

# 鑫元鑫趋势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：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<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.....	6
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.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>19</b>
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	22
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>55</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	55
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	55
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.....	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	69
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	71
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	71
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	71
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	71
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	72
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.12 投资组合报告附注.....	72
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>74</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
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.....	74
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>75</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>76</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	76
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
10.4 基金投资策略的改变.....	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
10.8 其他重大事件.....	77
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>80</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.....	80

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

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	鑫元鑫趋势	
基金主代码	004944	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 24 日	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	153,421,605.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C
下属分级基金的交易代码:	004944	004948
报告期末下属分级基金的份额总额	130,870,492.65 份	22,551,113.02 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在秉承价值投资理念的情况下，严格控制投资组合风险，并在追求资金的安全与长期稳定增长的基础上，通过积极主动的资产配置，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采用自上而下为主的分析模式、定性分析和定量分析相结合的研究方式，跟踪宏观经济基本面、政策面和资金等多方面因素，评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，并利用上述大类资产之间的相互关联性进行灵活的资产配置，制定本基金的大类资产配置比例，并适时进行调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鑫元基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕
	联系电话	021-20892000 转
	电子邮箱	service@xyamc.com
客户服务电话	4006066188	95528
传真	021-20892111	021-63602540
注册地址	上海市静安区中山北路 909 号 12 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址	上海市静安区中山北路 909	上海市北京东路 689 号

	号 12 层	
邮政编码	200070	200001
法定代表人	洪伟	郑杨

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xyamc.com">http://www.xyamc.com</a>
基金中期报告备置地点	上海市静安区中山北路 909 号 12 层 鑫元基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 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	23,779,422.48	3,721,753.47
本期利润	24,134,773.98	3,332,801.72
加权平均基金份额本期利润	0.1773	0.1476
本期加权平均净值利润率	11.77%	9.95%
本期基金份额净值增长率	10.56%	10.34%
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	42,477,422.21	6,756,284.15
期末可供分配基金份额利润	0.3246	0.2996
期末基金资产净值	210,673,329.33	35,644,861.74
期末基金份额净值	1.6098	1.5806
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	60.98%	58.06%

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

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

鑫元鑫趋势 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	2.71%	0.68%	-0.94%	0.41%	3.65%	0.27%
过去三个月	12.01%	0.83%	2.17%	0.49%	9.84%	0.34%
过去六个月	10.56%	1.18%	0.96%	0.66%	9.60%	0.52%
过去一年	44.31%	1.14%	13.94%	0.67%	30.37%	0.47%
过去三年	58.37%	0.95%	30.87%	0.68%	27.50%	0.27%
自基金合同生效起至今	60.98%	0.89%	27.73%	0.64%	33.25%	0.25%

