

# 中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:中融基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 28 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。本中期报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至2021年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	53
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	56

§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中融鑫价值混合	
基金主代码	004836	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年03月09日	
基金管理人	中融基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	194,175,838.63份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中融鑫价值混合A	中融鑫价值混合C
下属分级基金的交易代码	004836	004837
报告期末下属分级基金的份额总额	99,087,382.69份	95,088,455.94份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上，力求获得超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	1、封闭期投资策略（1）资产配置策略（2）债券投资组合策略（3）信用类债券投资策略（4）相对价值策略（5）债券选择策略（6）资产支持证券投资策略（7）中小企业私募债券投资策略（8）期限管理策略；2、开放期投资策略。
业绩比较基准	中债综合指数（全价）收益率
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中融基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 姓名	周妹云	陆志俊

露负责人	联系电话	010-56517000	95559
	电子邮箱	zhoumeiyun@zrfunds.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-160-6000; 010-5651729 9	95559
传真		010-56517001	021-62701216
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3202、3203B	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		北京市朝阳区望京东园四区2号楼17层1701号01室	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		100102	200336
法定代表人		王瑶	任德奇

#### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.zrfunds.com.cn/">http://www.zrfunds.com.cn/</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

#### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中融基金管理有限公司	北京市朝阳区望京东园四区2号楼17层1701号01室

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期
---------------	-----

	(2021年01月01日-2021年06月30日)	
	中融鑫价值混合A	中融鑫价值混合C
本期已实现收益	372,266.98	-101,084.30
本期利润	2,655,864.53	3,049,298.35
加权平均基金份额本期利润	0.0252	0.0260
本期加权平均净值利润率	2.17%	2.39%
本期基金份额净值增长率	3.54%	3.05%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	16,283,279.50	8,094,815.59
期末可供分配基金份额利润	0.1643	0.0851
期末基金资产净值	115,370,662.19	103,183,271.53
期末基金份额净值	1.1643	1.0851
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	16.43%	8.51%

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

中融鑫价值混合A

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	-4.17%	0.98%	-0.72%	0.33%	-3.45%	0.65%
过去三个月	1.98%	1.13%	1.97%	0.39%	0.01%	0.74%
过去六个月	3.54%	1.37%	1.35%	0.53%	2.19%	0.84%
过去一年	14.42%	1.07%	11.66%	0.53%	2.76%	0.54%
过去三年	23.61%	1.05%	28.22%	0.54%	-4.61%	0.51%
自基金合同生效起至今	16.43%	1.02%	22.33%	0.54%	-5.90%	0.48%

## 中融鑫价值混合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	-4.19%	0.98%	-0.72%	0.33%	-3.47%	0.65%
过去三个月	1.80%	1.13%	1.97%	0.39%	-0.17%	0.74%
过去六个月	3.05%	1.37%	1.35%	0.53%	1.70%	0.84%
过去一年	12.63%	1.07%	11.66%	0.53%	0.97%	0.54%
过去三年	15.28%	1.04%	28.22%	0.54%	-12.94%	0.50%
自基金合同生效起至今	8.51%	1.01%	22.33%	0.54%	-13.82%	0.47%

### 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



中融鑫价值混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年03月09日-2021年06月30日)



中融鑫价值混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年03月09日-2021年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

#### § 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

本基金管理人为中融基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由中融国际信托有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2021年6月30日，中融基金管理有限公司共管理67只基金，包括中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融中证银行指数证券投资基金(LOF)、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融稳健添利债券型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融融裕双利债券型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融融信双盈债券型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融上海清算所银行间1-3年高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融盈泽中短债债券型证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融睿祥纯债债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金(FOF)、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融策略优选混合型证券投资基金、中融恒鑫纯债债券型证券投资基金、中融聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融恒安纯债债券型证券投资基金、中融智选对冲策略3个月定期开放混合型证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金、中融1-5年国开行债券指数证券投资基金、中融聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、中融价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、中融创业板

