

# 中金精选股票型集合资产管理计划 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：中国国际金融股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	44
7.12 投资组合报告附注 .....	44
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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情况.....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>47</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 .....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金精选股票型集合资产管理计划	
基金简称	集合-中金精选	
基金主代码	920002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 8 月 4 日	
基金管理人	中国国际金融股份有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	186,932,856.06 份	
基金合同存续期	自基金合同生效后不超过 3 年	
下属分级基金的基金简称	中金精选 A 类份额	中金精选 C 类份额
下属分级基金的交易代码	920002	920922
报告期末下属分级基金的份额总额	180,209,139.60 份	6,723,716.46 份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合立足于通过筛选中长期高质量的成长股，在控制一定风险的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本集合计划致力于通过寻找中长期高质量的成长标的来为投资者创造价值，管理人认为唯一能够对抗经济周期的并不是所谓的防御，而是持续的高成长，管理人致力于寻找具备高护城河的成长股，整体组合偏好制造业、消费领域具备核心竞争优势的企业，通过量化护城河深度来为企业定价。为应对系统性风险，本集合计划会在满足证监会相关规定的基础上，择机配置部分股指期货对冲市场风险。债券方面，本集合计划主要配置具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券逆回购、银行存款等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*90%+中证全债指数收益率*5%+活期存款利率*5%，主要基于本组合投资策略为寻找具备中期核心竞争力的高质量成长标的，管理人认为沪深 300 指数成分股聚集了中国高竞争力的一批企业，具有较好的代表性。如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称，或今后法律法规发生变化，或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本管理人可依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，经履行适当程序，调整业绩比较基准并及时公告，而无需召开集合

	计划份额持有人大会。
风险收益特征	本集合计划为股票型集合资产管理计划，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划、混合型基金、混合型集合资产管理计划。

### 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		中国国际金融股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	宋璐芳	许俊
	联系电话	010-65051166	010-66594319
	电子邮箱	songlf@cicc.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		010-65051166	95566
传真		86(10) 65059372	010-66594942
注册地址		北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京朝阳区建国门外大街 1 号国贸 3 期 B 座 42 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100004	100818
法定代表人		沈如军	刘连舸

### 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	www.cicc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	中金精选 A 类份额	中金精选 C 类份额
本期已实现收益	5,156,983.75	147,675.58
本期利润	-26,396,402.53	-1,117,193.04
加权平均基金份额本期利润	-0.1433	-0.1533
本期加权平均净	-7.73%	-8.36%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	-6.81%	-7.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	274,565,477.70	6,079,213.55
期末可供分配基金份额利润	1.5236	0.9041
期末基金资产净值	346,409,629.18	12,802,930.01
期末基金份额净值	1.9223	1.9041
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.70%	-1.52%

注：①所述集合计划业绩指标不包括持有人交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。②本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益。③对期末可供分配利润，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

中金精选 A 类份额

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	8.92%	0.94%	8.63%	0.96%	0.29%	-0.02%
过去三个月	8.44%	1.35%	5.70%	1.29%	2.74%	0.06%
过去六个月	-6.81%	1.38%	-8.14%	1.31%	1.33%	0.07%

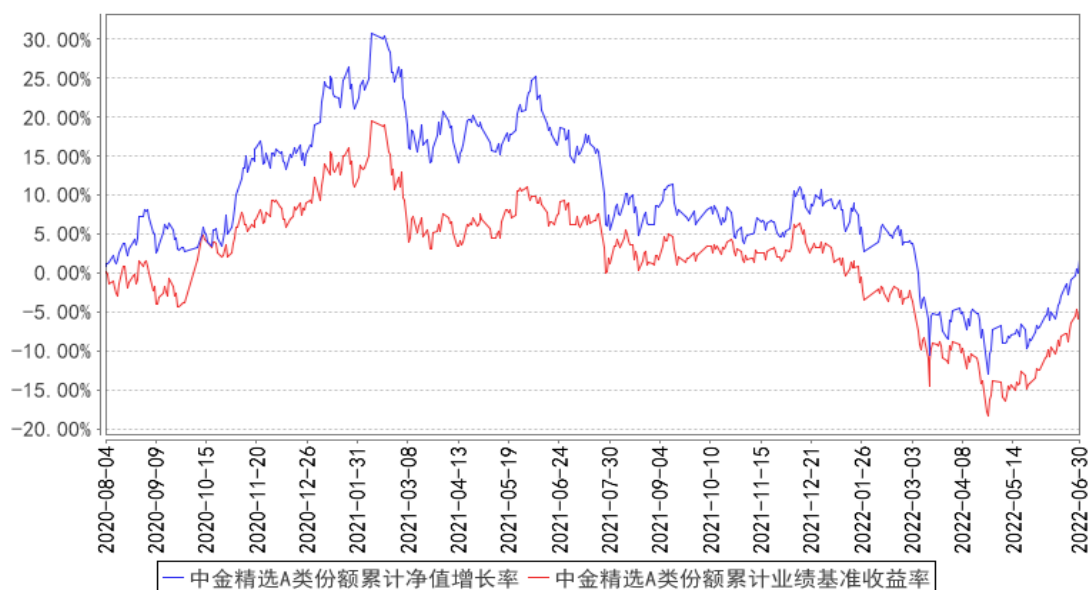
过去一年	-13.30%	1.22%	-12.44%	1.12%	-0.86%	0.10%
自基金合同生效起至今	1.70%	1.15%	-4.70%	1.10%	6.40%	0.05%

