

# 中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金 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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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、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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	55

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中金瑞祥	
基金主代码	006279	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 13 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,658,174.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中金瑞祥 A	中金瑞祥 C
下属分级基金的交易代码:	006279	006280
报告期末下属分级基金的份额总额	3,481,867.03 份	176,307.22 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	（一）资产配置策略，基于宏观基本面研究，结合对各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等因素的评估确定各大类资产的中长期基本配置比例并进行调整。（二）普通债券投资策略，包括债券类属配置策略、期限结构配置策略、利率策略、信用债券投资策略、骑乘策略、息差策略。（三）中小企业私募债券的投资策略，重点分析信用风险及流动性风险，选择风险与收益相匹配的品种进行配置。（四）可转换债券投资策略，从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注。（五）可交换债券投资策略，选择具有较高投资价值的可交换债券进行投资，积极参与可交换债券新券的申购。（六）资产支持证券投资策略，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，制定周密的投资策略。（七）国债期货投资策略，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。（八）股票投资策略，主要采纳两种选股投资思路，一是纯粹的自下而上的个股精选策略，二是运用量化模型自上而下的选股策略。（九）股指期货投资策略，通过对证券市场和期货市场运行趋势的定量化研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，并与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。（十）权证投资策略，通过对权证标的证券基本面的研究，辅助运用权证定价模型寻求其合理估值水平。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合财富(总值)指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵璧	李帅帅
	联系电话	010-63211122	0755-25878287
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95511-3
传真		010-66159121	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路5047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	深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼
邮政编码		100004	518001
法定代表人		胡长生	谢永林

### 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	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
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

基金级别	中金瑞祥 A	中金瑞祥 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	2,301,664.32	29,239.54
本期利润	1,028,257.66	14,848.84
加权平均基金份额本期利润	0.2876	0.0828
本期加权平均净值利润率	5.69%	6.25%
本期基金份额净值增长率	5.35%	5.30%
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	14,746,489.16	65,477.53
期末可供分配基金份额利润	4.2352	0.3714
期末基金资产净值	18,228,356.19	241,784.75
期末基金份额净值	5.2352	1.3714
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	423.52%	37.14%

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金瑞祥 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.74%	0.73%	-0.90%	0.40%	1.64%	0.33%
过去三个月	8.03%	0.78%	2.42%	0.49%	5.61%	0.29%
过去六个月	5.35%	1.13%	1.44%	0.66%	3.91%	0.47%
过去一年	24.81%	1.04%	14.18%	0.66%	10.63%	0.38%
自基金合同生效起至今	423.52%	10.01%	36.87%	0.65%	386.65%	9.36%

