662.39
应付管理人报酬		890,156.96	1,854,830.52
应付托管费		133,523.57	278,224.57
应付销售服务费		139,848.49	277,000.94
应付交易费用	6.4.7.7	416,890.76	4,096,513.18
应交税费		24,404.21	6,444,104.75
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	849,373.03	1,112,006.03
负债合计		25,480,838.33	128,712,638.37
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	739,828,554.81	1,421,873,336.47
未分配利润	6.4.7.10	281,499,689.41	562,418,882.14
所有者权益合计		1,021,328,244.22	1,984,292,218.61
负债和所有者权益总计		1,046,809,082.55	2,113,004,856.98

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 739,828,554.81 份，其中中金安心回报 A 类份额基金份额总额 447,619,669.71 份，基金份额净值 1.3829 元。中金安心回报 C 类份额基金份额总额 292,208,885.10 份，基金份额净值 1.3767 元；

6.2 利润表

会计主体：中金安心回报灵活配置混合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	上年度可比期间 2020 年 4 月 30 日（基金合
-----	-----	------------------------------	--------------------------------

		6 月 30 日	同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		23,560,809.44	45,299,587.49
1. 利息收入		10,694,645.80	1,382,840.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	644,744.84	192,712.90
债券利息收入		8,094,953.06	701,347.14
资产支持证券利息收入			
买入返售金融资产收入		1,954,947.90	488,780.38
证券出借利息收入			
其他利息收入			
2. 投资收益（损失以“-”填列）		115,947,174.94	22,568,900.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	126,882,359.22	18,825,757.55
基金投资收益	-		
债券投资收益	6.4.7.13	-735,589.86	-1,061.90
资产支持证券投资	6.4.7.13.5		
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14		
衍生工具收益	6.4.7.15	-11,962,516.04	
股利收益	6.4.7.16	1,762,921.62	3,744,204.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-106,069,614.52	20,107,533.71
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	2,988,603.22	1,240,313.29
减：二、费用		16,327,187.05	3,818,857.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,586,526.67	1,591,747.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	987,979.08	296,997.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	988,434.42	185,863.18
4. 交易费用	6.4.7.19	7,047,593.67	1,665,473.99
5. 利息支出			
其中：卖出回购金融资产支出			
6. 税金及附加		607,576.20	44,062.89
7. 其他费用	6.4.7.20	109,077.01	34,712.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,233,622.39	41,480,729.90
减：所得税费用			
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,233,622.39	41,480,729.90

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金安心回报灵活配置混合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）	1,421,873,336.47	562,418,882.14	1,984,292,218.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,233,622.39	7,233,622.39
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）	-682,044,781.66	-288,152,815.12	-970,197,596.78
其中：1. 基金申购款	210,118,731.84	91,023,283.54	301,142,015.38
2. 基金赎回款	-892,163,513.50	-379,176,098.66	-1,271,339,612.16
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）	739,828,554.81	281,499,689.41	1,021,328,244.22
项目	上年度可比期间 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	177,701,315.63	32,679,676.97	210,380,992.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,480,729.90	41,480,729.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	844,784,303.96	188,956,147.82	1,033,740,451.78

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	1,079,365,232.24	245,138,245.32	1,324,503,477.56
2. 基金赎回款	-234,580,928.28	-56,182,097.50	-290,763,025.78
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）	1,022,485,619.59	263,116,554.69	1,285,602,174.28

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

中金安心回报集合资产管理计划（“本集合计划”）是依据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）于 2003 年 12 月发布的《证券公司客户资产管理业务试行办法》以及于 2008 年 5 月发布的《证券公司集合资产管理业务实施细则（试行）》设立的非限定性集合资产管理计划。本集合计划的管理人为中国国际金融股份有限公司（“中金公司”），托管人为华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）。中金公司于 2010 年 1 月 14 日取得了中国证监会出具的《关于核准中国国际金融有限公司设立中金安心回报集合资产管理计划的批复》（证监机构字[2010] 53 号）。

本集合计划由中金公司和华夏银行作为推广机构，自 2010 年 3 月 8 日至 2010 年 3 月 24 日进行推广。本集合计划于 2010 年 3 月 29 日成立，成立之日集合计划实收份额为 340,861,292.56 份（含利息转份额 97,847.56 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。

