

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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 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	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	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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16

6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
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.....	70
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 市场中性策略执行情况.....	71
7.13 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.....	74
§10 重大事件揭示.....	75
10.1 基金份额持有人大会决议.....	75
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.....	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	75
10.4 基金投资策略的改变.....	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	75
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.....	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	75
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	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	中金绝对收益
基金主代码	001059
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 21 日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	149,622,428.83 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金灵活应用多种绝对收益策略对冲本系统性风险，寻求基金资产的长期稳健增值，以期实现超越业绩比较基准的绝对收益。
投资策略	本基金采用市场中性策略为主的多种绝对收益策略剥离系统风险，力争实现基金资产长期稳定的绝对回报。
业绩比较基准	一年期银行定期存款收益率。
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险，实现基金资产的保值增值，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。

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		中金基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵璧	李申
	联系电话	010-63211122	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-868-1166	021-60637111
传真		010-66159121	021-60635778
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100004	100033
法定代表人		胡长生	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 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

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)
本期已实现收益	1,911,765.09
本期利润	1,640,141.93
加权平均基金份额本期利润	0.0109
本期加权平均净值利润率	0.97%
本期基金份额净值增长率	1.70%
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	14,181,318.34
期末可供分配基金份额利润	0.0948
期末基金资产净值	169,709,224.01
期末基金份额净值	1.134
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	13.40%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、本报告所列示的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、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。

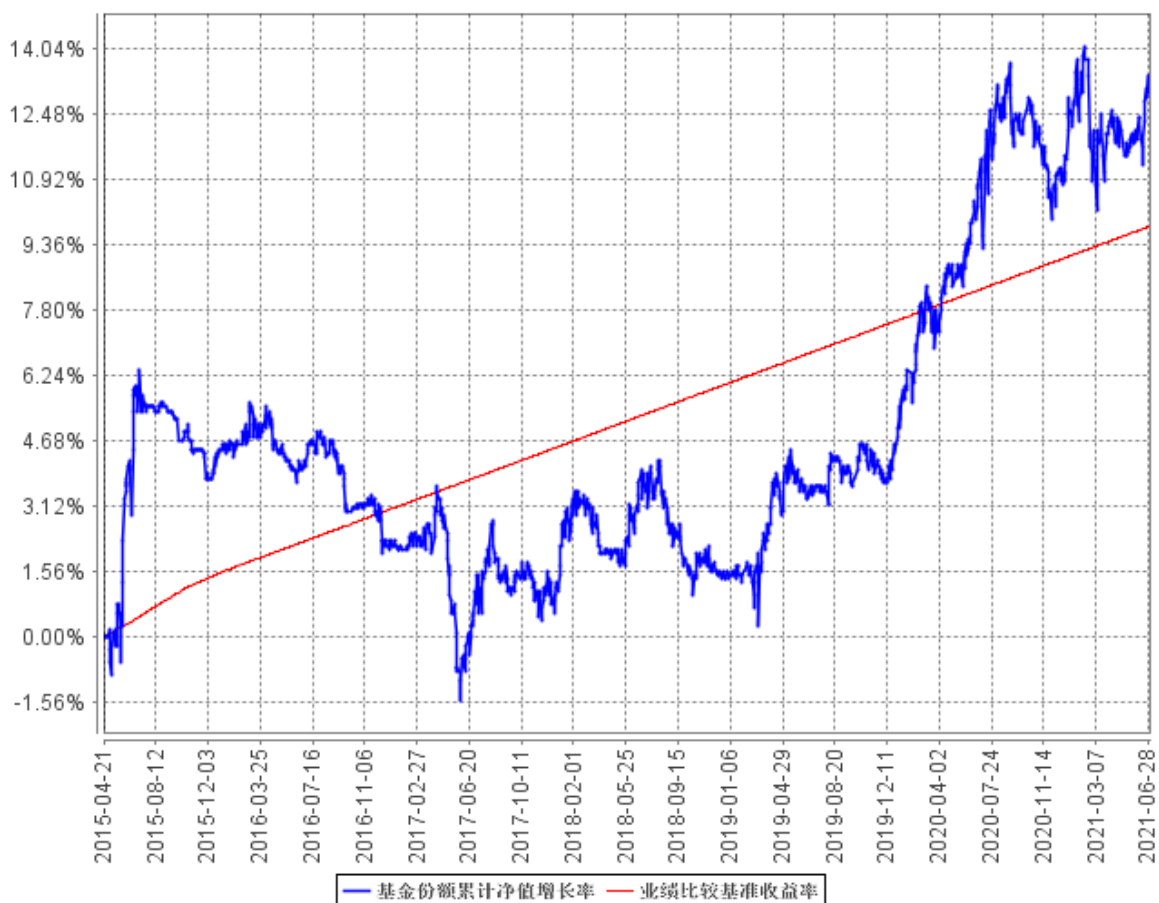
3.2 基金净值表现

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

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	1.34%	0.27%	0.11%	0.00%	1.23%	0.27%
过去三个月	1.25%	0.22%	0.34%	0.00%	0.91%	0.22%
过去六个月	1.70%	0.34%	0.68%	0.00%	1.02%	0.34%
过去一年	1.80%	0.34%	1.38%	0.00%	0.42%	0.34%
过去三年	9.78%	0.27%	4.28%	0.00%	5.50%	0.27%
自基金合同生效起至今	13.40%	0.25%	9.81%	0.00%	3.59%	0.25%

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

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



§ 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

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 37 只公募基金，证券投资基金管理规模 680.27 亿元。

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		
魏宇	本基金基金经理	2020 年 10 月 22 日	-	10 年	魏宇先生，统计学博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发。2014 年 11 月加入中金基金管理有限公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任量化指数部基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、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。

3、本基金无基金经理助理。

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

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金灵活应用多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险，寻求基金资产的长期稳健增值，以期实现超越业绩比较基准的绝对收益，目前选股模型表现平稳，后续将继续以量化对冲模型为主，辅以灵活的加减仓策略，同时积极参与新股网下新股申购，关注各类风险，努力创收。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.134 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.70%，业绩比较基准收益率为 0.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年宏观经济运行和资本市场表现，伴随主要经济体短期增长高点在上半年的接连确认，全球资本市场关注点逐渐经历了从高度关注通胀到更加关注增长可持续性的转变；在此期间，周期/防御、价值/成长、大/小市值风格的阶段性表现差异明显。A 股市场在经历春节前快速上涨和春节后明显调整的指数级别行情后，逐渐进入指数震荡、结构分化的行情阶段，不同风格、不同行业之间表现差异较大。整个上半年，沪深 300 指数上涨 0.24%，中证 500 指数上涨 6.93%。

展望下半年，为实现“宏观政策跨周期调节，保持经济运行在合理区间”等政策目标，国内宏观政策或将呈现“松货币、宽财政、紧信用”的组合。货币政策料将整体稳健，以保持流动性合理充裕，助力中小企业和困难行业持续恢复；财政及准财政政策有望发挥更积极高效的作用；信用条件在高基数背景下或将继续收敛。这一宏观背景下，市场对无风险收益率超预期上行的担忧或将得到明显缓解，市场整体风险偏好水平则有望保持稳定。行业景气程度较高、产业前景相

对明确、估值和业绩匹配度好、具有中长期成长潜力的公司或更具配置价值。

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和基金合同的约定，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。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；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、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：中金绝对收益策略定期开放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	4,545,455.15	1,428,707.59
结算备付金		13,157,240.37	3,421,410.27
存出保证金		17,027,080.90	4,531,184.59
交易性金融资产	6.4.7.2	130,840,094.40	45,633,986.00
其中：股票投资		130,834,494.40	42,827,626.00
基金投资		-	-
债券投资		5,600.00	2,806,360.00
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		5,310,235.39	25,480.18
应收利息	6.4.7.5	1,334.73	28,649.10
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		170,881,440.94	55,069,417.73
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		-	2,000,000.00
应付证券清算款		-	3,760.83
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		227,814.23	44,323.10
应付托管费		34,510.17	11,080.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	858,741.25	190,921.93
应交税费		-	-

应付利息		-	-691.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	51,151.28	194,000.00
负债合计		1,172,216.93	2,443,395.37
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	149,622,428.83	47,198,796.37
未分配利润	6.4.7.10	20,086,795.18	5,427,225.99
所有者权益合计		169,709,224.01	52,626,022.36
负债和所有者权益总计		170,881,440.94	55,069,417.73

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.134 元，基金份额总额 149,622,428.83 份。

6.2 利润表

会计主体：中金绝对收益策略定期开放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		5,785,705.70	9,889,677.17
1.利息收入		76,666.75	133,062.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	31,128.66	77,860.91
债券利息收入		7,034.86	12,917.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		38,503.23	42,284.33
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,786,621.02	6,429,524.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,704,270.44	11,091,529.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,291.17	1,109,198.73
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-1,835,311.36	-6,108,765.00
股利收益	6.4.7.15	913,370.77	337,560.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-271,623.16	2,894,604.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	194,041.09	432,485.68
减：二、费用		4,145,563.77	2,737,249.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	918,431.51	1,074,172.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	207,164.48	140,491.14

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,926,204.39	1,406,716.65
5. 利息支出		3,326.17	-
其中：卖出回购金融资产支出		3,326.17	-
6. 税金及附加		22,957.92	5.80
7. 其他费用	6.4.7.19	67,479.30	115,863.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,640,141.93	7,152,427.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,640,141.93	7,152,427.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金绝对收益策略定期开放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）	47,198,796.37	5,427,225.99	52,626,022.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,640,141.93	1,640,141.93
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）	102,423,632.46	13,019,427.26	115,443,059.72
其中：1. 基金申购款	162,395,340.12	20,228,173.75	182,623,513.87
2. 基金赎回款	-59,971,707.66	-7,208,746.49	-67,180,454.15
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）	149,622,428.83	20,086,795.18	169,709,224.01
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		

券股份有限公司（原齐鲁证券股份有限公司）共同销售，募集期为 2015 年 3 月 23 日至 2015 年 4 月 16 日。经向中国证监会备案，《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2015 年 4 月 21 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 709,513,460.11 份（含利息转份额 365,426.61 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(特殊普通合伙) 审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同的有关规定，本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具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。具体包括：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）、存托凭证、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具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的相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况、2021 年上半年度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 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税

政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、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》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(2) 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（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以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 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(3) 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、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的

非上市公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金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。

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	4,545,455.15
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：	4,545,455.15

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	128,750,867.67	130,834,494.40	2,083,626.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,600.00	5,600.00
	银行间市场	-	-
	合计	5,600.00	5,600.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	128,756,467.67	130,840,094.40	2,083,626.73

