

中金安心回报灵活配置混合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：华夏银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人华夏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。

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 30 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	61

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 ...	
61	
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 ...	
61	
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	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§9 开放式基金份额变动	63
§10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划	
基金简称	中金安心回报	
基金主代码	920011	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 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	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,022,485,619.59 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额
下属分级基金的交易代码	920011	920921
报告期末下属分级基金的份额总额	693,640,822.85 份	328,844,796.74 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	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券等大类资产中充分挖掘市场轮动机会、利用潜在投资价值，力求实现集合计划资产的持续稳定增值。
投资策略	依靠对大类资产配置和趋势研判的丰富实践与投资能力，结合系统化策略模型体系以及严格的风险预算机制，长期获取优异的绝对回报。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为中债新综合全价指数收益率×65%+中证 800 指数收益率×25%+恒生指数收益率×5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%。
风险收益特征	本集合计划为混合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，低于股票型基金、股票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	华夏银行股份有限公司
信息披露 姓名	宋璐芳	郑鹏

露负责人	联系电话	010-65051166	(010) 85238667
	电子邮箱	songlf@cicc.com.cn	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		010-65050105	95577
传真		010-65058035	(010) 85238680
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	北京市东城区建国门内大街22号(100005)
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	北京市东城区建国门内大街22号(100005)
邮政编码		100004	100005
法定代表人		沈如军	李氏吉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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30日(基金合同生效日)-2020年6月30日)	
	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额
本期已实现收益	15,677,860.32	5,695,335.87
本期利润	30,292,424.69	11,188,305.21
加权平均基金份额本期利润	0.0543	0.0420
本期加权平均净值利润率	4.40%	3.39%
本期基金份额净值增长率	6.22%	2.66%
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	178,637,648.62	79,938,646.49
期末可供分配基金份额利润	0.2575	0.2430
期末基金资产净值	872,278,471.47	413,323,702.81

期末基金份额净值	1.2575	1.2569
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	6.22%	2.66%

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

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

中金安心回报 A 类份额

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
过去一个月	2.42%	0.38%	1.63%	0.27%	0.79%	0.11%
自基金合同生效起	6.22%	0.47%	0.77%	0.27%	5.45%	0.20%

中金安心回报 C 类份额

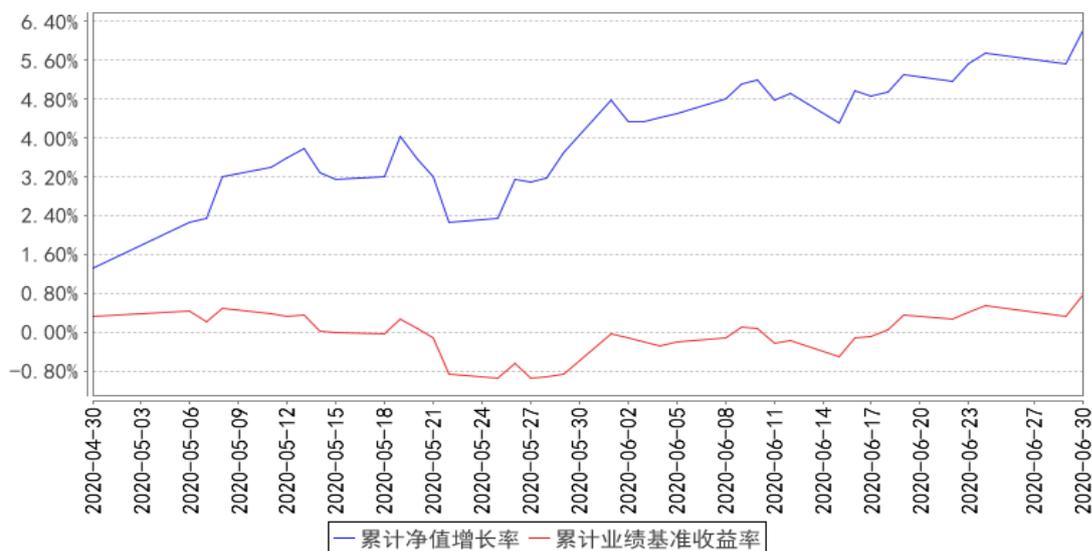
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
过去一个月	2.39%	0.38%	1.63%	0.27%	0.76%	0.11%
自基金合同生效起	2.66%	0.42%	0.38%	0.28%	2.28%	0.14%

注：1、本基金基金合同于 2020 年 4 月 30 日生效。截至本报告期末，基金合同生效未滿一年；

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

中金安心回报A类份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中金安心回报C类份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：2020年4月30日至2020年5月11日期间，中金安心回报集合计划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		
李飞	本基金基金经理	2018 年 9 月 17 日	-	9 年	李飞先生，2008 年获华中科技大学经济学学士和文学学士，2010 年获法国北方高等商学院理学硕士，2010 年—2015 年担任国家外汇管理局高级经理，负责全球资产配置工作；2016 年-2017 年担任中邮创业基金 QDII 投资经理，负责港股组合投资管理工作；2017 年-2018 年担任鹏扬基金多资产策略部执行总经理，负责股债混合策略投资管理工作；2018 年 6 月加入中金公司资产管理部，担任执行总经理，负责资产配置和 FOF 业务。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
李飞	公募基金	1	1,285,602,174.28	2018年09月17日
	私募资产管理计划	1	226,795,431.14	2018年07月25日
	其他组合	-	-	-
	合计	2	1,512,397,605.42	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

(1) 行情回顾

一季度以来，国内与海外市场先后遭遇了新冠肺炎疫情的黑天鹅事件，经济处于停摆状态；进入 4 月之后，随着国内疫情已逐步走向结束，海外绝大多数国家也已经进入到复工复产的阶段，国内经济出现明显的“爬坑”走势，且经济恢复动能持续保持；截至 6 月最新经济数据，PMI 与 BCI 等宏观数据和中观数据，如工程机械销量、地产销量等都表现出强劲的淡季不淡特征。同时为对冲疫情产生的负面影响，全球主要经济体均推出了力度远超 2008 年金融危机期间的财政刺激计划。与海外相似，中国亦在财政政策与货币政策上同步发力，助力需求的恢复。在这样的宏观和政策背景下，二季度在流动性及对经济复苏信心的推升下，权益方面表现亮眼；二季度上证综合指数上涨 8.79%，风格方面创业板指大幅上涨 31.2%，远超其他指数；行业方面疫情受益或影响较小的医药、电子、必选消费等行业表现出色；债券方面，宏观经济逐渐企稳复苏，同时 5 月宽松货币政策的边际转向，使得市场对短端资金价格进行重估，叠加利率债供给量的放量（包括地方债、特别国债等），使得长端价格大幅调整，十年期国债收益率经历 4 月下行、5、6 月快速上行后，最终二季度十年国债收益率上行 27bps。

股票方面，一季度以来，国内市场遭遇了新冠肺炎疫情的黑天鹅事件，经济处于停摆状态，国外也随着疫情的发酵，金融市场遭遇流动性危机，美股三月月内四回熔断，美债收益率创新历史最低值，市场避险情绪急剧升温。组合的投资操作并未因为市场恐慌而变形，并未出现追涨杀跌，在新年过后第一个交易日千股跌停之后，随着市场的底部出现，组合逐步提高权益仓位，以博弈反弹，净值也回到疫情冲击前的水平。在 3 月上旬，随着股指到达前期高位，且我们观察到海外疫情的逐步发酵，组合逐步降低权益仓位以兑现收益。

债券方面，资金面持续宽松且经济处于停摆状态，债券收益率快速下行，已经 price in 这些利空因素，债券估值处于历史偏贵水平，组合未采取久期操作，债券配置选择上精挑高等级信用债势。