中金精选 C 类份额

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	8.87%	0.94%	8.63%	0.96%	0.24%	-0.02%
过去三个月	8.30%	1.35%	5.70%	1.29%	2.60%	0.06%
过去六个月	-7.04%	1.38%	-8.14%	1.31%	1.10%	0.07%
过去一年	-13.74%	1.22%	-12.44%	1.12%	-1.30%	0.10%
自基金合同生效起至今	-1.52%	1.16%	-3.85%	1.10%	2.33%	0.06%

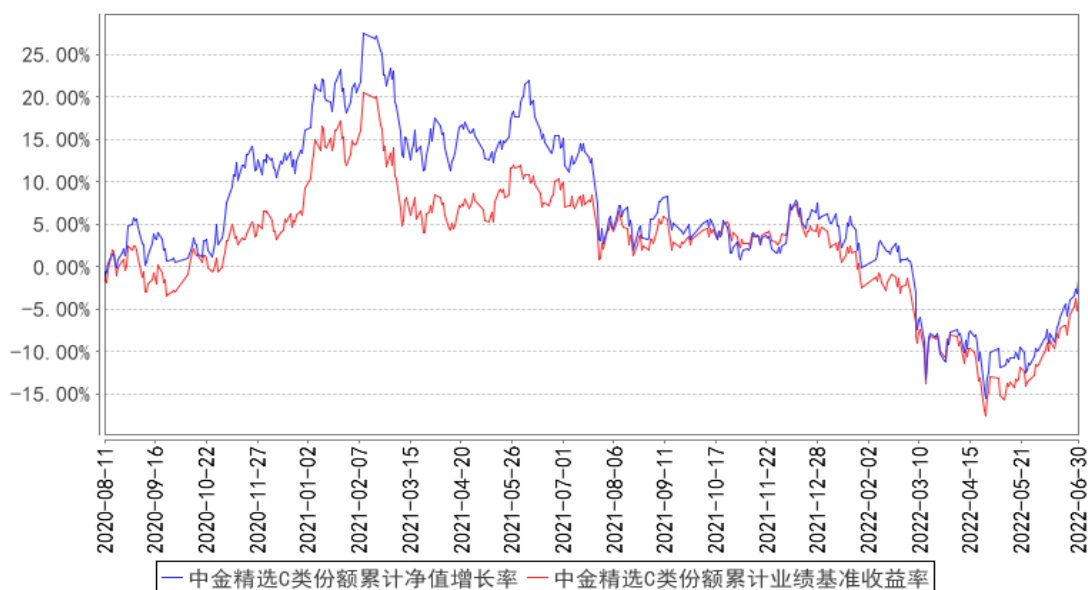
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中金精选A类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





中金精选C类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



### 3.3 其他指标

无。

## § 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

中国国际金融股份有限公司是中国第一家中外合资投资银行，面向国内外机构及个人客户提供综合化、一站式的全方位投资银行服务，公司成立日期：1995年7月31日，住所为北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层。

中金公司自2002年开始经营资产管理业务，以全方位投资银行平台优势为依托，参照国际行业标准与国内监管要求，致力于打造多资产、多策略、跨市场的综合性资管机构。中金公司资产管理业务牌照齐全、产品丰富。拥有全国社保基金管理人、企业年金投资管理人、职业年金投资管理人、保险资金投资管理人、境内集合/单一资产管理计划、合格境内机构投资者（QDII）集合/单一资产管理、人民币合格境内机构投资者（RQDII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）、合格境外机构投资者（QFII）等多项业务资格，并在香港设立了独立的资产管理子公司，拥有香港Type4证券咨询牌照和Type9资产管理牌照。

中金公司根据《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》的要求，截至2022年6月30日，旗下已有六只大集合产品完成公募化改造，分别为：中金恒瑞债券型集合资产管理计划、中金新锐股票型集合资产管理计划、中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划、中金精选股票型集合资产管理计划、中金汇越量化对冲3个月定

期开放灵活配置混合型集合资产管理计划、中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划。

#### 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		
张翔	本基金的基金经理	2020年8月4日	-	12.0年	2007年获武汉大学化学与管理学双学士，2010年获南京大学经济学硕士。2010.7-2015.4年就职于长江证券研究部任化工行业首席分析师；2015.5-至今主要任职于中金公司资产管理部，历任投资经理助理、投资经理。