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

股指期货投资明细如下：

单位：人民币元

股指期货投资：

2021 年 6 月 30 日

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IH2109	上证 50 期货 2109 合约	12.00	12,456,720.00	-236,713.85
IC2107	中证 500 期货 2107 合约	-47.00	-63,611,680.00	-1,319,840.00
IF2107	沪深 300 期货 2107 合约	-43.00	-66,966,480.00	368,226.38

注：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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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	573.34
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	722.60
应收债券利息	0.29
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	38.50
合计	1,334.73

注：“其他”为应收存出保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	858,741.25
银行间市场应付交易费用	-
合计	858,741.25

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	51,151.28
合计	51,151.28

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	47,198,796.37	47,198,796.37
本期申购	162,395,340.12	162,395,340.12
本期赎回(以“-”号填列)	-59,971,707.66	-59,971,707.66
- 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	149,622,428.83	149,622,428.83

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,859,068.93	1,568,157.06	5,427,225.99
本期利润	1,911,765.09	-271,623.16	1,640,141.93
本期基金份额交易产生的变动数	8,410,484.32	4,608,942.94	13,019,427.26
其中：基金申购款	14,307,159.68	5,921,014.07	20,228,173.75
基金赎回款	-5,896,675.36	-1,312,071.13	-7,208,746.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,181,318.34	5,905,476.84	20,086,795.18

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	15,255.50
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	15,401.54
其他	471.62
合计	31,128.66

注：“其他”为存出保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,066,119,780.84
减：卖出股票成本总额	1,059,415,510.40
买卖股票差价收入	6,704,270.44

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	4,291.17
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	4,291.17

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	10,465,964.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,311,460.00
减：应收利息总额	150,213.58
买卖债券差价收入	4,291.17

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	-1,835,311.36

6.4.7.15 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	913,370.77
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	913,370.77

6.4.7.16 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	-392,478.55
——股票投资	-393,388.55
——债券投资	910.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	120,855.39
——权证投资	-
——期货投资	120,855.39
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	-271,623.16

6.4.7.17 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	194,041.09
基金转换费收入	-
合计	194,041.09

6.4.7.18 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	2,926,204.39
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	2,926,204.39

6.4.7.19 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	17,356.09
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
帐户维护费	18,960.00
汇划手续费	6,368.02
合计	67,479.30

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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未发生变化。

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
中金基金管理有限公司（“中金基金”）	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（“中金财富证券”原“中国中投证券有限责任公司”）	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：以下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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
中金公司	-	-	25,000.00	0.04%

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间没有应支付关联方的佣金。

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	918,431.51	1,074,172.35
其中：支付销售机构的客户维护费	90,973.21	436,539.92

注：1、支付基金管理人中金基金的基本管理费按前一日基金资产净值 1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基本管理费=前一日基金资产净值×1%/当年天数。

2、基金管理人的附加管理费

1) 基金管理人可在同时满足以下条件的前提下，提取附加管理费：

①符合基金收益分配条件；

②附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照“新高法原则”提取超额收益的 10%作为附加管理费：即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，基金管理人才能收取附加管理费。

提取评价日：每个基金封闭期的最后一个工作日。

2) 附加管理费的计算方法和提取

在每个提取评价日，在同时满足以上附加管理费提取条件的情况下，附加管理费的计算方法为：

$$\text{附加管理费} = (\text{PA} - \text{PH}) \times 10\% \times \text{SA}$$

其中：

PA 为提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值；

PH 为以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，其中首次封闭期的 PH 为 1；

SA 为提取评价日的基金总份额数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年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	207,164.48	140,491.14

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

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	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
基金合同生效日（2015年4月21日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	8,000,000.00	-
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	8,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.3468%	-

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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	4,545,455.15	15,255.50	8,042,695.33	65,969.14

注：1、本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中金公司	003033	征和工业	网下	253	5,889.84
中金公司	688696	极米科技	网下	465	62,184.45
中金公司	688316	青云科技	网下	857	54,590.90
中金公司	605090	九丰能源	网下	1,090	37,681.30
中金公司	601156	东航物流	网下	2,090	32,959.30
中金公司	688425	铁建重工	网下	20,911	60,014.57
上年度可比期间					
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中金公司	688100	威胜信息	网下	9,350	128,843.00
中金公司	688158	优刻得	网下	4,370	145,215.10
中金公司	688266	泽璟制药	网下	6,978	235,577.28
中金公司	688200	华峰测控	网下	924	99,246.84
中金公司	300825	阿尔特	网下	1,642	10,081.88
中金公司	688222	成都先导	网下	4,134	84,829.68
中金公司	300831	派瑞股份	网下	1,716	6,829.68

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

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
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	-
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	新股流通受限	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688609	九联科技	2021年3月15日	2021年9月23日	新股流通受限	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688076	诺泰生物	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	15.57	48.55	3,209	49,964.13	155,796.95	-
688700	东威科技	2021年6月7日	2021年12月15日	新股流通受限	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-
688676	金盘科技	2021年3月2日	2021年9月9日	新股流通受限	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-
688217	睿昂基因	2021年5月7日	2021年11月17日	新股流通受限	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-
688565	力源科技	2021年5月6日	2021年11月15日	新股流通受限	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-

			日							
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	136	6,436.88	34,266.56	-
688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	新股流通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月20日	新股流通受限	28.77	99.85	185	5,322.45	18,472.25	-
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	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股流通受限	12.54	27.89	521	6,533.34	14,530.69	-
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	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	828	4,090.32	10,805.40	-
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	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
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	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

		日	月 30 日								
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	-	
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	-	
300950	德固 特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股流 通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-	
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	-	
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	-	
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	-	
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	-	

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123117	健帆转债	2021年6月23日	2021年7月12日	新债未上市	100.00	100.00	56	5,600.00	5,600.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为特殊的混合型基金，通过多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险，实现基金资产的保值增值，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货等。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市场风险、信用风险、流动性风险等。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制控制在合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对

相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可接受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

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	-	10,000.00
AAA 以下	5,600.00	-
未评级	-	-
合计	5,600.00	10,000.00

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性压力测试、流动性风险预警、指标超标及危机的处理、流动性风险管理工具、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性指标进行监控。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人在本基金开放期可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成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。首先，本基金在开放期保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、期货交易所等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金在开放期主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。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	4,545,455.15	-	-	-	4,545,455.15
结算备付金	1,605,757.86	-	-	11,551,482.51	13,157,240.37
存出保证金	85,468.10	-	-	16,941,612.80	17,027,080.90
交易性金融资产- 股票投资	-	-	-	130,834,494.40	130,834,494.40
交易性金融资产- 债券投资、资产支 持证券	-	-	5,600.00	-	5,600.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,310,235.39	5,310,235.39
应收利息	-	-	-	1,334.73	1,334.73
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	6,236,681.11	-	5,600.00	164,639,159.83	170,881,440.94
负债					
卖出回购金融资产 款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	227,814.23	227,814.23
应付托管费	-	-	-	34,510.17	34,510.17
应付交易费用	-	-	-	858,741.25	858,741.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	51,151.28	51,151.28
负债总计	-	-	-	1,172,216.93	1,172,216.93
利率敏感度缺口	6,236,681.11	-	5,600.00	163,466,942.90	169,709,224.01
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	1,428,707.59	-	-	-	1,428,707.59
结算备付金	1,074,058.02	-	-	2,347,352.25	3,421,410.27
存出保证金	26,050.99	-	-	4,505,133.60	4,531,184.59
交易性金融资产- 股票投资	-	-	-	42,827,626.00	42,827,626.00
交易性金融资产- 债券投资、资产支 持证券	2,796,360.00	-	10,000.00	-	2,806,360.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	25,480.18	25,480.18
应收利息	-	-	-	28,649.10	28,649.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	5,325,176.60	-	10,000.00	49,734,241.13	55,069,417.73
负债					
卖出回购金融资产 款	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	3,760.83	3,760.83
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	44,323.10	44,323.10
应付托管费	-	-	-	11,080.75	11,080.75
应付交易费用	-	-	-	190,921.93	190,921.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-691.24	-691.24
其他负债	-	-	-	194,000.00	194,000.00
负债总计	2,000,000.00	-	-	443,395.37	2,443,395.37
利率敏感度缺口	3,325,176.60	-	10,000.00	49,290,845.76	52,626,022.36

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	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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）

			日)
	市场利率下降 25 个基点	-	3,726.15
	市场利率上升 25 个基点	-	-3,726.15

注：本期末本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0033%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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

本基金面临的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的股票，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，采用市场中性策略为主的多种绝对收益策略剥离系统风险，力争实现基金资产长期稳定的绝对回报。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：权益类空头头寸的价值占权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地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	130,834,494.40	77.09	42,827,626.00	81.38
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	130,834,494.40	77.09	42,827,626.00	81.38

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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）
	沪深 300 指数上升 5%	1,068,866.52	235,086.71
	沪深 300 指数下降 5%	-1,068,866.52	-235,086.71

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	130,834,494.40	76.56
	其中：股票	130,834,494.40	76.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,600.00	0.00
	其中：债券	5,600.00	0.00
	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	17,702,695.52	10.36
8	其他各项资产	22,338,651.02	13.07
9	合计	170,881,440.94	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	2,981,325.54	1.76
B	采矿业	4,147,112.00	2.44
C	制造业	82,339,933.04	48.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,027,936.39	1.19
E	建筑业	1,224,213.44	0.72
F	批发和零售业	1,645,755.46	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	2,392,866.20	1.41
H	住宿和餐饮业	1,033,181.00	0.61
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,327,129.83	3.14
J	金融业	15,540,716.22	9.16
K	房地产业	2,522,984.00	1.49
L	租赁和商务服务业	1,855,427.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	1,443,759.80	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	1,099,610.58	0.65
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	747,231.00	0.44
Q	卫生和社会工作	3,810,188.90	2.25
R	文化、体育和娱乐业	695,124.00	0.41
S	综合	-	-
	合计	130,834,494.40	77.09

