

鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券 投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展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、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	54
7.1 期末基金资产组合情况.....	54
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
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.....	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
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.....	71
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.....	71
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.....	71
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.....	71
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
7.12 投资组合报告附注.....	72
§8 基金份额持有人信息.....	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
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的情况.....	73
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	73
§9 开放式基金份额变动.....	75
§10 重大事件揭示.....	76
10.1 基金份额持有人大会决议.....	76
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.....	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
10.4 基金投资策略的改变.....	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
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.....	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
10.8 其他重大事件.....	77
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	80

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	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§12 备查文件目录.....	81
12.1 备查文件目录.....	81
12.2 存放地点.....	81
12.3 查阅方式.....	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	鑫元行业轮动	
基金主代码	005949	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 5 月 31 日	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	230,789,948.66 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C
下属分级基金的交易代码:	005949	005950
报告期末下属分级基金的份额总额	230,461,143.70 份	328,804.96 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于中国大陆 A 股市场和法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，通过行业轮动策略和跨境资产配置，精选经济波动下强势行业中具备核心竞争力的上市公司，同时，在严格控制风险的前提下，力争获取超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采用自上而下为主的分析模式、定性分析和定量分析相结合的研究方式，跟踪宏观经济基本面、政策面和资金等多方面因素，评估中国 A 股、港股、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，并利用上述大类资产之间的相互关联性进行灵活的资产配置，制定本基金的大类资产配置比例，并适时进行调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+恒生指数收益率×30%+中证综合债券指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	鑫元基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕
	联系电话	021-20892000 转
	电子邮箱	service@xyamc.com
客户服务电话	4006066188	95528
传真	021-20892111	021-63602540

注册地址	上海市静安区中山北路909号12层	上海市中山东一路12号
办公地址	上海市静安区中山北路909号12层	上海市北京东路689号
邮政编码	200070	200001
法定代表人	洪伟	郑杨

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	http://www.xyamc.com
基金中期报告备置地点	上海市静安区中山北路909号12层 鑫元基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鑫元基金管理有限公司	上海市静安区中山北路909号12层

§ 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

基金级别	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C
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)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	9,343,066.59	146,447.99
本期利润	5,481,703.67	55,400.82
加权平均基金份额本期利润	0.0326	0.0128
本期加权平均净值利润率	3.00%	1.15%
本期基金份额净值增长率	5.04%	5.17%
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	31,437,520.21	44,743.62
期末可供分配基金份额利润	0.1364	0.1361
期末基金资产净值	261,898,663.91	373,548.58
期末基金份额净值	1.1364	1.1361
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	13.64%	5.17%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

4、鑫元行业轮动 C 类份额实际存续从 2021 年 4 月 30 日开始。

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

鑫元行业轮动 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	1.30%	0.62%	-0.87%	0.43%	2.17%	0.19%
过去三个月	8.76%	0.84%	2.01%	0.50%	6.75%	0.34%
过去六个月	5.04%	1.15%	2.71%	0.68%	2.33%	0.47%
过去一年	11.02%	1.27%	14.18%	0.66%	-3.16%	0.61%
过去三年	16.27%	0.95%	20.29%	0.72%	-4.02%	0.23%

自基金合同生效起至今	13.64%	0.94%	16.93%	0.72%	-3.29%	0.22%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

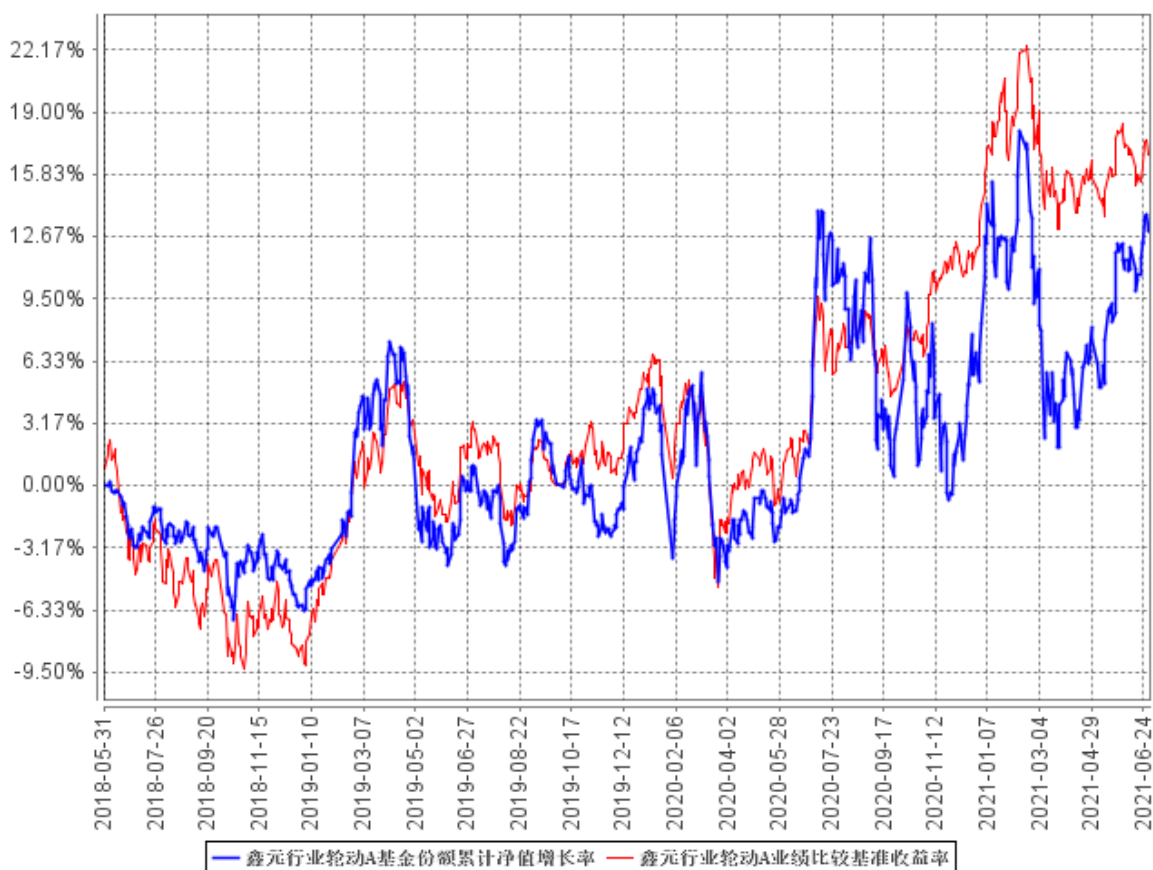
鑫元行业轮动 C

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	1.29%	0.62%	-0.87%	0.43%	2.16%	0.19%
自基金合同生效起至今	5.17%	0.84%	0.18%	0.50%	4.99%	0.34%