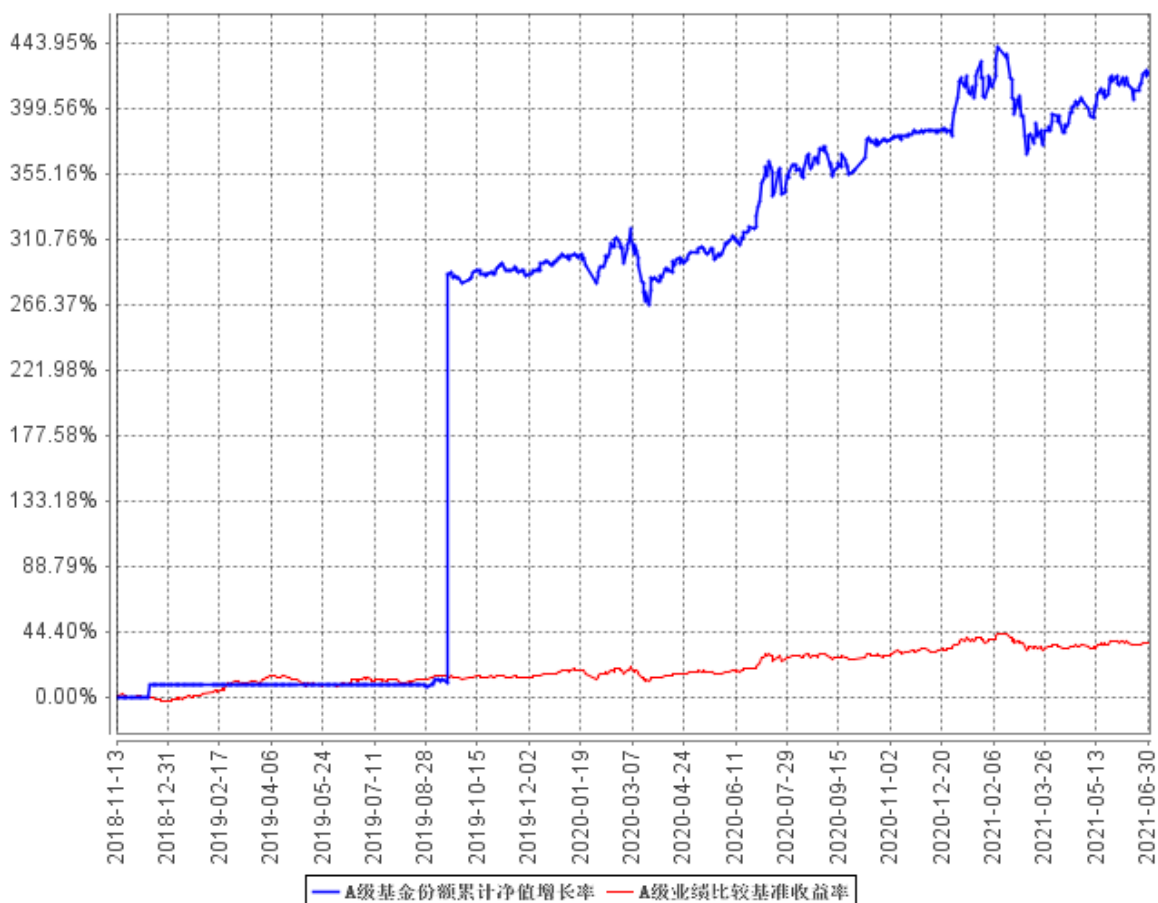
中金瑞祥 C



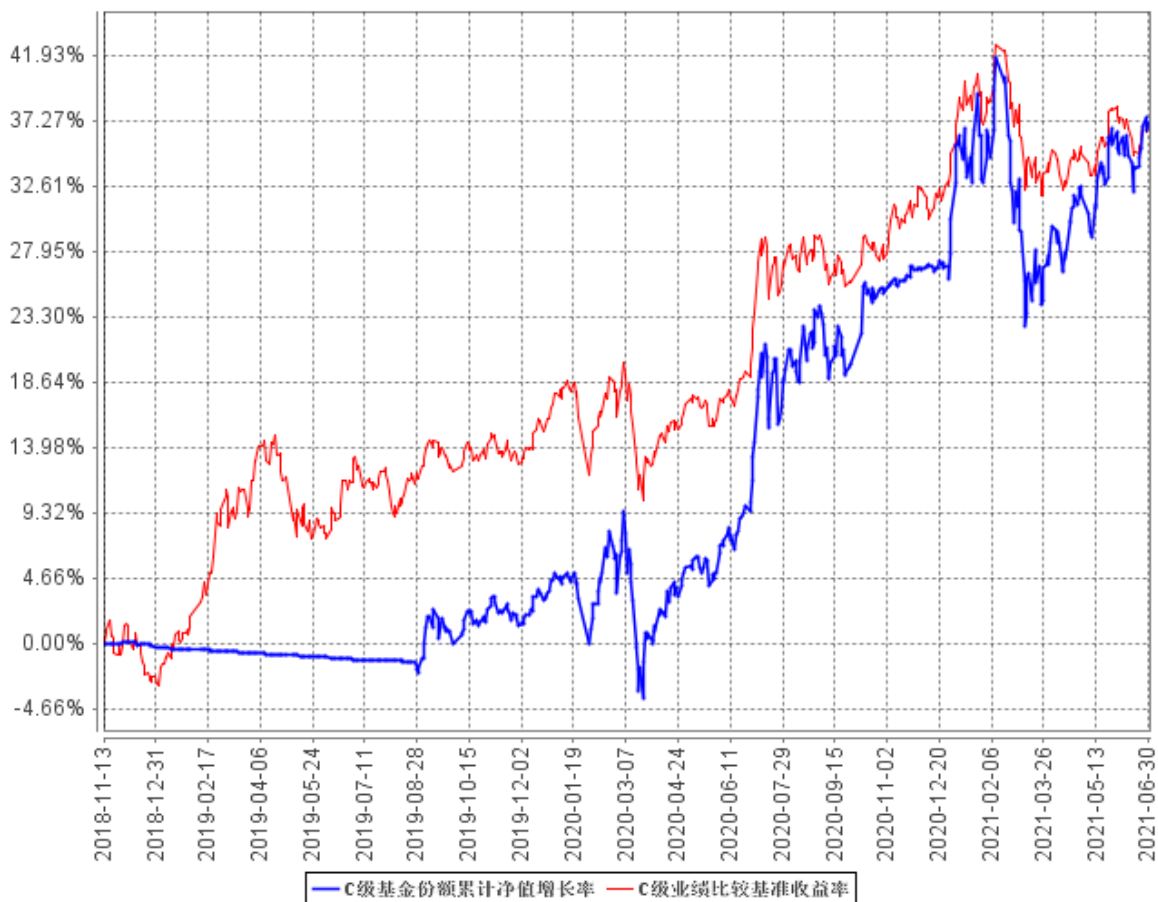
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.73%	0.73%	-0.90%	0.40%	1.63%	0.33%
过去三个月	8.00%	0.78%	2.42%	0.49%	5.58%	0.29%
过去六个月	5.30%	1.13%	1.44%	0.66%	3.86%	0.47%
过去一年	24.64%	1.04%	14.18%	0.66%	10.46%	0.38%
自基金合同生效起至今	37.14%	0.79%	36.87%	0.65%	0.27%	0.14%

