

中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
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	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	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划	
基金简称	集合-中金汇越定开	
基金主代码	920012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 9 月 17 日	
基金管理人	中国国际金融股份有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	55,756,573.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	集合-中金汇越定开 A	集合-中金汇越定开 C
下属分级基金的交易代码	920012	920926
报告期末下属分级基金的份额总额	38,633,772.45 份	17,122,801.52 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	利用定量投资模型，灵活应用多种策略对冲投资组合的市场风险，谋求投资组合资产的长期增值，以期实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本集合计划根据沪深 300 股指期货当月及下月合约基差情况灵活调整股票资产的配置比例。</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>在力求有效控制投资风险的前提下，通过全市场选股构建预期收益高于市场回报的投资组合，同时利用股指期货等对冲工具对冲投资组合的市场风险，以求获得不依赖市场整体走向的比较稳定的长期资产增值。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本集合计划将保持适当的流动性，方便投资人安排投资，在遵守本集合计划有关投资限制与投资比例的前提下，将适当增加高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
业绩比较基准	<p>本集合计划的业绩比较基准为一年期金融机构人民币存款基准利率。</p> <p>本集合计划为以量化对冲为投资基础，主要市场风险已通过对冲策略剥离，收益特征为追求稳健的绝对收益，与股票市场市场和债券市场的走势相关性低，因此，选取一年期金融机构人民币存款基准利率作为本集合计划的业绩比较基准。</p> <p>在每个封闭期首日至下一个开放期的最后一日，适用的业绩比</p>

	较基准为该封闭期首日（若为首个封闭期，则为集合计划合同生效日）中国人民银行公布并执行的一年期金融机构人民币存款基准利率。
风险收益特征	本集合计划为特殊的灵活配置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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	宋璐芳	罗丹丹
	联系电话	010-65051166	4006800000
	电子邮箱	songlf@cicc.com.cn	luodandan@citicbank.com
客户服务电话		010-65050105	95558
传真		010-65058035	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100004	100010
法定代表人		沈如军	李庆萍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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)	
	集合-中金汇越定开 A	集合-中金汇越定开 C
本期已实现收益	-11,979,884.60	-3,568,319.77

本期利润	-3,318,544.04	-1,245,226.33
加权平均基金份额本期利润	-0.0306	-0.0324
本期加权平均净值利润率	-2.98%	-3.16%
本期基金份额净值增长率	-2.71%	-2.96%
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	264,040.46	-1,435,860.41
期末可供分配基金份额利润	0.0068	-0.0839
期末基金资产净值	38,897,812.91	17,170,101.71
期末基金份额净值	1.0068	1.0028
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	-6.68%	-7.18%

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

集合-中金汇越定开 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	0.05%	0.09%	0.13%	0.00%	-0.08%	0.09%
过去三个月	-2.60%	0.16%	0.38%	0.00%	-2.98%	0.16%
过去六个月	-2.71%	0.24%	0.76%	0.00%	-3.47%	0.24%
自基金合同生效起 至今	-6.68%	0.22%	1.20%	0.00%	-7.88%	0.22%

集合-中金汇越定开 C

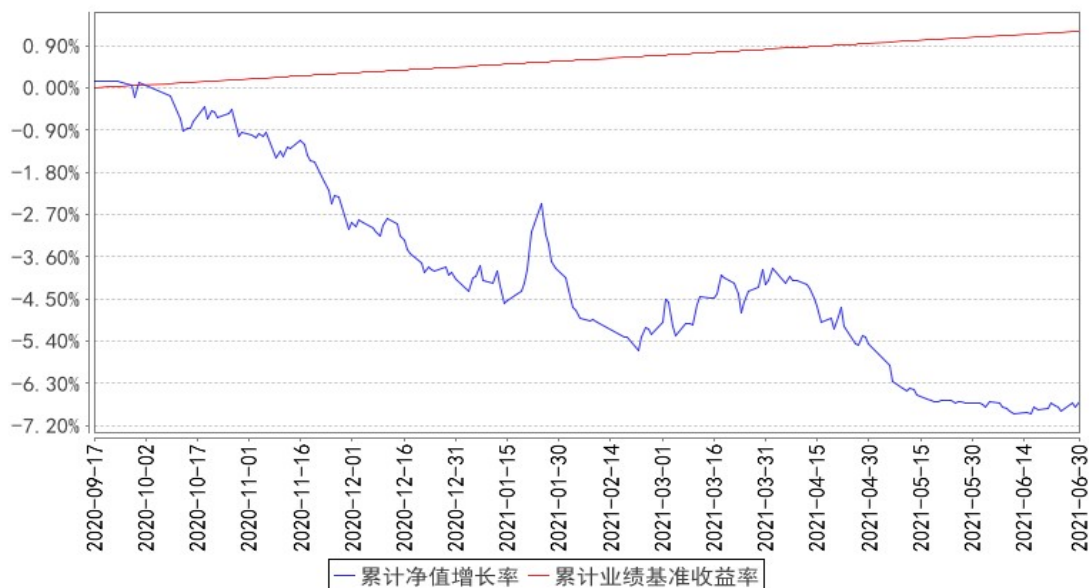
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.01%	0.09%	0.13%	0.00%	-0.12%	0.09%
过去三个月	-2.73%	0.16%	0.38%	0.00%	-3.11%	0.16%
过去六个月	-2.96%	0.24%	0.76%	0.00%	-3.72%	0.24%
自基金合同生效起 至今	-7.18%	0.22%	1.20%	0.00%	-8.38%	0.22%

注：注：1、本基金基金合同于 2020 年 9 月 17 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

集合-中金汇越定开A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



集合-中金汇越定开C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9月17日中金汇越量化对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划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		
方圆	本基金的基金经理	2019 年 11 月 08 日	-	12 年	北京大学数学学院数学与应用数学专业，学士、硕士。任中金公司资产管理部投资经理、副总经理，曾任职于中金公司量化分析组、固定收益部，及海外对冲基金。具有丰富的量化投研经验，投资业绩出色，投资风格稳健均衡。对股票、债券、商品及衍生品的量化投资均有深入研究。