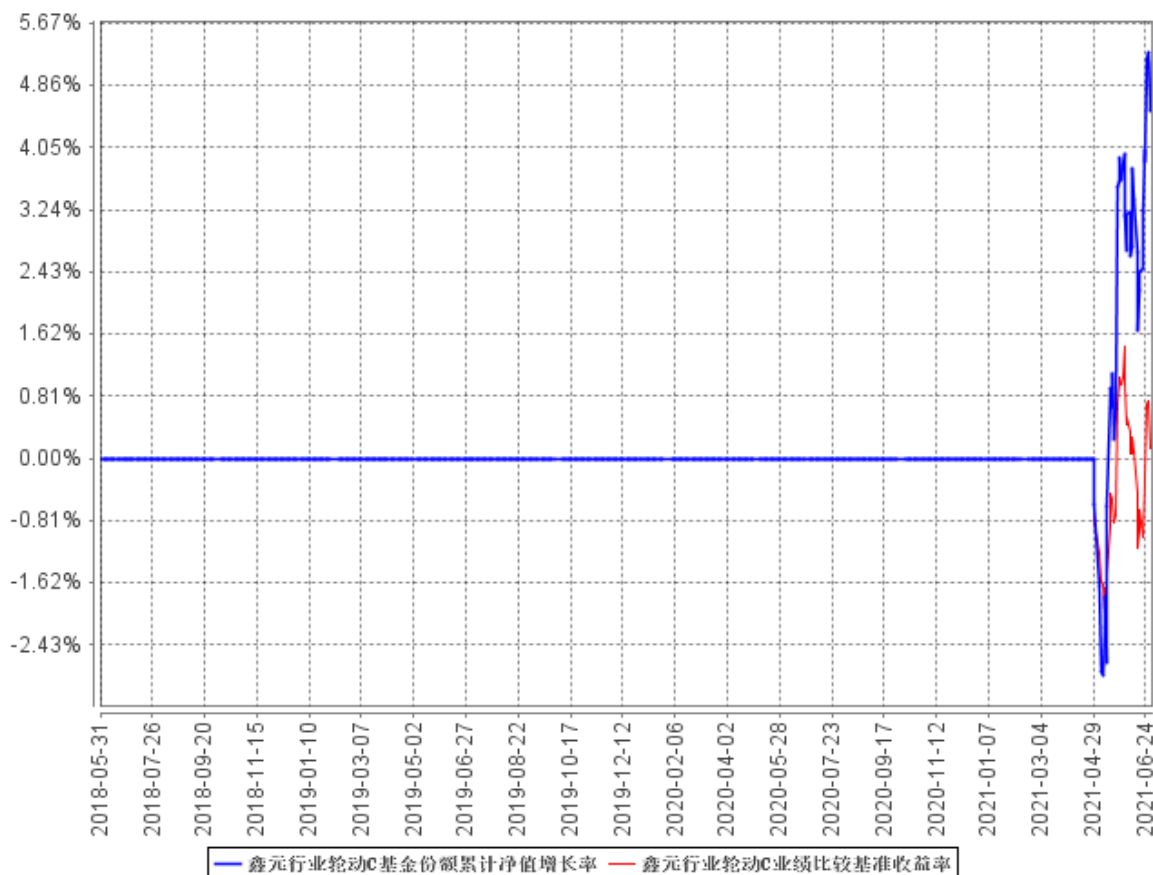
注：鑫元行业轮动 C 类份额实际存续从 2021 年 4 月 30 日开始。

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

鑫元行业轮动A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鑫元行业轮动C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：（1）本基金自2018年5月31日合同生效日起建仓，建仓期为6个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

（2）鑫元行业轮动C类份额实际存续从2021年4月30日开始。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为鑫元基金管理有限公司，本公司经中国证监会证监许可[2013]1115 号文批准于 2013 年 8 月成立，由南京银行股份有限公司发起，与南京高科股份有限公司联合组建；注册资本 17 亿元人民币，总部设在上海。经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理（包括特定对象投资咨询）和中国证监会许可的其他业务。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司旗下管理 46 只证券投资基金——鑫元货币市场基金、鑫元恒鑫收益增强债券型发起式证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元合享纯债债券型证券投资基金、鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元安鑫宝货币市场基金、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金、鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、鑫元聚利债券型证券投资基金、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元招利债券型证券投资基金、鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元添利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金、鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金、鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金、鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元全利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金、鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元臻利债券型证券投资基金、鑫元承利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元悦利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元永利债券型证券投资基金、鑫元恒利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元安睿三年定期开放债券型证券投资基金、鑫元泽利债券型证券投资基金、鑫元富利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、鑫元中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、鑫元锦利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元一年定期开放中高等级债券型证券投资基金、鑫元中短债债券型证券投资基金、鑫元安硕两年定期开放债券型证券投资基金、鑫元安鑫回报混合型证券投资基金、鑫元乾利债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵慧	基金经理。鑫元货币市场基金、鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元淳利定期开	2018年11月13日	-	7年	学历：经济学专业，硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010年7月起任北京汇致资本管理有限公司交易员，2011年4月至2012年2月任南京银行金融市场部资产管理部和金融市场部投资交易中心债券交易员，2014年6月加入鑫元基金，担任基金经理助理，2021年6月担任固定收益部总监助理。2016年1月13日至2019年10月15日担任鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2016年3月2日起担任鑫元货币市场基金的基金经理，2016年3月9日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理，2016年6月3日起担任鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理，2016年7月13日至2019年10月22日担任鑫元裕利债券型证券投资基金的基金经理，2016年8月17日起担任鑫元得利债券型证券投资基金的基金经理，2016年10月27日至2019年10月11日担任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理，2016年12月22日至2019年10月22日担任鑫元招利债券型证券投资基金的基金经理，2017年3月13日至2019年10月15日担任鑫元瑞利定期开放债券

	<p>放债券型发起式证券投资基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金、鑫元悦利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元富利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元中短债债券型证券投资基金、鑫元安</p>			<p>型发起式证券投资基金的基金经理,2017年3月17日至2020年6月1日担任鑫元添利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2017年12月13日起担任鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年3月22日起担任鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年4月19日至2019年10月11日担任鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年5月25日起担任鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年7月11日起担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年11月13日起担任鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金和鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月25日至2020年4月20日担任鑫元臻利债券型证券投资基金的基金经理,2019年3月1日至2020年4月20日担任鑫元承利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年4月30日起担任鑫元悦利定</p>
--	--	--	--	---

	鑫宝货币市场基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元安鑫回报混合型证券投资基金的基金经理；兼任固定收益部总监助理、基金投资决策委员会委员				期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2019年5月9日至2020年6月1日担任鑫元永利债券型证券投资基金的基金经理，2019年7月5日至2020年8月12日担任鑫元恒利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2019年11月13日起担任鑫元富利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2020年5月27日起担任鑫元中短债债券型证券投资基金的基金经理，2020年11月25日起担任鑫元安鑫宝货币市场基金的基金经理，2021年3月25日起担任鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元安鑫回报混合型证券投资基金的基金经理。
陈令朝	基金经理。鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理	2018年6月20日	-	11年	学历：经济学硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2009年7月至2010年9月任中信银行福州分行管理培训生，2010年10月至2013年7月任天相投资顾问有限公司专题量化研究员、宏观策略研究员、策略主管。2013年8月加入鑫元基金，担任宏观策略研究员，2014年9月至2018年1月担任专户投资经理。2018年1月9日至2019年11月25日担任鑫元恒鑫收益增强债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018年1月9日起担任鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年6月20

					日起担任鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理，2019年1月11日至2020年2月18日担任鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1. 基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离职日期为根据公司决议确定的解聘日期；

2. 非首任基金经理，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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定，基金投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

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

报告期内，本公司继续严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部关于公平交易管理的各项制度规范，进一步完善境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易活动。本公司通过系统控制和人工控制等各种方式，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的相关环节均得到公平对待。

报告期内，公司整体公平交易制度执行情况良好，通过对不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易价格和交易时机进行监控分析，未发现违反公平交易要求的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司制订《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》，通过系统和人工相结合的方式对基金投资交易行为的日常监督检查，执行异常交易行为的监控、分析与记录工作机制。报告期内未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年经济继续处于疫情的恢复阶段，因疫情影响暂未消失及全球就业数据恢复较慢，政策继续维持较为宽松的环境，大宗商品价格因供需错配及新能源相关行业需求较为强劲，商品价格持续上涨，CRB 指数大幅上扬，推动 PPI 同比大幅回升，但因消费需求回升较弱，阶段性市场并未担心因大宗商品价格上涨推动通胀压力上行而导致货币政策边际收紧，其中 10 年美债收益率高点下行 40BP，下行幅度超预期。在货币维持宽松、无风险收益率大幅下行及经济持续改善，全球股市继续表现强劲，美国三大股指均不断创历史新高，A 股方面，结构性演绎非常极致，行业景气与国家战略强力推动共振，半导体、新能源表现强势，低估值股普遍表现不佳。

上半年，组合继续维持较高仓位，并采取相对分散的投资策略，成长、价值的配置比重相对均衡，实现净值的上涨。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期鑫元行业轮动 A 基金份额净值增长率为 5.04%，同期业绩比较基准收益率为 2.71%；鑫元行业轮动 C 基金份额净值增长率为 5.17%，同期业绩比较基准收益率为 0.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济层面，下半年国内经济面临持续的下行压力，短期角度，一是下半年面临去年较高的基数以及疫情影响较弱海外工业链恢复，出口高增速不可持续；二是疫情冲击后，居民消费恢复相对缓慢，消费增长持续低于预期；三是中长期角度，新增劳动力人口持续减少和资本边际回报率下降，潜在增速面临持续下行压力。货币政策，取决于疫情管控情况及就业恢复情况，整体来看，相对宽松的预期可以持续。资本市场层面，与过去 10 年相比，已经发生结构性的实质性变化，金融、地产和能源等三大传统产业占市值比重由过去 10 年的 46%降至 23%，对指数影响力大幅下降，同时，信息技术、医疗及消费由过去 10 年的 22%提升至 45%，占比大幅提升，其中信息技术、医疗和消费未来成长性及持续性的能见度较高，能够形成较好的实体与资本的良性互动，因此，虽然指数整体估值较过去 10 年明显上升，但结构得到较大的优化，一定程度上讲，指数的稳定性是上升的。

投资策略方面，当前改革进入深水区，在体制和机制层面也取得实质性进展，虽然短期可能面临因改革阵痛导致资本市场的波动风险，包括打破城投刚兑、反垄断等等，但随着市场化程度不断深化（对外开放、公平竞争、保护知识产权、鼓励创新等），给资本市场营造良好的外部环境，股市系统性风险相对较低。行业层面，在碳中和及创新战略导向下，科技将继续作为配置的主赛