两年定期开放混合型证券投资基金、中融成长优选混合型证券投资基金、中融景瑞一年持有期混合型证券投资基金、中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金、中融景颐6个月持有期混合型证券投资基金、中融行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、中融景盛一年持有期混合型证券投资基金、中融恒益纯债债券型证券投资基金、中融恒阳纯债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		
陈荔	中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2020-08-26	-	5	陈荔女士，中国国籍，毕业于罗彻斯特大学金融学专业，研究生、硕士学历，已取得基金从业资格，证券从业年限5年。2015年7月至2016年5月，任中国中投证券有限责任公司研究总部助理研究员；2016年5月加入中融基金，现任权益投资部基金经理。
王可汗	中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中	2021-03-12	-	5	王可汗先生，中国国籍，毕业于美国德克萨斯大学达拉斯分校会计学、金融学专业，研究生、硕士学历，已取得基金从业资格，证券从业年限5年。2016年4月加入中融基金，现任权

	融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。				益投资部基金经理。
--	-------------------------	--	--	--	-----------

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券从业的含义遵从行业协会《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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

##### 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。

报告期内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

从估值角度来看，我们认为高景气度的中游和有提价能力的下游后续或更加值得关注，短期建议规避由于前期持续结构性分化导致的高估值品种。行业配置上建议持续关

注高景气、低估值、疫后复苏三条主线。选择在内外需共振的背景下，风险收益比较高的金融板块，行业主要集中在银行、券商等。本基金将继续坚持稳健的投资策略，辅以积极打新实现收益增强。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融鑫价值混合A基金份额净值为1.1643元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.54%，同期业绩比较基准收益率为1.35%；截至报告期末中融鑫价值混合C基金份额净值为1.0851元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.05%，同期业绩比较基准收益率为1.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年上半年A股整体呈现出结构波动加剧、风格均衡化的特征，创业板指、大盘成长等核心资产代表指数波动率显著放大，中证1000、小盘价值等波动率变化相对较小。在经济与流动性稳定、外资流入、市场情绪回升的情况下，市场整体估值风险有限。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## § 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，基金托管人在中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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，中融基金管理有限公司在中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 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，由中融基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06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	27,399,700.78	18,999,253.46
结算备付金		570,197.16	659,791.07
存出保证金		134,956.05	19,333.28
交易性金融资产	6.4.7.2	198,061,474.55	172,715,650.75
其中：股票投资		187,124,022.95	167,140,224.85
基金投资		-	-
债券投资		10,937,451.60	5,575,425.90

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		-	-
应收证券清算款		238,717.92	-
应收利息	6.4.7.4	332,620.65	72,129.15
应收股利		-	-
应收申购款		1,778,240.28	12,888,660.02
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		228,515,907.39	205,354,817.73
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		8,493,201.72	14,313,052.20
应付赎回款		877,726.80	257,877.83
应付管理人报酬		108,267.44	62,891.40
应付托管费		18,044.53	10,481.87
应付销售服务费		8,660.92	6,452.92
应付交易费用	6.4.7.5	385,288.71	130,634.72
应交税费		-	0.19
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	70,783.55	70,032.62
负债合计		9,961,973.67	14,851,423.75

<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.7	194,175,838.63	175,976,404.03
未分配利润	6.4.7.8	24,378,095.09	14,526,989.95
所有者权益合计		218,553,933.72	190,503,393.98
负债和所有者权益总计		228,515,907.39	205,354,817.73

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额194,175,838.63份，其中A类基金份额的份额总额为99,087,382.69份，份额净值1.1643元；C类基金份额的份额总额为95,088,455.94份，份额净值1.0851元。

## 6.2 利润表

会计主体：中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
<b>一、收入</b>		7,747,104.87	467,330.92
1. 利息收入		221,581.21	264,888.16
其中：存款利息收入	6.4.7.9	91,412.14	75,502.54
债券利息收入		130,169.07	158,115.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	31,269.89
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,075,083.80	6,331,804.15
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,628,615.36	6,214,445.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,095,185.80	36,228.56



资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.12	1,608,513.36	81,130.59
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.13	5,433,980.20	-6,227,869.43
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.14	1,016,459.66	98,508.04
<b>减：二、费用</b>		2,041,941.99	939,599.82
1. 管理人报酬		745,496.97	295,803.50
2. 托管费		124,249.46	49,300.55
3. 销售服务费		63,612.20	33,616.46
4. 交易费用	6.4.7.15	1,034,713.38	484,703.32
5. 利息支出		-	253.97
其中：卖出回购金融资产 支出		-	253.97
6. 税金及附加		0.78	-
7. 其他费用	6.4.7.16	73,869.20	75,922.02
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		5,705,162.88	-472,268.90
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		5,705,162.88	-472,268.90