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

本报告期内，本基金采用量化中性策略，利用量化选股模型构造股票组合，并通过做空股指期货的方式对冲市场波动，在控制回撤的前提下，力图获取绝对收益。做空合约选择方面，根据股指期货基差及相应组合超额收益情况灵活调整，从而在对冲成本及超额收益之间取得平衡。

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 1.0068 元，份额累计净值为 1.2438 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0028 元，份额累计净值为 1.0028 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-2.71%，同期业绩基准增长率 0.76%，本基金 C 类基金份额净值增长率为

-2.96%，同期业绩基准增长率 0.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济上，市场融资需求趋弱，外加当前全球疫情持续演变，国外环境更趋复杂严峻，投资上要做好应对未来经济下行压力的准备。

市场方面，预计下半年市场震荡、板块分化依然为主要基调。中期来看，成长因子溢价有望持续，以新能源车、半导体为代表的高景气度高人气赛道持续受到市场关注，上半年表现良好，但由于交易拥挤带来的高估值和高波动率，预计未来将面临较大调整压力，投资上赔率有限。在行业配置上可关注汽车、5G 通信等关注度低或已经经历调整的高景气行业，寻找高低切换带来的投资机会。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《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，对中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划 2021 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监

督，履行了托管人的义务，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，管理人中国国际金融股份有限公司在中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，管理人中国国际金融股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2021 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放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	1,575,778.42	1,077,959.60
结算备付金		9,323,809.74	16,536,463.52
存出保证金		3,494,324.16	18,120,902.78
交易性金融资产	6.4.7.2	23,515,205.93	129,345,019.59
其中：股票投资		23,515,205.93	129,343,019.59
基金投资		-	-
债券投资		-	2,000.00
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	19,000,225.15	98,701,169.61
应收证券清算款		8,447.93	-
应收利息	6.4.7.5	3,549.42	-24,065.44
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		56,921,340.75	263,757,449.66
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		-	37,177.81
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		75,880.86	339,754.33
应付托管费		7,588.08	33,975.45
应付销售服务费		6,585.42	35,480.99
应付交易费用	6.4.7.7	77,090.01	296,991.82
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	686,281.76	766,938.60
负债合计		853,426.13	1,510,319.00
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	55,756,573.97	253,531,586.31
未分配利润	6.4.7.10	311,340.65	8,715,544.35
所有者权益合计		56,067,914.62	262,247,130.66
负债和所有者权益总计		56,921,340.75	263,757,449.66

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 55,756,573.97 份，其中集合-中金汇越定开 A 基金份额总额 38,633,772.45 份，基金份额净值 1.0068 人民币。集合-中金汇越定开 C 基金份额总额 17,122,801.52 份，基金份额净值 1.0028 人民币；

6.2 利润表

会计主体：中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放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 6 月 30 日
一、收入		-1,138,942.92
1. 利息收入		522,008.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	133,073.29
债券利息收入		0.76

资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		388,934.89
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-12,966,163.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,482,960.98
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	916.80
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	-19,763,942.99
股利收益	6.4.7.16	313,901.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,984,434.00
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	320,777.66
减：二、费用		3,424,827.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,146,644.39
2. 托管费	6.4.10.2.2	114,664.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	100,511.46
4. 交易费用	6.4.7.19	1,934,220.67
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		46,069.92
7. 其他费用	6.4.7.20	82,716.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,563,770.37
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,563,770.37

注：本基金合同生效日为 2020 年 9 月 17 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放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）	253,531,586.31	8,715,544.35	262,247,130.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期	-	-4,563,770.37	-4,563,770.37

利润)			
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)	-197,775,012.34	-3,840,433.33	-201,615,445.67
其中：1. 基金申购款	17,736,212.81	221,102.35	17,957,315.16
2. 基金赎回款	-215,511,225.15	-4,061,535.68	-219,572,760.83
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)	55,756,573.97	311,340.65	56,067,914.62

注：本基金合同生效日为 2020 年 9 月 17 日，无上年度可比期间数据。

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：

基金管理人负责人：徐翌成 主管会计工作负责人：赵阳光 会计机构负责人：赵阳光

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划(以下简称“本基金”)由中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划变更而来。中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2010 年 8 月 9 日经中国证监会证监许可[2010]1080 号文核准设立，自 2010 年 11 月 15 日起开始募集，于 2010 年 12 月 24 日结束募集工作，并于 2010 年 12 月 29 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”)、中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)作为推广机构，自 2010 年 11 月 15 日至 2010 年 12 月 24 日进行推广。中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划于 2010 年 12 月 29 日成立，成立之日集合计划实收份额为 300,188,991.28 份(含利息转份额 159,856.20 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。中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划于 2015 年 12 月 7 日发布了《关于中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划法律文件变更的公

告》名称由“中金消费指数集合资产管理计划”变更为“中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划”。

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,中金中铭量化对冲 1 号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 9 月 17 日起,《中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效,原《中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划集合资产管理合同》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(含国债、地方政府债、金融债、公司债、企业债、公开发行次级债、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券以及中国证监会允许投资的其他债券)、股指期货、股票期权、资产支持证券、债券回购、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、现金等,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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资融券业务。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。基金的投资组合比例为:权益类资产占基金资产比例为 0%-85%,权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值,占基金资产净值比例范围 0%-10%。其中:权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值;权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值。开放期内,每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%封闭期内,可不受前述 5%的限制。本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第(一)项、第(三)项、第(五)项及第(七)项的限制。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一年期金融机构人民币存款基准利率。

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	1,575,778.42
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	1,575,778.42

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	22,995,824.31	23,515,205.93	519,381.62
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	22,995,824.31	23,515,205.93	519,381.62

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	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-23,292,540.00	-	-	

其中：股指期货投资	-23,292,540.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-
合计	-23,292,540.00	-	-

注：1：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 0。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，则衍生金融资产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 0。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2107	沪深 300 期货 2107 合约	-15.00	-23,360,400.00	-67,860.00
减：可抵销期货暂收款				-67,860.00
股指期货投资净额				-

