

中金新锐股票型集合资产管理计划 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：中国国际金融股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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 2020 年 4 月 7 日起至 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§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遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43

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 ...	43
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 ...	43
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	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	45
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金新锐股票型集合资产管理计划	
基金简称	集合-中金新锐	
基金主代码	920003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 7 日	
基金管理人	中国国际金融股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	266,835,960.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金新锐集合计划 A	中金新锐集合计划 C
下属分级基金的交易代码	920003	920923
报告期末下属分级基金的份额总额	227,578,512.80 份	39,257,447.47 份

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

2.2 基金产品说明

投资目标	自下而上精选具有良好成长潜力的上市公司，在控制一定风险的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，本集合计划定位于把握中国产业转型、升级过程中的投资机会，精选成长型公司。
投资策略	本集合计划在深入研究的基础上，把握中国产业转型、升级过程中的投资机会，自下而上精选成长型公司，实现集合计划资产的长期稳健增值。为应对系统性风险，本集合计划会在满足证监会相关规定的基础上，择机配置部分股指期货资产对冲市场风险。债券方面，本集合计划主要配置具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券逆回购、银行存款等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为中证 500 指数收益率×90%+中证全债指数收益率×5%+活期存款利率×5%。
风险收益特征	本集合计划为股票型集合资产管理计划，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管

理计划、混合型基金、混合型集合资产管理计划。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中国国际金融股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	宋璐芳	李申
	联系电话	010-65051166	021-60637102
	电子邮箱	songlf@cicc.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		010-65050105	021-60637111
传真		010-65058035	021-60635778
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦3期B座42层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100004	100033
法定代表人		沈如军	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cicc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人住所

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年4月7日(基金合同生效日)-2020年6月30日)	
	中金新锐集合计划 A	中金新锐集合计划 C
本期已实现收益	32,609,480.66	6,720,540.89
本期利润	59,729,018.29	10,745,174.23
加权平均基金份额本期利润	0.2917	0.2837
本期加权平均净值利润率	13.21%	12.82%
本期基金份额净值增长率	14.30%	11.66%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	301,661,204.76	48,437,628.78
期末可供分配基金份额利润	1.3255	1.2338
期末基金资产净值	529,239,717.56	91,198,942.98
期末基金份额净值	2.3255	2.3231
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	14.30%	11.66%

注：①所述集合计划业绩指标不包括持有人交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金新锐集合计划 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
过去一个月	5.83%	0.80%	7.56%	0.79%	-1.73%	0.01%
自基金合同生效起	14.30%	0.95%	13.26%	1.00%	1.04%	-0.05%

中金新锐集合计划 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
过去一个月	5.78%	0.80%	7.56%	0.79%	-1.78%	0.01%
自基金合同生效起	11.66%	0.92%	10.03%	0.95%	1.63%	-0.03%