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06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)	175,976,404.03	14,526,989.95	190,503,393.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,705,162.88	5,705,162.88
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)	18,199,434.60	4,145,942.26	22,345,376.86
其中: 1. 基金申购款	304,431,234.27	41,969,064.69	346,400,298.96
2. 基金赎回款	-286,231,799.67	-37,823,122.43	-324,054,922.10
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)	194,175,838.63	24,378,095.09	218,553,933.72
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06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)	150,407,113.81	4,172,950.65	154,580,064.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-472,268.90	-472,268.90
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)	-128,529,615.21	-4,445,457.20	-132,975,072.41

其中：1. 基金申购款	70,910,623.76	2,360,773.12	73,271,396.88
2. 基金赎回款	-199,440,238.97	-6,806,230.32	-206,246,469.29
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）	21,877,498.60	-744,775.45	21,132,723.15

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：

王瑶

曹健

李克

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

中融鑫价值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[2017]852号《关于准予中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由基金发起人中融基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2018年3月9日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金募集期为自2017年12月4日至2018年3月2日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,本基金共募集有效净认购资金203,687,534.87元,折合203,687,534.87份中融鑫价值混合基金份额(其中:A类基金份额为2,663,814.09份;C类基金份额为201,023,720.78份)。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币39,782.94元,折合39,782.94份中融鑫价值混合基金份额(其中:A类基金份额为5,361.34份;C类基金份额为34,421.60份),以上收到的实收基金共计人民币203,727,317.81元,折合203,727,317.81份中融鑫价值混合基金份额(其中:A类基金份额为2,669,175.43份;C类基金份额为201,058,142.38份),有效认购户数为503户。按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《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》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券、中小企业私募债券、次级债等)、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、债券回购、同业存单、权证、股指期货、国债期货等及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×40%+上证国债指数收益率×60%。

#### 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于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于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。

#### 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2021年06月30日的财务状况以及2021年半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金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

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、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》、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》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、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。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、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，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人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，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

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

6、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，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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06月30日	
活期存款	27,399,700.78	
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	27,399,700.78	

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	180,459,254.68	187,124,022.95	6,664,768.27	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	10,960,176.95	10,937,451.60	-22,725.35
	银行间市场	-	-	-
	合计	10,960,176.95	10,937,451.60	-22,725.35
资产支持证券	-	-	-	

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	191,419,431.63	198,061,474.55	6,642,042.92

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	3,091.04
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	256.50
应收债券利息	329,212.41
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	60.70
合计	332,620.65

#### 6.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	385,288.71
银行间市场应付交易费用	-
合计	385,288.71

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,359.19	
应付证券出借违约金	-	
预提费用	69,424.36	
合计	70,783.55	

## 6.4.7.7 实收基金

## 6.4.7.7.1 中融鑫价值混合A

金额单位：人民币元

项目 (中融鑫价值混合A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	72,708,421.37	72,708,421.37
本期申购	151,280,749.54	151,280,749.54
本期赎回(以“-”号填列)	-124,901,788.22	-124,901,788.22
本期末	99,087,382.69	99,087,382.69

## 6.4.7.7.2 中融鑫价值混合C

金额单位：人民币元

项目 (中融鑫价值混合C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	103,267,982.66	103,267,982.66
本期申购	153,150,484.73	153,150,484.73
本期赎回(以“-”号填列)	-161,330,011.45	-161,330,011.45
本期末	95,088,455.94	95,088,455.94

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。



## 6.4.7.8 未分配利润

## 6.4.7.8.1 中融鑫价值混合A

单位：人民币元

项目 (中融鑫价值混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,763,062.32	-3,713,831.59	9,049,230.73
本期利润	372,266.98	2,283,597.55	2,655,864.53
本期基金份额交易产生的变动数	5,636,031.59	-1,057,847.35	4,578,184.24
其中：基金申购款	26,913,826.40	-14,493.51	26,899,332.89
基金赎回款	-21,277,794.81	-1,043,353.84	-22,321,148.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,771,360.89	-2,488,081.39	16,283,279.50