注 2：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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	19,000,225.15	-
银行间市场	-	-
合计	19,000,225.15	-

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	474.00
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	2,974.72
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	100.70
合计	3,549.42

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	77,090.01
银行间市场应付交易费用	-
合计	77,090.01

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	79,343.16
代扣代缴个人所得税	606,938.60
合计	686,281.76

注：代扣代缴个人所得税为原中金中铭量化对冲 1 号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

集合-中金汇越定开 A

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	175,233,123.97	175,233,123.97
本期申购	7,658,243.88	7,658,243.88
本期赎回(以“-”号填列)	-144,257,595.40	-144,257,595.40
-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	38,633,772.45	38,633,772.45
-----	---------------	---------------

集合-中金汇越定开 C

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	78,298,462.34	78,298,462.34
本期申购	10,077,968.93	10,077,968.93
本期赎回(以“-”号填列)	-71,253,629.75	-71,253,629.75
-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	17,122,801.52	17,122,801.52

6.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

集合-中金汇越定开 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	105,612,511.33	-99,511,340.45	6,101,170.88
本期利润	-11,979,884.60	8,661,340.56	-3,318,544.04
本期基金份额 交易产生的变 动数	-76,280,807.70	73,762,221.32	-2,518,586.38
其中:基金申 购款	4,536,089.47	-4,342,146.19	193,943.28
基金赎 回款	-80,816,897.17	78,104,367.51	-2,712,529.66
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	17,351,819.03	-17,087,778.57	264,040.46

集合-中金汇越定开 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,636,868.08	-3,022,494.61	2,614,373.47
本期利润	-3,568,319.77	2,323,093.44	-1,245,226.33
本期基金份额 交易产生的变 动数	-3,504,408.72	2,182,561.77	-1,321,846.95
其中:基金申 购款	-609,758.35	636,917.42	27,159.07
基金赎 回款	-2,894,650.37	1,545,644.35	-1,349,006.02
本期已分配利	-	-	-

润			
本期末	-1,435,860.41	1,483,160.60	47,300.19

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		38,429.09
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		92,640.41
其他		2,003.79
合计		133,073.29

注：此处其他列示的是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		1,346,827,590.06
减：卖出股票成本总额		1,340,344,629.08
买卖股票差价收入		6,482,960.98

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。

6.4.7.13 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		2,917.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		2,000.00
减：应收利息总额		0.80
买卖债券差价收入		916.80

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 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	-19,763,942.99

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	313,901.69
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	313,901.69

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	-5,148,121.34
股票投资	-5,148,121.34
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	16,132,555.34
权证投资	-
期货投资	16,132,555.34
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	10,984,434.00

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	243,961.72

基金转换费收入	76,815.94
合计	320,777.66

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	1,917,971.44
银行间市场交易费用	-
其他	16,249.23
合计	1,934,220.67

注：此处其他列示的是期货交易费用。

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	3,373.38
合计	82,716.54

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，本基金无需要披露的或有事项。

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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	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	2,586,427,691.83	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	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
中金公司	2,917.60	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	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
中金公司	4,064,800,000.00	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	387,767.66	100.00	77,090.01	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	1,146,644.39
其中：支付销售机构的客户维护费	417,954.12

注：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约定年费率计提，逐日计提并按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

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	114,664.47

注：注：支付托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，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		
	集合-中金汇越定开A	集合-中金汇越定开C	合计
中金财富	-	86,485.89	86,485.89
中金公司	-	14,004.60	14,004.60
合计	-	100,490.49	100,490.49

注：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**

份额单位：份

项目	本期	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
	集合-中金汇越定开 A	集合-中金汇越定开 C
基金合同生效日（2020年9月17日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,158,227.12	-
报告期内申购/买入总份额	5,614,806.13	-
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	7,773,033.25	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.94%	-

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
中信银行	1,575,778.42	38,429.09

注：本基金的银行存款由托管行中信银行保管，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
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	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	首次非公开发行限售	4.31	13.11	218	939.58	2,857.98	-
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	141	3,481.29	4,471.11	-
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	572	1,927.64	5,971.68	-
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	65	1,870.05	6,490.25	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	--------	-------	--------	--------	----

				价						
002024	苏宁 易购	2021 年 6 月 16 日	重大事 项停牌	5.59	2021 年 7 月 6 日	6.15	5,400	33,419.49	30,186.00	-

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。

本基金的银行存款存放于中信银行，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。

6.4.13.2.1 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	-	-
AAA 以下	-	2,000.00
未评级	-	-
合计	-	2,000.00

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	1,575,778.42	-	-	-	1,575,778.42
结算备付金	9,323,809.74	-	-	-	9,323,809.74
存出保证金	3,494,324.16	-	-	-	3,494,324.16
交易性金融资产	-	-	-	23,515,205.93	23,515,205.93
买入返售金融资产	19,000,225.15	-	-	-	19,000,225.15
应收利息	-	-	-	3,549.42	3,549.42
应收证券清算款	-	-	-	8,447.93	8,447.93
资产总计	33,394,137.47	-	-	23,527,203.28	56,921,340.75
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	75,880.86	75,880.86
应付托管费	-	-	-	7,588.08	7,588.08
应付销售服务费	-	-	-	6,585.42	6,585.42
应付交易费用	-	-	-	77,090.01	77,090.01
其他负债	-	-	-	686,281.76	686,281.76
负债总计	-	-	-	853,426.13	853,426.13
利率敏感度缺口	33,394,137.47	-	-	22,673,777.15	56,067,914.62
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	1,077,959.60	-	-	-	1,077,959.60
结算备付金	16,536,463.52	-	-	-	16,536,463.52
存出保证金	18,120,902.78	-	-	-	18,120,902.78
交易性金融资产	-	-	2,000.00	129,343,019.59	129,345,019.59
买入返售金融资产	98,701,169.61	-	-	-	98,701,169.61
应收利息	-	-	-	-24,065.44	-24,065.44
资产总计	134,436,495.51	-	2,000.00	129,318,954.15	263,757,449.66
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	339,754.33	339,754.33
应付托管费	-	-	-	33,975.45	33,975.45