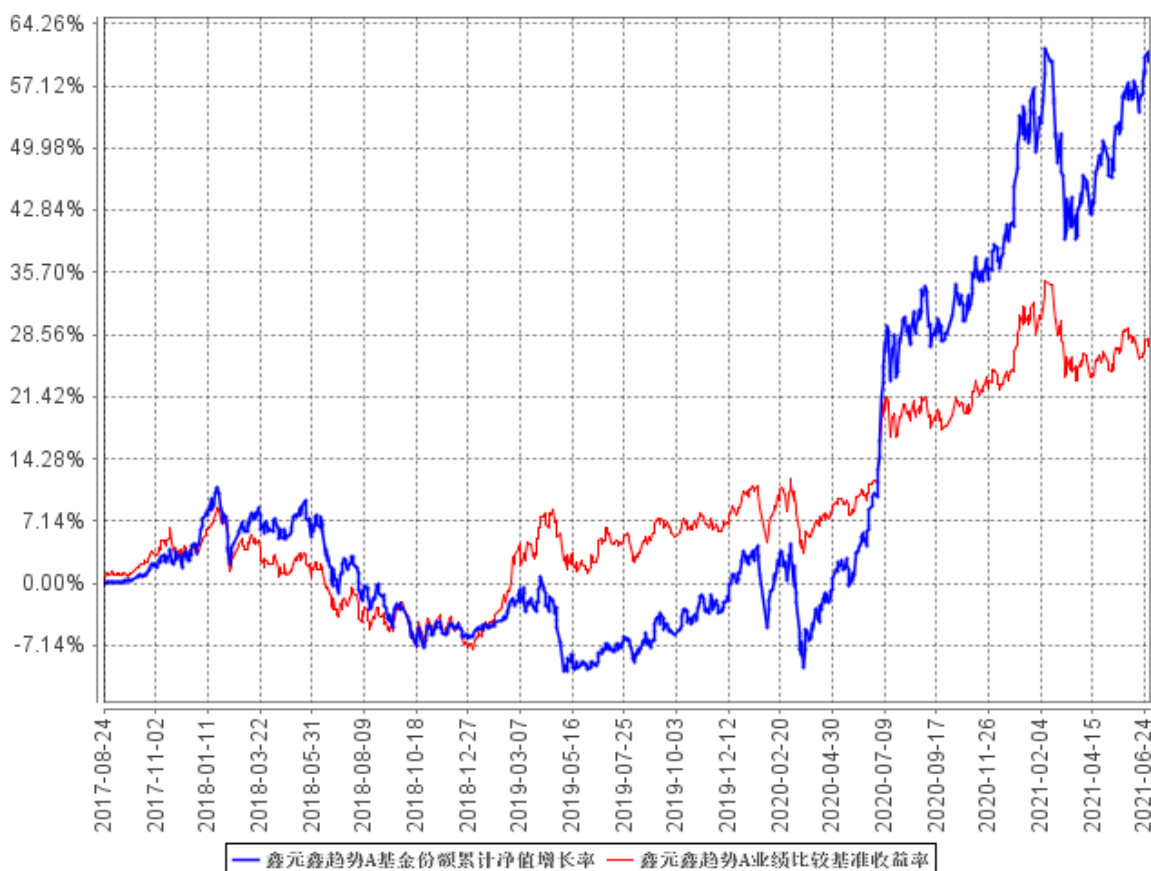


鑫元鑫趋势 C

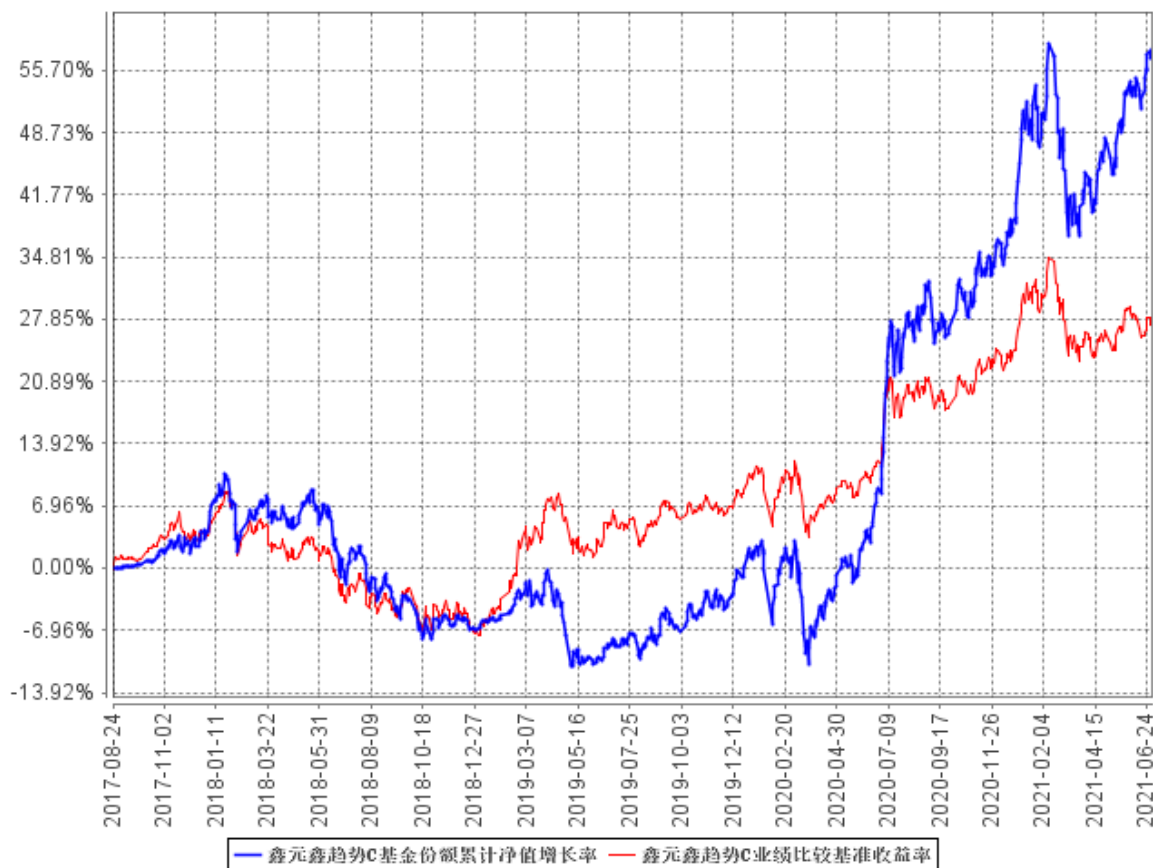
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.68%	0.68%	-0.94%	0.41%	3.62%	0.27%
过去三个月	11.89%	0.83%	2.17%	0.49%	9.72%	0.34%
过去六个月	10.34%	1.18%	0.96%	0.66%	9.38%	0.52%
过去一年	43.74%	1.14%	13.94%	0.67%	29.80%	0.47%
过去三年	56.45%	0.95%	30.87%	0.68%	25.58%	0.27%
自基金合同生效起至今	58.06%	0.89%	27.73%	0.64%	30.33%	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

鑫元鑫趋势A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鑫元鑫趋势C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的合同生效日为 2017 年 8 月 24 日。根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁玥	基金经理。鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金、鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的基金经理；兼任市场研究部总监、基金投资决策委员会委员	2017年9月4日	-	12年	学历：金融工程硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2009年7月至2015年7月任中国国际金融有限公司研究部副总经理。2015年7月加入鑫元基金担任信用研究主管，2016年7月起担任研究部总监，2018年6月起担任权益投研部总监，2021年6月担任市场研究部总监。2016年7月26日至2019年8月30日担任鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金的基金经理，2017年9月4日起担任鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年12月14日至2019年8月30日担任鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年1月23日起担任鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年5月31日至2019年6月11日担任鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理，2018年11月14日起担任鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的基金经理。
赵慧	基金经理。鑫元货币市场基金、鑫元汇利债券	2018年11月13日	-	7年	学历：经济学专业，硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010年7月起任北京汇致资本管理有限公司交易员，2011年4月至2012

	<p>型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基</p>			<p>年 2 月任南京银行金融市场部资产管理部和金融市场部投资交易中心债券交易员，2014 年 6 月加入鑫元基金，担任基金经理助理，2021 年 6 月担任固定收益部总监助理。2016 年 1 月 13 日至 2019 年 10 月 15 日担任鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2016 年 3 月 2 日起担任鑫元货币市场基金的基金经理，2016 年 3 月 9 日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 6 月 3 日起担任鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 7 月 13 日至 2019 年 10 月 22 日担任鑫元裕利债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 8 月 17 日起担任鑫元得利债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 10 月 27 日至 2019 年 10 月 11 日担任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 22 日担任鑫元招利债券型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月 13 日至 2019 年 10 月 15 日担任鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月 17 日至 2020 年 6 月 1 日担任鑫元添利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2017 年 12 月 13 日起担任鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018 年 3 月 22 日起担任</p>
--	--	--	--	--

	<p>金、鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金、鑫元悦利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元富利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元中短债债券型证券投资基金、鑫元安鑫宝货币基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元安鑫回报混合型</p>			<p>鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年4月19日至2019年10月11日担任鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年5月25日起担任鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年7月11日起担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年11月13日起担任鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金和鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月25日至2020年4月20日担任鑫元臻利债券型证券投资基金的基金经理,2019年3月1日至2020年4月20日担任鑫元承利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年4月30日起担任鑫元悦利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年5月9日至2020年6月1日担任鑫元永利债券型证券投资基金的基金经理,2019年7月5日至2020年8月12日担任鑫元恒利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年11</p>
--	---	--	--	--

	证券投资基金的基金经理；兼任固定收益部总监助理、基金投资决策委员会委员			月 13 日起担任鑫元富利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2020 年 5 月 27 日起担任鑫元中短债债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 11 月 25 日起担任鑫元安鑫宝货币市场基金的基金经理，2021 年 3 月 25 日起担任鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元安鑫回报混合型证券投资基金的基金经理。
--	-------------------------------------	--	--	---

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

2. 非首任基金经理，任职日期和离任日期分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3. 证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司制订《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》，通过系统和人工相结合的方式进

行基金投资交易行为的日常监督检查，执行异常交易行为的监控、分析与记录工作机制。报告期内未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初我们明确提出了“货币政策回归正常化，估值收缩，关注盈利”的判断。上半年权益市场经历了大幅波动和极致的分化。2月美债利率快速上升、通胀预期高企成为市场下跌的导火索，本质上是去年低利率环境下估值过度扩张积累了风险。5月以后通胀预期得到遏制，美债利率超预期下行，市场开始提前交易“通缩”。

具体到组合操作方面，我们坚定持有受益于海外资产配置、基本面扎实的个股，用分散化持股来降低组合波动率，并充分利用打新策略，为投资者增厚收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内鑫元鑫趋势 A 的基金份额净值增长率为 10.56%，鑫元鑫趋势 C 的基金份额净值增长率为 10.34%，同期业绩比较基准收益率为 0.96%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济运行至复苏尾声，伴随支持政策退出和海外供需缺口收窄，下半年经济将放缓。但在跨周期调节的政策背景下，经济下行的幅度仍将可控，并不会出现剧烈的衰退。下半年海外流动性宽松退出和疫情的反复仍将是持续观察的对宏观的扰动因素。中长期视角，我们看好权益市场受益于居民资产再配置和经济结构转型的逻辑没有变化。但这一路程将是曲折的，螺旋式上升的。下半年海外流动性收缩以及整体盈利增速开启下行趋势都可能是造成阶段性逆流的阻力。前者的冲击我们认为大概率是短期的，最终会被“以我为主”的政策定力平抑，因此冲击带来的更多是机会。而后者的冲击影响会更大，需要我们精挑细选出能够逆势穿越周期的行业和标的来应对。

在此宏观背景下，权益市场中与总量经济相关的行业仍难有趋势性行情，即使出现短期反弹也应谨慎对待。受益于转型升级和政策支持的行业，是具有确定性、稀缺性、成长性的行业，是穿越周期的不二之选。另外，政策托底经济涉及的行业也将在经济下行中受益，只是过去这一受益链条主要是地产、基建产业链相关行业；而在数字化时代浪潮下更多集中在科技领域的“新基建”。



#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由鑫元基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：鑫元鑫趋势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	856,312.66	492,296.89
结算备付金		2,257,373.93	3,750,280.50
存出保证金		21,274.01	78,672.34
交易性金融资产	6.4.7.2	289,836,630.33	354,022,022.31
其中：股票投资		191,836,630.33	233,784,022.31
基金投资		-	-
债券投资		98,000,000.00	120,238,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		480,503.71	174,982.52
应收利息	6.4.7.5	2,021,491.54	1,618,327.49
应收股利		-	-
应收申购款		3,294.89	1,099.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		295,476,881.07	360,137,681.96
<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		48,799,512.00	85,299,147.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,632.31	176,716.07
应付管理人报酬		163,222.02	180,587.96
应付托管费		30,604.11	33,860.26
应付销售服务费		14,005.58	10,800.03
应付交易费用	6.4.7.7	40,136.16	42,557.73
应交税费		-	1.00