## 6.4.7.8.2 中融鑫价值混合C

单位：人民币元

项目 (中融鑫价值混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,440,301.66	-4,962,542.44	5,477,759.22
本期利润	-101,084.30	3,150,382.65	3,049,298.35
本期基金份额交易产生的变动数	-4,385.27	-427,856.71	-432,241.98
其中：基金申购款	15,166,226.77	-96,494.97	15,069,731.80
基金赎回款	-15,170,612.04	-331,361.74	-15,501,973.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,334,832.09	-2,240,016.50	8,094,815.59

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	85,872.60

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	4,838.43
其他	701.11
合计	91,412.14

#### 6.4.7.10 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01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	381,724,120.07
减：卖出股票成本总额	383,352,735.43
买卖股票差价收入	-1,628,615.36

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,095,185.80
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,095,185.80

##### 6.4.7.11.2 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01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,866,251.16

减：卖出债券（、 债转股及债券到期 兑付）成本总额	8,678,749.10
减：应收利息总额	92,316.26
买卖债券差价收入	1,095,185.80

## 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,608,513.36
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	1,608,513.36

## 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	5,433,980.20
——股票投资	5,473,944.88
——债券投资	-39,964.68
——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	5,433,980.20

## 6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	1,016,052.70
转换费收入	406.96
合计	1,016,459.66

## 6.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	1,034,713.38
银行间市场交易费用	-
合计	1,034,713.38

## 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,444.84
合计	73,869.20

## 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

无。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

##### 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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中融基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	745,496.97	295,803.50
其中：支付销售机构的客户维护费	364,527.58	16,356.53

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，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 $\times$ 0.60%/当年天数。

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	124,249.46	49,300.55

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 $\times$ 0.10%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融鑫价值混合A	中融鑫价值混合C	合计
中融基金 管理有限 公司	0.00	1,108.13	1,108.13
交通银行 股份有限 公司	0.00	24.99	24.99
合计	0.00	1,133.12	1,133.12
获得销售	上年度可比期间		

服务费的各关联方名称	2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融鑫价值混合A	中融鑫价值混合C	合计
交通银行股份有限公司	0.00	15.11	15.11
中融基金管理有限公司	0.00	33,108.36	33,108.36
合计	0.00	33,123.47	33,123.47

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.10%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构代付给销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。C类基金销售服务费的计算公式为：C类基金份额的日销售服务费=前一日C类基金资产净值 $\times$ 0.10%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	27,399,700.78	85,872.60	3,938,599.37	71,355.73

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

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

#### 6.4.12 期末（2021年06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
688076	诺泰生物	2021-05-12	2021-11-22	首次公开发售	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688630	芯碁微装	2021-03-25	2021-10-08	首次公开发售	15.23	58.42	3,397	51,736.31	198,452.74	-
688425	铁建重工	2021-06-11	2021-12-22	首次公开发售	2.87	4.75	29,723	85,305.01	141,184.25	-
688625	呈和科技	2021-05-	2021-12-	首次公开	16.48	42.63	2,672	44,034.5	113,907.	-



		31	07	发行 限售				6	36	
6881 09	品茗 股份	2021 -03- 22	2021 -09- 30	首次 公开发 行 限售	50.0 5	72.1 0	1,301	65,1 15.0 5	93,8 02.1 0	-
6886 33	星球 石墨	2021 -03- 17	2021 -09- 24	首次 公开发 行 限售	33.6 2	53.1 4	1,558	52,3 79.9 6	82,7 92.1 2	-
6883 14	康拓 医疗	2021 -05- 11	2021 -11- 18	首次 公开发 行 限售	17.3 4	74.4 8	1,085	18,8 13.9 0	80,8 10.8 0	-
6885 33	上声 电子	2021 -04- 09	2021 -10- 19	首次 公开发 行 限售	7.72	19.1 1	3,493	26,9 65.9 6	66,7 51.2 3	-
6884 99	利元 亨	2021 -06- 23	2021 -07- 01	新股 未流 通	38.8 5	38.8 5	1,620	62,9 37.0 0	62,9 37.0 0	-
6886 11	杭州 柯林	2021 -04- 01	2021 -10- 12	首次 公开发 行 限售	33.4 4	42.3 4	1,400	46,8 16.0 0	59,2 76.0 0	-
6882 39	航宇 科技	2021 -06- 25	2021 -07- 05	新股 未流 通	11.4 8	11.4 8	4,926	56,5 50.4 8	56,5 50.4 8	-
3009 57	贝泰 妮	2021 -03- 18	2021 -09- 27	首次 公开发 行 限售	47.3 3	251. 96	202	9,56 0.66	50,8 95.9 2	-
6880 87	英科 再生	2021 -06- -	2021 -07- -	新股 未流	21.9 6	21.9 6	2,197	48,2 46.1	48,2 46.1	-

