

中金消费升级股票型证券投资基金 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：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.....	11
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.....	45
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
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
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金消费升级股票型证券投资基金
基金简称	中金消费升级
基金主代码	001193
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 24 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	200,278,530.74 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入研究并积极投资消费升级相关的优质公司，在有效控制下行风险的前提下，力争实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。
业绩比较基准	中证主要消费指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于高预期风险和高预期收益的证券投资基金。

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	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	《证券日报》
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	45,686,352.59
本期利润	18,545,712.53
加权平均基金份额本期利润	0.1027
本期加权平均净值利润率	6.42%
本期基金份额净值增长率	1.51%
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	123,702,932.65
期末可供分配基金份额利润	0.6177
期末基金资产净值	323,981,463.39
期末基金份额净值	1.618
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	61.80%

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。

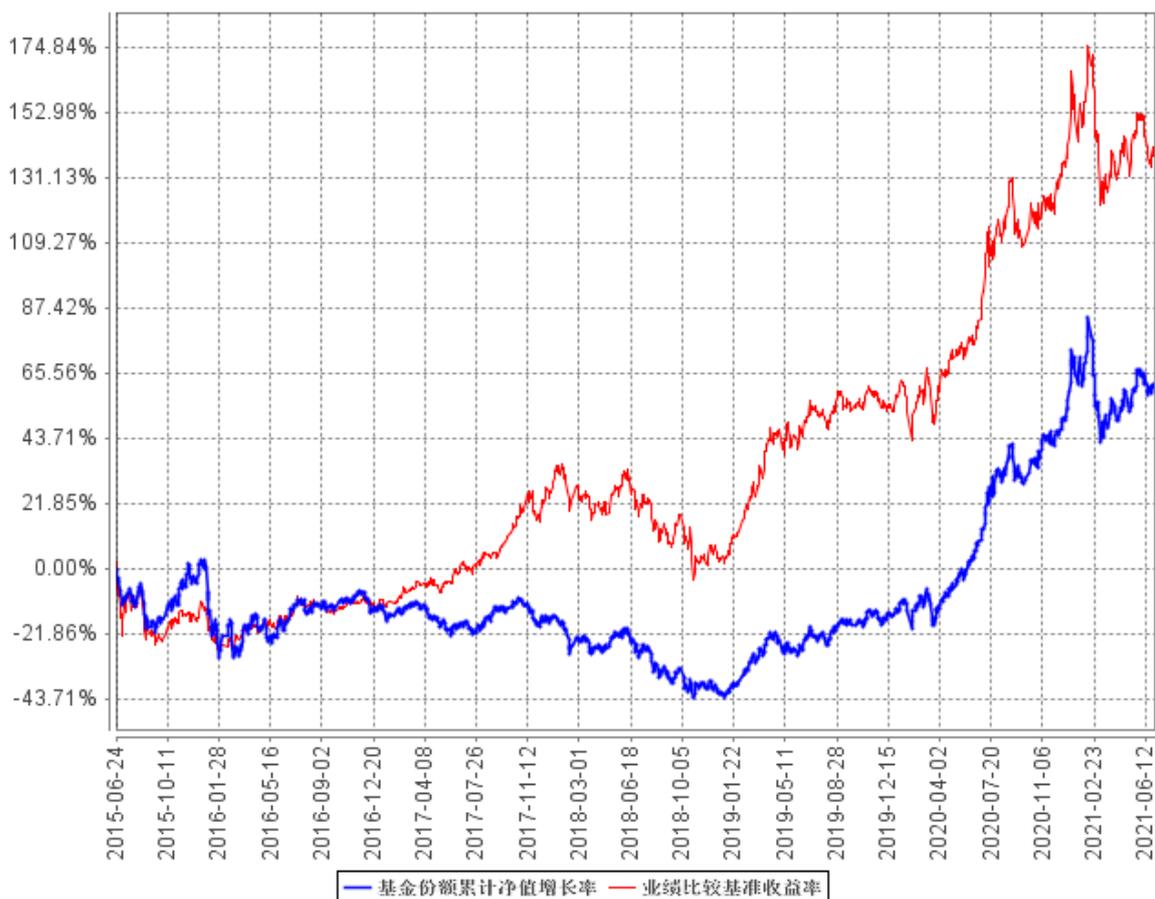
3.2 基金净值表现

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	-2.29%	1.02%	-4.80%	0.98%	2.51%	0.04%
过去三个月	6.38%	1.16%	2.95%	1.13%	3.43%	0.03%
过去六个月	1.51%	1.67%	-2.33%	1.53%	3.84%	0.14%
过去一年	45.37%	1.51%	28.34%	1.44%	17.03%	0.07%
过去三年	117.18%	1.44%	94.36%	1.40%	22.82%	0.04%
自基金合同生效起至今	61.80%	1.47%	138.81%	1.40%	-77.01%	0.07%