道之一，但随着投资者对科技预期的极度充分，风险回报率与上半年相比将明显回落。消费在经过估值与业绩双重调整下，配置价值开始凸显。大金融，整体估值处于绝对历史低位，防御性价值更加凸显。产品配置上，继续坚持分散且风格相对均衡的投资策略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司成立估值委员会，并制订有关工作规则。成员包括公司总经理、基金运营部分管领导、固定收益部、权益投资部和市场研究部分管领导、督察长、固定收益部负责人、权益投资部负责人、市场研究部负责人、风险管理部负责人、监察稽核部负责人、交易部负责人、基金运营部负责人等，对公司依法受托管理资产的投资品种估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制，确保基金估值的公允、合理，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。本公司的基金估值和会计核算由基金运营部负责实施，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金运营部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司基金经理可参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间债券市场及证券交易所上市流通或挂牌转让的固定收益品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。截止报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

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

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。

§ 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《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、托管协议的规定，对鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由鑫元基金管理有限公司编制本托管人复核的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”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	775,450.61	2,936,284.24
结算备付金		1,703,338.88	53,073.96
存出保证金		96,700.52	24,884.49
交易性金融资产	6.4.7.2	277,339,617.16	18,137,105.00
其中：股票投资		205,430,167.16	16,737,245.00
基金投资		-	-
债券投资		71,909,450.00	1,399,860.00
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	-	-
应收证券清算款		221,158.18	-
应收利息	6.4.7.5	1,349,581.06	31,147.47
应收股利		-	-
应收申购款		13,200.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		281,499,046.41	21,182,495.16
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		18,999,810.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,142.92	-
应付管理人报酬		124,065.72	15,430.36
应付托管费		20,677.62	1,714.48
应付销售服务费		3,152.25	-
应付交易费用	6.4.7.7	59,187.14	32,600.63
应交税费		-	-

应付利息		1,921.88	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	14,876.39	30,000.00
负债合计		19,226,833.92	79,745.47
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	230,789,948.66	19,505,642.34
未分配利润	6.4.7.10	31,482,263.83	1,597,107.35
所有者权益合计		262,272,212.49	21,102,749.69
负债和所有者权益总计		281,499,046.41	21,182,495.16

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 230,789,948.66 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1364 元，份额总额 230,461,143.70 份；下属 C 类基金份额净值 1.1361 元，份额总额 328,804.96 份。

6.2 利润表

会计主体：鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		7,012,259.40	277,304.23
1.利息收入		596,726.50	148,708.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	31,665.40	49,536.82
债券利息收入		551,780.57	652.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,280.53	98,519.08
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,294,850.26	139,321.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,840,162.39	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	8,552.71	-
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	1,446,135.16	139,321.63
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,952,410.09	-10,726.19
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	73,092.73	-
减：二、费用		1,475,154.91	235,204.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	602,801.18	174,947.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	91,124.21	19,438.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,158.90	-
4. 交易费用	6.4.7.19	411,707.68	922.66
5. 利息支出		351,001.87	-
其中：卖出回购金融资产支出		351,001.87	-
6. 税金及附加		0.02	-
7. 其他费用	6.4.7.20	15,361.05	39,896.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,537,104.49	42,099.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,537,104.49	42,099.31

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金

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）	19,505,642.34	1,597,107.35	21,102,749.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,537,104.49	5,537,104.49
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）	211,284,306.32	24,348,051.99	235,632,358.31
其中：1.基金申购款	234,349,400.23	27,126,261.23	261,475,661.46
2.基金赎回款	-23,065,093.91	-2,778,209.24	-25,843,303.15
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）	230,789,948.66	31,482,263.83	262,272,212.49
项目	上年度可比期间 2020年1月1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）	39,007,134.69	880,144.49	39,887,279.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	42,099.31	42,099.31
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	39,007,134.69	922,243.80	39,929,378.49

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：

 龙艺 陈宇 包颖
 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

鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2182号文《关于准予鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由鑫元基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开

募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 38,998,000.00 元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0140 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 5 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 39,007,134.69 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,134.69 份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为鑫元基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和《鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金根据认购费、申购费、赎回费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资者认购、申购时收取认购、申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算和公告基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债、可转换债、可交换债、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款等）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金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：股票资产占基金资产的 0%-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0%-95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；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；权证、股指期货、国债期货及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。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×30%+恒生指数收益率×30%+中证综合债券指数收益率×40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	775,450.61
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：	775,450.61

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	208,593,223.98	205,430,167.16	-3,163,056.82
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	71,909,450.00	52,730.00
	银行间市场	-	-
	合计	71,856,720.00	52,730.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	280,449,943.98	277,339,617.16	-3,110,326.82

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

注：无。

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	150.55
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	689.85
应收债券利息	1,348,701.51
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	39.15
合计	1,349,581.06

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	59,187.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	59,187.14

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	14,876.39
合计	14,876.39

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鑫元行业轮动 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	19,505,642.34	19,505,642.34
本期申购	220,958,641.36	220,958,641.36
本期赎回(以“-”号填列)	-10,003,140.00	-10,003,140.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	230,461,143.70	230,461,143.70

金额单位：人民币元

鑫元行业轮动 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	-	-
本期申购	13,390,758.87	13,390,758.87
本期赎回(以“-”号填列)	-13,061,953.91	-13,061,953.91
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	328,804.96	328,804.96

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）鑫元行业轮动 C 类份额实际存续从 2021 年 4 月 30 日开始。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鑫元行业轮动 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	1,787,882.67	-190,775.32	1,597,107.35
本期利润	9,343,066.59	-3,861,362.92	5,481,703.67
本期基金份额交易产生的变动数	38,204,870.81	-13,846,161.62	24,358,709.19
其中：基金申购款	40,177,248.18	-14,584,151.51	25,593,096.67
基金赎回款	-1,972,377.37	737,989.89	-1,234,387.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,335,820.07	-17,898,299.86	31,437,520.21

单位：人民币元

鑫元行业轮动 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	146,447.99	-91,047.17	55,400.82
本期基金份额交易产生的变动数	-76,159.81	65,502.61	-10,657.20
其中：基金申购款	2,646,722.90	-1,113,558.34	1,533,164.56
基金赎回款	-2,722,882.71	1,179,060.95	-1,543,821.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	70,288.18	-25,544.56	44,743.62

注：鑫元行业轮动 C 类份额实际存续从 2021 年 4 月 30 日开始。

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	16,501.58
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14,483.09
其他	680.73
合计	31,665.40

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,840,162.39

股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	8,840,162.39

6.4.7.12.2 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	88,170,401.31
减：卖出股票成本总额	79,330,238.92
买卖股票差价收入	8,840,162.39

6.4.7.12.3 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 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	8,552.71
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	8,552.71

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	1,577,507.64
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,537,440.00
减：应收利息总额	31,514.93

买卖债券差价收入	8,552.71
----------	----------

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

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	1,446,135.16
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	1,446,135.16

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	-3,952,410.09
——股票投资	-4,006,820.09
——债券投资	54,410.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-3,952,410.09

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	73,092.73
合计	73,092.73

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	411,707.68
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-

合计	411,707.68
----	------------

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	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	484.66
合计	15,361.05

6.4.7.21 分部报告

无。

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重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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

本报告期内不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。

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
鑫元基金管理有限公司（“鑫元基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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****6.4.10.1.1 股票交易**

注：无。

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

注：无。

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	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	602,801.18	174,947.12
其中：支付销售机构的客户维护费	5,808.42	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。2021年1月1日至2021年3月3日，基金管理费按前一日基金资产净值的0.90%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

根据 2021 年 3 月 4 日《鑫元基金管理有限公司关于鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金调整管理费率并修订基金合同的公告》，自 2021 年 3 月 4 日起，支付基金管理人鑫元基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计

算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

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 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	91,124.21	19,438.58

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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		
	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C	合计
鑫元基金	-	1.68	1.68
合计	-	1.68	1.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C	合计
合计	-	-	-

注：基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值的 0.40% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。销售服务费计提的计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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	
	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C
基金合同生效日（2018 年 5 月 31 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,003,150.00	-
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	10,003,140.00	-
报告期末持有的基金份额	10.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C
基金合同生效日（2018 年	-	-

5 月 31 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	10,003,150.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,003,150.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	25.6444%	-

注: (1) 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

(2) 本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

(3) 目前系统仅能保留六位小数。本报告期末基金管理人持有的本基金 A 类份额占基金总份额比例实际为 0.000004%。

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 1 月 1 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
浦发银行	775,450.61	16,501.58	2,493,559.12	40,694.73

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
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
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	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
600905	三峡能源	2021 年 6 月 2 日	2021 年 12 月 10 日	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-