		30	09	通				2	2	
3010 17	漱玉 平民	2021 -06- 23	2021 -07- 05	新股 未流 通	8.86	8.86	4,995	44,2 55.7 0	44,2 55.7 0	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2021 -07- 06	新股 未流 通	10.6 4	10.6 4	3,789	40,3 14.9 6	40,3 14.9 6	-
3009 79	华利 集团	2021 -04- 15	2021 -10- 26	首次 公开 发行 限售	33.2 2	87.5 0	384	12,7 56.4 8	33,6 00.0 0	-
3009 73	立高 食品	2021 -04- 08	2021 -10- 15	首次 公开 发行 限售	28.2 8	115. 71	267	7,55 0.76	30,8 94.5 7	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2021 -07- 06	新股 未流 通	9.46	9.46	2,609	24,6 81.1 4	24,6 81.1 4	-
3009 53	震裕 科技	2021 -03- 11	2021 -09- 22	首次 公开 发行 限售	28.7 7	99.8 5	240	6,90 4.80	23,9 64.0 0	-
3010 15	百洋 医药	2021 -06- 22	2021 -12- 30	首次 公开 发行 限售	7.64	38.8 3	462	3,52 9.68	17,9 39.4 6	-
6882 26	威腾 电气	2021 -06- 28	2021 -07- 07	新股 未流 通	6.42	6.42	2,693	17,2 89.0 6	17,2 89.0 6	-
3009 82	苏文 电能	2021 -04- 19	2021 -10- 27	首次 公开 发行 限售	15.8 3	45.2 9	317	5,01 8.11	14,3 56.9 3	-

300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	首次公开发行限售	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	首次公开发行限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	首次公开发行限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未流通	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	首次公开发行限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	首次公开发行限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	首次公开发行限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	首次公开发行限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	首次公开发行	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

				限售						
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	首次公开发行限售	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	首次公开发行限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未流通	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	首次公开发行限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	首次公开发行限售	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	首次公开发行限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	首次公开发行限售	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300975	商络电子	2021-04-	2021-10-	首次公开	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-

		14	21	发行 限售						
3009 63	中洲 特材	2021 -03- 30	2021 -10- 11	首次 公开发 行 限售	12.1 3	22.4 9	283	3,43 2.79	6,36 4.67	-
3010 11	华立 科技	2021 -06- 09	2021 -12- 17	首次 公开发 行 限售	14.2 0	33.8 4	175	2,48 5.00	5,92 2.00	-
3009 67	晓鸣 股份	2021 -04- 02	2021 -10- 13	首次 公开发 行 限售	4.54	11.5 4	507	2,30 1.78	5,85 0.78	-
3009 72	万辰 生物	2021 -04- 08	2021 -10- 19	首次 公开发 行 限售	7.19	12.6 5	430	3,09 1.70	5,43 9.50	-
3009 60	通业 科技	2021 -03- 22	2021 -09- 29	首次 公开发 行 限售	12.0 8	23.0 6	234	2,82 6.72	5,39 6.04	-
3010 17	漱玉 平民	2021 -06- 23	2022 -01- 05	首次 公开发 行 限售	8.86	8.86	555	4,91 7.30	4,91 7.30	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	首次 公开发 行 限售	10.6 4	10.6 4	421	4,47 9.44	4,47 9.44	-
3009 95	奇德 新材	2021 -05- 17	2021 -11- 26	首次 公开发 行 限售	14.7 2	23.3 2	191	2,81 1.52	4,45 4.12	-

301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	首次公开发行限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	首次公开发行限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	首次公开发行限售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	首次公开发行限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	首次公开发行限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

#### 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

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

#### 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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	57,000.00
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	57,000.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

#### 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

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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。



### 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基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于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，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。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未来现金流量因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关于未来现金流的风险。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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 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	27,399,700.78	-	-	-	27,399,700.78

