

**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 年年度报告

2021 年 12 月 31 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:2022 年 03 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本年度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2022年3月24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。

本报告中的财务资料经审计，上会会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2021年1月1日起至2021年12月31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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
8.3 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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	103
8.6 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	103
8.7 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	103
8.8 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	103
8.9 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	103
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	103
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	104

8.12 市场中性策略执行情况.....	104
8.13 投资组合报告附注.....	104
§9 基金份额持有人信息.....	105
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	105
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	106
9.3 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.....	106
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	106
§10 开放式基金份额变动.....	106
§11 重大事件揭示.....	107
11.1 基金份额持有人大会决议.....	107
11.2 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.....	107
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	107
11.4 基金投资策略的改变.....	107
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	107
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	107
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	107
11.8 其他重大事件.....	108
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	110
12.1 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.....	110
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	111
§13 备查文件目录.....	111
13.1 备查文件目录.....	111
13.2 存放地点.....	111
13.3 查阅方式.....	111

§ 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	388,192,911.80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	<ol style="list-style-type: none"> 1、资产配置策略； 2、多头股票投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (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; 010-56517299	95568
传真	010-56517001	010-57093382
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zrfunds.com.cn/
基金年度报告备置地点	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
----	----	------

会计师事务所	上会会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021年	2020年04月03日(基金合同生效日)-2020年12月31日
本期已实现收益	22,231,624.76	6,497.67
本期利润	14,842,709.57	6,497.67
加权平均基金份额本期利润	0.0660	0.0006
本期加权平均净值利润率	6.26%	0.07%
本期基金份额净值增长率	7.78%	0.06%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	30,446,496.87	6,497.67
期末可供分配基金份额利润	0.0784	0.0006
期末基金资产净值	418,639,408.67	10,006,497.67
期末基金份额净值	1.0784	1.0006
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末
基金份额累计净值增长率	7.84%	0.06%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.40%	0.32%	0.89%	0.01%	-0.49%	0.31%
过去六个月	3.49%	0.35%	1.79%	0.01%	1.70%	0.34%
过去一年	7.78%	0.33%	3.55%	0.01%	4.23%	0.32%
自基金合同生效起至今	7.84%	0.29%	6.20%	0.01%	1.64%	0.28%

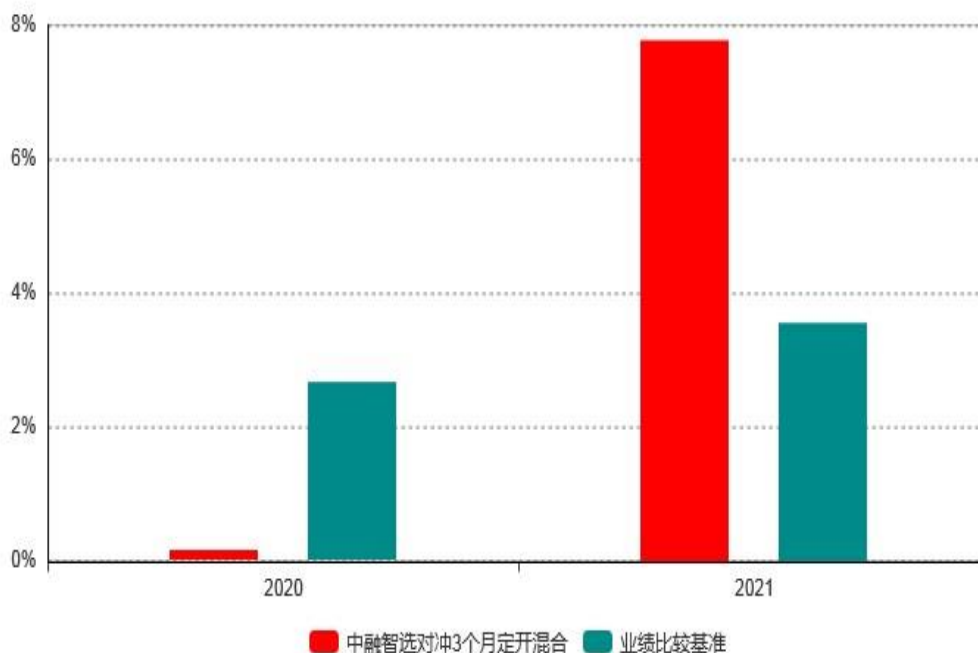
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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12月31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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自合同生效以来未进行利润分配。

§ 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12月31日，中融基金管理有限公司共管理73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、中融竞争优势股票型证券

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个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、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、中融低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、中融景泓一年持有期混合型证券投资基金、中融金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、中融匠心优选混合型证券投资基金、中融添益进取3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中融恒利纯债债券型证券投资基金、中融高质量成长混合型证券投资基金、中融景惠混合型证券投资基金、中融聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒泽纯债债券型证券投资基金、中融研发创新混合型证券投资基金。

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	-	13	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13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。

4.2 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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理办法》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理办法要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 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。

4.3.3 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，在本年度震荡下行的市场下表现稳健。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。

2021年，市场风格变化剧烈，主要因子的表现有较大波动。价值因子和红利因子在第一、四季度表现较好，而成长因子在第二、三季度占优。盈利、质量因子在全年维度表现较弱。动量反转、波动率、流动性等市场类因子的有效性波动较大，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。

此外，本基金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1.0784元，本报告期内，基金份额净值增长率为7.78%，同期业绩比较基准收益率为3.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾2021年，全球经济在疫情不断演变中继续复苏，年初全球通胀引发了市场高度关注，这可能是疫情后巨幅需求刺激叠加暂时性的供给弹性不足导致的，且视各国国情而有差异。对中长期物价来说，虽然当期是周期性因素占主导，但“碳中和”和“逆全球化”的趋势使得后续走势更加复杂。随着“保供顺价”的政策陆续出台，我国的供给已经开始增加，但需求仍有下行压力，最明显的就是下半年政策管控下的煤炭。2021年结构性改革，加强反垄断、反对资本无序扩张、教育改革推进以及医保集采的力度，都让投资者印象深刻。反观A股，主要指数表现分化，沪深300跑输中证500和创业板等中小盘指数，板块轮动加快，上半年上市公司业绩整体表现较优，但下半年随着经济增长放缓，盈利压力显现，估值水平出现整体下滑，部分板块由于政策调控影响也有较大幅度的下跌。

展望2022年，整体受地产下行压力、出口增速回落以及固定投资增速缺乏弹性的影响，预期宏观经济仍将维持略微下行趋势。当前的宏观环境，货币政策“稳中有松”，趋松的拐点从2021年7月下旬的降准开始，随着9月底能源商品的“保供稳价”和稳房地产信号的进一步明确，以及面临保经济增长的压力，2022年政策放松力度有望进一步加强。

在流动性宽松的预期下，高景气度、高增长的行业仍将受到青睐。2022年，预计共同富裕政策框架的进一步完善将推进科技创新和产业升级、碳达峰和碳中和以及高质量、均衡的产业发展，也将促进相应的财政改革和金融资本市场的进一步开放。

随着A股市场广度和深度不断进步，过去以某一宽基指数界定A股市场投资机会的时代已经结束，而基于行业、板块、个股的基本面变化的结构行情贯穿始终。在货币财政政策偏宽松的2022年，估值支撑存在压力，市场结构或许更加均衡。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中，一切从合规运作、保障基金份额持有人的利益出发，由督察长领导法律合规部及风险管理部对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，推动公司内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议，并跟踪改进落实情况。本报告期内，公司内部控制体系运行顺利，本基金运作没有出现违法违规行为。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

1、根据基金监管法律法规的最新变化，推动公司各部门及时完善与更新制度规范和业务流程，制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度，确保内控制度的适时性、全面性和合法合规性，并加强内部督导，将风险意识贯穿于各岗位与各业务环节。

2、日常监察和专项监察相结合，通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法，加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测，并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查。

3、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

4、规范基金投资业务，保证投资管理工作规范有序、合法合规进行。公司制定了严格规范的投资管理制度和流程机制，以投资决策委员会为最高投资决策机构，投资业务均按照管理制度和业务流程执行。

5、以外聘律师、讲座等多种方式加强合规教育与培训，促进公司合规文化的建设，及时向公司传达基金相关的法律法规；加大了对员工行为的监察稽核力度，从源头上防范合规风险，防范利益输送行为。公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。我们将继续以风险控制为核心，进一步提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金的规范运作，充分保障基金份额持有人的利益。

4.7 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，本基金管理人应严格按照新准则、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。

4.8 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，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 托管人对本年度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、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字(2022)第2115号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体份额持有人
审计意见	我们审计了中融智选对冲策略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“中融智选对冲3个月定开混合”)财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附中融智选对冲3个月定开混合的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了中融智选对冲3个月定开混合2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中融智选对冲3个月定开混合,

	并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系中融智选对冲3个月定开混合管理人（以下简称“管理人”）根据《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》的规定为其基金份额持有人编制的，因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供中融智选对冲3个月定开混合份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。
其他信息	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括中融智选对冲3个月定开混合2021年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大

	<p>错报。在编制财务报表时，管理人负责评估中融智选对冲3个月定开混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。3、评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。4、对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中融智选对冲3个月定开混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的</p>

	事项或情况可能导致中融智选对冲3个月定开混合不能持续经营。5、评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与管理人就中融智选对冲3个月定开混合的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	胡治华	江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼	
审计报告日期	2022-03-24	

§ 7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	7,071,950.91	87,748.46
结算备付金		63,713,524.10	384,439.64
存出保证金		34,824,109.15	22,335.11
交易性金融资产	7.4.7.2	308,869,044.11	-
其中：股票投资		308,529,044.11	-
基金投资		-	-
债券投资		340,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	12,000,000.00	9,600,000.00
应收证券清算款		702,355.26	-
应收利息	7.4.7.5	18,577.27	2,277.69
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		427,199,560.80	10,096,800.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,066,660.26	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		426,908.33	10,119.15
应付托管费		88,939.26	2,108.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	837,644.28	48,075.48
应交税费		-	0.43
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	140,000.00	30,000.00
负债合计		8,560,152.13	90,303.23
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	388,192,911.80	10,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	30,446,496.87	6,497.67

所有者权益合计		418,639,408.67	10,006,497.67
负债和所有者权益总计		427,199,560.80	10,096,800.90

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额总额 388,192,911.80 份，份额净值1.0784元。

7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年04月03日（基金 合同生效日）至2020年 12月31日
一、收入		20,639,414.14	323,116.67
1. 利息收入		721,947.95	67,333.47
其中：存款利息收入	7.4.7.11	388,200.01	32,174.20
债券利息收入		8,365.40	66.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		325,382.54	35,092.31
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,274,598.59	255,783.20
其中：股票投资收益	7.4.7.12	14,700,308.46	1,221,827.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	229,296.29	12,376.04
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-

衍生工具收益	7.4.7.15	10,173,844.65	-1,037,832.62
股利收益	7.4.7.16	2,171,149.19	59,412.35
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-7,388,915.19	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	31,782.79	-
减：二、费用		5,796,704.57	316,619.00
1. 管理人报酬		2,792,369.78	88,205.20
2. 托管费		581,743.74	18,376.13
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,245,783.94	179,375.34
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		36,626.40	227.33
7. 其他费用	7.4.7.20	140,180.71	30,435.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,842,709.57	6,497.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,842,709.57	6,497.67

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权	10,000,000.00	6,497.67	10,006,497.67