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		
闫鑫	本基金基金经理	2020 年 9 月 7 日	-	5 年	闫鑫女士，工程硕士。曾任阳光资产管理股份有限公司证券研究部研究员，现任中金基金管理有限公司权益部基金经理。
高懋	本基金基金经理助理	2020 年 8 月 4 日	-	4 年	高懋女士，经济学硕士。2016 年加入中金基金管理有限公司，现任权益部基金经理助理。

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。

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

回顾上半年，消费板块行情表现较差。市场预期由年初的高增长逐步回落，主要因为 1) 消费品（尤其是大众消费品）需求恢复缓慢，各地零星疫情不断出现，餐饮、旅游、家居用品、保险等可选消费增长不及年初预期；2) 成本超预期上行，部分偏制造型消费企业面临巨大成本压力，典型如家电、家具板块，且在下游需求较弱的环境下难以转嫁成本。

我们在配置策略上，上半年减配了受成本影响明显且需求不强的家电板块，清仓了保险板块。配置集中在高端消费和医疗服务板块。在个股选择上，仍然重点配置高景气赛道的优质龙头。

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 1.618 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.51%，业绩比较基准收益率为-2.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内方面短期经济保持平稳，系统性风险不大。但 7 月份河南暴雨、浙江台风以及南京疫情的扩散，预计会对消费需求有负面影响。8 月份有可能迎来中报行情，我们会重点关注中报有可能超预期的标的。10 月份进入消费旺季，预计在中秋国庆期间电商购物需求会有所改善。

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《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同中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：中金消费升级股票型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	46,124,374.80	28,215,646.66
结算备付金		153,912.45	295,514.71
存出保证金		183,968.29	43,728.24
交易性金融资产	6.4.7.2	274,039,105.42	168,964,801.90
其中：股票投资		274,039,105.42	168,964,801.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		1,142,164.87	-
应收利息	6.4.7.5	4,350.37	2,992.81
应收股利		-	-
应收申购款		5,823,565.35	3,066,597.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		327,471,441.55	200,589,281.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,591,988.45	1,243,050.63
应付赎回款		231,200.51	13,499,424.02
应付管理人报酬		326,555.00	236,517.48
应付托管费		54,425.81	39,419.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	225,903.72	108,304.66
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	59,904.67	161,669.68
负债合计		3,489,978.16	15,288,386.05
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	200,278,530.74	116,229,425.27
未分配利润	6.4.7.10	123,702,932.65	69,071,470.28
所有者权益合计		323,981,463.39	185,300,895.55
负债和所有者权益总计		327,471,441.55	200,589,281.60

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.618 元，基金份额总额为 200,278,530.74 份。

6.2 利润表

会计主体：中金消费升级股票型证券投资基金

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
一、收入		22,604,784.06	43,436,126.94
1.利息收入		81,840.95	107,093.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	81,840.95	51,618.88
债券利息收入		-	2.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	55,472.35
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		46,544,473.80	36,131,143.39
其中：股票投资收益	6.4.7.12	45,442,594.36	34,783,521.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	3,668.58
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	1,101,879.44	1,343,952.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-27,140,640.06	7,155,700.15
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	3,119,109.37	42,189.95
减：二、费用		4,059,071.53	2,084,753.10

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2, 172, 193. 57	1, 216, 236. 23
2. 托管费	6.4.10.2.2	362, 032. 27	202, 706. 03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1, 456, 707. 91	581, 697. 88
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	68, 137. 78	84, 112. 96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18, 545, 712. 53	41, 351, 373. 84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18, 545, 712. 53	41, 351, 373. 84