结算备付金	570,197.16	-	-	-	570,197.16
存出保证金	134,956.05	-	-	-	134,956.05
交易性金融资产	10,937,451.60	-	-	187,124,022.95	198,061,474.55
应收证券清算款	-	-	-	238,717.92	238,717.92
应收利息	-	-	-	332,620.65	332,620.65
应收申购款	-	-	-	1,778,240.28	1,778,240.28
资产总计	39,042,305.59	-	-	189,473,601.80	228,515,907.39
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,493,201.72	8,493,201.72
应付赎回款	-	-	-	877,726.80	877,726.80
应付管理人报酬	-	-	-	108,267.44	108,267.44
应付托管费	-	-	-	18,044.53	18,044.53
应付销售服务费	-	-	-	8,660.92	8,660.92
应付交易费用	-	-	-	385,288.71	385,288.71
其他负债	-	-	-	70,783.55	70,783.55
负债总计	-	-	-	9,961,973.67	9,961,973.67
利率敏感度缺口	39,042,305.59	-	-	179,511,628.13	218,553,933.72
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存	18,999,253.46	-	-	-	18,999,253.46

款					
结算备付金	659,791.07	-	-	-	659,791.07
存出保证金	19,333.28	-	-	-	19,333.28
交易性金融资产	5,575,425.90	-	-	167,140,224.85	172,715,650.75
应收利息	-	-	-	72,129.15	72,129.15
应收申购款	-	-	-	12,888,660.02	12,888,660.02
资产总计	25,253,803.71	-	-	180,101,014.02	205,354,817.73
负债					
应付证券清算款	-	-	-	14,313,052.20	14,313,052.20
应付赎回款	-	-	-	257,877.83	257,877.83
应付管理人报酬	-	-	-	62,891.40	62,891.40
应付托管费	-	-	-	10,481.87	10,481.87
应付销售服务费	-	-	-	6,452.92	6,452.92
应付交易费用	-	-	-	130,634.72	130,634.72
应交税费	-	-	-	0.19	0.19
其他负债	-	-	-	70,032.62	70,032.62
负债总计	-	-	-	14,851,423.75	14,851,423.75
利率敏感度缺口	25,253,803.71	-	-	165,249,590.27	190,503,393.98

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

利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

##### 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06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	187,124,022.95	85.62	167,140,224.85	87.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	10,937,451.60	5.00	5,575,425.90	2.93
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	198,061,474.55	90.62	172,715,650.75	90.66

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；		
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；		
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
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06月30日	上年度末 2020年12月31日
	沪深300指数上升5%	5,296,797.76	5,377,107.10
	沪深300指数下降5%	-5,296,797.76	-5,377,107.10

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

##### (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应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

##### ① 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

### ② 各层级金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币185,344,050.23元，属于第二层次的余额为人民币12,717,424.32元，无属于第三层次的余额。

### ③ 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换。

2、除公允价值外，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	187,124,022.95	81.89
	其中：股票	187,124,022.95	81.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,937,451.60	4.79
	其中：债券	10,937,451.60	4.79
	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	27,969,897.94	12.24
8	其他各项资产	2,484,534.90	1.09
9	合计	228,515,907.39	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	11,290.28	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,709,523.88	0.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	73,523.22	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	124,279.74	0.06
J	金融业	185,136,867.47	84.71
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	187,124,022.95	85.62

## 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	300059	东方财富	668,440	21,918,147.60	10.03
2	600036	招商银行	388,200	21,036,558.00	9.63
3	600030	中信证券	674,001	16,809,584.94	7.69
4	600926	杭州银行	1,126,161	16,610,874.75	7.60
5	002142	宁波银行	421,720	16,434,428.40	7.52
6	600958	东方证券	1,311,125	13,098,138.75	5.99
7	000001	平安银行	525,328	11,882,919.36	5.44
8	601838	成都银行	803,900	10,161,296.00	4.65
9	601229	上海银行	1,210,451	9,925,698.20	4.54
10	601398	工商银行	1,481,200	7,657,804.00	3.50
11	601688	华泰证券	433,144	6,843,675.20	3.13
12	601009	南京银行	626,600	6,591,832.00	3.02
13	601377	兴业证券	665,500	6,428,730.00	2.94
14	000776	广发证券	421,500	6,381,510.00	2.92
15	601166	兴业银行	298,700	6,138,285.00	2.81
16	300033	同花顺	23,800	2,684,164.00	1.23
17	601995	中金公司	41,400	2,546,100.00	1.16
18	601066	中信建投	62,119	1,952,400.17	0.89
19	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.11
20	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.09
21	688276	百克生物	1,474	154,150.92	0.07
22	688425	铁建重工	29,723	141,184.25	0.06
23	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.05
24	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.04
25	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.04
26	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.04
27	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.03
28	688499	利元亨	1,620	62,937.00	0.03