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	1,600	3,290,720.00	1.94
2	000858	五粮液	8,818	2,626,794.02	1.55
3	300059	东方财富	57,804	1,895,393.16	1.12
4	300015	爱尔眼科	22,805	1,618,698.90	0.95
5	002074	国轩高科	34,800	1,515,888.00	0.89
6	603259	药明康德	9,220	1,443,759.80	0.85
7	002230	科大讯飞	21,000	1,419,180.00	0.84
8	601328	交通银行	288,800	1,415,120.00	0.83
9	000568	泸州老窖	5,900	1,392,046.00	0.82
10	002714	牧原股份	21,520	1,308,846.40	0.77
11	002241	歌尔股份	30,600	1,307,844.00	0.77
12	603799	华友钴业	11,400	1,301,880.00	0.77
13	002353	杰瑞股份	29,000	1,296,300.00	0.76
14	601636	旗滨集团	69,800	1,295,488.00	0.76
15	600884	杉杉股份	54,900	1,280,268.00	0.75
16	000063	中兴通讯	38,300	1,272,709.00	0.75
17	300122	智飞生物	6,800	1,269,764.00	0.75
18	601318	中国平安	19,561	1,257,381.08	0.74
19	300124	汇川技术	16,785	1,246,454.10	0.73
20	300088	长信科技	150,200	1,240,652.00	0.73
21	002080	中材科技	47,100	1,232,607.00	0.73
22	601717	郑煤机	105,500	1,226,965.00	0.72
23	603444	吉比特	2,300	1,219,000.00	0.72
24	300014	亿纬锂能	11,700	1,215,981.00	0.72
25	600919	江苏银行	169,080	1,200,468.00	0.71

26	600188	兖州煤业	77,400	1,188,864.00	0.70
27	600019	宝钢股份	155,600	1,188,784.00	0.70
28	600529	山东药玻	34,300	1,164,485.00	0.69
29	000012	南玻A	113,500	1,162,240.00	0.68
30	601601	中国太保	39,200	1,135,624.00	0.67
31	002304	洋河股份	5,400	1,118,880.00	0.66
32	002821	凯莱英	3,000	1,117,800.00	0.66
33	601225	陕西煤业	94,200	1,116,270.00	0.66
34	002179	中航光电	14,100	1,114,182.00	0.66
35	601888	中国中免	3,700	1,110,370.00	0.65
36	002511	中顺洁柔	39,800	1,096,490.00	0.65
37	600426	华鲁恒升	35,300	1,092,535.00	0.64
38	002050	三花智控	45,300	1,086,294.00	0.64
39	600862	中航高科	35,000	1,077,300.00	0.63
40	300146	汤臣倍健	32,700	1,075,830.00	0.63
41	000970	中科三环	111,000	1,060,050.00	0.62
42	000001	平安银行	46,700	1,056,354.00	0.62
43	300433	蓝思科技	35,900	1,055,819.00	0.62
44	300136	信维通信	34,100	1,053,008.00	0.62
45	603160	汇顶科技	8,100	1,050,003.00	0.62
46	601628	中国人寿	30,600	1,037,034.00	0.61
47	600754	锦江酒店	18,100	1,030,795.00	0.61
48	600031	三一重工	35,100	1,020,357.00	0.60
49	000799	酒鬼酒	3,900	996,840.00	0.59
50	600763	通策医疗	2,400	986,400.00	0.58
51	300628	亿联网络	11,700	980,460.00	0.58
52	002625	光启技术	46,200	961,422.00	0.57
53	600926	杭州银行	65,100	960,225.00	0.57
54	600036	招商银行	17,600	953,744.00	0.56
55	603355	莱克电气	15,100	939,673.00	0.55
56	002299	圣农发展	39,297	938,412.36	0.55
57	002390	信邦制药	89,200	934,816.00	0.55
58	600623	华谊集团	101,700	895,977.00	0.53
59	603806	福斯特	8,500	893,605.00	0.53
60	002648	卫星石化	22,700	889,613.00	0.52
61	000768	中航西飞	33,500	880,380.00	0.52
62	601600	中国铝业	163,200	864,960.00	0.51
63	000967	盈峰环境	125,600	862,872.00	0.51
64	603833	欧派家居	6,000	851,760.00	0.50

65	002456	欧菲光	95,100	844,488.00	0.50
66	600038	中直股份	15,900	838,566.00	0.49
67	002250	联化科技	29,800	831,420.00	0.49
68	000100	TCL 科技	108,300	828,495.00	0.49
69	600728	佳都科技	111,700	827,697.00	0.49
70	601009	南京银行	74,800	786,896.00	0.46
71	601006	大秦铁路	118,200	777,756.00	0.46
72	600580	卧龙电驱	58,100	772,730.00	0.46
73	603377	东方时尚	69,900	747,231.00	0.44
74	002153	石基信息	31,700	745,267.00	0.44
75	002429	兆驰股份	122,400	742,968.00	0.44
76	600886	国投电力	77,300	742,853.00	0.44
77	600195	中牧股份	61,300	733,148.00	0.43
78	000998	隆平高科	45,400	728,216.00	0.43
79	600642	申能股份	116,500	715,310.00	0.42
80	000333	美的集团	9,731	694,501.47	0.41
81	300347	泰格医药	3,500	676,550.00	0.40
82	600549	厦门钨业	31,300	651,979.00	0.38
83	000002	万科 A	27,200	647,632.00	0.38
84	300037	新宙邦	6,300	630,630.00	0.37
85	000656	金科股份	108,700	629,373.00	0.37
86	603225	新风鸣	29,400	596,820.00	0.35
87	600089	特变电工	45,100	579,535.00	0.34
88	600068	葛洲坝	77,300	578,977.00	0.34
89	002183	怡亚通	100,700	577,011.00	0.34
90	601899	紫金矿业	59,100	572,679.00	0.34
91	002180	纳思达	17,700	569,940.00	0.34
92	601998	中信银行	111,400	568,140.00	0.33
93	000686	东北证券	66,800	564,460.00	0.33
94	000938	紫光股份	25,500	557,940.00	0.33
95	601872	招商轮船	119,660	552,829.20	0.33
96	002013	中航机电	54,300	546,801.00	0.32
97	601336	新华保险	11,600	532,556.00	0.31
98	300244	迪安诊断	13,800	528,540.00	0.31
99	300072	三聚环保	89,900	516,026.00	0.30
100	603638	艾迪精密	11,820	506,723.40	0.30
101	603338	浙江鼎力	8,600	504,734.00	0.30
102	002212	天融信	25,400	502,158.00	0.30
103	002396	星网锐捷	23,500	501,725.00	0.30

104	002460	赣锋锂业	4,100	496,469.00	0.29
105	600875	东方电气	45,100	494,747.00	0.29
106	600707	彩虹股份	52,400	493,084.00	0.29
107	601128	常熟银行	79,300	491,660.00	0.29
108	300274	阳光电源	4,200	483,252.00	0.28
109	600835	上海机电	29,500	479,375.00	0.28
110	600064	南京高科	50,200	466,358.00	0.27
111	002635	安洁科技	30,800	450,604.00	0.27
112	002414	高德红外	16,320	450,105.60	0.27
113	002683	宏大爆破	16,100	447,097.00	0.26
114	002294	信立泰	13,500	444,150.00	0.26
115	600655	豫园股份	37,600	435,784.00	0.26
116	002557	洽洽食品	10,100	435,310.00	0.26
117	000999	华润三九	15,800	422,650.00	0.25
118	000039	中集集团	23,100	419,958.00	0.25
119	601997	贵阳银行	58,600	419,576.00	0.25
120	600111	北方稀土	20,100	416,070.00	0.25
121	300595	欧普康视	4,000	414,200.00	0.24
122	601611	中国核建	57,200	412,984.00	0.24
123	000825	太钢不锈	55,000	411,950.00	0.24
124	600660	福耀玻璃	7,300	407,705.00	0.24
125	300529	健帆生物	4,500	388,620.00	0.23
126	600392	盛和资源	22,300	387,128.00	0.23
127	002340	格林美	41,300	386,155.00	0.23
128	002415	海康威视	5,705	367,972.50	0.22
129	603707	健友股份	8,800	367,400.00	0.22
130	600900	长江电力	17,600	363,264.00	0.21
131	601088	中国神华	18,200	355,264.00	0.21
132	002078	太阳纸业	26,000	347,100.00	0.20
133	601168	西部矿业	28,100	335,233.00	0.20
134	300207	欣旺达	10,000	325,600.00	0.19
135	600299	安迪苏	26,700	319,332.00	0.19
136	002925	盈趣科技	7,750	301,552.50	0.18
137	600755	厦门国贸	36,600	300,486.00	0.18
138	601098	中南传媒	33,900	298,998.00	0.18
139	603228	景旺电子	11,100	290,820.00	0.17
140	002030	达安基因	13,500	286,740.00	0.17
141	600373	中文传媒	28,900	284,954.00	0.17
142	300001	特锐德	8,900	267,979.00	0.16

143	002056	横店东磁	20,500	266,500.00	0.16
144	600388	龙净环保	30,600	260,712.00	0.15
145	600233	圆通速递	25,900	259,259.00	0.15
146	603885	吉祥航空	16,800	256,368.00	0.15
147	600787	中储股份	47,400	252,642.00	0.15
148	002387	维信诺	24,200	252,406.00	0.15
149	000425	徐工机械	38,900	247,793.00	0.15
150	000963	华东医药	5,300	243,853.00	0.14
151	600177	雅戈尔	36,400	239,876.00	0.14
152	000651	格力电器	4,600	239,660.00	0.14
153	002595	豪迈科技	8,600	229,620.00	0.14
154	600585	海螺水泥	5,500	225,775.00	0.13
155	000750	国海证券	53,200	225,568.00	0.13
156	600667	太极实业	24,700	224,770.00	0.13
157	600998	九州通	14,500	222,865.00	0.13
158	603786	科博达	2,900	218,950.00	0.13
159	000089	深圳机场	27,100	210,567.00	0.12
160	601933	永辉超市	44,200	209,066.00	0.12
161	002368	太极股份	10,400	208,624.00	0.12
162	603986	兆易创新	1,100	206,690.00	0.12
163	600690	海尔智家	7,900	204,689.00	0.12
164	002532	天山铝业	24,200	203,038.00	0.12
165	002594	比亚迪	800	200,800.00	0.12
166	600120	浙江东方	46,310	198,206.80	0.12
167	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.12
168	000717	韶钢松山	42,100	193,239.00	0.11
169	002475	立讯精密	4,199	193,154.00	0.11
170	002600	领益智造	19,500	179,205.00	0.11
171	601555	东吴证券	21,400	178,476.00	0.11
172	002203	海亮股份	15,700	167,048.00	0.10
173	600741	华域汽车	6,113	160,588.51	0.09
174	600061	国投资本	18,892	160,393.08	0.09
175	600918	中泰证券	14,700	159,054.00	0.09
176	600376	首开股份	28,400	159,040.00	0.09
177	000402	金融街	23,500	158,625.00	0.09
178	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.09
179	000725	京东方 A	25,400	158,496.00	0.09
180	603233	大参林	3,100	158,441.00	0.09
181	688076	诺泰生物	3,209	155,796.95	0.09