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

2. 非首任基金经理，其“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. 本集合计划基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理；

4. 证券从业的涵义参照行业的相关规定，包括资管相关从业经历；

5. 本基金的基金经理张翔于2022年7月1日离任，公司于2022年7月2日发布了《中金精选股票型集合资产管理计划基金经理变更公告》。

#### 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

本集合计划基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

报告期内，两市受国内疫情、海外疫情蔓延、国际地缘冲突等因素影响波动较大。组合在报告期内维持了仓位的稳定性，同时根据市场整体走势进行了部分调整。展望未来，我们认为经过市场的整体调整，部分板块估值的风险得到了较好的释放，在此时点更应该回归到投资的本质，通过自下而上的分析来判断标的公司的价值与价格之间的差异。本产品将继续聚焦优质的成长股，在合理价格区间内买入。具体操作上，消费及具备竞争力的制造业龙头依然是组合重仓的重点。在新兴行业上，力争做到挑选具备明显护城河的公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.9223 元，份额累计净值为 5.6213 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.9041 元，份额累计净值为 1.9041 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-6.81%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-7.04%，同期业绩基准增长率-8.14%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下阶段市场展望：结构性机会不断出现，重点看好低估值成长机会

#### 4.5.1 下半年经济将呈现复苏态势

疫情对于国内经济冲击最大时点已经过去，复工复产和政策刺激将推动经济下半年持续复苏。二季度国内生产、消费、投资等数据已经体现了不太理想的预期，后续很有可能会出现全面好转的局面。好于预期的社融和信贷数据也或将逐步传导到实体经济，宏观数据的好转可能会带动企业端盈利的改善。

#### 4.5.2 货币政策预期将保持宽松

国内经济复苏目前来看不会是斜率特别陡峭的过程，在这样的情况下，经济需求出现稳步复苏的概率相对较高，因此出于对经济的基本面支撑，因此国内流动性大概率会保持比较宽松的情况，这也为 A 股下半年的表现提供了一个较为优良的环境。

#### 4.5.3 投资策略：全市场寻找低估的机会

护城河足够高的标的依然是本组合最核心的选择，经历了市场的系统性下跌之后，不少标的出现了系统性的机会，因此我们会专注于自身优势领域，重点布局消费、医药以及制造业等领域品种

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据企业会计准则、中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，估值委员会负责估值运作的基本原则与工作机制、会计政策、估值办法、特殊情况下的估值决策，定期对估值政策与流程进行评价。使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行收益分配。

#### 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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中金精选股票型集合资产管理计划（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，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地复核，未发现本基金管理人存在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的真实、准确和完整发表意见

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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中金精选股票型集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	53,070,808.50	45,913,152.91
结算备付金		-	-
存出保证金		19,269.30	21,360.78
交易性金融资产	6.4.7.2	316,009,613.51	364,292,851.54
其中：股票投资		316,009,613.51	364,292,851.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,440.15	13,157.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	4,653.33
资产总计		369,104,131.46	410,245,175.70
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		139,496.21	344,328.01
应付管理人报酬		424,155.42	510,222.84
应付托管费		56,554.10	68,029.72
应付销售服务费		5,056.07	6,501.74
应付投资顾问费		-	-
应交税费		232,488.81	1,091,413.76
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	9,033,821.66	9,145,346.39
负债合计		9,891,572.27	11,165,842.46
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	78,567,867.94	81,747,469.38
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	280,644,691.25	317,331,863.86
净资产合计		359,212,559.19	399,079,333.24
负债和净资产总计		369,104,131.46	410,245,175.70

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 186,932,856.06 份，其中中金精选 A 类基金份额总额 180,209,139.60 份，基金份额净值 1.9223 元。中金精选 C 类基金份额总额 6,723,716.46 份，基金份额净值 1.9041 元；

## 6.2 利润表

会计主体：中金精选股票型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-24,386,809.30	453,474.85
1. 利息收入		93,250.68	138,152.46
其中：存款利息收入	6.4.7.13	93,250.68	123,033.98
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	15,118.48
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,327,203.52	81,422,999.07

其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,917,588.65	77,107,183.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	4,409,614.87	4,315,816.04
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.20	-32,818,254.90	-81,554,487.28
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	10,991.40	446,810.60
<b>减：二、营业总支出</b>		3,126,786.27	5,293,355.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,645,878.79	3,908,552.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	352,783.89	521,140.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	33,247.76	56,027.54
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		14,415.87	275,898.34
8. 其他费用	6.4.7.23	80,459.96	531,736.71
<b>三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）</b>		-27,513,595.57	-4,839,880.95
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		-27,513,595.57	-4,839,880.95
<b>五、其他综合收益的税后净 额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-27,513,595.57	-4,839,880.95

