

**中融智选对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式
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:中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
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	74
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	74
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	74
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	74
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
7.12 市场中性策略执行情况	75
7.13 投资组合报告附注	75
§8 基金份额持有人信息	76
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	76
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.....	76
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	77
§9 开放式基金份额变动.....	77
§10 重大事件揭示.....	78
10.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
10.4 基金投资策略的改变.....	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
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.....	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
10.8 其他重大事件.....	79
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
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.....	81
§12 备查文件目录.....	81
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	中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	中融智选对冲3个月定开混合
基金主代码	008848
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020年04月03日
基金管理人	中融基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	178,794,627.19份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、多头股票投资策略：（1）多因子选股模型（2）投资组合优化模型；3、对冲工具投资策略；4、其他绝对收益策略；5、股票期权投资策略；6、债券投资策略；7、国债期货投资策略；8、可转换债券投资策略；9、现金管理策略；10、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，使用股指期货对冲市场风险，使得收益波动与股票市场相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周妹云
	联系电话	010-56517000
	电子邮箱	zhoumeiyun@zrfunds.com.cn
客户服务电话	400-160-6000; 010-5651729 9	95568
传真	010-56517001	010-58560798
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	北京市西城区复兴门内大街2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	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码	100102	100031
法定代表人	王瑶	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.zrfunds.com.cn/
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)
本期已实现收益	12,145,486.27
本期利润	6,351,466.41
加权平均基金份额本期利润	0.0383
本期加权平均净值利润率	3.76%
本期基金份额净值增长率	4.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	7,502,698.61
期末可供分配基金份额利润	0.0420
期末基金资产净值	186,297,325.80
期末基金份额净值	1.0420
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	4.20%

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

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	1.61%	0.25%	0.29%	0.01%	1.32%	0.24%

过去三个月	2.53%	0.20%	0.88%	0.01%	1.65%	0.19%
过去六个月	4.14%	0.32%	1.76%	0.01%	2.38%	0.31%
过去一年	4.22%	0.29%	3.55%	0.01%	0.67%	0.28%
自基金合同生效起至今	4.20%	0.27%	4.41%	0.01%	-0.21%	0.26%

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

中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年04月03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		
赵菲	中融中证银行指数证券投资基金（LOF）、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、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金的基金经理及数量投资部联席总经理。	2020-04-08	-	12	赵菲先生，中国国籍，毕业于北京师范大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限12年。2008年8月至2011年5月曾任国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部投资经理；2011年5月至2012年11月曾任嘉实基金管理有限公司结构产品投资部专户投资经理。2012年11月加入中融基金管理有限公司，现任数量投资部联席总经理。

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

本报告期，基金坚持市场中性投资策略，利用股指期货对股票组合进行完全对冲，在上半年大幅波动的市场下表现稳健。本基金股票部位的构建采用量化多因子选股模型，主要选取低估值、高成长、高盈利、高质量等基本面因子，精选基本面优质的个股作为主要的投资标的，在有效控制跟踪误差的前提下，力求持续获得相对基准的超额收益。同时运用股指期货进行对冲，剥离股票组合的系统性风险，根据不同股指期货合约的基差水平，灵活选择合适的股指期货合约进行对冲，并适时进行展期，力求整体对冲组合的收益最大化。

上半年，价值、红利、盈利质量因子一季度表现较好，二季度有所调整，而成长因子的有效性自二月份后持续表现较为稳定，并有望在下半年延续。市值、动量反转、波动率、流动性等市场类因子的有效性上半年波动较大，体现出该类因子的风险特征。本基金在因子的配置上坚持以基本面因子为阿尔法来源，适应了市场变化，多头组合的超额收益表现良好。

同时，在市场情绪剧烈波动的市场环境中，本基金积极参与和把握基差水平巨幅波动带来的期限套利机会。此外，还积极把握指数分红、指数成分调整、新股及可转债申购等确定性增强机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融智选对冲3个月定开混合基金份额净值为1.0420元，本报告期内，基金份额净值增长率为4.14%，同期业绩比较基准收益率为1.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年，市场在经历春节后的快速大幅调整后，于二季度逐步恢复，包括沪深300、上证指数在内的大盘指数基本回到年初水平，其中成长风格大幅跑赢，周期板块整体表现较好。

展望下半年，全球范围内，复苏向服务业转移，海外供应链虽仍未完全恢复，但各主要经济体的经济在持续修复中，中国有望率先进入“疫后新常态”。国内GDP增长放缓，消费增速修复缓慢，虽然2季度末社融增速止跌企稳，但偿债负担仍在上升。此外，本轮的供给不平衡超出预期，一方面资源再配置导致劳动市场短期出现供需错配，中低端劳动力市场求人倍率和失业率同时上升；另一方面供应链问题和企业经营思维的变化，导致补产能的不积极和弹性产能的超预期下降，短时间内将继续支撑物价，因此经济面临两大主要矛盾，即成本上升和偿债压力。即使如此，央行应不会因为供给约束导致的成本上升采取收紧货币的政策，反而会关注物价上涨对企业利润的挤压、债务风险的形成，“紧信用、松货币、宽政策”将仍然是未来一段时间央行的主基调。

市场方面，已经采取的降准等措施，将有望维持下半年的流动性宽裕，在一些高景气行业，中国已具备竞争力或正在壮大产业链，形成国产替代，市场焦点将从此前的通货膨胀，转向更加关注企业盈利增长的可持续性。

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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续20个工作日份额持有人数不满200人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	124,646.46	87,748.46
结算备付金		12,288,218.76	384,439.64
存出保证金		16,370,530.76	22,335.11
交易性金融资产	6.4.7.2	147,556,255.74	-
其中：股票投资		147,556,255.74	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	10,200,000.00	9,600,000.00
应收证券清算款		1,809,337.35	-
应收利息	6.4.7.5	6,919.07	2,277.69
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		188,355,908.14	10,096,800.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,711,538.00	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		181,875.32	10,119.15
应付托管费		37,890.71	2,108.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	97,013.63	48,075.48
应交税费		20,347.69	0.43
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	9,916.99	30,000.00
负债合计		2,058,582.34	90,303.23
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	178,794,627.19	10,000,000.00
未分配利润	6.4.7.10	7,502,698.61	6,497.67
所有者权益合计		186,297,325.80	10,006,497.67
负债和所有者权益总计		188,355,908.14	10,096,800.90

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额总额178,794,627.19份，份额净值1.0420元。

6.2 利润表

会计主体：中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

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04月03日（基金 合同生效日）至2020 年06月30日
一、收入		8,072,871.14	68,516.52
1. 利息收入		244,608.53	25,496.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	143,192.73	18,712.81
债券利息收入		151.05	0.25
资产支持证券利息		-	-

收入			
买入返售金融资产收入		101,264.75	6,782.99
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,603,327.58	-114,738.59
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,880,207.05	-16,186.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	53,074.12	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	6,644,330.09	-135,452.62
股利收益	6.4.7.16	1,025,716.32	36,900.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-5,794,019.86	157,759.06
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	18,954.89	-
减：二、费用		1,721,404.73	70,675.44
1. 管理人报酬		1,003,971.16	28,756.76
2. 托管费		209,160.70	5,991.02
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	474,295.48	25,505.34
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		23,919.69	227.11
7. 其他费用	6.4.7.20	10,057.70	10,195.21
三、利润总额（亏损总额		6,351,466.41	-2,158.92

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		6,351,466.41	-2,158.92

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

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)	10,000,000.00	6,497.67	10,006,497.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,351,466.41	6,351,466.41
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)	168,794,627.19	1,144,734.53	169,939,361.72
其中：1. 基金申购款	173,762,330.66	1,231,669.34	174,994,000.00
2. 基金赎回款	-4,967,703.47	-86,934.81	-5,054,638.28
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)	178,794,627.19	7,502,698.61	186,297,325.80
项 目	上年度可比期间 2020年04月03日（基金合同生效日）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)	10,000,000.00	-	10,000,000.00
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	-2,158.92	-2,158.92
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)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回 款	-	-	-
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)	10,000,000.00	-2,158.92	9,997,841.08

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

中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金(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[2019]2888号文《关于准予中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》批准,由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《中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

基金合同》(“基金合同”)发起,于2020年4月3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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金募集期为自2020年3月31日至2020年3月31日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,募集资金总额为人民币10,000,000.00元,折合10,000,000.00份中融智选对冲3个月定开混合基金份额,有效认购户数为1户。其中,认购资金在募集期间产生的利息共计人民币零元,折合基金份额零份,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,本基金的投资对象是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)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权)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:中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+2%。