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金消费升级股票型证券投资基金

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）	116, 229, 425. 27	69, 071, 470. 28	185, 300, 895. 55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18, 545, 712. 53	18, 545, 712. 53
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）	84, 049, 105. 47	36, 085, 749. 84	120, 134, 855. 31
其中：1.基金申购款	395, 026, 898. 45	256, 792, 777. 75	651, 819, 676. 20
2. 基金赎回款	-310, 977, 792. 98	-220, 707, 027. 91	-531, 684, 820. 89
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）	200, 278, 530. 74	123, 702, 932. 65	323, 981, 463. 39

消费升级股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 24 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 694,717,196.35 份（含利息转份额 409,128.68 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》及其配套规则、《中金消费升级股票型证券投资基金基金合同》和《中金消费升级股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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	46,124,374.80
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：	46,124,374.80

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	255,032,171.99	274,039,105.42	19,006,933.43
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约			
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	255,032,171.99	274,039,105.42	19,006,933.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

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	4,198.27
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	69.30
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	82.80
合计	4,350.37

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	225,903.72
银行间市场应付交易费用	-
合计	225,903.72

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	397.30
应付证券出借违约金	-
预提费用	59,507.37
应付审计费	-
应付信息披露费	-
合计	59,904.67

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	116,229,425.27	116,229,425.27
本期申购	395,026,898.45	395,026,898.45
本期赎回(以“-”号填列)	-310,977,792.98	-310,977,792.98
- 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	200,278,530.74	200,278,530.74

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	46,280,465.69	22,791,004.59	69,071,470.28
本期利润	45,686,352.59	-27,140,640.06	18,545,712.53
本期基金份额交易产生的变动数	43,525,121.98	-7,439,372.14	36,085,749.84
其中：基金申购款	204,656,908.87	52,135,868.88	256,792,777.75
基金赎回款	-161,131,786.89	-59,575,241.02	-220,707,027.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	135,491,940.26	-11,789,007.61	123,702,932.65

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	73,636.11
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	7,029.63
其他	1,175.21
合计	81,840.95

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	519,501,598.73
减：卖出股票成本总额	474,059,004.37
买卖股票差价收入	45,442,594.36

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

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期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

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

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	1,101,879.44
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,101,879.44

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	-27,140,640.06
——股票投资	-27,140,640.06
——债券投资	-
——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	-27,140,640.06

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	3,114,917.23
转换费收入	4,192.14
合计	3,119,109.37

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	1,456,707.91
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	1,456,707.91

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	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	8,630.41
帐户维护费	-
银行手续费	-
合计	68,137.78

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

截至财务报表批准日，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
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	-	-	16,100.00	44.88%

注：本基金本报告期未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

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无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	2,172,193.57	1,216,236.23
其中：支付销售机构的客户维护费	1,069,292.95	545,313.70

注：支付基金管理人中金基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年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	362,032.27	202,706.03

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。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。

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期本基金无销售服务费。

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

本报告期本基金未发生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**

本基金在本期及上期间均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

本基金在本期及上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
中国建设银行	46,124,374.80	73,636.11	11,150,747.33	45,660.57

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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
中金公司	003033	征和工业	网下	301	7,007.28
中金公司	688696	极米科技	网下	1,073	143,492.29
中金公司	688316	青云科技	网下	1,269	80,835.30
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	31,385	90,074.95
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	688520	神州细胞	网下	4,185	107,303.40
中金公司	688505	复旦张江	网下	8,120	72,674.00
中金公司	300831	派瑞股份	网下	1,716	6,829.68
中金公司	688365	光云科技	网下	8,249	89,089.20

中金公司	300825	阿尔特	网下	1,642	10,081.88
中金公司	688200	华峰测控	网下	1,092	117,291.72
中金公司	688266	泽璟制药	网下	9,111	307,587.36
中金公司	688158	优刻得	网下	5,520	183,429.60
中金公司	688100	威胜信息	网下	7,848	108,145.44

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

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

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
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
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	-
688183	生益电子	2021年2月10日	2021年8月25日	新股流通受限	12.42	14.19	13,243	164,478.06	187,918.17	-
688201	信安世纪	2021年4月13日	2021年10月21日	新股流通受限	26.78	45.41	2,129	57,014.62	96,677.89	-