益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,842,709.57	14,842,709.57
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)	378,192,911.80	15,597,289.63	393,790,201.43
其中:1.基金申购款	388,073,637.38	15,902,362.62	403,976,000.00
2.基金赎回款	-9,880,725.58	-305,072.99	-10,185,798.57
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)	388,192,911.80	30,446,496.87	418,639,408.67
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12月31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)	-	6,497.67	6,497.67
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	6,497.67	10,006,497.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 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%。

本基金的财务报表于2022年3月24日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资（主要为权证投资）等，其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：

（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基

金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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，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，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值；

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

① 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

② 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

③ 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

(2) 投资收益

① 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

② 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

③ 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

④ 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金的基金托管费按《基金合同》约定的方法进行计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	7,071,950.91	87,748.46
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	7,071,950.91	87,748.46

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	309,918,619.30	308,529,044.11	-1,389,575.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	340,000.00	340,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	340,000.00	340,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	310,258,619.30	308,869,044.11	-1,389,575.19
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
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	-	-	-
----	---	---	---

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	-283,249,620.00	-	-	-
股指期货	-283,249,620.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-283,249,620.00	-	-	-
项目	上年度末 2020年12月31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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

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12月31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

IF2206	沪深300股指期货2206合约	-196	-289,248,960.00	-5,999,340.00
总额合计		-	-289,248,960.00	-5,999,340.00
减：可抵销期货暂收款		-	-	-5,999,340.00
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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	12,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	12,000,000.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	9,600,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	9,600,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	1,388.87	19.92

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	17,124.41	534.41
应收债券利息	7.45	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	1,712.36
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	56.54	11.00
合计	18,577.27	2,277.69

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	837,644.28	48,075.48
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	837,644.28	48,075.48

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31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	140,000.00	30,000.00
合计	140,000.00	30,000.00

7.4.7.9 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12月31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	388,073,637.38	388,073,637.38
本期赎回（以“-”号填列）	-9,880,725.58	-9,880,725.58
本期末	388,192,911.80	388,192,911.80

注：本期申购中含转换入份额及金额，本期赎回中含转换出份额及金额。

7.4.7.10 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	22,231,624.76	-7,388,915.19	14,842,709.57
本期基金份额交易产生的变动数	26,571,126.33	-10,973,836.70	15,597,289.63
其中：基金申购款	27,061,726.35	-11,159,363.73	15,902,362.62
基金赎回款	-490,600.02	185,527.03	-305,072.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,809,248.76	-18,362,751.89	30,446,496.87

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年04月03日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	21,246.89	8,008.89
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	365,770.32	24,032.74
其他	1,182.80	132.57
合计	388,200.01	32,174.20

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2020年04月03日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	733,663,775.56	67,070,879.60
减：卖出股票成本总额	718,963,467.10	65,849,052.17
买卖股票差价收入	14,700,308.46	1,221,827.43

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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2 021年12月31日	上年度可比期间 2020年04月03日（基金合同生效 日）至2020年12月31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	229,296.29	12,376.04
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	229,296.29	12,376.04

7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年04月03日（基金合同生效日） 至2020年12月31日

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	14,346,656.03	1,239,623.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,877,228.83	1,225,451.65
减：应收利息总额	240,130.91	1,795.37
买卖债券差价收入	229,296.29	12,376.04

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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12月31日	上年度可比期间收益金额 2020年04月03日（基金合同生效日）至2020年12月31日
期货投资	10,173,844.65	-1,037,832.62

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年04月03日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,171,149.19	59,412.35
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	2,171,149.19	59,412.35

7.4.7.17 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20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年04月03日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,389,575.19	-
——股票投资	-1,389,575.19	-
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-5,999,340.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-5,999,340.00	-
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	-7,388,915.19	-

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年04月03日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
基金赎回费收入	31,782.79	-
合计	31,782.79	-

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至	上年度可比期间 2020年04月03日(基金合同生效
----	--------------------	-------------------------------

	2021年12月31日	日)至2020年12月31日
交易所市场交易费用	2,204,793.31	176,107.87
银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	40,990.63	3,267.47
合计	2,245,783.94	179,375.34

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年04月03日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
审计费用	20,000.00	10,000.00
信息披露费	120,000.00	20,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	180.71	35.00
其他	-	400.00
合计	140,180.71	30,435.00

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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
中融国际信托有限公司	基金管理人股东

上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
中融（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

7.4.10.1.2 权证交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券交易

注：无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年04月03日（基金合同 生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,792,369.78	88,205.20
其中：支付销售机构的客户维护费	22,346.70	-

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1.20%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 X 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年04月03日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	581,743.74	18,376.13

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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12 月31日	上年度可比期间 2020年04月03日（基金 合同生效日）至2020年1 月31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	2.58%	100.00%
---------------------	-------	---------

注：(1) 基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付；

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

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中融（北京）资产管理有限公司	37,378,749.65	9.63%	-	-

7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2020年04月03日（基金合同生效日） 至2020年12月31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	7,071,950.91	21,246.89	87,748.46	8,008.89

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 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

注：无。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688082	盛美上海	2021-11-10	2022-05-18	首次公开发行限售	85.00	114.28	3,001	255,085.00	342,954.28	-
688733	壹石通	2021-08-10	2022-02-17	首次公开发行限售	15.49	75.36	3,232	50,063.68	243,563.52	-
688305	科德数控	2021-07-02	2022-01-10	首次公开发行限售	11.03	105.68	1,496	16,500.88	158,097.28	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股未流通	41.98	41.98	3,725	156,375.50	156,375.50	-
688285	高铁电气	2021-10-12	2022-04-20	首次公开发行限售	7.18	9.14	15,159	108,841.62	138,553.26	-
6881	国力	2021	2022	首次	12.0	66.1	1,595	19,2	105,	-

03	股份	-09-02	-03-10	公开发 行 限 售	4	0		03.8 0	429. 50	
6887 18	唯赛 勃	2021 -07- 20	2022 -01- 28	首次 公 开 发 行 限 售	5.85	27.7 1	3,145	18,3 98.2 5	87,1 47.9 5	-
3010 29	怡合 达	2021 -07- 14	2022 -01- 24	首次 公 开 发 行 限 售	14.1 4	89.8 7	462	6,53 2.68	41,5 19.9 4	-
3011 27	天源 环保	2021 -12- 23	2022 -06- 30	首次 公 开 发 行 限 售	12.0 3	17.1 2	1,632	19,6 32.9 6	27,9 39.8 4	-
3010 50	雷电 微力	2021 -08- 17	2022 -02- 24	首次 公 开 发 行 限 售	60.6 4	234. 74	110	6,67 0.40	25,8 21.4 0	-
3010 58	中粮 工科	2021 -09- 01	2022 -03- 09	首次 公 开 发 行 限 售	3.55	18.2 4	1,386	4,92 0.30	25,2 80.6 4	-
3010 99	雅创 电子	2021 -11- 10	2022 -05- 23	首次 公 开 发 行 限 售	21.9 9	71.3 6	351	7,71 8.49	25,0 47.3 6	-
3011 77	迪阿 股份	2021 -12- 08	2022 -06- 15	首次 公 开 发 行 限 售	116. 88	116. 08	212	24,7 78.5 6	24,6 08.9 6	-
3010 69	凯盛 新材	2021 -09- 16	2022 -03- 28	首次 公 开 发 行	5.17	44.2 1	539	2,78 6.63	23,8 29.1 9	-

				限售						
3012 21	光庭 信息	2021 -12- 15	2022 -06- 22	首次 公开 发行 限售	69.8 9	88.7 2	216	15,0 96.2 4	19,1 63.5 2	-
3009 94	久祺 股份	2021 -08- 02	2022 -02- 14	首次 公开 发行 限售	11.9 0	45.4 5	420	4,99 8.00	19,0 89.0 0	-
3010 60	兰卫 医学	2021 -09- 06	2022 -03- 14	首次 公开 发行 限售	4.17	30.9 4	587	2,44 7.79	18,1 61.7 8	-
3011 68	通灵 股份	2021 -12- 02	2022 -06- 10	首次 公开 发行 限售	39.0 8	52.1 3	312	12,1 92.9 6	16,2 64.5 6	-
3011 01	明月 镜片	2021 -12- 09	2022 -06- 16	首次 公开 发行 限售	26.9 1	43.3 6	371	9,98 3.61	16,0 86.5 6	-
3011 18	恒光 股份	2021 -11- 09	2022 -05- 18	首次 公开 发行 限售	22.7 0	49.0 2	315	7,15 0.50	15,4 41.3 0	-
3011 00	风光 股份	2021 -12- 10	2022 -06- 17	首次 公开 发行 限售	27.8 1	31.1 4	494	13,7 38.1 4	15,3 83.1 6	-
3011 80	万祥 科技	2021 -11- 09	2022 -05- 16	首次 公开 发行 限售	12.2 0	22.7 2	654	7,97 8.80	14,8 58.8 8	-
3011	奥尼	2021	2022	首次	66.1	56.6	251	16,6	14,2	-

89	电子	-12-21	-06-28	公开发 行限 售	8	2		11.1 8	11.6 2	
3010 89	拓新 药业	2021 -10- 20	2022 -04- 27	首次 公开 发行 限 售	19.1 1	67.9 3	206	3,93 6.66	13,9 93.5 8	-
3010 35	润丰 股份	2021 -07- 21	2022 -01- 28	首次 公开 发行 限 售	22.0 4	56.2 8	240	5,28 9.60	13,5 07.2 0	-
3010 17	漱玉 平民	2021 -06- 23	2022 -01- 05	首次 公开 发行 限 售	8.86	23.8 0	555	4,91 7.30	13,2 09.0 0	-
3011 99	迈赫 股份	2021 -11- 30	2022 -06- 07	首次 公开 发行 限 售	29.2 8	32.0 0	402	11,7 70.5 6	12,8 64.0 0	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	首次 公开 发行 限 售	10.6 4	30.4 4	421	4,47 9.44	12,8 15.2 4	-
3011 90	善水 科技	2021 -12- 17	2022 -06- 24	首次 公开 发行 限 售	27.8 5	27.4 6	453	12,6 16.0 5	12,4 39.3 8	-
3011 85	鸥玛 软件	2021 -11- 11	2022 -05- 19	首次 公开 发行 限 售	11.8 8	21.1 6	578	6,86 6.64	12,2 30.4 8	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2022 -01- 06	首次 公开 发行	9.46	41.4 3	290	2,74 3.40	12,0 14.7 0	-

				限售						
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	首次公开发售	6.96	12.51	888	6,180.48	11,108.88	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	首次公开发售	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	首次公开发售	79.60	78.53	139	11,064.40	10,915.67	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	首次公开发售	43.99	50.77	214	9,413.86	10,864.78	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	首次公开发售	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301045	天禄科技	2021-08-06	2022-02-17	首次公开发售	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	首次公开发售	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	首次公开发售	93.09	75.34	124	11,543.16	9,342.16	-
3011	洁雅	2021	2022	首次	57.2	53.7	171	9,79	9,18	-