			日							
688131	皓元医药	2021年6月1日	2021年12月8日	新股流通受限	64.99	247.10	1,330	86,436.70	328,643.00	-
688630	芯碁微装	2021年3月25日	2021年10月8日	新股流通受限	15.23	58.42	3,397	51,736.31	198,452.74	-
688625	呈和科技	2021年5月31日	2021年12月7日	新股流通受限	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
688319	欧林生物	2021年5月31日	2021年12月8日	新股流通受限	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
688359	三孚新科	2021年5月14日	2021年11月22日	新股流通受限	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
688616	西力科技	2021年3月10日	2021年9月22日	新股流通受限	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	210	9,939.30	52,911.60	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	352	11,693.44	30,800.00	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	225	6,363.00	26,034.75	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	48.59	90.39	189	9,183.51	17,083.71	-

			日							
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	168	4,833.36	16,774.80	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-

			日							
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-

			日							
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

			日						
--	--	--	---	--	--	--	--	--	--

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	期末估值单价	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
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项	5.59	2021年7月6日	6.15	39,900	272,100.51	223,041.00	-

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 18,999,810.00 元，于 2021 年 7 月 2 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金为混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现基金合同中约定的投资

目标。

本基金的基金管理人实行全员风险管理，风险管理是公司所有部门、全体员工的应尽职责。公司建立董事会、经营管理层、独立风险管理部门、业务部门四级风险管理组织架构，并分别明确风险管理职能与责任。董事会对公司的风险管理负有最终责任，董事会下设风险控制与合规审计委员会，负责研究、确定公司风险管理理念，指导公司风险管理体系的建设；经营管理层负责组织、部署风险管理工作，经营管理层设风险控制委员会，负责确定风险管理理念、原则、目标和方法，促进风险管理环境、文化的形成，组织风险管理体系建设，审议风险管理制度和流程，审议重大风险事件；独立风险管理部门负责协同相关业务部门落实投资风险、操作风险、合规风险、道德风险等各类风险的控制和管理，督促、检查各业务部门、各业务环节的风险管理工作；各业务部门负责根据职能分工贯彻落实风险管理程序，执行风险管理措施。根据风险管理工作要求，各业务部门健全完善规章制度和操作流程，严格遵守风险管理制度、流程和限额，严格执行从风险识别、风险测量、风险控制、风险评价到风险报告的风险管理程序，对本部门发生风险事件承担直接责任，及时、准确、全面、客观地将本部门及本部门发现的风险信息向风险管理部门报告。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金根据存款存放银行的资质，评估并控制银行存款的信用风险。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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	0.00	0.00

A-1 以下	0.00	0.00
未评级	71,909,450.00	1,399,860.00
合计	71,909,450.00	1,399,860.00

注：未评级部分为国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

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	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

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	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金运作周期内的每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 18,999,810.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控本基金的组合资产持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标，对本基金的流动性风险进行持续的监测和分析。同时，本基金的基金管理人在基金运作周期内的每个开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制相关的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于银行存款、交易所及银行间市场交易的固定收益品种等其他计息品种，因此在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

2021年6月30日							
资产							
银行存款	775,450.61	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	775,450.61
结算备付金	1,703,338.88	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,703,338.88
存出保证金	96,700.52	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	96,700.52
交易性金融资产	58,400,000.00	0.00	13,509,450.00	0.00	0.00	205,430,167.16	277,339,617.16
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	221,158.18	221,158.18
应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,349,581.06	1,349,581.06
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	13,200.00	13,200.00
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	60,975,490.01	0.00	13,509,450.00	0.00	0.00	207,014,106.40	281,499,046.41
负债							
卖出回购金融资产款	18,999,810.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	18,999,810.00
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,142.92	3,142.92
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	124,065.72	124,065.72
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	20,677.62	20,677.62
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,152.25	3,152.25
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	59,187.14	59,187.14
应付税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,921.88	1,921.88
应付利润	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	14,876.39	14,876.39
短期借款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
负债总计	18,999,810.00	0.00	0.00	0.00	0.00	227,023.92	19,226,833.92
利率敏感度缺口	41,975,680.01	0.00	13,509,450.00	0.00	0.00	206,787,082.48	262,272,212.49
上年度末	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

2020 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	2,936,284.24	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,936,284.24
结算备付金	53,073.96	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	53,073.96
存出保证金	24,884.49	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	24,884.49
交易性金融资产	1,399,860.00	0.00	0.00	0.00	0.00	16,737,245.00	18,137,105.00
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	31,147.47	31,147.47
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	4,414,102.69	0.00	0.00	0.00	0.00	16,768,392.47	21,182,495.16
负债							
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	15,430.36	15,430.36
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,714.48	1,714.48
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	32,600.63	32,600.63
应付税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	30,000.00	30,000.00
短期借款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	79,745.47	79,745.47
利率敏感度缺口	4,414,102.69	0.00	0.00	0.00	0.00	16,688,647.00	21,102,749.69

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	25,152.31	105.35
2. 市场利率上升 25 个基点	-25,098.99	-105.33	

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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”为主的分析模式、定性分析和定量分析相结合的研究方式，跟踪宏观经济基本面、政策面和资金等多方面因素，评估符合基金合同约定范围的大类资产的估值水平和投资价值，并利用上述大类资产之间的相互关联性进行灵活的资产配置，制定本基金的大类资产配置比例，并适时进行调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产占基金资产的 0%-95%，权证资产占基金资产净值的比例为 0%-3%，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

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	205,430,167.16	78.33	16,737,245.00	79.31
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	205,430,167.16	78.33	16,737,245.00	79.31

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	沪深300指数上涨1%	1,877,171.52	195,084.98
	沪深300指数下跌1%	-1,877,171.52	-195,084.98

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

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198,497,104.13元，属于第二层次的余额为人民币78,842,513.03元，无划分为第三层次的余额。（于2020年12月31日，属于第一层次的余额为人民币16,737,245.00元，属于第二层次的余额为人民币1,399,860.00元，无划分为第三层次的余额。）

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非

公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	205,430,167.16	72.98
	其中：股票	205,430,167.16	72.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	71,909,450.00	25.55
	其中：债券	71,909,450.00	25.55
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,478,789.49	0.88
8	其他各项资产	1,680,639.76	0.60
9	合计	281,499,046.41	100.00

7.2 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	2,429,299.28	0.93
B	采矿业	4,419,899.00	1.69
C	制造业	110,696,980.15	42.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,320,078.60	3.17
E	建筑业	2,575,970.37	0.98
F	批发和零售业	1,863,206.54	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	4,969,788.80	1.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,178,084.64	2.36
J	金融业	47,405,605.26	18.07
K	房地产业	4,326,655.00	1.65
L	租赁和商务服务业	4,077,198.00	1.55
M	科学研究和技术服务业	3,928,042.00	1.50

N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	133,696.00	0.05
Q	卫生和社会工作	3,145,851.92	1.20
R	文化、体育和娱乐业	929,665.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	205,430,167.16	78.33

注：相关行业分类已根据最新证监会行业分类调整。

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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	5,100	10,489,170.00	4.00
2	601318	中国平安	108,700	6,987,236.00	2.66
3	600036	招商银行	123,400	6,687,046.00	2.55
4	000858	五粮液	19,900	5,928,011.00	2.26
5	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	1.96
6	000333	美的集团	52,100	3,718,377.00	1.42
7	601888	中国中免	10,300	3,091,030.00	1.18
8	601166	兴业银行	149,200	3,066,060.00	1.17
9	600276	恒瑞医药	43,800	2,977,086.00	1.14
10	601012	隆基股份	33,460	2,972,586.40	1.13
11	300059	东方财富	80,900	2,652,711.00	1.01
12	000651	格力电器	48,600	2,532,060.00	0.97
13	002415	海康威视	37,500	2,418,750.00	0.92
14	603259	药明康德	15,100	2,364,509.00	0.90
15	600887	伊利股份	62,700	2,309,241.00	0.88
16	000001	平安银行	97,200	2,198,664.00	0.84
17	600030	中信证券	86,200	2,149,828.00	0.82
18	002475	立讯精密	41,200	1,895,200.00	0.72
19	600031	三一重工	64,900	1,886,643.00	0.72
20	002594	比亚迪	7,400	1,857,400.00	0.71
21	000568	泸州老窖	7,700	1,816,738.00	0.69
22	600900	长江电力	85,800	1,770,912.00	0.68
23	601398	工商银行	342,400	1,770,208.00	0.67