182	600782	新钢股份	27,800	155,124.00	0.09
183	000723	美锦能源	19,000	143,640.00	0.08
184	300741	华宝股份	2,800	142,016.00	0.08
185	000671	阳光城	26,800	139,360.00	0.08
186	601216	君正集团	26,700	135,903.00	0.08
187	601012	隆基股份	1,517	134,770.28	0.08
188	603568	伟明环保	5,900	134,697.00	0.08
189	002602	世纪华通	20,000	128,400.00	0.08
190	603658	安图生物	1,670	126,535.90	0.07
191	002027	分众传媒	13,400	126,094.00	0.07
192	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.07
193	002268	卫士通	5,700	111,036.00	0.07
194	600266	城建发展	23,300	110,442.00	0.07
195	001914	招商积余	6,400	109,952.00	0.06
196	600025	华能水电	17,700	102,483.00	0.06
197	600390	五矿资本	17,100	102,258.00	0.06
198	002463	沪电股份	6,600	102,102.00	0.06
199	002048	宁波华翔	5,200	101,400.00	0.06
200	600039	四川路桥	15,600	97,812.00	0.06
201	600507	方大特钢	13,600	92,208.00	0.05
202	002624	完美世界	3,800	90,858.00	0.05
203	002233	塔牌集团	8,600	88,408.00	0.05
204	600737	中粮糖业	8,600	86,086.00	0.05
205	000598	兴蓉环境	16,200	84,402.00	0.05
206	601801	皖新传媒	17,800	84,016.00	0.05
207	000090	天健集团	14,800	81,844.00	0.05
208	000960	锡业股份	4,400	70,532.00	0.04
209	600985	淮北矿业	5,600	68,376.00	0.04
210	601229	上海银行	8,300	68,060.00	0.04
211	600062	华润双鹤	5,200	61,932.00	0.04
212	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.04
213	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.04
214	600016	民生银行	13,400	59,094.00	0.03
215	603868	飞科电器	1,400	58,884.00	0.03
216	000786	北新建材	1,500	58,875.00	0.03
217	000826	启迪环境	11,000	58,850.00	0.03
218	300308	中际旭创	1,500	57,780.00	0.03
219	603708	家家悦	3,300	57,321.00	0.03
220	600276	恒瑞医药	688	46,763.36	0.03

221	000636	风华高科	1,500	45,330.00	0.03
222	000061	农产品	7,600	41,952.00	0.02
223	600348	华阳股份	5,600	41,552.00	0.02
224	002008	大族激光	1,000	40,390.00	0.02
225	300474	景嘉微	400	39,168.00	0.02
226	600048	保利地产	3,200	38,528.00	0.02
227	002444	巨星科技	1,100	37,488.00	0.02
228	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
229	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.02
230	002223	鱼跃医疗	900	34,317.00	0.02
231	300957	贝泰妮	136	34,266.56	0.02
232	000537	广宇发展	6,200	32,426.00	0.02
233	600498	烽火通信	1,700	31,671.00	0.02
234	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.02
235	000069	华侨城 A	4,200	31,248.00	0.02
236	300142	沃森生物	500	30,850.00	0.02
237	600037	歌华有线	3,200	30,752.00	0.02
238	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.02
239	601238	广汽集团	2,100	27,195.00	0.02
240	002352	顺丰控股	400	27,080.00	0.02
241	601166	兴业银行	1,300	26,715.00	0.02
242	603288	海天味业	200	25,790.00	0.02
243	600115	中国东航	4,900	24,892.00	0.01
244	601618	中国中冶	8,300	24,734.00	0.01
245	688009	中国通号	4,000	22,760.00	0.01
246	601577	长沙银行	2,300	20,562.00	0.01
247	601928	凤凰传媒	2,600	18,564.00	0.01
248	300953	震裕科技	185	18,472.25	0.01
249	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
250	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
251	601800	中国交建	2,600	16,848.00	0.01
252	600435	北方导航	2,100	16,674.00	0.01
253	002311	海大集团	200	16,320.00	0.01
254	600703	三安光电	500	16,025.00	0.01
255	600563	法拉电子	100	15,836.00	0.01
256	600141	兴发集团	800	15,064.00	0.01
257	601689	拓普集团	400	14,972.00	0.01
258	002124	天邦股份	2,100	14,721.00	0.01
259	301009	可靠股份	521	14,530.69	0.01

260	603712	七一二	400	14,440.00	0.01
261	600406	国电南瑞	600	13,944.00	0.01
262	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
263	603993	洛阳钼业	2,600	13,416.00	0.01
264	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
265	002142	宁波银行	300	11,691.00	0.01
266	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
267	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
268	300997	欢乐家	828	10,805.40	0.01
269	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.01
270	603087	甘李药业	100	10,658.00	0.01
271	300996	普联软件	241	10,177.43	0.01
272	002468	申通快递	1,300	9,906.00	0.01
273	600901	江苏租赁	1,900	9,880.00	0.01
274	300956	英力股份	371	9,571.80	0.01
275	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
276	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.01
277	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.01
278	300966	共同药业	286	9,020.44	0.01
279	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.01
280	601100	恒立液压	100	8,592.00	0.01
281	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
282	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
283	000898	鞍钢股份	1,800	8,010.00	0.00
284	600699	均胜电子	300	7,656.00	0.00
285	600109	国金证券	600	7,614.00	0.00
286	300009	安科生物	500	7,450.00	0.00
287	601808	中海油服	500	7,180.00	0.00
288	600566	济川药业	400	7,160.00	0.00
289	600332	白云山	200	6,770.00	0.00
290	600803	新奥股份	400	6,604.00	0.00
291	601698	中国卫通	400	6,476.00	0.00
292	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
293	002384	东山精密	300	6,252.00	0.00
294	600029	南方航空	1,000	6,020.00	0.00
295	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
296	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
297	601021	春秋航空	100	5,690.00	0.00
298	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00

299	002705	新宝股份	200	5,250.00	0.00
300	600018	上港集团	1,100	5,247.00	0.00
301	002739	万达电影	300	4,737.00	0.00
302	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
303	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
304	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
305	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
306	000156	华数传媒	500	3,855.00	0.00
307	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
308	601838	成都银行	300	3,792.00	0.00
309	002946	新乳业	250	3,787.50	0.00
310	601919	中远海控	100	3,054.00	0.00
311	600258	首旅酒店	100	2,386.00	0.00
312	002653	海思科	100	2,152.00	0.00
313	603379	三美股份	100	1,871.00	0.00
314	601111	中国国航	200	1,556.00	0.00
315	002558	巨人网络	100	1,330.00	0.00
316	601699	潞安环能	100	1,181.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	13,490,048.69	25.63
2	600519	贵州茅台	11,575,547.00	22.00
3	600036	招商银行	10,800,075.00	20.52
4	000858	五粮液	10,325,270.36	19.62
5	601012	隆基股份	8,584,899.00	16.31
6	300059	东方财富	7,855,546.82	14.93
7	600276	恒瑞医药	7,624,974.04	14.49
8	601166	兴业银行	7,426,493.00	14.11
9	601888	中国中免	7,264,435.00	13.80
10	601601	中国太保	7,156,206.00	13.60
11	000001	平安银行	7,145,423.00	13.58
12	000333	美的集团	7,059,040.06	13.41

13	601899	紫金矿业	7,033,127.51	13.36
14	600900	长江电力	6,414,508.00	12.19
15	002594	比亚迪	6,078,385.05	11.55
16	000568	泸州老窖	6,028,444.60	11.46
17	000786	北新建材	5,801,653.60	11.02
18	601100	恒立液压	5,620,396.65	10.68
19	002415	海康威视	5,560,137.00	10.57
20	002714	牧原股份	5,511,367.51	10.47
21	603259	药明康德	5,303,300.20	10.08
22	300015	爱尔眼科	5,301,461.45	10.07
23	000100	TCL 科技	5,274,831.00	10.02
24	600809	山西汾酒	5,258,660.00	9.99
25	002271	东方雨虹	5,027,957.00	9.55
26	600309	万华化学	4,964,911.38	9.43
27	600031	三一重工	4,939,392.00	9.39
28	603799	华友钴业	4,922,741.12	9.35
29	300347	泰格医药	4,849,204.10	9.21
30	600926	杭州银行	4,846,241.00	9.21
31	603501	韦尔股份	4,795,952.00	9.11
32	000725	京东方 A	4,787,026.00	9.10
33	600919	江苏银行	4,781,926.50	9.09
34	300142	沃森生物	4,703,173.09	8.94
35	000661	长春高新	4,608,656.14	8.76
36	300033	同花顺	4,567,208.00	8.68
37	601336	新华保险	4,523,717.00	8.60
38	002142	宁波银行	4,522,184.00	8.59
39	300124	汇川技术	4,470,161.00	8.49
40	002493	荣盛石化	4,459,950.00	8.47
41	002304	洋河股份	4,364,273.00	8.29
42	300014	亿纬锂能	4,180,313.00	7.94
43	300122	智飞生物	4,174,509.00	7.93
44	600660	福耀玻璃	4,152,723.00	7.89
45	000651	格力电器	4,123,920.17	7.84
46	002027	分众传媒	4,101,218.00	7.79
47	300408	三环集团	4,015,858.00	7.63
48	002414	高德红外	3,995,596.00	7.59

49	002241	歌尔股份	3,992,725.00	7.59
50	601838	成都银行	3,992,711.37	7.59
51	601919	中远海控	3,955,006.00	7.52
52	600763	通策医疗	3,954,886.00	7.52
53	601328	交通银行	3,873,595.00	7.36
54	002001	新和成	3,793,459.64	7.21
55	000002	万科 A	3,757,190.00	7.14
56	603288	海天味业	3,755,582.00	7.14
57	300529	健帆生物	3,741,041.00	7.11
58	300628	亿联网络	3,706,210.00	7.04
59	603160	汇顶科技	3,684,122.36	7.00
60	603833	欧派家居	3,637,444.00	6.91
61	600009	上海机场	3,571,617.62	6.79
62	002821	凯莱英	3,552,868.00	6.75
63	600690	海尔智家	3,540,830.92	6.73
64	600436	片仔癀	3,509,648.00	6.67
65	601225	陕西煤业	3,505,552.00	6.66
66	002008	大族激光	3,503,282.00	6.66
67	002841	视源股份	3,501,502.00	6.65
68	002179	中航光电	3,481,174.00	6.61
69	600406	国电南瑞	3,426,922.00	6.51
70	000596	古井贡酒	3,426,731.16	6.51
71	600000	浦发银行	3,399,177.00	6.46
72	601600	中国铝业	3,379,247.00	6.42
73	601633	长城汽车	3,339,190.00	6.35
74	000069	华侨城 A	3,322,178.36	6.31
75	603899	晨光文具	3,293,403.00	6.26
76	002460	赣锋锂业	3,272,437.00	6.22
77	000012	南玻 A	3,223,394.00	6.13
78	603392	万泰生物	3,209,628.00	6.10
79	000063	中兴通讯	3,205,943.00	6.09
80	601211	国泰君安	3,194,727.00	6.07
81	002250	联化科技	3,176,419.00	6.04
82	002410	广联达	3,166,738.00	6.02
83	601398	工商银行	3,161,048.00	6.01
84	601577	长沙银行	3,143,046.00	5.97