### 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

A级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



C级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	2018 年 11 月 13 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。

- 1、本基金基金经理的任职日期为基金合同生效日。
- 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》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本基金采用量化与基本面相结合的投资策略。通过量化指标建模，对基金的仓位进行调整，对股票初步筛选出指标较好的候选股票；再使用主动投资策略，通过基金经理与研究员对宏观经济研究，行业分析，公司估值和基本面的分析，以及公司上下游产业链情况，经营情况，盈利能力等的分析进行股票的筛选，构建股票组合。接下来，我们会密切监控市场变化以及策略表现，积极应对，在控制风险的同时尽可能获得更好的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金瑞祥 A 基金份额净值为 5.2352 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.35%；截至本报告期末中金瑞祥 C 基金份额净值为 1.3714 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.30%；同期业绩比较基准收益率为 1.44%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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验。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

本报告期内，本基金自 2021 年 1 月 4 日至 2021 年 6 月 30 日存在连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形；本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

## § 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，平安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。

### 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，本托管人复核的财务指标、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：中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,254,128.83	1,391,541.04
结算备付金		341,717.17	582,380.95
存出保证金		25,159.04	118,723.05
交易性金融资产	6.4.7.2	14,749,131.35	18,363,005.66
其中：股票投资		14,747,731.35	17,363,105.66
基金投资		-	-
债券投资		1,400.00	999,900.00
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	2,000,000.00	100,000.00
应收证券清算款		274,848.49	45.70
应收利息	6.4.7.5	303.45	23,094.91
应收股利		-	-
应收申购款		313,344.31	38,327.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		18,958,632.64	20,617,119.28
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		286,601.83	-
应付赎回款		55,346.91	149,938.66
应付管理人报酬		7,472.45	9,030.76
应付托管费		1,494.49	1,806.17
应付销售服务费		19.56	19.34
应付交易费用	6.4.7.7	60,660.10	103,267.63
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	76,896.36	120,211.89
负债合计		488,491.70	384,274.45
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	3,658,174.25	4,200,100.06
未分配利润	6.4.7.10	14,811,966.69	16,032,744.77
所有者权益合计		18,470,140.94	20,232,844.83
负债和所有者权益总计		18,958,632.64	20,617,119.28

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，中金瑞祥 A 份额净值 5.2352 元，基金份额总额 3,481,867.03 份；中金瑞祥 C 份额净值 1.3714 元，基金份额总额 176,307.22 份。基金份额总额合计为 3,658,174.25 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		1,443,965.30	5,155,311.27
1.利息收入		20,788.34	368,653.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,693.78	53,087.03
债券利息收入		493.22	27,859.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,601.34	287,706.76
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,689,279.42	4,840,139.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,585,933.04	3,915,443.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,000.00	27,675.51
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	-	-
股利收益	6.4.7.15	102,346.38	897,020.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,287,797.36	-81,655.77
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	21,694.90	28,174.20
<b>减：二、费用</b>		400,858.80	527,133.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	45,546.51	263,167.39
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,109.32	52,633.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	117.48	49,448.15
4. 交易费用	6.4.7.18	269,222.03	102,211.68
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.07
7. 其他费用	6.4.7.19	76,863.46	59,672.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,043,106.50	4,628,178.15
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,043,106.50	4,628,178.15

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金

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）	4,200,100.06	16,032,744.77	20,232,844.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,043,106.50	1,043,106.50
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）	-541,925.81	-2,263,884.58	-2,805,810.39
其中：1.基金申购款	1,662,817.82	6,270,799.21	7,933,617.03
2.基金赎回款	-2,204,743.63	-8,534,683.79	-10,739,427.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-	-



基金招募说明书》和《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）。

本基金通过中金基金直销中心及管理人指定的其他投资机构向投资者公开发售，募集期为 2018 年 8 月 8 日起至 2018 年 11 月 7 日。经向中国证监会备案，《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 11 月 13 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 203,953,024.20 份（含利息转份额 9,685.62 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。

根据经中国证监会备案的《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购 / 申购时，收取认购 / 申购费用，但从本类别基金资产中不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取认购 / 申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。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基金份额净值并分别公告，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、银行存款、同业存单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）。

#### 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 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众公司（“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	1,254,128.83
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	1,254,128.83