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中金精选股票型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	81,747,469.38	-	317,331,863.86	399,079,333.24
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	81,747,469.38	-	317,331,863.86	399,079,333.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,179,601.44	-	-36,687,172.61	-39,866,774.05
(一)、综合收益总额	-	-	-27,513,595.57	-27,513,595.57
(二)、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)	-3,179,601.44	-	-9,173,577.04	-12,353,178.48
其中:1.基金申购款	3,095,968.25	-	4,727,574.70	7,823,542.95
2.基金赎回款	-6,275,569.69	-	-13,901,151.74	-20,176,721.43
(三)、	-	-	-	-



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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	78,567,867.94	-	280,644,691.25	359,212,559.19
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	104,459,960.65	-	462,891,847.78	567,351,808.43
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-9,517,121.83	-	-64,979,852.13	-74,496,973.96

(一)、 综合收益总额	-	-	-4,839,880.95	-4,839,880.95
(二)、 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)	-9,517,121.83	-	-60,139,971.18	-69,657,093.01
其中:1. 基金申购款	23,429,689.67	-	65,172,418.84	88,602,108.51
2. 基金赎回款	-32,946,811.50	-	-125,312,390.02	-158,259,201.52
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	94,942,838.82	-	397,911,995.65	492,854,834.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-财务报表由下列负责人签署：

徐翌成	赵阳光	赵阳光
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

中金精选股票型集合资产管理计划(以下简称“本基金”)由中金股票精选集合资产管理计划变更而来。中金股票精选集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划,于 2006 年 6 月 5 日经中国证监会证监许可[2006]100 号文核准设立,自 2006 年 6 月 14 日起开始募集,于 2006 年 7 月 14 日结束募集工作,并于 2006 年 7 月 20 日正式成立。由中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)和中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)作为推广机构,自 2006 年 6 月 14 日至 2006 年 7 月 14 日进行推广。中金股票精选集合资产管理计划于 2006 年 7 月 20 日成立,成立之日集合计划实收份额为 1,663,022,251.25 份(含利息转份额 540,611.22 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审验并出具验资报告。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》(证监会公告〔2018〕39 号)的规定,中金精选股票型集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。经中国证监会批准,自 2020 年 8 月 4 日起,《中金精选股票型集合资产管理计划资产管理合同》生效,原《中金股票精选集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本基金自基金合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等)、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、货币市场工具等,以及法律法规或中国证监会允许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投资其他品种,管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产比例不低于 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于本基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为沪深 300

指数收益率\*90%+ 中证全债指数收益率 \*5%+ 活期存款利率\*5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时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发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。除下述会计政策外,本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产,暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付,且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标,则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

###### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负

债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

##### （1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### （2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息（若有）后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

##### （3）公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值

变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### (4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

### 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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下简称“新金融工具准则”)相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22 号)，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用新金融工具准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、存出保证金、应收利息、应收申购款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应交税费、其他负债，金额分别为人民币 45,913,152.91 元、人民币 21,360.78 元、人民币 4,653.33 元、人民币 13,157.14 元、人民币 344,328.01 元、人民币 510,222.84 元、人民币 68,029.72 元、人民币 6,501.74 元、人民币 46,986.88 元、人民币 1,091,413.76 元、人民币 9,098,359.51 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款、其他资产-应收利息、应收申购款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应交税费、其他负债，本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、存出保证金、其他资产-应收利息、应收申购款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应交税费、其他负债的金额分别为人民币 45,917,795.68 元、人民币 21,371.34 元、人民币 0.00 元、人民币 13,157.14 元、人民币 344,328.01 元、人民币 510,222.84 元、人民币 68,029.72 元、人民币 6,501.74 元、人民币 1,091,413.76 元、人民币 9,145,346.39 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资

产，金额为人民币 364,292,851.54 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 364,292,851.54 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

本基金目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

(1) 根据财政部和国家税务总局 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，2018 年 1 月 1 日起，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，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(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照资管产品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。

(2) 对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，暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

(4) 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、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税。

#### 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	53,070,808.50
等于：本金	53,065,409.33
加：应计利息	5,399.17
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-



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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	53,070,808.50

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	308,890,032.05	-	316,009,613.51	7,119,581.46
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	308,890,032.05	-	316,009,613.51	7,119,581.46

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

无

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	16,245.02
其中：交易所市场	16,245.02
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
扣代缴个人所得税	8,938,233.48
合计	9,033,821.66

注：代扣代缴个人所得税为原中金精选集合资产管理计划在以前年度派发股息红利及债券利息时代扣代缴的个人所得税。

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 中金精选 A 类份额

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	185,893,696.16	74,110,399.12
本期申购	1,853,548.28	738,943.28
本期赎回（以“-”号填列）	-7,538,104.84	-3,005,190.92
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	180,209,139.60	71,844,151.48

##### 中金精选 C 类份额

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,637,070.26	7,637,070.26
本期申购	2,357,024.97	2,357,024.97
本期赎回（以“-”号填列）	-3,270,378.77	-3,270,378.77
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	6,723,716.46	6,723,716.46