688316	青云科技	2021年3月5日	2021年9月16日	新股流通受限	63.70	65.00	1,269	80,835.30	82,485.00	-
688533	上声电子	2021年4月9日	2021年10月19日	新股流通受限	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688655	迅捷兴	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-
688683	莱尔科技	2021年4月1日	2021年10月12日	新股流通受限	9.51	14.73	3,296	31,344.96	48,550.08	-
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	182	8,614.06	45,856.72	-
688367	工大高科	2021年6月21日	2021年12月28日	新股流通受限	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	237	6,702.36	27,423.27	-
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	240	6,904.80	23,964.00	-
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	773	9,693.42	21,558.97	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	48.59	90.39	198	9,620.82	17,897.22	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-

			日							
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,136	7,804.32	13,711.52	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
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	928	4,584.32	12,110.40	-
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	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	350	8,641.50	11,098.50	-
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30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	数量包含送股
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
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	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	271	6,747.90	6,723.51	-

			日								
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-	
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-	
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	-	
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	572	1,927.64	5,971.68	-	
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	-	
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-	
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-	
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-	
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-	
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-	
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-	
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-	

			日							
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金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

本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于高预期风险和高预期收益的证券投资基金。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

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

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	46,124,374.80	-	-	-	46,124,374.80
结算备付金	153,912.45	-	-	-	153,912.45
存出保证金	183,968.29	-	-	-	183,968.29
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-274,039,105.42	274,039,105.42
交易性金融资产-债券投资、 资产支持证券	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,142,164.87	1,142,164.87
应收利息	-	-	-	4,350.37	4,350.37
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,823,565.35	5,823,565.35
资产总计	46,462,255.54	-	-	-281,009,186.01	327,471,441.55
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,591,988.45	2,591,988.45
应付赎回款	-	-	-	231,200.51	231,200.51
应付管理人报酬	-	-	-	326,555.00	326,555.00
应付托管费	-	-	-	54,425.81	54,425.81
应付交易费用	-	-	-	225,903.72	225,903.72

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	59,904.67	59,904.67
负债总计	-	-	-	3,489,978.16	3,489,978.16
利率敏感度缺口	46,462,255.54	-	-	-277,519,207.85	323,981,463.39
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	28,215,646.66	-	-	-	28,215,646.66
结算备付金	295,514.71	-	-	-	295,514.71
存出保证金	43,728.24	-	-	-	43,728.24
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	168,964,801.90	168,964,801.90
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,992.81	2,992.81
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,066,597.28	3,066,597.28
资产总计	28,554,889.61	-	-	172,034,391.99	200,589,281.60
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,243,050.63	1,243,050.63
应付赎回款	-	-	-	13,499,424.02	13,499,424.02
应付管理人报酬	-	-	-	236,517.48	236,517.48
应付托管费	-	-	-	39,419.58	39,419.58
应付交易费用	-	-	-	108,304.66	108,304.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	161,669.68	161,669.68
负债总计	-	-	-	15,288,386.05	15,288,386.05

利率敏感度缺口	28,554,889.61	-	-156,746,005.94	185,300,895.55
---------	---------------	---	-----------------	----------------

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

本期末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

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。

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	274,039,105.42	84.58	168,964,801.90	91.18
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	274,039,105.42	84.58	168,964,801.90	91.18

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%	15,715,332.16	9,006,160.33
	业绩比较基准下降 5%	-15,715,332.16	-9,006,160.33

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	274,039,105.42	83.68
	其中：股票	274,039,105.42	83.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	46,278,287.25	14.13
8	其他各项资产	7,154,048.88	2.18
9	合计	327,471,441.55	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	180,070.78	0.06
B	采矿业	-	-
C	制造业	223,531,846.79	69.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,311,308.39	1.64
E	建筑业	184,996.72	0.06
F	批发和零售业	4,007,343.06	1.24
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	437,259.32	0.13
J	金融业	11,954,290.40	3.69
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,843,922.76	3.04
M	科学研究和技术服务业	8,077,729.31	2.49
N	水利、环境和公共设施管理业	420,175.99	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,090,161.90	3.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	274,039,105.42	84.58