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年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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，暂免予缴纳印花税、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	124,646.46
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	124,646.46

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	149,672,575.60	147,556,255.74	-2,116,319.86

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	149,672,575.60	147,556,255.74		-2,116,319.86

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-132,023,580.00	-	-	-
股指期货	-132,023,580.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-132,023,580.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为零。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益。因此，衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的股指期货暂收暂付款（结算所得的持仓损益）抵销后无余额。于2021年06月30日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2112	沪深300股指期货2112合约	-88	-135,701,280.00	-3,677,700.00

总额合计	-	-	-	-3,677,700.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-3,677,700.00
股指期货投资净值	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,200,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,200,000.00	-

6.4.7.5 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	266.61
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	6,613.66
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	38.80
合计	6,919.07

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 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	97,013.63
银行间市场应付交易费用	-
合计	97,013.63

6.4.7.8 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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	9,916.99
合计	9,916.99

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,000,000.00	10,000,000.00
本期申购	173,762,330.66	173,762,330.66
本期赎回（以“-”号填列）	-4,967,703.47	-4,967,703.47
本期末	178,794,627.19	178,794,627.19

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,497.67	-	6,497.67
本期利润	12,145,486.27	-5,794,019.86	6,351,466.41
本期基金份额交易产生的变动数	1,147,141.17	-2,406.64	1,144,734.53
其中：基金申购款	1,227,528.17	4,141.17	1,231,669.34
基金赎回款	-80,387.00	-6,547.81	-86,934.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,299,125.11	-5,796,426.50	7,502,698.61

6.4.7.11 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	7,176.07
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	135,416.66
其他	600.00
合计	143,192.73

6.4.7.12 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	125,805,631.13
减：卖出股票成本总额	119,925,424.08
买卖股票差价收入	5,880,207.05

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	53,074.12
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	53,074.12

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	965,023.14
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	906,530.70
减：应收利息总额	5,418.32
买卖债券差价收入	53,074.12

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

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**

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年01月01日至2021年06月30日
期货投资	6,644,330.09

6.4.7.16 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	1,025,716.32
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	1,025,716.32

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01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-2,116,319.86
——股票投资	-2,116,319.86
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-3,677,700.00
——权证投资	-
——期货投资	-3,677,700.00
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	-5,794,019.86

6.4.7.18 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	18,954.89
合计	18,954.89

6.4.7.19 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	457,546.40
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	16,749.08
合计	474,295.48

6.4.7.20 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	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	140.71
合计	10,057.70

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
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
中国民生银行股份有限公司	基金托管人

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年01月01日至2021年06月30日	2020年04月03日（基金合同生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,003,971.16	28,756.76
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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×1.20%/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04月03日（基金合同生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	209,160.70	5,991.02

注：①支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的年费率计提，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×0.25%/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

份额单位：份

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04月03日（基金合同生效日）至2020年06月30日
----	-------------------------------	---

基金合同生效日（2020年04月03日）持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
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	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.59%	100.00%

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04月03日（基金合同生效日） 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
中国民生银行股份有限公司	124,646.46	7,176.07	81,791.55	7,520.68

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
688690	纳微科技	2021-06-16	2021-12-23	首次公开发行限售	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-
688315	诺禾致源	2021-04-02	2021-10-13	首次公开发行限售	12.76	39.20	3,142	40,091.92	123,166.40	-
688319	欧林生物	2021-05-31	2021-12-08	首次公开发行限售	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
688636	智明达	2021-03-30	2021-10-08	首次公开发行限售	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
688355	明志科技	2021-04-30	2021-11-12	首次公开发行限售	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-
688676	金盘科技	2021-03-02	2021-09-09	首次公开发行限售	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-

688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未流通	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未流通	21.96	21.96	2,024	44,447.04	44,447.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未流通	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未流通	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
688395	正弦电气	2021-04-21	2021-10-29	首次公开发行限售	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	首次公开发行限售	47.33	251.96	128	6,058.24	32,250.88	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未流通	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行限售	33.22	87.50	245	8,138.90	21,437.50	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	首次公开发行限售	28.28	115.71	171	4,835.88	19,786.41	-
301015	百洋医药	2021-06-	2021-12-	首次公开	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.4	-

		22	30	发行 限售					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	-
3006 14	百川 畅银	2021 -05- 18	2021 -11- 25	首次 公开 发行 限售	9.19	40.3 8	329	3,02 3.51	13,2 85.0 2	-
3010 02	崧盛 股份	2021 -05- 27	2021 -12- 07	首次 公开 发行 限售	18.7 1	57.6 2	201	3,76 0.71	11,5 81.6 2	-
6052 87	德才 股份	2021 -06- 28	2021 -07- 06	新股 未流 通	31.5 6	31.5 6	349	11,0 14.4 4	11,0 14.4 4	-
3009 55	嘉亨 家化	2021 -03- 16	2021 -09- 24	首次 公开 发行 限售	16.5 3	46.0 7	232	3,83 4.96	10,6 88.2 4	-
3009 96	普联 软件	2021 -05- 26	2021 -12- 03	首次 公开 发行 限售	20.8 1	42.2 3	241	5,01 5.21	10,1 77.4 3	-
3009 68	格林 精密	2021 -04- 06	2021 -10- 15	首次 公开 发行 限售	6.87	12.0 7	791	5,43 4.17	9,54 7.37	-
3009 62	中金 辐照	2021 -03- -	2021 -10- -	首次 公开	3.40	16.3 7	576	1,95 8.40	9,42 9.12	-

		29	11	发行 限售						
3009 66	共同 药业	2021 -03- 31	2021 -10- 11	首次 公开发 行 限售	8.24	31.5 4	286	2,35 6.64	9,02 0.44	-
3009 61	深水 海纳	2021 -03- 23	2021 -09- 30	首次 公开发 行 限售	8.48	22.0 7	394	3,34 1.12	8,69 5.58	-
6051 62	新中 港	2021 -06- 29	2021 -07- 07	新股 未流 通	6.07	6.07	1,377	8,35 8.39	8,35 8.39	-
3009 58	建工 修复	2021 -03- 18	2021 -09- 29	首次 公开发 行 限售	8.53	27.2 2	300	2,55 9.00	8,16 6.00	-
3009 87	川网 传媒	2021 -04- 28	2021 -11- 11	首次 公开发 行 限售	6.79	26.8 1	301	2,04 3.79	8,06 9.81	-
3009 78	东箭 科技	2021 -04- 15	2021 -10- 26	首次 公开发 行 限售	8.42	13.6 0	593	4,99 3.06	8,06 4.80	-
3010 04	嘉益 股份	2021 -06- 18	2021 -12- 27	首次 公开发 行 限售	7.81	21.9 4	312	2,43 6.72	6,84 5.28	-
3009 91	创益 通	2021 -05- 12	2021 -11- 22	首次 公开发 行 限售	13.0 6	26.5 1	254	3,31 7.24	6,73 3.54	-
3009	商络	2021	2021	首次	5.48	13.0	492	2,69	6,41	-

75	电子	-04-14	-10-21	公开发 行限 售		3		6.16	0.76	
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	首次公开发 行限 售	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	首次公开发 行限 售	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	首次公开发 行限 售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	首次公开发 行限 售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	首次公开发 行限 售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发 行限 售	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	首次公开发 行限 售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	首次公开发 行	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-

				限售						
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	-
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

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	2021-06-16	重大事项停牌	5.59	2021-07-06	6.15	22,700	166,699.19	126,893.00	-

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

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

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产品开放赎回期间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同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	124,646.46	-	-	-	124,646.46
结算备付金	12,288,218.76	-	-	-	12,288,218.76
存出保证金	16,370,530.76	-	-	-	16,370,530.76
交易性	-	-	-	147,556,255.74	147,556,255.74