85	600588	用友网络	3,136,364.40	5.96
86	601628	中国人寿	3,135,333.00	5.96
87	000656	金科股份	3,126,809.00	5.94
88	000538	云南白药	3,121,049.00	5.93
89	300433	蓝思科技	3,094,242.00	5.88
90	300136	信维通信	3,045,310.00	5.79
91	002508	老板电器	3,031,379.25	5.76
92	300482	万孚生物	3,006,115.00	5.71
93	600019	宝钢股份	2,998,082.00	5.70
94	002456	欧菲光	2,996,584.00	5.69
95	000963	华东医药	2,942,368.00	5.59
96	600600	青岛啤酒	2,934,005.00	5.58
97	002607	中公教育	2,933,629.05	5.57
98	688036	传音控股	2,932,225.00	5.57
99	002916	深南电路	2,925,175.15	5.56
100	600025	华能水电	2,916,988.49	5.54
101	601009	南京银行	2,906,568.00	5.52
102	601006	大秦铁路	2,901,192.00	5.51
103	600999	招商证券	2,892,999.00	5.50
104	002773	康弘药业	2,866,963.95	5.45
105	600570	恒生电子	2,853,611.00	5.42
106	601689	拓普集团	2,846,070.00	5.41
107	002511	中顺洁柔	2,833,156.07	5.38
108	002311	海大集团	2,822,715.57	5.36
109	600741	华域汽车	2,807,280.00	5.33
110	603355	莱克电气	2,800,529.00	5.32
111	601377	兴业证券	2,792,259.00	5.31
112	601877	正泰电器	2,787,152.00	5.30
113	000938	紫光股份	2,784,740.00	5.29
114	600549	厦门钨业	2,777,472.71	5.28
115	601390	中国中铁	2,763,100.00	5.25
116	600048	保利地产	2,759,719.00	5.24
117	603638	艾迪精密	2,756,806.00	5.24
118	601169	北京银行	2,748,511.00	5.22
119	600038	中直股份	2,740,740.00	5.21
120	000895	双汇发展	2,735,965.00	5.20

121	688008	澜起科技	2,724,977.74	5.18
122	600346	恒力石化	2,719,130.00	5.17
123	000960	锡业股份	2,716,361.00	5.16
124	000625	长安汽车	2,703,155.20	5.14
125	300413	芒果超媒	2,699,199.96	5.13
126	600703	三安光电	2,674,634.00	5.08
127	300146	汤臣倍健	2,666,499.00	5.07
128	600176	中国巨石	2,624,483.00	4.99
129	002050	三花智控	2,618,406.00	4.98
130	000783	长江证券	2,607,262.00	4.95
131	300274	阳光电源	2,594,353.00	4.93
132	603486	科沃斯	2,578,877.32	4.90
133	002352	顺丰控股	2,570,813.00	4.89
134	002709	天赐材料	2,564,607.18	4.87
135	600029	南方航空	2,545,792.00	4.84
136	600132	重庆啤酒	2,509,566.00	4.77
137	600216	浙江医药	2,509,291.00	4.77
138	000961	中南建设	2,509,179.00	4.77
139	002938	鹏鼎控股	2,503,747.00	4.76
140	600438	通威股份	2,499,854.00	4.75
141	600884	杉杉股份	2,492,797.08	4.74
142	002648	卫星石化	2,488,211.20	4.73
143	300009	安科生物	2,487,079.00	4.73
144	603377	东方时尚	2,480,144.00	4.71
145	600827	百联股份	2,479,939.00	4.71
146	002157	正邦科技	2,447,497.71	4.65
147	002032	苏泊尔	2,436,555.00	4.63
148	300144	宋城演艺	2,429,656.94	4.62
149	600392	盛和资源	2,423,331.00	4.60
150	600085	同仁堂	2,421,881.00	4.60
151	000898	鞍钢股份	2,412,268.00	4.58
152	603806	福斯特	2,369,267.00	4.50
153	601021	春秋航空	2,367,613.00	4.50
154	000708	中信特钢	2,362,226.00	4.49
155	601985	中国核电	2,348,268.00	4.46
156	603444	吉比特	2,347,161.00	4.46

157	600332	白云山	2,336,483.96	4.44
158	000338	潍柴动力	2,329,746.00	4.43
159	601231	环旭电子	2,318,110.87	4.40
160	002812	恩捷股份	2,305,195.00	4.38
161	600030	中信证券	2,304,004.00	4.38
162	002049	紫光国微	2,298,976.00	4.37
163	000776	广发证券	2,285,528.00	4.34
164	002736	国信证券	2,279,898.00	4.33
165	002092	中泰化学	2,272,339.00	4.32
166	002230	科大讯飞	2,264,789.00	4.30
167	600104	上汽集团	2,248,539.00	4.27
168	600383	金地集团	2,243,531.00	4.26
169	002384	东山精密	2,225,961.00	4.23
170	000768	中航西飞	2,218,493.00	4.22
171	600845	宝信软件	2,216,968.00	4.21
172	600068	葛洲坝	2,208,144.00	4.20
173	002600	领益智造	2,198,165.00	4.18
174	603986	兆易创新	2,177,736.56	4.14
175	601658	邮储银行	2,168,090.00	4.12
176	002007	华兰生物	2,154,741.01	4.09
177	300003	乐普医疗	2,139,389.00	4.07
178	601229	上海银行	2,138,394.00	4.06
179	002080	中材科技	2,136,938.00	4.06
180	600707	彩虹股份	2,123,458.00	4.03
181	603737	三棵树	2,119,654.00	4.03
182	300285	国瓷材料	2,105,396.50	4.00
183	601872	招商轮船	2,094,928.00	3.98
184	601688	华泰证券	2,067,705.00	3.93
185	600760	中航沈飞	2,062,748.00	3.92
186	000627	天茂集团	2,050,709.00	3.90
187	600887	伊利股份	2,048,114.00	3.89
188	002568	百润股份	2,033,619.00	3.86
189	601857	中国石油	2,025,046.00	3.85
190	600299	安迪苏	2,019,345.00	3.84
191	002124	天邦股份	2,017,309.00	3.83
192	601799	星宇股份	2,015,405.00	3.83

193	600585	海螺水泥	2,012,520.43	3.82
194	600141	兴发集团	1,999,793.00	3.80
195	600258	首旅酒店	1,998,393.65	3.80
196	300496	中科创达	1,995,425.00	3.79
197	300601	康泰生物	1,987,950.00	3.78
198	002371	北方华创	1,965,992.00	3.74
199	601668	中国建筑	1,954,320.00	3.71
200	688012	中微公司	1,949,503.37	3.70
201	601998	中信银行	1,947,813.00	3.70
202	002078	太阳纸业	1,939,299.00	3.69
203	601717	郑煤机	1,938,729.87	3.68
204	601077	渝农商行	1,937,977.00	3.68
205	600079	人福医药	1,913,779.00	3.64
206	600745	闻泰科技	1,909,261.00	3.63
207	002557	洽洽食品	1,904,832.00	3.62
208	600390	五矿资本	1,900,662.00	3.61
209	603345	安井食品	1,897,780.00	3.61
210	600754	锦江酒店	1,890,932.00	3.59
211	603260	合盛硅业	1,887,664.00	3.59
212	300595	欧普康视	1,883,051.00	3.58
213	000671	阳光城	1,877,882.00	3.57
214	603156	养元饮品	1,876,356.58	3.57
215	601108	财通证券	1,872,179.00	3.56
216	002475	立讯精密	1,868,749.00	3.55
217	600028	中国石化	1,862,745.00	3.54
218	000157	中联重科	1,854,095.00	3.52
219	600623	华谊集团	1,851,642.00	3.52
220	603885	吉祥航空	1,840,180.00	3.50
221	600584	长电科技	1,833,064.00	3.48
222	600886	国投电力	1,831,136.21	3.48
223	600315	上海家化	1,821,952.00	3.46
224	000807	云铝股份	1,811,516.31	3.44
225	600642	申能股份	1,798,084.00	3.42
226	600956	新天绿能	1,795,927.00	3.41
227	002791	坚朗五金	1,792,707.00	3.41
228	600177	雅戈尔	1,789,417.00	3.40

229	000723	美锦能源	1,788,320.00	3.40
230	002926	华西证券	1,773,434.00	3.37
231	600018	上港集团	1,772,854.00	3.37
232	600918	中泰证券	1,768,545.00	3.36
233	000066	中国长城	1,758,940.00	3.34
234	002129	中环股份	1,758,357.00	3.34
235	000876	新希望	1,751,549.00	3.33
236	603338	浙江鼎力	1,749,727.00	3.32
237	601233	桐昆股份	1,749,310.00	3.32
238	600061	国投资本	1,748,691.00	3.32
239	601186	中国铁建	1,736,225.00	3.30
240	603893	瑞芯微	1,731,411.00	3.29
241	601088	中国神华	1,717,224.00	3.26
242	600426	华鲁恒升	1,698,595.00	3.23
243	600329	中新药业	1,683,313.00	3.20
244	601117	中国化学	1,677,223.00	3.19
245	600546	山煤国际	1,659,997.00	3.15
246	002153	石基信息	1,657,812.20	3.15
247	600837	海通证券	1,651,547.00	3.14
248	002317	众生药业	1,645,281.00	3.13
249	601098	中南传媒	1,644,473.00	3.12
250	601238	广汽集团	1,637,445.00	3.11
251	000999	华润三九	1,636,979.00	3.11
252	600109	国金证券	1,635,714.00	3.11
253	000425	徐工机械	1,634,007.00	3.10
254	601818	光大银行	1,632,585.00	3.10
255	000860	顺鑫农业	1,624,548.00	3.09
256	000703	恒逸石化	1,613,404.00	3.07
257	002294	信立泰	1,609,573.00	3.06
258	603882	金域医学	1,607,117.00	3.05
259	600362	江西铜业	1,603,574.00	3.05
260	002074	国轩高科	1,595,480.00	3.03
261	600498	烽火通信	1,593,452.00	3.03
262	601816	京沪高铁	1,593,341.00	3.03
263	600704	物产中大	1,590,703.00	3.02
264	002925	盈趣科技	1,572,932.40	2.99