注：1、本基金基金合同于 2020 年 4 月 7 日生效。截至本报告期末，基金合同生效

未满一年；

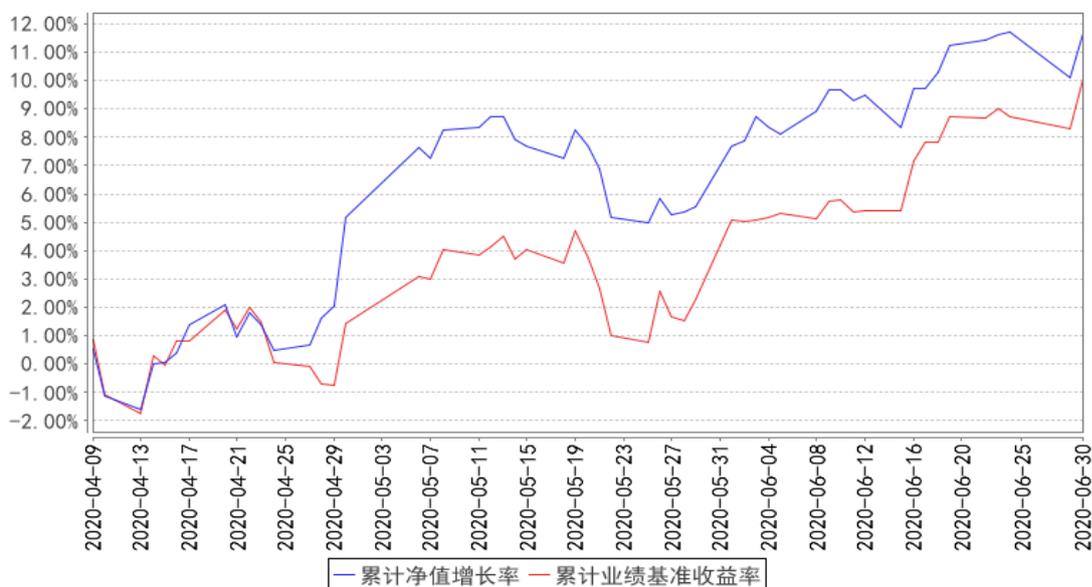
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

中金新锐集合计划A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中金新锐集合计划C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：2020年4月7日至2020年4月8日期间，中金新锐集合计划C类基金份额为零。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

中金公司根据《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》的要求，截至 2020 年 6 月 30 日，旗下已有三只大集合产品完成公募化改造，分别为：中金恒瑞债券型集合资产管理计划、中金新锐股票型集合资产管理计划、中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划。

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		
韩庆	本基金基金经理	2018 年 6 月 15 日	-	9 年	韩庆先生，管理学硕士。2015 年 4 月加入中金公司，担任资产管理部行业研究员、基金经理助理。现任中金新锐集合资产管理计划投资经理。

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

(2)非首任基金经理，其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)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) 本集合计划投资经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A 股上半年波折不断，在新冠疫情等多重风险聚集以及全球经济疲软之下，整体波动较大。不过，国内市场在全球范围内具备一定的估值优势，在深化改革以及政策推动下，市场迎来较大变革，一批新兴科技企业以及内需品种一度成为市场上行的主力军。特别是注册制改革下，市场投资生态发生改变，也给科创板以及创业板带来了较大的提振。而经历一季度的波折之后，伴随着二季度的逐步恢复，市场稳中向好的趋势得以体现。

产品 2 季度配置相对均衡，既配置了半导体、云计算、新能源等新兴产业的公司，也配置了部分乘用车、大金融等传统行业估值较低、基本面出现明显改善的公司。

组合 2 季度仓位基本稳定，截至 6 月 30 日，产品股票仓位为 82.95%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 2.3255 元，份额累计净值为 2.8055 元，本基金 C 类基金份额净值为 2.3231 元，份额累计净值为 2.3231 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 14.30%，同期业绩基准增长率 13.26%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 11.66%，同期业绩基准增长率 10.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下阶段市场展望：喧嚣之后重归慢牛，仍将是结构性行情

4.5.1 下半年经济将呈现复苏态势

(1) 疫情对于国内经济冲击最大时点已经过去，复工复产和政策刺激将推动经济下半年持续复苏。二季度国内生产、消费、投资等数据已经全面好转。好于预期的社融和信贷数据也将逐步传导到实体经济，宏观数据的好转会带动企业端盈利的改善。

(2) PMI 显示中国制造业稳步恢复，基建、房地产、出口均呈现改善趋势。统计局公布数据显示 6 月份，中国制造业采购经理指数（PMI）为 50.9%，比上月回升 0.3 个百分点，同时也超过了此前市场预期的 50.4%。自今年 3 月起 PMI 连续第 4 个月处于 50% 的荣枯线上方。

4.5.2 货币政策最宽松的时刻或已过去

(1) 国内经济复苏明显，客观上降低了超预期货币政策刺激的必要性。上半年货币供应增速明显快于信贷增速，下半年，政策的重心将从货币扩张转向信用扩张上。

(2) 央行已经给出了指引：“全年贷款 20 万亿，社融超过 30 万亿”，这意味着下半年贷款和社融的增速能够保持平稳，年内针对实体经济的宽松流动性环境仍将持续。