金融资产					
买入返售金融资产	10,200,000.00	-	-	-	10,200,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,809,337.35	1,809,337.35
应收利息	-	-	-	6,919.07	6,919.07
资产总计	38,983,395.98	-	-	149,372,512.16	188,355,908.14
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,711,538.00	1,711,538.00
应付管理人报酬	-	-	-	181,875.32	181,875.32
应付托管费	-	-	-	37,890.71	37,890.71
应付交易费用	-	-	-	97,013.63	97,013.63
应交税费	-	-	-	20,347.69	20,347.69
其他负债	-	-	-	9,916.99	9,916.99
负债总计	-	-	-	2,058,582.34	2,058,582.34
利率敏感度缺口	38,983,395.98	-	-	147,313,929.82	186,297,325.80
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	87,748.46	-	-	-	87,748.46
结算备付金	384,439.64	-	-	-	384,439.64
存出保证金	22,335.11	-	-	-	22,335.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-

产					
买入返售金融资产	9,600,000.00	-	-	-	9,600,000.00
应收利息	-	-	-	2,277.69	2,277.69
资产总计	10,094,523.21	-	-	2,277.69	10,096,800.90
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	10,119.15	10,119.15
应付托管费	-	-	-	2,108.17	2,108.17
应付交易费用	-	-	-	48,075.48	48,075.48
应交税费	-	-	-	0.43	0.43
其他负债	-	-	-	30,000.00	30,000.00
负债总计	-	-	-	90,303.23	90,303.23
利率敏感度缺口	10,094,523.21	-	-	-88,025.54	10,006,497.67

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	147,556,255.74	79.20	-	-
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	147,556,255.74	79.20	-	-

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%	741,423.69	-
沪深300指数下降5%	-741,423.69	-	

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的金融工具中属于第一层次的余额为人民币146,162,865.79元，属于第二层次的余额为人民币1,393,389.95元，无属于第三层次的余额。

③ 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	147,556,255.74	78.34
	其中：股票	147,556,255.74	78.34
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	10,200,000.00	5.42
	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	12,412,865.22	6.59
8	其他各项资产	18,186,787.18	9.66
9	合计	188,355,908.14	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	1,233,148.98	0.66
B	采矿业	3,000,295.00	1.61
C	制造业	85,790,710.05	46.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,951,204.59	1.05

E	建筑业	1,778,350.37	0.95
F	批发和零售业	876,208.22	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	3,781,511.60	2.03
H	住宿和餐饮业	369,811.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,162,292.44	2.77
J	金融业	31,706,098.64	17.02
K	房地产业	2,825,965.00	1.52
L	租赁和商务服务业	2,122,195.00	1.14
M	科学研究和技术服务业	2,308,148.40	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	347,533.61	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	213,078.00	0.11
Q	卫生和社会工作	3,353,673.84	1.80
R	文化、体育和娱乐业	736,031.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	147,556,255.74	79.20

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	3,800	7,815,460.00	4.20
2	601318	中国平安	74,500	4,788,860.00	2.57
3	600036	招商银行	87,900	4,763,301.00	2.56
4	000858	五粮液	13,700	4,081,093.00	2.19
5	601012	隆基股份	29,260	2,599,458.40	1.40
6	002415	海康威视	34,000	2,193,000.00	1.18
7	000001	平安银行	89,500	2,024,490.00	1.09
8	000333	美的集团	27,000	1,926,990.00	1.03
9	601567	三星医疗	85,500	1,821,150.00	0.98

10	000661	长春高新	4,700	1,818,900.00	0.98
11	300059	东方财富	52,960	1,736,558.40	0.93
12	000002	万科A	69,900	1,664,319.00	0.89
13	601166	兴业银行	80,000	1,644,000.00	0.88
14	002594	比亚迪	6,500	1,631,500.00	0.88
15	601888	中国中免	5,300	1,590,530.00	0.85
16	300122	智飞生物	8,500	1,587,205.00	0.85
17	603259	药明康德	9,800	1,534,582.00	0.82
18	000568	泸州老窖	6,300	1,486,422.00	0.80
19	002142	宁波银行	37,983	1,480,197.51	0.79
20	600887	伊利股份	38,700	1,425,321.00	0.77
21	300015	爱尔眼科	19,708	1,398,873.84	0.75
22	603501	韦尔股份	4,300	1,384,600.00	0.74
23	000651	格力电器	26,500	1,380,650.00	0.74
24	600900	长江电力	62,500	1,290,000.00	0.69
25	600276	恒瑞医药	18,435	1,253,026.95	0.67
26	002475	立讯精密	27,020	1,242,920.00	0.67
27	688276	百克生物	11,714	1,225,050.12	0.66
28	601398	工商银行	230,000	1,189,100.00	0.64
29	600030	中信证券	46,800	1,167,192.00	0.63
30	000725	京东方A	186,300	1,162,512.00	0.62
31	000301	东方盛虹	55,000	1,149,500.00	0.62
32	601899	紫金矿业	107,500	1,041,675.00	0.56
33	601919	中远海控	33,300	1,016,982.00	0.55
34	600309	万华化学	8,700	946,734.00	0.51
35	002460	赣锋锂业	7,800	944,502.00	0.51
36	002352	顺丰控股	13,900	941,030.00	0.51
37	000776	广发证券	61,500	931,110.00	0.50
38	300347	泰格医药	4,800	927,840.00	0.50
39	600809	山西汾酒	2,000	896,000.00	0.48
40	002714	牧原股份	14,400	875,808.00	0.47

41	600660	福耀玻璃	15,500	865,675.00	0.46
42	002271	东方雨虹	15,100	835,332.00	0.45
43	600690	海尔智家	32,000	829,120.00	0.45
44	600031	三一重工	28,500	828,495.00	0.44
45	603986	兆易创新	4,340	815,486.00	0.44
46	603799	华友钴业	7,000	799,400.00	0.43
47	603288	海天味业	5,960	768,542.00	0.41
48	600436	片仔癀	1,700	762,110.00	0.41
49	000786	北新建材	18,200	714,350.00	0.38
50	300628	亿联网络	8,200	687,160.00	0.37
51	002304	洋河股份	3,300	683,760.00	0.37
52	002812	恩捷股份	2,900	678,890.00	0.36
53	002230	科大讯飞	9,800	662,284.00	0.36
54	002648	卫星石化	16,860	660,743.40	0.35
55	600000	浦发银行	64,500	645,000.00	0.35
56	300014	亿纬锂能	6,200	644,366.00	0.35
57	600438	通威股份	14,800	640,396.00	0.34
58	002624	完美世界	26,500	633,615.00	0.34
59	300274	阳光电源	5,500	632,830.00	0.34
60	600926	杭州银行	42,890	632,627.50	0.34
61	300124	汇川技术	8,500	631,210.00	0.34
62	600745	闻泰科技	6,500	629,850.00	0.34
63	600837	海通证券	53,000	609,500.00	0.33
64	600919	江苏银行	85,000	603,500.00	0.32
65	000100	TCL科技	77,200	590,580.00	0.32
66	002311	海大集团	7,100	579,360.00	0.31
67	601816	京沪高铁	107,960	571,108.40	0.31
68	000063	中兴通讯	16,994	564,710.62	0.30
69	002241	歌尔股份	13,200	564,168.00	0.30
70	601601	中国太保	18,829	545,476.13	0.29
71	601668	中国建筑	115,500	537,075.00	0.29

72	002027	分众传媒	56,500	531,665.00	0.29
73	601117	中国化学	60,000	525,600.00	0.28
74	300142	沃森生物	8,500	524,450.00	0.28
75	002967	广电计量	11,600	508,080.00	0.27
76	688169	石头科技	400	504,400.00	0.27
77	601328	交通银行	102,800	503,720.00	0.27
78	600985	淮北矿业	40,000	488,400.00	0.26
79	002409	雅克科技	6,000	486,000.00	0.26
80	002821	凯莱英	1,300	484,380.00	0.26
81	600196	复星医药	6,700	483,271.00	0.26
82	603882	金城医学	3,000	479,310.00	0.26
83	601288	农业银行	158,000	478,740.00	0.26
84	600703	三安光电	14,800	474,340.00	0.25
85	300413	芒果超媒	6,800	466,480.00	0.25
86	000338	潍柴动力	26,000	464,620.00	0.25
87	601311	骆驼股份	40,000	462,800.00	0.25
88	002179	中航光电	5,800	458,316.00	0.25
89	002129	中环股份	11,700	451,620.00	0.24
90	600600	青岛啤酒	3,900	451,035.00	0.24
91	601229	上海银行	54,700	448,540.00	0.24
92	601688	华泰证券	28,300	447,140.00	0.24
93	600050	中国联通	102,300	441,936.00	0.24
94	601211	国泰君安	24,800	425,072.00	0.23
95	600104	上汽集团	19,300	424,021.00	0.23
96	002541	鸿路钢构	7,200	420,120.00	0.23
97	600570	恒生电子	4,500	419,625.00	0.23
98	600763	通策医疗	1,000	411,000.00	0.22
99	688308	欧科亿	5,985	405,603.45	0.22
100	600048	保利地产	33,300	400,932.00	0.22
101	688111	金山办公	1,000	394,800.00	0.21
102	600399	抚顺特钢	21,600	391,824.00	0.21