本集合计划不设固定存续期，主要投资的标的物为具有良好流动性的金融工具，包括现金及现金等价物、国内依法发行的上市公司股票、权证、证券投资基金、国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、可转换公司债券、分离交易的可转换公司债券、资产支持受益凭证、短期融资

券以及法律法规允许集合资产管理计划投资的其他金融工具。

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，暂免于缴纳印花税、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	108,246,438.81
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	108,246,438.81

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	127,668,605.46	125,635,693.59	-2,032,911.87
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	30,162,000.00	155,700.00
	银行间市场	644,891,247.00	3,110,253.00
	合计	674,897,547.00	3,265,953.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	802,566,152.46	803,799,193.59	1,233,041.13

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	121,982,881.75	-	-	

其中：国债 期货投资	121,982,881.75	-	-	-
货币衍生 工具	-	-	-	-
权益衍生 工具	-	-	-	-
其他衍生 工具	-	-	-	-
合计	121,982,881.75	-	-	-

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的国债期货情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
T2109	10 年期国债期货 2109 合 约	124.00	122053200.00	70318.25
总额合计				70318.25
减：可抵销期货暂收款				70318.25
股指期货投资净额				-

注：1. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为零。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融负债项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为零。

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	70,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	70,000,000.00	-

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	13,565.98
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	2,280.26
应收债券利息	6,671,356.85
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	1,368.80
合计	6,688,571.89

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	405,878.26
银行间市场应付交易费用	11012.5
合计	416,890.76

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	13,708.77
应付证券出借违约金	-
预提费用	88,643.16
其他	747,021.10
合计	849,373.03

注：代扣代缴个人所得税为原中金安心回报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

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	913,422,562.16	913,422,562.16
本期申购	110,650,746.54	110,650,746.54
本期赎回(以“-”号填列)	-576,453,638.99	-576,453,638.99
-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	447,619,669.71	447,619,669.71

中金安心回报 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	508,450,774.31	508,450,774.31
本期申购	99,467,985.30	99,467,985.30
本期赎回(以“-”号填列)	-315,709,874.51	-315,709,874.51
-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	292,208,885.10	292,208,885.10

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金安心回报 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	379,514,979.68	-17,067,096.04	362,447,883.64
本期利润	72,622,319.16	-67,754,889.72	4,867,429.44
本期基金份额交易产生的变动数	-226,777,236.49	30,876,294.55	-195,900,941.94
其中：基金申购款	58,032,513.59	-9,372,225.01	48,660,288.58
基金赎回款	-284,809,750.08	40,248,519.56	-244,561,230.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	225,360,062.35	-53,945,691.21	171,414,371.14

中金安心回报 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	168,721,319.53	31,249,678.97	199,970,998.50

本期利润	40,680,917.75	-38,314,724.80	2,366,192.95
本期基金份额交易产生的变动数	-87,604,747.34	-4,647,125.84	-92,251,873.18
其中：基金申购款	43,608,179.48	-1,245,184.52	42,362,994.96
基金赎回款	-131,212,926.82	-3,401,941.32	-134,614,868.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	121,797,489.94	-11,712,171.67	110,085,318.27

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		377,978.12
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		232,923.17
其他		33,843.55
合计		644,744.84

注：其他为保证金利息收入。

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		3,640,009,306.99
减：卖出股票成本总额		3,513,126,947.77
买卖股票差价收入		126,882,359.22

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

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	629,502,898.76
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	623,656,159.86
减：应收利息总额	6,582,328.76
买卖债券差价收入	-735,589.86

注：卖出债券成交总额中扣除了债券投资收益中增值税的影响。

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

6.4.7.15.1 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
	2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	-13,949,363.81
国债期货投资收益	1,986,847.77

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	1,762,921.62
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,762,921.62

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	-115,458,847.06
股票投资	-118,731,901.92
债券投资	3,273,054.86
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	5,768,465.85
权证投资	-
期货投资	5,768,465.85
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-3,620,766.69
合计	-106,069,614.52

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	2,988,603.22
合计	2,988,603.22

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	6,931,932.22
银行间市场交易费用	15,537.50
其他	100,123.95
合计	7,047,593.67

注：其他为中金所交易费用。

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	1,833.85
账户维护费	27,900.00

合计	109,077.01
----	------------

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
华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）	基金托管人
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