**6.4.7.11 其他综合收益**

无。

**6.4.7.12 未分配利润**

单位：人民币元

中金精选 A 类份额

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	337,729,236.09	-28,403,151.22	309,326,084.87
本期利润	5,156,983.75	-31,553,386.28	-26,396,402.53
本期基金份额交易产生的变动数	-10,430,995.55	2,066,790.91	-8,364,204.64
其中：基金申购款	3,385,731.03	-673,759.80	2,711,971.23
基金赎回款	-13,816,726.58	2,740,550.71	-11,076,175.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	332,455,224.29	-57,889,746.59	274,565,477.70

中金精选 C 类份额

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	9,741,789.10	-1,736,010.11	8,005,778.99
本期利润	147,675.58	-1,264,868.62	-1,117,193.04
本期基金份额交易产生的变动数	-1,156,400.37	347,027.97	-809,372.40
其中：基金申购款	3,032,853.82	-1,017,250.35	2,015,603.47
基金赎回款	-4,189,254.19	1,364,278.32	-2,824,975.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,733,064.31	-2,653,850.76	6,079,213.55

**6.4.7.13 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	92,994.15
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	130.76
其他	125.77
合计	93,250.68

注：此处其他列示的是存出保证金利息收入。

**6.4.7.14 股票投资收益****6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	33,942,486.15
减：卖出股票成本总额	29,938,085.16
减：交易费用	86,812.34
买卖股票差价收入	3,917,588.65

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,409,614.87
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	4,409,614.87

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-33,677,418.24
股票投资	-33,677,418.24
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-859,163.34
合计	-32,818,254.90

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10,969.86
基金转换费收入	21.54
合计	10,991.40

**6.4.7.22 信用减值损失**

无。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,116.80
合计	80,459.96

**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，本基金无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至资产负债表日，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**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

**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
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（“中金财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
中金公司	47,367,268.88	100.00	249,426,010.44	100.00

## 6.4.10.1.2 债券交易

无。

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

## 6.4.10.1.4 权证交易

无。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	43,203.40	100.00	16,245.02	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	232,293.55	100.00	27,379.90	100.00

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,645,878.79	3,908,552.87
其中：支付销售机构的客户维护费	1,242,616.84	1,394,391.09

注：支付基金管理人中金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，逐日计提并按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	352,783.89	521,140.34

注：支付托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提，逐日计提并按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金精选 A 类份额	中金精选 C 类份额	合计
中国银行	-	16,971.26	16,971.26
中金财富	-	12,451.82	12,451.82
中金公司	-	-	-
合计	-	29,423.08	29,423.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金精选 A 类份额	中金精选 C 类份额	合计
中国银行	-	21,013.64	21,013.64
中金财富	-	20,762.05	20,762.05
中金公司	-	11,972.80	11,972.80
合计	-	53,748.49	53,748.49

注：支付销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.50% 的年费率计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类资产净值 × 0.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

无。

## 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

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国银行	53,070,808.50	92,994.15	65,392,004.83	121,144.10

注：本基金的银行存款由托管行中国银行保管，按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

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

无。

## 6.4.12 期末(2022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	受限期	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
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月	首次公开发行限售	55.57	30.03	176	9,780.32	5,285.28	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月	首次公开发行限售	39.88	31.09	181	7,218.28	5,627.29	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月	首次公开发行	42.50	32.02	146	4,760.00	4,674.92	限售期间发生送股



				限售							
301110	青木股份	2022-03-04	6 个月	首次公开发售 限售	63.10	39.85	91	5,742.10	3,626.35	-	
301120	新特电气	2022-04-11	6 个月	首次公开发售 限售	13.73	15.49	261	3,583.53	4,042.89	-	
301130	西点药业	2022-02-16	6 个月	首次公开发售 限售	22.55	37.7	87	1,961.85	3,279.90	-	
301135	瑞德智能	2022-04-01	6 个月	首次公开发售 限售	31.98	26.26	119	3,805.62	3,124.94	-	
301148	嘉戎技术	2022-04-14	6 个月	首次公开发售 限售	38.39	23.9	149	5,720.11	3,561.10	-	
301151	冠龙节能	2022-03-30	6 个月	首次公开发售 限售	30.82	21.46	198	6,102.36	4,249.08	-	
301163	宏德股份	2022-04-11	6 个月	首次公开发售 限售	26.27	32.33	99	2,600.73	3,200.67	-	
301187	欧圣电气	2022-04-13	6 个月	首次公开发售 限售	21.33	22.54	289	6,164.37	6,514.06	-	
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	首次公开发售 限售	173.98	87.82	61	5,915.32	5,357.02	-	限售期间发生送股
301222	浙江恒威	2022-03-02	6 个月	首次公开发售 限售	33.98	28.96	128	4,349.44	3,706.88	-	
301237	和顺科技	2022-03-16	6 个月	首次公开发售 限售	56.69	41.86	110	6,235.90	4,604.60	-	
301263	泰恩康	2022-03-22	6 个月	首次公开发售 限售	19.93	31.38	351	6,995.43	11,014.38	-	
301268	铭利达	2022-03-29	6 个月	首次公开发售 限售	28.50	34.87	232	6,612.00	8,089.84	-	
301279	金道科技	2022-04-06	6 个月	首次公开发售 限售	31.20	22.81	144	4,492.80	3,284.64	-	