(2) 运作情况

在报告期内，本产品采用大类资产配置的策略，运作平稳，实现 2.79% 的绝对收益，符合产品的目标定位。

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 1.2575 元，份额累计净值为 2.3035 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.2569 元，份额累计净值为 1.2569 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 6.22%，同期业绩基准增长率 0.77%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 2.66%，同期业绩基准增长率 0.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

(1) 市场展望

往前看，经济修复的趋势可持续性仍未明朗：一方面基建有明显的季节因素，房地产也仍处于严密的调控之中，疫情对企业家资本开支意愿也存在抑制；另一方面，海外疫情蔓延对外需的冲击也是负面因素。

股票方面，近期 A 股主要指数突破技术阻力位快速大幅拉升，主要的导火索来自于 6 月 PMI 等经济数据大幅超出预期，市场形成对经济的 V 型反转预期，引发股票市场风格剧烈切换，前期持续跑输的金融、地产、有色金属等偏价值的周期行业出现重估，带动指数大幅度上行。市场的强劲表现进一步吸引散户等新增资金入场，对市场上涨形成了加速度。

从中期经济周期角度看，市场能否形成持续性的牛市取决于经济复苏强度和长度。近期公布的一系列宏观（如 PMI，BCI 等）和中观（如工程机械销量，房地产销售等）数据都比较强，表现出淡季不淡的特征，但由于新冠疫情的扰动，这些数据是否能持续还存在疑问。因此，我们担心，很多市场参与者某种程度上对近期强劲的数据进行了线性外推，但在复苏被证伪之前，市场可能随着惯性按照当前的趋势继续行进。但我们的观点认为实体经济复苏迹象并未超出预期，无法给 A 股持续性上涨提供坚实基础。估值角度，随着周期股估值修复，A 股整体估值水平进一步抬高，股债相对性价比进一步减弱。目前需紧密跟踪高频数据与交易信号，时刻警惕市场可能的调整，并积极快速降低仓位。

债券方面，由于经济复苏还未被证伪、货币政策边际性收紧、叠加三季度资金缺口较大、利率供给量不小，虽然债券短期来看有超跌的迹象，但仍未达到合意的配置水平，交易性价比较低。我们保持低仓位配置，但如果后续出现价格大幅偏离基本面，产生预期差；或价格调整至具有较高配置价值，也会提升配置仓位。

(2) 下期投资策略

股票仓位维持中性仓位。操作思路：中性仓位基础上拿出部分头寸根据短期战术

配置模型 TAA 抓取交易机会。主要考虑：一、对宏观基本面的复苏并没有十足确信度，不能将近期较强的经济数据简单线性外推（近期市场融涨模式可能已部分反应参与者对经济的线性外推）；二、短期快速大幅上涨后，股票技术面和情绪面都非常极端，市场投机情绪浓重；三、估值上看，股债相对比价已经大幅调整，股票内部部分行业估值已经很贵，从以绝对收益目标角度出发，时刻保持一定理性和警惕。

债券方面，短期市场由于货币政策预期的纠偏、经济基本面数据的持续向好和风险情绪的大幅上行，一定程度压制债券市场短期情绪，利率市场快速调整。权益市场消化短期超买后，利率市场的主要交易点将重回基本面：4-6 月经济的环比大幅走好符合预期，在外需大概率走弱背景下，国内经济的主导因素仍然在内需的恢复，现阶段性回升来自需求滞后效应还是持续性转好需进一步验证。以上是利率策略可能产生预期差的交易机会。组合计划维持中性偏低仓位，但不排除会根据市场变化提升久期。

信用债策略：经过 5、6 月的持续调整，信用债收益率有所反弹，考虑信用利差和期限利差，3Y 和 5Y 的高等级品种初步具备配置价值。组合前期持仓信用债久期维持在较低水平，一定程度上规避了近期债市波动带来的信用久期风险及信用利差风险，后续可逐步提高久期，坚持高等级中短久期的投资原则。

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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划未进行利润分配。（如有利润分配情况，请写具体分配金额等信息。）

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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2020 年中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金安心回报灵活配置混合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	67,994,609.26
结算备付金		9,815,139.90
存出保证金		766,540.52
交易性金融资产	6.4.7.2	779,504,036.20
其中：股票投资		498,725,435.20
基金投资		-
债券投资		280,778,601.00
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	450,000,000.00
应收证券清算款		76,215.78
应收利息	6.4.7.5	3,726,606.60
应收股利		82,029.44

应收申购款		9,729,495.86
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,321,694,673.56
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		8.25
应付赎回款		31,765,207.25
应付管理人报酬		1,058,179.01
应付托管费		190,283.67
应付销售服务费		137,169.43
应付交易费用	6.4.7.7	837,279.21
应交税费		1,268,915.30
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	835,457.16
负债合计		36,092,499.28
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	1,022,485,619.59
未分配利润	6.4.7.10	263,116,554.69
所有者权益合计		1,285,602,174.28
负债和所有者权益总计		1,321,694,673.56

注：1.报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,022,485,619.59 份，其中 A 类基金份额净值 1.2575 元，基金份额总额 693,640,822.85 份；C 类基金份额净值 1.2569 元，基金份额总额 328,844,796.74 份。

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

6.2 利润表

会计主体：中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划

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

		月 30 日
一、收入		45,299,587.49
1.利息收入		1,382,840.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	192,712.90
债券利息收入		701,347.14
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		488,780.38
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		22,568,900.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	18,824,695.65
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	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	3,744,204.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	20,107,533.71
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	1,240,313.29
减：二、费用		3,818,857.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,591,747.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	296,997.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	185,863.18
4. 交易费用	6.4.7.19	1,665,473.99
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		44,062.89
7. 其他费用	6.4.7.20	34,712.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		41,480,729.90
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		41,480,729.90

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 4 月 30 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 30 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）	177,701,315.63	32,679,676.97	210,380,992.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,480,729.90	41,480,729.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	844,784,303.96	188,956,147.82	1,033,740,451.78
其中：1.基金申购款	1,079,365,232.24	245,138,245.32	1,324,503,477.56
2.基金赎回款	-234,580,928.28	-56,182,097.50	-290,763,025.78
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）	1,022,485,619.59	263,116,554.69	1,285,602,174.28

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

中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划由中金安心回报集合资产管理计划变更而来。中金安心回报集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2010 年 1 月 14 日经中国证监会证监许可[2010]53 号文核准设立，自 2010 年 3 月 8 日起开始募集，于 2010 年 3 月 24 日结束募集工作，并于 2010 年 3 月 29 日正式成立。根据中国证监会于 2018 年 11 月 30 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，中金安心回报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 23 日起，《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《中金安心回报集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

为满足广大投资者的理财需求，本集合计划经中国证券监督管理委员会批准，自 2020 年 6 月 19 日起，将中金安心回报集合计划托管费率进行调整。

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）、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、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为 0%-85%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）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。同业存单占集合计划资产比例不超过 20%。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债新综合全价指数收益率 \times 65%+中证 800 指数收益率 \times 25%+恒生指数收益率 \times 5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后) \times 5%

本集合计划是混合型。本集合计划采用“中证 800 指数”、“中债新综合全价指数收益率”、“恒生指数收益率”和“金融机构人民币活期存款基准利率（税后）”分别作为股票、债券、港股和现金类资产投资的比较基准，并将业绩比较基准中股票指数、债券指数与现金类资产的权重确定为 30%、65%和 5%，基于指数的权威性和代表性以及本集合计划的投资范围和投资理念，选用该业绩比较基准能够真实、客观的反映本集合计划的风险收益特征。

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 30 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 30 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 30 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、资产支持证券投资和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	67,994,609.26
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	67,994,609.26

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	471,544,125.25	498,725,435.20	27,181,309.95
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	86,304,757.60	86,083,601.00
	银行间市场	195,363,740.00	194,695,000.00
	合计	281,668,497.60	280,778,601.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	753,212,622.85	779,504,036.20	26,291,413.35