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	14,422,464.00	14,747,731.35	325,267.35
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,400.00	1,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,400.00	1,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	14,423,864.00	14,749,131.35	325,267.35

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,000,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无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	138.18
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	153.80
应收债券利息	0.07
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	11.40
合计	303.45

#### 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	60,660.10
银行间市场应付交易费用	-
合计	60,660.10

## 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	32.90
应付证券出借违约金	-
预提费用	76,863.46
合计	76,896.36

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金瑞祥 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	4,025,935.16	4,025,935.16
本期申购	1,528,967.86	1,528,967.86
本期赎回(以“-”号填列)	-2,073,035.99	-2,073,035.99
- 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	3,481,867.03	3,481,867.03

金额单位：人民币元

中金瑞祥 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	174,164.90	174,164.90
本期申购	133,849.96	133,849.96
本期赎回(以“-”号填列)	-131,707.64	-131,707.64
- 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	176,307.22	176,307.22



## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金瑞祥 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,209,454.56	-229,369.92	15,980,084.64
本期利润	2,301,664.32	-1,273,406.66	1,028,257.66
本期基金份额交易产生的变动数	-2,321,384.71	59,531.57	-2,261,853.14
其中：基金申购款	6,710,138.84	-484,230.86	6,225,907.98
基金赎回款	-9,031,523.55	543,762.43	-8,487,761.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,189,734.17	-1,443,245.01	14,746,489.16

单位：人民币元

中金瑞祥 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	54,111.90	-1,451.77	52,660.13
本期利润	29,239.54	-14,390.70	14,848.84
本期基金份额交易产生的变动数	112.95	-2,144.39	-2,031.44
其中：基金申购款	51,294.63	-6,403.40	44,891.23
基金赎回款	-51,181.68	4,259.01	-46,922.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	83,464.39	-17,986.86	65,477.53

## 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	3,221.63
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	2,870.50
其他	601.65
合计	6,693.78

**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	103,192,830.65
减：卖出股票成本总额	100,606,897.61
买卖股票差价收入	2,585,933.04

**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	1,000.00
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	1,000.00

**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	1,022,500.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	999,000.00
减：应收利息总额	22,500.00
买卖债券差价收入	1,000.00

**6.4.7.13.3 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**

本基金在本期无衍生工具投资收益。

**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	102,346.38
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	102,346.38

**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	-1,287,797.36
——股票投资	-1,286,897.36
——债券投资	-900.00
——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	-1,287,797.36

**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	21,655.31
转换费收入	39.59
合计	21,694.90

**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	269,222.03
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	269,222.03

**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	59,507.37
证券出借违约金	-
开户费	-
合计	76,863.46

**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、基金注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人
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

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	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中金财富证券	202,471,251.31	100.00%	66,540,295.95	100.00%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年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
中金财富证券	-	-	234,002.97	100.00%

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中金财富证券	152,200,000.00	100.00%	2,651,500,000.00	100.00%

**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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中金财富证券	148,067.44	100.00%	60,660.10	100.00%
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中金财富证券	48,661.46	100.00%	31,499.85	100.00%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还获得证券研究综合服务。

**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	45,546.51
其中：支付销售机构的客户维护费	19,706.34	16,976.65

注：支付基金管理人中金基金管理有限公司的基本管理费按前一日基金资产净值 0.50%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×0.50%/当年天数。

**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	9,109.32	52,633.49

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金瑞祥 A	中金瑞祥 C	合计
中金基金	-	0.00	0.00
中金财富证券	-	0.00	0.00
中金公司	-	1.81	1.81
合计	-	1.81	1.81
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		
	中金瑞祥 A	中金瑞祥 C	合计
中金基金	-	36,316.42	36,316.42
中金财富证券	-	13,065.55	13,065.55
中金公司	-	0.00	0.00
合计	-	49,381.97	49,381.97

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；  
2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.10%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：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.10%/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

本基金本报告期末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****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**

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。

**6.4.10.4.2 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**

本基金在本报告期及上年度可比期间均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自有资金投资本基金的情况**

本报告期内，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

**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 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
平安银行	1,254,128.83	3,221.63	8,784,478.57	29,613.77

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

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
-	-	-	-	-	-
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	6,210	85,573.80
中金公司	688158	优刻得	网下	4,255	141,393.65
中金公司	688266	泽璟制药	网下	7,172	242,126.72
中金公司	688200	华峰测控	网下	588	63,157.08



中金公司	688222	成都先导	网下	2,267	46,518.84
中金公司	688365	光云科技	网下	3,032	32,745.60
中金公司	688505	复旦张江	网下	5,195	46,495.25
中金公司	688520	神州细胞	网下	2,744	70,356.16

注：本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 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进行利润分配。

#### 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

本基金本期末未持有因认购/增发的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金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中作为抵押的债券。