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本基金管理人制定了相应的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，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了由风险管理部、内部审计部、法律合规部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理部、内部审计部、法律合规部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。此外，业务部门也建立了自身的内部控制机制，主要由授权体系和业务后台部门信息监控机制组成。

#### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放于中国银行，该行为本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。流动性风险一般存在两种形式：资产变现风险和现金流风险。

#### (1) 资产变现风险

资产变现风险是指由于基金持有的某个券种的头寸相对于市场正常的交易量过大，或由于停牌造成交易无法在当前的市场价格下成交。本基金管理人应用定量方法对各持仓品种的变现能力进行测算和分析，以对资产变现风险进行管理。

#### (2) 现金流风险

现金流风险是指基金因现金流不足导致无法应对正常基金支付义务的风险。本基金管理人对基金每日和每周净赎回比例进行测算和分析，以对该风险进行跟踪和管理。此外，本基金管理人建立了现金头寸控制机制，以确保赎回款项的及时支付。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申购、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 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 2022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	53,070,808.50	-	-	-	53,070,808.50
存出保证金	19,269.30	-	-	-	19,269.30
交易性金融资产	-	-	-316,009,613.51	-	316,009,613.51
应收申购款	-	-	-	4,440.15	4,440.15
资产总计	53,090,077.80	-	-316,014,053.66	-	369,104,131.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	139,496.21	139,496.21
应付管理人报酬	-	-	-	424,155.42	424,155.42
应付托管费	-	-	-	56,554.10	56,554.10
应付销售服务费	-	-	-	5,056.07	5,056.07
应交税费	-	-	-	232,488.81	232,488.81
其他负债	-	-	-	9,033,821.66	9,033,821.66
负债总计	-	-	-	9,891,572.27	9,891,572.27
利率敏感度缺口	53,090,077.80	-	-306,122,481.39	-	359,212,559.19
上年度末 2021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	45,913,152.91	-	-	-	45,913,152.91
存出保证金	21,360.78	-	-	-	21,360.78
交易性金融资产	-	-	-364,292,851.54	-	364,292,851.54
应收利息	-	-	-	4,653.33	4,653.33
应收申购款	-	-	-	13,157.14	13,157.14
资产总计	45,934,513.69	-	-364,310,662.01	-	410,245,175.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	344,328.01	344,328.01
应付管理人报酬	-	-	-	510,222.84	510,222.84

应付托管费	-	-	-	68,029.72	68,029.72
应付销售服务费	-	-	-	6,501.74	6,501.74
应付交易费用	-	-	-	46,986.88	46,986.88
应交税费	-	-	-	1,091,413.76	1,091,413.76
其他负债	-	-	-	9,098,359.51	9,098,359.51
负债总计	-	-	-	11,165,842.46	11,165,842.46
利率敏感度缺口	45,934,513.69	-	-	-353,144,819.55	399,079,333.24

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

无。

#### 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的债券等资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	316,009,613.51	87.97	364,292,851.54	91.28
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	316,009,613.51	87.97	364,292,851.54	91.28
----	----------------	-------	----------------	-------

#### 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		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	15,800,480.68	18,214,642.58
	业绩比较基准下降 5%	-15,800,480.68	-18,214,642.58

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	315,926,369.67	364,056,390.39
第二层次	-	236,461.15
第三层次	83,243.84	-
合计	316,009,613.51	364,292,851.54

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃包括涨跌停时的交易不活

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将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	316,009,613.51	85.62
	其中：股票	316,009,613.51	85.62
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	53,070,808.50	14.38
8	其他各项资产	23,709.45	0.01
9	合计	369,104,131.46	100.00

### 7.2 报告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	5,680.97	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	280,972,980.92	78.22

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,311.28	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	7,488.72	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,845,273.35	0.79
J	金融业	11,442,532.00	3.19
K	房地产业	9,807,077.00	2.73
L	租赁和商务服务业	5,627.29	0.00
M	科学研究和技术服务业	9,582.30	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,546.70	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,962.94	0.00
R	文化、体育和娱乐业	10,873,550.04	3.03
S	综合	-	-
	合计	316,009,613.51	87.97