4.5.3 市场将从估值驱动向盈利驱动转变

(1) 随着疫情冲击逐渐结束，国内流动性最宽松时刻已过去，叠加经济开始复苏，A 股上半年估值极端分化的格局会有所收敛，成长与周期行业均有机会。市场的驱动力也将从上半年流动性宽松带来的提估值阶段向经济复苏带来的业绩驱动阶段转变。

(2) 经济处于弱复苏期，不同行业之间的景气分化较大。市场仍会追捧那些景气相对较高的行业及公司。

4.5.4 投资策略：超配那些景气处于上升期、盈利能力边际改善的行业及公司

(1) 半导体、自主可控、高端制造等领域的进口替代仍是未来几年国内经济发展的“主旋律”。从产业周期角度，以半导体、自主可控、云计算及数据中心、新能源汽车、5G 应用为代表的新兴产业周期正在处于上行阶段。

(2)关注传统行业中那些估值处于低位，业绩持续改善的公司。随着经济复苏，A 股市场的风格预计将更均衡。除了高预期、高景气的科技行业，那些传统行业中，基本面看到明显边际改善的公司亦存在较好的投资机会。

4.5.5 组合配置的重点

(1)半导体上游设备及材料：未来几年国内半导体行业将进入资本开支高峰。产业链上游相关公司业绩将进入高速增长期。看好那些存在进口替代潜力的优质设备、材料公司的机会。

(2) 5G、ICT、消费电子产业链：5G 进入快速普及期，关注应用端新的投资机会，如云计算、数据中心、云游戏等；以及 5G 换机周期中相关电子元器件需求爆发的机会。

(3) 新能源产业链：2020 年，国内光伏、风电将迎来需求大年，相关产业链公司将迎来业绩释放。

(4) 地产后周期产业链：随着疫情冲击的结束，房地产销售持续改善，房地产竣工面积也持续回升，6 月份同比增速已恢复正增长。疫情压制的地产后周期相关行业下半年将迎来爆发期。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金新锐股票型集合资产管理计划

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	92,123,437.48
结算备付金		2,365,975.66
存出保证金		260,313.96
交易性金融资产	6.4.7.2	551,229,008.64
其中：股票投资		540,508,814.24
基金投资		-
债券投资		10,720,194.40
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		1,155,838.94
应收利息	6.4.7.5	74,341.21
应收股利		-

应收申购款		4,415,806.94
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		651,624,722.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30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		10,726,742.25
应付赎回款		10,784,702.19
应付管理人报酬		728,793.43
应付托管费		97,172.47
应付销售服务费		36,767.97
应付交易费用	6.4.7.7	1,357,074.92
应交税费		933,399.96
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	6,521,409.10
负债合计		31,186,062.29
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	266,835,960.27
未分配利润	6.4.7.10	353,602,700.27
所有者权益合计		620,438,660.54
负债和所有者权益总计		651,624,722.83

注：1.报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 266,835,960.27 份，其中 A 类基金份额净值 2.3255 元，基金份额总额 227,578,512.80 份，C 类基金份额净值 2.3231 元，基金份额总额 39,257,447.47 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：中金新锐股票型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年4月7日(基金合同生效日)至2020年6
----	-----	---------------------------------

		月 30 日
一、收入		74,885,614.36
1.利息收入		273,548.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	183,894.81
债券利息收入		51,310.09
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		38,343.91
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		42,476,090.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	38,454,075.25
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,299,943.36
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	2,722,071.85
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	31,144,170.97
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	991,804.12
减：二、费用		4,411,421.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,884,525.72
2. 托管费	6.4.10.2.2	251,270.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	96,601.27
4. 交易费用	6.4.7.19	1,975,787.69
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		143,126.97
7. 其他费用	6.4.7.20	60,110.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		70,474,192.52
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		70,474,192.52