265	600271	航天信息	1,571,263.00	2.99
266	002146	荣盛发展	1,568,722.00	2.98
267	600655	豫园股份	1,555,693.00	2.96
268	601808	中海油服	1,542,163.00	2.93
269	002236	大华股份	1,536,170.00	2.92
270	600016	民生银行	1,535,750.00	2.92
271	300699	光威复材	1,533,718.00	2.91
272	300498	温氏股份	1,526,621.00	2.90
273	688099	晶晨股份	1,517,104.15	2.88
274	002223	鱼跃医疗	1,502,307.00	2.85
275	002028	思源电气	1,500,735.00	2.85
276	300012	华测检测	1,495,895.00	2.84
277	600535	天士力	1,476,799.00	2.81
278	600862	中航高科	1,476,563.00	2.81
279	000009	中国宝安	1,475,519.66	2.80
280	600039	四川路桥	1,474,502.68	2.80
281	600529	山东药玻	1,464,550.00	2.78
282	002705	新宝股份	1,453,187.00	2.76
283	600733	北汽蓝谷	1,440,656.00	2.74
284	002390	信邦制药	1,435,165.00	2.73
285	300088	长信科技	1,428,088.00	2.71
286	600115	中国东航	1,427,058.00	2.71
287	601878	浙商证券	1,413,015.00	2.69
288	600765	中航重机	1,411,702.00	2.68
289	002202	金风科技	1,410,473.00	2.68
290	600350	山东高速	1,410,459.00	2.68
291	002946	新乳业	1,407,675.02	2.67
292	002396	星网锐捷	1,403,157.00	2.67
293	300676	华大基因	1,402,754.00	2.67
294	601066	中信建投	1,390,685.29	2.64
295	600460	士兰微	1,380,578.00	2.62
296	002120	韵达股份	1,373,404.00	2.61
297	600872	中炬高新	1,368,785.00	2.60
298	000301	东方盛虹	1,363,919.00	2.59
299	002340	格林美	1,361,809.00	2.59
300	002299	圣农发展	1,354,658.40	2.57

301	600409	三友化工	1,351,937.00	2.57
302	600060	海信视像	1,349,737.00	2.56
303	000166	申万宏源	1,347,865.34	2.56
304	601933	永辉超市	1,333,042.00	2.53
305	002353	杰瑞股份	1,328,630.00	2.52
306	002563	森马服饰	1,328,565.00	2.52
307	000690	宝新能源	1,319,431.00	2.51
308	600188	兖州煤业	1,313,812.00	2.50
309	002797	第一创业	1,310,285.00	2.49
310	000717	韶钢松山	1,306,568.00	2.48
311	601636	旗滨集团	1,302,416.00	2.47
312	000636	风华高科	1,299,020.00	2.47
313	600489	中金黄金	1,289,997.00	2.45
314	600161	天坛生物	1,285,728.00	2.44
315	600201	生物股份	1,284,166.00	2.44
316	603816	顾家家居	1,278,278.34	2.43
317	002625	光启技术	1,277,847.00	2.43
318	002595	豪迈科技	1,276,757.15	2.43
319	002985	北摩高科	1,274,925.00	2.42
320	600487	亨通光电	1,274,860.00	2.42
321	002138	顺络电子	1,272,596.52	2.42
322	601360	三六零	1,271,976.79	2.42
323	000887	中鼎股份	1,263,334.00	2.40
324	300376	易事特	1,259,339.00	2.39
325	600958	东方证券	1,256,812.00	2.39
326	603198	迎驾贡酒	1,253,033.00	2.38
327	603658	安图生物	1,250,262.00	2.38
328	600637	东方明珠	1,240,022.90	2.36
329	601236	红塔证券	1,233,161.00	2.34
330	603983	丸美股份	1,231,803.00	2.34
331	601198	东兴证券	1,229,912.00	2.34
332	600699	均胜电子	1,227,640.00	2.33
333	600064	南京高科	1,225,751.00	2.33
334	001914	招商积余	1,223,779.80	2.33
335	300115	长盈精密	1,223,728.00	2.33
336	600985	淮北矿业	1,223,625.00	2.33

337	600729	重庆百货	1,222,756.00	2.32
338	002156	通富微电	1,214,333.00	2.31
339	600820	隧道股份	1,212,367.00	2.30
340	603568	伟明环保	1,209,236.58	2.30
341	603225	新凤鸣	1,208,154.00	2.30
342	600998	九州通	1,205,607.00	2.29
343	002252	上海莱士	1,203,822.00	2.29
344	300058	蓝色光标	1,197,752.00	2.28
345	002422	科伦药业	1,196,934.00	2.27
346	002945	华林证券	1,189,463.00	2.26
347	600737	中粮糖业	1,187,946.00	2.26
348	601598	中国外运	1,181,878.00	2.25
349	002368	太极股份	1,179,750.05	2.24
350	600120	浙江东方	1,179,024.70	2.24
351	601698	中国卫通	1,174,651.00	2.23
352	002624	完美世界	1,170,216.00	2.22
353	001979	招商蛇口	1,168,067.00	2.22
354	002385	大北农	1,166,895.00	2.22
355	002429	兆驰股份	1,166,332.00	2.22
356	688088	虹软科技	1,150,773.40	2.19
357	002212	天融信	1,138,020.00	2.16
358	000623	吉林敖东	1,135,639.00	2.16
359	688009	中国通号	1,134,142.44	2.16
360	600500	中化国际	1,131,577.00	2.15
361	300001	特锐德	1,121,245.00	2.13
362	000967	盈峰环境	1,115,991.00	2.12
363	002670	国盛金控	1,111,150.00	2.11
364	002602	世纪华通	1,106,871.00	2.10
365	601288	农业银行	1,100,905.00	2.09
366	603708	家家悦	1,100,784.00	2.09
367	002203	海亮股份	1,088,289.00	2.07
368	000970	中科三环	1,067,560.00	2.03
369	600522	中天科技	1,066,326.00	2.03
370	002690	美亚光电	1,065,097.00	2.02
371	002603	以岭药业	1,063,094.00	2.02
372	300296	利亚德	1,056,128.00	2.01

373	002653	海思科	1,054,340.50	2.00
-----	--------	-----	--------------	------

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	601318	中国平安	12,541,678.00	23.83
2	600036	招商银行	10,999,626.10	20.90
3	600519	贵州茅台	10,141,237.00	19.27
4	000858	五粮液	9,193,446.88	17.47
5	601012	隆基股份	8,470,570.00	16.10
6	600276	恒瑞医药	7,977,461.80	15.16
7	601166	兴业银行	7,839,149.36	14.90
8	000333	美的集团	6,847,279.90	13.01
9	601899	紫金矿业	6,652,386.00	12.64
10	601888	中国中免	6,621,510.00	12.58
11	000001	平安银行	6,581,034.00	12.51
12	002594	比亚迪	6,528,376.00	12.41
13	601601	中国太保	6,413,739.00	12.19
14	002415	海康威视	6,389,525.00	12.14
15	600900	长江电力	6,331,539.47	12.03
16	600809	山西汾酒	6,295,226.00	11.96
17	300059	东方财富	6,080,530.00	11.55
18	000786	北新建材	5,797,709.00	11.02
19	600309	万华化学	5,502,090.00	10.46
20	000568	泸州老窖	5,211,253.00	9.90
21	601100	恒立液压	5,139,301.51	9.77
22	002271	东方雨虹	5,123,474.00	9.74
23	300142	沃森生物	5,074,169.00	9.64
24	002142	宁波银行	4,894,614.51	9.30
25	002714	牧原股份	4,877,082.40	9.27
26	000725	京东方 A	4,651,960.00	8.84
27	002493	荣盛石化	4,634,505.91	8.81
28	603501	韦尔股份	4,628,851.00	8.80
29	000661	长春高新	4,556,416.00	8.66
30	300347	泰格医药	4,524,173.00	8.60
31	603259	药明康德	4,445,789.00	8.45

32	300033	同花顺	4,380,981.00	8.32
33	000100	TCL 科技	4,238,986.00	8.05
34	002001	新和成	4,219,644.00	8.02
35	600926	杭州银行	4,159,741.33	7.90
36	603799	华友钴业	4,144,903.32	7.88
37	601336	新华保险	4,143,888.00	7.87
38	300408	三环集团	4,136,740.00	7.86
39	300124	汇川技术	4,132,611.04	7.85
40	603288	海天味业	4,108,773.40	7.81
41	601838	成都银行	4,082,000.00	7.76
42	002008	大族激光	4,010,142.00	7.62
43	000651	格力电器	4,005,650.00	7.61
44	002027	分众传媒	4,000,568.00	7.60
45	601919	中远海控	3,976,087.00	7.56
46	600000	浦发银行	3,881,344.72	7.38
47	600436	片仔癀	3,849,176.00	7.31
48	600031	三一重工	3,824,346.00	7.27
49	002841	视源股份	3,756,205.00	7.14
50	600660	福耀玻璃	3,745,561.00	7.12
51	600919	江苏银行	3,711,335.00	7.05
52	300015	爱尔眼科	3,689,108.00	7.01
53	600009	上海机场	3,652,146.00	6.94
54	600406	国电南瑞	3,497,747.34	6.65
55	002414	高德红外	3,452,050.94	6.56
56	000069	华侨城 A	3,444,312.00	6.54
57	603899	晨光文具	3,422,524.00	6.50
58	000596	古井贡酒	3,380,846.85	6.42
59	300529	健帆生物	3,369,104.00	6.40
60	603392	万泰生物	3,368,992.20	6.40
61	601633	长城汽车	3,367,913.00	6.40
62	600690	海尔智家	3,359,263.43	6.38
63	600763	通策医疗	3,358,864.10	6.38
64	000002	万科 A	3,320,237.00	6.31
65	601398	工商银行	3,298,557.00	6.27
66	603486	科沃斯	3,296,595.00	6.26
67	300014	亿纬锂能	3,251,744.00	6.18
68	600600	青岛啤酒	3,222,329.00	6.12
69	688036	传音控股	3,197,261.01	6.08