103	600999	招商证券	20,500	389,910.00	0.21
104	002736	国信证券	36,000	387,000.00	0.21
105	000166	申万宏源	82,500	386,100.00	0.21
106	000830	鲁西化工	20,600	385,838.00	0.21
107	002049	紫光国微	2,500	385,475.00	0.21
108	600019	宝钢股份	49,000	374,360.00	0.20
109	300316	晶盛机电	7,400	373,700.00	0.20
110	300587	天铁股份	16,300	365,935.00	0.20
111	300496	中科创达	2,300	361,238.00	0.19
112	002371	北方华创	1,300	360,594.00	0.19
113	601988	中国银行	116,000	357,280.00	0.19
114	601088	中国神华	18,200	355,264.00	0.19
115	002410	广联达	5,200	354,640.00	0.19
116	600406	国电南瑞	15,240	354,177.60	0.19
117	300498	温氏股份	24,460	351,490.20	0.19
118	002139	拓邦股份	19,300	347,207.00	0.19
119	601818	光大银行	90,800	343,224.00	0.18
120	300601	康泰生物	2,300	342,700.00	0.18
121	600585	海螺水泥	8,300	340,715.00	0.18
122	601838	成都银行	26,900	340,016.00	0.18
123	002677	浙江美大	18,100	330,868.00	0.18
124	000783	长江证券	45,200	330,864.00	0.18
125	300450	先导智能	5,500	330,770.00	0.18
126	000625	长安汽车	12,500	328,500.00	0.18
127	000538	云南白药	2,800	324,016.00	0.17
128	601628	中国人寿	9,200	311,788.00	0.17
129	300454	深信服	1,200	311,376.00	0.17
130	600893	航发动力	5,800	308,502.00	0.17
131	601995	中金公司	4,900	301,350.00	0.16
132	601169	北京银行	61,800	300,966.00	0.16
133	601658	邮储银行	59,800	300,196.00	0.16

134	300982	苏文电能	5,317	294,106.93	0.16
135	601390	中国中铁	56,000	293,440.00	0.16
136	601633	长城汽车	6,700	292,053.00	0.16
137	601766	中国中车	48,000	291,840.00	0.16
138	300595	欧普康视	2,800	289,940.00	0.16
139	601009	南京银行	27,500	289,300.00	0.16
140	002493	荣盛石化	16,750	289,272.50	0.16
141	601377	兴业证券	29,500	284,970.00	0.15
142	601857	中国石油	53,500	283,015.00	0.15
143	688059	华锐精密	1,674	281,064.60	0.15
144	002028	思源电气	9,100	280,189.00	0.15
145	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.15
146	300782	卓胜微	500	268,750.00	0.14
147	600009	上海机场	5,500	264,715.00	0.14
148	601225	陕西煤业	22,000	260,700.00	0.14
149	688036	传音控股	1,240	259,780.00	0.14
150	600346	恒力石化	9,900	259,776.00	0.14
151	002601	龙佰集团	7,500	259,350.00	0.14
152	300034	钢研高纳	8,000	257,680.00	0.14
153	600132	重庆啤酒	1,300	257,335.00	0.14
154	600584	长电科技	6,800	256,224.00	0.14
155	300408	三环集团	6,000	254,520.00	0.14
156	600426	华鲁恒升	8,200	253,790.00	0.14
157	600111	北方稀土	12,000	248,400.00	0.13
158	002709	天赐材料	2,300	245,134.00	0.13
159	601939	建设银行	36,800	244,720.00	0.13
160	300593	新雷能	5,612	243,841.40	0.13
161	002001	新和成	8,460	242,632.80	0.13
162	300433	蓝思科技	8,200	241,162.00	0.13
163	601100	恒立液压	2,800	240,576.00	0.13
164	000895	双汇发展	7,500	238,500.00	0.13

165	600563	法拉电子	1,500	237,540.00	0.13
166	002050	三花智控	9,800	235,004.00	0.13
167	688012	中微公司	1,400	232,288.00	0.12
168	600958	东方证券	23,000	229,770.00	0.12
169	300003	乐普医疗	7,020	225,482.40	0.12
170	002841	视源股份	1,800	223,722.00	0.12
171	000963	华东医药	4,800	220,848.00	0.12
172	002007	华兰生物	6,000	220,080.00	0.12
173	688188	柏楚电子	500	218,000.00	0.12
174	601006	大秦铁路	32,800	215,824.00	0.12
175	000157	中联重科	23,300	215,292.00	0.12
176	300687	赛意信息	10,000	213,700.00	0.11
177	002607	中公教育	10,200	213,078.00	0.11
178	600028	中国石化	48,500	211,460.00	0.11
179	002236	大华股份	10,000	211,000.00	0.11
180	002466	天齐锂业	3,400	210,868.00	0.11
181	603806	福斯特	2,000	210,260.00	0.11
182	600143	金发科技	10,000	208,600.00	0.11
183	601155	新城控股	5,000	208,000.00	0.11
184	000012	南玻A	20,264	207,503.36	0.11
185	601336	新华保险	4,500	206,595.00	0.11
186	603568	伟明环保	8,900	203,187.00	0.11
187	002563	森马服饰	16,800	200,760.00	0.11
188	601877	正泰电器	6,000	200,280.00	0.11
189	603993	洛阳钼业	38,800	200,208.00	0.11
190	603596	伯特利	5,600	200,200.00	0.11
191	000768	中航西飞	7,500	197,100.00	0.11
192	603589	口子窖	2,900	196,301.00	0.11
193	600760	中航沈飞	3,220	194,166.00	0.10
194	600258	首旅酒店	8,100	193,266.00	0.10
195	001979	招商蛇口	17,500	191,625.00	0.10

196	601788	光大证券	10,700	191,423.00	0.10
197	300529	健帆生物	2,200	189,992.00	0.10
198	002008	大族激光	4,700	189,833.00	0.10
199	600588	用友网络	5,700	189,582.00	0.10
200	603369	今世缘	3,500	189,560.00	0.10
201	002202	金风科技	15,200	184,832.00	0.10
202	000876	新希望	12,500	183,375.00	0.10
203	601916	浙商银行	45,800	181,826.00	0.10
204	601799	星宇股份	800	180,576.00	0.10
205	600754	锦江酒店	3,100	176,545.00	0.09
206	002555	三七互娱	7,300	175,346.00	0.09
207	000938	紫光股份	7,840	171,539.20	0.09
208	603899	晨光文具	2,000	169,120.00	0.09
209	000596	古井贡酒	700	167,650.00	0.09
210	000069	华侨城A	22,500	167,400.00	0.09
211	600989	宝丰能源	12,200	166,896.00	0.09
212	688363	华熙生物	600	166,716.00	0.09
213	601066	中信建投	5,300	166,579.00	0.09
214	000425	徐工机械	26,000	165,620.00	0.09
215	000807	云铝股份	13,800	164,220.00	0.09
216	603659	璞泰来	1,200	163,920.00	0.09
217	300136	信维通信	5,300	163,664.00	0.09
218	600795	国电电力	65,000	157,950.00	0.08
219	002384	东山精密	7,500	156,300.00	0.08
220	601238	广汽集团	12,000	155,400.00	0.08
221	000977	浪潮信息	5,500	154,715.00	0.08
222	601901	方正证券	16,500	154,440.00	0.08
223	600521	华海药业	7,200	150,336.00	0.08
224	300677	英科医疗	1,200	149,760.00	0.08
225	688008	澜起科技	2,400	149,712.00	0.08
226	300767	震安科技	1,800	149,490.00	0.08