###### 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中作为抵押的债券。

##### 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

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，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，对交易对手的资金状况进行充分评估、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

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	1,400.00	-
未评级	-	-
合计	1,400.00	-

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、全国银行间债券市场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	1,254,128.83	-	-	-	1,254,128.83
结算备付金	341,717.17	-	-	-	341,717.17
存出保证金	25,159.04	-	-	-	25,159.04
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	14,747,731.35	14,747,731.35
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	-	-	1,400.00	-	1,400.00
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	274,848.49	274,848.49
应收利息	-	-	-	303.45	303.45
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	313,344.31	313,344.31
资产总计	3,621,005.04	-	1,400.00	15,336,227.60	18,958,632.64
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	286,601.83	286,601.83
应付赎回款	-	-	-	55,346.91	55,346.91
应付管理人报酬	-	-	-	7,472.45	7,472.45
应付托管费	-	-	-	1,494.49	1,494.49
应付交易费用	-	-	-	60,660.10	60,660.10
应付销售服务费	-	-	-	19.56	19.56
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	76,896.36	76,896.36
负债总计	-	-	-	488,491.70	488,491.70
利率敏感度缺	3,621,005.04	-	1,400.00	14,847,735.90	18,470,140.94

口					
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,391,541.04	-	-	-	1,391,541.04
结算备付金	582,380.95	-	-	-	582,380.95
存出保证金	118,723.05	-	-	-	118,723.05
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-17,363,105.66	17,363,105.66
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	999,900.00	-	-	-	999,900.00
买入返售金融资产	100,000.00	-	-	-	100,000.00
应收证券清算款	-	-	-	45.70	45.70
应收利息	-	-	-	23,094.91	23,094.91
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	38,327.97	38,327.97
资产总计	3,192,545.04	-	-	-17,424,574.24	20,617,119.28
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	149,938.66	149,938.66
应付管理人报酬	-	-	-	9,030.76	9,030.76
应付托管费	-	-	-	1,806.17	1,806.17
应付交易费用	-	-	-	103,267.63	103,267.63
应付销售服务费	-	-	-	19.34	19.34
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	120,211.89	120,211.89
负债总计	-	-	-	384,274.45	384,274.45
利率敏感度缺口	3,192,545.04	-	-	-17,040,299.79	20,232,844.83

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）
	市场利率下降 25 个基点	-	75.24
市场利率上升 25 个基点	-	-75.24	

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 0.0076%，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。

本基金部分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。

##### 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	14,747,731.35	79.85	17,363,105.66	85.82
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	14,747,731.35	79.85	17,363,105.66	85.82

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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）
	业绩比较基准上升 5%	1,326,757.43	1,292,609.18
	业绩比较基准下降 5%	-1,326,757.43	-1,292,609.18

#### 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	14,747,731.35	77.79
	其中：股票	14,747,731.35	77.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,400.00	0.01
	其中：债券	1,400.00	0.01
	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	2,000,000.00	10.55
	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	1,595,846.00	8.42
8	其他各项资产	613,655.29	3.24
9	合计	18,958,632.64	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	6,082.00	0.03
B	采矿业	167,424.00	0.91
C	制造业	11,984,407.35	64.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	125,147.00	0.68
E	建筑业	157,829.00	0.85
F	批发和零售业	16,988.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	375,354.00	2.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	560,198.00	3.03
J	金融业	567,603.00	3.07
K	房地产业	220,173.00	1.19
L	租赁和商务服务业	156,471.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	314,193.00	1.70



N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	95,862.00	0.52
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,747,731.35	79.85

### 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股票资产。

### 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	200	411,340.00	2.23
2	002475	立讯精密	8,300	381,800.00	2.07
3	600276	恒瑞医药	5,305	360,580.85	1.95
4	300628	亿联网络	3,900	326,820.00	1.77
5	600436	片仔癀	700	313,810.00	1.70
6	600809	山西汾酒	700	313,600.00	1.70
7	000858	五粮液	1,000	297,890.00	1.61
8	300760	迈瑞医疗	600	288,030.00	1.56
9	603288	海天味业	2,110	272,084.50	1.47
10	600887	伊利股份	7,300	268,859.00	1.46
11	000596	古井贡酒	1,100	263,450.00	1.43
12	300782	卓胜微	460	247,250.00	1.34
13	000568	泸州老窖	1,000	235,940.00	1.28
14	601717	郑煤机	18,600	216,318.00	1.17
15	000970	中科三环	21,600	206,280.00	1.12
16	603799	华友钴业	1,800	205,560.00	1.11
17	300072	三聚环保	35,300	202,622.00	1.10
18	601636	旗滨集团	10,800	200,448.00	1.09
19	603355	莱克电气	3,200	199,136.00	1.08
20	600019	宝钢股份	26,000	198,640.00	1.08
21	002179	中航光电	2,500	197,550.00	1.07
22	002635	安洁科技	13,500	197,505.00	1.07
23	300433	蓝思科技	6,700	197,047.00	1.07