70	601577	长沙银行	3,187,737.97	6.06
71	601211	国泰君安	3,128,452.00	5.94
72	300122	智飞生物	3,124,838.00	5.94
73	601169	北京银行	3,106,123.00	5.90
74	600570	恒生电子	3,094,703.90	5.88
75	600588	用友网络	3,086,286.00	5.86
76	002410	广联达	3,085,374.50	5.86
77	002304	洋河股份	3,075,602.00	5.84
78	002508	老板电器	3,021,168.00	5.74
79	300482	万孚生物	3,016,691.00	5.73
80	000538	云南白药	2,951,799.13	5.61
81	002916	深南电路	2,928,674.02	5.57
82	601390	中国中铁	2,922,259.00	5.55
83	300628	亿联网络	2,904,954.37	5.52
84	002460	赣锋锂业	2,892,579.00	5.50
85	002607	中公教育	2,892,087.00	5.50
86	300413	芒果超媒	2,873,695.72	5.46
87	600025	华能水电	2,837,279.00	5.39
88	601377	兴业证券	2,835,812.00	5.39
89	002773	康弘药业	2,834,822.60	5.39
90	000963	华东医药	2,828,084.43	5.37
91	600132	重庆啤酒	2,815,976.00	5.35
92	000960	锡业股份	2,807,846.00	5.34
93	600346	恒力石化	2,793,503.00	5.31
94	002709	天赐材料	2,777,552.84	5.28
95	600029	南方航空	2,772,874.00	5.27
96	603833	欧派家居	2,767,289.40	5.26
97	000961	中南建设	2,764,840.00	5.25
98	002352	顺丰控股	2,763,773.94	5.25
99	601877	正泰电器	2,731,925.00	5.19
100	000656	金科股份	2,725,871.00	5.18
101	002311	海大集团	2,711,884.58	5.15
102	600703	三安光电	2,695,688.01	5.12
103	002241	歌尔股份	2,680,997.88	5.09
104	600048	保利地产	2,677,000.00	5.09
105	000895	双汇发展	2,671,640.00	5.08
106	000625	长安汽车	2,667,903.00	5.07
107	002821	凯莱英	2,644,549.00	5.03

108	600104	上汽集团	2,644,056.14	5.02
109	600176	中国巨石	2,643,880.00	5.02
110	002179	中航光电	2,642,748.00	5.02
111	601689	拓普集团	2,638,016.00	5.01
112	688008	澜起科技	2,636,200.99	5.01
113	601600	中国铝业	2,613,358.00	4.97
114	600030	中信证券	2,585,970.00	4.91
115	600438	通威股份	2,575,248.00	4.89
116	600999	招商证券	2,572,250.00	4.89
117	601009	南京银行	2,560,649.00	4.87
118	600741	华域汽车	2,554,159.95	4.85
119	002157	正邦科技	2,528,038.00	4.80
120	000783	长江证券	2,484,884.00	4.72
121	600085	同仁堂	2,480,817.00	4.71
122	000898	鞍钢股份	2,475,182.01	4.70
123	300274	阳光电源	2,468,911.00	4.69
124	300009	安科生物	2,463,902.60	4.68
125	601328	交通银行	2,457,746.00	4.67
126	600216	浙江医药	2,453,650.00	4.66
127	000938	紫光股份	2,451,157.00	4.66
128	603160	汇顶科技	2,445,366.00	4.65
129	601021	春秋航空	2,444,410.00	4.64
130	601985	中国核电	2,435,177.00	4.63
131	002938	鹏鼎控股	2,434,253.00	4.63
132	000708	中信特钢	2,409,287.00	4.58
133	601225	陕西煤业	2,398,512.00	4.56
134	601229	上海银行	2,397,782.00	4.56
135	600887	伊利股份	2,386,494.40	4.53
136	002092	中泰化学	2,382,857.85	4.53
137	002475	立讯精密	2,380,247.00	4.52
138	002812	恩捷股份	2,372,455.00	4.51
139	002032	苏泊尔	2,357,983.00	4.48
140	000338	潍柴动力	2,353,323.00	4.47
141	600585	海螺水泥	2,338,370.00	4.44
142	300144	宋城演艺	2,326,691.00	4.42
143	600332	白云山	2,323,187.00	4.41
144	603737	三棵树	2,320,191.20	4.41
145	600845	宝信软件	2,309,797.70	4.39

146	300136	信维通信	2,305,047.00	4.38
147	601628	中国人寿	2,292,231.00	4.36
148	603638	艾迪精密	2,285,037.00	4.34
149	601658	邮储银行	2,282,878.00	4.34
150	600827	百联股份	2,279,082.00	4.33
151	000776	广发证券	2,269,724.00	4.31
152	000157	中联重科	2,265,521.80	4.30
153	601231	环旭电子	2,262,842.34	4.30
154	002384	东山精密	2,259,819.00	4.29
155	600383	金地集团	2,257,736.70	4.29
156	300285	国瓷材料	2,255,516.64	4.29
157	300496	中科创达	2,243,804.00	4.26
158	002250	联化科技	2,215,464.00	4.21
159	002456	欧菲光	2,196,630.00	4.17
160	603986	兆易创新	2,192,668.89	4.17
161	002736	国信证券	2,183,430.00	4.15
162	002568	百润股份	2,174,795.20	4.13
163	002049	紫光国微	2,142,354.45	4.07
164	600549	厦门钨业	2,141,588.40	4.07
165	000012	南玻 A	2,140,376.45	4.07
166	000063	中兴通讯	2,139,337.00	4.07
167	601799	星宇股份	2,138,267.00	4.06
168	300003	乐普医疗	2,127,746.00	4.04
169	002007	华兰生物	2,097,764.00	3.99
170	600141	兴发集团	2,090,821.76	3.97
171	601006	大秦铁路	2,066,484.44	3.93
172	601688	华泰证券	2,062,136.00	3.92
173	601186	中国铁建	2,062,083.00	3.92
174	603260	合盛硅业	2,027,441.00	3.85
175	600258	首旅酒店	2,021,889.90	3.84
176	600392	盛和资源	2,020,244.03	3.84
177	603355	莱克电气	2,020,002.00	3.84
178	000627	天茂集团	2,019,911.00	3.84
179	601857	中国石油	2,019,849.00	3.84
180	600315	上海家化	2,017,327.00	3.83
181	600019	宝钢股份	2,006,338.00	3.81
182	600760	中航沈飞	1,993,916.00	3.79
183	600109	国金证券	1,990,411.00	3.78

184	002124	天邦股份	1,978,362.00	3.76
185	601818	光大银行	1,973,390.00	3.75
186	600299	安迪苏	1,969,411.80	3.74
187	002371	北方华创	1,969,225.00	3.74
188	300601	康泰生物	1,965,652.84	3.74
189	688012	中微公司	1,951,973.61	3.71
190	601668	中国建筑	1,941,437.00	3.69
191	601117	中国化学	1,937,020.00	3.68
192	002600	领益智造	1,936,452.00	3.68
193	603893	瑞芯微	1,920,935.00	3.65
194	002791	坚朗五金	1,920,211.00	3.65
195	601077	渝农商行	1,919,270.00	3.65
196	300498	温氏股份	1,902,550.00	3.62
197	300433	蓝思科技	1,893,611.00	3.60
198	600028	中国石化	1,868,816.00	3.55
199	002511	中顺洁柔	1,857,884.00	3.53
200	600271	航天信息	1,857,168.00	3.53
201	600704	物产中大	1,838,558.00	3.49
202	000807	云铝股份	1,833,234.00	3.48
203	601233	桐昆股份	1,826,613.00	3.47
204	002129	中环股份	1,825,535.93	3.47
205	600079	人福医药	1,824,025.00	3.47
206	603156	养元饮品	1,822,357.00	3.46
207	601108	财通证券	1,817,035.00	3.45
208	600038	中直股份	1,813,117.24	3.45
209	600837	海通证券	1,798,108.00	3.42
210	600956	新天绿能	1,793,802.00	3.41
211	600584	长电科技	1,792,810.00	3.41
212	603345	安井食品	1,792,017.00	3.41
213	002648	卫星石化	1,789,473.00	3.40
214	600390	五矿资本	1,789,154.00	3.40
215	600745	闻泰科技	1,772,515.00	3.37
216	600329	中新药业	1,767,843.00	3.36
217	600018	上港集团	1,760,956.00	3.35
218	000703	恒逸石化	1,725,995.00	3.28
219	000876	新希望	1,712,183.00	3.25
220	002926	华西证券	1,707,534.00	3.24
221	002317	众生药业	1,683,817.00	3.20

222	000671	阳光城	1,678,449.50	3.19
223	601998	中信银行	1,665,395.00	3.16
224	603377	东方时尚	1,656,129.00	3.15
225	600115	中国东航	1,649,661.00	3.13
226	601066	中信建投	1,648,962.00	3.13
227	601088	中国神华	1,642,766.00	3.12
228	000066	中国长城	1,642,215.00	3.12
229	002078	太阳纸业	1,637,180.00	3.11
230	000723	美锦能源	1,635,450.00	3.11
231	002236	大华股份	1,624,439.00	3.09
232	601238	广汽集团	1,621,954.33	3.08
233	600546	山煤国际	1,621,609.00	3.08
234	603882	金域医学	1,611,756.00	3.06
235	601808	中海油服	1,604,753.46	3.05
236	300699	光威复材	1,597,367.00	3.04
237	600177	雅戈尔	1,595,167.03	3.03
238	600060	海信视像	1,588,741.00	3.02
239	600707	彩虹股份	1,588,136.00	3.02
240	002223	鱼跃医疗	1,578,204.00	3.00
241	600068	葛洲坝	1,577,962.00	3.00
242	601816	京沪高铁	1,574,000.00	2.99
243	300012	华测检测	1,573,089.00	2.99
244	000009	中国宝安	1,569,866.92	2.98
245	600918	中泰证券	1,569,425.00	2.98
246	600884	杉杉股份	1,563,864.00	2.97
247	600061	国投资本	1,545,098.00	2.94
248	600498	烽火通信	1,538,787.00	2.92
249	002146	荣盛发展	1,535,749.00	2.92
250	300595	欧普康视	1,530,000.00	2.91
251	601872	招商轮船	1,525,124.90	2.90
252	002050	三花智控	1,520,781.31	2.89
253	600699	均胜电子	1,517,766.00	2.88
254	002028	思源电气	1,510,624.00	2.87
255	300146	汤臣倍健	1,508,201.00	2.87
256	600535	天士力	1,498,549.60	2.85
257	600765	中航重机	1,498,392.00	2.85
258	000425	徐工机械	1,484,225.00	2.82
259	603806	福斯特	1,480,223.00	2.81