227	600886	国投电力	15,300	147,033.00	0.08
228	600029	南方航空	24,300	146,286.00	0.08
229	601985	中国核电	28,800	145,728.00	0.08
230	002414	高德红外	5,280	145,622.40	0.08
231	000703	恒逸石化	12,000	143,400.00	0.08
232	603517	绝味食品	1,700	143,293.00	0.08
233	300144	宋城演艺	8,500	142,800.00	0.08
234	002600	领益智造	15,500	142,445.00	0.08
235	300676	华大基因	1,200	142,320.00	0.08
236	603833	欧派家居	1,000	141,960.00	0.08
237	000066	中国长城	9,700	141,620.00	0.08
238	300558	贝达药业	1,300	140,712.00	0.08
239	002252	上海莱士	18,500	138,565.00	0.07
240	002044	美年健康	15,000	136,650.00	0.07
241	688396	华润微	1,500	136,530.00	0.07
242	002938	鹏鼎控股	3,800	136,344.00	0.07
243	601077	渝农商行	34,000	135,660.00	0.07
244	300033	同花顺	1,200	135,336.00	0.07
245	600522	中天科技	13,500	135,000.00	0.07
246	601607	上海医药	6,300	133,119.00	0.07
247	000728	国元证券	16,700	133,099.00	0.07
248	002602	世纪华通	20,500	131,610.00	0.07
249	600161	天坛生物	3,800	130,150.00	0.07
250	002557	洽洽食品	3,000	129,300.00	0.07
251	600332	白云山	3,800	128,630.00	0.07
252	601111	中国国航	16,500	128,370.00	0.07
253	603345	安井食品	500	127,010.00	0.07
254	002024	苏宁易购	22,700	126,893.00	0.07
255	600845	宝信软件	2,480	126,232.00	0.07
256	600115	中国东航	24,700	125,476.00	0.07
257	688315	诺禾致源	3,142	123,166.40	0.07

258	002531	天顺风能	14,200	122,830.00	0.07
259	601727	上海电气	28,200	119,568.00	0.06
260	000860	顺鑫农业	2,800	118,104.00	0.06
261	601618	中国中冶	39,300	117,114.00	0.06
262	002508	老板电器	2,500	116,250.00	0.06
263	000708	中信特钢	5,500	114,620.00	0.06
264	000967	盈峰环境	16,623	114,200.01	0.06
265	601021	春秋航空	2,000	113,800.00	0.06
266	000983	山西焦煤	13,500	112,185.00	0.06
267	002916	深南电路	1,000	111,130.00	0.06
268	000733	振华科技	1,800	109,926.00	0.06
269	002286	保龄宝	11,500	109,825.00	0.06
270	002456	欧菲光	12,000	106,560.00	0.06
271	600741	华域汽车	4,000	105,080.00	0.06
272	002157	正邦科技	8,700	103,965.00	0.06
273	600011	华能国际	24,300	102,546.00	0.06
274	000656	金科股份	17,500	101,325.00	0.05
275	002463	沪电股份	6,500	100,555.00	0.05
276	601933	永辉超市	21,000	99,330.00	0.05
277	600655	豫园股份	8,500	98,515.00	0.05
278	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.05
279	600848	上海临港	5,160	92,364.00	0.05
280	600018	上港集团	19,000	90,630.00	0.05
281	600176	中国巨石	5,774	89,554.74	0.05
282	002558	巨人网络	6,700	89,110.00	0.05
283	601108	财通证券	8,300	87,067.00	0.05
284	601998	中信银行	16,800	85,680.00	0.05
285	002120	韵达股份	6,300	85,239.00	0.05
286	601555	东吴证券	10,000	83,400.00	0.04
287	600352	浙江龙盛	6,000	82,440.00	0.04
288	601872	招商轮船	17,760	82,051.20	0.04

289	002673	西部证券	9,800	80,850.00	0.04
290	688009	中国通号	13,940	79,318.60	0.04
291	002739	万达电影	5,000	78,950.00	0.04
292	688126	沪硅产业	2,700	78,786.00	0.04
293	603658	安图生物	1,030	78,043.10	0.04
294	603392	万泰生物	300	77,754.00	0.04
295	603338	浙江鼎力	1,300	76,297.00	0.04
296	688636	智明达	918	74,100.96	0.04
297	002727	一心堂	2,000	66,220.00	0.04
298	600061	国投资本	7,600	64,524.00	0.03
299	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.03
300	002032	苏泊尔	1,000	63,790.00	0.03
301	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.03
302	000400	许继电气	4,800	60,768.00	0.03
303	600025	华能水电	10,000	57,900.00	0.03
304	002939	长城证券	5,200	57,876.00	0.03
305	600859	王府井	2,000	57,760.00	0.03
306	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
307	000800	一汽解放	5,200	56,264.00	0.03
308	300653	正海生物	700	54,810.00	0.03
309	002153	石基信息	2,320	54,543.20	0.03
310	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.03
311	603801	志邦家居	1,500	47,940.00	0.03
312	300788	中信出版	1,300	47,801.00	0.03
313	601808	中海油服	3,300	47,388.00	0.03
314	002773	康弘药业	2,028	46,907.64	0.03
315	600918	中泰证券	4,200	45,444.00	0.02
316	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
317	688087	英科再生	2,024	44,447.04	0.02
318	603019	中科曙光	1,500	41,415.00	0.02
319	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.02

320	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.02
321	688586	江航装备	1,300	36,244.00	0.02
322	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
323	300957	贝泰妮	128	32,250.88	0.02
324	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
325	300979	华利集团	245	21,437.50	0.01
326	300973	立高食品	171	19,786.41	0.01
327	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
328	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
329	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
330	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
331	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
332	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
333	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
334	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.01
335	300996	普联软件	241	10,177.43	0.01
336	300968	格林精密	791	9,547.37	0.01
337	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
338	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
339	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
340	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
341	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
342	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
343	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
344	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
345	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
346	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
347	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
348	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
349	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
350	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00

351	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
352	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
353	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
354	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
355	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
356	300992	泰福泵业	200	4,064.00	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	600519	贵州茅台	10,132,193.74	101.26
2	601318	中国平安	8,551,406.00	85.46
3	600036	招商银行	6,385,380.00	63.81
4	000858	五粮液	5,528,722.90	55.25
5	000333	美的集团	4,504,751.28	45.02
6	000001	平安银行	4,041,251.01	40.39
7	002415	海康威视	3,461,726.00	34.59
8	600276	恒瑞医药	3,409,224.89	34.07
9	000002	万科A	3,302,906.00	33.01
10	601567	三星医疗	3,187,499.00	31.85
11	000661	长春高新	3,093,522.00	30.92
12	300059	东方财富	3,050,358.00	30.48
13	300122	智飞生物	2,967,257.64	29.65
14	002142	宁波银行	2,964,906.15	29.63
15	601166	兴业银行	2,942,352.00	29.40
16	601012	隆基股份	2,816,433.07	28.15
17	600887	伊利股份	2,498,615.00	24.97
18	002475	立讯精密	2,398,715.92	23.97
19	000651	格力电器	2,397,999.00	23.96

20	601888	中国中免	2,273,041.21	22.72
21	000776	广发证券	2,259,231.79	22.58
22	600030	中信证券	2,157,331.00	21.56
23	002352	顺丰控股	2,112,876.16	21.12
24	000568	泸州老窖	2,108,322.00	21.07
25	000725	京东方A	2,100,273.00	20.99
26	600031	三一重工	2,065,774.48	20.64
27	601899	紫金矿业	1,987,940.00	19.87
28	300124	汇川技术	1,979,276.00	19.78
29	002594	比亚迪	1,966,533.00	19.65
30	002460	赣锋锂业	1,889,626.00	18.88
31	002541	鸿路钢构	1,877,523.00	18.76
32	601398	工商银行	1,826,201.00	18.25
33	603259	药明康德	1,816,218.00	18.15
34	600690	海尔智家	1,810,745.00	18.10
35	603501	韦尔股份	1,726,832.00	17.26
36	600809	山西汾酒	1,718,175.00	17.17
37	600900	长江电力	1,615,144.00	16.14
38	603288	海天味业	1,604,586.56	16.04
39	300347	泰格医药	1,424,483.00	14.24
40	600309	万华化学	1,418,348.94	14.17
41	002714	牧原股份	1,374,595.23	13.74
42	300015	爱尔眼科	1,360,850.00	13.60
43	000786	北新建材	1,328,421.00	13.28
44	600745	闻泰科技	1,317,160.00	13.16
45	600926	杭州银行	1,316,459.01	13.16
46	000301	东方盛虹	1,311,127.00	13.10
47	002648	卫星石化	1,294,582.00	12.94
48	601601	中国太保	1,251,212.04	12.50
49	002493	荣盛石化	1,251,073.00	12.50
50	002410	广联达	1,225,546.00	12.25