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

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	450,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	450,000,000.00	-

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	10,797.77
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	4,895.20
应收债券利息	3,710,568.63
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	345.00
合计	3,726,606.60

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	834,829.21
银行间市场应付交易费用	2,450.00
合计	837,279.21

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	45,760.04
应付证券出借违约金	-
预提费用	42,676.02
其他	747,021.10
合计	835,457.16

注：代扣代缴个人所得税为原（中金安心回报）集合资产管理计划在以前年度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

中金安心回报 A 类份额

项目	本期 2020 年 4 月 30 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	177,701,315.63	177,701,315.63
本期申购	634,226,116.17	634,226,116.17
本期赎回（以“-”号填列）	-118,286,608.95	-118,286,608.95
-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	693,640,822.85	693,640,822.85

中金安心回报 C 类份额

项目	本期 2020 年 4 月 30 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	445,139,116.07	445,139,116.07
本期赎回（以“-”号填列）	-116,294,319.33	-116,294,319.33
-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	328,844,796.74	328,844,796.74

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金安心回报 A 类份额

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	51,258,544.44	-18,578,867.47	32,679,676.97
本期利润	15,677,860.32	14,614,564.37	30,292,424.69
本期基金份额交易产生的变动数	157,773,141.37	-42,107,594.41	115,665,546.96
其中：基金申购款	195,021,351.15	-51,141,439.25	143,879,911.90
基金赎回款	-37,248,209.78	9,033,844.84	-28,214,364.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	224,709,546.13	-46,071,897.51	178,637,648.62
中金安心回报 C 类份额			
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	5,695,335.87	5,492,969.34	11,188,305.21
本期基金份额交易产生的变动数	74,243,310.62	-952,709.76	73,290,600.86
其中：基金申购款	101,511,298.01	-252,964.59	101,258,333.42
基金赎回款	-27,267,987.39	-699,745.17	-27,967,732.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	79,938,646.49	4,540,259.58	84,478,906.07

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		172,431.60
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		18,600.91
其他		1,680.39
合计		192,712.90

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 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		18,824,695.65
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	18,824,695.65

6.4.7.12.2 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 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	719,367,042.26
减：卖出股票成本总额	700,542,346.61
买卖股票差价收入	18,824,695.65

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

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 30 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	3,744,204.42
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	3,744,204.42

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 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	20,965,195.35
股票投资	21,835,795.65

债券投资	-870,600.30
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	857,661.64
合计	20,107,533.71

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,240,313.29
合计	1,240,313.29

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,663,023.99
银行间市场交易费用	2,450.00
合计	1,665,473.99

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	4,235.22
信息披露费	30,243.60
证券出借违约金	-
银行费用	233.29
合计	34,712.11

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
华夏银行股份有限公司	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 30 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	1,676,902,109.14	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 30 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	67,152,461.30	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 30 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	5,225,000,000.00	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30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	745,341.60	100.00	834,829.21	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30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	1,591,747.96
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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30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	296,997.46

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 30 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		
	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额	合计
上海天天基金	0.00	554.45	554.45
中国中金财富证券	0.00	134,302.52	134,302.52
中国国际金融股份有限公司	0.00	51,006.21	51,006.21
合计	-	185,863.18	185,863.18

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 类基金份额和 B 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 30 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
华夏银行	67,994,609.26	172,431.60

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总 额	期末 估值总 额	备注
601880	大连港	2020 年6月 22日	重大事项	1.72	2020 年7月 22日	2.06	1,200	2,089.38	2,064.00	-
600317	营口港	2020 年6月 22日	重大事项	2.21	2020 年7月 22日	2.64	700	1,517.21	1,547.00	-
600240	退市华业	2020 年2月 3日	重大事项	0.41	-	-	200	579.29	82.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资。

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	67,994,609.26	-	-	-	67,994,609.26
结算备付金	9,815,139.90	-	-	-	9,815,139.90
存出保证金	766,540.52	-	-	-	766,540.52
交易性金融资产	84,081,000.00	-	196,697,601.00	498,725,435.20	779,504,036.20
买入返售金融资产	450,000,000.00	-	-	-	450,000,000.00
应收利息	-	-	-	3,726,606.60	3,726,606.60
应收股利	-	-	-	82,029.44	82,029.44
应收申购款	-	-	-	9,729,495.86	9,729,495.86
应收证券清算款	-	-	-	76,215.78	76,215.78
资产总计	612,657,289.68	-	196,697,601.00	512,339,782.88	1,321,694,673.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	31,765,207.25	31,765,207.25
应付管理人报酬	-	-	-	1,058,179.01	1,058,179.01
应付托管费	-	-	-	190,283.67	190,283.67
应付证券清算款	-	-	-	8.25	8.25
应付销售服务费	-	-	-	137,169.43	137,169.43
应付交易费用	-	-	-	837,279.21	837,279.21
应交税费	-	-	-	1,268,915.30	1,268,915.30
其他负债	-	-	-	835,457.16	835,457.16
负债总计	-	-	-	36,092,499.28	36,092,499.28
利率敏感度缺口	612,657,289.68	-	196,697,601.00	476,247,283.60	1,285,602,174.28

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	8,373,875.00
	市场利率上升 25 个基点	-8,373,875.00

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	38,160,401.07	-	38,160,401.07
资产合计	-	38,160,401.07	-	38,160,401.07
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	38,160,401.07	-	38,160,401.07

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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	港币相对人民币升值 5%	1,908,020.05
	港币相对人民币贬值 5%	-1,908,020.05

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	498,725,435.20	38.79
交易性金融资产 - 基金投资	-	-
交易性金融资产 - 债券投资	-	-
交易性金融资产 - 贵金属投资	-	-
衍生金融资产 - 权证投资	-	-
其他	-	-
合计	498,725,435.20	38.79

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%	24,936,271.76
	业绩比较基准下降 5%	-24,936,271.76

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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 498,725,435.20 元，属于第二层次的余额为 280,778,601.00 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	498,725,435.20	37.73
	其中：股票	498,725,435.20	37.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	280,778,601.00	21.24
	其中：债券	280,778,601.00	21.24
	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	450,000,000.00	34.05
	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	77,809,749.16	5.89
8	其他各项资产	14,380,888.20	1.09
9	合计	1,321,694,673.56	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	104,086.00	0.01
B	采矿业	7,800,860.00	0.61
C	制造业	317,076,389.60	24.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,425.40	0.01
E	建筑业	43,716.90	0.00
F	批发和零售业	1,738,995.54	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	14,026,929.29	1.09
H	住宿和餐饮业	5,758,125.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,624,271.93	2.30

J	金融业	44,701,185.94	3.48
K	房地产业	18,647,865.38	1.45
L	租赁和商务服务业	75,433.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	13,339,280.60	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	1,768,051.20	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,068.00	0.00
Q	卫生和社会工作	1,161,561.95	0.09
R	文化、体育和娱乐业	4,613,551.00	0.36
S	综合	4,237.40	0.00
	合计	460,565,034.13	35.82

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
周期性消费品	9,516,144.85	0.74
非周期性消费品	8,744,216.80	0.68
能源	-	-
金融	-	-
医疗	3,640,789.15	0.28
工业	-	-
信息科技	-	-
电信服务	16,259,250.27	1.26
公用事业	-	-
合计	38,160,401.07	2.97