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金新锐股票型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	126,357,289.10	130,722,698.34	257,079,987.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,474,192.52	70,474,192.52
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）	140,478,671.17	152,405,809.41	292,884,480.58
其中：1.基金申购款	244,196,815.89	279,923,788.06	524,120,603.95
2.基金赎回款	-103,718,144.72	-127,517,978.65	-231,236,123.37
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）	266,835,960.27	353,602,700.27	620,438,660.54

报表附注为财务报表的组成部分。

基金管理人负责人：徐翌成 主管会计工作负责人：赵阳光 会计机构负责人：赵阳光

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金新锐股票型集合资产管理计划由中金股票策略集合资产管理计划变更而来。中金股票策略集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2007 年 2 月 2 日经中国证监会证监许可[2007]39 号文核准设立，自 2007 年 2 月 27 日起开始募集于 2007 年 2 月 28 日结束募集工作，并于 2007 年 3 月 6 日正式成立。根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，中金股票策略集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变

更。经中国证监会批准，自 2020 年 4 月 7 日起，《中金新锐股票型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《中金股票策略集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、股指期货、国债期货、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本集合计划的业绩比较基准为中证 500 指数收益率 \times 90%+中证全债指数收益率 \times 5%+活期存款利率 \times 5%。本集合计划以投资基本面优良的成长类公司为主，投资策略定位于把握中国产业转型、升级过程中的投资机会，基于产业景气趋势，自下而上精选成长型公司。故以最具代表性的中盘成长风格指数中证 500 指数收益率和代表债券市场平均收益率的中证全债指数收益率为基准，另外留取 5%的活期存款以满足流动性要求。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则 - 基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中金新锐股票型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表如附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务

操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指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。

(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。

6.4.4.4 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或资产支持证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；或者(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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具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。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金, 上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

收入是本基金在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本基金、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时, 予以确认。

投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

货币市场基金, 按基金管理公司公布的估值日每万份收益计提红利基金红利收

入；其他类型基金于除权日按基金管理公司公布的收益分配方案计算确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额，并扣除适用情况下代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

资产支持证券利息收入按证券票面价值与预期收益率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动净收益 / (损失) 核算集合计划持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类和 C 类基金份额的销售费用收取方式存在不同，各基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同。同一类别每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分为现金本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末

未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则并参照中国证监会允许的证券投资基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券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，本集合计划参照中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况参照《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、市盈率法、现金流量折现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)》(以下简称“指引”)，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债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

由于财政部、国家税务总局目前尚未对证券公司集合资产管理计划以及参照公开募集证券投资基金运作的证券公司集合资产管理计划公布专门的税收政策,因此,本基金参照如下规定执行。

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《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]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 2018年1月1日起,集合计划运营过程中发生的增值税应税行为,以集合

计划管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税；对集合计划在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照集合计划管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(2) 对集合计划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) 对于集合计划从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

(4) 集合计划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。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	92,123,437.48
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	92,123,437.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	514,002,409.98	540,508,814.24	26,506,404.26	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	10,749,616.54	10,720,194.40	-29,422.14
	银行间市场	-	-	-
	合计	10,749,616.54	10,720,194.40	-29,422.14
资产支持证券	-	-	-	

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	524,752,026.52	551,229,008.64	26,476,982.12

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	15,471.77
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	1,064.70
应收债券利息	57,687.54
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	117.20
合计	74,341.21

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,357,074.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,357,074.92

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,474.89
应付证券出借违约金	-
预提费用	50,350.92
代扣代缴个人所得税	6,467,583.29
合计	6,521,409.10

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

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金新锐集合计划 A

项目	本期 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	126,357,289.10	126,357,289.10
本期申购	164,903,165.02	164,903,165.02
本期赎回（以“-”号填列）	-63,681,941.32	-63,681,941.32
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	227,578,512.80	227,578,512.80