应付证券清算款	-	-	-	37,177.81	37,177.81
应付销售服务费	-	-	-	35,480.99	35,480.99
应付交易费用	-	-	-	296,991.82	296,991.82
其他负债	-	-	-	766,938.60	766,938.60
负债总计	-	-	-	1,510,319.00	1,510,319.00
利率敏感度缺口	134,436,495.51	-	2,000.00	127,808,635.15	262,247,130.66

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：无。

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

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	23,515,205.93	41.94	129,343,019.59	49.32
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	2,000.00	-
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	23,515,205.93	41.94	129,345,019.59	49.32

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%	1,175,760.30	6,467,250.98
	业绩比较基准下降 5%	-1,175,760.30	-6,467,250.98

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 23,458,539.02 元，属于第二层次的余额为人民币 56,666.91 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	23,515,205.93	41.31
	其中：股票	23,515,205.93	41.31
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	19,000,225.15	33.38
	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	10,899,588.16	19.15
8	其他各项资产	3,506,321.51	6.16
9	合计	56,921,340.75	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	263,486.60	0.47
B	采矿业	516,822.00	0.92
C	制造业	13,152,573.12	23.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	407,090.00	0.73
E	建筑业	302,109.00	0.54
F	批发和零售业	203,646.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	725,778.40	1.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服	653,427.40	1.17

	务业		
J	金融业	5,196,729.13	9.27
K	房地产业	521,996.00	0.93
L	租赁和商务服务业	446,794.00	0.80
M	科学研究和技术服务业	331,970.80	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	2,659.50	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	43,869.00	0.08
Q	卫生和社会工作	623,286.98	1.11
R	文化、体育和娱乐业	122,968.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	23,515,205.93	41.94

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	600519	贵州茅台	500	1,028,350.00	1.83
2	601318	中国平安	12,640	812,499.20	1.45
3	600036	招商银行	14,155	767,059.45	1.37
4	000858	五粮液	2,100	625,569.00	1.12
5	601012	隆基股份	5,120	454,860.80	0.81
6	000333	美的集团	5,911	421,868.07	0.75
7	600276	恒瑞医药	5,418	368,261.46	0.66
8	002415	海康威视	5,400	348,300.00	0.62
9	601166	兴业银行	16,900	347,295.00	0.62
10	603259	药明康德	2,120	331,970.80	0.59
11	601888	中国中免	1,100	330,110.00	0.59
12	300059	东方财富	9,160	300,356.40	0.54
13	000651	格力电器	5,700	296,970.00	0.53
14	002594	比亚迪	1,100	276,100.00	0.49
15	600900	长江电力	13,300	274,512.00	0.49
16	002475	立讯精密	5,800	266,800.00	0.48
17	000568	泸州老窖	1,100	259,534.00	0.46
18	600887	伊利股份	7,000	257,810.00	0.46
19	600030	中信证券	10,100	251,894.00	0.45
20	000001	平安银行	11,100	251,082.00	0.45
21	000725	京东方A	40,000	249,600.00	0.45
22	600436	片仔癀	500	224,150.00	0.40

23	600809	山西汾酒	500	224,000.00	0.40
24	300015	爱尔眼科	3,001	213,010.98	0.38
25	601398	工商银行	40,900	211,453.00	0.38
26	600763	通策医疗	500	205,500.00	0.37
27	603288	海天味业	1,570	202,451.50	0.36
28	600031	三一重工	6,700	194,769.00	0.35
29	000661	长春高新	500	193,500.00	0.35
30	000002	万科A	8,000	190,480.00	0.34
31	002714	牧原股份	3,080	187,325.60	0.33
32	300122	智飞生物	1,000	186,730.00	0.33
33	600309	万华化学	1,600	174,112.00	0.31
34	601919	中远海控	5,500	167,970.00	0.30
35	300014	亿纬锂能	1,600	166,288.00	0.30
36	603501	韦尔股份	500	161,000.00	0.29
37	601899	紫金矿业	15,800	153,102.00	0.27
38	002352	顺丰控股	2,100	142,170.00	0.25
39	002230	科大讯飞	2,100	141,918.00	0.25
40	002371	北方华创	500	138,690.00	0.25
41	600438	通威股份	3,200	138,464.00	0.25
42	600000	浦发银行	13,800	138,000.00	0.25
43	002460	赣锋锂业	1,100	133,199.00	0.24
44	000100	TCL 科技	16,800	128,520.00	0.23
45	603799	华友钴业	1,100	125,620.00	0.22
46	000063	中兴通讯	3,700	122,951.00	0.22
47	601601	中国太保	4,200	121,674.00	0.22
48	601816	XD 京沪高	22,500	119,025.00	0.21
49	002812	恩捷股份	500	117,050.00	0.21
50	002027	分众传媒	12,400	116,684.00	0.21
51	002271	东方雨虹	2,100	116,172.00	0.21
52	600196	复星医药	1,600	115,408.00	0.21
53	002241	歌尔股份	2,700	115,398.00	0.21
54	300274	阳光电源	1,000	115,060.00	0.21
55	601668	中国建筑	24,000	111,600.00	0.20
56	300124	汇川技术	1,500	111,390.00	0.20
57	600016	民生银行	24,800	109,368.00	0.20
58	600703	三安光电	3,400	108,970.00	0.19
59	600585	海螺水泥	2,600	106,730.00	0.19
60	688036	传音控股	500	104,750.00	0.19
61	000338	潍柴动力	5,800	103,646.00	0.18
62	002304	洋河股份	500	103,600.00	0.18
63	600048	保利地产	8,500	102,340.00	0.18
64	601288	农业银行	33,700	102,111.00	0.18