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	00700 HG	腾讯控股	35,700	16,259,250.27	1.26
2	000651	格力电器	227,400	12,864,018.00	1.00
3	603899	晨光文具	214,700	11,722,620.00	0.91
4	600612	老凤祥	225,102	10,847,665.38	0.84
5	600887	伊利股份	341,700	10,637,121.00	0.83
6	002078	太阳纸业	1,115,647	10,620,959.44	0.83
7	600426	华鲁恒升	592,550	10,476,284.00	0.81
8	002508	老板电器	327,064	10,174,961.04	0.79
9	600362	江西铜业	736,136	9,908,390.56	0.77
10	600176	中国巨石	1,031,484	9,438,078.60	0.73
11	600036	招商银行	265,895	8,965,979.40	0.70

12	300750	宁德时代	49,742	8,673,015.12	0.67
13	000977	浪潮信息	212,300	8,317,914.00	0.65
14	000333	美的集团	133,845	8,002,592.55	0.62
15	601628	中国人寿	293,500	7,986,135.00	0.62
16	601012	隆基股份	184,685	7,522,220.05	0.59
17	603060	国检集团	368,740	7,371,112.60	0.57
18	000961	中南建设	816,700	7,268,630.00	0.57
19	00780 HG	同程艺龙	539,200	6,875,674.80	0.53
20	002367	康力电梯	787,000	6,870,510.00	0.53
21	601336	新华保险	148,300	6,566,724.00	0.51
22	000002	万科A	248,481	6,495,293.34	0.51
23	002353	杰瑞股份	206,500	6,401,500.00	0.50
24	600143	金发科技	454,600	5,987,082.00	0.47
25	603259	药明康德	61,680	5,958,288.00	0.46
26	600754	锦江酒店	207,500	5,758,125.00	0.45
27	002597	金禾实业	250,060	5,743,878.20	0.45
28	600346	恒力石化	392,640	5,496,960.00	0.43
29	02319 HG	蒙牛乳业	202,000	5,461,640.45	0.42
30	603505	金石资源	248,074	5,358,398.40	0.42
31	002410	广联达	75,563	5,266,741.10	0.41
32	600309	万华化学	102,200	5,108,978.00	0.40
33	601799	星宇股份	40,165	5,100,955.00	0.40
34	300760	迈瑞医疗	16,300	4,982,910.00	0.39
35	300482	万孚生物	46,900	4,877,600.00	0.38
36	000921	海信家电	399,887	4,862,625.92	0.38
37	600048	保利地产	324,800	4,800,544.00	0.37
38	002803	吉宏股份	188,870	4,710,417.80	0.37
39	000100	TCL 科技	742,900	4,605,980.00	0.36
40	002352	顺丰控股	83,900	4,589,330.00	0.36
41	603866	桃李面包	88,051	4,480,915.39	0.35
42	002014	永新股份	475,078	4,465,733.20	0.35
43	002120	韵达股份	178,749	4,370,413.05	0.34
44	601318	中国平安	60,100	4,291,140.00	0.33
45	300416	苏试试验	189,650	4,287,986.50	0.33
46	300725	药石科技	33,800	4,199,650.00	0.33
47	002371	北方华创	24,074	4,114,487.34	0.32
48	06186 HG	中国飞鹤	286,000	4,054,504.40	0.32
49	002324	普利特	263,760	3,959,037.60	0.31
50	000001	平安银行	308,100	3,943,680.00	0.31
51	002568	百润股份	83,756	3,795,821.92	0.30
52	601688	华泰证券	197,200	3,707,360.00	0.29
53	600519	贵州茅台	2,500	3,657,200.00	0.28

54	002624	完美世界	63,207	3,643,251.48	0.28
55	01177 HG	中国生物制药	273,000	3,640,789.15	0.28
56	600588	用友网络	79,982	3,527,206.20	0.27
57	603799	华友钴业	90,250	3,507,115.00	0.27
58	000636	风华高科	116,100	3,388,959.00	0.26
59	600030	中信证券	132,245	3,188,426.95	0.25
60	300383	光环新网	121,200	3,159,684.00	0.25
61	603801	志邦家居	114,570	3,057,873.30	0.24
62	000338	潍柴动力	217,871	2,989,190.12	0.23
63	603239	浙江仙通	201,200	2,981,784.00	0.23
64	600031	三一重工	158,000	2,964,080.00	0.23
65	002475	立讯精密	57,595	2,957,503.25	0.23
66	300496	中科创达	37,400	2,905,980.00	0.23
67	600276	恒瑞医药	31,305	2,889,451.50	0.22
68	603816	顾家家居	63,300	2,849,133.00	0.22
69	601021	春秋航空	78,400	2,762,816.00	0.21
70	300702	天宇股份	25,700	2,732,424.00	0.21
71	300413	芒果超媒	41,390	2,698,628.00	0.21
72	600336	澳柯玛	442,068	2,674,511.40	0.21
73	300059	东方财富	130,848	2,643,129.60	0.21
74	600845	宝信软件	42,300	2,499,084.00	0.19
75	601100	恒立液压	30,976	2,484,275.20	0.19
76	002648	卫星石化	148,400	2,414,468.00	0.19
77	300308	中际旭创	37,980	2,392,740.00	0.19
78	603993	洛阳钼业	642,000	2,356,140.00	0.18
79	601128	常熟银行	312,500	2,346,875.00	0.18
80	002511	中顺洁柔	104,440	2,329,012.00	0.18
81	603986	兆易创新	9,780	2,307,199.80	0.18
82	688008	澜起科技	22,554	2,293,290.72	0.18
83	000568	泸州老窖	24,900	2,268,888.00	0.18
84	600009	上海机场	31,200	2,248,584.00	0.17
85	300738	奥飞数据	36,900	2,128,392.00	0.17
86	600597	光明乳业	137,900	2,049,194.00	0.16
87	000858	五粮液	11,600	1,984,992.00	0.15
88	03690 HG	美团点评-W	11,900	1,868,542.00	0.15
89	300144	宋城演艺	107,840	1,865,632.00	0.15
90	000049	德赛电池	37,569	1,841,256.69	0.14
91	002332	仙琚制药	104,900	1,766,516.00	0.14
92	603136	天目湖	72,200	1,747,240.00	0.14
93	002859	洁美科技	58,020	1,739,439.60	0.14

94	600703	三安光电	69,300	1,732,500.00	0.13
95	603737	三棵树	18,760	1,730,047.20	0.13
96	002837	英维克	57,200	1,694,264.00	0.13
97	603338	浙江鼎力	21,960	1,663,909.20	0.13
98	300463	迈克生物	28,200	1,642,086.00	0.13
99	002572	索菲亚	67,700	1,636,309.00	0.13
100	002812	恩捷股份	24,700	1,625,260.00	0.13
101	300755	华致酒行	48,800	1,581,120.00	0.12
102	300408	三环集团	56,800	1,573,360.00	0.12
103	000625	长安汽车	141,700	1,558,700.00	0.12
104	002007	华兰生物	30,840	1,545,392.40	0.12
105	600127	金健米业	159,500	1,539,175.00	0.12
106	000951	中国重汽	46,837	1,464,124.62	0.11
107	600529	山东药玻	23,900	1,386,200.00	0.11
108	002138	顺络电子	54,700	1,364,765.00	0.11
109	603533	掌阅科技	33,500	1,277,355.00	0.10
110	603501	韦尔股份	6,000	1,211,700.00	0.09
111	300529	健帆生物	17,220	1,196,790.00	0.09
112	600585	海螺水泥	20,900	1,105,819.00	0.09
113	600720	祁连山	68,000	1,105,000.00	0.09
114	300347	泰格医药	10,625	1,082,475.00	0.08
115	002385	大北农	116,400	1,060,404.00	0.08
116	002916	深南电路	6,197	1,038,121.44	0.08
117	600183	生益科技	32,600	954,202.00	0.07
118	603707	健友股份	14,300	923,351.00	0.07
119	300782	卓胜微	2,160	876,463.20	0.07
120	601288	农业银行	231,700	783,146.00	0.06
121	603180	金牌厨柜	14,819	699,160.42	0.05
122	300661	圣邦股份	1,950	594,847.50	0.05
123	300630	普利制药	6,800	502,860.00	0.04
124	600038	中直股份	8,400	344,988.00	0.03
125	000661	长春高新	400	174,120.00	0.01
126	300124	汇川技术	3,700	140,563.00	0.01
127	603444	吉比特	200	109,802.00	0.01
128	002714	牧原股份	680	55,760.00	0.00
129	300014	亿纬锂能	1,141	54,596.85	0.00
130	600570	恒生电子	455	49,003.50	0.00
131	002821	凯莱英	200	48,600.00	0.00
132	603160	汇顶科技	200	44,580.00	0.00
133	300498	温氏股份	2,040	44,472.00	0.00
134	300136	信维通信	800	42,416.00	0.00
135	002304	洋河股份	400	42,056.00	0.00