应付利息		10,314.74	-11,463.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,263.08	189,206.85
负债合计		49,158,690.00	85,921,413.75
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	153,421,605.67	188,675,460.65
未分配利润	6.4.7.10	92,896,585.40	85,540,807.56
所有者权益合计		246,318,191.07	274,216,268.21
负债和所有者权益总计		295,476,881.07	360,137,681.96

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 153,421,605.67 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.6098 元，份额总额 130,870,492.65 份；下属 C 类基金份额净值 1.5806 元，份额总额 22,551,113.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鑫元鑫趋势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>		29,761,980.53	7,763,700.59
1.利息收入		1,106,992.98	231,261.19
其中：存款利息收入	6.4.7.11	42,220.22	76,170.17
债券利息收入		1,064,772.76	111,786.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	43,304.91
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		28,655,844.73	8,467,902.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	27,335,193.54	7,420,143.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	51,138.10	55,642.10
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,269,513.09	992,116.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-33,600.25	-1,022,129.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	32,743.07	86,666.65
<b>减：二、费用</b>		2,294,404.83	1,332,290.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	948,179.95	601,054.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	177,783.76	112,697.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	66,406.90	45,966.85
4. 交易费用	6.4.7.19	174,532.01	467,726.00
5. 利息支出		818,236.93	-
其中：卖出回购金融资产支出		818,236.93	-
6. 税金及附加		0.13	1.33
7. 其他费用	6.4.7.20	109,265.15	104,844.75
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		27,467,575.70	6,431,409.73
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		27,467,575.70	6,431,409.73

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鑫元鑫趋势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）	188,675,460.65	85,540,807.56	274,216,268.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,467,575.70	27,467,575.70
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）	-35,253,854.98	-20,111,797.86	-55,365,652.84
其中：1.基金申购款	10,400,184.80	5,508,644.44	15,908,829.24
2.基金赎回款	-45,654,039.78	-25,620,442.30	-71,274,482.08
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）	153,421,605.67	92,896,585.40	246,318,191.07
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	152,885,948.75	3,761,063.57	156,647,012.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,431,409.73	6,431,409.73
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）	-30,366,921.39	3,583,510.77	-26,783,410.62
其中：1.基金申购款	99,090,680.65	4,396,048.49	103,486,729.14
2.基金赎回款	-129,457,602.04	-812,537.72	-130,270,139.76
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）	122,519,027.36	13,775,984.07	136,295,011.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>          龙艺          </u>	<u>          陈宇          </u>	<u>          包颖          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1919 号文《关于准予鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和证监许可[2017]746 号《关于准予鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》核准，由鑫元基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》

和《鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 216,116,330.24 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 786 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 8 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 216,127,039.02 份基金份额，其中认购资金利息折合 10,708.78 份基金份额。本基金的基金管理人为鑫元基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致并报监管机构备案，基金管理人就基金合同进行了修订，并对赎回费相关规则进行了调整。该修订自 2018 年 3 月 31 日起生效。

根据《鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，即 A 类基金份额和 C 类基金份额。其中在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债、可转换债券含分离交易可转债、可交换债、短期融资券、超短期融资券等）、权证、股指期货、国债期货、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括但不限于协议存款、定期存款及其他银行存款等）、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相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 0-95%；权证资产占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题



的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运

用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

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

#### 6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

### 6.4.7 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	856,312.66
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:	856,312.66

#### 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	151,375,038.01	191,836,630.33	40,461,592.32
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	97,799,401.14	98,000,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	97,799,401.14	98,000,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	249,174,439.15	289,836,630.33	40,662,191.18

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	157.72
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	914.22
应收债券利息	2,020,410.96
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	8.64
合计	2,021,491.54

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	40,136.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	40,136.16

#### 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	2.93
应付证券出借违约金	-
预提费用	98,260.15
合计	98,263.08

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鑫元鑫趋势 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	167,340,702.11	167,340,702.11
本期申购	748,379.37	748,379.37
本期赎回(以“-”号填列)	-37,218,588.83	-37,218,588.83
- 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	130,870,492.65	130,870,492.65

金额单位：人民币元

鑫元鑫趋势 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	21,334,758.54	21,334,758.54
本期申购	9,651,805.43	9,651,805.43
本期赎回(以“-”号填列)	-8,435,450.95	-8,435,450.95
- 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	22,551,113.02	22,551,113.02

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

鑫元鑫趋势 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,651,674.88	49,661,834.03	76,313,508.91
本期利润	23,779,422.48	355,351.50	24,134,773.98
本期基金份额交易产生的变动数	-7,953,675.15	-12,691,771.06	-20,645,446.21
其中：基金申购款	175,583.89	217,807.17	393,391.06
基金赎回款	-8,129,259.04	-12,909,578.23	-21,038,837.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,477,422.21	37,325,414.47	79,802,836.68

单位：人民币元

鑫元鑫趋势 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,988,083.00	6,239,215.65	9,227,298.65
本期利润	3,721,753.47	-388,951.75	3,332,801.72
本期基金份额交易产生的变动数	46,447.68	487,200.67	533,648.35
其中：基金申购款	2,429,935.81	2,685,317.57	5,115,253.38
基金赎回款	-2,383,488.13	-2,198,116.90	-4,581,605.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,756,284.15	6,337,464.57	13,093,748.72

#### 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	5,238.50
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	36,633.14
其他	348.58
合计	42,220.22

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	27,335,193.54
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	27,335,193.54

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	80,012,128.17

减：卖出股票成本总额	52,676,934.63
买卖股票差价收入	27,335,193.54

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	51,138.10
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	51,138.10

##### 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	46,607,108.12
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	45,654,794.37
减：应收利息总额	901,175.65
买卖债券差价收入	51,138.10

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

##### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

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

注：无。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

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

注：无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,269,513.09
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	1,269,513.09

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-33,600.25
——股票投资	-120,494.62
——债券投资	86,894.37
——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	-33,600.25

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	32,743.07
合计	32,743.07

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	174,532.01
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	174,532.01

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券账户维护费	18,000.00
银行汇划费用	1,405.00

上清所证书查询费	600.00
合计	109,265.15

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鑫元基金管理有限公司（“鑫元基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构
南京银行股份有限公司（“南京银行”）	基金管理人股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	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管理费	948,179.95	601,054.24
其中：支付销售机构的客户维护费	14,204.92	53,505.47

注：基金管理费逐日累计至每月月底，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	177,783.76	112,697.69

注：基金托管费逐日累计至每月月底，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C	合计
浦发银行	-	166.20	166.20
南京银行	-	1,759.85	1,759.85
鑫元基金	-	58,871.42	58,871.42
合计	-	60,797.47	60,797.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C	合计
浦发银行	-	140.65	140.65
南京银行	-	42.46	42.46
鑫元基金	-	39,628.47	39,628.47
合计	-	39,811.58	39,811.58

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：无。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C
基金合同生效日（2017 年 8 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	20,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	20,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	13.0360%

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C
基金合同生效日（2017 年 8 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	20,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	20,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	16.3240%

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

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

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	856,312.66	5,238.50	5,465,890.51	66,653.11

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

注：无。

**6.4.11 利润分配情况**

注：无。

**6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺	2021年	2021	新股	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-

	激光	6月28日	年7月6日	未上市						
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688607	康众医疗	2021年1月25日	2021年8月2日	新股流通受限	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	-
688113	联测科技	2021年4月26日	2021年11月8日	新股流通受限	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-
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	-
688611	杭州柯林	2021年4月1日	2021年10月12日	新股流通受限	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-
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	229	10,838.57	57,698.84	-
688191	智洋创新	2021年3月30日	2021年10月8日	新股流通受限	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-
688328	深科	2021年	2021	新股	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-