24	000725	京东方 A	275,600	1,719,744.00	0.66
25	000002	万科 A	70,100	1,669,081.00	0.64
26	603288	海天味业	12,800	1,650,560.00	0.63
27	600309	万华化学	15,100	1,643,182.00	0.63
28	002714	牧原股份	26,300	1,599,566.00	0.61
29	300015	爱尔眼科	21,004	1,490,863.92	0.57
30	600809	山西汾酒	3,300	1,478,400.00	0.56
31	603501	韦尔股份	4,400	1,416,800.00	0.54
32	601899	紫金矿业	140,000	1,356,600.00	0.52
33	002304	洋河股份	6,500	1,346,800.00	0.51
34	601328	交通银行	268,400	1,315,160.00	0.50
35	600436	片仔癀	2,800	1,255,240.00	0.48
36	601919	中远海控	40,900	1,249,086.00	0.48
37	600438	通威股份	28,800	1,246,176.00	0.48
38	002230	科大讯飞	18,200	1,229,956.00	0.47
39	002142	宁波银行	31,000	1,208,070.00	0.46
40	300124	汇川技术	16,150	1,199,299.00	0.46
41	300122	智飞生物	6,400	1,195,072.00	0.46
42	002352	顺丰控股	17,600	1,191,520.00	0.45
43	300014	亿纬锂能	10,900	1,132,837.00	0.43
44	000661	长春高新	2,900	1,122,300.00	0.43
45	000100	TCL 科技	146,500	1,120,725.00	0.43
46	002241	歌尔股份	25,000	1,068,500.00	0.41
47	600690	海尔智家	39,900	1,033,809.00	0.39
48	300142	沃森生物	16,500	1,018,050.00	0.39
49	002271	东方雨虹	18,400	1,017,888.00	0.39
50	601601	中国太保	34,300	993,671.00	0.38
51	002027	分众传媒	104,800	986,168.00	0.38
52	300347	泰格医药	5,100	985,830.00	0.38
53	002460	赣锋锂业	8,100	980,829.00	0.37
54	600585	海螺水泥	23,800	976,990.00	0.37
55	601688	华泰证券	60,600	957,480.00	0.37
56	601668	中国建筑	205,000	953,250.00	0.36
57	600016	民生银行	209,200	922,572.00	0.35
58	002812	恩捷股份	3,900	912,990.00	0.35
59	600763	通策医疗	2,200	904,200.00	0.34
60	000338	潍柴动力	49,100	877,417.00	0.33
61	600048	保利地产	71,800	864,472.00	0.33
62	600196	复星医药	11,900	858,347.00	0.33

63	603799	华友钴业	7,500	856,500.00	0.33
64	600837	海通证券	74,300	854,450.00	0.33
65	000063	中兴通讯	25,700	854,011.00	0.33
66	600919	江苏银行	118,900	844,190.00	0.32
67	601288	农业银行	275,300	834,159.00	0.32
68	603986	兆易创新	4,400	826,760.00	0.32
69	601229	上海银行	99,600	816,720.00	0.31
70	600570	恒生电子	8,500	792,625.00	0.30
71	601211	国泰君安	46,100	790,154.00	0.30
72	600104	上汽集团	35,000	768,950.00	0.29
73	600999	招商证券	37,900	720,858.00	0.27
74	600703	三安光电	22,300	714,715.00	0.27
75	601766	中国中车	117,300	713,184.00	0.27
76	300274	阳光电源	6,100	701,866.00	0.27
77	601169	北京银行	143,100	696,897.00	0.27
78	601988	中国银行	223,700	688,996.00	0.26
79	600660	福耀玻璃	12,100	675,785.00	0.26
80	002129	中环股份	17,400	671,640.00	0.26
81	600019	宝钢股份	86,400	660,096.00	0.25
82	000538	云南白药	5,700	659,604.00	0.25
83	002311	海大集团	8,000	652,800.00	0.25
84	600406	国电南瑞	28,080	652,579.20	0.25
85	002049	紫光国微	4,200	647,598.00	0.25
86	002410	广联达	9,300	634,260.00	0.24
87	300498	温氏股份	43,400	623,658.00	0.24
88	600346	恒力石化	23,700	621,888.00	0.24
89	601088	中国神华	31,500	614,880.00	0.23
90	002371	北方华创	2,200	610,236.00	0.23
91	600132	重庆啤酒	3,000	593,850.00	0.23
92	601628	中国人寿	17,300	586,297.00	0.22
93	601818	光大银行	155,100	586,278.00	0.22
94	000625	长安汽车	22,300	586,044.00	0.22
95	600893	航发动力	10,700	569,133.00	0.22
96	600028	中国石化	125,600	547,616.00	0.21
97	002493	荣盛石化	31,700	547,459.00	0.21
98	601377	兴业证券	56,400	544,824.00	0.21
99	300601	康泰生物	3,600	536,400.00	0.20
100	601390	中国中铁	101,100	529,764.00	0.20
101	600588	用友网络	15,900	528,834.00	0.20

102	002821	凯莱英	1,400	521,640.00	0.20
103	300413	芒果超媒	7,300	500,780.00	0.19
104	603882	金域医学	3,000	479,310.00	0.18
105	688111	金山办公	1,200	473,760.00	0.18
106	600111	北方稀土	22,500	465,750.00	0.18
107	300433	蓝思科技	15,700	461,737.00	0.18
108	300408	三环集团	10,800	458,136.00	0.17
109	601857	中国石油	86,300	456,527.00	0.17
110	600926	杭州银行	30,800	454,300.00	0.17
111	000776	广发证券	30,000	454,200.00	0.17
112	002001	新和成	15,800	453,144.00	0.17
113	601225	陕西煤业	38,200	452,670.00	0.17
114	600009	上海机场	9,300	447,609.00	0.17
115	600745	闻泰科技	4,600	445,740.00	0.17
116	601939	建设银行	66,700	443,555.00	0.17
117	601633	长城汽车	10,100	440,259.00	0.17
118	600958	东方证券	44,000	439,560.00	0.17
119	002601	龙佰集团	12,700	439,166.00	0.17
120	000157	中联重科	46,900	433,356.00	0.17
121	002007	华兰生物	11,600	425,488.00	0.16
122	002050	三花智控	17,700	424,446.00	0.16
123	000166	申万宏源	89,900	420,732.00	0.16
124	002179	中航光电	5,300	418,806.00	0.16
125	300003	乐普医疗	13,000	417,560.00	0.16
126	000963	华东医药	9,000	414,090.00	0.16
127	600584	长电科技	10,900	410,712.00	0.16
128	002841	视源股份	3,300	410,157.00	0.16
129	603659	璞泰来	3,000	409,800.00	0.16
130	601006	大秦铁路	61,500	404,670.00	0.15
131	601155	新城控股	9,600	399,360.00	0.15
132	000786	北新建材	10,100	396,425.00	0.15
133	601336	新华保险	8,600	394,826.00	0.15
134	002236	大华股份	18,700	394,570.00	0.15
135	601901	方正证券	42,100	394,056.00	0.15
136	600176	中国巨石	25,000	387,750.00	0.15
137	600741	华域汽车	14,700	386,169.00	0.15
138	600600	青岛啤酒	3,300	381,645.00	0.15
139	688169	石头科技	300	378,300.00	0.14
140	600015	华夏银行	60,900	376,971.00	0.14

141	603993	洛阳钼业	73,000	376,680.00	0.14
142	000768	中航西飞	14,300	375,804.00	0.14
143	600050	中国联通	86,900	375,408.00	0.14
144	601989	中国重工	90,800	374,096.00	0.14
145	300450	先导智能	6,100	366,854.00	0.14
146	601877	正泰电器	10,900	363,842.00	0.14
147	600547	山东黄金	18,900	363,258.00	0.14
148	603369	今世缘	6,700	362,872.00	0.14
149	000876	新希望	24,600	360,882.00	0.14
150	600352	浙江龙盛	26,200	359,988.00	0.14
151	001979	招商蛇口	32,000	350,400.00	0.13
152	688012	中微公司	2,100	348,432.00	0.13
153	600010	包钢股份	224,500	347,975.00	0.13
154	600760	中航沈飞	5,740	346,122.00	0.13
155	601100	恒立液压	4,000	343,680.00	0.13
156	601186	中国铁建	45,600	338,808.00	0.13
157	000895	双汇发展	10,600	337,080.00	0.13
158	300529	健帆生物	3,900	336,804.00	0.13
159	601600	中国铝业	63,100	334,430.00	0.13
160	002202	金风科技	27,400	333,184.00	0.13
161	002008	大族激光	8,200	331,198.00	0.13
162	601788	光大证券	18,500	330,965.00	0.13
163	688131	皓元医药	1,330	328,643.00	0.13
164	300558	贝达药业	3,000	324,720.00	0.12
165	603899	晨光文具	3,800	321,328.00	0.12
166	601066	中信建投	10,100	317,443.00	0.12
167	603806	福斯特	3,000	315,390.00	0.12
168	000425	徐工机械	49,500	315,315.00	0.12
169	688036	传音控股	1,500	314,250.00	0.12
170	600109	国金证券	24,700	313,443.00	0.12
171	603160	汇顶科技	2,400	311,112.00	0.12
172	003816	中国广核	116,400	310,788.00	0.12
173	300595	欧普康视	3,000	310,650.00	0.12
174	002736	国信证券	28,800	309,600.00	0.12
175	000069	华侨城 A	41,600	309,504.00	0.12
176	000938	紫光股份	14,100	308,508.00	0.12
177	601669	中国电建	75,500	292,185.00	0.11
178	000783	长江证券	39,400	288,408.00	0.11
179	000596	古井贡酒	1,200	287,400.00	0.11