中金新锐集合计划 C

项目	本期 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	79,293,650.87	79,293,650.87
本期赎回（以“-”号填列）	-40,036,203.40	-40,036,203.40
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	39,257,447.47	39,257,447.47

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金新锐集合计划 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	190,747,969.40	-60,025,271.06	130,722,698.34
本期利润	32,609,480.66	27,119,537.63	59,729,018.29
本期基金份额交易产生的变动数	153,608,701.17	-42,399,213.04	111,209,488.13
其中：基金申购款	255,616,316.45	-65,699,924.54	189,916,391.91
基金赎回款	-102,007,615.28	23,300,711.50	-78,706,903.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	376,966,151.23	-75,304,946.47	301,661,204.76
中金新锐集合计划 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,720,540.89	4,024,633.34	10,745,174.23
本期基金份额交易产生的变动数	41,717,087.89	-520,766.61	41,196,321.28
其中：基金申购款	88,335,297.37	1,672,098.78	90,007,396.15
基金赎回款	-46,618,209.48	-2,192,865.39	-48,811,074.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,437,628.78	3,503,866.73	51,941,495.51

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	175,488.47
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	7,653.88
其他	752.46
合计	183,894.81

注：此处其他列示的是存出保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	566,490,744.17
减：卖出股票成本总额	528,036,668.92
买卖股票差价收入	38,454,075.25

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月7日（基金合同生效日）至2020 年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,918,492.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,612,523.91
减：应收利息总额	6,025.58
买卖债券差价收入	1,299,943.36

注：卖出债券成交总额中扣除了债券投资收益中增值税的影响。

6.4.7.13.2 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

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月7日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,722,071.85
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	2,722,071.85

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年4月7日（基金合同生效日）至2020年6
------	---------------------------------

	月 30 日
1.交易性金融资产	32,007,886.12
股票投资	31,960,414.95
债券投资	47,471.17
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	863,715.15
合计	31,144,170.97

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	991,804.12
合计	991,804.12

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,975,787.69
银行间市场交易费用	-
合计	1,975,787.69

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	5,806.35
信息披露费	37,918.50
证券出借违约金	-
银行费用	16,385.23
合计	60,110.08

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国国际金融股份有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
中国中金财富证券有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中金公司	1,380,053,924.34	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
中金公司	15,062,673.98	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
中金公司	169,600,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月7日（基金合同生效日）至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣 金总额的比例 （%）
中金公司	1,285,247.80	100.00	1,357,074.92	100.00

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,884,525.72
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人中金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日计提并按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：支付托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日计提并按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金新锐集合计划 A	中金新锐集合计划 C	合计
上海天天基金	0.00	281.42	281.42
中国中金财富证券	0.00	58,331.64	58,331.64
陆金所	0.00	1.74	1.74
中国国际金融股份有限公司	0.00	37,986.47	37,986.47
合计	-	96,601.27	96,601.27

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	92,123,437.48	175,488.47

注：本基金的银行存款由托管行中国建设银行保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2020 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本基金管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有除可转债以外的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

(1) 资产变现风险

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

(2) 现金流风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	92,123,437.48	-	-	-	92,123,437.48
结算备付金	2,365,975.66	-	-	-	2,365,975.66
存出保证金	260,313.96	-	-	-	260,313.96
交易性金融资产		-7,182,113.20	3,538,081.20	540,508,814.24	551,229,008.64
应收利息	-	-	-	74,341.21	74,341.21
应收申购款	-	-	-	4,415,806.94	4,415,806.94
应收证券清算款	-	-	-	1,155,838.94	1,155,838.94
资产总计	94,749,727.10	7,182,113.20	3,538,081.20	546,154,801.33	651,624,722.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,784,702.19	10,784,702.19
应付管理人报酬	-	-	-	728,793.43	728,793.43
应付托管费	-	-	-	97,172.47	97,172.47
应付证券清算款	-	-	-	10,726,742.25	10,726,742.25
应付销售服务费	-	-	-	36,767.97	36,767.97
应付交易费用	-	-	-	1,357,074.92	1,357,074.92
应交税费	-	-	-	933,399.96	933,399.96
其他负债	-	-	-	6,521,409.10	6,521,409.10
负债总计	-	-	-	31,186,062.29	31,186,062.29
利率敏感度缺口	94,749,727.10	7,182,113.20	3,538,081.20	514,968,739.04	620,438,660.54