260	603885	吉祥航空	1,466,472.00	2.79
261	600460	士兰微	1,466,453.00	2.79
262	002557	洽洽食品	1,460,019.34	2.77
263	600016	民生银行	1,458,199.00	2.77
264	000860	顺鑫农业	1,452,543.00	2.76
265	300376	易事特	1,429,176.00	2.72
266	600733	北汽蓝谷	1,404,741.00	2.67
267	002202	金风科技	1,396,474.00	2.65
268	002705	新宝股份	1,395,989.00	2.65
269	600350	山东高速	1,392,676.00	2.65
270	688099	晶晨股份	1,392,296.90	2.65
271	600362	江西铜业	1,389,789.00	2.64
272	000301	东方盛虹	1,389,728.00	2.64
273	600998	九州通	1,384,554.00	2.63
274	600886	国投电力	1,384,541.00	2.63
275	002563	森马服饰	1,374,105.40	2.61
276	601878	浙商证券	1,373,194.00	2.61
277	300676	华大基因	1,367,902.00	2.60
278	603198	迎驾贡酒	1,364,493.00	2.59
279	002797	第一创业	1,363,541.00	2.59
280	000768	中航西飞	1,348,792.00	2.56
281	000166	申万宏源	1,345,388.00	2.56
282	600039	四川路桥	1,345,078.00	2.56
283	002946	新乳业	1,344,323.50	2.55
284	002120	韵达股份	1,337,708.00	2.54
285	002624	完美世界	1,333,840.00	2.53
286	600655	豫园股份	1,317,819.00	2.50
287	000887	中鼎股份	1,312,526.00	2.49
288	002985	北摩高科	1,308,255.90	2.49
289	600161	天坛生物	1,305,695.00	2.48
290	600201	生物股份	1,305,132.97	2.48
291	600489	中金黄金	1,301,356.00	2.47
292	600872	中炬高新	1,293,229.00	2.46
293	600409	三友化工	1,293,160.00	2.46
294	002156	通富微电	1,278,807.00	2.43
295	000690	宝新能源	1,270,107.00	2.41
296	002138	顺络电子	1,268,520.00	2.41
297	000999	华润三九	1,256,392.00	2.39

298	601098	中南传媒	1,256,265.00	2.39
299	601598	中国外运	1,253,550.00	2.38
300	600985	淮北矿业	1,245,559.00	2.37
301	603983	丸美股份	1,240,441.00	2.36
302	600729	重庆百货	1,239,605.00	2.36
303	688088	虹软科技	1,221,324.59	2.32
304	600487	亨通光电	1,221,041.00	2.32
305	603816	顾家家居	1,219,020.00	2.32
306	002945	华林证券	1,213,288.00	2.31
307	601236	红塔证券	1,211,763.00	2.30
308	002925	盈趣科技	1,211,288.00	2.30
309	603444	吉比特	1,208,653.00	2.30
310	600958	东方证券	1,204,395.00	2.29
311	600500	中化国际	1,203,831.00	2.29
312	600637	东方明珠	1,197,466.00	2.28
313	300058	蓝色光标	1,187,341.00	2.26
314	300115	长盈精密	1,182,370.00	2.25
315	002252	上海莱士	1,179,087.00	2.24
316	600820	隧道股份	1,177,257.00	2.24
317	601198	东兴证券	1,172,731.00	2.23
318	601360	三六零	1,171,819.04	2.23
319	603338	浙江鼎力	1,167,527.00	2.22
320	002422	科伦药业	1,159,606.38	2.20
321	000636	风华高科	1,155,429.00	2.20
322	002670	国盛金控	1,146,500.00	2.18
323	000983	山西焦煤	1,140,211.00	2.17
324	002385	大北农	1,140,176.00	2.17
325	001979	招商蛇口	1,135,141.00	2.16
326	000623	吉林敖东	1,127,908.00	2.14
327	600155	华创阳安	1,119,509.18	2.13
328	002294	信立泰	1,118,859.00	2.13
329	601881	中国银河	1,114,979.00	2.12
330	601933	永辉超市	1,103,112.00	2.10
331	601698	中国卫通	1,102,187.00	2.09
332	600642	申能股份	1,099,848.00	2.09
333	688009	中国通号	1,098,643.35	2.09
334	002690	美亚光电	1,097,343.00	2.09
335	601288	农业银行	1,075,047.00	2.04

336	600737	中粮糖业	1,074,479.00	2.04
337	603708	家家悦	1,068,864.00	2.03
338	002080	中材科技	1,061,961.00	2.02
339	603568	伟明环保	1,058,579.00	2.01
340	600171	上海贝岭	1,056,395.00	2.01
341	000717	韶钢松山	1,054,663.00	2.00
342	001914	招商积余	1,052,992.00	2.00

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	1,147,815,767.35
卖出股票收入（成交）总额	1,066,119,780.84

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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）	5,600.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,600.00	0.00

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	123117	健帆转债	56	5,600.00	0.00

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

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

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

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
IH2109	上证 50 期货 2109 合约	12	12,456,720.00	-236,713.85	-
IC2107	中证 500 期 货 2107 合约	-47	-63,611,680.00	-1,319,840.00	-
IF2107	沪深 300 期 货 2107 合约	-43	-66,966,480.00	368,226.38	-
公允价值变动总额合计（元）					-1,188,327.47
股指期货投资本期收益（元）					-1,835,311.36
股指期货投资本期公允价值变动（元）					120,855.39

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金利用股指期货与股票现货组合进行对冲，并通过量化模型，寻找最优的股指期货对冲工具构建整个组合，从而剥离现货组合的系统性风险，仅保留现货组合相对于期货组合的超额收益，力争在牛市和熊市中均为投资者获取稳健的正向收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 130,834,494.40 元，占基金资产净值的比例为 77.09%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 130,578,160.00 元，占基金资产净值的比例为 76.94%，空头合约市值占股票资产的比例为 99.80%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 4,868,959.08 元，公允价值变动损益为 -272,533.16 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除交通银行股份有限公司（交通银行）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2021 年 1 月 15 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局发布行政处罚决定书（沪银保监罚决字〔2021〕10 号），对交通银行股份有限公司代理销售业务管理严重违反审慎经营规则的违法违规事实进行处罚。

本基金采用量化对冲的投资策略，由于有套保的限制很大一部分仓位集中于沪深 300 成分股内，而银行业在沪深 300 指数中占很大权重，所以不可避免的选入银行，同时我们认为交通银行（601328）所受处罚并未对其投资价值产生实质性的负面影响，所以依然按照模型选股的结果而没有进行专门的减仓操作。

7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	17,027,080.90
2	应收证券清算款	5,310,235.39
3	应收股利	-
4	应收利息	1,334.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,338,651.02

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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

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
972	153,932.54	124,063,322.44	82.92%	25,559,106.39	17.08%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	59,039.59	0.0395%

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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金已成立满三年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年4月21日）基金份额总额	709,513,460.11
本报告期期初基金份额总额	47,198,796.37
本报告期基金总申购份额	162,395,340.12
减：本报告期基金总赎回份额	59,971,707.66
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	149,622,428.83

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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) 基金管理人的重大人事变动情况

2021 年 3 月 5 日，本基金管理人发布公告，赵璧先生自 2021 年 3 月 3 日担任公司督察长；李虹女士同日起不再担任公司督察长。同日，本基金管理人发布公告，公司股东中金公司于 2021 年 3 月作出股东决定，赵璧先生不再担任公司第三届董事会董事，任命邱延冰先生担任公司第三届董事会董事。

2021 年 6 月 2 日，本基金管理人发布公告，杨毓莹女士自 2021 年 6 月 1 日起担任公司独立董事；王元先生同日起不再担任公司独立董事。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门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、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	2	604,727,745.83	27.36%	442,240.49	27.36%	-
东兴证券	2	499,260,463.76	22.59%	365,109.34	22.59%	-
银河证券	2	422,512,319.25	19.12%	308,982.18	19.12%	-
东方财富证券	2	336,826,767.99	15.24%	246,322.57	15.24%	-

安信证券	2	158,404,188.66	7.17%	115,842.31	7.17%	-
东方证券	2	116,327,286.38	5.26%	85,070.39	5.26%	-
申万宏源证券	2	39,621,913.59	1.79%	28,975.80	1.79%	-
华泰证券	2	18,180,716.56	0.82%	13,295.78	0.82%	-
太平洋证券	2	14,039,979.00	0.64%	10,267.16	0.64%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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
平安证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	6,899,310.00	38.73%	200,500,000.00	39.59%	-	-
银河证券	7,015.40	0.04%	13,400,000.00	2.65%	-	-

东方财富证券	8,097,070.00	45.46%	268,300,000.00	52.98%	-	-
安信证券	10,188.00	0.06%	-	-	-	-
东方证券	-	-	11,500,000.00	2.27%	-	-
申万宏源证券	399,600.00	2.24%	8,700,000.00	1.72%	-	-
华泰证券	2,399,760.00	13.47%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	4,000,000.00	0.79%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

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	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021年1月5日
2	中金基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证监会规定媒介	2021年1月16日
3	中金基金管理有限公司旗下基金2020年第4季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021年1月22日
4	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2021年1月22日
5	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021年2月24日
6	中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2021年3月5日
7	中金基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2021年3月5日
8	中金基金管理有限公司关于设立厦门分公司的公告	中国证监会规定媒介	2021年3月6日
9	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021年3月6日
10	关于中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放	中国证监会规定媒介	2021年3月24日

	申购、赎回及转换业务的公告		
11	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 24 日
12	中金基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 31 日
13	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2020 年年度报告及摘要	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 31 日
14	中金基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 22 日
15	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 22 日
16	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 6 日
17	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 6 日
18	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 18 日
19	关于不法分子假冒“中金基金”名义进行诈骗的风险提示	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 26 日
20	关于不法分子假冒“中金基金”名义虚构“中金基金静态战略投资项目”进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 27 日
21	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 29 日
22	中金基金管理有限公司关于公司独立董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 2 日
23	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 12 日
24	关于中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 25 日
25	中金绝对收益策略定期开放混合	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 25 日

	型发起式证券投资基金关于运用 股指期货对冲的投资策略执行情 况公告		
--	---	--	--

§ 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	2021 年 01 月 11 日-2021 年 06 月 30 日	0.00	71,111,111.11	0.00	71,111,111.11	47.53%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形。如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，从而可能面临基金合同终止等基金合同中约定的情形。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 6、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 8、本报告期内在指定媒介上披露的有关本基金的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人和/或基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：010-63211122 400-868-1166

传真：010-66159121

中金基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日