180	688008	澜起科技	4,600	286,948.00	0.11
181	600426	华鲁恒升	9,100	281,645.00	0.11
182	002555	三七互娱	11,700	281,034.00	0.11
183	002600	领益智造	30,400	279,376.00	0.11
184	300144	宋城演艺	16,600	278,880.00	0.11
185	688363	华熙生物	1,000	277,860.00	0.11
186	000977	浪潮信息	9,800	275,674.00	0.11
187	600795	国电电力	113,100	274,833.00	0.10
188	688396	华润微	3,000	273,060.00	0.10
189	002414	高德红外	9,900	273,042.00	0.10
190	600183	生益科技	11,600	271,556.00	0.10
191	002044	美年健康	29,800	271,478.00	0.10
192	603019	中科曙光	9,800	270,578.00	0.10
193	601838	成都银行	21,400	270,496.00	0.10
194	002624	完美世界	11,300	270,183.00	0.10
195	601108	财通证券	25,600	268,544.00	0.10
196	600029	南方航空	44,000	264,880.00	0.10
197	601555	东吴证券	31,700	264,378.00	0.10
198	601985	中国核电	52,000	263,120.00	0.10
199	002938	鹏鼎控股	7,300	261,924.00	0.10
200	600085	同仁堂	6,400	261,440.00	0.10
201	600886	国投电力	27,200	261,392.00	0.10
202	300033	同花顺	2,300	259,394.00	0.10
203	000066	中国长城	17,700	258,420.00	0.10
204	600872	中炬高新	6,100	256,322.00	0.10
205	603833	欧派家居	1,800	255,528.00	0.10
206	600522	中天科技	25,500	255,000.00	0.10
207	603517	绝味食品	3,000	252,870.00	0.10
208	002384	东山精密	12,100	252,164.00	0.10
209	601607	上海医药	11,900	251,447.00	0.10
210	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.10
211	601360	三六零	20,500	250,305.00	0.10
212	300136	信维通信	8,100	250,128.00	0.10
213	300677	英科医疗	2,000	249,600.00	0.10
214	300676	华大基因	2,100	249,060.00	0.09
215	600362	江西铜业	10,900	243,942.00	0.09
216	600161	天坛生物	7,100	243,175.00	0.09
217	601138	工业富联	19,300	239,513.00	0.09
218	000860	顺鑫农业	5,600	236,208.00	0.09

219	601111	中国国航	29,600	230,288.00	0.09
220	600383	金地集团	22,400	229,376.00	0.09
221	600115	中国东航	45,100	229,108.00	0.09
222	601800	中国交建	35,000	226,800.00	0.09
223	601799	星宇股份	1,000	225,720.00	0.09
224	002508	老板电器	4,800	223,200.00	0.09
225	002024	苏宁易购	39,900	223,041.00	0.09
226	000703	恒逸石化	18,400	219,880.00	0.08
227	601021	春秋航空	3,800	216,220.00	0.08
228	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.08
229	002602	世纪华通	33,600	215,712.00	0.08
230	600061	国投资本	25,384	215,510.16	0.08
231	601618	中国中冶	70,400	209,792.00	0.08
232	300628	亿联网络	2,500	209,500.00	0.08
233	688161	威高骨科	1,967	208,600.35	0.08
234	000728	国元证券	26,000	207,220.00	0.08
235	000708	中信特钢	9,900	206,316.00	0.08
236	600655	豫园股份	17,800	206,302.00	0.08
237	600705	中航产融	52,400	202,788.00	0.08
238	002456	欧菲光	22,600	200,688.00	0.08
239	601878	浙商证券	15,300	200,124.00	0.08
240	002916	深南电路	1,800	200,034.00	0.08
241	600332	白云山	5,900	199,715.00	0.08
242	002252	上海莱士	26,500	198,485.00	0.08
243	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.08
244	000656	金科股份	33,700	195,123.00	0.07
245	002157	正邦科技	16,300	194,785.00	0.07
246	601933	永辉超市	40,000	189,200.00	0.07
247	601658	邮储银行	37,300	187,246.00	0.07
248	002463	沪电股份	12,000	185,640.00	0.07
249	600606	绿地控股	33,900	184,755.00	0.07
250	600011	华能国际	43,200	182,304.00	0.07
251	601816	京沪高铁	33,400	176,686.00	0.07
252	603338	浙江鼎力	3,000	176,070.00	0.07
253	600118	中国卫星	6,000	175,560.00	0.07
254	600489	中金黄金	20,200	174,124.00	0.07
255	601216	君正集团	34,100	173,569.00	0.07
256	600079	人福医药	6,100	172,447.00	0.07
257	601162	天风证券	35,300	171,558.00	0.07

258	603939	益丰药房	3,000	168,270.00	0.06
259	600845	宝信软件	3,300	167,970.00	0.06
260	600018	上港集团	34,100	162,657.00	0.06
261	002120	韵达股份	11,600	156,948.00	0.06
262	603392	万泰生物	600	155,508.00	0.06
263	601727	上海电气	36,600	155,184.00	0.06
264	603233	大参林	3,000	153,330.00	0.06
265	601998	中信银行	30,000	153,000.00	0.06
266	002673	西部证券	18,400	151,800.00	0.06
267	603658	安图生物	2,000	151,540.00	0.06
268	601990	南京证券	14,400	151,488.00	0.06
269	002739	万达电影	9,500	150,005.00	0.06
270	688009	中国通号	25,800	146,802.00	0.06
271	601881	中国银河	13,300	143,374.00	0.05
272	002607	中公教育	6,400	133,696.00	0.05
273	601916	浙商银行	32,900	130,613.00	0.05
274	600233	圆通速递	12,800	128,128.00	0.05
275	600521	华海药业	6,100	127,368.00	0.05
276	601319	中国人保	21,300	126,309.00	0.05
277	600848	上海临港	6,960	124,584.00	0.05
278	603195	公牛集团	600	121,200.00	0.05
279	601231	环旭电子	7,000	117,670.00	0.04
280	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.04
281	601238	广汽集团	8,900	115,255.00	0.04
282	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.04
283	601872	招商轮船	24,240	111,988.80	0.04
284	600482	中国动力	6,300	109,746.00	0.04
285	600150	中国船舶	6,600	108,966.00	0.04
286	002032	苏泊尔	1,700	108,443.00	0.04
287	002153	石基信息	4,480	105,324.80	0.04
288	002939	长城证券	9,400	104,622.00	0.04
289	600989	宝丰能源	7,500	102,600.00	0.04
290	601236	红塔证券	7,500	101,700.00	0.04
291	002558	巨人网络	7,400	98,420.00	0.04
292	600025	华能水电	16,700	96,693.00	0.04
293	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.04
294	002773	康弘药业	3,900	90,207.00	0.03
295	600918	中泰证券	8,100	87,642.00	0.03
296	688126	沪硅产业	3,000	87,540.00	0.03

297	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.03
298	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.03
299	601808	中海油服	5,400	77,544.00	0.03
300	601698	中国卫通	4,400	71,236.00	0.03
301	601077	渝农商行	17,100	68,229.00	0.03
302	603087	甘李药业	600	63,948.00	0.02
303	601696	中银证券	2,900	59,711.00	0.02
304	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.02
305	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.02
306	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
307	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
308	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.02
309	300957	贝泰妮	210	52,911.60	0.02
310	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
311	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
312	002945	华林证券	2,500	34,550.00	0.01
313	600299	安迪苏	2,800	33,488.00	0.01
314	300979	华利集团	352	30,800.00	0.01
315	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
316	300973	立高食品	225	26,034.75	0.01
317	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
318	300981	中红医疗	189	17,083.71	0.01
319	300953	震裕科技	168	16,774.80	0.01
320	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
321	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.01
322	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
323	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
324	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
325	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
326	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
327	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
328	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
329	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
330	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
331	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
332	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
333	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
334	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
335	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00

336	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
337	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
338	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
339	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
340	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
341	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
342	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
343	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
344	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
345	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
346	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
347	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
348	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
349	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
350	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
351	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
352	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
353	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
354	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	600519	贵州茅台	12,451,159.00	59.00
2	601318	中国平安	9,515,405.98	45.09
3	600036	招商银行	6,949,946.97	32.93
4	000858	五粮液	6,384,314.00	30.25
5	601398	工商银行	5,475,994.00	25.95
6	000333	美的集团	5,128,653.00	24.30
7	600276	恒瑞医药	4,086,273.00	19.36
8	601166	兴业银行	3,763,308.00	17.83
9	600905	三峡能源	3,436,527.95	16.28
10	601888	中国中免	3,383,992.00	16.04
11	601939	建设银行	3,366,864.00	15.95
12	002415	海康威视	3,056,942.00	14.49