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

6.4.10.1.1 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		上年度可比期间 2020年4月30日（基金合同生效日）至 2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
中金公司	5,988,223,774.08	100.00	1,676,902,109.14	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

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	上年度可比期间 2020年4月30日（基金合同生效日）至 2020年6月30日
-------	----------------------------	---

	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
中金公司	30,006,300.00	100.00	67,152,461.30	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

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		上年度可比期间 2020年4月30日（基金合同生效日） 至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
中金公司	20,025,000,000.00	100.00	5,225,000,000.00	100.00

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	2,593,263.69	100.00	405,878.26	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020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	745,341.60	100.00	834,829.21	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	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,586,526.67	1,591,747.96
其中：支付销售机构的客户维护费	2,248,960.21	795,240.92

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 1.00% 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×1.00%/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	上年度可比期间 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	987,979.08	296,997.46

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 0.15% 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×0.15%/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		
	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额	合计
中金财富	-	194,221.41	194,221.41
中金公司	-	267,862.49	267,862.49
合计	-	462,083.90	462,083.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额	合计
中金财富	0.00	134,302.52	134,302.52
中金公司	0.00	51,006.21	51,006.21
合计	-	185,308.73	185,308.73

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 0.40% 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 × 0.40% / 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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额
基金合同生效日（2020 年 4 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	11,917,189.06	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	11,917,189.06	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.61%	-
项目	上年度可比期间 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 12 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额

基金合同生效日（2020年4月30日）持有的基金份额	11,917,189.06	-
报告期初持有的基金份额	11,917,189.06	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	11,917,189.06	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.17%	-

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		上年度可比期间 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行	108,246,438.81	377,978.12	67,994,609.26	172,431.60

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 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

注：无。

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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，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，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。

6.4.13.2.1 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	52,994,700.00
合计	-	52,994,700.00

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	140,689,000.00	-
AAA 以下	70,941,000.00	-
未评级	-	-
合计	211,630,000.00	-

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	108,246,438.81	-	-	-	108,246,438.81
结算备付金	52,117,309.73	-	-	-	52,117,309.73
存出保证金	5,482,782.86	-	-	-	5,482,782.86
交易性金融资产	-	211,630,000.00	466,533,500.00	125,635,693.59	803,799,193.59
买入返售金融资产	70,000,000.00	-	-	-	70,000,000.00
应收利息	-	-	-	6,688,571.89	6,688,571.89

应收股利	-	-	-	75,504.00	75,504.00
应收申购款	-	-	-	399,281.67	399,281.67
资产总计	235,846,531.40	211,630,000.00	466,533,500.00	132,799,051.15	1,046,809,082.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,033,754.20	13,033,754.20
应付管理人报酬	-	-	-	890,156.96	890,156.96
应付托管费	-	-	-	133,523.57	133,523.57
应付证券清算款	-	-	-	9,992,887.11	9,992,887.11
应付销售服务费	-	-	-	139,848.49	139,848.49
应付交易费用	-	-	-	416,890.76	416,890.76
应交税费	-	-	-	24,404.21	24,404.21
其他负债	-	-	-	849,373.03	849,373.03
负债总计	-	-	-	25,480,838.33	25,480,838.33
利率敏感度缺口	235,846,531.40	211,630,000.00	466,533,500.00	107,318,212.82	1,021,328,244.22
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	251,482,501.43	-	-	-	251,482,501.43
结算备付金	96,557,379.95	-	-	-	96,557,379.95
存出保证金	41,388,627.13	-	-	-	41,388,627.13
交易性金融资产	52,994,700.00	-	-	1,414,759,160.29	1,467,753,860.29
买入返售金融资产	200,000,000.00	-	-	-	200,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,126,982.64	1,126,982.64
应收股利	-	-	-	102,955.75	102,955.75
应收申购款	-	-	-	4,478,279.80	4,478,279.80
应收证券清算款	-	-	-	50,114,269.99	50,114,269.99
资产总计	642,423,208.51	-	-	1,470,581,648.47	2,113,004,856.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	89,856,662.39	89,856,662.39
应付管理人报酬	-	-	-	1,854,830.52	1,854,830.52
应付托管费	-	-	-	278,224.57	278,224.57
应付证券清算款	-	-	-	24,793,295.99	24,793,295.99
应付销售服务费	-	-	-	277,000.94	277,000.94
应付交易费用	-	-	-	4,096,513.18	4,096,513.18
应交税费	-	-	-	6,444,104.75	6,444,104.75
其他负债	-	-	-	1,112,006.03	1,112,006.03
负债总计	-	-	-	128,712,638.37	128,712,638.37
利率敏感度缺口	642,423,208.51	-	-	1,341,869,010.10	1,984,292,218.61