	达	3月1日	年9月9日	流通受限						
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	393	13,055.46	34,387.50	-
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	249	7,041.72	28,811.79	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
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	206	10,009.54	18,620.34	-
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	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
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	-
301013	利和	2021年	2021	新股	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-



	兴	6月21日	2021年12月29日	流通受限						
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	-
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	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
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	2021年	2021	新股	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-

	生态	2月18日	年8月25日	流通受限						
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	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
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	2021年	2021	新股	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-

	新能	4月21日	年10月29日	流通受限						
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
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	-
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	2021年	2021	新股	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-

	环保	1月12日	年7月21日	流通受限						
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	360	8,856.00	58,680.00	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项	5.59	2021年7月6日	6.15	53,800	566,477.36	300,742.00	-
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项	56.35	2021年7月1日	59.49	4,000	70,273.33	225,400.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 48,799,512.00 元，于 2021 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人实行全员风险管理，风险管理是公司所有部门、全体员工的应尽职责。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	98,000,000.00	119,886,000.00
合计	98,000,000.00	119,886,000.00

注：未评级部分为国债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	0.00	352,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	352,000.00

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 48,799,512.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的



基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
---------------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

资产							
银行存款	856,312.66	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	856,312.66
结算备付金	2,257,373.93	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,257,373.93
存出保证金	21,274.01	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	21,274.01
交易性金融资产	98,000,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00	191,836,630.33	289,836,630.33
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	480,503.71	480,503.71
应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,021,491.54	2,021,491.54
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,294.89	3,294.89
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	101,134,960.60	0.00	0.00	0.00	0.00	194,341,920.47	295,476,881.07
负债							
卖出回购金融资产款	48,799,512.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	48,799,512.00
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,632.31	2,632.31
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	163,222.02	163,222.02
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	30,604.11	30,604.11
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	14,005.58	14,005.58
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	40,136.16	40,136.16
应付税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	10,314.74	10,314.74
应付利润	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	98,263.08	98,263.08
短期借款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
负债总计	48,799,512.00	0.00	0.00	0.00	0.00	359,178.00	49,158,690.00
利率敏感度缺口	52,335,448.60	0.00	0.00	0.00	0.00	193,982,742.47	246,318,191.07

上年度末 2020年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	492,296.89	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	492,296.89
结算备付金	3,750,280.50	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,750,280.50
存出保证金	78,672.34	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	78,672.34
交易性金融资产	34,996,500.00	0.00	84,889,500.00	0.00	352,000.00	233,784,022.31	354,022,022.31
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	174,982.52	174,982.52
应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,618,327.49	1,618,327.49
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,099.91	1,099.91
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	39,317,749.73	0.00	84,889,500.00	0.00	352,000.00	235,578,432.23	360,137,681.96
负债							
卖出回购金融资产款	85,299,147.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	85,299,147.00
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	176,716.07	176,716.07
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	180,587.96	180,587.96
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	33,860.26	33,860.26
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	10,800.03	10,800.03
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	42,557.73	42,557.73
应付税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1.00	1.00
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-11,463.15	-11,463.15
应付利润	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	189,206.85	189,206.85
短期借款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
负债总计	85,299,147.00	0.00	0.00	0.00	0.00	622,266.75	85,921,413.75
利率敏感度	-45,981,397.27	0.00	84,889,500.00	0.00	352,000.00	234,956,165.48	274,216,268.21

缺口							
----	--	--	--	--	--	--	--

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	10,732.16	115,899.65
2. 市场利率上升 25 个基点	-10,729.84	-115,597.84	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	191,836,630.33	77.88	233,784,022.31	85.26
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	191,836,630.33	77.88	233,784,022.31	85.26

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	沪深300指数上涨1%	1,729,090.95	2,395,931.12
沪深300指数下跌1%	-1,729,090.95	-2,395,931.12	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

##### 6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

##### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币184,852,258.09元，属于第二层次的余额为人民币104,984,372.24元，无划分为第三层次的余额。（于2020年12月31日，属于第一层次的余额为人民币

230,361,152.43 元，属于第二层次的余额为人民币 123,660,869.88 元，无划分为第三层次的余额)。

#### 6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

#### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

#### 6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

#### 6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	191,836,630.33	64.92
	其中：股票	191,836,630.33	64.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	98,000,000.00	33.17
	其中：债券	98,000,000.00	33.17
	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	3,113,686.59	1.05
8	其他各项资产	2,526,564.15	0.86
9	合计	295,476,881.07	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	2,313,561.28	0.94
B	采矿业	3,757,052.14	1.53
C	制造业	115,629,565.71	46.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,297,509.40	3.37
E	建筑业	2,595,009.37	1.05
F	批发和零售业	2,602,851.04	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	3,543,072.00	1.44
H	住宿和餐饮业	170,850.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,049,820.34	3.27
J	金融业	28,260,159.34	11.47
K	房地产业	4,050,896.00	1.64
L	租赁和商务服务业	3,003,437.00	1.22
M	科学研究和技术服务业	3,950,807.68	1.60

N	水利、环境和公共设施管理业	191,310.33	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,091,120.70	1.66
R	文化、体育和娱乐业	1,302,668.00	0.53
S	综合	26,940.00	0.01
	合计	191,836,630.33	77.88

注：相关行业分类已根据最新证监会行业分类调整。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,300	8,843,810.00	3.59
2	300750	宁德时代	11,700	6,257,160.00	2.54
3	000858	五粮液	19,800	5,898,222.00	2.39
4	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	2.09
5	000661	长春高新	9,600	3,715,200.00	1.51
6	002415	海康威视	46,500	2,999,250.00	1.22
7	600036	招商银行	54,500	2,953,355.00	1.20
8	603259	药明康德	15,752	2,466,605.68	1.00
9	002475	立讯精密	53,297	2,451,662.00	1.00
10	300760	迈瑞医疗	5,000	2,400,250.00	0.97
11	002594	比亚迪	8,300	2,083,300.00	0.85
12	000001	平安银行	91,200	2,062,944.00	0.84
13	300015	爱尔眼科	28,965	2,055,935.70	0.83
14	601888	中国中免	6,800	2,040,680.00	0.83
15	000568	泸州老窖	8,500	2,005,490.00	0.81
16	603288	海天味业	14,830	1,912,328.50	0.78
17	601318	中国平安	27,800	1,786,984.00	0.73
18	600276	恒瑞医药	26,056	1,771,026.32	0.72
19	002304	洋河股份	8,500	1,761,200.00	0.72
20	600900	长江电力	82,700	1,706,928.00	0.69
21	601012	隆基股份	18,760	1,666,638.40	0.68
22	601166	兴业银行	81,100	1,666,605.00	0.68
23	300059	东方财富	49,908	1,636,483.32	0.66