29	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.03
30	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
31	300957	贝泰妮	202	50,895.92	0.02
32	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
33	688087	英科再生	2,197	48,246.12	0.02
34	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
35	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
36	300979	华利集团	384	33,600.00	0.02
37	300973	立高食品	267	30,894.57	0.01
38	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
39	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
40	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
41	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
42	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
43	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
44	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.01
45	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
46	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
47	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
48	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
49	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
50	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
51	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
52	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
53	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
54	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
55	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
56	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
57	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
58	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
59	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00

60	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
61	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
62	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
63	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
64	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
65	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
66	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
67	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
68	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
69	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
70	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
71	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
72	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
73	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
74	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
75	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	601688	华泰证券	47,167,039.00	24.76
2	600030	中信证券	46,452,381.64	24.38
3	300059	东方财富	33,419,892.60	17.54
4	601229	上海银行	28,300,159.77	14.86
5	601166	兴业银行	25,502,196.00	13.39
6	601318	中国平安	22,651,045.26	11.89
7	002142	宁波银行	22,552,690.00	11.84
8	600926	杭州银行	22,338,081.00	11.73
9	300033	同花顺	21,912,335.00	11.50

10	601838	成都银行	20,150,032.00	10.58
11	601398	工商银行	16,973,809.00	8.91
12	600036	招商银行	15,837,791.00	8.31
13	600958	东方证券	13,174,123.83	6.92
14	000776	广发证券	13,172,634.00	6.91
15	000001	平安银行	11,233,276.60	5.90
16	601066	中信建投	7,168,625.00	3.76
17	601377	兴业证券	6,434,439.00	3.38
18	601009	南京银行	6,395,423.00	3.36
19	601995	中金公司	5,628,631.00	2.95
20	600837	海通证券	5,303,226.01	2.78

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	601688	华泰证券	47,721,515.51	25.05
2	601166	兴业银行	36,316,460.00	19.06
3	600030	中信证券	33,614,155.55	17.64
4	601318	中国平安	26,762,595.17	14.05
5	002142	宁波银行	26,204,869.36	13.76
6	300059	东方财富	25,679,613.20	13.48
7	601398	工商银行	23,964,906.00	12.58
8	600926	杭州银行	23,688,387.69	12.43
9	601229	上海银行	22,729,883.35	11.93
10	000001	平安银行	19,677,577.60	10.33
11	601838	成都银行	19,629,478.71	10.30
12	600036	招商银行	17,997,051.00	9.45
13	300033	同花顺	16,661,516.38	8.75
14	601939	建设银行	9,998,959.00	5.25

15	000776	广发证券	6,600,187.86	3.46
16	600837	海通证券	5,406,868.90	2.84
17	601066	中信建投	2,981,409.10	1.57
18	601995	中金公司	1,788,612.00	0.94
19	688131	皓元医药	436,574.10	0.23
20	688538	和辉光电	335,312.59	0.18

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	397,862,588.65
卖出股票收入（成交）总额	381,724,120.07

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,937,451.60	5.00
	其中：政策性金融债	10,937,451.60	5.00
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	10,937,451.60	5.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	108604	国开1805	109,080	10,937,451.60	5.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 报告期内基金投资的前十名证券除招商银行(600036), 中信证券(600030), 杭州银行(600926), 宁波银行(002142), 平安银行(000001), 国开1805(108604), 成都银行(601838), 上海银行(601229)外其他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。国家外汇管理局深圳市分局2020年11月27日发布对招商银行股份有限公司的处罚(深外管检(2020)92号), 国家外汇管理局深圳市分局2020年09月29日发布对招商银行股份有限公司的处罚(深外管检[2020]76号), 银保监会2021年05月17日发布对招商银行股份有限公司的处罚(银保监罚决字(2021)16号), 深圳公安局2020年07月13日发布对招商银行股份有限公司开展立案调查, 中国证券业协会2020年07月20日发布对中信证券股份有限公司的处罚, 央行杭州中心支行2021年01月12日发布对杭州银行股份有限公司的处罚(杭银处罚字(2021)6号), 浙江银保监局2021年05月18日发布对杭州银行股份有限公司的处罚(浙银保监罚决字(2021)25号), 中国银行间市场交易商协会2020年12月31日发布对宁波银行股份有限公