24	002050	三花智控	8,200	196,636.00	1.06
25	000012	南玻A	19,200	196,608.00	1.06
26	002241	歌尔股份	4,600	196,604.00	1.06
27	600623	华谊集团	22,300	196,463.00	1.06
28	600388	龙净环保	23,000	195,960.00	1.06
28	600919	江苏银行	27,600	195,960.00	1.06
29	603160	汇顶科技	1,500	194,445.00	1.05
30	000661	长春高新	500	193,500.00	1.05
31	002080	中材科技	7,300	191,041.00	1.03
32	002153	石基信息	8,100	190,431.00	1.03
33	603259	药明康德	1,200	187,908.00	1.02
34	002821	凯莱英	500	186,300.00	1.01
35	600426	华鲁恒升	6,000	185,700.00	1.01
36	600585	海螺水泥	4,500	184,725.00	1.00
37	600188	兖州煤业	10,900	167,424.00	0.91
38	601100	恒立液压	1,900	163,248.00	0.88
39	600522	中天科技	16,300	163,000.00	0.88
40	002252	上海莱士	21,500	161,035.00	0.87
41	002938	鹏鼎控股	4,400	157,872.00	0.85
42	601816	京沪高铁	29,400	155,526.00	0.84
43	603392	万泰生物	600	155,508.00	0.84
44	600637	东方明珠	18,800	153,972.00	0.83
45	600918	中泰证券	14,100	152,562.00	0.83
46	600068	葛洲坝	19,900	149,051.00	0.81
47	000671	阳光城	28,200	146,640.00	0.79
48	002916	深南电路	1,300	144,469.00	0.78
49	002371	北方华创	500	138,690.00	0.75
50	000333	美的集团	1,900	135,603.00	0.73
51	002157	正邦科技	11,300	135,035.00	0.73
52	600271	航天信息	10,300	134,209.00	0.73
53	300003	乐普医疗	4,000	128,480.00	0.70
54	600487	亨通光电	10,700	121,980.00	0.66
55	601888	中国中免	400	120,040.00	0.65
56	600132	重庆啤酒	600	118,770.00	0.64
57	601698	中国卫通	7,300	118,187.00	0.64
58	000895	双汇发展	3,700	117,660.00	0.64
59	002120	韵达股份	8,400	113,652.00	0.62
60	300595	欧普康视	1,080	111,834.00	0.61
61	600025	华能水电	18,600	107,694.00	0.58

62	601166	兴业银行	5,000	102,750.00	0.56
63	600085	同仁堂	2,500	102,125.00	0.55
64	603899	晨光文具	1,200	101,472.00	0.55
65	002841	视源股份	800	99,432.00	0.54
66	601006	大秦铁路	14,800	97,384.00	0.53
67	603882	金域医学	600	95,862.00	0.52
68	300529	健帆生物	1,100	94,996.00	0.51
69	688396	华润微	1,000	91,020.00	0.49
70	688036	传音控股	400	83,800.00	0.45
71	300033	同花顺	700	78,946.00	0.43
72	002007	华兰生物	2,100	77,028.00	0.42
73	600779	水井坊	600	75,810.00	0.41
74	000656	金科股份	12,700	73,533.00	0.40
75	300676	华大基因	600	71,160.00	0.39
76	002555	三七互娱	2,800	67,256.00	0.36
77	002353	杰瑞股份	1,400	62,580.00	0.34
78	300124	汇川技术	800	59,408.00	0.32
79	603127	昭衍新药	300	55,125.00	0.30
80	601012	隆基股份	600	53,304.00	0.29
81	603658	安图生物	690	52,281.30	0.28
82	002508	老板电器	1,100	51,150.00	0.28
83	600298	安琪酵母	900	48,942.00	0.26
84	603589	口子窖	700	47,383.00	0.26
85	002223	鱼跃医疗	1,200	45,756.00	0.25
86	002372	伟星新材	2,200	45,474.00	0.25
87	300751	迈为股份	100	45,470.00	0.25
88	002271	东方雨虹	800	44,256.00	0.24
89	603638	艾迪精密	980	42,012.60	0.23
90	601633	长城汽车	900	39,231.00	0.21
91	002690	美亚光电	700	39,032.00	0.21
92	300357	我武生物	600	38,472.00	0.21
93	002032	苏泊尔	600	38,274.00	0.21
94	300482	万孚生物	590	38,167.10	0.21
95	600872	中炬高新	900	37,818.00	0.20
96	002507	涪陵榨菜	1,000	37,660.00	0.20
97	002626	金达威	800	35,760.00	0.19
98	603338	浙江鼎力	600	35,214.00	0.19
99	002242	九阳股份	900	29,241.00	0.16
100	600926	杭州银行	1,900	28,025.00	0.15