24	603444	吉比特	3,000	1,590,000.00	0.65
25	300122	智飞生物	8,500	1,587,205.00	0.64
26	600809	山西汾酒	3,500	1,568,000.00	0.64
27	600309	万华化学	13,400	1,458,188.00	0.59
28	002821	凯莱英	3,800	1,415,880.00	0.57
29	600436	片仔癀	3,000	1,344,900.00	0.55
30	002371	北方华创	4,800	1,331,424.00	0.54
31	601398	工商银行	251,300	1,299,221.00	0.53
32	600763	通策医疗	3,100	1,274,100.00	0.52
33	000002	万科 A	52,700	1,254,787.00	0.51
34	002714	牧原股份	20,470	1,244,985.40	0.51
35	000725	京东方 A	190,600	1,189,344.00	0.48
36	002142	宁波银行	30,100	1,172,997.00	0.48
37	603986	兆易创新	6,012	1,129,654.80	0.46
38	000596	古井贡酒	4,394	1,052,363.00	0.43
39	600031	三一重工	36,100	1,049,427.00	0.43
40	600030	中信证券	41,200	1,027,528.00	0.42
41	300454	深信服	3,900	1,011,972.00	0.41
42	000538	云南白药	8,400	972,048.00	0.39
43	603501	韦尔股份	3,000	966,000.00	0.39
44	000063	中兴通讯	29,000	963,670.00	0.39
45	300595	欧普康视	8,950	926,772.50	0.38
46	300014	亿纬锂能	8,903	925,288.79	0.38
47	601668	中国建筑	195,400	908,610.00	0.37
48	002230	科大讯飞	13,400	905,572.00	0.37
49	300124	汇川技术	12,100	898,546.00	0.36
50	002812	恩捷股份	3,800	889,580.00	0.36
51	000651	格力电器	17,000	885,700.00	0.36
52	002311	海大集团	10,800	881,280.00	0.36
53	601288	农业银行	286,800	869,004.00	0.35
54	600887	伊利股份	23,200	854,456.00	0.35
55	002241	歌尔股份	18,600	794,964.00	0.32
56	601601	中国太保	26,700	773,499.00	0.31
57	601919	中远海控	25,200	769,608.00	0.31
58	300347	泰格医药	3,900	753,870.00	0.31
59	601328	交通银行	150,300	736,470.00	0.30
60	002027	分众传媒	77,000	724,570.00	0.29
61	002916	深南电路	6,400	711,232.00	0.29
62	601899	紫金矿业	72,700	704,463.00	0.29

63	002271	东方雨虹	12,350	683,202.00	0.28
64	600438	通威股份	15,700	679,339.00	0.28
65	601799	星宇股份	3,000	677,160.00	0.27
66	300529	健帆生物	7,690	664,108.40	0.27
67	600585	海螺水泥	15,800	648,590.00	0.26
68	600104	上汽集团	29,100	639,327.00	0.26
69	600690	海尔智家	24,100	624,431.00	0.25
70	300433	蓝思科技	21,100	620,551.00	0.25
71	002007	华兰生物	16,810	616,590.80	0.25
72	600132	重庆啤酒	3,100	613,645.00	0.25
73	603833	欧派家居	4,280	607,588.80	0.25
74	603882	金域医学	3,800	607,126.00	0.25
75	600016	民生银行	137,400	605,934.00	0.25
76	601818	光大银行	155,500	587,790.00	0.24
77	300601	康泰生物	3,900	581,100.00	0.24
78	600346	恒力石化	22,000	577,280.00	0.23
79	002352	顺丰控股	8,400	568,680.00	0.23
80	300628	亿联网络	6,750	565,650.00	0.23
81	600703	三安光电	17,500	560,875.00	0.23
82	601766	中国中车	91,500	556,320.00	0.23
83	000625	长安汽车	21,100	554,508.00	0.23
84	002493	荣盛石化	31,350	541,414.50	0.22
85	600048	保利地产	44,900	540,596.00	0.22
86	002049	紫光国微	3,500	539,665.00	0.22
87	000166	申万宏源	114,200	534,456.00	0.22
88	600019	宝钢股份	69,800	533,272.00	0.22
89	300413	芒果超媒	7,700	528,220.00	0.21
90	000338	潍柴动力	29,500	527,165.00	0.21
91	600999	招商证券	27,380	520,767.60	0.21
92	601211	国泰君安	30,300	519,342.00	0.21
93	300142	沃森生物	8,400	518,280.00	0.21
94	600050	中国联通	118,700	512,784.00	0.21
95	002466	天齐锂业	8,200	508,564.00	0.21
96	000100	TCL 科技	66,000	504,900.00	0.20
97	600893	航发动力	9,300	494,667.00	0.20
98	600745	闻泰科技	5,100	494,190.00	0.20
99	600196	复星医药	6,800	490,484.00	0.20
100	603799	华友钴业	4,200	479,640.00	0.19
101	002129	中环股份	12,400	478,640.00	0.19

102	601688	华泰证券	29,800	470,840.00	0.19
103	603160	汇顶科技	3,600	466,668.00	0.19
104	300498	温氏股份	32,260	463,576.20	0.19
105	300676	华大基因	3,900	462,540.00	0.19
106	002460	赣锋锂业	3,800	460,142.00	0.19
107	001979	招商蛇口	42,000	459,900.00	0.19
108	000776	广发证券	29,800	451,172.00	0.18
109	688063	派能科技	2,277	448,113.60	0.18
110	601229	上海银行	54,000	442,800.00	0.18
111	601988	中国银行	140,900	433,972.00	0.18
112	002001	新和成	15,080	432,494.40	0.18
113	600406	国电南瑞	18,480	429,475.20	0.17
114	300033	同花顺	3,800	428,564.00	0.17
115	600588	用友网络	12,840	427,058.40	0.17
116	600028	中国石化	97,200	423,792.00	0.17
117	603993	洛阳钼业	81,000	417,960.00	0.17
118	600919	江苏银行	58,350	414,285.00	0.17
119	300558	贝达药业	3,800	411,312.00	0.17
120	600570	恒生电子	4,370	407,502.50	0.17
121	000895	双汇发展	12,700	403,860.00	0.16
122	600837	海通证券	35,000	402,500.00	0.16
123	002236	大华股份	18,900	398,790.00	0.16
124	002050	三花智控	16,270	390,154.60	0.16
125	601169	北京银行	79,900	389,113.00	0.16
126	601390	中国中铁	73,900	387,236.00	0.16
127	601155	新城控股	9,300	386,880.00	0.16
128	000963	华东医药	8,400	386,484.00	0.16
129	601100	恒立液压	4,448	382,172.16	0.16
130	600779	水井坊	3,000	379,050.00	0.15
131	601006	大秦铁路	57,100	375,718.00	0.15
132	601225	陕西煤业	31,500	373,275.00	0.15
133	601989	中国重工	87,900	362,148.00	0.15
134	300450	先导智能	6,000	360,840.00	0.15
135	600660	福耀玻璃	6,400	357,440.00	0.15
136	002179	中航光电	4,500	355,590.00	0.14
137	300408	三环集团	8,300	352,086.00	0.14
138	601628	中国人寿	10,300	349,067.00	0.14
139	600600	青岛啤酒	3,000	346,950.00	0.14
140	603658	安图生物	4,480	339,449.60	0.14

141	601186	中国铁建	45,500	338,065.00	0.14
142	600741	华域汽车	12,800	336,256.00	0.14
143	600486	扬农化工	3,000	335,310.00	0.14
144	603939	益丰药房	5,966	334,632.94	0.14
145	601088	中国神华	17,122	334,221.44	0.14
146	601857	中国石油	63,100	333,799.00	0.14
147	000768	中航西飞	12,200	320,616.00	0.13
148	601877	正泰电器	9,500	317,110.00	0.13
149	000069	华侨城 A	42,000	312,480.00	0.13
150	601336	新华保险	6,800	312,188.00	0.13
151	601066	中信建投	9,900	311,157.00	0.13
152	000876	新希望	21,100	309,537.00	0.13
153	000157	中联重科	33,300	307,692.00	0.12
154	002024	苏宁易购	53,800	300,742.00	0.12
155	601901	方正证券	31,800	297,648.00	0.12
156	300207	欣旺达	9,100	296,296.00	0.12
157	002624	完美世界	12,350	295,288.50	0.12
158	600015	华夏银行	47,700	295,263.00	0.12
159	000977	浪潮信息	10,412	292,889.56	0.12
160	002555	三七互娱	12,100	290,642.00	0.12
161	002601	龙佰集团	8,400	290,472.00	0.12
162	300699	光威复材	3,800	288,610.00	0.12
163	300003	乐普医疗	8,900	285,868.00	0.12
164	601788	光大证券	15,900	284,451.00	0.12
165	600926	杭州银行	19,200	283,200.00	0.11
166	300146	汤臣倍健	8,500	279,650.00	0.11
167	600547	山东黄金	14,020	269,464.40	0.11
168	601600	中国铝业	50,700	268,710.00	0.11
169	300012	华测检测	8,400	267,792.00	0.11
170	600111	北方稀土	12,900	267,030.00	0.11
171	600183	生益科技	11,400	266,874.00	0.11
172	002410	广联达	3,900	265,980.00	0.11
173	002600	领益智造	28,600	262,834.00	0.11
174	002414	高德红外	9,508	262,230.64	0.11
175	603899	晨光文具	3,100	262,136.00	0.11
176	600085	同仁堂	6,400	261,440.00	0.11
177	603517	绝味食品	3,100	261,299.00	0.11
178	600010	包钢股份	167,700	259,935.00	0.11
179	300144	宋城演艺	15,400	258,720.00	0.11