51	600660	福耀玻璃	1,191,786.00	11.91
52	688276	百克生物	1,187,504.90	11.87
53	000783	长江证券	1,161,353.00	11.61
54	002624	完美世界	1,141,780.00	11.41
55	300628	亿联网络	1,126,636.00	11.26
56	002027	分众传媒	1,125,624.22	11.25
57	000338	潍柴动力	1,111,420.00	11.11
58	002271	东方雨虹	1,059,091.00	10.58
59	600585	海螺水泥	1,045,640.00	10.45
60	000100	TCL科技	1,044,281.00	10.44
61	603986	兆易创新	1,034,815.00	10.34
62	600048	保利地产	1,020,329.00	10.20
63	300767	震安科技	1,016,621.72	10.16
64	601328	交通银行	1,014,848.00	10.14
65	002230	科大讯飞	1,011,659.00	10.11
66	601688	华泰证券	982,936.00	9.82
67	600438	通威股份	981,091.00	9.80
68	002001	新和成	977,537.00	9.77
69	600000	浦发银行	966,297.00	9.66
70	002736	国信证券	953,004.00	9.52
71	300014	亿纬锂能	943,309.00	9.43
72	300413	芒果超媒	935,474.00	9.35
73	002304	洋河股份	922,637.00	9.22
74	002601	龙佰集团	915,147.00	9.15
75	601818	光大银行	913,025.00	9.12
76	002049	紫光国微	905,318.00	9.05
77	603799	华友钴业	903,795.00	9.03
78	300274	阳光电源	898,843.00	8.98
79	600837	海通证券	890,002.00	8.89
80	601100	恒立液压	889,462.00	8.89
81	002179	中航光电	883,218.00	8.83

82	002311	海大集团	868,954.00	8.68
83	600999	招商证券	858,328.50	8.58
84	601668	中国建筑	857,557.00	8.57
85	002812	恩捷股份	849,380.00	8.49
86	002409	雅克科技	837,647.00	8.37
87	600346	恒力石化	819,818.00	8.19
88	000063	中兴通讯	819,361.06	8.19
89	600176	中国巨石	816,826.00	8.16
90	601919	中远海控	801,986.00	8.01
91	002402	和而泰	793,990.00	7.93
92	600703	三安光电	787,121.00	7.87
93	688036	传音控股	784,830.00	7.84
94	002241	歌尔股份	779,445.00	7.79
95	600570	恒生电子	777,755.88	7.77
96	601088	中国神华	755,975.00	7.55
97	300142	沃森生物	752,968.00	7.52
98	600436	片仔癀	749,494.00	7.49
99	600050	中国联通	745,992.00	7.46
100	601288	农业银行	743,627.00	7.43
101	300454	深信服	736,186.00	7.36
102	601816	京沪高铁	711,191.20	7.11
103	300896	爱美客	710,172.00	7.10
104	600919	江苏银行	698,803.00	6.98
105	600763	通策医疗	698,359.00	6.98
106	600406	国电南瑞	693,257.00	6.93
107	002821	凯莱英	683,195.00	6.83
108	601766	中国中车	671,908.00	6.71
109	601229	上海银行	669,449.00	6.69
110	300498	温氏股份	665,164.80	6.65
111	601377	兴业证券	661,050.00	6.61
112	600104	上汽集团	654,919.00	6.54

113	000703	恒逸石化	650,422.00	6.50
114	603882	金域医学	639,460.00	6.39
115	601211	国泰君安	635,053.00	6.35
116	002867	周大生	633,725.00	6.33
117	002008	大族激光	627,098.00	6.27
118	601117	中国化学	624,564.00	6.24
119	000157	中联重科	619,985.00	6.20
120	600588	用友网络	608,981.96	6.09
121	600009	上海机场	604,410.00	6.04
122	002967	广电计量	595,790.00	5.95
123	688169	石头科技	585,858.00	5.85
124	601169	北京银行	584,207.00	5.84
125	688059	华锐精密	583,532.16	5.83
126	603369	今世缘	580,835.00	5.80
127	600893	航发动力	574,578.00	5.74
128	688308	欧科亿	574,332.85	5.74
129	300496	中科创达	572,143.00	5.72
130	000830	鲁西化工	572,110.00	5.72
131	000166	申万宏源	564,019.00	5.64
132	601628	中国人寿	557,707.00	5.57
133	600196	复星医药	544,902.00	5.45
134	000538	云南白药	542,179.00	5.42
135	002709	天赐材料	536,559.80	5.36
136	000708	中信特钢	536,447.00	5.36
137	000977	浪潮信息	531,051.00	5.31
138	600019	宝钢股份	530,448.48	5.30
139	000625	长安汽车	529,380.00	5.29
140	688111	金山办公	506,408.00	5.06
141	002139	拓邦股份	504,863.00	5.05
142	601988	中国银行	499,156.00	4.99
143	600332	白云山	497,460.00	4.97

144	600985	淮北矿业	491,651.00	4.91
145	300587	天铁股份	477,916.00	4.78
146	600399	抚顺特钢	471,356.00	4.71
147	601390	中国中铁	465,807.00	4.66
148	002371	北方华创	464,316.00	4.64
149	300750	宁德时代	463,801.00	4.63
150	300601	康泰生物	461,700.00	4.61
151	300034	钢研高纳	457,631.00	4.57
152	300408	三环集团	455,672.00	4.55
153	002129	中环股份	454,603.00	4.54
154	601311	骆驼股份	449,463.00	4.49
155	000895	双汇发展	449,450.00	4.49
156	300433	蓝思科技	448,944.00	4.49
157	600426	华鲁恒升	442,699.00	4.42
158	002007	华兰生物	434,536.00	4.34
159	300595	欧普康视	433,662.00	4.33
160	688012	中微公司	431,754.00	4.31
161	002466	天齐锂业	430,540.00	4.30
162	002028	思源电气	427,056.00	4.27
163	600522	中天科技	426,709.00	4.26
164	300687	赛意信息	423,600.00	4.23
165	600600	青岛啤酒	423,261.00	4.23
166	000066	中国长城	420,439.00	4.20
167	601633	长城汽车	420,012.00	4.20
168	600966	博汇纸业	417,677.00	4.17
169	600584	长电科技	416,470.00	4.16
170	600305	恒顺醋业	415,432.00	4.15
171	601009	南京银行	414,872.43	4.15
172	600028	中国石化	409,026.00	4.09
173	000876	新希望	407,797.00	4.08
174	601225	陕西煤业	406,842.00	4.07

175	300316	晶盛机电	406,246.00	4.06
176	000860	顺鑫农业	397,447.00	3.97
177	002384	东山精密	396,865.00	3.97
178	300033	同花顺	395,698.36	3.95
179	002727	一心堂	391,525.40	3.91
180	688008	澜起科技	391,412.50	3.91
181	300450	先导智能	390,920.00	3.91
182	000768	中航西飞	382,606.00	3.82
183	600741	华域汽车	378,906.00	3.79
184	601658	邮储银行	378,113.00	3.78
185	601939	建设银行	377,960.00	3.78
186	002414	高德红外	377,624.00	3.77
187	601336	新华保险	377,476.00	3.77
188	600109	国金证券	375,922.00	3.76
189	600958	东方证券	374,144.00	3.74
190	002677	浙江美大	373,649.00	3.73
191	002607	中公教育	373,596.00	3.73
192	601800	中国交建	369,464.20	3.69
193	002841	视源股份	369,048.00	3.69
194	600655	豫园股份	365,284.00	3.65
195	002531	天顺风能	363,331.00	3.63
196	601838	成都银行	361,796.18	3.62
197	603678	火炬电子	360,513.00	3.60
198	601998	中信银行	358,795.00	3.59
199	300653	正海生物	358,617.00	3.58
200	603993	洛阳钼业	351,666.00	3.51
201	002756	永兴材料	351,222.00	3.51
202	001979	招商蛇口	351,104.00	3.51
203	002236	大华股份	348,978.00	3.49
204	603899	晨光文具	348,768.00	3.49
205	002050	三花智控	346,811.00	3.47