65	002129	中环股份	2,600	100,360.00	0.18
66	600132	重庆啤酒	500	98,975.00	0.18
67	300142	沃森生物	1,600	98,720.00	0.18
68	600919	江苏银行	13,800	97,980.00	0.17
69	300347	泰格医药	500	96,650.00	0.17
70	601229	上海银行	11,600	95,120.00	0.17
71	600050	中国联通	21,800	94,176.00	0.17
72	603986	兆易创新	500	93,950.00	0.17
73	601688	华泰证券	5,800	91,640.00	0.16
74	600104	XD 上汽集	4,100	90,077.00	0.16
75	600660	福耀玻璃	1,600	89,360.00	0.16
76	601211	国泰君安	5,200	89,128.00	0.16
77	601766	中国中车	14,300	86,944.00	0.16
78	601169	北京银行	17,400	84,738.00	0.15
79	688012	中微公司	500	82,960.00	0.15
80	600999	XD 招商证	4,300	81,786.00	0.15
81	600019	宝钢股份	10,700	81,748.00	0.15
82	002311	海大集团	1,000	81,600.00	0.15
83	603882	金域医学	500	79,885.00	0.14
84	002049	紫光国微	500	77,095.00	0.14
85	300498	温氏股份	5,300	76,161.00	0.14
86	601988	中国银行	24,700	76,076.00	0.14
87	300413	芒果超媒	1,100	75,460.00	0.13
88	300601	康泰生物	500	74,500.00	0.13
89	601088	中国神华	3,800	74,176.00	0.13
90	601818	光大银行	19,500	73,710.00	0.13
91	600406	国电南瑞	3,120	72,508.80	0.13
92	601628	中国人寿	2,100	71,169.00	0.13
93	000625	长安汽车	2,700	70,956.00	0.13
94	600588	用友网络	2,100	69,846.00	0.12
95	601633	长城汽车	1,600	69,744.00	0.12
96	600028	中国石化	15,800	68,888.00	0.12
97	600346	恒力石化	2,600	68,224.00	0.12
98	002410	广联达	1,000	68,200.00	0.12
99	603160	汇顶科技	500	64,815.00	0.12
100	601390	中国中铁	12,100	63,404.00	0.11
101	601658	邮储银行	12,600	63,252.00	0.11
102	002841	视源股份	500	62,145.00	0.11
103	601009	南京银行	5,800	61,016.00	0.11
104	601377	兴业证券	6,300	60,858.00	0.11
105	002493	荣盛石化	3,500	60,445.00	0.11
106	600584	长电科技	1,600	60,288.00	0.11

107	300450	先导智能	1,000	60,140.00	0.11
108	601857	中国石油	11,000	58,190.00	0.10
109	000538	云南白药	500	57,860.00	0.10
110	600009	上海机场	1,200	57,756.00	0.10
111	600926	杭州银行	3,900	57,525.00	0.10
112	600111	北方稀土	2,700	55,890.00	0.10
113	002601	龙佰集团	1,600	55,328.00	0.10
114	601225	陕西煤业	4,600	54,510.00	0.10
115	300558	贝达药业	500	54,120.00	0.10
116	600893	航发动力	1,000	53,190.00	0.09
117	603806	福斯特	500	52,565.00	0.09
118	601939	建设银行	7,900	52,535.00	0.09
119	300595	欧普康视	500	51,775.00	0.09
120	300003	乐普医疗	1,600	51,392.00	0.09
121	300408	三环集团	1,200	50,904.00	0.09
122	000895	双汇发展	1,600	50,880.00	0.09
123	002050	三花智控	2,100	50,358.00	0.09
124	601155	新城控股	1,200	49,920.00	0.09
125	600426	华鲁恒升	1,600	49,520.00	0.09
126	600745	闻泰科技	500	48,450.00	0.09
127	600143	金发科技	2,300	47,978.00	0.09
128	300433	蓝思科技	1,600	47,056.00	0.08
129	600958	东方证券	4,700	46,953.00	0.08
130	600015	华夏银行	7,500	46,425.00	0.08
131	000963	华东医药	1,000	46,010.00	0.08
132	601138	工业富联	3,700	45,917.00	0.08
133	688396	华润微	500	45,510.00	0.08
134	601006	大秦铁路	6,900	45,402.00	0.08
135	600352	浙江龙盛	3,300	45,342.00	0.08
136	002008	大族激光	1,100	44,429.00	0.08
137	002236	大华股份	2,100	44,310.00	0.08
138	601901	方正证券	4,700	43,992.00	0.08
139	002607	中公教育	2,100	43,869.00	0.08
140	601989	中国重工	10,600	43,672.00	0.08
141	002001	新和成	1,520	43,593.60	0.08
142	000157	中联重科	4,700	43,428.00	0.08
143	600176	中国巨石	2,800	43,428.00	0.08
144	300529	健帆生物	500	43,180.00	0.08
145	000786	北新建材	1,100	43,175.00	0.08
146	002938	鹏鼎控股	1,200	43,056.00	0.08
147	601100	恒立液压	500	42,960.00	0.08
148	603993	洛阳钼业	8,200	42,312.00	0.08