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	000858	五粮液	76,469	22,779,350.41	7.03
2	600809	山西汾酒	40,424	18,109,952.00	5.59
3	000568	泸州老窖	67,335	15,887,019.90	4.90
4	600519	贵州茅台	7,657	15,748,151.90	4.86
5	002304	洋河股份	61,100	12,659,920.00	3.91
6	600276	恒瑞医药	175,901	11,955,990.97	3.69
7	300760	迈瑞医疗	23,307	11,188,525.35	3.45
8	688363	华熙生物	39,313	10,923,510.18	3.37
9	300015	爱尔眼科	142,155	10,090,161.90	3.11
10	601888	中国中免	32,584	9,778,458.40	3.02
11	300894	火星人	132,879	9,035,772.00	2.79
12	300896	爱美客	11,248	8,873,322.24	2.74
13	600600	青岛啤酒	72,600	8,396,190.00	2.59
14	601318	中国平安	129,700	8,337,116.00	2.57
15	600690	海尔智家	315,600	8,177,196.00	2.52
16	000333	美的集团	114,148	8,146,742.76	2.51
17	688169	石头科技	6,423	8,099,403.00	2.50
18	603259	药明康德	46,560	7,290,830.40	2.25
19	600887	伊利股份	195,700	7,207,631.00	2.22
20	688626	翔宇医疗	54,761	6,617,319.24	2.04
21	002791	坚朗五金	30,200	5,860,310.00	1.81
22	300595	欧普康视	53,260	5,515,073.00	1.70
23	600900	长江电力	256,700	5,298,288.00	1.64
24	603517	绝味食品	54,800	4,619,092.00	1.43
25	603899	晨光文具	54,063	4,571,567.28	1.41

26	000596	古井贡酒	18,200	4,358,900.00	1.35
27	002475	立讯精密	91,400	4,204,400.00	1.30
28	601601	中国太保	121,500	3,519,855.00	1.09
29	000963	华东医药	74,800	3,441,548.00	1.06
30	600132	重庆啤酒	6,700	1,326,265.00	0.41
31	688696	极米科技	1,073	892,736.00	0.28
32	688131	皓元医药	1,369	473,934.11	0.15
33	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.13
34	300973	立高食品	2,365	357,263.27	0.11
35	688076	诺泰生物	4,984	339,958.64	0.10
36	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.08
37	300953	震裕科技	2,394	258,642.30	0.08
38	301009	可靠股份	7,727	255,769.69	0.08
39	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.08
40	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.07
41	002372	伟星新材	11,400	235,638.00	0.07
42	688538	和辉光电	61,525	234,410.25	0.07
43	300981	中红医疗	1,973	218,223.72	0.07
44	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.07
45	688677	海泰新光	1,768	193,596.00	0.06
46	688425	铁建重工	31,385	192,076.20	0.06
47	688183	生益电子	13,243	187,918.17	0.06
48	688315	诺禾致源	3,711	181,096.80	0.06
49	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.05
50	300968	格林精密	11,354	175,155.92	0.05
51	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.05
52	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.05
53	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.05
54	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.05
55	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.05
56	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.05
57	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.04
58	300940	南极光	3,068	136,458.26	0.04
59	300962	中金辐照	5,757	133,773.12	0.04
60	300937	药易购	2,434	133,599.04	0.04
61	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.04
62	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.04
63	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.04
64	300942	易瑞生物	4,428	131,028.71	0.04

65	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.04
66	300966	共同药业	2,858	126,586.56	0.04
67	300955	嘉亨家化	2,314	115,870.88	0.04
68	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.04
69	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.04
70	300987	川网传媒	3,004	113,378.69	0.03
71	300932	三友联众	3,491	112,081.65	0.03
72	300978	东箭科技	5,930	105,678.53	0.03
73	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.03
74	300956	英力股份	3,707	100,044.12	0.03
75	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.03
76	300961	深水海纳	3,936	95,687.10	0.03
77	300952	恒辉安防	3,398	95,320.48	0.03
78	300945	曼卡龙	4,731	92,939.73	0.03
79	300948	冠中生态	3,230	92,896.54	0.03
80	300931	通用电梯	6,713	89,880.14	0.03
81	300950	德固特	2,186	89,334.49	0.03
82	300975	商络电子	4,917	88,140.51	0.03
83	688217	睿昂基因	1,040	86,736.00	0.03
84	300963	中洲特材	2,830	85,321.67	0.03
85	688316	青云科技	1,269	82,485.00	0.03
86	300967	晓鸣股份	5,061	81,674.88	0.03
87	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.02
88	300926	博俊科技	3,584	80,854.80	0.02
89	300930	屹通新材	3,220	80,013.78	0.02
90	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.02
91	300985	致远新能	2,709	77,157.33	0.02
92	300972	万辰生物	4,300	71,539.10	0.02
93	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.02
94	300927	江天化学	2,163	65,631.72	0.02
95	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.02
96	300933	中辰股份	5,717	60,405.78	0.02
97	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.02
98	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.02
99	300943	春晖智控	2,542	59,955.10	0.02
100	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.02
101	300960	通业科技	2,332	57,006.84	0.02
102	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.02
103	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.02