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

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的
----	-------------------------------------

	利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	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	市场利率下降 25 个基点	13,834,175.00	3,975.00
	市场利率上升 25 个基点	-13,834,175.00	-3,975.00

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	22,271,105.88	-	22,271,105.88
资产合计	-	22,271,105.88	-	22,271,105.88
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	22,271,105.88	-	22,271,105.88
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			

	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	81,564,633.58	-	81,564,633.58
应收股利	-	102,955.75	-	102,955.75
资产合计	-	81,667,589.33	-	81,667,589.33
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	81,667,589.33	-	81,667,589.33

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变。		
	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	港币相对人民币升值5%	1,113,555.29	4,083,379.47
	港币相对人民币贬值5%	-1,113,555.29	-4,083,379.47

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	125,635,693.59	12.30	1,414,759,160.29	71.30
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	2.67
交易性金融资产—债券投资	—	—	52,994,700.00	—
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	125,635,693.59	12.30	1,467,753,860.29	73.97

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%	6,281,784.68	73,387,693.01
	业绩比较基准下降 5%	-6,281,784.68	-73,387,693.01

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 125635611.59 元，属于第二层次的余额为人民币 678163582.00 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	125,635,693.59	12.00
	其中：股票	125,635,693.59	12.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	678,163,500.00	64.78
	其中：债券	678,163,500.00	64.78
	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	70,000,000.00	6.69
	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	160,363,748.54	15.32
8	其他各项资产	12,646,140.42	1.21
9	合计	1,046,809,082.55	100.00

注：报告期末本基金持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票市值为 82.00 元，占基金资产净值比例为 0.0000%。

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	728,914.80	0.07
B	采矿业	9,696,647.88	0.95
C	制造业	70,612,263.00	6.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,929,416.40	0.19
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,092,456.50	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	643,820.90	0.06
J	金融业	10,612,114.22	1.04
K	房地产业	2,511,798.00	0.25
L	租赁和商务服务业	831,477.01	0.08
M	科学研究和技术服务业	1,518,923.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	2,185,076.00	0.21
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	1,680.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	103,364,587.71	10.12

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
周期性消费品	5,149,992.74	0.50
非周期性消费品	-	-
能源	-	-
金融	111,848.19	0.01
房地产	10,449,146.23	1.02
医疗	-	-
工业	-	-
信息科技	-	-
电信服务	6,560,118.72	0.64

公用事业	-	-
合计	22,271,105.88	2.18

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	167,300	10,790,850.00	1.06
2	600150	中国船舶	527,300	8,705,723.00	0.85
3	00700	腾讯控股	13,500	6,560,118.72	0.64
4	03319	雅生活服务	180,250	5,796,820.53	0.57
5	000039	中集集团	293,900	5,343,102.00	0.52
6	603605	珀莱雅	26,500	5,212,815.00	0.51
7	01995	旭辉永升服务	290,000	4,652,325.70	0.46
8	002460	赣锋锂业	36,200	4,383,458.00	0.43
9	300737	科顺股份	136,900	4,304,136.00	0.42
10	603899	晨光文具	48,300	4,084,248.00	0.40
11	603801	志邦家居	124,429	3,976,750.84	0.39
12	600985	淮北矿业	324,300	3,959,703.00	0.39
13	601225	陕西煤业	318,800	3,777,780.00	0.37
14	002271	东方雨虹	68,100	3,767,292.00	0.37
15	600036	招商银行	63,124	3,420,689.56	0.33
16	000001	平安银行	127,873	2,892,487.26	0.28
17	002557	洽洽食品	66,812	2,879,597.20	0.28
18	00291	华润啤酒	48,000	2,785,803.84	0.27
19	300750	宁德时代	4,926	2,634,424.80	0.26
20	002311	海大集团	31,300	2,554,080.00	0.25
21	001914	招商积余	146,200	2,511,716.00	0.25
22	06969	思摩尔国际	66,000	2,364,188.90	0.23
23	000661	长春高新	5,400	2,089,800.00	0.20
24	603707	健友股份	47,100	1,966,425.00	0.19
25	601158	重庆水务	369,620	1,929,416.40	0.19
26	601899	紫金矿业	194,520	1,884,898.80	0.18
27	000902	新洋丰	108,900	1,702,107.00	0.17
28	601939	建设银行	239,300	1,591,345.00	0.16
29	601658	邮储银行	309,600	1,554,192.00	0.15
30	603259	药明康德	9,700	1,518,923.00	0.15
31	601636	旗滨集团	77,700	1,442,112.00	0.14
32	002034	旺能环境	90,000	1,435,500.00	0.14
33	000568	泸州老窖	4,800	1,132,512.00	0.11
34	601166	兴业银行	52,680	1,082,574.00	0.11
35	300308	中际旭创	27,900	1,074,708.00	0.11