101	002127	南极电商	2,800	27,356.00	0.15
102	300418	昆仑万维	1,300	21,294.00	0.12
103	000738	航发控制	500	10,415.00	0.06
104	603515	欧普照明	400	10,268.00	0.06
105	002156	通富微电	400	9,616.00	0.05
106	600273	嘉化能源	1,100	9,570.00	0.05
107	002465	海格通信	1,000	9,460.00	0.05
108	600901	江苏租赁	1,800	9,360.00	0.05
109	600903	贵州燃气	1,000	9,200.00	0.05
110	300058	蓝色光标	1,500	9,075.00	0.05
111	300113	顺网科技	700	9,058.00	0.05
112	000878	云南铜业	700	8,981.00	0.05
113	002385	大北农	1,300	8,840.00	0.05
114	603056	德邦股份	800	8,792.00	0.05
115	600039	四川路桥	1,400	8,778.00	0.05
116	002075	沙钢股份	800	8,728.00	0.05
117	600859	王府井	300	8,664.00	0.05
118	600739	辽宁成大	400	8,324.00	0.05
119	000027	深圳能源	900	8,253.00	0.04
120	000999	华润三九	300	8,025.00	0.04
121	002714	牧原股份	100	6,082.00	0.03

## 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	600132	重庆啤酒	861,236.00	4.26
2	600276	恒瑞医药	721,146.00	3.56
3	603260	合盛硅业	702,322.00	3.47
4	603885	吉祥航空	693,499.00	3.43
5	300033	同花顺	661,957.00	3.27
6	601166	兴业银行	661,102.00	3.27
7	300595	欧普康视	659,467.00	3.26
8	600660	福耀玻璃	657,931.00	3.25
9	002568	百润股份	611,339.00	3.02
10	002821	凯莱英	598,625.00	2.96

11	002841	视源股份	578,663.00	2.86
12	002092	中泰化学	574,594.00	2.84
13	300482	万孚生物	572,502.00	2.83
14	000012	南玻 A	559,777.00	2.77
15	002080	中材科技	550,887.00	2.72
16	002709	天赐材料	544,880.00	2.69
17	603882	金域医学	536,761.00	2.65
18	603737	三棵树	536,734.00	2.65
19	603899	晨光文具	536,536.00	2.65
20	002916	深南电路	518,913.00	2.56
21	601689	拓普集团	508,697.00	2.51
22	600258	首旅酒店	503,755.20	2.49
23	002416	爱施德	488,281.00	2.41
24	600085	同仁堂	487,353.00	2.41
25	601717	郑煤机	487,310.00	2.41
26	600745	闻泰科技	486,837.00	2.41
27	601012	隆基股份	485,839.00	2.40
28	603444	吉比特	480,685.00	2.38
29	600884	杉杉股份	474,055.00	2.34
30	000596	古井贡酒	467,400.00	2.31
31	000568	泸州老窖	451,833.00	2.23
32	002511	中顺洁柔	426,698.00	2.11
33	601100	恒立液压	425,965.00	2.11
34	688202	美迪西	425,713.10	2.10
35	002250	联化科技	425,140.00	2.10
36	300347	泰格医药	424,206.00	2.10
37	603198	迎驾贡酒	422,910.00	2.09
38	603338	浙江鼎力	421,735.00	2.08
39	603486	科沃斯	420,436.00	2.08
40	688069	德林海	417,427.15	2.06
41	688008	澜起科技	417,360.59	2.06
42	603355	莱克电气	417,101.00	2.06
43	002271	东方雨虹	416,875.00	2.06
44	600019	宝钢股份	416,624.00	2.06
45	600623	华谊集团	415,222.00	2.05
46	603638	艾迪精密	414,125.12	2.05

47	300009	安科生物	410,534.00	2.03
48	600549	厦门钨业	409,454.00	2.02
49	600406	国电南瑞	407,561.00	2.01
50	603501	韦尔股份	406,502.00	2.01