206	600352	浙江龙盛	341,097.00	3.41
207	002651	利君股份	339,254.00	3.39
208	600810	神马股份	337,853.00	3.38
209	601066	中信建投	336,892.00	3.37
210	002154	报喜鸟	333,704.00	3.33
211	000425	徐工机械	332,632.00	3.32
212	000983	山西焦煤	331,366.00	3.31
213	601877	正泰电器	329,669.00	3.29
214	300982	苏文电能	328,843.10	3.29
215	000636	风华高科	327,380.00	3.27
216	002202	金风科技	325,242.00	3.25
217	600111	北方稀土	323,517.00	3.23
218	000807	云铝股份	323,291.00	3.23
219	601006	大秦铁路	321,151.00	3.21
220	300593	新雷能	320,330.96	3.20
221	600183	生益科技	317,609.00	3.17
222	601857	中国石油	316,529.00	3.16
223	002563	森马服饰	314,206.00	3.14
224	002555	三七互娱	314,063.00	3.14
225	601155	新城控股	312,057.00	3.12
226	600845	宝信软件	306,427.00	3.06
227	601995	中金公司	305,561.00	3.05
228	002044	美年健康	304,581.00	3.04
229	300676	华大基因	303,545.00	3.03
230	601636	旗滨集团	300,338.00	3.00
231	002157	正邦科技	299,934.00	3.00
232	300529	健帆生物	299,828.00	3.00
233	603008	喜临门	297,112.00	2.97
234	002508	老板电器	292,166.00	2.92
235	300003	乐普医疗	286,850.00	2.87
236	000938	紫光股份	286,558.60	2.86

237	601916	浙商银行	283,239.00	2.83
238	002938	鹏鼎控股	279,298.00	2.79
239	601788	光大证券	276,224.00	2.76
240	603659	璞泰来	273,193.00	2.73
241	600760	中航沈飞	272,393.00	2.72
242	600761	安徽合力	271,760.00	2.72
243	601989	中国重工	269,298.00	2.69
244	601077	渝农商行	268,877.00	2.69
245	002739	万达电影	268,470.96	2.68
246	603833	欧派家居	267,864.00	2.68
247	002901	大博医疗	267,362.00	2.67
248	600547	山东黄金	267,273.00	2.67
249	002600	领益智造	264,663.00	2.64
250	300136	信维通信	261,604.00	2.61
251	603658	安图生物	259,917.00	2.60
252	601717	郑煤机	258,938.00	2.59
253	002120	韵达股份	257,681.00	2.58
254	002286	保龄宝	256,491.00	2.56
255	600132	重庆啤酒	256,021.00	2.56
256	603187	海容冷链	255,393.00	2.55
257	002916	深南电路	246,858.00	2.47
258	601607	上海医药	241,634.00	2.41
259	000069	华侨城A	240,995.00	2.41
260	300782	卓胜微	239,475.00	2.39
261	300415	伊之密	238,580.00	2.38
262	601186	中国铁建	238,539.00	2.38
263	002511	中顺洁柔	237,962.00	2.38
264	003816	中国广核	237,786.00	2.38
265	300012	华测检测	236,675.00	2.37
266	000967	盈峰环境	230,987.55	2.31
267	605117	德业股份	230,534.00	2.30

268	002444	巨星科技	225,593.00	2.25
269	603160	汇顶科技	223,835.00	2.24
270	603019	中科曙光	223,831.00	2.24
271	002557	洽洽食品	223,698.00	2.24
272	601138	工业富联	223,672.00	2.24
273	601985	中国核电	223,559.00	2.23
274	600143	金发科技	222,544.00	2.22
275	600383	金地集团	221,047.00	2.21
276	600563	法拉电子	219,006.00	2.19
277	300327	中颖电子	216,418.00	2.16
278	600754	锦江酒店	215,426.00	2.15
279	600161	天坛生物	215,175.00	2.15
280	601933	永辉超市	214,227.00	2.14
281	300144	宋城演艺	213,820.00	2.14
282	600029	南方航空	212,675.00	2.13
283	000963	华东医药	210,814.00	2.11
284	688009	中国通号	209,796.00	2.10
285	002602	世纪华通	208,516.00	2.08
286	600989	宝丰能源	207,741.00	2.08
287	000596	古井贡酒	206,695.00	2.07
288	603596	伯特利	206,363.00	2.06
289	603806	福斯特	204,791.00	2.05
290	600795	国电电力	202,187.00	2.02
291	002024	苏宁易购	201,214.00	2.01
292	603589	口子窖	200,270.00	2.00

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	2,491,933.00	24.90
2	000001	平安银行	2,106,482.00	21.05
3	601318	中国平安	1,916,551.00	19.15
4	300122	智飞生物	1,914,559.00	19.13
5	601567	三星医疗	1,907,510.00	19.06
6	600036	招商银行	1,819,364.00	18.18
7	000858	五粮液	1,815,170.96	18.14
8	000333	美的集团	1,717,384.00	17.16
9	002541	鸿路钢构	1,637,380.00	16.36
10	300124	汇川技术	1,571,366.00	15.70
11	600276	恒瑞医药	1,545,123.20	15.44
12	002142	宁波银行	1,541,838.00	15.41
13	300059	东方财富	1,482,260.40	14.81
14	002415	海康威视	1,474,840.00	14.74
15	000002	万科A	1,135,592.00	11.35
16	000776	广发证券	1,133,195.00	11.32
17	000661	长春高新	1,054,167.59	10.53
18	300767	震安科技	1,049,953.00	10.49
19	600809	山西汾酒	999,863.00	9.99
20	601166	兴业银行	997,025.00	9.96
21	002460	赣锋锂业	990,770.00	9.90
22	002648	卫星石化	933,228.00	9.33
23	002493	荣盛石化	927,236.00	9.27
24	601888	中国中免	898,193.00	8.98
25	000725	京东方A	849,357.00	8.49
26	601899	紫金矿业	846,516.00	8.46
27	002352	顺丰控股	842,015.00	8.41
28	002475	立讯精密	831,006.00	8.30
29	002402	和而泰	823,654.00	8.23
30	600031	三一重工	811,771.00	8.11
31	600690	海尔智家	778,379.00	7.78

32	300896	爱美客	743,558.00	7.43
33	601012	隆基股份	725,670.00	7.25
34	000568	泸州老窖	715,061.44	7.15
35	002410	广联达	713,409.00	7.13
36	603259	药明康德	712,539.32	7.12
37	000783	长江证券	710,074.00	7.10
38	002601	龙佰集团	705,858.00	7.05
39	002867	周大生	690,098.00	6.90
40	000651	格力电器	689,029.00	6.89
41	600176	中国巨石	685,781.00	6.85
42	002001	新和成	678,789.20	6.78
43	600887	伊利股份	676,479.00	6.76
44	600030	中信证券	667,539.00	6.67
45	600926	杭州银行	640,267.00	6.40
46	688036	传音控股	631,371.89	6.31
47	002049	紫光国微	626,206.45	6.26
48	603288	海天味业	618,180.40	6.18
49	000338	潍柴动力	615,039.00	6.15
50	601398	工商银行	606,589.00	6.06
51	002230	科大讯飞	598,516.00	5.98
52	002594	比亚迪	597,072.00	5.97
53	601100	恒立液压	589,312.00	5.89
54	300347	泰格医药	588,341.00	5.88
55	600585	海螺水泥	546,036.00	5.46
56	601818	光大银行	544,471.00	5.44
57	601328	交通银行	543,803.00	5.43
58	300750	宁德时代	529,612.00	5.29
59	002714	牧原股份	506,802.00	5.06
60	600745	闻泰科技	505,145.00	5.05
61	600309	万华化学	488,414.00	4.88
62	000786	北新建材	485,583.00	4.85

63	002179	中航光电	469,477.00	4.69
64	002812	恩捷股份	468,781.00	4.68
65	002624	完美世界	464,392.00	4.64
66	300628	亿联网络	456,275.00	4.56
67	002409	雅克科技	446,767.00	4.46
68	002736	国信证券	442,596.00	4.42
69	002027	分众传媒	440,999.00	4.41
70	600048	保利地产	430,638.00	4.30
71	603501	韦尔股份	423,247.00	4.23
72	002311	海大集团	422,652.00	4.22
73	600438	通威股份	419,141.00	4.19
74	300274	阳光电源	416,317.50	4.16
75	600346	恒力石化	410,651.00	4.10
76	601088	中国神华	406,570.00	4.06
77	601377	兴业证券	406,153.60	4.06
78	601688	华泰证券	403,344.00	4.03
79	600305	恒顺醋业	402,010.00	4.02
80	600900	长江电力	401,847.00	4.02
81	300413	芒果超媒	401,036.00	4.01
82	600763	通策医疗	398,165.00	3.98
83	002008	大族激光	397,632.00	3.97
84	601601	中国太保	397,257.00	3.97
85	000703	恒逸石化	397,240.00	3.97
86	002154	报喜鸟	390,228.00	3.90
87	300014	亿纬锂能	388,977.00	3.89
88	600332	白云山	377,393.00	3.77
89	300454	深信服	375,342.00	3.75
90	600660	福耀玻璃	374,959.00	3.75
91	603369	今世缘	374,674.00	3.74
92	601919	中远海控	369,389.00	3.69
93	600109	国金证券	361,713.00	3.61