36	300577	开润股份	45,500	975,065.00	0.10
37	300502	新易盛	28,487	890,218.75	0.09
38	603939	益丰药房	15,790	885,661.10	0.09
39	603233	大参林	16,940	865,803.40	0.08
40	002027	分众传媒	88,361	831,477.01	0.08
41	600323	瀚蓝环境	34,400	749,576.00	0.07
42	002299	圣农发展	30,500	728,340.00	0.07
43	300628	亿联网络	7,950	666,210.00	0.07
44	603881	数据港	17,700	640,740.00	0.06
45	300783	三只松鼠	7,200	340,992.00	0.03
46	00939	建设银行	22,000	111,848.19	0.01
47	600547	山东黄金	3,864	74,266.08	0.01
48	300059	东方财富	2,160	70,826.40	0.01
49	300661	圣邦股份	75	18,954.75	0.00
50	300014	亿纬锂能	70	7,275.10	0.00
51	300747	锐科激光	50	5,703.00	0.00
52	300741	华宝股份	73	3,702.56	0.00
53	300144	宋城演艺	100	1,680.00	0.00
54	300226	上海钢联	20	1,191.00	0.00
55	300212	易华录	40	1,076.40	0.00
56	300457	赢合科技	50	993.00	0.00
57	300253	卫宁健康	50	813.50	0.00
58	300498	温氏股份	40	574.80	0.00
59	400080	华业 3	200	82.00	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	56,746,025.21	2.86
2	600519	贵州茅台	56,521,808.98	2.85
3	601233	桐昆股份	52,525,222.77	2.65
4	000568	泸州老窖	46,926,864.95	2.36
5	600176	中国巨石	40,422,818.70	2.04
6	600309	万华化学	40,050,848.58	2.02
7	000858	五粮液	39,923,805.94	2.01
8	601658	邮储银行	39,315,817.00	1.98
9	600346	恒力石化	39,193,201.46	1.98
10	601318	中国平安	38,490,157.00	1.94
11	002271	东方雨虹	37,353,455.91	1.88
12	300750	宁德时代	37,292,503.27	1.88
13	601601	中国太保	35,883,611.00	1.81

14	600036	招商银行	35,056,182.12	1.77
15	300083	创世纪	34,135,231.00	1.72
16	002460	赣锋锂业	33,939,889.25	1.71
17	600372	中航电子	33,677,700.09	1.70
18	600486	扬农化工	33,661,856.84	1.70
19	601899	紫金矿业	33,188,850.80	1.67
20	300015	爱尔眼科	32,890,195.54	1.66