136	300033	同花顺	300	39,924.00	0.00
137	600436	片仔癀	200	34,050.00	0.00
138	600763	通策医疗	200	33,354.00	0.00
139	601888	中国中免	200	30,806.00	0.00
140	300253	卫宁健康	1,300	29,822.00	0.00
141	600809	山西汾酒	200	29,000.00	0.00
142	002594	比亚迪	400	28,720.00	0.00
143	603939	益丰药房	280	25,480.00	0.00
144	603233	大参林	312	25,340.64	0.00
145	300433	蓝思科技	900	25,236.00	0.00
146	600745	闻泰科技	200	25,190.00	0.00
147	002460	赣锋锂业	400	21,428.00	0.00
148	002415	海康威视	700	21,245.00	0.00
149	600690	海尔智家	1,200	21,240.00	0.00
150	300142	沃森生物	400	20,944.00	0.00
151	603659	璞泰来	200	20,604.00	0.00
152	300454	深信服	100	20,596.00	0.00
153	603883	老百姓	200	20,008.00	0.00
154	002311	海大集团	400	19,036.00	0.00
155	000538	云南白药	200	18,762.00	0.00
156	603882	金城医学	200	17,900.00	0.00
157	002773	康弘药业	360	17,856.00	0.00
158	000938	紫光股份	400	17,192.00	0.00
159	300207	欣旺达	900	17,010.00	0.00
160	002439	启明星辰	400	16,828.00	0.00
161	300285	国瓷材料	500	16,755.00	0.00
162	600486	扬农化工	200	16,500.00	0.00
163	600016	民生银行	2,900	16,443.00	0.00
164	603019	中科曙光	420	16,128.00	0.00
165	000725	京东方 A	3,300	15,411.00	0.00
166	000596	古井贡酒	100	15,024.00	0.00
167	002230	科大讯飞	400	14,972.00	0.00
168	300316	晶盛机电	600	14,844.00	0.00
169	600132	重庆啤酒	200	14,600.00	0.00
170	002049	紫光国微	200	14,550.00	0.00
171	002008	大族激光	400	14,380.00	0.00
172	002179	中航光电	350	14,353.50	0.00
173	000423	东阿阿胶	400	14,324.00	0.00
174	002032	苏泊尔	200	14,200.00	0.00
175	603806	福斯特	280	13,974.80	0.00
176	300450	先导智能	300	13,863.00	0.00
177	600837	海通证券	1,100	13,838.00	0.00

178	603858	步长制药	470	13,559.50	0.00
179	600196	复星医药	400	13,540.00	0.00
180	600900	长江电力	700	13,258.00	0.00
181	600547	山东黄金	360	13,183.20	0.00
182	601877	正泰电器	500	13,175.00	0.00
183	300015	爱尔眼科	299	12,991.55	0.00
184	600332	白云山	400	12,932.00	0.00
185	002466	天齐锂业	560	12,852.00	0.00
186	300699	光威复材	200	12,546.00	0.00
187	601155	新城控股	400	12,496.00	0.00
188	002463	沪电股份	500	12,490.00	0.00
189	600779	水井坊	200	12,484.00	0.00
190	002414	高德红外	425	12,444.00	0.00
191	600563	法拉电子	200	12,360.00	0.00
192	600118	中国卫星	400	12,332.00	0.00
193	300024	机器人	900	12,303.00	0.00
194	002920	德赛西威	200	12,266.00	0.00
195	601211	国泰君安	700	12,082.00	0.00
196	002233	塔牌集团	1,000	12,030.00	0.00
197	000876	新希望	400	11,920.00	0.00
198	002241	歌尔股份	400	11,744.00	0.00
199	002001	新和成	400	11,640.00	0.00
200	603833	欧派家居	100	11,590.00	0.00
201	002925	盈趣科技	200	11,588.00	0.00
202	300115	长盈精密	500	11,425.00	0.00
203	300088	长信科技	1,000	11,200.00	0.00
204	300212	易华录	200	11,200.00	0.00
205	002607	中公教育	400	11,100.00	0.00
206	600999	招商证券	500	10,975.00	0.00
207	300058	蓝色光标	1,400	10,920.00	0.00
208	300251	光线传媒	1,000	10,910.00	0.00
209	601601	中国太保	400	10,900.00	0.00
210	300747	锐科激光	100	10,883.00	0.00
211	002050	三花智控	494	10,818.60	0.00
212	002690	美亚光电	200	10,520.00	0.00
213	300001	特锐德	500	10,470.00	0.00
214	300628	亿联网络	150	10,239.00	0.00
215	300017	网宿科技	1,200	10,188.00	0.00
216	002938	鹏鼎控股	200	10,012.00	0.00
217	600298	安琪酵母	200	9,896.00	0.00
218	300012	华测检测	500	9,880.00	0.00
219	002180	纳思达	300	9,873.00	0.00

220	601328	交通银行	1,900	9,747.00	0.00
221	300070	碧水源	1,200	9,744.00	0.00
222	300226	上海钢联	120	9,432.00	0.00
223	002555	三七互娱	200	9,360.00	0.00
224	601169	北京银行	1,900	9,310.00	0.00
225	000895	双汇发展	200	9,218.00	0.00
226	600340	华夏幸福	400	9,144.00	0.00
227	600161	天坛生物	200	9,066.00	0.00
228	000028	国药一致	200	9,002.00	0.00
229	002027	分众传媒	1,600	8,912.00	0.00
230	603228	景旺电子	252	8,867.88	0.00
231	300724	捷佳伟创	100	8,853.00	0.00
232	002368	太极股份	200	8,738.00	0.00
233	002250	联化科技	400	8,720.00	0.00
234	600104	上汽集团	500	8,495.00	0.00
235	300271	华宇软件	300	8,463.00	0.00
236	600660	福耀玻璃	400	8,348.00	0.00
237	600741	华域汽车	400	8,316.00	0.00
238	000513	丽珠集团	170	8,161.70	0.00
239	600511	国药股份	200	8,134.00	0.00
240	002271	东方雨虹	200	8,126.00	0.00
241	000063	中兴通讯	200	8,026.00	0.00
242	600885	宏发股份	200	8,024.00	0.00
243	000066	中国长城	600	7,920.00	0.00
244	601899	紫金矿业	1,800	7,920.00	0.00
245	601166	兴业银行	500	7,890.00	0.00
246	601066	中信建投	200	7,876.00	0.00
247	002153	石基信息	200	7,806.00	0.00
248	002044	美年健康	540	7,781.40	0.00
249	600516	方大炭素	1,238	7,774.64	0.00
250	002236	大华股份	400	7,684.00	0.00
251	603712	七一二	200	7,676.00	0.00
252	600739	辽宁成大	400	7,572.00	0.00
253	002065	东华软件	600	7,512.00	0.00
254	300418	昆仑万维	300	7,488.00	0.00
255	002242	九阳股份	200	7,454.00	0.00
256	600998	九州通	400	7,448.00	0.00
257	002601	龙蟠佰利	400	7,400.00	0.00
258	002456	欧菲光	400	7,356.00	0.00
259	601607	上海医药	400	7,352.00	0.00
260	000988	华工科技	300	7,329.00	0.00
261	600415	小商品城	1,500	7,305.00	0.00