94	000708	中信特钢	358,264.00	3.58
95	600966	博汇纸业	352,012.00	3.52
96	600810	神马股份	349,579.00	3.49
97	600436	片仔癀	347,502.00	3.47
98	601800	中国交建	345,654.60	3.45
99	002709	天赐材料	344,957.60	3.45
100	600406	国电南瑞	339,530.00	3.39
101	002756	永兴材料	336,248.00	3.36
102	603008	喜临门	334,949.00	3.35
103	603799	华友钴业	334,492.00	3.34
104	000157	中联重科	332,182.00	3.32
105	002271	东方雨虹	328,792.00	3.29
106	300015	爱尔眼科	324,093.00	3.24
107	000625	长安汽车	323,754.00	3.24
108	000977	浪潮信息	319,683.00	3.19
109	601636	旗滨集团	318,108.00	3.18
110	002304	洋河股份	316,980.00	3.17
111	600999	招商证券	316,939.00	3.17
112	600570	恒生电子	315,687.40	3.15
113	300653	正海生物	314,585.00	3.14
114	688059	华锐精密	314,068.67	3.14
115	603678	火炬电子	312,725.00	3.13
116	600000	浦发银行	308,354.00	3.08
117	601766	中国中车	303,281.00	3.03
118	000100	TCL科技	302,028.00	3.02
119	002651	利君股份	300,328.00	3.00
120	002821	凯莱英	299,708.00	3.00
121	603986	兆易创新	298,389.80	2.98
122	002727	一心堂	297,752.12	2.98
123	000636	风华高科	297,094.00	2.97
124	600703	三安光电	288,527.00	2.88

125	600588	用友网络	287,239.00	2.87
126	600050	中国联通	285,242.00	2.85
127	000301	东方盛虹	284,320.00	2.84
128	600522	中天科技	282,472.94	2.82
129	300327	中颖电子	281,546.00	2.81
130	601169	北京银行	278,668.00	2.78
131	601600	中国铝业	271,768.00	2.72
132	688076	诺泰生物	271,345.98	2.71
133	300496	中科创达	268,397.00	2.68
134	600183	生益科技	268,253.00	2.68
135	002901	大博医疗	263,921.00	2.64
136	600547	山东黄金	262,342.00	2.62
137	601998	中信银行	262,268.00	2.62
138	002028	思源电气	261,766.00	2.62
139	601668	中国建筑	261,517.00	2.61
140	601717	郑煤机	261,330.00	2.61
141	603187	海容冷链	259,430.00	2.59
142	600655	豫园股份	250,930.00	2.51
143	601989	中国重工	250,710.00	2.51
144	600761	安徽合力	248,992.00	2.49
145	002444	巨星科技	246,331.00	2.46
146	688538	和辉光电	244,676.70	2.45
147	300955	嘉亨家化	240,520.76	2.40
148	000983	山西焦煤	239,404.00	2.39
149	002241	歌尔股份	237,651.00	2.37
150	002531	天顺风能	236,586.00	2.36
151	300033	同花顺	236,548.00	2.36
152	605117	德业股份	234,426.00	2.34
153	601288	农业银行	233,746.00	2.34
154	600741	华域汽车	233,595.00	2.33
155	300012	华测检测	232,058.00	2.32

156	002466	天齐锂业	228,770.00	2.29
157	601186	中国铁建	228,701.00	2.29
158	688185	康希诺	227,415.00	2.27
159	600019	宝钢股份	227,411.00	2.27
160	002511	中顺洁柔	225,941.00	2.26
161	603160	汇顶科技	225,912.00	2.26
162	003816	中国广核	224,755.00	2.25
163	600028	中国石化	222,438.00	2.22
164	688345	博力威	220,608.00	2.20
165	603882	金域医学	219,468.00	2.19
166	300979	华利集团	216,832.50	2.17
167	000066	中国长城	214,451.59	2.14
168	300415	伊之密	213,114.00	2.13
169	601229	上海银行	213,108.00	2.13
170	688613	奥精医疗	212,362.20	2.12
171	300687	赛意信息	211,200.00	2.11
172	000063	中兴通讯	210,500.00	2.10
173	600837	海通证券	207,202.00	2.07
174	600383	金地集团	206,163.00	2.06
175	600377	宁沪高速	205,200.00	2.05
176	601009	南京银行	203,709.00	2.04
177	601138	工业富联	203,139.00	2.03
178	300408	三环集团	202,977.00	2.03
179	300034	钢研高纳	202,975.00	2.03

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	269,597,999.68
卖出股票收入（成交）总额	125,805,631.13

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 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

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约 市值	公允 价值 变动	风险说明
IF2112	沪深300 股指期货 2112 合约	-88	-135, 701,2 80.00	-3,67 7,70 0.00	本报告期内，本基金继续采用市场中性投资策略，利用股指期货空头合约对冲多头股票部分的系统性风险，以获取绝对收益。
公允价值变动总额合计（元）					-3,677,700.00
股指期货投资本期收益（元）					6,644,330.09
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-3,677,700.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要运用股指期货合约进行套期保值操作，利用股指期货空头合约对冲多头股票部分的系统性风险。本基金根据股票多头组合的市值计算需要用到的股指期货合约

数量，并对这个数量进行动态跟踪以及适时调整。同时，综合考虑股指期货的流动性、对冲成本以及保证金要求等因素，选择合适的股指期货合约并适时进行合约展期操作，通过空头部分的优化降低对冲成本。随着监管的放开及其他工具流动性增强，本基金优选空头工具，采用最优的多头系统性风险对冲方式。

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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产147,556,255.74元，占基金资产净值的比例为79.20%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-135,701,280.00元，占基金资产净值的比例为-72.84%，空头合约市值占股票资产的比例为-91.97%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为13,550,253.46元，公允价值变动损益为-5,794,019.86元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 报告期内基金投资的前十名证券除贵州茅台(600519),招商银行(600036),平安银行(000001)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。 蕲春县烟草专卖局2020年07月19日发布对贵州茅台酒股份有限公司的处罚(蕲烟简处【2020】第282号),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,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)。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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	16,370,530.76

2	应收证券清算款	1,809,337.35
3	应收股利	-
4	应收利息	6,919.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,186,787.18

7.13.4 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债券。

7.13.5 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。

7.13.6 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

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
6	29,799,104.53	178,794,627.19	100.00%	-	0.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

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。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	5.59%	10,000,000.00	5.59%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	5.59%	10,000,000.00	5.59%	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年04月03日)基金份额总额	10,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	10,000,000.00
本报告期基金总申购份额	173,762,330.66
减：本报告期基金总赎回份额	4,967,703.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	178,794,627.19

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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、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	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	佣金	占当期佣金总量的比	

	数量		的比例		例	
海通 证券	2	391,421,905.44	100.0 0%	286,248.12	100.0 0%	-

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 总额的 比例	成交金 额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金 额	占当期 基金成 交总额 的比例
海通证 券	1,563,20 5.77	100.0 0%	1,102,400,0 00.00	100.0 0%	-	-	-	-

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	中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金第三个开放期开放申购、赎回及转换业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-06

2	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
3	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
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	中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金第四个开放期开放申购、赎回及转换业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-07
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

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	20210114-20210630	0.00	74,492,451.33	0.00	74,492,451.33	41.66%
	2	20210114-20210630	0.00	44,695,073.50	0.00	44,695,073.50	25.00%
	3	20210114-20210630	0.00	39,728,843.86	0.00	39,728,843.86	22.22%
	4	20210101-20210113	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	5.59%
产品特有风险							
<p>本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。</p> <p>当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。</p>							

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智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件

(2) 《中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

(3) 《中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

(4) 关于申请募集注册中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式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