180	600426	华鲁恒升	8,340	258,123.00	0.10
181	603338	浙江鼎力	4,380	257,062.20	0.10
182	601985	中国核电	50,800	257,048.00	0.10
183	600760	中航沈飞	4,200	253,260.00	0.10
184	601939	建设银行	37,852	251,715.80	0.10
185	002032	苏泊尔	3,900	248,781.00	0.10
186	300357	我武生物	3,879	248,721.48	0.10
187	000938	紫光股份	11,260	246,368.80	0.10
188	002690	美亚光电	4,400	245,344.00	0.10
189	601377	兴业证券	25,200	243,432.00	0.10
190	600886	国投电力	25,300	243,133.00	0.10
191	000425	徐工机械	37,700	240,149.00	0.10
192	000066	中国长城	16,300	237,980.00	0.10
193	000786	北新建材	6,000	235,500.00	0.10
194	603589	口子窖	3,400	230,146.00	0.09
195	603883	老百姓	4,320	227,577.60	0.09
196	600176	中国巨石	14,645	227,143.95	0.09
197	002736	国信证券	21,000	225,750.00	0.09
198	600460	士兰微	4,000	225,400.00	0.09
199	600958	东方证券	22,300	222,777.00	0.09
200	002384	东山精密	10,400	216,736.00	0.09
201	600332	白云山	6,400	216,640.00	0.09
202	600795	国电电力	87,200	211,896.00	0.09
203	600362	江西铜业	9,400	210,372.00	0.09
204	601138	工业富联	16,800	208,488.00	0.08
205	002013	中航机电	20,500	206,435.00	0.08
206	002202	金风科技	16,900	205,504.00	0.08
207	601838	成都银行	16,100	203,504.00	0.08
208	600699	均胜电子	7,900	201,608.00	0.08
209	002739	万达电影	12,600	198,954.00	0.08
210	002340	格林美	21,200	198,220.00	0.08
211	600674	川投能源	15,900	196,047.00	0.08
212	002074	国轩高科	4,500	196,020.00	0.08
213	000703	恒逸石化	16,400	195,980.00	0.08
214	000050	深天马 A	13,800	195,684.00	0.08
215	600845	宝信软件	3,830	194,947.00	0.08
216	601618	中国中冶	65,200	194,296.00	0.08
217	600029	南方航空	31,800	191,436.00	0.08
218	000825	太钢不锈	25,400	190,246.00	0.08

219	600885	宏发股份	3,000	188,100.00	0.08
220	300285	国瓷材料	3,800	185,250.00	0.08
221	000027	深圳能源	20,140	184,683.80	0.07
222	000783	长江证券	25,200	184,464.00	0.07
223	000983	山西焦煤	22,110	183,734.10	0.07
224	600009	上海机场	3,800	182,894.00	0.07
225	601669	中国电建	47,200	182,664.00	0.07
226	002508	老板电器	3,900	181,350.00	0.07
227	002153	石基信息	7,700	181,027.00	0.07
228	600315	上海家化	3,000	180,420.00	0.07
229	600352	浙江龙盛	13,000	178,620.00	0.07
230	600115	中国东航	34,900	177,292.00	0.07
231	000860	顺鑫农业	4,200	177,156.00	0.07
232	000039	中集集团	9,700	176,346.00	0.07
233	002152	广电运通	13,500	175,905.00	0.07
234	002372	伟星新材	8,500	175,695.00	0.07
235	600061	国投资本	20,368	172,924.32	0.07
236	600089	特变电工	13,300	170,905.00	0.07
237	600754	锦江酒店	3,000	170,850.00	0.07
238	600536	中国软件	3,000	170,790.00	0.07
239	601021	春秋航空	3,000	170,700.00	0.07
240	002353	杰瑞股份	3,800	169,860.00	0.07
241	002422	科伦药业	8,500	169,575.00	0.07
242	002078	太阳纸业	12,600	168,210.00	0.07
243	603369	今世缘	3,100	167,896.00	0.07
244	300253	卫宁健康	10,230	166,442.10	0.07
245	000932	华菱钢铁	25,200	166,320.00	0.07
246	601117	中国化学	18,900	165,564.00	0.07
247	601933	永辉超市	34,900	165,077.00	0.07
248	600383	金地集团	16,000	163,840.00	0.07
249	600298	安琪酵母	3,000	163,140.00	0.07
250	000709	河钢股份	65,900	162,114.00	0.07
251	600109	国金证券	12,700	161,163.00	0.07
252	603707	健友股份	3,860	161,155.00	0.07
253	002157	正邦科技	13,400	160,130.00	0.07
254	600219	南山铝业	44,400	159,840.00	0.06
255	600038	中直股份	3,000	158,220.00	0.06
256	000723	美锦能源	20,900	158,004.00	0.06
257	002281	光迅科技	6,400	157,440.00	0.06

258	601233	桐昆股份	6,400	154,176.00	0.06
259	002044	美年健康	16,900	153,959.00	0.06
260	002385	大北农	22,600	153,680.00	0.06
261	600704	物产中大	19,420	152,835.40	0.06
262	600018	上港集团	31,600	150,732.00	0.06
263	002439	启明星辰	5,178	150,213.78	0.06
264	601699	潞安环能	12,700	149,987.00	0.06
265	000630	铜陵有色	55,100	149,872.00	0.06
266	000656	金科股份	25,700	148,803.00	0.06
267	600521	华海药业	7,040	146,995.20	0.06
268	002373	千方科技	8,800	146,960.00	0.06
269	002507	涪陵榨菜	3,900	146,874.00	0.06
270	300308	中际旭创	3,800	146,376.00	0.06
271	002120	韵达股份	10,790	145,988.70	0.06
272	002223	鱼跃医疗	3,800	144,894.00	0.06
273	002500	山西证券	21,550	144,600.50	0.06
274	000028	国药一致	3,800	143,792.00	0.06
275	600188	兖州煤业	9,300	142,848.00	0.06
276	002463	沪电股份	9,200	142,324.00	0.06
277	002065	东华软件	17,900	141,947.00	0.06
278	601872	招商轮船	30,720	141,926.40	0.06
279	600068	葛洲坝	18,700	140,063.00	0.06
280	000423	东阿阿胶	3,900	140,049.00	0.06
281	601990	南京证券	13,300	139,916.00	0.06
282	300136	信维通信	4,500	138,960.00	0.06
283	000830	鲁西化工	7,400	138,602.00	0.06
284	002673	西部证券	16,800	138,600.00	0.06
285	601727	上海电气	31,900	135,256.00	0.05
286	000998	隆平高科	8,400	134,736.00	0.05
287	000960	锡业股份	8,400	134,652.00	0.05
288	601111	中国国航	17,200	133,816.00	0.05
289	002405	四维图新	9,100	133,770.00	0.05
290	603866	桃李面包	4,280	133,536.00	0.05
291	600549	厦门钨业	6,400	133,312.00	0.05
292	601108	财通证券	12,700	133,223.00	0.05
293	600739	辽宁成大	6,400	133,184.00	0.05
294	000728	国元证券	16,600	132,302.00	0.05
295	601555	东吴证券	15,830	132,022.20	0.05
296	300251	光线传媒	12,200	131,882.00	0.05