149	603899	晨光文具	500	42,280.00	0.08
150	603517	绝味食品	500	42,145.00	0.08
151	000768	中航西飞	1,600	42,048.00	0.07
152	300628	亿联网络	500	41,900.00	0.07
153	001979	招商蛇口	3,800	41,610.00	0.07
154	601600	中国铝业	7,800	41,340.00	0.07
155	600010	包钢股份	26,400	40,920.00	0.07
156	600085	同仁堂	1,000	40,850.00	0.07
157	600332	白云山	1,200	40,620.00	0.07
158	600547	山东黄金	2,100	40,362.00	0.07
159	002202	金风科技	3,300	40,128.00	0.07
160	002179	中航光电	500	39,510.00	0.07
161	600741	XD 华域汽	1,500	39,405.00	0.07
162	601186	中国铁建	5,300	39,379.00	0.07
163	002555	三七互娱	1,600	38,432.00	0.07
164	002624	完美世界	1,600	38,256.00	0.07
165	000876	新 希 望	2,600	38,142.00	0.07
166	601066	中信建投	1,200	37,716.00	0.07
167	601916	XD 浙商银	9,500	37,715.00	0.07
168	601788	光大证券	2,100	37,569.00	0.07
169	600183	生益科技	1,600	37,456.00	0.07
170	688008	澜起科技	600	37,428.00	0.07
171	300136	信维通信	1,200	37,056.00	0.07
172	601877	正泰电器	1,100	36,718.00	0.07
173	002007	华兰生物	1,000	36,680.00	0.07
174	000069	华侨城 A	4,800	35,712.00	0.06
175	002736	国信证券	3,300	35,475.00	0.06
176	000783	长江证券	4,800	35,136.00	0.06
177	000938	紫光股份	1,600	35,008.00	0.06
178	601238	广汽集团	2,700	34,965.00	0.06
179	601669	中国电建	9,000	34,830.00	0.06
180	600150	中国船舶	2,100	34,671.00	0.06
181	601108	财通证券	3,300	34,617.00	0.06
182	600161	天坛生物	1,000	34,250.00	0.06
183	600989	宝丰能源	2,500	34,200.00	0.06
184	601838	成都银行	2,700	34,128.00	0.06
185	600079	人福医药	1,200	33,924.00	0.06
186	601607	上海医药	1,600	33,808.00	0.06
187	000977	浪潮信息	1,200	33,756.00	0.06
188	600795	国电电力	13,800	33,534.00	0.06
189	000425	徐工机械	5,200	33,124.00	0.06
190	600029	南方航空	5,500	33,110.00	0.06

191	600109	国金证券	2,600	32,994.00	0.06
192	601360	三六零	2,700	32,967.00	0.06
193	601985	中国核电	6,400	32,384.00	0.06
194	600886	国投电力	3,300	31,713.00	0.06
195	002384	东山精密	1,500	31,260.00	0.06
196	000703	恒逸石化	2,600	31,070.00	0.06
197	601555	东吴证券	3,700	30,858.00	0.06
198	000066	中国长城	2,100	30,660.00	0.05
199	603019	中科曙光	1,100	30,371.00	0.05
200	002600	领益智造	3,300	30,327.00	0.05
201	002024	苏宁易购	5,400	30,186.00	0.05
202	600760	中航沈飞	500	30,150.00	0.05
203	601077	渝农商行	7,500	29,925.00	0.05
204	601111	中国国航	3,800	29,564.00	0.05
205	000728	国元证券	3,700	29,489.00	0.05
206	603338	浙江鼎力	500	29,345.00	0.05
207	002414	高德红外	1,060	29,234.80	0.05
208	300144	宋城演艺	1,700	28,560.00	0.05
209	601021	春秋航空	500	28,450.00	0.05
210	002044	美年健康	3,100	28,241.00	0.05
211	603939	益丰药房	500	28,045.00	0.05
212	600522	中天科技	2,800	28,000.00	0.05
213	601800	中国交建	4,300	27,864.00	0.05
214	002252	上海莱士	3,700	27,713.00	0.05
215	600383	金地集团	2,700	27,648.00	0.05
216	002602	世纪华通	4,300	27,606.00	0.05
217	600115	中国东航	5,400	27,432.00	0.05
218	603369	今世缘	500	27,080.00	0.05
219	600845	宝信软件	530	26,977.00	0.05
220	002463	沪电股份	1,700	26,299.00	0.05
221	002157	正邦科技	2,200	26,290.00	0.05
222	600061	国投资本	3,092	26,251.08	0.05
223	603233	大参林	500	25,555.00	0.05
224	601618	中国中冶	8,400	25,032.00	0.04
225	601727	上海电气	5,900	25,016.00	0.04
226	600705	中航产融	6,400	24,768.00	0.04
227	600606	绿地控股	4,300	23,435.00	0.04
228	002508	老板电器	500	23,250.00	0.04
229	002456	欧菲光	2,600	23,088.00	0.04
230	600521	华海药业	1,100	22,968.00	0.04
231	600011	华能国际	5,400	22,788.00	0.04
232	600362	江西铜业	1,000	22,380.00	0.04

233	601990	南京证券	2,100	22,092.00	0.04
234	600872	中炬高新	524	22,018.48	0.04
235	002120	韵达股份	1,600	21,648.00	0.04
236	000656	金科股份	3,700	21,423.00	0.04
237	002558	巨人网络	1,600	21,280.00	0.04
238	000860	顺鑫农业	500	21,090.00	0.04
239	601878	浙商证券	1,600	20,928.00	0.04
240	000708	中信特钢	1,000	20,840.00	0.04
241	601696	中银证券	1,000	20,590.00	0.04
242	600018	上港集团	4,300	20,511.00	0.04
243	601933	永辉超市	4,300	20,339.00	0.04
244	600655	豫园股份	1,700	19,703.00	0.04
245	002739	万达电影	1,200	18,948.00	0.03
246	601216	君正集团	3,700	18,833.00	0.03
247	601319	中国人保	3,100	18,383.00	0.03
248	688009	中国通号	3,200	18,208.00	0.03
249	002673	西部证券	2,200	18,150.00	0.03
250	600489	中金黄金	2,100	18,102.00	0.03
251	600848	上海临港	1,000	17,900.00	0.03
252	601881	中国银河	1,600	17,248.00	0.03
253	601872	招商轮船	3,620	16,724.40	0.03
254	600233	圆通速递	1,600	16,016.00	0.03
255	601236	红塔证券	1,100	14,916.00	0.03
256	600118	中国卫星	500	14,630.00	0.03
257	688126	沪硅产业	500	14,590.00	0.03
258	002939	长城证券	1,200	13,356.00	0.02
259	002153	石基信息	560	13,165.60	0.02
260	600025	华能水电	2,100	12,159.00	0.02
261	000800	一汽解放	1,100	11,902.00	0.02
262	002773	康弘药业	500	11,565.00	0.02
263	600340	华夏幸福	2,200	11,528.00	0.02
264	600918	中泰证券	1,000	10,820.00	0.02
265	600482	中国动力	500	8,710.00	0.02
266	601231	环旭电子	500	8,405.00	0.01
267	601698	中国卫通	500	8,095.00	0.01
268	601808	中海油服	500	7,180.00	0.01
269	002945	华林证券	500	6,910.00	0.01
270	300953	震裕科技	65	6,490.25	0.01
271	600299	安迪苏	500	5,980.00	0.01
272	300933	中辰股份	572	5,971.68	0.01
273	300932	三友联众	141	4,471.11	0.01
274	300950	德固特	103	4,030.39	0.01