262	300003	乐普医疗	200	7,304.00	0.00
263	601229	上海银行	880	7,304.00	0.00
264	002373	千方科技	300	7,197.00	0.00
265	601088	中国神华	500	7,180.00	0.00
266	300244	迪安诊断	200	7,060.00	0.00
267	600867	通化东宝	400	6,972.00	0.00
268	002558	巨人网络	400	6,960.00	0.00
269	300773	拉卡拉	200	6,954.00	0.00
270	600438	通威股份	400	6,952.00	0.00
271	002019	亿帆医药	300	6,891.00	0.00
272	000869	张裕A	200	6,830.00	0.00
273	300567	精测电子	100	6,825.00	0.00
274	600919	江苏银行	1,200	6,804.00	0.00
275	300474	景嘉微	100	6,730.00	0.00
276	601766	中国中车	1,200	6,684.00	0.00
277	600801	华新水泥	280	6,638.80	0.00
278	300168	万达信息	300	6,621.00	0.00
279	300073	当升科技	200	6,614.00	0.00
280	002831	裕同科技	240	6,602.40	0.00
281	002281	光迅科技	200	6,572.00	0.00
282	600760	中航沈飞	200	6,564.00	0.00
283	601231	环旭电子	300	6,552.00	0.00
284	600535	天士力	400	6,488.00	0.00
285	601788	光大证券	400	6,424.00	0.00
286	002268	卫士通	300	6,402.00	0.00
287	600177	雅戈尔	1,060	6,317.60	0.00
288	600028	中国石化	1,600	6,256.00	0.00
289	600729	重庆百货	200	6,244.00	0.00
290	000581	威孚高科	300	6,204.00	0.00
291	300618	寒锐钴业	100	6,202.00	0.00
292	603156	养元饮品	288	6,192.00	0.00
293	002028	思源电气	300	6,138.00	0.00
294	002739	万达电影	400	6,108.00	0.00
295	600004	白云机场	400	6,096.00	0.00
296	002709	天赐材料	180	6,082.20	0.00
297	000963	华东医药	240	6,072.00	0.00
298	000166	申万宏源	1,200	6,060.00	0.00
299	601138	工业富联	400	6,060.00	0.00
300	601966	玲珑轮胎	300	6,060.00	0.00
301	300616	尚品宅配	100	6,008.00	0.00
302	600259	广晟有色	200	6,000.00	0.00
303	002273	水晶光电	350	5,999.00	0.00

304	300666	江丰电子	100	5,968.00	0.00
305	002294	信立泰	200	5,932.00	0.00
306	300146	汤臣倍健	300	5,907.00	0.00
307	300010	豆神教育	300	5,871.00	0.00
308	300315	掌趣科技	800	5,864.00	0.00
309	601009	南京银行	800	5,864.00	0.00
310	600050	中国联通	1,200	5,808.00	0.00
311	600827	百联股份	400	5,780.00	0.00
312	300274	阳光电源	400	5,756.00	0.00
313	002387	维信诺	400	5,712.00	0.00
314	000776	广发证券	400	5,648.00	0.00
315	601390	中国中铁	1,100	5,522.00	0.00
316	600383	金地集团	400	5,480.00	0.00
317	600019	宝钢股份	1,200	5,472.00	0.00
318	600085	同仁堂	200	5,424.00	0.00
319	600372	中航电子	400	5,328.00	0.00
320	002653	海思科	200	5,322.00	0.00
321	002142	宁波银行	200	5,254.00	0.00
322	600977	中国电影	400	5,252.00	0.00
323	000061	农产品	700	5,187.00	0.00
324	002152	广电运通	400	5,176.00	0.00
325	002465	海格通信	400	5,176.00	0.00
326	603568	伟明环保	221	5,127.20	0.00
327	600352	浙江龙盛	400	5,116.00	0.00
328	600061	国投资本	400	5,092.00	0.00
329	600566	济川药业	200	5,092.00	0.00
330	300113	顺网科技	200	5,080.00	0.00
331	600862	中航高科	300	5,076.00	0.00
332	601225	陕西煤业	700	5,047.00	0.00
333	601857	中国石油	1,200	5,028.00	0.00
334	603355	莱克电气	200	4,978.00	0.00
335	603377	东方时尚	300	4,968.00	0.00
336	300166	东方国信	400	4,964.00	0.00
337	603868	飞科电器	100	4,933.00	0.00
338	603260	合盛硅业	180	4,921.20	0.00
339	002493	荣盛石化	400	4,920.00	0.00
340	600066	宇通客车	400	4,880.00	0.00
341	600195	中牧股份	300	4,869.00	0.00
342	300476	胜宏科技	200	4,810.00	0.00
343	601989	中国重工	1,200	4,800.00	0.00
344	600694	大商股份	200	4,798.00	0.00
345	601377	兴业证券	700	4,795.00	0.00

346	000997	新大陆	300	4,794.00	0.00
347	300457	赢合科技	150	4,782.00	0.00
348	600958	东方证券	500	4,745.00	0.00
349	600373	中文传媒	400	4,712.00	0.00
350	000975	银泰黄金	300	4,704.00	0.00
351	600893	航发动力	200	4,696.00	0.00
352	601933	永辉超市	500	4,690.00	0.00
353	000987	越秀金控	400	4,664.00	0.00
354	300369	绿盟科技	200	4,658.00	0.00
355	603650	彤程新材	200	4,654.00	0.00
356	300768	迪普科技	100	4,629.00	0.00
357	002745	木林森	300	4,623.00	0.00
358	600718	东软集团	400	4,600.00	0.00
359	002670	国盛金控	500	4,575.00	0.00
360	600109	国金证券	400	4,564.00	0.00
361	002736	国信证券	400	4,520.00	0.00
362	002191	劲嘉股份	500	4,455.00	0.00
363	601198	东兴证券	400	4,360.00	0.00
364	603198	迎驾贡酒	200	4,354.00	0.00
365	300674	宇信科技	100	4,315.00	0.00
366	600848	上海临港	200	4,294.00	0.00
367	601668	中国建筑	900	4,293.00	0.00
368	000786	北新建材	200	4,266.00	0.00
369	603877	太平鸟	300	4,260.00	0.00
370	002926	华西证券	400	4,252.00	0.00
371	000878	云南铜业	400	4,244.00	0.00
372	002127	南极电商	200	4,234.00	0.00
373	600000	浦发银行	400	4,232.00	0.00
374	601098	中南传媒	400	4,232.00	0.00
375	002422	科伦药业	200	4,200.00	0.00
376	000158	常山北明	400	4,176.00	0.00
377	600557	康缘药业	300	4,176.00	0.00
378	000547	航天发展	300	4,101.00	0.00
379	600909	华安证券	600	4,098.00	0.00
380	300078	思创医惠	300	4,059.00	0.00
381	600498	烽火通信	140	4,047.40	0.00
382	600167	联美控股	280	4,015.20	0.00
383	600640	号百控股	200	3,990.00	0.00
384	002202	金风科技	400	3,988.00	0.00
385	300188	美亚柏科	200	3,966.00	0.00
386	603000	人民网	200	3,966.00	0.00
387	601878	浙商证券	400	3,964.00	0.00