08	股份	-11-25	-06-06	公开发 行限 售	7	1		3.17	4.41	
3010 78	孩子 王	2021 -09- 30	2022 -04- 14	首次 公开 发行 限售	5.77	12.1 4	756	4,36 2.12	9,17 7.84	-
3011 82	凯旺 科技	2021 -12- 16	2022 -06- 23	首次 公开 发行 限售	27.1 2	30.5 8	294	7,97 3.28	8,99 0.52	-
3010 62	上海 艾录	2021 -09- 07	2022 -03- 14	首次 公开 发行 限售	3.31	17.0 1	523	1,73 1.13	8,89 6.23	-
3010 90	华润 材料	2021 -10- 19	2022 -04- 26	首次 公开 发行 限售	10.4 5	11.2 2	785	8,20 3.25	8,80 7.70	-
3010 52	果麦 文化	2021 -08- 23	2022 -02- 28	首次 公开 发行 限售	8.11	33.6 4	252	2,04 3.72	8,47 7.28	-
3010 25	读客 文化	2021 -07- 06	2022 -01- 24	首次 公开 发行 限售	1.55	20.8 8	403	624. 65	8,41 4.64	-
3010 66	万事 利	2021 -09- 13	2022 -03- 22	首次 公开 发行 限售	5.24	22.8 4	344	1,80 2.56	7,85 6.96	-
3008 14	中富 电路	2021 -08- 04	2022 -02- 14	首次 公开 发行	8.40	23.8 8	328	2,75 5.20	7,83 2.64	-

				限售						
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	首次公开发售	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	首次公开发售	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	首次公开发售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	首次公开发售	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	首次公开发售	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	首次公开发售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	首次公开发售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	首次公开发售	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
3010	双乐	2021	2022	首次	23.3	29.9	200	4,67	5,98	-

36	股份	-07-21	-02-16	公开发 行 限 售	8	3		6.00	6.00	
3010 93	华兰 股份	2021 -10- 21	2022 -05- 05	首次 公 开 发 行 限 售	58.0 8	49.8 5	119	6,91 1.52	5,93 2.15	-
3010 83	百胜 智能	2021 -10- 13	2022 -04- 21	首次 公 开 发 行 限 售	9.08	14.2 1	416	3,77 7.28	5,91 1.36	-
3008 54	中兰 环保	2021 -09- 08	2022 -03- 16	首次 公 开 发 行 限 售	9.96	27.2 9	203	2,02 1.88	5,53 9.87	-
3010 63	海锅 股份	2021 -09- 09	2022 -03- 24	首次 公 开 发 行 限 售	17.4 0	36.1 1	153	2,66 2.20	5,52 4.83	-
0012 34	泰慕 士	2021 -12- 31	2022 -01- 11	新股 未 流 通	16.5 3	16.5 3	333	5,50 4.49	5,50 4.49	-
3010 88	戎美 股份	2021 -10- 19	2022 -04- 28	首次 公 开 发 行 限 售	33.1 6	24.6 7	223	7,39 4.68	5,50 1.41	-
3010 38	深水 规院	2021 -07- 22	2022 -02- 07	首次 公 开 发 行 限 售	6.68	20.2 3	266	1,77 6.88	5,38 1.18	-
3010 92	争光 股份	2021 -10- 21	2022 -05- 05	首次 公 开 发 行 限 售	36.3 1	35.5 2	150	5,44 6.50	5,32 8.00	-

301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	首次公开发售	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	首次公开发售	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	首次公开发售	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	首次公开发售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	首次公开发售	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	首次公开发售	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	首次公开发售	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	首次公开发售	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021-12-27	2022-01-14	新债未流通	100.00	100.00	3,400	340,000.00	340,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	340,000.00	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	340,000.00	-

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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7.4.12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7.4.12.3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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2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	7,071,950.91	-	-	-	7,071,950.91
结算备付金	63,713,524.10	-	-	-	63,713,524.10
存出保证金	34,824,109.15	-	-	-	34,824,109.15
交易性金融资产	340,000.00	-	-	308,529,044.11	308,869,044.11
买入返售金融资产	12,000,000.00	-	-	-	12,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	702,355.26	702,355.26
应收利息	-	-	-	18,577.27	18,577.27
资产总计	117,949,584.16	-	-	309,249,976.64	427,199,560.80
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,066,660.26	7,066,660.26
应付管理人报	-	-	-	426,908.33	426,908.33

酬					
应付托管费	-	-	-	88,939.26	88,939.26
应付交易费用	-	-	-	837,644.28	837,644.28
其他负债	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	-	-	-	8,560,152.13	8,560,152.13
利率敏感度缺口	117,949,584.16	-	-	300,689,824.51	418,639,408.67
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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	30,000.00	30,000.00

债					
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	308,529,044.11	73.70	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	340,000.00	0.08	-	-
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	308,869,044.11	73.78	-	-

7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
	沪深300指数上升5%	2,934,820.82	-
	沪深300指数下降5%	-2,934,820.82	-

7.4.14 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

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306,553,277.45元，属于第二层次的余额为人民币2,315,766.66元，无属于第三层次的余额。（2020年12月31日，本基金未持有以公允价值计量的金融工具。）

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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	308,529,044.11	72.22
	其中：股票	308,529,044.11	72.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	340,000.00	0.08
	其中：债券	340,000.00	0.08

	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	12,000,000.00	2.81
	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	70,785,475.01	16.57
8	其他各项资产	35,545,041.68	8.32
9	合计	427,199,560.80	100.00

8.2 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	4,966,360.00	1.19
B	采矿业	2,254,844.00	0.54
C	制造业	190,774,900.86	45.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,671,583.70	1.35
E	建筑业	2,681,889.83	0.64
F	批发和零售业	3,536,205.09	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	7,458,023.00	1.78
H	住宿和餐饮业	2,053,200.00	0.49
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,045,787.08	2.16
J	金融业	59,363,608.36	14.18
K	房地产业	6,203,239.00	1.48
L	租赁和商务服务业	4,106,588.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	7,169,549.39	1.71
N	水利、环境和公共设施管理业	49,291.55	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	3,147,564.66	0.75
R	文化、体育和娱乐业	46,409.59	0.01

S	综合	-	-
	合计	308,529,044.11	73.70

8.3 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	11,100	22,755,000.00	5.44
2	300750	宁德时代	24,500	14,406,000.00	3.44
3	600036	招商银行	266,700	12,990,957.00	3.10
4	601012	隆基股份	103,300	8,904,460.00	2.13
5	601318	中国平安	149,600	7,541,336.00	1.80
6	300059	东方财富	184,360	6,841,599.60	1.63
7	000333	美的集团	72,400	5,343,844.00	1.28
8	002475	立讯精密	104,920	5,162,064.00	1.23
9	000001	平安银行	294,000	4,845,120.00	1.16
10	600809	山西汾酒	15,100	4,768,278.00	1.14
11	002142	宁波银行	124,211	4,754,797.08	1.14
12	002812	恩捷股份	17,600	4,407,040.00	1.05
13	600030	中信证券	166,600	4,399,906.00	1.05
14	603259	药明康德	34,000	4,031,720.00	0.96
15	603501	韦尔股份	12,400	3,853,548.00	0.92
16	600048	保利发展	239,700	3,746,511.00	0.89
17	600745	闻泰科技	26,800	3,465,240.00	0.83
18	000963	华东医药	85,600	3,441,120.00	0.82
19	000301	东方盛虹	158,200	3,059,588.00	0.73
20	002352	顺丰控股	43,800	3,018,696.00	0.72
21	000568	泸州老窖	11,800	2,995,666.00	0.72

22	600887	伊利股份	71,900	2,980,974.00	0.71
23	600276	恒瑞医药	58,435	2,963,238.85	0.71
24	601658	邮储银行	558,000	2,845,800.00	0.68
25	600926	杭州银行	214,990	2,756,171.80	0.66
26	601166	兴业银行	141,100	2,686,544.00	0.64
27	601567	三星医疗	163,700	2,669,947.00	0.64
28	600690	海尔智家	88,200	2,636,298.00	0.63
29	002594	比亚迪	9,800	2,627,576.00	0.63
30	002230	科大讯飞	48,400	2,541,484.00	0.61
31	300015	爱尔眼科	59,896	2,532,402.88	0.60
32	688169	石头科技	3,100	2,520,300.00	0.60
33	000977	浪潮信息	69,800	2,500,934.00	0.60
34	002049	紫光国微	11,100	2,497,500.00	0.60
35	601688	华泰证券	138,500	2,459,760.00	0.59
36	002415	海康威视	46,700	2,443,344.00	0.58
37	600111	北方稀土	52,200	2,390,760.00	0.57
38	600570	恒生电子	37,900	2,355,485.00	0.56
39	002271	东方雨虹	44,600	2,349,528.00	0.56
40	603799	华友钴业	20,900	2,305,479.00	0.55
41	601601	中国太保	84,929	2,303,274.48	0.55
42	300767	震安科技	21,519	2,245,507.65	0.54
43	002027	分众传媒	273,700	2,241,603.00	0.54
44	300124	汇川技术	32,500	2,229,500.00	0.53
45	002466	天齐锂业	20,200	2,161,400.00	0.52
46	002714	牧原股份	39,600	2,113,056.00	0.50
47	600588	用友网络	57,500	2,063,100.00	0.49
48	600258	首旅酒店	78,400	2,048,592.00	0.49
49	002648	卫星化学	50,940	2,039,128.20	0.49
50	002028	思源电气	41,100	2,022,531.00	0.48
51	300316	晶盛机电	28,800	2,001,600.00	0.48
52	300547	川环科技	134,300	1,988,983.00	0.48

53	601877	正泰电器	36,900	1,988,541.00	0.48
54	300498	温氏股份	103,100	1,985,706.00	0.47
55	002025	航天电器	23,500	1,972,825.00	0.47
56	600456	宝钛股份	26,600	1,909,348.00	0.46
57	000776	广发证券	76,500	1,881,135.00	0.45
58	601888	中国中免	8,500	1,864,985.00	0.45
59	600703	三安光电	49,600	1,862,976.00	0.45
60	603707	健友股份	43,900	1,843,800.00	0.44
61	300590	移为通信	63,040	1,818,704.00	0.43
62	301096	百诚医药	21,139	1,815,025.67	0.43
63	600872	中炬高新	47,300	1,795,981.00	0.43
64	300122	智飞生物	14,000	1,744,400.00	0.42
65	001979	招商蛇口	128,700	1,716,858.00	0.41
66	600436	片仔癀	3,900	1,704,885.00	0.41
67	603279	景津装备	36,300	1,683,594.00	0.40
68	601211	国泰君安	93,400	1,670,926.00	0.40
69	605068	明新旭腾	45,300	1,637,595.00	0.39
70	300630	普利制药	29,400	1,618,176.00	0.39
71	600660	福耀玻璃	34,000	1,602,760.00	0.38
72	300450	先导智能	20,900	1,554,333.00	0.37
73	000887	中鼎股份	70,700	1,541,967.00	0.37
74	601117	中国化学	124,800	1,497,600.00	0.36
75	601919	中远海控	79,700	1,489,593.00	0.36
76	300760	迈瑞医疗	3,900	1,485,120.00	0.35
77	600483	福能股份	89,200	1,452,176.00	0.35
78	000938	紫光股份	61,337	1,401,550.45	0.33
79	600010	包钢股份	501,100	1,398,069.00	0.33
80	601128	常熟银行	209,700	1,386,117.00	0.33
81	601677	明泰铝业	31,400	1,384,426.00	0.33
82	603693	江苏新能	48,400	1,377,464.00	0.33
83	002409	雅克科技	16,600	1,347,422.00	0.32