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发

	生变化。	
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
	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（2020年6月30日）
分析	市场利率下降 25 个基点	22,975.00
	市场利率上升 25 个	-22,975.00

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产 - 股票投资	540,508,814.24	87.12
交易性金融资产 - 基金投资	-	-
交易性金融资产 - 债券投资	10,720,194.40	1.73
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	551,229,008.64	88.85
----	----------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2020年6月30日）
分析	业绩比较基准上升 5%	27,561,450.43
	业绩比较基准下降 5%	-27,561,450.43

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

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 545,839,455.44 元，属于第二层次的余额为 5,389,553.20 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

(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	540,508,814.24	82.95
	其中：股票	540,508,814.24	82.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,720,194.40	1.65
	其中：债券	10,720,194.40	1.65
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	94,489,413.14	14.50
8	其他各项资产	5,906,301.05	0.91
9	合计	651,624,722.83	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	357,155,158.93	57.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,250,505.32	11.97
J	金融业	97,050,856.89	15.64
K	房地产业	12,052,293.10	1.94
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	540,508,814.24	87.12

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	000625	长安汽车	5,004,014	55,044,154.00	8.87
2	002624	完美世界	500,179	28,830,317.56	4.65
3	300567	精测电子	363,400	24,802,050.00	4.00
4	002601	龙蟠佰利	1,226,200	22,684,700.00	3.66
5	601628	中国人寿	810,409	22,051,228.89	3.55
6	300059	东方财富	1,084,600	21,908,920.00	3.53
7	601688	华泰证券	1,133,600	21,311,680.00	3.43
8	002853	皮阿诺	874,000	19,822,320.00	3.19
9	002531	天顺风能	3,254,954	19,464,624.92	3.14
10	000977	浪潮信息	493,968	19,353,666.24	3.12
11	300033	同花顺	130,048	17,306,787.84	2.79
12	601211	国泰君安	928,200	16,020,732.00	2.58
13	600030	中信证券	653,600	15,758,296.00	2.54
14	002487	大金重工	2,624,800	15,643,808.00	2.52
15	600498	烽火通信	532,700	15,400,357.00	2.48
16	600406	国电南瑞	743,200	15,049,800.00	2.43
17	000938	紫光股份	339,500	14,591,710.00	2.35
18	002938	鹏鼎控股	276,400	13,836,584.00	2.23

19	002384	东山精密	422,100	12,641,895.00	2.04
20	002202	金风科技	1,161,400	11,579,158.00	1.87
21	300772	运达股份	878,600	10,850,710.00	1.75
22	600176	中国巨石	1,094,300	10,012,845.00	1.61
23	000425	徐工机械	1,610,000	9,515,100.00	1.53
24	002508	老板电器	278,100	8,651,691.00	1.39
25	002409	雅克科技	154,100	8,039,397.00	1.30
26	002970	锐明技术	115,200	7,871,616.00	1.27
27	600528	中铁工业	876,000	7,726,320.00	1.25
28	688018	乐鑫科技	32,687	6,720,447.20	1.08
29	603659	璞泰来	64,700	6,665,394.00	1.07
30	300406	九强生物	289,794	6,665,262.00	1.07
31	603788	宁波高发	365,040	6,545,167.20	1.05
32	000002	万科A	247,400	6,467,036.00	1.04
33	603801	志邦股份	242,172	6,463,570.68	1.04
34	688368	晶丰明源	77,811	6,343,152.72	1.02
35	688388	嘉元科技	109,472	6,168,747.20	0.99
36	600383	金地集团	407,683	5,585,257.10	0.90
37	300258	精锻科技	518,200	5,456,646.00	0.88
38	600893	航发动力	231,900	5,445,012.00	0.88
39	600703	三安光电	127,300	3,182,500.00	0.51
40	300747	锐科激光	27,843	3,030,153.69	0.49