297	601966	玲珑轮胎	3,000	131,220.00	0.05
298	600655	豫园股份	11,300	130,967.00	0.05
299	601878	浙商证券	10,000	130,800.00	0.05
300	002092	中泰化学	12,700	130,429.00	0.05
301	601607	上海医药	6,100	128,893.00	0.05
302	603019	中科曙光	4,660	128,662.60	0.05
303	002294	信立泰	3,900	128,310.00	0.05
304	600872	中炬高新	3,000	126,060.00	0.05
305	600161	天坛生物	3,640	124,670.00	0.05
306	600705	中航产融	32,200	124,614.00	0.05
307	601018	宁波港	31,500	124,425.00	0.05
308	002127	南极电商	12,700	124,079.00	0.05
309	000961	中南建设	20,800	123,136.00	0.05
310	000333	美的集团	1,700	121,329.00	0.05
311	002456	欧菲光	13,500	119,880.00	0.05
312	002146	荣盛发展	21,200	119,568.00	0.05
313	002299	圣农发展	5,000	119,400.00	0.05
314	002797	第一创业	16,700	119,238.00	0.05
315	601238	广汽集团	9,200	119,140.00	0.05
316	600066	宇通客车	9,500	118,655.00	0.05
317	000988	华工科技	5,000	117,600.00	0.05
318	000401	冀东水泥	9,500	117,325.00	0.05
319	600642	申能股份	19,100	117,274.00	0.05
320	002465	海格通信	12,100	114,466.00	0.05
321	002010	传化智联	14,800	114,108.00	0.05
322	000402	金融街	16,900	114,075.00	0.05
323	002603	以岭药业	3,900	113,724.00	0.05
324	000975	银泰黄金	11,720	111,457.20	0.05
325	600392	盛和资源	6,400	111,104.00	0.05
326	000750	国海证券	26,200	111,088.00	0.05
327	600867	通化东宝	9,300	111,042.00	0.05
328	000671	阳光城	21,300	110,760.00	0.04
329	601216	君正集团	21,600	109,944.00	0.04
330	002180	纳思达	3,400	109,480.00	0.04
331	600489	中金黄金	12,700	109,474.00	0.04
332	002926	华西证券	11,300	108,819.00	0.04
333	002558	巨人网络	8,100	107,730.00	0.04
334	600369	西南证券	22,100	107,627.00	0.04
335	600606	绿地控股	19,700	107,365.00	0.04



336	600801	华新水泥	6,100	107,177.00	0.04
337	000686	东北证券	12,600	106,470.00	0.04
338	600637	东方明珠	12,900	105,651.00	0.04
339	601231	环旭电子	6,100	102,541.00	0.04
340	300383	光环新网	7,100	102,169.00	0.04
341	600875	东方电气	9,300	102,021.00	0.04
342	000999	华润三九	3,800	101,650.00	0.04
343	601198	东兴证券	9,300	101,649.00	0.04
344	600516	方大炭素	13,480	100,291.20	0.04
345	600511	国药股份	3,000	99,180.00	0.04
346	600998	九州通	6,400	98,368.00	0.04
347	002081	金螳螂	12,400	98,208.00	0.04
348	600909	华安证券	17,550	97,753.50	0.04
349	600208	新湖中宝	31,700	96,368.00	0.04
350	600598	北大荒	6,400	95,744.00	0.04
351	300296	利亚德	12,200	95,404.00	0.04
352	600535	天士力	6,400	94,784.00	0.04
353	600170	上海建工	34,300	94,668.00	0.04
354	300070	碧水源	12,700	92,837.00	0.04
355	000627	天茂集团	25,600	92,672.00	0.04
356	601997	贵阳银行	12,900	92,364.00	0.04
357	600500	中化国际	11,700	91,962.00	0.04
358	002572	索菲亚	3,800	91,960.00	0.04
359	600398	海澜之家	12,700	91,948.00	0.04
360	000729	燕京啤酒	12,600	91,224.00	0.04
361	002773	康弘药业	3,900	90,207.00	0.04
362	300024	机器人	8,400	89,628.00	0.04
363	600522	中天科技	8,900	89,000.00	0.04
364	600118	中国卫星	3,000	87,780.00	0.04
365	600027	华电国际	25,500	87,720.00	0.04
366	002506	协鑫集成	25,200	87,696.00	0.04
367	002387	维信诺	8,300	86,569.00	0.04
368	600583	海油工程	19,200	86,400.00	0.04
369	002563	森马服饰	7,200	86,040.00	0.03
370	601099	太平洋	25,200	85,428.00	0.03
371	600256	广汇能源	25,600	85,248.00	0.03
372	601360	三六零	6,900	84,249.00	0.03
373	601992	金隅集团	31,300	84,197.00	0.03
374	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.03

375	600895	张江高科	4,600	84,042.00	0.03
376	600160	巨化股份	9,500	83,980.00	0.03
377	002124	天邦股份	11,940	83,699.40	0.03
378	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.03
379	600297	广汇汽车	28,400	81,792.00	0.03
380	600271	航天信息	6,200	80,786.00	0.03
381	600977	中国电影	6,400	80,192.00	0.03
382	000581	威孚高科	3,800	79,154.00	0.03
383	300017	网宿科技	13,500	78,975.00	0.03
384	600567	山鹰国际	22,800	78,660.00	0.03
385	600153	建发股份	9,616	77,889.60	0.03
386	000778	新兴铸管	20,900	77,748.00	0.03
387	002019	亿帆医药	4,500	77,625.00	0.03
388	000060	中金岭南	16,900	76,388.00	0.03
389	600528	中铁工业	9,300	75,330.00	0.03
390	000738	航发控制	3,600	74,988.00	0.03
391	600372	中航电子	4,500	74,475.00	0.03
392	300072	三聚环保	12,700	72,898.00	0.03
393	600004	白云机场	6,400	71,552.00	0.03
394	600782	新钢股份	12,700	70,866.00	0.03
395	600879	航天电子	9,300	69,936.00	0.03
396	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.03
397	600487	亨通光电	6,000	68,400.00	0.03
398	600688	上海石化	18,100	68,056.00	0.03
399	603858	步长制药	3,000	67,470.00	0.03
400	600011	华能国际	15,900	67,098.00	0.03
401	603077	和邦生物	31,700	65,936.00	0.03
402	600021	上海电力	9,500	65,645.00	0.03
403	000089	深圳机场	8,400	65,268.00	0.03
404	600967	内蒙一机	6,400	64,768.00	0.03
405	601598	中国外运	12,678	64,023.90	0.03
406	600582	天地科技	16,100	62,790.00	0.03
407	002424	贵州百灵	8,300	61,088.00	0.02
408	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.02
409	600380	健康元	4,412	60,576.76	0.02
410	002399	海普瑞	3,800	60,534.00	0.02
411	601800	中国交建	9,300	60,264.00	0.02
412	601128	常熟银行	9,700	60,140.00	0.02
413	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.02