84	688133	泰坦科技	5,900	1,287,380.00	0.31
85	002384	东山精密	45,500	1,233,050.00	0.29
86	002460	赣锋锂业	8,500	1,214,225.00	0.29
87	600963	岳阳林纸	149,200	1,175,696.00	0.28
88	300203	聚光科技	41,300	1,167,138.00	0.28
89	002241	歌尔股份	21,500	1,163,150.00	0.28
90	601669	中国电建	143,100	1,156,248.00	0.28
91	000786	北新建材	32,100	1,150,143.00	0.27
92	601111	中国国航	125,400	1,144,902.00	0.27
93	301129	瑞纳智能	13,457	1,139,538.76	0.27
94	300041	回天新材	60,600	1,123,524.00	0.27
95	600905	三峡能源	147,000	1,103,970.00	0.26
96	300745	欣锐科技	16,900	1,084,980.00	0.26
97	605222	起帆电缆	39,200	1,018,808.00	0.24
98	600989	宝丰能源	57,500	998,200.00	0.24
99	300274	阳光电源	6,600	962,280.00	0.23
100	002557	洽洽食品	15,400	944,944.00	0.23
101	002791	坚朗五金	5,200	944,268.00	0.23
102	600029	南方航空	137,900	939,099.00	0.22
103	002531	天顺风能	47,600	922,964.00	0.22
104	002128	电投能源	60,800	902,880.00	0.22
105	600900	长江电力	39,400	894,380.00	0.21
106	000998	隆平高科	37,300	867,598.00	0.21
107	600309	万华化学	8,500	858,500.00	0.21

108	300725	药石科技	5,900	838,803.00	0.20
109	000519	中兵红箭	31,400	837,438.00	0.20
110	300457	赢合科技	26,200	804,864.00	0.19
111	300613	富瀚微	4,900	798,945.00	0.19
112	600011	华能国际	82,200	796,518.00	0.19
113	601225	陕西煤业	64,300	784,460.00	0.19
114	300628	亿联网络	9,500	773,775.00	0.18
115	000537	广宇发展	30,700	739,870.00	0.18
116	002493	荣盛石化	40,100	728,216.00	0.17
117	002624	完美世界	34,600	702,726.00	0.17
118	603833	欧派家居	4,600	678,500.00	0.16
119	600426	华鲁恒升	20,900	654,170.00	0.16
120	300841	康华生物	2,900	616,888.00	0.15
121	688008	澜起科技	7,200	603,864.00	0.14
122	600763	通策医疗	3,000	597,000.00	0.14
123	300915	海融科技	10,400	594,984.00	0.14
124	002541	鸿路钢构	11,100	594,294.00	0.14

4					
12 5	603309	维力医疗	37,400	592,042.00	0.14
12 6	600132	重庆啤酒	3,900	590,148.00	0.14
12 7	600438	通威股份	13,000	584,480.00	0.14
12 8	601600	中国铝业	94,700	576,723.00	0.14
12 9	002245	蔚蓝锂芯	20,900	574,959.00	0.14
13 0	601088	中国神华	25,200	567,504.00	0.14
13 1	002126	银轮股份	45,100	566,456.00	0.14
13 2	600018	上港集团	102,600	562,248.00	0.13
13 3	000596	古井贡酒	2,000	488,000.00	0.12
13 4	002048	宁波华翔	22,100	478,023.00	0.11
13 5	001215	千味央厨	7,900	459,859.00	0.11
13 6	002371	北方华创	1,300	451,126.00	0.11
13 7	002488	金固股份	49,970	438,736.60	0.10
13 8	300496	中科创达	2,700	373,734.00	0.09
13 9	688082	盛美上海	3,001	342,954.28	0.08
14 0	600009	上海机场	6,500	303,485.00	0.07

14 1	688733	壹石通	3,232	243,563.52	0.06
14 2	600399	抚顺特钢	9,400	232,838.00	0.06
14 3	301089	拓新药业	2,060	163,055.18	0.04
14 4	688305	科德数控	1,496	158,097.28	0.04
14 5	688262	国芯科技	3,725	156,375.50	0.04
14 6	688285	高铁电气	15,159	138,553.26	0.03
14 7	688636	智明达	918	129,667.50	0.03
14 8	688103	国力股份	1,595	105,429.50	0.03
14 9	688718	唯赛勃	3,145	87,147.95	0.02
15 0	600032	浙江新能	3,045	47,075.70	0.01
15 1	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
15 2	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.01
15 3	301127	天源环保	1,632	27,939.84	0.01
15 4	301050	雷电微力	110	25,821.40	0.01
15 5	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
15 6	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.01
15	300957	贝泰妮	128	24,611.84	0.01

7					
15 8	301177	迪阿股份	212	24,608.96	0.01
15 9	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
16 0	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.01
16 1	301221	光庭信息	216	19,163.52	0.00
16 2	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
16 3	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
16 4	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
16 5	605056	咸亨国际	934	17,540.52	0.00
16 6	301168	通灵股份	312	16,264.56	0.00
16 7	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
16 8	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
16 9	301100	风光股份	494	15,383.16	0.00
17 0	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
17 1	301189	奥尼电子	251	14,211.62	0.00
17 2	301035	润丰股份	240	13,507.20	0.00
17 3	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00

17 4	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
17 5	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
17 6	688012	中微公司	100	12,660.00	0.00
17 7	301190	善水科技	453	12,439.38	0.00
17 8	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
17 9	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
18 0	300987	川网传媒	301	11,678.80	0.00
18 1	301039	中集车辆	888	11,108.88	0.00
18 2	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
18 3	301179	泽宇智能	214	10,864.78	0.00
18 4	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
18 5	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
18 6	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
18 7	301087	可孚医疗	124	9,342.16	0.00
18 8	301108	洁雅股份	171	9,184.41	0.00
18 9	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
19	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00

0					
19 1	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
19 2	301090	华润材料	785	8,807.70	0.00
19 3	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
19 4	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
19 5	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
19 6	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
19 7	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
19 8	603986	兆易创新	40	7,034.00	0.00
19 9	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
20 0	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
20 1	688396	华润微	100	6,460.00	0.00
20 2	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
20 3	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
20 4	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
20 5	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
20 6	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00

20 7	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
20 8	301036	双乐股份	200	5,986.00	0.00
20 9	301093	华兰股份	119	5,932.15	0.00
21 0	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
21 1	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
21 2	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
21 3	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
21 4	301088	戎美股份	223	5,501.41	0.00
21 5	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
21 6	301092	争光股份	150	5,328.00	0.00
21 7	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
21 8	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
21 9	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
22 0	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
22 1	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
22 2	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
22	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00

3					
22 4	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
22 5	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
22 6	300962	中金辐照	76	1,507.08	0.00
22 7	600176	中国巨石	74	1,346.80	0.00
22 8	002773	康弘药业	28	569.80	0.00
22 9	002463	沪电股份	30	497.40	0.00
23 0	300003	乐普医疗	20	452.60	0.00
23 1	600061	国投资本	20	164.40	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	27,839,073.74	278.21
2	300014	亿纬锂能	18,585,752.68	185.74
3	300750	宁德时代	17,616,990.40	176.06
4	601012	隆基股份	16,984,647.27	169.74
5	600036	招商银行	16,849,863.00	168.39
6	601567	三星医疗	14,346,680.00	143.37
7	601318	中国平安	13,916,425.00	139.07
8	000301	东方盛虹	12,783,208.00	127.75
9	300059	东方财富	10,461,352.00	104.55

10	002460	赣锋锂业	9,714,461.00	97.08
11	000858	五 粮 液	9,666,917.90	96.61
12	000333	美的集团	9,464,026.28	94.58
13	000001	平安银行	9,438,223.01	94.32
14	688033	天宜上佳	8,894,812.84	88.89
15	300124	汇川技术	8,852,902.00	88.47
16	600522	中天科技	8,399,436.00	83.94
17	002812	恩捷股份	8,361,035.00	83.56
18	002475	立讯精密	8,253,905.92	82.49
19	601877	正泰电器	7,904,189.00	78.99
20	002466	天齐锂业	7,526,846.00	75.22
21	603259	药明康德	7,277,213.00	72.72
22	000661	长春高新	7,097,613.00	70.93
23	002415	海康威视	7,044,252.00	70.40
24	002049	紫光国微	6,807,773.00	68.03
25	600809	山西汾酒	6,791,278.60	67.87
26	002142	宁波银行	6,703,920.31	67.00
27	688169	石头科技	6,606,702.08	66.02
28	600745	闻泰科技	6,593,395.00	65.89
29	688276	百克生物	6,569,514.90	65.65
30	300122	智飞生物	6,525,323.64	65.21
31	300316	晶盛机电	6,510,904.00	65.07
32	002714	牧原股份	6,490,934.03	64.87
33	688599	天合光能	6,477,383.38	64.73
34	600276	恒瑞医药	6,468,972.89	64.65
35	300767	震安科技	6,464,037.28	64.60
36	600887	伊利股份	6,362,170.00	63.58
37	600030	中信证券	6,281,666.00	62.78
38	000568	泸州老窖	6,211,664.00	62.08
39	002594	比亚迪	6,200,089.00	61.96
40	601166	兴业银行	6,125,995.00	61.22

41	603501	韦尔股份	6,072,730.00	60.69
42	002011	盾安环境	6,065,634.00	60.62
43	300274	阳光电源	5,837,749.00	58.34
44	603799	华友钴业	5,791,512.00	57.88
45	605117	德业股份	5,690,619.00	56.87
46	300203	聚光科技	5,618,983.00	56.15
47	000776	广发证券	5,554,095.79	55.50
48	600048	保利发展	5,475,155.00	54.72
49	002028	思源电气	5,346,025.00	53.43
50	300450	先导智能	5,316,940.88	53.13
51	600660	福耀玻璃	5,205,678.00	52.02
52	002409	雅克科技	5,172,123.20	51.69
53	688277	天智航	5,096,220.28	50.93
54	002648	卫星化学	5,032,379.00	50.29
55	601899	紫金矿业	5,005,887.00	50.03
56	688059	华锐精密	4,958,149.09	49.55
57	002352	顺丰控股	4,847,054.16	48.44
58	300015	爱尔眼科	4,799,724.00	47.97
59	002027	分众传媒	4,755,332.22	47.52
60	600926	杭州银行	4,732,686.01	47.30
61	002541	鸿路钢构	4,725,877.00	47.23
62	600438	通威股份	4,656,907.00	46.54
63	600483	福能股份	4,644,994.88	46.42
64	002025	航天电器	4,628,858.00	46.26
65	300413	芒果超媒	4,615,608.00	46.13
66	000977	浪潮信息	4,546,414.00	45.43
67	601677	明泰铝业	4,544,471.11	45.42
68	600690	海尔智家	4,427,542.00	44.25
69	002126	银轮股份	4,419,297.00	44.16
70	002080	中材科技	4,390,579.00	43.88
71	000519	中兵红箭	4,365,117.00	43.62

72	300896	爱美客	4,355,336.78	43.53
73	601888	中国中免	4,219,625.21	42.17
74	000963	华东医药	4,168,876.60	41.66
75	300582	英飞特	4,148,248.00	41.46
76	000002	万科A	4,144,280.00	41.42
77	601688	华泰证券	4,114,339.00	41.12
78	002371	北方华创	4,068,929.00	40.66
79	600456	宝钛股份	3,933,523.00	39.31
80	002271	东方雨虹	3,906,344.40	39.04
81	300724	捷佳伟创	3,837,601.36	38.35
82	600703	三安光电	3,832,120.00	38.30
83	601238	广汽集团	3,824,342.00	38.22
84	600406	国电南瑞	3,805,594.13	38.03
85	600588	用友网络	3,794,402.88	37.92
86	603707	健友股份	3,701,316.70	36.99
87	600009	上海机场	3,671,280.00	36.69
88	002531	天顺风能	3,628,075.00	36.26
89	600111	北方稀土	3,609,708.00	36.07
90	600031	三一重工	3,594,445.48	35.92
91	300034	钢研高纳	3,570,249.00	35.68
92	600900	长江电力	3,503,496.00	35.01
93	300628	亿联网络	3,474,935.00	34.73
94	301129	瑞纳智能	3,363,941.43	33.62
95	603786	科博达	3,354,277.43	33.52
96	300547	川环科技	3,336,612.00	33.34
97	600963	岳阳林纸	3,329,076.00	33.27
98	002241	歌尔股份	3,321,003.00	33.19
99	300498	温氏股份	3,289,854.80	32.88
100	000938	紫光股份	3,244,875.57	32.43
101	300630	普利制药	3,228,523.00	32.26
102	002230	科大讯飞	3,223,717.00	32.22