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000625	长安汽车	34,677,487.48	5.59
2	600036	招商银行	33,406,797.33	5.38
3	300567	精测电子	25,870,167.00	4.17
4	601628	中国人寿	24,896,481.23	4.01
5	002601	龙蟠佰利	24,717,740.44	3.98
6	002371	北方华创	23,606,817.00	3.80
7	002624	完美世界	23,204,601.82	3.74
8	601688	华泰证券	21,667,702.00	3.49
9	000977	浪潮信息	21,283,414.80	3.43
10	002853	皮阿诺	20,925,688.00	3.37
11	300059	东方财富	18,350,783.60	2.96
12	600498	烽火通信	17,548,660.31	2.83
13	600406	国电南瑞	17,131,153.02	2.76
14	300033	同花顺	16,670,552.96	2.69

15	601318	中国平安	16,668,628.00	2.69
16	000938	紫光股份	16,109,845.00	2.60
17	600030	中信证券	15,479,230.00	2.49
18	601211	国泰君安	15,298,923.00	2.47
19	688388	嘉元科技	15,272,011.68	2.46
20	000651	格力电器	13,930,110.04	2.25
21	000425	徐工机械	13,768,452.00	2.22
22	002384	东山精密	13,744,562.60	2.22
23	002938	鹏鼎控股	13,621,901.47	2.20
24	601933	永辉超市	13,189,190.60	2.13

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	40,128,708.63	6.47
2	002371	北方华创	31,123,646.10	5.02
3	600584	长电科技	21,773,476.41	3.51
4	601933	永辉超市	20,573,479.00	3.32
5	600031	三一重工	18,547,589.59	2.99
6	000333	美的集团	17,387,206.47	2.80
7	601601	中国太保	17,255,632.97	2.78
8	601318	中国平安	16,814,750.00	2.71
9	300724	捷佳伟创	16,410,532.00	2.64
10	000100	TCL 集团	15,663,498.00	2.52
11	603986	兆易创新	15,217,450.82	2.45
12	600297	广汇汽车	14,637,102.00	2.36
13	000651	格力电器	13,823,544.00	2.23
14	000910	大亚圣象	11,712,405.90	1.89
15	600160	巨化股份	11,711,179.00	1.89
16	300308	中际旭创	11,418,776.40	1.84
17	600298	安琪酵母	11,279,078.00	1.82
18	600801	华新水泥	11,118,661.24	1.79
19	002180	纳思达	10,837,560.00	1.75
20	600406	国电南瑞	10,221,521.56	1.65

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	812,409,557.88
卖出股票收入（成交）总额	566,490,744.17

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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	5,389,553.20	0.87
	其中：政策性金融债	5,389,553.20	0.87
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）	5,330,641.20	0.86
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,720,194.40	1.73

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	018006	国开 1702	52,540	5,389,553.20	0.87
2	113543	欧派转债	14,790	1,838,692.80	0.30
3	123025	精测转债	12,320	1,792,560.00	0.29
4	110062	烽火转债	13,630	1,699,388.40	0.27

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

-

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	260,313.96
2	应收证券清算款	1,155,838.94
3	应收股利	-
4	应收利息	74,341.21
5	应收申购款	4,415,806.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,906,301.05

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113543	欧派转债	1,838,692.80	0.30
2	123025	精测转债	1,792,560.00	0.29
3	110062	烽火转债	1,699,388.40	0.27

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
中金新锐集合计划 A	3,731	60,996.65	4,821,778.04	2.12	222,756,734.76	97.88
中金新锐集合计划 C	1,062	36,965.58	4,509,278.75	11.49	34,748,168.72	88.51
合计	4,793	55,672.01	9,331,056.79	3.50	257,504,903.48	96.50