司的处罚,宁波银保监局2020年10月16日发布对宁波银行股份有限公司的处罚(甬银保监罚决字(2020)48号),宁波银保监局2021年06月10日发布对宁波银行股份有限公司的处罚(甬银保监罚决字(2021)36号),央行宁波市中心支行2021年07月13日发布对宁波银行股份有限公司的处罚(甬银处罚字(2021)2号),国家外汇管理局宁波市分局2021年07月13日发布对宁波银行股份有限公司的处罚(甬外管罚(2021)7号),宁波银保监局2020年10月16日发布对平安银行股份有限公司的处罚(甬银保监罚决字(2020)66号),云南银保监局2021年05月28日发布对平安银行股份有限公司的处罚(云银保监罚决字(2021)34号),银保监会2020年12月25日发布对国家开发银行的处罚(银保监罚决字(2020)67号),国家外汇管理局北京外汇管理部2020年10月26日发布对国家开发银行的处罚(京汇罚(2020)33号),国家外汇管理局北京外汇管理部2020年10月26日发布对国家开发银行的处罚(京汇罚(2020)32号),人行营管部(成都分行)2020年07月03日发布对成都银行股份有限公司的处罚(成银营罚字(2020)7号、8号、9号、10号),上海银保监局2020年08月14日发布对上海银行股份有限公司的处罚(沪银保监银罚决字(2020)14号),上海银保监局2020年11月18日发布对上海银行股份有限公司的处罚(沪银保监银罚决字(2020)25号),上海银保监局2021年04月25日发布对上海银行股份有限公司的处罚(沪银保监罚决字(2021)31号),上海银保监局2021年07月02日发布对上海银行股份有限公司的处罚(沪银保监罚决字(2021)72号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作,上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票未超过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	134,956.05
2	应收证券清算款	238,717.92
3	应收股利	-
4	应收利息	332,620.65
5	应收申购款	1,778,240.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,484,534.90

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的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
中融鑫价值混合A	2,942	33,680.28	-	0.00%	99,087,382.69	100.00%
中融鑫价值混合C	2,253	42,205.26	2,702,214.12	2.84%	92,386,241.82	97.16%
合计	5,195	37,377.45	2,702,214.12	1.39%	191,473,624.51	98.61%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

#### 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	占基金总份额比
----	------	--------	---------

		(份)	例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中融鑫价值混合A	9.99	0.00%
	中融鑫价值混合C	100.00	0.00%
	合计	109.99	0.00%

### 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

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
- 2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中融鑫价值混合A	中融鑫价值混合C
基金合同生效日(2018年03月09日)基金份额总额	2,669,175.43	201,058,142.38
本报告期期初基金份额总额	72,708,421.37	103,267,982.66
本报告期基金总申购份额	151,280,749.54	153,150,484.73
减：本报告期基金总赎回份额	124,901,788.22	161,330,011.45
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	99,087,382.69	95,088,455.94

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

## § 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) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2021年6月19日发布公告，罗杰先生因个人原因提出离职，不再担任中融基金管理有限公司副总裁。

公司其他高管人员未变动。



## (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 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

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

## 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

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	596,419,501.30	77.11%	436,159.75	77.11%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大	2	47,321,678.72	6.12%	34,605.85	6.12%	-

证券						
海通 证券	2	-	-	-	-	-
恒泰 证券	2	129,750,770.76	16.77%	94,886.91	16.77%	-
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
网信 证券	2	-	-	-	-	-
西南 证券	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额	成交金额	占当期基金成交总额

				总额的比例		的比例		的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	18,647,324.83	100.00%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
网信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-06
2	中融基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-27

3	中融基金管理有限公司基金经理变更公告（中融鑫价值混合）	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-13
4	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-17
5	中融基金管理有限公司关于基金经理休假期间由他人代为履职的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
6	中融基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
7	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-29
8	中融基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-19

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 《中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (4) 关于申请募集中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(7) 中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：中融基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，（010）56517299。

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司  
二〇二一年八月二十八日