103	601601	中国太保	3,205,573.04	32.03
104	600763	通策医疗	3,195,081.00	31.93
105	601658	邮储银行	3,193,653.00	31.92
106	600011	华能国际	3,172,784.11	31.71
107	601128	常熟银行	3,136,643.75	31.35
108	600487	亨通光电	3,132,725.00	31.31
109	000596	古井贡酒	3,091,042.00	30.89
110	300745	欣锐科技	3,084,922.00	30.83
111	300601	康泰生物	3,072,617.00	30.71
112	601111	中国国航	3,060,602.00	30.59
113	002791	坚朗五金	2,974,380.00	29.72
114	002384	东山精密	2,903,146.00	29.01
115	600570	恒生电子	2,812,235.88	28.10
116	601225	陕西煤业	2,787,379.00	27.86
117	601211	国泰君安	2,756,525.00	27.55
118	600309	万华化学	2,739,311.94	27.38
119	603688	石英股份	2,719,988.00	27.18
120	600872	中炬高新	2,717,811.00	27.16
121	002139	拓邦股份	2,700,089.00	26.98
122	600258	首旅酒店	2,633,825.80	26.32
123	603288	海天味业	2,625,222.56	26.24
124	601633	长城汽车	2,616,285.48	26.15
125	002459	晶澳科技	2,603,319.00	26.02
126	001979	招商蛇口	2,594,927.06	25.93
127	001215	千味央厨	2,554,414.05	25.53
128	600976	健民集团	2,549,399.00	25.48
129	300496	中科创达	2,535,759.00	25.34
130	605068	明新旭腾	2,467,003.00	24.65
131	002727	一心堂	2,458,225.40	24.57
132	688036	传音控股	2,452,377.41	24.51
133	601919	中远海控	2,448,420.00	24.47

134	000400	许继电气	2,437,174.00	24.36
135	000651	格力电器	2,433,771.00	24.32
136	603369	今世缘	2,420,253.00	24.19
137	002709	天赐材料	2,418,408.80	24.17
138	000786	北新建材	2,391,337.00	23.90
139	300457	赢合科技	2,330,924.00	23.29
140	600399	抚顺特钢	2,304,478.00	23.03
141	603986	兆易创新	2,281,868.00	22.80
142	600426	华鲁恒升	2,270,279.00	22.69
143	600845	宝信软件	2,255,934.00	22.54
144	603982	泉峰汽车	2,241,665.00	22.40
145	605111	新洁能	2,239,590.00	22.38
146	601669	中国电建	2,206,519.00	22.05
147	603301	振德医疗	2,205,819.00	22.04
148	601600	中国铝业	2,188,837.00	21.87
149	603596	伯特利	2,186,466.00	21.85
150	000725	京东方A	2,136,190.00	21.35
151	601117	中国化学	2,116,667.00	21.15
152	000887	中鼎股份	2,107,040.00	21.06
153	300735	光弘科技	2,093,168.00	20.92
154	600436	片仔癀	2,050,357.00	20.49
155	600261	阳光照明	2,037,622.19	20.36
156	300590	移为通信	2,031,588.20	20.30
157	600029	南方航空	2,018,423.00	20.17
158	603290	斯达半导	2,010,278.00	20.09
159	002493	荣盛石化	1,992,559.00	19.91
160	600521	华海药业	1,973,669.00	19.72
161	301096	百诚医药	1,955,112.00	19.54
162	601988	中国银行	1,946,968.00	19.46
163	002624	完美世界	1,938,355.00	19.37
164	300347	泰格医药	1,933,633.00	19.32

165	002179	中航光电	1,933,070.00	19.32
166	000063	中兴通讯	1,887,566.06	18.86
167	600188	兖矿能源	1,882,416.00	18.81
168	001965	招商公路	1,874,439.20	18.73
169	301071	力量钻石	1,859,567.00	18.58
170	601398	工商银行	1,826,201.00	18.25
171	600702	舍得酒业	1,816,935.00	18.16
172	600821	金开新能	1,813,379.00	18.12
173	601995	中金公司	1,797,291.00	17.96
174	603693	江苏新能	1,784,822.00	17.84
175	600741	华域汽车	1,760,759.00	17.60
176	002557	洽洽食品	1,710,345.00	17.09
177	600585	海螺水泥	1,710,076.00	17.09
178	002050	三花智控	1,674,476.00	16.73
179	300661	圣邦股份	1,656,730.00	16.56
180	002916	深南电路	1,639,793.00	16.39
181	600010	包钢股份	1,637,386.00	16.36
182	603518	锦泓集团	1,607,987.00	16.07
183	002311	海大集团	1,600,271.00	15.99
184	603279	景津装备	1,593,860.00	15.93
185	688063	派能科技	1,574,320.38	15.73
186	600171	上海贝岭	1,550,868.00	15.50
187	301080	百普赛斯	1,541,412.00	15.40
188	603392	万泰生物	1,531,160.00	15.30
189	603833	欧派家居	1,521,759.00	15.21
190	600958	东方证券	1,499,380.00	14.98
191	300627	华测导航	1,499,376.00	14.98
192	300725	药石科技	1,488,254.00	14.87
193	300760	迈瑞医疗	1,487,666.00	14.87
194	300088	长信科技	1,467,333.00	14.66
195	600132	重庆啤酒	1,447,983.00	14.47

196	600566	济川药业	1,438,087.00	14.37
197	688008	澜起科技	1,434,662.69	14.34
198	600019	宝钢股份	1,418,864.48	14.18
199	002821	凯莱英	1,417,946.00	14.17
200	600893	航发动力	1,397,989.00	13.97
201	688133	泰坦科技	1,390,168.04	13.89
202	601857	中国石油	1,384,942.00	13.84
203	688111	金山办公	1,378,062.68	13.77
204	300587	天铁股份	1,377,034.00	13.76
205	688308	欧科亿	1,368,896.70	13.68
206	600460	士兰微	1,354,752.00	13.54
207	601088	中国神华	1,326,870.00	13.26
208	605222	起帆电缆	1,316,249.00	13.15
209	000830	鲁西化工	1,301,682.00	13.01
210	601668	中国建筑	1,287,663.00	12.87
211	000837	秦川机床	1,280,492.00	12.80
212	300973	立高食品	1,277,942.48	12.77
213	605369	拱东医疗	1,262,772.80	12.62
214	688005	容百科技	1,252,500.10	12.52
215	002410	广联达	1,246,158.00	12.45
216	002013	中航机电	1,182,300.00	11.82
217	000783	长江证券	1,164,891.00	11.64
218	600989	宝丰能源	1,162,186.00	11.61
219	000338	潍柴动力	1,139,195.00	11.38
220	002245	蔚蓝锂芯	1,132,763.00	11.32
221	600765	中航重机	1,129,135.00	11.28
222	300041	回天新材	1,127,921.00	11.27
223	300454	深信服	1,118,249.00	11.18
224	300850	新强联	1,115,748.00	11.15
225	000657	中钨高新	1,111,019.00	11.10
226	688002	睿创微纳	1,080,521.77	10.80

227	600905	三峡能源	1,077,654.00	10.77
228	000100	TCL科技	1,076,160.00	10.75
229	002128	电投能源	1,056,404.00	10.56
230	603659	璞泰来	1,047,346.00	10.47
231	002385	大北农	1,034,598.00	10.34
232	601328	交通银行	1,031,750.00	10.31
233	000768	中航西飞	1,008,502.00	10.08
234	601816	京沪高铁	1,000,736.20	10.00
235	688303	大全能源	997,913.33	9.97
236	600000	浦发银行	993,909.00	9.93
237	600779	水井坊	992,409.00	9.92
238	002736	国信证券	985,964.00	9.85
239	002001	新和成	982,847.00	9.82
240	600176	中国巨石	971,172.00	9.71
241	603690	至纯科技	967,299.00	9.67
242	002304	洋河股份	959,903.00	9.59
243	000998	隆平高科	951,855.00	9.51
244	000012	南玻A	935,997.88	9.35
245	601818	光大银行	931,505.00	9.31
246	603613	国联股份	927,033.00	9.26
247	688235	百济神州	925,250.40	9.25
248	600383	金地集团	921,391.00	9.21
249	002120	韵达股份	916,234.00	9.16
250	600837	海通证券	915,304.00	9.15
251	002601	龙佰集团	915,147.00	9.15
252	601100	恒立液压	906,648.00	9.06
253	300343	联创股份	886,504.00	8.86
254	002488	金固股份	880,119.00	8.80
255	600999	招商证券	879,969.50	8.79
256	600028	中国石化	877,258.00	8.77
257	600346	恒力石化	874,484.00	8.74

258	000739	普洛药业	851,438.00	8.51
259	300613	富瀚微	832,662.00	8.32
260	300604	长川科技	832,110.00	8.32
261	002967	广电计量	824,115.00	8.24
262	601766	中国中车	799,990.00	7.99
263	002402	和而泰	793,990.00	7.93
264	000537	广宇发展	785,829.00	7.85
265	603297	永新光学	770,908.00	7.70
266	300142	沃森生物	768,095.00	7.68
267	300171	东富龙	764,613.00	7.64
268	600050	中国联通	759,554.00	7.59
269	600236	桂冠电力	758,301.00	7.58
270	688185	康希诺	754,260.00	7.54
271	600018	上港集团	751,814.00	7.51
272	601288	农业银行	747,771.00	7.47
273	688390	固德威	745,604.00	7.45
274	300593	新雷能	738,984.96	7.39
275	601689	拓普集团	738,132.00	7.38
276	600919	江苏银行	735,763.00	7.35
277	601865	福莱特	732,260.00	7.32
278	601138	工业富联	713,685.00	7.13
279	603882	金域医学	702,675.00	7.02
280	000733	振华科技	697,063.00	6.97
281	603489	八方股份	694,465.00	6.94
282	603816	顾家家居	691,328.00	6.91
283	001914	招商积余	688,661.00	6.88
284	601377	兴业证券	686,741.00	6.86
285	601169	北京银行	679,865.00	6.79
286	601229	上海银行	675,320.00	6.75
287	600104	上汽集团	668,550.00	6.68
288	600150	中国船舶	667,359.00	6.67