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金新锐集合计划 A	48,120.63	0.02
	中金新锐集合计划 C	960,799.39	2.45
	合计	1,008,920.02	0.38

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

注：本公司基金经理、高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本开放式基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金新锐集合计划 A	中金新锐集合计划 C
基金合同生效日 (2020 年 4 月 7 日) 基金份额总额	126,357,289.10	-
基金合同生效日 起至报告期期末 基金总申购份额	164,903,165.02	79,293,650.87
减: 基金合同生效 日起至报告期期 末基金总赎回份 额	63,681,941.32	40,036,203.40
基金合同生效日 起至报告期期末 基金拆分变动份 额 (份额减少以“-” 填列)	-	-
本报告期期末基 金份额总额	227,578,512.80	39,257,447.47

§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，本集合计划未召开份额持有人大会。

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

王晟先生，43 岁，自 2020 年 3 月起获委任为本公司的管理委员会成员。王晟先生现任本公司的投资银行部负责人、董事总经理。自 2018 年 3 月至 2020 年 3 月担任本公司总裁助理。并自 2010 年起在中金公司投行部担任重要管理职务。

孙男先生，40 岁，自 2020 年 5 月起获委任为本公司董事会秘书。孙男先生现任战略发展部负责人、综合办公室负责人。彼于 2003 年 7 月加入本公司投资银行部，曾担任投资银行全球并购业务负责人、投资银行保荐业务负责人、投资银行业务委员会成员、投资银行运营团队成员、战略研究部负责人等职务。

徐翌成先生，45 岁，自 2020 年 3 月起获委任为本公司总裁助理。徐翌成先生现任本公司资产管理业务板块负责人。彼自 2000 年 1 月加入公司投资银行部，2008 年 1 月成为董事总经理，先后担任多个职位，包括董事会秘书、战略发展部负责人、综合办公室负责人。

基金托管人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

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2020 年 4 月 21 日，证监会北京监管局向中金公司出具《关于对中国国际金融股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定》（[2020]63 号），指出中金公司管理的 11 只私募资管计划投资于同一资产的资金均超过该资产管理计划资产净值的 25%，违反了《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2018]31 号）第十五条的规定，决定对中金公司采取出具警示函的行政监督管理措施。中金公司自包商银行被接管后，即对固定收益资产投资项目进行了自查和梳理，并启动对存量资管业务内部控制制度及流程的全面自查和整改工作，目前已落实完成整改方案，并于 2020 年 5 月 21 日向证监会北京监管局报送了《关于 11 只私募资管计划投资于同一资产比例超标相关问题的整改报告》（中金证[2020]0474 号）。

基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	1,380,053,924.34	100.00%	1,285,247.80	100.00%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	15,062,673.98	100.00%	169,600,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于中金股票策略集合资产管理计划变更为中金新锐股票型集合资产管理计划及法律文件变更生效的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年4月07日
2	基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年4月08日
3	中国国际金融股份有限公司更正公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年4月10日
4	集合-中金新锐基金开放定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年4月10日
5	关于新增上海陆金所基金销售有限公司为中金新锐股票型集合资产管理计划代销机构的公告	中国证监会指定网站	2020年5月29日
6	关于新增上海浦东发展银行股份有限公司为中金新锐股票型集合资产管理计划代销机构的公告	中国证监会指定网站	2020年7月6日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 关于准予中金股票策略集合资产管理计划合同变更的回函
- (二) 中金新锐股票型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 中金新锐股票型集合资产管理计划招募说明书
- (四) 中金新锐股票型集合资产管理计划托管协议
- (五) 管理人业务资格批复件、营业执照
- (六) 报告期内披露的各项公告

12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸 3 期 B 座 42 层

12.3 查阅方式

投资者可到管理人办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

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

公司网址：www.cicc.com

中国国际金融股份有限公司

2020 年 8 月 30 日