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	17,300	35,378,500.00	9.85
2	002250	联化科技	1,922,269	31,467,543.53	8.76
3	000333	美的集团	464,871	28,073,559.69	7.82
4	002078	太阳纸业	2,076,656	25,563,635.36	7.12
5	002415	海康威视	702,500	25,430,500.00	7.08
6	600426	华鲁恒升	840,944	24,555,564.80	6.84
7	603833	欧派家居	159,545	24,040,240.60	6.69
8	002254	泰和新材	1,049,120	17,572,760.00	4.89
9	000596	古井贡酒	55,500	13,856,130.00	3.86
10	600066	宇通客车	1,592,589	13,775,894.85	3.84
11	600036	招商银行	271,145	11,442,319.00	3.19
12	300144	宋城演艺	708,100	10,869,335.00	3.03
13	000002	万科 A	478,394	9,807,077.00	2.73
14	002422	科伦药业	465,410	8,703,167.00	2.42
15	000568	泸州老窖	33,800	8,333,052.00	2.32
16	002557	洽洽食品	80,600	4,588,558.00	1.28



17	600298	安琪酵母	85,900	4,187,625.00	1.17
18	000860	顺鑫农业	155,613	4,173,540.66	1.16
19	600309	万华化学	40,900	3,966,891.00	1.10
20	300408	三环集团	123,700	3,723,370.00	1.04
21	002475	立讯精密	95,200	3,216,808.00	0.90
22	300253	卫宁健康	323,650	2,841,647.00	0.79
23	301187	欧圣电气	2,889	75,310.06	0.02
24	301237	和顺科技	1,092	48,598.20	0.01
25	300979	华利集团	630	46,040.40	0.01
26	300953	震裕科技	91	12,466.09	0.00
27	301089	拓新药业	97	12,185.14	0.00
28	301069	凯盛新材	249	11,481.39	0.00
29	301263	泰恩康	351	11,014.38	0.00
30	301091	深城交	351	9,582.30	0.00
31	001323	慕思股份	194	9,517.64	0.00
32	301268	铭利达	232	8,089.84	0.00
33	301101	明月镜片	154	7,904.82	0.00
34	301073	君亭酒店	108	7,488.72	0.00
35	301211	亨迪药业	321	6,959.28	0.00
36	301199	迈赫股份	195	6,247.80	0.00
37	301190	善水科技	242	5,742.66	0.00
38	301102	兆讯传媒	181	5,627.29	0.00
39	301180	万祥科技	259	5,426.05	0.00
40	301219	腾远钴业	61	5,357.02	0.00
41	301060	兰卫医学	151	5,288.02	0.00
42	300834	星辉环材	176	5,285.28	0.00
43	300940	南极光	223	5,247.19	0.00
44	300968	格林精密	579	5,245.74	0.00
45	301103	何氏眼科	146	4,674.92	0.00
46	301092	争光股份	146	4,593.16	0.00
47	301048	金鹰重工	391	4,304.91	0.00
48	301015	百洋医药	199	4,294.42	0.00
49	301151	冠龙节能	198	4,249.08	0.00
50	301188	力诺特玻	237	4,218.60	0.00
51	301052	果麦文化	128	4,215.04	0.00
52	301193	家联科技	153	4,153.95	0.00
53	300967	晓鸣股份	230	4,142.30	0.00
54	301120	新特电气	261	4,042.89	0.00
55	301166	优宁维	68	4,002.48	0.00
56	300614	百川畅银	158	3,975.28	0.00
57	301138	华研精机	124	3,813.00	0.00
58	301222	浙江恒威	128	3,706.88	0.00

59	301111	粤万年青	134	3,674.28	0.00
60	301110	青木股份	91	3,626.35	0.00
61	301148	嘉戎技术	149	3,561.10	0.00
62	301189	奥尼电子	102	3,397.62	0.00
63	301279	金道科技	144	3,284.64	0.00
64	301130	西点药业	87	3,279.90	0.00
65	301108	洁雅股份	82	3,244.74	0.00
66	301163	宏德股份	99	3,200.67	0.00
67	301135	瑞德智能	119	3,124.94	0.00
68	301072	中捷精工	95	3,042.85	0.00
69	300961	深水海纳	222	3,010.32	0.00
70	301198	喜悦智行	125	2,818.75	0.00
71	300955	嘉亨家化	113	2,770.76	0.00
72	300963	中洲特材	138	2,674.44	0.00
73	300971	博亚精工	105	2,588.25	0.00
74	300950	德固特	155	2,526.50	0.00
75	300960	通业科技	126	2,358.72	0.00
76	301182	凯旺科技	99	2,352.24	0.00
77	301081	严牌股份	150	2,262.00	0.00
78	301016	雷尔伟	108	2,014.20	0.00
79	300992	泰福泵业	91	1,939.21	0.00
80	301083	百胜智能	130	1,814.80	0.00
81	301079	邵阳液压	63	1,562.40	0.00
82	300972	万辰生物	119	1,538.67	0.00
83	301068	大地海洋	63	1,521.45	0.00
84	601688	华泰证券	15	213.00	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	600298	安琪酵母	3,456,985.00	0.87
2	300408	三环集团	3,456,862.00	0.87
3	002475	立讯精密	3,215,493.70	0.81
4	600309	万华化学	3,175,310.00	0.80
5	688220	翱捷科技	287,945.00	0.07
6	688234	天岳先进	141,984.85	0.04
7	688337	普源精电	127,665.36	0.03
8	688072	拓荆科技	111,126.48	0.03
9	688238	和元生物	105,879.69	0.03
10	300834	星辉环材	97,525.35	0.02
11	688267	中触媒	74,917.20	0.02