388	000400	许继电气	300	3,960.00	0.00
389	600886	国投电力	500	3,930.00	0.00
390	002500	山西证券	600	3,924.00	0.00
391	000970	中科三环	400	3,912.00	0.00
392	600637	东方明珠	400	3,860.00	0.00
393	300761	立华股份	100	3,854.00	0.00
394	300766	每日互动	100	3,806.00	0.00
395	601865	福莱特	200	3,760.00	0.00
396	600111	北方稀土	400	3,728.00	0.00
397	600674	川投能源	400	3,708.00	0.00
398	601985	中国核电	900	3,681.00	0.00
399	601360	三六零	200	3,662.00	0.00
400	002440	闰土股份	400	3,656.00	0.00
401	600060	海信视像	300	3,645.00	0.00
402	300296	利亚德	600	3,642.00	0.00
403	600029	南方航空	700	3,619.00	0.00
404	601698	中国卫通	200	3,602.00	0.00
405	601238	广汽集团	400	3,600.00	0.00
406	600926	杭州银行	400	3,568.00	0.00
407	600549	厦门钨业	300	3,552.00	0.00
408	000768	中航飞机	200	3,548.00	0.00
409	600655	豫园股份	400	3,544.00	0.00
410	601006	大秦铁路	500	3,520.00	0.00
411	600256	广汇能源	1,300	3,510.00	0.00
412	002024	苏宁易购	400	3,508.00	0.00
413	600188	兖州煤业	400	3,504.00	0.00
414	601398	工商银行	700	3,486.00	0.00
415	600329	中新药业	200	3,464.00	0.00
416	000488	晨鸣纸业	700	3,458.00	0.00
417	000778	新兴铸管	1,000	3,430.00	0.00
418	300180	华峰超纤	400	3,424.00	0.00
419	600884	杉杉股份	290	3,419.10	0.00
420	300682	朗新科技	200	3,404.00	0.00
421	600835	上海机电	200	3,386.00	0.00
422	600089	特变电工	500	3,385.00	0.00
423	002252	上海莱士	400	3,384.00	0.00
424	600580	卧龙电驱	300	3,372.00	0.00
425	000783	长江证券	500	3,370.00	0.00
426	600989	宝丰能源	400	3,368.00	0.00
427	000728	国元证券	400	3,360.00	0.00
428	601186	中国铁建	400	3,352.00	0.00
429	300203	聚光科技	200	3,346.00	0.00

430	300748	金力永磁	100	3,338.00	0.00
431	002110	三钢闽光	500	3,330.00	0.00
432	000967	盈峰环境	400	3,300.00	0.00
433	000025	特力A	180	3,299.40	0.00
434	001979	招商蛇口	200	3,288.00	0.00
435	002468	申通快递	200	3,282.00	0.00
436	600487	亨通光电	200	3,282.00	0.00
437	000656	金科股份	400	3,264.00	0.00
438	002673	西部证券	400	3,264.00	0.00
439	601555	东吴证券	400	3,264.00	0.00
440	000156	华数传媒	300	3,249.00	0.00
441	600271	航天信息	200	3,248.00	0.00
442	600380	健康元	200	3,248.00	0.00
443	600466	蓝光发展	600	3,234.00	0.00
444	002004	华邦健康	600	3,228.00	0.00
445	000157	中联重科	500	3,215.00	0.00
446	002038	双鹭药业	250	3,202.50	0.00
447	300068	南都电源	300	3,198.00	0.00
448	600639	浦东金桥	200	3,196.00	0.00
449	601838	成都银行	400	3,184.00	0.00
450	600316	洪都航空	200	3,160.00	0.00
451	002081	金螳螂	400	3,144.00	0.00
452	600482	中国动力	200	3,140.00	0.00
453	603328	依顿电子	300	3,129.00	0.00
454	000012	南玻A	620	3,112.40	0.00
455	600606	绿地控股	500	3,090.00	0.00
456	002048	宁波华翔	200	3,088.00	0.00
457	601869	长飞光纤	100	3,081.00	0.00
458	002375	亚厦股份	300	3,066.00	0.00
459	002602	世纪华通	200	3,062.00	0.00
460	600776	东方通信	200	3,018.00	0.00
461	600021	上海电力	400	2,960.00	0.00
462	600011	华能国际	700	2,954.00	0.00
463	600115	东方航空	700	2,954.00	0.00
464	600704	物产中大	700	2,947.00	0.00
465	601800	中国交建	400	2,936.00	0.00
466	600633	浙数文化	300	2,934.00	0.00
467	600376	首开股份	500	2,930.00	0.00
468	600064	南京高科	300	2,916.00	0.00
469	600100	同方股份	400	2,916.00	0.00
470	600233	圆通速递	200	2,912.00	0.00
471	001872	招商港口	200	2,910.00	0.00

472	601179	中国西电	600	2,904.00	0.00
473	300133	华策影视	400	2,900.00	0.00
474	601000	唐山港	1,300	2,899.00	0.00
475	603556	海兴电力	200	2,888.00	0.00
476	300170	汉得信息	300	2,886.00	0.00
477	002302	西部建设	300	2,880.00	0.00
478	600120	浙江东方	417	2,864.79	0.00
479	601997	贵阳银行	400	2,864.00	0.00
480	000690	宝新能源	600	2,832.00	0.00
481	601901	方正证券	400	2,832.00	0.00
482	600010	包钢股份	2,600	2,808.00	0.00
483	600795	国电电力	1,500	2,775.00	0.00
484	002945	华林证券	200	2,762.00	0.00
485	600572	康恩贝	500	2,750.00	0.00
486	601117	中国化学	500	2,740.00	0.00
487	603885	吉祥航空	300	2,730.00	0.00
488	000006	深振业 A	400	2,724.00	0.00
489	601928	凤凰传媒	400	2,720.00	0.00
490	002092	中泰化学	600	2,718.00	0.00
491	002411	延安必康	400	2,704.00	0.00
492	000090	天健集团	390	2,694.90	0.00
493	300741	华宝股份	73	2,692.24	0.00
494	300324	旋极信息	400	2,664.00	0.00
495	002212	南洋股份	100	2,658.00	0.00
496	000402	金融街	400	2,656.00	0.00
497	002936	郑州银行	770	2,648.80	0.00
498	600528	中铁工业	300	2,646.00	0.00
499	600062	华润双鹤	200	2,644.00	0.00
500	601200	上海环境	220	2,640.00	0.00
501	002544	杰赛科技	200	2,630.00	0.00
502	601808	中海油服	200	2,628.00	0.00
503	300459	金科文化	761	2,625.45	0.00
504	600273	嘉化能源	300	2,622.00	0.00
505	300257	开山股份	200	2,614.00	0.00
506	000060	中金岭南	700	2,604.00	0.00
507	002434	万里扬	300	2,604.00	0.00
508	002085	万丰奥威	400	2,592.00	0.00
509	002818	富森美	210	2,583.00	0.00
510	601998	中信银行	500	2,575.00	0.00
511	600733	北汽蓝谷	400	2,572.00	0.00
512	000960	锡业股份	300	2,568.00	0.00
513	002244	滨江集团	600	2,562.00	0.00