289	603338	浙江鼎力	660,611.00	6.60
290	600760	中航沈飞	655,473.00	6.55
291	000703	恒逸石化	652,908.00	6.52
292	300915	海融科技	651,064.00	6.51
293	600039	四川路桥	648,471.00	6.48
294	601872	招商轮船	648,234.00	6.48
295	002008	大族激光	634,404.00	6.34
296	002867	周大生	633,725.00	6.33
297	000157	中联重科	633,716.00	6.33
298	600584	长电科技	631,428.00	6.31
299	002154	报喜鸟	628,707.00	6.28
300	601006	大秦铁路	609,169.00	6.09
301	603309	维力医疗	606,135.00	6.06
302	300841	康华生物	593,276.00	5.93
303	603568	伟明环保	587,052.00	5.87
304	000538	云南白药	583,379.00	5.83
305	300363	博腾股份	579,068.00	5.79
306	300982	苏文电能	575,915.10	5.76
307	000166	申万宏源	568,589.00	5.68
308	601628	中国人寿	563,921.00	5.64
309	600196	复星医药	562,144.00	5.62
310	000708	中信特钢	561,057.00	5.61
311	300702	天宇股份	558,152.00	5.58
312	000625	长安汽车	546,749.00	5.46
313	002568	百润股份	542,742.00	5.42
314	601618	中国中冶	540,607.00	5.40
315	600109	国金证券	537,065.00	5.37
316	000807	云铝股份	530,593.00	5.30
317	601186	中国铁建	525,793.00	5.25
318	601800	中国交建	522,371.20	5.22
319	688018	乐鑫科技	522,142.00	5.22

320	600332	白云山	504,719.00	5.04
321	600547	山东黄金	502,979.00	5.03
322	688357	建龙微纳	493,242.84	4.93
323	600985	淮北矿业	491,651.00	4.91
324	600352	浙江龙盛	484,557.00	4.84
325	002048	宁波华翔	481,778.00	4.81
326	000895	双汇发展	481,609.00	4.81
327	601390	中国中铁	480,687.00	4.80
328	002129	中环股份	478,066.00	4.78
329	601989	中国重工	475,436.00	4.75
330	300709	精研科技	473,120.00	4.73
331	300595	欧普康视	467,842.00	4.68
332	300408	三环集团	463,803.00	4.64
333	300433	蓝思科技	457,650.00	4.57
334	601838	成都银行	454,899.18	4.55
335	601311	骆驼股份	449,463.00	4.49
336	600563	法拉电子	443,076.23	4.43
337	600183	生益科技	440,160.00	4.40
338	600754	锦江酒店	436,386.00	4.36
339	002007	华兰生物	434,536.00	4.34
340	601009	南京银行	432,091.43	4.32
341	688012	中微公司	431,754.00	4.31
342	000066	中国长城	427,894.00	4.28
343	300687	赛意信息	423,600.00	4.23
344	600600	青岛啤酒	423,261.00	4.23
345	000876	新希望	420,127.00	4.20
346	600966	博汇纸业	417,677.00	4.17
347	600305	恒顺醋业	415,432.00	4.15
348	000983	山西焦煤	410,535.00	4.10
349	603305	旭升股份	405,162.00	4.05
350	000860	顺鑫农业	404,274.00	4.04

351	003816	中国广核	403,796.00	4.04
352	002274	华昌化工	399,349.00	3.99
353	300033	同花顺	395,698.36	3.95
354	002508	老板电器	392,452.00	3.92
355	601336	新华保险	389,646.00	3.89
356	002607	中公教育	387,486.00	3.87
357	002841	视源股份	384,731.00	3.84
358	601939	建设银行	384,403.00	3.84
359	002677	浙江美大	384,317.00	3.84
360	002414	高德红外	377,624.00	3.77
361	600141	兴发集团	377,100.00	3.77
362	000683	远兴能源	369,178.00	3.69
363	600655	豫园股份	367,277.00	3.67
364	601998	中信银行	365,357.00	3.65
365	603993	洛阳钼业	361,782.00	3.62
366	603678	火炬电子	360,513.00	3.60
367	300653	正海生物	358,617.00	3.58
368	002236	大华股份	355,679.00	3.55
369	603160	汇顶科技	352,298.00	3.52
370	002756	永兴材料	351,222.00	3.51
371	601066	中信建投	350,814.00	3.51
372	688083	中望软件	350,700.00	3.50
373	603899	晨光文具	348,768.00	3.49
374	688208	道通科技	348,437.96	3.48
375	002651	利君股份	339,254.00	3.39
376	600810	神马股份	337,853.00	3.38
377	002202	金风科技	336,222.00	3.36
378	000425	徐工机械	335,957.00	3.36
379	600362	江西铜业	335,315.00	3.35
380	603019	中科曙光	333,057.00	3.33
381	601155	新城控股	327,497.00	3.27

382	000636	风华高科	327,380.00	3.27
383	300676	华大基因	324,060.00	3.24
384	002555	三七互娱	320,964.00	3.21
385	002335	科华数据	320,451.00	3.20
386	300782	卓胜微	320,245.00	3.20
387	002563	森马服饰	319,102.00	3.19
388	002044	美年健康	312,655.00	3.12
389	600085	同仁堂	310,006.00	3.10
390	300529	健帆生物	305,555.00	3.05
391	002157	正邦科技	303,175.00	3.03
392	601636	旗滨集团	300,338.00	3.00
393	688686	奥普特	299,682.00	2.99
394	603008	喜临门	297,112.00	2.97
395	603589	口子窖	290,942.00	2.91
396	601916	浙商银行	289,464.00	2.89
397	601788	光大证券	287,326.92	2.87
398	300003	乐普医疗	286,850.00	2.87
399	300136	信维通信	282,349.00	2.82
400	002938	鹏鼎控股	279,298.00	2.79
401	002528	英飞拓	277,900.00	2.78
402	002739	万达电影	272,345.96	2.72
403	600761	安徽合力	271,760.00	2.72
404	601077	渝农商行	269,647.00	2.69
405	002600	领益智造	268,106.00	2.68
406	002901	大博医疗	267,362.00	2.67
407	601901	方正证券	260,914.00	2.61
408	603658	安图生物	259,917.00	2.60
409	000069	华侨城A	259,148.00	2.59
410	601717	郑煤机	258,938.00	2.59
411	600323	瀚蓝环境	258,605.00	2.58
412	002286	保龄宝	256,491.00	2.56

413	600118	中国卫星	255,690.00	2.56
414	603187	海容冷链	255,393.00	2.55
415	688082	盛美上海	255,085.00	2.55
416	601216	君正集团	253,510.00	2.53
417	000967	盈峰环境	251,788.55	2.52
418	601607	上海医药	249,483.00	2.49
419	301177	迪阿股份	246,850.56	2.47
420	300415	伊之密	238,580.00	2.38
421	002511	中顺洁柔	237,962.00	2.38
422	300012	华测检测	236,675.00	2.37
423	601799	星宇股份	236,405.00	2.36
424	002153	石基信息	235,547.20	2.35
425	600161	天坛生物	229,814.00	2.30
426	601985	中国核电	225,934.00	2.26
427	002444	巨星科技	225,593.00	2.25
428	600143	金发科技	224,931.00	2.25
429	300144	宋城演艺	222,222.00	2.22
430	603195	公牛集团	222,033.00	2.22
431	601933	永辉超市	220,912.00	2.21
432	601555	东吴证券	220,030.00	2.20
433	688192	迪哲医药	217,050.24	2.17
434	300327	中颖电子	216,418.00	2.16
435	002602	世纪华通	211,800.00	2.12
436	601878	浙商证券	211,300.00	2.11
437	688112	鼎阳科技	211,284.40	2.11
438	688009	中国通号	209,796.00	2.10
439	688363	华熙生物	209,742.00	2.10
440	000656	金科股份	205,066.00	2.05
441	603806	福斯特	204,791.00	2.05
442	600795	国电电力	202,645.00	2.03
443	688032	禾迈股份	201,923.60	2.02

444	002024	苏宁易购	201,214.00	2.01
-----	--------	------	------------	------

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

8.4.2 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	300014	亿纬锂能	18,415,453.20	184.03
2	601567	三星医疗	12,150,619.00	121.43
3	600522	中天科技	9,766,675.94	97.60
4	000301	东方盛虹	9,571,525.36	95.65
5	688033	天宜上佳	9,560,296.30	95.54
6	000858	五粮液	8,650,390.96	86.45
7	002460	赣锋锂业	8,476,495.00	84.71
8	601012	隆基股份	8,435,200.40	84.30
9	002011	盾安环境	7,343,869.00	73.39
10	600519	贵州茅台	6,864,031.00	68.60
11	300124	汇川技术	6,646,347.00	66.42
12	688599	天合光能	6,615,605.18	66.11
13	601877	正泰电器	6,143,190.00	61.39
14	000661	长春高新	6,087,357.59	60.83
15	605117	德业股份	6,016,460.00	60.13
16	688276	百克生物	5,840,570.49	58.37
17	300203	聚光科技	5,340,246.00	53.37
18	002466	天齐锂业	5,339,480.00	53.36
19	300274	阳光电源	5,142,971.50	51.40
20	688059	华锐精密	5,120,869.95	51.18
21	002049	紫光国微	4,940,939.45	49.38
22	300316	晶盛机电	4,859,388.00	48.56
23	300413	芒果超媒	4,788,258.00	47.85

24	300122	智飞生物	4,777,780.00	47.75
25	601899	紫金矿业	4,769,842.00	47.67
26	300767	震安科技	4,731,613.00	47.29
27	300059	东方财富	4,692,301.40	46.89
28	688277	天智航	4,563,390.08	45.60
29	002080	中材科技	4,454,622.00	44.52
30	002415	海康威视	4,354,424.00	43.52
31	300582	英飞特	4,330,472.50	43.28
32	002541	鸿路钢构	4,282,672.46	42.80
33	600406	国电南瑞	4,275,577.78	42.73
34	600438	通威股份	4,257,833.00	42.55
35	002714	牧原股份	4,225,569.00	42.23
36	300034	钢研高纳	4,178,231.00	41.76
37	300896	爱美客	4,175,582.00	41.73
38	000776	广发证券	4,165,352.00	41.63
39	002126	银轮股份	4,112,481.00	41.10
40	002594	比亚迪	3,955,892.00	39.53
41	002409	雅克科技	3,876,354.12	38.74
42	300450	先导智能	3,859,127.00	38.57
43	002371	北方华创	3,848,847.00	38.46
44	002812	恩捷股份	3,823,098.00	38.21
45	000568	泸州老窖	3,700,899.44	36.98
46	002028	思源电气	3,695,529.00	36.93
47	601238	广汽集团	3,610,484.00	36.08
48	300724	捷佳伟创	3,583,760.00	35.81
49	000001	平安银行	3,546,164.00	35.44
50	603786	科博达	3,515,603.58	35.13
51	002475	立讯精密	3,501,111.00	34.99
52	688169	石头科技	3,480,143.01	34.78
53	600660	福耀玻璃	3,455,858.00	34.54
54	000519	中兵红箭	3,453,824.00	34.52

55	000333	美的集团	3,433,463.00	34.31
56	601318	中国平安	3,398,536.00	33.96
57	603799	华友钴业	3,374,997.00	33.73
58	000002	万科A	3,368,764.00	33.67
59	600887	伊利股份	3,331,628.00	33.29
60	601677	明泰铝业	3,270,279.00	32.68
61	002648	卫星化学	3,253,784.80	32.52
62	600745	闻泰科技	3,204,326.00	32.02
63	600483	福能股份	3,054,213.00	30.52
64	601166	兴业银行	3,046,680.00	30.45
65	600036	招商银行	3,042,130.00	30.40
66	603688	石英股份	3,021,767.00	30.20
67	600976	健民集团	3,011,970.00	30.10
68	002139	拓邦股份	2,987,227.00	29.85
69	300601	康泰生物	2,965,882.00	29.64
70	600009	上海机场	2,955,120.00	29.53
71	600031	三一重工	2,928,052.00	29.26
72	600487	亨通光电	2,910,721.00	29.09
73	002025	航天电器	2,903,129.00	29.01
74	000596	古井贡酒	2,896,777.00	28.95
75	600900	长江电力	2,751,062.00	27.49
76	002241	歌尔股份	2,735,003.00	27.33
77	300628	亿联网络	2,710,124.00	27.08
78	601633	长城汽车	2,693,691.00	26.92
79	603369	今世缘	2,668,694.00	26.67
80	600276	恒瑞医药	2,649,224.20	26.48
81	603501	韦尔股份	2,645,575.00	26.44
82	002709	天赐材料	2,644,706.60	26.43
83	605111	新洁能	2,620,127.00	26.18
84	600011	华能国际	2,599,801.00	25.98
85	002459	晶澳科技	2,595,640.00	25.94