13	601012	隆基股份	3,018,745.00	14.30
14	000651	格力电器	3,005,064.00	14.24
15	601288	农业银行	2,998,400.00	14.21
16	600887	伊利股份	2,946,593.00	13.96
17	002594	比亚迪	2,881,304.12	13.65
18	600031	三一重工	2,730,396.00	12.94
19	601628	中国人寿	2,684,288.00	12.72
20	600030	中信证券	2,521,082.00	11.95
21	603288	海天味业	2,500,715.00	11.85
22	300059	东方财富	2,498,420.00	11.84
23	601988	中国银行	2,423,722.00	11.49
24	000001	平安银行	2,417,591.00	11.46
25	002475	立讯精密	2,319,356.99	10.99
26	002352	顺丰控股	2,274,334.00	10.78
27	603259	药明康德	2,196,959.00	10.41
28	000002	万科 A	2,129,809.00	10.09
29	000568	泸州老窖	2,128,620.00	10.09
30	600438	通威股份	2,125,291.00	10.07
31	601857	中国石油	2,118,707.00	10.04
32	600309	万华化学	2,014,494.00	9.55
33	000725	京东方 A	1,897,094.00	8.99
34	002714	牧原股份	1,862,154.00	8.82
35	600900	长江电力	1,833,736.00	8.69
36	600028	中国石化	1,776,218.00	8.42
37	601899	紫金矿业	1,708,501.00	8.10
38	002241	歌尔股份	1,667,643.69	7.90
39	002304	洋河股份	1,569,511.00	7.44
40	300015	爱尔眼科	1,544,330.00	7.32
41	600660	福耀玻璃	1,538,458.00	7.29
42	000661	长春高新	1,464,298.00	6.94
43	600009	上海机场	1,452,523.00	6.88
44	600809	山西汾酒	1,401,874.00	6.64
45	603501	韦尔股份	1,401,410.00	6.64
46	601601	中国太保	1,382,059.00	6.55
47	601658	邮储银行	1,380,900.00	6.54
48	000100	TCL 科技	1,368,165.00	6.48

49	600690	海尔智家	1,313,562.00	6.22
50	600585	海螺水泥	1,296,829.00	6.15
51	600346	恒力石化	1,294,155.00	6.13
52	002142	宁波银行	1,292,884.18	6.13
53	601328	交通银行	1,292,277.00	6.12
54	002027	分众传媒	1,259,616.00	5.97
55	300014	亿纬锂能	1,234,168.00	5.85
56	300122	智飞生物	1,190,605.00	5.64
57	002493	荣盛石化	1,164,503.00	5.52
58	600016	民生银行	1,137,235.54	5.39
59	601088	中国神华	1,130,091.00	5.36
60	601688	华泰证券	1,116,713.00	5.29
61	600048	保利地产	1,105,896.00	5.24
62	300124	汇川技术	1,104,021.80	5.23
63	601668	中国建筑	1,076,594.00	5.10
64	601633	长城汽车	1,047,965.00	4.97
65	002460	赣锋锂业	1,042,841.00	4.94
66	000338	潍柴动力	1,015,553.00	4.81
67	600104	上汽集团	1,001,109.00	4.74
68	300450	先导智能	1,000,897.00	4.74
69	600436	片仔癀	995,845.85	4.72
70	600837	海通证券	963,453.00	4.57
71	300347	泰格医药	951,187.00	4.51
72	002230	科大讯飞	939,742.00	4.45
73	600999	招商证券	939,731.00	4.45
74	000063	中兴通讯	935,222.62	4.43
75	002607	中公教育	929,521.00	4.40
76	002271	东方雨虹	925,284.00	4.38
77	300750	宁德时代	920,548.00	4.36
78	601138	工业富联	918,859.00	4.35
79	601066	中信建投	887,585.00	4.21
80	601229	上海银行	870,517.29	4.13
81	601766	中国中车	863,735.00	4.09
82	000538	云南白药	855,016.00	4.05
83	300498	温氏股份	843,270.00	4.00
84	600570	恒生电子	842,184.00	3.99

85	300433	蓝思科技	819,147.00	3.88
86	601211	国泰君安	818,786.00	3.88
87	601818	光大银行	815,812.00	3.87
88	601816	京沪高铁	814,114.00	3.86
89	002410	广联达	813,814.00	3.86
90	300142	沃森生物	779,810.00	3.70
91	603799	华友钴业	776,394.00	3.68
92	600588	用友网络	775,121.24	3.67
93	600019	宝钢股份	748,430.00	3.55
94	601919	中远海控	732,745.00	3.47
95	600919	江苏银行	732,042.00	3.47
96	601169	北京银行	723,723.00	3.43
97	600703	三安光电	721,694.00	3.42
98	300413	芒果超媒	713,918.12	3.38
99	600406	国电南瑞	704,349.00	3.34
100	601319	中国人保	699,387.00	3.31
101	300999	金龙鱼	699,205.00	3.31
102	600763	通策医疗	694,193.00	3.29
103	600893	航发动力	683,023.00	3.24
104	601998	中信银行	676,514.00	3.21
105	603986	兆易创新	666,929.00	3.16
106	000895	双汇发展	624,961.00	2.96
107	000708	中信特钢	624,555.00	2.96
108	600196	复星医药	622,917.00	2.95
109	300601	康泰生物	622,883.00	2.95
110	002812	恩捷股份	614,025.00	2.91
111	002049	紫光国微	601,579.00	2.85
112	000157	中联重科	600,700.00	2.85
113	601390	中国中铁	600,109.00	2.84
114	300760	迈瑞医疗	592,836.00	2.81
115	688036	传音控股	591,250.20	2.80
116	300274	阳光电源	578,466.00	2.74
117	002007	华兰生物	568,999.14	2.70
118	600745	闻泰科技	560,244.52	2.65
119	601155	新城控股	559,357.00	2.65
120	002311	海大集团	558,512.00	2.65

121	000876	新希望	554,233.00	2.63
122	002001	新和成	552,352.00	2.62
123	601100	恒立液压	550,740.00	2.61
124	002129	中环股份	545,405.00	2.58
125	003816	中国广核	537,821.00	2.55
126	000768	中航西飞	537,473.00	2.55
127	603993	洛阳钼业	530,659.00	2.51
128	600176	中国巨石	530,240.00	2.51
129	601377	兴业证券	526,460.00	2.49
130	000786	北新建材	522,845.00	2.48
131	600885	宏发股份	519,877.00	2.46
132	000776	广发证券	517,852.00	2.45
133	600132	重庆啤酒	514,575.00	2.44
134	002736	国信证券	510,665.00	2.42
135	002601	龙佰集团	509,762.00	2.42
136	600584	长电科技	509,232.00	2.41
137	600050	中国联通	504,882.00	2.39
138	601336	新华保险	501,255.00	2.38
139	600926	杭州银行	497,034.00	2.36
140	600111	北方稀土	496,688.00	2.35
141	688111	金山办公	491,942.00	2.33
142	002371	北方华创	489,425.00	2.32
143	000625	长安汽车	485,409.00	2.30
144	002236	大华股份	482,031.00	2.28
145	601360	三六零	481,916.00	2.28
146	002821	凯莱英	473,397.30	2.24
147	000166	申万宏源	470,311.00	2.23
148	600958	东方证券	468,732.00	2.22
149	601225	陕西煤业	464,834.00	2.20
150	002050	三花智控	464,205.00	2.20
151	002841	视源股份	460,059.00	2.18
152	002044	美年健康	459,463.00	2.18
153	603392	万泰生物	455,161.00	2.16
154	600741	华域汽车	453,936.00	2.15
155	300408	三环集团	444,230.00	2.11
156	000596	古井贡酒	443,092.00	2.10

157	002179	中航光电	442,129.00	2.10
158	600547	山东黄金	435,672.00	2.06
159	601877	正泰电器	434,452.00	2.06
160	688169	石头科技	427,140.00	2.02
161	603882	金域医学	424,500.00	2.01

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	601398	工商银行	3,709,567.00	17.58
2	601939	建设银行	2,879,333.00	13.64
3	603259	药明康德	2,265,862.40	10.74
4	601288	农业银行	2,114,318.00	10.02
5	601628	中国人寿	1,953,898.00	9.26
6	600519	贵州茅台	1,757,520.00	8.33
7	002475	立讯精密	1,743,621.00	8.26
8	601857	中国石油	1,729,717.00	8.20
9	600905	三峡能源	1,712,989.60	8.12
10	601988	中国银行	1,704,022.00	8.07
11	300760	迈瑞医疗	1,611,626.39	7.64
12	002352	顺丰控股	1,321,906.00	6.26
13	601012	隆基股份	1,265,852.00	6.00
14	600276	恒瑞医药	1,254,035.80	5.94
15	600028	中国石化	1,230,957.00	5.83
16	600570	恒生电子	1,219,594.00	5.78
17	601658	邮储银行	1,150,883.00	5.45
18	600031	三一重工	1,089,710.00	5.16
19	002594	比亚迪	1,077,421.00	5.11
20	601899	紫金矿业	1,056,890.00	5.01
21	002410	广联达	1,019,330.00	4.83
22	603236	移远通信	902,484.00	4.28
23	600660	福耀玻璃	899,188.00	4.26
24	600438	通威股份	863,824.00	4.09
25	002444	巨星科技	862,920.00	4.09
26	300750	宁德时代	830,908.00	3.94
27	002050	三花智控	813,558.00	3.86