414	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.02
415	000623	吉林敖东	3,800	58,862.00	0.02
416	300919	中伟股份	360	58,680.00	0.02
417	000559	万向钱潮	11,000	58,410.00	0.02
418	600498	烽火通信	3,100	57,753.00	0.02
419	300957	贝泰妮	229	57,698.84	0.02
420	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.02
421	600026	中远海能	9,200	56,672.00	0.02
422	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.02
423	600282	南钢股份	15,900	56,604.00	0.02
424	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
425	601098	中南传媒	6,300	55,566.00	0.02
426	600566	济川药业	3,100	55,490.00	0.02
427	600273	嘉化能源	6,300	54,810.00	0.02
428	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
429	000826	启迪环境	10,100	54,035.00	0.02
430	601000	唐山港	21,900	52,779.00	0.02
431	601880	辽港股份	30,700	52,497.00	0.02
432	600201	生物股份	3,000	52,350.00	0.02
433	600916	中国黄金	3,171	49,213.92	0.02
434	000681	视觉中国	3,800	49,134.00	0.02
435	600835	上海机电	3,000	48,750.00	0.02
436	601333	广深铁路	22,200	47,064.00	0.02
437	002583	海能达	9,200	46,368.00	0.02
438	600648	外高桥	3,100	45,818.00	0.02
439	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
440	600643	爱建集团	6,400	44,672.00	0.02
441	000839	中信国安	21,100	43,677.00	0.02
442	300894	火星人	628	42,704.00	0.02
443	002038	双鹭药业	3,800	40,014.00	0.02
444	000046	泛海控股	15,700	36,110.00	0.01
445	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
446	600062	华润双鹤	2,900	34,539.00	0.01
447	300979	华利集团	393	34,387.50	0.01
448	600777	新潮能源	19,700	30,929.00	0.01
449	300973	立高食品	249	28,811.79	0.01
450	000732	泰禾集团	13,100	28,296.00	0.01
451	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
452	600673	东阳光	6,000	26,940.00	0.01

453	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
454	603659	璞泰来	140	19,124.00	0.01
455	300981	中红医疗	206	18,620.34	0.01
456	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
457	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
458	300925	法本信息	600	15,774.00	0.01
459	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
460	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.01
461	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
462	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
463	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
464	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
465	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
466	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
467	002841	视源股份	100	12,429.00	0.01
468	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
469	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
470	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
471	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
472	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
473	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
474	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
475	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
476	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
477	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
478	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
479	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
480	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
481	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
482	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
483	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
484	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
485	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
486	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
487	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
488	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
489	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
490	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
491	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00

492	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
493	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
494	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
495	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
496	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
497	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
498	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
499	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
500	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
501	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
502	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
503	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
504	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
505	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
506	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
507	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
508	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
509	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
510	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
511	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
512	300271	华宇软件	100	1,925.00	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	600905	三峡能源	3,436,527.95	1.25
2	688819	天能股份	189,768.39	0.07
3	688606	奥泰生物	180,588.17	0.07
4	300979	华利集团	130,521.38	0.05
5	688680	海优新材	127,500.62	0.05
6	688183	生益电子	123,355.44	0.04
7	688619	罗普特	113,079.36	0.04
8	688425	铁建重工	109,487.63	0.04
9	300957	贝泰妮	108,149.05	0.04
10	688317	之江生物	108,093.22	0.04

11	688687	凯因科技	101,618.92	0.04
12	300981	中红医疗	99,998.22	0.04
13	688669	聚石化学	98,258.65	0.04
14	688131	皓元医药	96,575.14	0.04
15	688079	美迪凯	96,213.98	0.04
16	688696	极米科技	95,616.95	0.03
17	688316	青云科技	90,963.60	0.03
18	688083	中望软件	90,149.50	0.03
19	688499	利元亨	83,488.65	0.03
20	601963	重庆银行	80,921.76	0.03

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	2,389,715.00	0.87
2	000858	五粮液	1,836,365.00	0.67
3	600905	三峡能源	1,742,065.00	0.64
4	300750	宁德时代	1,358,453.00	0.50
5	000661	长春高新	1,329,840.00	0.48
6	002415	海康威视	926,411.82	0.34
7	600036	招商银行	876,615.00	0.32
8	002475	立讯精密	847,363.00	0.31
9	603259	药明康德	698,260.00	0.25
10	300760	迈瑞医疗	681,597.00	0.25
11	601318	中国平安	677,668.00	0.25
12	600276	恒瑞医药	668,606.00	0.24
13	603288	海天味业	664,347.00	0.24
14	000001	平安银行	638,025.00	0.23
15	000568	泸州老窖	629,930.00	0.23
16	601888	中国中免	616,000.00	0.22
17	002594	比亚迪	594,930.00	0.22
18	300015	爱尔眼科	562,990.00	0.21
19	601166	兴业银行	562,644.00	0.21
20	688390	固德威	555,777.00	0.20

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	10,850,037.27
卖出股票收入（成交）总额	80,012,128.17

**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	98,000,000.00	39.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	98,000,000.00	39.79

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019640	20 国债 10	980,000	98,000,000.00	39.79

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	21,274.01
2	应收证券清算款	480,503.71
3	应收股利	-
4	应收利息	2,021,491.54
5	应收申购款	3,294.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,526,564.15



**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	2.09	新股流通受限

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
鑫元鑫趋势 A	211	620,239.30	127,799,245.07	97.65%	3,071,247.58	2.35%
鑫元鑫趋势 C	156	144,558.42	20,000,000.00	88.69%	2,551,113.02	11.31%
合计	367	418,042.52	147,799,245.07	96.34%	5,622,360.60	3.66%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	鑫元鑫趋势 A	237,429.02	0.1814%
	鑫元鑫趋势 C	3,003.33	0.0133%
	合计	240,432.35	0.1567%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	鑫元鑫趋势 A	0~10
	鑫元鑫趋势 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鑫元鑫趋势 A	10~50
	鑫元鑫趋势 C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元鑫趋势 A	鑫元鑫趋势 C
基金合同生效日（2017 年 8 月 24 日）基金份额总额	23,254,535.06	192,872,503.96
本报告期期初基金份额总额	167,340,702.11	21,334,758.54
本报告期基金总申购份额	748,379.37	9,651,805.43
减：本报告期基金总赎回份额	37,218,588.83	8,435,450.95
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	130,870,492.65	22,551,113.02

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

2、基金托管人：本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

2、本报告期托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	2	49,328,397.57	61.65%	48,605.51	43.27%	-
安信证券	2	30,683,730.60	38.35%	63,728.52	56.73%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-

注：（1）交易单元的主要选择标准：

1) 财务状况良好，经营行为规范；

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

易设施符合代理基金进行证券交易的需要；

3) 具备研究实力，能及时提供高质量的研究服务；

4) 收取的交易佣金费率合理。

(2) 交易单元的选择程序：

1) 市场研究部根据选择标准选取合作券商，发起签署研究服务协议；

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

(3) 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
天风证券	65,349,290.00	99.45%	1,187,800,000.00	25.26%	-	-
安信证券	358,534.55	0.55%	3,514,900,000.00	74.74%	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站	2021 年 1 月 22 日
2	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 1 月 22 日
3	鑫元基金管理有限公司关于修订旗下 7 只公募基金基金合同等相关法律文件的公告	公司官网、证券时报、上海证券报、中国证券报	2021 年 2 月 3 日
4	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同	公司网站	2021 年 2 月 3 日
5	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2021 年 2 月 3 日
6	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 1 号）	公司网站	2021 年 2 月 5 日

7	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金（鑫元鑫趋势 A 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 2 月 5 日
8	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金（鑫元鑫趋势 C 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 2 月 5 日
9	鑫元基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 2 月 6 日
10	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站	2021 年 3 月 31 日
11	鑫元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	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 3 月 31 日
12	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站	2021 年 4 月 22 日
13	鑫元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	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 4 月 22 日
14	鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 4 月 29 日
15	鑫元基金管理有限公司关于修订旗下 10 只公募基金基金合同等相关法律文件的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 5 月 26 日
16	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同	公司网站	2021 年 5 月 26 日
17	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2021 年 5 月 26 日
18	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 2 号）	公司网站	2021 年 5 月 31 日
19	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金（鑫元鑫趋势 A 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 5 月 31 日
20	鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金（鑫元鑫趋势 C 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 5 月 31 日

21	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购、定期定额投资费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 6 月 30 日
----	--	----------------------------	-----------------

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210630	70,559,360.89	0.00	12,800,000.00	57,759,360.89	37.65%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

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

#### （一）赎回申请延期办理或暂停赎回的风险

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

#### （二）基金净值大幅波动的风险

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

#### （三）基金投资目标偏离的风险

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

#### （四）基金合同提前终止或其它相关风险

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批复、营业执照。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件。

鑫元基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日