86	603259	药明康德	2,556,377.99	25.55
87	603301	振德医疗	2,535,856.00	25.34
88	603982	泉峰汽车	2,526,418.00	25.25
89	002531	天顺风能	2,471,868.00	24.70
90	002727	一心堂	2,444,808.12	24.43
91	603986	兆易创新	2,423,297.40	24.22
92	603596	伯特利	2,402,220.00	24.01
93	600399	抚顺特钢	2,400,505.00	23.99
94	600763	通策医疗	2,388,416.00	23.87
95	688036	传音控股	2,365,868.79	23.64
96	000400	许继电气	2,343,693.00	23.42
97	603288	海天味业	2,333,750.80	23.32
98	600456	宝钛股份	2,307,035.00	23.06
99	600048	保利发展	2,272,777.00	22.71
100	002142	宁波银行	2,271,544.00	22.70
101	300745	欣锐科技	2,264,724.00	22.63
102	002027	分众传媒	2,240,649.00	22.39
103	600809	山西汾酒	2,230,592.20	22.29
104	301129	瑞纳智能	2,182,420.00	21.81
105	600845	宝信软件	2,163,425.90	21.62
106	603290	斯达半导	2,146,157.00	21.45
107	300750	宁德时代	2,143,299.00	21.42
108	300496	中科创达	2,137,497.00	21.36
109	000977	浪潮信息	2,135,719.00	21.34
110	600703	三安光电	2,132,915.00	21.32
111	001215	千味央厨	2,093,301.64	20.92
112	603707	健友股份	2,076,753.00	20.75
113	300735	光弘科技	2,068,964.00	20.68
114	002179	中航光电	2,046,078.00	20.45
115	601111	中国国航	2,032,124.00	20.31
116	600261	阳光照明	2,019,615.36	20.18

117	600963	岳阳林纸	1,971,297.00	19.70
118	600690	海尔智家	1,970,758.00	19.69
119	600702	舍得酒业	1,957,482.00	19.56
120	600521	华海药业	1,926,672.00	19.25
121	300015	爱尔眼科	1,924,791.69	19.24
122	601988	中国银行	1,915,996.00	19.15
123	002271	东方雨虹	1,915,372.00	19.14
124	002791	坚朗五金	1,914,392.00	19.13
125	601225	陕西煤业	1,899,735.00	18.99
126	601888	中国中免	1,890,258.00	18.89
127	301071	力量钻石	1,874,196.00	18.73
128	600821	金开新能	1,829,828.00	18.29
129	300347	泰格医药	1,825,406.00	18.24
130	601688	华泰证券	1,822,548.00	18.21
131	600188	兖矿能源	1,821,201.00	18.20
132	600309	万华化学	1,814,058.00	18.13
133	000725	京东方A	1,808,338.00	18.07
134	000063	中兴通讯	1,805,466.58	18.04
135	600030	中信证券	1,802,557.00	18.01
136	001965	招商公路	1,794,859.04	17.94
137	600566	济川药业	1,691,311.00	16.90
138	000651	格力电器	1,680,463.00	16.79
139	601398	工商银行	1,675,953.00	16.75
140	601995	中金公司	1,659,199.00	16.58
141	002050	三花智控	1,656,426.00	16.55
142	002352	顺丰控股	1,653,265.00	16.52
143	300630	普利制药	1,650,908.00	16.50
144	600426	华鲁恒升	1,642,375.38	16.41
145	600741	华域汽车	1,639,013.00	16.38
146	300661	圣邦股份	1,635,323.00	16.34
147	300627	华测导航	1,611,783.00	16.11

148	002384	东山精密	1,610,419.00	16.09
149	601128	常熟银行	1,583,825.00	15.83
150	002821	凯莱英	1,573,238.00	15.72
151	688063	派能科技	1,564,329.88	15.63
152	300587	天铁股份	1,555,998.21	15.55
153	002311	海大集团	1,541,325.00	15.40
154	002916	深南电路	1,539,476.00	15.38
155	600588	用友网络	1,518,896.00	15.18
156	600585	海螺水泥	1,514,471.00	15.13
157	603392	万泰生物	1,510,388.80	15.09
158	600926	杭州银行	1,496,850.00	14.96
159	600171	上海贝岭	1,494,496.32	14.94
160	300973	立高食品	1,493,006.10	14.92
161	688308	欧科亿	1,487,421.89	14.86
162	300498	温氏股份	1,487,277.20	14.86
163	000938	紫光股份	1,484,513.00	14.84
164	300547	川环科技	1,474,611.00	14.74
165	603518	锦泓集团	1,471,623.00	14.71
166	601857	中国石油	1,423,329.00	14.22
167	600958	东方证券	1,410,470.00	14.10
168	600111	北方稀土	1,407,429.00	14.07
169	601600	中国铝业	1,405,634.00	14.05
170	300457	赢合科技	1,395,268.00	13.94
171	600019	宝钢股份	1,392,239.00	13.91
172	300088	长信科技	1,392,211.00	13.91
173	600765	中航重机	1,389,321.00	13.88
174	301080	百普赛斯	1,381,172.00	13.80
175	601919	中远海控	1,372,512.20	13.72
176	600893	航发动力	1,355,902.00	13.55
177	000830	鲁西化工	1,341,869.00	13.41
178	600460	士兰微	1,327,923.00	13.27

179	000837	秦川机床	1,319,643.00	13.19
180	688303	大全能源	1,316,267.03	13.15
181	601668	中国建筑	1,232,870.00	12.32
182	688005	容百科技	1,217,568.29	12.17
183	605369	拱东医疗	1,217,314.60	12.17
184	002493	荣盛石化	1,213,559.00	12.13
185	000657	中钨高新	1,199,860.00	11.99
186	601669	中国电建	1,192,953.00	11.92
187	002013	中航机电	1,171,136.00	11.70
188	688111	金山办公	1,167,397.79	11.67
189	000786	北新建材	1,135,919.00	11.35
190	002624	完美世界	1,131,723.00	11.31
191	603659	璞泰来	1,114,108.00	11.13
192	601211	国泰君安	1,107,289.00	11.07
193	002410	广联达	1,089,582.00	10.89
194	600029	南方航空	1,087,813.00	10.87
195	600383	金地集团	1,047,828.00	10.47
196	300850	新强联	1,046,327.00	10.46
197	002385	大北农	1,042,623.00	10.42
198	000783	长江证券	1,042,016.00	10.41
199	000338	潍柴动力	1,040,395.61	10.40
200	601328	交通银行	1,031,344.00	10.31
201	688002	睿创微纳	1,029,690.52	10.29
202	300343	联创股份	1,008,804.00	10.08
203	300454	深信服	949,826.00	9.49
204	002304	洋河股份	948,606.00	9.48
205	603690	至纯科技	931,544.00	9.31
206	600176	中国巨石	928,017.00	9.27
207	688008	澜起科技	927,040.65	9.26
208	000768	中航西飞	923,387.00	9.23
209	002001	新和成	919,921.00	9.19

210	002601	龙佰集团	915,419.00	9.15
211	600779	水井坊	914,175.00	9.14
212	000012	南玻A	898,898.06	8.98
213	600000	浦发银行	893,158.00	8.93
214	601689	拓普集团	888,585.00	8.88
215	603833	欧派家居	884,920.00	8.84
216	002736	国信证券	884,394.00	8.84
217	600837	海通证券	883,960.00	8.83
218	603613	国联股份	876,481.00	8.76
219	601816	京沪高铁	874,505.40	8.74
220	601818	光大银行	869,748.00	8.69
221	600028	中国石化	869,487.00	8.69
222	001979	招商蛇口	864,269.00	8.64
223	000963	华东医药	857,133.00	8.57
224	002120	韵达股份	856,143.00	8.56
225	000739	普洛药业	848,691.00	8.48
226	601100	恒立液压	838,113.00	8.38
227	600872	中炬高新	825,221.00	8.25
228	002402	和而泰	823,654.00	8.23
229	000100	TCL科技	811,588.00	8.11
230	002557	洽洽食品	806,544.00	8.06
231	001914	招商积余	806,397.00	8.06
232	600132	重庆啤酒	806,326.00	8.06
233	300604	长川科技	805,266.00	8.05
234	601117	中国化学	787,727.00	7.87
235	600919	江苏银行	782,677.00	7.82
236	300593	新雷能	779,848.08	7.79
237	688235	百济神州	771,652.12	7.71
238	601088	中国神华	771,420.00	7.71
239	000733	振华科技	771,251.00	7.71
240	688185	康希诺	770,003.00	7.70

241	600236	桂冠电力	769,557.00	7.69
242	600258	首旅酒店	767,772.00	7.67
243	688390	固德威	761,763.14	7.61
244	600760	中航沈飞	748,994.40	7.49
245	603816	顾家家居	735,160.00	7.35
246	603297	永新光学	724,642.00	7.24
247	601766	中国中车	717,884.00	7.17
248	605068	明新旭腾	716,247.00	7.16
249	601865	福莱特	713,660.00	7.13
250	002230	科大讯飞	708,303.00	7.08
251	600050	中国联通	707,927.00	7.07
252	601288	农业银行	699,840.00	6.99
253	600150	中国船舶	696,992.00	6.97
254	300982	苏文电能	696,807.78	6.96
255	002867	周大生	690,098.00	6.90
256	601377	兴业证券	689,506.60	6.89
257	600999	招商证券	689,248.00	6.89
258	601138	工业富联	688,494.00	6.88
259	002129	中环股份	686,759.00	6.86
260	600436	片仔癀	685,888.00	6.85
261	300171	东富龙	680,565.00	6.80
262	000625	长安汽车	677,019.00	6.77
263	603489	八方股份	674,761.00	6.74
264	600039	四川路桥	671,993.00	6.72
265	002967	广电计量	664,773.00	6.64
266	600346	恒力石化	663,864.00	6.63
267	002154	报喜鸟	659,124.00	6.59
268	603338	浙江鼎力	658,348.00	6.58
269	300142	沃森生物	655,978.00	6.56
270	601169	北京银行	648,088.00	6.48
271	603568	伟明环保	646,979.00	6.47