275	300931	通用电梯	218	2,857.98	0.01
276	300929	华骐环保	90	2,659.50	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	300059	东方财富	24,043,150.62	9.17
2	600519	贵州茅台	23,994,224.00	9.15
3	601318	中国平安	20,039,518.00	7.64
4	600276	恒瑞医药	19,300,613.69	7.36
5	601888	中国中免	19,106,761.00	7.29
6	601012	隆基股份	17,444,138.00	6.65
7	000333	美的集团	16,080,398.88	6.13
8	600309	万华化学	14,738,933.59	5.62
9	000002	万科A	14,404,310.00	5.49
10	600585	海螺水泥	14,260,091.60	5.44
11	601166	兴业银行	14,154,788.00	5.40
12	002714	牧原股份	14,143,302.00	5.39
13	000651	格力电器	13,947,786.00	5.32
14	600031	三一重工	13,006,455.36	4.96
15	300124	汇川技术	12,987,171.93	4.95
16	600887	伊利股份	12,814,082.00	4.89
17	603288	海天味业	12,681,210.20	4.84
18	603259	药明康德	12,567,529.37	4.79
19	300496	中科创达	12,082,496.95	4.61
20	600438	通威股份	11,492,277.92	4.38
21	600900	长江电力	11,047,680.15	4.21
22	002129	中环股份	11,005,001.99	4.20
23	300122	智飞生物	10,183,218.00	3.88
24	600036	招商银行	9,982,683.47	3.81
25	603799	华友钴业	9,873,386.00	3.76
26	002594	比亚迪	9,677,532.54	3.69
27	000001	平安银行	9,261,506.00	3.53
28	600436	片仔癀	9,183,395.50	3.50
29	601688	华泰证券	8,943,623.00	3.41
30	600030	中信证券	8,642,549.00	3.30
31	300033	同花顺	8,275,786.23	3.16
32	002475	立讯精密	8,251,921.33	3.15
33	600760	中航沈飞	8,218,503.00	3.13
34	002460	赣锋锂业	8,170,555.34	3.12

35	600196	复星医药	8,148,215.00	3.11
36	000858	五粮液	7,956,647.00	3.03
37	002396	星网锐捷	7,820,715.00	2.98
38	300274	阳光电源	7,760,887.00	2.96
39	603501	韦尔股份	7,692,843.97	2.93
40	601601	中国太保	7,627,138.00	2.91
41	000661	长春高新	7,614,544.17	2.90
42	600201	生物股份	7,600,936.75	2.90
43	002601	龙佰集团	7,576,884.00	2.89
44	300207	欣旺达	7,330,160.00	2.80
45	601615	明阳智能	7,257,088.00	2.77
46	000786	北新建材	7,189,884.00	2.74
47	002557	洽洽食品	7,125,989.92	2.72
48	601877	正泰电器	7,111,106.00	2.71
49	002415	海康威视	7,103,587.00	2.71
50	300136	信维通信	7,096,343.00	2.71
51	601689	拓普集团	7,026,179.93	2.68
52	601155	新城控股	6,952,595.00	2.65
53	603658	安图生物	6,774,370.00	2.58
54	600132	重庆啤酒	6,753,358.00	2.58
55	002230	科大讯飞	6,720,015.00	2.56
56	600584	长电科技	6,571,285.00	2.51
57	600048	保利地产	6,527,892.00	2.49
58	600699	均胜电子	6,492,345.91	2.48
59	002812	恩捷股份	6,164,667.00	2.35
60	600801	华新水泥	6,132,712.00	2.34
61	002236	大华股份	6,129,601.00	2.34
62	000568	泸州老窖	5,990,692.72	2.28
63	600754	锦江酒店	5,902,648.00	2.25
64	600009	上海机场	5,703,779.00	2.17
65	300015	爱尔眼科	5,682,428.00	2.17
66	603986	兆易创新	5,657,736.00	2.16
67	002463	沪电股份	5,597,629.89	2.13
68	600426	华鲁恒升	5,581,243.40	2.13
69	002008	大族激光	5,555,855.15	2.12
70	300433	蓝思科技	5,497,905.00	2.10
71	002202	金风科技	5,487,245.00	2.09
72	000401	冀东水泥	5,320,302.22	2.03
73	300463	迈克生物	5,317,827.00	2.03
74	600104	XD 上汽集	5,278,120.00	2.01
75	601865	福莱特	5,277,084.00	2.01
76	601211	国泰君安	5,275,510.00	2.01

77	000860	顺鑫农业	5,245,079.00	2.00
----	--------	------	--------------	------

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	600519	贵州茅台	29,679,613.44	11.32
2	601318	中国平安	26,453,566.88	10.09
3	300059	东方财富	26,317,851.16	10.04
4	600276	恒瑞医药	22,766,506.40	8.68
5	000333	美的集团	20,290,515.00	7.74
6	601888	中国中免	18,779,566.67	7.16
7	601012	隆基股份	17,948,139.98	6.84
8	601166	兴业银行	16,416,567.55	6.26
9	000651	格力电器	16,355,619.00	6.24
10	000002	万科A	16,349,717.00	6.23
11	600887	伊利股份	15,685,946.42	5.98
12	002714	牧原股份	15,617,897.39	5.96
13	600309	万华化学	15,347,208.34	5.85
14	600585	海螺水泥	14,700,830.00	5.61
15	600036	招商银行	14,368,900.00	5.48
16	300124	汇川技术	14,184,515.80	5.41
17	600031	三一重工	13,588,104.00	5.18
18	603259	药明康德	13,293,110.00	5.07
19	000858	五粮液	13,009,291.20	4.96
20	600438	通威股份	12,728,615.00	4.85
21	603288	海天味业	12,569,544.73	4.79
22	600900	长江电力	12,470,278.36	4.76
23	300496	中科创达	12,091,406.00	4.61
24	002129	中环股份	11,098,853.60	4.23
25	002594	比亚迪	11,038,613.00	4.21
26	000001	平安银行	11,012,318.60	4.20
27	603799	华友钴业	10,432,215.21	3.98
28	300122	智飞生物	10,327,764.00	3.94
29	002475	立讯精密	10,172,076.97	3.88
30	601688	华泰证券	9,749,701.00	3.72
31	600030	中信证券	9,278,309.50	3.54
32	600436	片仔癀	9,236,225.99	3.52
33	000661	长春高新	9,143,260.00	3.49
34	002460	赣锋锂业	8,842,442.55	3.37
35	300033	同花顺	8,548,106.25	3.26