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	600176	中国巨石	110,691,102.12	5.58
2	600346	恒力石化	81,736,350.38	4.12
3	858	五粮液	81,072,187.69	4.09
4	600519	贵州茅台	80,526,986.46	4.06
5	600031	三一重工	75,034,106.94	3.78
6	601318	中国平安	73,243,445.97	3.69
7	600309	万华化学	71,156,416.83	3.59
8	300124	汇川技术	65,744,795.39	3.31
9	600036	招商银行	64,926,244.10	3.27
10	700	腾讯控股	64,216,831.16	3.24
11	601601	中国太保	59,162,778.97	2.98
12	601233	桐昆股份	56,830,308.69	2.86
13	600426	华鲁恒升	54,854,496.32	2.76
14	1	平安银行	54,772,607.85	2.76
15	601899	紫金矿业	54,700,549.17	2.76
16	2027	分众传媒	53,960,499.92	2.72
17	601166	兴业银行	52,010,268.60	2.62
18	3690	美团-W	49,793,627.60	2.51
19	601100	恒立液压	49,160,239.72	2.48
20	2812	恩捷股份	48,799,638.41	2.46
21	2269	药明生物	48,165,561.78	2.43
22	300083	创世纪	48,145,146.50	2.43
23	300750	宁德时代	48,044,192.35	2.42
24	601658	邮储银行	46,531,793.72	2.35
25	568	泸州老窖	46,183,324.23	2.33
26	2415	海康威视	44,678,912.17	2.25
27	603259	药明康德	41,751,953.80	2.1
28	600486	扬农化工	41,672,055.51	2.1
29	601939	建设银行	41,478,328.00	2.09

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	2,342,735,382.99
卖出股票收入（成交）总额	3,645,488,391.09

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

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	264,033,500.00	25.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	202,500,000.00	19.83
	其中：政策性金融债	202,500,000.00	19.83
4	企业债券	30,162,000.00	2.95
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	181,468,000.00	17.77
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	678,163,500.00	66.40

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	210009	21 付息国债 09	2,450,000	243,799,500.00	23.87
2	210205	21 国开 05	2,000,000	202,500,000.00	19.83
3	102100312	21 铁建房产 MTN001	300,000	30,408,000.00	2.98
4	102100117	21 广安控股 MTN001	300,000	30,357,000.00	2.97
5	102100232	21 招商积余 MTN001	300,000	30,264,000.00	2.96

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

代 码	名 称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计 (元)					-
股指期货投资本期收益 (元)					-13,949,363.81
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本集合计划将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本集合计划参与国债期货投资用于管理债券组合的久期、流动性和风险水平，以套期保值为主要目的。本集合计划构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、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，在最大限度保证资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

7.11.2 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
T2109	T2109	124	122,053,200.00	70,318.25	-
公允价值变动总额合计 (元)					70,318.25
国债期货投资本期收益 (元)					1,986,847.77
国债期货投资本期公允价值变动 (元)					70,318.25

7.11.3 本期国债期货投资评价

在长周期国内宏观经济边际走弱与对货币政策稳中趋松的判断下，我们逐步增加债券配置，提升组合平衡性，将组合的久期维持在中性偏高的水平。考虑到现券和期货的相对价值，通过配置国债期货来表达我们的久期观点。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本集合投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行出现在报告编制日
前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本集合对上述主体发行的相关
证券的投资决策程序符合相关法律法规及合同的要求。

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	5,482,782.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	75,504.00
4	应收利息	6,688,571.89
5	应收申购款	399,281.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,646,140.42

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

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 安 心 回 报	5,889	76,009.45	21,383,259.39	4.78	426,235,410.32	95.22

A 类份额						
中金安心回报 C 类份额	3,517	83,084.70	28,712,931.58	9.83	263,192,992.07	90.07
合计	-	-	50,096,190.97	6.77	689,428,402.39	93.23

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金安心回报 A 类份额	3,054,209.49	0.68
	中金安心回报 C 类份额	3,453.32	0.00
	合计	3,057,662.81	0.41

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	中金安心回报 A 类份额	>100
	中金安心回报 C 类份额	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中金安心回报 A 类份额	>100
	中金安心回报 C 类份额	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额
基金合同生效日 (2020 年 4 月 30 日)	177,701,315.63	-

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	913,422,562.16	508,450,774.31
本报告期基金总申购份额	110,650,746.54	99,467,985.30
减：本报告期基金总赎回份额	576,453,638.99	315,709,874.51
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	447,619,669.71	292,208,885.10

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	5,988,223,774.08	100.00%	2,593,263.69	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	30,006,300.00	100.00%	20,025,000,000.00	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	关于新增江苏江南农村商业银行股份有限公司为中金安心回报灵活配置混合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03月12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
3	关于新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划代销机构的公告（C类份额）	中国证监会指定网站	2021年05月06日
4	关于新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划代销机构的公告（A类份额）	中国证监会指定网站	2021年05月10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) 关于准予中金安心回报集合资产管理计划合同变更的回函
- (二) 中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书
- (四) 中金安心回报灵活配置混合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