28	688188	柏楚电子	813,100.00	3.85
29	002241	歌尔股份	804,105.00	3.81
30	300285	国瓷材料	758,710.00	3.60
31	600009	上海机场	741,924.00	3.52
32	002812	恩捷股份	725,944.00	3.44
33	300316	晶盛机电	723,236.86	3.43
34	688012	中微公司	719,484.00	3.41
35	002607	中公教育	706,547.00	3.35
36	601633	长城汽车	643,768.00	3.05
37	002415	海康威视	637,610.00	3.02
38	300450	先导智能	630,000.00	2.99
39	300999	金龙鱼	626,269.00	2.97
40	601816	京沪高铁	608,900.00	2.89
41	601138	工业富联	605,562.00	2.87
42	603288	海天味业	593,345.00	2.81
43	601318	中国平安	561,863.00	2.66
44	601319	中国人保	556,403.00	2.64
45	000858	五粮液	534,690.00	2.53
46	601088	中国神华	527,358.00	2.50
47	601998	中信银行	517,008.00	2.45
48	600036	招商银行	504,570.00	2.39
49	601066	中信建投	503,289.00	2.38
50	600885	宏发股份	475,728.00	2.25
51	688408	中信博	468,000.00	2.22

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	272,029,981.17
卖出股票收入（成交）总额	88,170,401.31

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	71,909,450.00	27.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	71,909,450.00	27.42

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	019640	20 国债 10	584,000	58,400,000.00	22.27
2	019649	21 国债 01	135,000	13,509,450.00	5.15

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：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

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：本基金本报告期内未投资国债期货。

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：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

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受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内基金投资的前十名证券中的发行主体包括兴业银行股份有限公司。中国银保监会福建监管局、中国人民银行福州中心支行分别于 2020 年 8 月 31 日、2020 年 9 月 4 日对兴业银行股份有限公司作出了处罚决定。但本基金投资相关证券的投资决策程序符合相关法律、法规的规定。

本报告期内基金投资的前十名证券的其余发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

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	96,700.52
2	应收证券清算款	221,158.18
3	应收股利	-
4	应收利息	1,349,581.06
5	应收申购款	13,200.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,680,639.76

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末本基金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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	1.96	新股流通受限

§ 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
鑫元行业轮动A	97	2,375,888.08	230,048,584.49	99.82%	412,559.21	0.18%
鑫元行业轮动C	382	860.75	0.00	0.00%	328,804.96	100.00%
合计	479	481,816.18	230,048,584.49	99.68%	741,364.17	0.32%

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	鑫元行业轮动A	10,885.97	0.0047%
	鑫元行业轮动C	2,062.84	0.6274%
	合计	12,948.81	0.0056%

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的情况

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	鑫元行业轮动A	0~10
	鑫元行业轮动C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鑫元行业轮动A	0
	鑫元行业轮动C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金	10.00	0.00	10.00	0.00	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10.00	0.00	10.00	0.00	3 年

注：1、报告期内，基金管理人部分赎回了认购的持有期限已满三年的本基金份额。

2、目前系统仅能保留四位小数。报告期末基金管理人固有资金持有的份额占基金总份额比例实际为 0.000004%，基金管理人固有资金发起份额占基金总份额比例实际为 0.000004% 。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C
基金合同生效日（2018 年 5 月 31 日）基金份额总额	39,007,134.69	-
本报告期期初基金份额总额	19,505,642.34	-
本报告期基金总申购份额	220,958,641.36	13,390,758.87
减：本报告期基金总赎回份额	10,003,140.00	13,061,953.91
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	230,461,143.70	328,804.96

注：鑫元行业轮动 C 类份额实际存续从 2021 年 4 月 30 日开始。

§ 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

1、基金管理人：本报告期内，基金管理人于 2021 年 4 月 29 日发布了《鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。自 2021 年 4 月 28 日起，龙艺女士担任公司总经理，同时张乐赛先生不再担任上述职务。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

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

1、本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

2、本报告期托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

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	
天风证券	2	245,777,591.20	69.85%	180,603.76	60.53%	-
安信证券	2	106,067,949.70	30.15%	117,773.36	39.47%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-

注：（1）交易单元的主要选择标准：

1) 财务状况良好，经营行为规范；

2) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，具备投资运作所需的高效、安全的通讯条件，交

易设施符合代理基金进行证券交易的需要；

3) 具备研究实力，能及时提供高质量的研究服务；

4) 收取的交易佣金费率合理。

(2) 交易单元的选择程序：

1) 市场研究部根据选择标准选取合作券商，发起签署研究服务协议；

2) 交易部发起与合作券商签订交易单元租用协议，办理交易单元的相关开通手续，调整相关系统参数，基金运营部及时通知托管人。

(3) 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：无。

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
天风证券	10,290,060.00	14.29%	76,400,000.00	3.99%	-	-
安信证券	61,712,667.64	85.71%	1,837,500,000.00	96.01%	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

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	鑫元基金管理有限公司关于鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更的公告	公司网站、上海证券报	2021年1月15日
2	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2021年第1号）	公司网站	2021年1月19日
3	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金（鑫元行业轮动A份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021年1月19日
4	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金（鑫元行业轮动C份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021年1月19日
5	鑫元基金管理有限公司关于	公司网站、上海证券	2021年1月20日

	旗下鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金开通基金转换业务的公告	报	
6	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站	2021 年 1 月 22 日
7	鑫元基金管理有限公司关于修订旗下 7 只公募基金基金合同等相关法律文件的公告	公司官网、证券时报、上海证券报、中国证券报	2021 年 2 月 3 日
8	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同	公司网站	2021 年 2 月 3 日
9	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议	公司网站	2021 年 2 月 3 日
10	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 2 号）	公司网站	2021 年 2 月 5 日
11	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金（鑫元行业轮动 A 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 2 月 5 日
12	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金（鑫元行业轮动 C 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 2 月 5 日
13	鑫元基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 2 月 6 日
14	鑫元基金管理有限公司关于鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金调整管理费率并修订基金合同的公告	公司网站、上海证券报	2021 年 3 月 4 日
15	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同	公司网站	2021 年 3 月 4 日
16	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 3 号）	公司网站	2021 年 3 月 9 日
17	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金（鑫元行业轮动 A 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 3 月 9 日

18	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金（鑫元行业轮动 C 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 3 月 9 日
19	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站	2021 年 3 月 31 日
20	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站	2021 年 4 月 22 日
21	鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 4 月 29 日
22	鑫元基金管理有限公司关于修订旗下 10 只公募基金基金合同等相关法律文件的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 5 月 26 日
23	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同	公司网站	2021 年 5 月 26 日
24	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议	公司网站	2021 年 5 月 26 日
25	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 4 号）	公司网站	2021 年 5 月 31 日
26	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金（鑫元行业轮动 A 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 5 月 31 日
27	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金（鑫元行业轮动 C 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 5 月 31 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210125	10,003,150.00	0.00	10,003,140.00	10.00	0.00%
	2	20210101-20210125	9,502,492.34	0.00	0.00	9,502,492.34	4.12%
	3	20210126-20210607	0.00	44,400,142.08	0.00	44,400,142.08	19.24%
	4	20210303-20210607	0.00	45,619,525.55	0.00	45,619,525.55	19.77%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金已有单一投资者所持基金份额达到或超过本基金总份额的 20%，中小投资者在投资本基金时可能面临以下风险：

（一）赎回申请延期办理或暂停赎回的风险

单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件，因此当发生巨额赎回时，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要按同比例部分延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。

（二）基金净值大幅波动的风险

单一投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产大量变现，会对基金资产净值产生影响；且如遇大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，都可能会造成基金资产净值的较大波动。

（三）基金投资目标偏离的风险

单一投资者大额赎回后，很可能导致基金规模骤然缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。

（四）基金合同提前终止或其它相关风险

《基金合同》生效满 3 年后继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。因此，在极端情况下，当单一投资者大量赎回本基金后，可能造成基金资产净值大幅缩减，对本基金的存续情况产生实质性影响。

注：目前系统仅能保留四位小数，报告期末机构投资者 1 持有的基金份额占全部份额比例实际为 0.000004%。

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

- 1、中国证监会批准鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批复、营业执照。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件。

鑫元基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日