36	600760	中航沈飞	8,351,936.52	3.18
37	601601	中国太保	8,301,458.00	3.17
38	600196	复星医药	8,243,791.75	3.14
39	002230	科大讯飞	8,182,773.00	3.12
40	300274	阳光电源	8,159,731.20	3.11
41	000568	泸州老窖	8,087,221.00	3.08
42	603501	韦尔股份	8,055,946.00	3.07
43	002415	海康威视	7,933,869.48	3.03
44	002396	星网锐捷	7,785,482.41	2.97
45	600201	生物股份	7,667,634.05	2.92
46	300207	欣旺达	7,571,572.00	2.89
47	002601	龙佰集团	7,546,273.00	2.88
48	000786	北新建材	7,342,898.55	2.80
49	601155	新城控股	7,233,694.04	2.76
50	300136	信维通信	7,208,291.11	2.75
51	601615	明阳智能	7,190,972.86	2.74
52	002557	洽洽食品	7,150,088.74	2.73
53	601877	正泰电器	7,088,070.00	2.70
54	600048	保利地产	7,050,595.59	2.69
55	300015	爱尔眼科	6,933,692.00	2.64
56	601689	拓普集团	6,858,269.30	2.62
57	600132	重庆啤酒	6,740,701.00	2.57
58	603658	安图生物	6,557,013.68	2.50
59	600801	华新水泥	6,269,219.00	2.39
60	002236	大华股份	6,253,550.00	2.38
61	600584	长电科技	6,129,403.00	2.34
62	600699	均胜电子	6,097,994.30	2.33
63	002812	恩捷股份	6,042,529.00	2.30
64	600104	XD 上汽集	6,033,385.00	2.30
65	603986	兆易创新	6,018,356.20	2.29
66	002202	金风科技	5,883,167.92	2.24
67	601211	国泰君安	5,829,660.00	2.22
68	600754	锦江酒店	5,789,993.58	2.21
69	002352	顺丰控股	5,787,214.00	2.21
70	002008	大族激光	5,634,243.30	2.15
71	002463	沪电股份	5,536,182.00	2.11
72	600426	华鲁恒升	5,535,582.67	2.11
73	600009	上海机场	5,489,048.00	2.09
74	000401	冀东水泥	5,442,504.00	2.08
75	002371	北方华创	5,386,767.00	2.05
76	300463	迈克生物	5,367,842.00	2.05
77	300433	蓝思科技	5,350,917.00	2.04

78	000860	顺鑫农业	5,316,783.00	2.03
79	601100	恒立液压	5,281,328.08	2.01
80	300014	亿纬锂能	5,279,877.00	2.01

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	1,239,666,599.78
卖出股票收入（成交）总额	1,346,827,590.06

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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
IF2107	IF2107	-15	-23,360,400.00	-67,860.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-67,860.00
股指期货投资本期收益（元）					-19,763,942.99
股指期货投资本期公允价值变动（元）					16,132,555.34

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

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

本集合投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司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	3,494,324.16
2	应收证券清算款	8,447.93
3	应收股利	-
4	应收利息	3,549.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,506,321.51

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本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	持有人户	户均持有的	持有人结构
---	------	-------	-------

额 级 别	数（户）	基金份额	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 （%）
集 合- 中 金 汇 越 定 开 A	409	94,459.10	9,860,318.53	25.52	28,773,453.92	74.48
集 合- 中 金 汇 越 定 开 C	166	103,149.41	9,975,062.34	58.26	7,147,739.18	41.74
合 计	575	-	19,835,380.87	35.57	35,921,193.10	64.43

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	集合-中金汇越定开 A	945,448.03	2.45
	集合-中金汇越定开 C	2,113.60	0.01
	合计	947,561.63	1.70

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 、 基 金 投 资 和 研 究 部 门 负 责 人 持 有 本 开 放 式 基 金	集合-中金汇越定开 A	0
	集合-中金汇越定开 C	0
	合计	0
本 基 金 基 金 经 理 持 有 本 开 放 式 基 金	集合-中金汇越定开 A	50~100
	集合-中金汇越定开 C	0

	合计	50~100
--	----	--------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	集合-中金汇越定开 A	集合-中金汇越定开 C
基金合同生效日 (2020 年 9 月 17 日)	14,296,284.98	-
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	175,233,123.97	78,298,462.34
本报告期基金总申购份额	7,658,243.88	10,077,968.93
减：本报告期基金总赎回份额	144,257,595.40	71,253,629.75
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	38,633,772.45	17,122,801.52

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

本报告期内未召开持有人大会。

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

本报告期内本基金投资策略未变化。

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，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

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	2,586,427,691.83	100.00%	387,767.66	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	2,917.60	100.00%	4,064,800,000.00	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	中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划（赎回、转换、定期定额投资）业务和规模控制安排公告	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 02 月 25 日
2	中国国际金融股份有限公司关于旗下部分按照公募基金规定运作的大集合产品开通转换转入、转出业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 03 月 03 日
3	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
4	中金汇越量化对冲策略 3 个月定	中国证监会指定报刊及	2021 年 05 月 28 日

	期开放灵活配置混合型集合资产管理计划（赎回、转换、定期定额投资）业务安排公告	网站	
--	--	----	--

§ 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） 关于准予中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划合同变更的回函
- （二） 中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同
- （三） 中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书
- （四） 中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放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