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600276	恒瑞医药	858,301.00	4.24
2	603260	合盛硅业	812,258.00	4.01
3	300124	汇川技术	811,854.00	4.01
4	600132	重庆啤酒	790,763.00	3.91
5	000568	泸州老窖	767,490.00	3.79
6	600809	山西汾酒	750,780.00	3.71
7	601799	星宇股份	722,260.00	3.57
8	603885	吉祥航空	684,647.00	3.38
9	600660	福耀玻璃	684,274.00	3.38
10	002568	百润股份	672,680.00	3.32
11	300033	同花顺	646,961.00	3.20
12	300595	欧普康视	636,736.00	3.15
13	603899	晨光文具	634,648.00	3.14
14	000661	长春高新	633,058.00	3.13
15	600258	首旅酒店	623,271.77	3.08
16	603444	吉比特	609,302.00	3.01
17	002841	视源股份	603,370.00	2.98
18	002092	中泰化学	594,141.00	2.94
19	603882	金域医学	580,854.00	2.87
20	688036	传音控股	562,113.05	2.78
21	601012	隆基股份	560,260.00	2.77
22	601166	兴业银行	557,234.00	2.75
23	603737	三棵树	554,748.00	2.74
24	002709	天赐材料	541,505.20	2.68
25	300482	万孚生物	537,058.00	2.65
26	002415	海康威视	532,898.00	2.63
27	300274	阳光电源	526,242.56	2.60
28	002416	爱施德	516,622.00	2.55

29	600884	杉杉股份	515,737.00	2.55
30	300496	中科创达	508,044.00	2.51
31	601689	拓普集团	490,296.00	2.42
32	300347	泰格医药	487,692.00	2.41
33	600745	闻泰科技	483,625.92	2.39
34	002916	深南电路	474,876.00	2.35
35	603198	迎驾贡酒	473,253.00	2.34
36	688202	美迪西	468,531.80	2.32
37	002080	中材科技	468,418.00	2.32
38	603288	海天味业	464,098.00	2.29
39	603345	安井食品	461,460.00	2.28
40	603806	福斯特	457,935.00	2.26
41	601601	中国太保	455,621.00	2.25
42	000960	锡业股份	453,861.00	2.24
43	603638	艾迪精密	449,186.40	2.22
44	603338	浙江鼎力	444,834.00	2.20
45	688185	康希诺	437,389.48	2.16
46	002078	太阳纸业	434,341.00	2.15
47	603486	科沃斯	431,522.00	2.13
48	688069	德林海	429,608.31	2.12
49	600085	同仁堂	429,487.00	2.12
50	002821	凯莱英	421,948.00	2.09
51	600519	贵州茅台	421,802.00	2.08
52	000858	五粮液	420,918.00	2.08
53	300285	国瓷材料	420,725.00	2.08
54	002511	中顺洁柔	418,048.00	2.07
55	002250	联化科技	415,308.00	2.05
56	600549	厦门钨业	414,546.00	2.05
57	300012	华测检测	413,249.00	2.04
58	688008	澜起科技	412,307.60	2.04
59	603501	韦尔股份	412,005.00	2.04
60	600406	国电南瑞	409,476.00	2.02
61	603893	瑞芯微	406,922.00	2.01
62	601598	中国外运	405,843.00	2.01

### 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	99,278,420.66
卖出股票收入（成交）总额	103,192,830.65

注：“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）	1,400.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,400.00	0.01

### 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	14	1,400.00	0.01

### 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

本基金本报告期末未持有股指期货。



### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 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

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

#### 7.12.2 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。

#### 7.12.3 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	25,159.04
2	应收证券清算款	274,848.49
3	应收股利	-
4	应收利息	303.45
5	应收申购款	313,344.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	613,655.29

#### 7.12.4 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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中金瑞祥 A	3,317	1,049.70	0.00	0.00%	3,481,867.03	100.00%
中金瑞祥 C	33	5,342.64	0.00	0.00%	176,307.22	100.00%
合计	3,350	1,091.99	0.00	0.00%	3,658,174.25	100.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金瑞祥 A	100.04	0.0029%
	中金瑞祥 C	0.00	0.0000%
	合计	100.04	0.0027%

### 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	中金瑞祥 A	0
	中金瑞祥 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中金瑞祥 A	0
	中金瑞祥 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金瑞祥 A	中金瑞祥 C
基金合同生效日（2018 年 11 月 13 日）基金份额总额	8,130,113.21	195,822,910.99
本报告期期初基金份额总额	4,025,935.16	174,164.90
本报告期基金总申购份额	1,528,967.86	133,849.96
减：本报告期基金总赎回份额	2,073,035.99	131,707.64
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	3,481,867.03	176,307.22

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

2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

### 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任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金财富证券	2	202,471,251.31	100.00%	148,067.44	100.00%	-

方正证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	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服务；能根据公司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
中金财富证券	-	-	152,200,000.00	100.00%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
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

2	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
3	中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2021 年 1 月 22 日
4	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
5	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
6	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
7	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
8	中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告及摘要	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 31 日
9	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
10	中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 22 日
11	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
12	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
13	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

## § 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

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有份额比例达到或超过总份额 20%的情况。

### 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瑞祥灵活配置混合型证券投资基金募集的注册文件
- 2、《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金瑞祥灵活配置混合型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和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 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

基金合同、托管协议及其余备查文件存放在基金管理人和基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/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和复印件。

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：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2021年8月31日