104	300929	华骐环保	1,827	54,892.05	0.02
105	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
106	603529	爱玛科技	928	53,935.36	0.02
107	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.02
108	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.02
109	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.02
110	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.02
111	688683	莱尔科技	3,296	48,550.08	0.01
112	300957	贝泰妮	182	45,856.72	0.01
113	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.01
114	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.01
115	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.01
116	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
117	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.01
118	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
119	605296	神农集团	569	26,856.80	0.01
120	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
121	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.01
122	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
123	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
124	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
125	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
126	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
127	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
128	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
129	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
130	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
131	605011	杭州热电	525	4,662.00	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	600809	山西汾酒	34,400,798.93	18.56
2	000858	五粮液	31,308,905.70	16.90
3	600600	青岛啤酒	28,499,414.84	15.38

4	600519	贵州茅台	28,022,352.48	15.12
5	601318	中国平安	24,660,990.29	13.31
6	603801	志邦家居	23,162,288.45	12.50
7	300896	爱美客	19,052,476.00	10.28
8	601888	中国中免	17,849,849.68	9.63
9	603259	药明康德	17,349,717.73	9.36
10	000568	泸州老窖	16,440,871.00	8.87
11	688169	石头科技	16,394,922.46	8.85
12	002572	索菲亚	16,259,810.16	8.77
13	000333	美的集团	15,973,865.73	8.62
14	300760	迈瑞医疗	15,700,099.80	8.47
15	002304	洋河股份	15,566,437.69	8.40
16	600690	海尔智家	15,226,663.20	8.22
17	688363	华熙生物	15,079,344.20	8.14
18	300015	爱尔眼科	13,336,095.49	7.20
19	603816	顾家家居	13,002,414.64	7.02
20	600276	恒瑞医药	12,357,792.37	6.67
21	000651	格力电器	10,884,930.58	5.87
22	002032	苏泊尔	9,562,165.92	5.16
23	601601	中国太保	9,466,677.51	5.11
24	603833	欧派家居	9,187,978.23	4.96
25	300894	火星人	8,783,566.00	4.74
26	002475	立讯精密	8,767,693.03	4.73
27	603288	海天味业	8,561,982.15	4.62
28	601398	工商银行	8,170,454.00	4.41
29	600612	老凤祥	7,995,537.35	4.31
30	000661	长春高新	7,522,670.00	4.06
31	600887	伊利股份	7,482,278.00	4.04
32	603882	金域医学	6,531,348.36	3.52
33	688626	翔宇医疗	6,441,702.57	3.48
34	002624	完美世界	6,085,061.00	3.28
35	600036	招商银行	5,582,260.00	3.01
36	300595	欧普康视	5,432,209.24	2.93
37	002791	坚朗五金	5,410,035.00	2.92
38	002142	宁波银行	5,400,182.06	2.91
39	600900	长江电力	5,274,553.90	2.85

40	002705	新宝股份	5,218,237.00	2.82
41	600132	重庆啤酒	5,130,320.00	2.77
42	603486	科沃斯	5,082,960.00	2.74
43	002242	九阳股份	4,361,963.00	2.35
44	002078	太阳纸业	3,995,443.00	2.16
45	000596	古井贡酒	3,909,171.00	2.11
46	000063	中兴通讯	3,762,669.00	2.03
47	300136	信维通信	3,762,306.00	2.03
48	603501	韦尔股份	3,748,787.00	2.02
49	002371	北方华创	3,746,305.00	2.02