12	301102	兆讯传媒	71,983.40	0.02
13	688306	均普智能	71,572.12	0.02
14	301263	泰恩康	69,914.44	0.02
15	301268	铭利达	65,863.50	0.02
16	301237	和顺科技	61,905.48	0.02
17	301187	欧圣电气	61,622.37	0.02
18	301151	冠龙节能	61,023.60	0.02
19	301219	腾远钴业	59,153.20	0.01
20	301148	嘉戎技术	57,162.71	0.01

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600426	华鲁恒升	13,743,868.00	3.44
2	002557	洽洽食品	6,974,798.00	1.75
3	601933	永辉超市	3,962,761.50	0.99
4	000333	美的集团	3,852,638.00	0.97
5	600519	贵州茅台	3,337,457.00	0.84
6	688238	和元生物	204,067.36	0.05
7	688220	翱捷科技	195,882.74	0.05
8	688234	天岳先进	149,625.00	0.04
9	688072	拓荆科技	137,810.44	0.03
10	301263	泰恩康	112,398.50	0.03
11	688337	普源精电	94,511.79	0.02
12	688306	均普智能	92,666.96	0.02
13	688267	中触媒	80,463.28	0.02
14	300834	星辉环材	79,831.33	0.02
15	301222	浙江恒威	70,916.66	0.02
16	301110	青木股份	68,076.50	0.02
17	301268	铭利达	66,424.00	0.02
18	301136	招标股份	65,870.12	0.02
19	688259	创耀科技	64,506.96	0.02
20	301219	腾远钴业	60,430.00	0.02

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	15,332,265.37
卖出股票收入（成交）总额	34,062,618.18

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）

填列，不考虑交易费用

### 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 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

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	19,269.30
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,440.15
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,709.45

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
中金精选 A类份额	1,580	114,056.42	880,600.79	0.49	179,328,538.81	99.51
中金精选 C类份额	368	18,270.97	0.00	0	6,723,716.46	100
合计	1,930	96,856.40	880,600.79	0.47	186,052,255.27	99.53

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管 理人所 有从业 人员持 有本基 金	中金精选 A 类份额	0.00	0.0000
	中金精选 C 类份额	100,745.54	1.4984
	合计	100,745.54	0.0539

### 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、 基金投资和部门 负责人持有本开放式	中金精选 A 类份额	0
	中金精选 C 类份额	0

基金		
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	中金精选 A 类份额	0
	中金精选 C 类份额	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金精选 A 类份额	中金精选 C 类份额
基金合同生效日 (2020 年 8 月 4 日) 基金份额总额	204,128,356.91	-
本报告期期初基金份 额总额	185,893,696.16	7,637,070.26
本报告期基金总申购 份额	1,853,548.28	2,357,024.97
减：本报告期基金总 赎回份额	7,538,104.84	3,270,378.77
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	180,209,139.60	6,723,716.46

## § 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

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。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

本报告期内无涉及本基金管理人基金管理业务、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

本基金自基金合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所为本基金提供审计服务。

### 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

本报告期内，本基金管理人资产管理业务及其高级管理人员、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无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 (%)	
中金公司	2	47,367,268.88	100.00	43,203.40	100.00	-

#### 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

无。

### 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	关于新增上海万得基金销售有限公司为旗下部分大集合产品代销机构的公告	中国证监会规定网站	2022年1月24日
2	中国国际金融股份有限公司关于新增南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分大集合产品代销机构的公告	中国证监会规定网站	2022年2月18日
3	中国国际金融股份有限公司关于新增浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分大集合产品代销机构的公告	中国证监会规定网站	2022年4月18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

无

### 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

- (一) 关于准予中金股票精选集合资产管理计划合同变更的回函
- (二) 中金精选股票型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 中金精选股票型集合资产管理计划招募说明书
- (四) 中金精选股票型集合资产管理计划托管协议
- (五) 法律意见书
- (六) 管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 报告期内披露的各项公告

### 12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸 3 期 B 座 42 层。

### 12.3 查阅方式

投资者可到管理人办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：800-810-8802（固话用户免费） | （010）6505-0105（直线）

公司网址：[www.cicc.com](http://www.cicc.com)

中国国际金融股份有限公司

2022 年 8 月 30 日