272	603882	金城医学	646,436.00	6.46
273	000807	云铝股份	624,679.00	6.24
274	300702	天宇股份	616,031.00	6.16
275	601229	上海银行	615,922.00	6.16
276	600104	上汽集团	615,761.00	6.15
277	002008	大族激光	610,673.00	6.10
278	601006	大秦铁路	599,023.00	5.99
279	601872	招商轮船	584,067.20	5.84
280	300725	药石科技	560,787.00	5.60
281	000166	申万宏源	558,573.00	5.58
282	300363	博腾股份	541,451.00	5.41
283	601618	中国中冶	534,530.00	5.34
284	688018	乐鑫科技	527,120.84	5.27
285	000703	恒逸石化	525,446.00	5.25
286	600584	长电科技	517,320.00	5.17
287	600109	国金证券	516,332.00	5.16
288	601186	中国铁建	515,665.00	5.15
289	600196	复星医药	510,859.90	5.11
290	601800	中国交建	510,469.60	5.10
291	000157	中联重科	510,194.00	5.10
292	600547	山东黄金	498,828.00	4.99
293	002568	百润股份	497,087.00	4.97
294	600332	白云山	494,167.00	4.94
295	688357	建龙微纳	487,103.48	4.87
296	601009	南京银行	484,324.00	4.84
297	000708	中信特钢	483,452.00	4.83
298	688112	鼎阳科技	480,734.30	4.80
299	300709	精研科技	477,812.30	4.78
300	600563	法拉电子	477,754.24	4.77
301	688385	复旦微电	469,156.00	4.69
302	601601	中国太保	461,119.00	4.61

303	300408	三环集团	459,161.00	4.59
304	601989	中国重工	458,667.00	4.58
305	601628	中国人寿	452,318.00	4.52
306	000983	山西焦煤	451,923.00	4.52
307	601311	骆驼股份	451,727.40	4.51
308	603693	江苏新能	450,780.00	4.50
309	002274	华昌化工	450,423.00	4.50
310	000538	云南白药	450,307.00	4.50
311	601838	成都银行	449,375.00	4.49
312	601390	中国中铁	445,346.00	4.45
313	603305	旭升股份	443,047.00	4.43
314	002488	金固股份	441,706.00	4.41
315	301029	怡合达	441,515.08	4.41
316	600985	淮北矿业	440,400.00	4.40
317	300687	赛意信息	439,800.00	4.40
318	002245	蔚蓝锂芯	426,722.00	4.26
319	688148	芳源股份	424,588.00	4.24
320	600570	恒生电子	420,940.40	4.21
321	688182	灿勤科技	420,807.43	4.21
322	003816	中国广核	411,006.00	4.11
323	600352	浙江龙盛	402,263.00	4.02
324	600305	恒顺醋业	402,010.00	4.02
325	600600	青岛啤酒	399,917.00	4.00
326	000887	中鼎股份	398,127.00	3.98
327	600183	生益科技	391,934.00	3.92
328	002202	金风科技	384,227.00	3.84
329	600141	兴发集团	383,441.00	3.83
330	688012	中微公司	378,516.00	3.78
331	600754	锦江酒店	377,299.00	3.77
332	300033	同花顺	374,702.00	3.74
333	002508	老板电器	363,542.00	3.63

334	300653	正海生物	360,942.00	3.61
335	603160	汇顶科技	359,998.00	3.60
336	300595	欧普康视	356,634.00	3.56
337	000066	中国长城	355,515.59	3.55
338	002677	浙江美大	354,548.00	3.54
339	688248	南网科技	353,690.00	3.53
340	688083	中望软件	352,419.40	3.52
341	600966	博汇纸业	352,012.00	3.52
342	002236	大华股份	350,645.00	3.50
343	000895	双汇发展	350,159.00	3.50
344	600810	神马股份	349,579.00	3.49
345	000425	徐工机械	349,195.00	3.49
346	601998	中信银行	344,752.00	3.45
347	002841	视源股份	344,236.00	3.44
348	601939	建设银行	340,680.00	3.40
349	603993	洛阳钼业	337,442.00	3.37
350	002756	永兴材料	336,248.00	3.36
351	600655	豫园股份	335,551.00	3.35
352	603008	喜临门	334,949.00	3.35
353	600362	江西铜业	323,847.00	3.24
354	301177	迪阿股份	319,200.00	3.19
355	601636	旗滨集团	318,108.00	3.18
356	603019	中科曙光	317,548.00	3.17
357	002414	高德红外	316,736.84	3.17
358	301127	天源环保	315,405.30	3.15
359	603678	火炬电子	312,725.00	3.13
360	002335	科华数据	312,200.00	3.12
361	002563	森马服饰	307,693.00	3.07
362	688686	奥普特	304,000.00	3.04
363	000876	新希望	301,797.00	3.02
364	601336	新华保险	300,642.08	3.00

365	002651	利君股份	300,328.00	3.00
366	300433	蓝思科技	298,721.00	2.99
367	000636	风华高科	297,094.00	2.97
368	688690	纳微科技	296,811.48	2.97
369	002007	华兰生物	295,342.00	2.95
370	688208	道通科技	294,764.00	2.95
371	688190	云路股份	292,884.18	2.93
372	300782	卓胜微	288,075.00	2.88
373	000683	远兴能源	287,522.00	2.87
374	000860	顺鑫农业	286,388.00	2.86
375	300327	中颖电子	281,546.00	2.81
376	603899	晨光文具	278,291.00	2.78
377	603806	福斯特	277,205.00	2.77
378	002528	英飞拓	276,732.00	2.77
379	600085	同仁堂	274,898.00	2.75
380	601985	中国核电	273,016.00	2.73
381	300529	健帆生物	272,869.00	2.73
382	688076	诺泰生物	271,345.98	2.71
383	688110	东芯股份	270,676.00	2.71
384	301050	雷电微力	267,871.22	2.68
385	002555	三七互娱	265,266.00	2.65
386	601066	中信建投	264,494.00	2.64
387	300676	华大基因	264,265.00	2.64
388	002901	大博医疗	263,921.00	2.64
389	301100	风光股份	263,603.19	2.63
390	605222	起帆电缆	262,244.00	2.62
391	601717	郑煤机	261,330.00	2.61
392	601916	浙商银行	260,796.00	2.61
393	603187	海容冷链	259,430.00	2.59
394	600323	瀚蓝环境	254,841.00	2.55
395	601788	光大证券	254,353.00	2.54

396	601155	新城控股	253,532.00	2.53
397	688793	倍轻松	252,996.00	2.53
398	300003	乐普医疗	252,731.00	2.53
399	600761	安徽合力	248,992.00	2.49
400	601901	方正证券	248,601.00	2.48
401	601077	渝农商行	248,030.00	2.48
402	688032	禾迈股份	247,970.00	2.48
403	688789	宏华数科	247,860.00	2.48
404	300955	嘉亨家化	247,756.84	2.48
405	002444	巨星科技	246,331.00	2.46
406	002153	石基信息	246,044.40	2.46
407	688538	和辉光电	244,676.70	2.45
408	688049	炬芯科技	242,203.50	2.42
409	603589	口子窖	241,816.00	2.42
410	600795	国电电力	241,738.00	2.42
411	601799	星宇股份	240,958.00	2.41
412	688188	柏楚电子	240,439.00	2.40
413	002157	正邦科技	239,623.00	2.39
414	600118	中国卫星	236,907.00	2.37
415	000069	华侨城A	236,263.00	2.36
416	300979	华利集团	236,091.95	2.36
417	601607	上海医药	234,665.00	2.35
418	688778	厦钨新能	234,382.12	2.34
419	002739	万达电影	233,977.00	2.34
420	688707	振华新材	233,050.00	2.33
421	601216	君正集团	232,562.00	2.32
422	300012	华测检测	232,058.00	2.32
423	601658	邮储银行	231,712.00	2.32
424	002938	鹏鼎控股	230,508.00	2.30
425	688206	概伦电子	230,094.40	2.30
426	002602	世纪华通	228,656.00	2.29

427	600989	宝丰能源	228,307.00	2.28
428	301180	万祥科技	227,633.40	2.27
429	688167	炬光科技	227,344.00	2.27
430	002511	中顺洁柔	225,941.00	2.26
431	002286	保龄宝	222,810.00	2.23
432	688798	艾为电子	221,987.21	2.22
433	600886	国投电力	221,849.00	2.22
434	688345	博力威	220,608.00	2.20
435	000967	盈峰环境	218,680.68	2.19
436	688779	长远锂科	218,524.46	2.18
437	601878	浙商证券	214,663.00	2.15
438	300415	伊之密	213,114.00	2.13
439	688187	时代电气	213,108.00	2.13
440	688613	奥精医疗	212,362.20	2.12
441	002044	美年健康	207,456.00	2.07
442	600010	包钢股份	205,263.00	2.05
443	600377	宁沪高速	205,200.00	2.05
444	300590	移为通信	204,540.00	2.04
445	301101	明月镜片	203,864.80	2.04
446	300136	信维通信	203,823.00	2.04
447	688728	格科微	202,874.72	2.03
448	300144	宋城演艺	200,352.57	2.00

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。

8.4.3 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	1,028,882,086.40
卖出股票收入（成交）总额	733,663,775.56

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。

8.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	340,000.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	340,000.00	0.08

8.6 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	113052	兴业转债	3,400	340,000.00	0.08

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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	合约	公允	风险说明
----	----	----	----	----	------

		量(买/卖)	市值	价值变动	
IF2206	沪深300股指期货2206合约	-196	-289,248,960.00	-5,999,340.00	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)					-5,999,340.00
股指期货投资本期收益(元)					10,173,844.65
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-5,999,340.00

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 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308,529,044.11元,占基金资产净值的比例为73.70%;运用股指期货进行对冲的空头合约市值-289,248,960.00元,占基金资产净值的比例为-69.09%,空头合约市值占股票资产的比例为-93.75%。

本报告期内,本基金执行市场中性策略的投资收益为27,045,302.30元,公允价值变动损益为-7,388,915.19元。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 报告期内基金投资的前十名证券除招商银行(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。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),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),国家外汇管理局深圳市分局2021年09月29日发布对平安银行股份有限公司的处罚(深外管检[2021]40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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	34,824,109.15
2	应收证券清算款	702,355.26
3	应收股利	-
4	应收利息	18,577.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,545,041.68

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

8.13.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
20	19,409,645.59	388,192,911.8	100.00%	-	0.00%

		0		
--	--	---	--	--

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，本基金基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.3 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

注：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。

9.4 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	2.58%	10,000,000.00	2.58%	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	2.58%	10,000,000.00	2.58%	-

§ 10 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	388,073,637.38
减：本报告期基金总赎回份额	9,880,725.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	388,192,911.80

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，中融基金管理有限公司副总裁罗杰先生离任。

本基金管理人于2021年8月28日发布公告，中融基金管理有限公司副总裁田刚先生离任。

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

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于2021年11月19日公告，根据工作需要，任命崔岩女士担任本公司资产托管部总经理，负责资产托管部相关工作。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，未改聘会计师事务所。该审计机构已经连续2年为本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为20,000.00元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
海通证券	2	1,748,713,497.26	100.00%	1,278,834.88	100.00%	-

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。

11.7.2 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	27,663,479.87	100.00%	3,436,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-06

	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		
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
9	中融智选对冲策略3个月定 期开放灵活配置混合型发起 式证券投资基金第五个开放 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	2021-07-06
10	中融基金管理有限公司关于 提醒投资者警惕不法分子冒 用“中融基金”名义进行诈 骗活动的风险提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-09
11	中融基金管理有限公司关于	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-20

	旗下部分公募基金产品风险等级变动的公告		
12	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-14
13	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-21
14	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	2021-08-28
15	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六个开放期开放申购、赎回及转换业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-29
16	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-26
17	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-18

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20210114-20211231	0.00	109,898,225.94	0.00	109,898,225.94	28.31%
	2	20210114-20211014	0.00	74,492,451.33	0.00	74,492,451.33	19.19%
	3	20210114-20211011	0.00	44,695,073.50	0.00	44,695,073.50	11.51%
	4	20210101-20210113	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	2.58%
产品特有风险							
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。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。

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

13.3 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
二〇二二年三月三十日