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	34,174,314.96	18.44
2	000858	五粮液	28,609,395.24	15.44
3	600809	山西汾酒	27,848,700.50	15.03
4	603801	志邦家居	25,402,691.24	13.71
5	600600	青岛啤酒	24,157,519.87	13.04
6	601888	中国中免	18,237,744.32	9.84
7	000651	格力电器	18,139,745.54	9.79
8	601318	中国平安	17,036,203.40	9.19
9	002572	索菲亚	16,751,265.57	9.04
10	300896	爱美客	16,412,528.90	8.86
11	000333	美的集团	13,679,763.00	7.38
12	603816	顾家家居	13,547,343.24	7.31
13	603259	药明康德	13,327,174.20	7.19
14	000568	泸州老窖	12,017,416.68	6.49
15	002032	苏泊尔	11,649,957.00	6.29
16	000661	长春高新	10,785,226.00	5.82
17	600690	海尔智家	10,216,709.00	5.51
18	002475	立讯精密	9,593,653.90	5.18
19	002304	洋河股份	9,186,780.00	4.96
20	600887	伊利股份	8,711,910.83	4.70
21	603833	欧派家居	8,680,602.00	4.68
22	688169	石头科技	8,564,407.32	4.62

23	002624	完美世界	8,540,914.56	4.61
24	600612	老凤祥	8,339,640.00	4.50
25	000799	酒鬼酒	8,211,355.48	4.43
26	601398	工商银行	8,041,195.00	4.34
27	600036	招商银行	7,823,684.00	4.22
28	300015	爱尔眼科	7,427,084.42	4.01
29	603288	海天味业	7,219,221.53	3.90
30	300760	迈瑞医疗	7,069,733.80	3.82
31	603486	科沃斯	6,986,760.38	3.77
32	601601	中国太保	6,877,899.85	3.71
33	603882	金域医学	6,073,854.00	3.28
34	002705	新宝股份	5,884,400.00	3.18
35	002142	宁波银行	5,764,840.00	3.11
36	688363	华熙生物	5,570,129.60	3.01
37	000596	古井贡酒	4,894,739.00	2.64
38	600276	恒瑞医药	4,490,381.40	2.42
39	002242	九阳股份	4,119,456.00	2.22
40	600132	重庆啤酒	4,069,062.00	2.20

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	606,273,947.95
卖出股票收入（成交）总额	519,501,598.73

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，或在本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	183,968.29
2	应收证券清算款	1,142,164.87
3	应收股利	-
4	应收利息	4,350.37
5	应收申购款	5,823,565.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,154,048.88

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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
11,811	16,956.95	587.70	0.0003%	200,277,943.04	99.9997%

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	207,944.40	0.1038%

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月24日）基金份额总额	694,717,196.35
本报告期期初基金份额总额	116,229,425.27
本报告期基金总申购份额	395,026,898.45
减：本报告期基金总赎回份额	310,977,792.98
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	200,278,530.74

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	
银河证券	2	530,739,650.76	47.43%	388,126.67	47.43%	-
平安证券	2	174,672,241.25	15.61%	127,737.69	15.61%	-
安信证券	2	109,881,795.78	9.82%	80,356.06	9.82%	-
西藏东财	2	87,769,271.56	7.84%	64,185.70	7.84%	-

东兴证券	2	67,126,930.42	6.00%	49,091.99	6.00%	-
申万宏源	2	66,585,496.24	5.95%	48,696.27	5.95%	-
东方证券	2	34,974,453.84	3.13%	25,576.96	3.13%	-
太平洋	2	34,288,808.67	3.06%	25,075.04	3.06%	-
华泰证券	2	12,967,711.00	1.16%	9,483.24	1.16%	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期本基金未退租证券公司交易单元。

2、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；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。

3、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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证 券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

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	中金消费升级股票型证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2021年1月22日
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	中国证监会规定媒介	2021年3月5日

	变更的公告		
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	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
11	中金消费升级股票型证券投资基金 2020 年年度报告及摘要	中国证监会规定媒介	2021年3月31日
12	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
13	中金消费升级股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2021年4月22日
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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

§ 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，本基金单一投资者持有份额比例没有达到或超过总份额 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消费升级股票型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金消费升级股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金消费升级股票型证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金消费升级股票型证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金消费升级股票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

基金管理人或基金托管人的住所。

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