514	000671	阳光城	400	2,536.00	0.00
515	601939	建设银行	400	2,524.00	0.00
516	000723	美锦能源	400	2,504.00	0.00
517	601615	明阳智能	200	2,490.00	0.00
518	002408	齐翔腾达	400	2,484.00	0.00
519	601600	中国铝业	900	2,484.00	0.00
520	002939	长城证券	200	2,464.00	0.00
521	600350	山东高速	400	2,456.00	0.00
522	300038	数知科技	300	2,448.00	0.00
523	600299	安迪苏	200	2,444.00	0.00
524	601988	中国银行	700	2,436.00	0.00
525	000069	华侨城A	400	2,424.00	0.00
526	300098	高新兴	400	2,424.00	0.00
527	601669	中国电建	700	2,422.00	0.00
528	603486	科沃斯	80	2,416.80	0.00
529	300182	捷成股份	600	2,394.00	0.00
530	600643	爱建集团	300	2,385.00	0.00
531	002444	巨星科技	200	2,376.00	0.00
532	600649	城投控股	400	2,376.00	0.00
533	000703	恒逸石化	260	2,373.80	0.00
534	000425	徐工机械	400	2,364.00	0.00
535	600737	中粮糖业	300	2,334.00	0.00
536	600881	亚泰集团	800	2,328.00	0.00
537	002128	露天煤业	300	2,325.00	0.00
538	601168	西部矿业	400	2,320.00	0.00
539	600369	西南证券	500	2,295.00	0.00
540	601881	中国银河	200	2,294.00	0.00
541	600522	中天科技	200	2,290.00	0.00
542	600435	北方导航	300	2,268.00	0.00
543	600820	隧道股份	400	2,260.00	0.00
544	601618	中国中冶	900	2,259.00	0.00
545	600221	海航控股	1,500	2,250.00	0.00
546	600663	陆家嘴	200	2,242.00	0.00
547	600823	世茂股份	500	2,235.00	0.00
548	000027	深圳能源	480	2,227.20	0.00
549	300634	彩讯股份	100	2,223.00	0.00
550	600338	西藏珠峰	220	2,200.00	0.00
551	600022	山东钢铁	1,700	2,193.00	0.00
552	002010	传化智联	400	2,176.00	0.00
553	002625	光启技术	300	2,175.00	0.00
554	002416	爱施德	300	2,154.00	0.00
555	600170	上海建工	700	2,149.00	0.00

556	300072	三聚环保	500	2,140.00	0.00
557	601828	美凯龙	200	2,118.00	0.00
558	600392	盛和资源	300	2,115.00	0.00
559	000883	湖北能源	600	2,112.00	0.00
560	600928	西安银行	400	2,104.00	0.00
561	000848	承德露露	300	2,100.00	0.00
562	601689	拓普集团	75	2,092.50	0.00
563	600208	新湖中宝	700	2,086.00	0.00
564	000627	天茂集团	400	2,084.00	0.00
565	600901	江苏租赁	400	2,084.00	0.00
566	600673	东阳光	300	2,073.00	0.00
567	601880	大连港	1,200	2,064.00	0.00
568	000729	燕京啤酒	300	2,055.00	0.00
569	601108	财通证券	200	2,050.00	0.00
570	600765	中航重机	200	2,044.00	0.00
571	600782	新钢股份	500	2,040.00	0.00
572	601811	新华文轩	200	2,034.00	0.00
573	600500	中化国际	400	2,024.00	0.00
574	601727	上海电气	400	2,016.00	0.00
575	600705	中航资本	500	1,980.00	0.00
576	600903	贵州燃气	200	1,968.00	0.00
577	600565	迪马股份	700	1,953.00	0.00
578	000983	西山煤电	520	1,950.00	0.00
579	000559	万向钱潮	400	1,936.00	0.00
580	000528	柳工	300	1,893.00	0.00
581	300377	赢时胜	200	1,868.00	0.00
582	000681	视觉中国	100	1,862.00	0.00
583	002372	伟星新材	160	1,860.80	0.00
584	000718	苏宁环球	600	1,854.00	0.00
585	601958	金钼股份	300	1,854.00	0.00
586	600489	中金黄金	200	1,828.00	0.00
587	600219	南山铝业	900	1,827.00	0.00
588	600777	新潮能源	1,200	1,824.00	0.00
589	600583	海油工程	400	1,820.00	0.00
590	600141	兴发集团	200	1,790.00	0.00
591	601818	光大银行	500	1,790.00	0.00
592	600642	申能股份	300	1,773.00	0.00
593	600875	东方电气	200	1,770.00	0.00
594	000008	神州高铁	600	1,764.00	0.00
595	600388	龙净环保	200	1,760.00	0.00
596	600787	中储股份	400	1,756.00	0.00
597	002203	海亮股份	200	1,750.00	0.00

598	002423	中粮资本	200	1,740.00	0.00
599	000630	铜陵有色	900	1,737.00	0.00
600	601919	中远海控	500	1,735.00	0.00
601	600027	华电国际	500	1,710.00	0.00
602	601678	滨化股份	400	1,696.00	0.00
603	000686	东北证券	200	1,690.00	0.00
604	600348	阳泉煤业	400	1,688.00	0.00
605	600018	上港集团	400	1,680.00	0.00
606	601975	招商南油	700	1,673.00	0.00
607	000301	东方盛虹	300	1,668.00	0.00
608	601801	皖新传媒	300	1,668.00	0.00
609	300222	科大智能	200	1,622.00	0.00
610	002146	荣盛发展	200	1,620.00	0.00
611	600153	建发股份	200	1,620.00	0.00
612	000543	皖能电力	400	1,608.00	0.00
613	600297	广汇汽车	500	1,595.00	0.00
614	601577	长沙银行	200	1,588.00	0.00
615	600970	中材国际	300	1,584.00	0.00
616	002013	中航机电	200	1,580.00	0.00
617	300376	易事特	300	1,560.00	0.00
618	002266	浙富控股	400	1,548.00	0.00
619	600623	华谊集团	300	1,548.00	0.00
620	603766	隆鑫通用	400	1,548.00	0.00
621	600317	营口港	700	1,547.00	0.00
622	601633	长城汽车	200	1,544.00	0.00
623	000685	中山公用	200	1,540.00	0.00
624	600428	中远海特	500	1,540.00	0.00
625	600664	哈药股份	500	1,540.00	0.00
626	002491	通鼎互联	300	1,536.00	0.00
627	000031	大悦城	300	1,527.00	0.00
628	002948	青岛银行	300	1,527.00	0.00
629	601898	中煤能源	400	1,520.00	0.00
630	600025	华能水电	400	1,516.00	0.00
631	600507	方大特钢	288	1,494.72	0.00
632	600017	日照港	600	1,494.00	0.00
633	000563	陕国投 A	400	1,484.00	0.00
634	603025	大豪科技	200	1,454.00	0.00
635	000039	中集集团	200	1,446.00	0.00
636	000766	通化金马	300	1,446.00	0.00
637	000709	河钢股份	700	1,428.00	0.00
638	600917	重庆燃气	200	1,428.00	0.00
639	601018	宁波港	400	1,428.00	0.00

640	600390	五矿资本	200	1,412.00	0.00
641	000629	攀钢钒钛	700	1,407.00	0.00
642	600023	浙能电力	400	1,404.00	0.00
643	600409	三友化工	300	1,398.00	0.00
644	600307	酒钢宏兴	900	1,386.00	0.00
645	000598	兴蓉环境	300	1,380.00	0.00
646	000825	太钢不锈	400	1,328.00	0.00
647	601111	中国国航	200	1,322.00	0.00
648	601139	深圳燃气	200	1,300.00	0.00
649	601866	中远海发	700	1,288.00	0.00
650	601216	君正集团	500	1,270.00	0.00
651	601019	山东出版	200	1,250.00	0.00
652	601611	中国核建	200	1,236.00	0.00
653	601992	金隅集团	400	1,224.00	0.00
654	601162	天风证券	200	1,212.00	0.00
655	600006	东风汽车	300	1,209.00	0.00
656	600008	首创股份	400	1,204.00	0.00
657	000415	渤海租赁	400	1,192.00	0.00
658	600068	葛洲坝	200	1,190.00	0.00
659	601001	大同煤业	300	1,176.00	0.00
660	600398	海澜之家	200	1,164.00	0.00
661	600039	四川路桥	300	1,146.00	0.00
662	601298	青岛港	200	1,136.00	0.00
663	600098	广州发展	200	1,098.00	0.00
664	000413	东旭光电	400	1,068.00	0.00
665	601016	节能风电	500	1,060.00	0.00
666	603077	和邦生物	800	1,056.00	0.00
667	601005	重庆钢铁	700	1,043.00	0.00
668	601212	白银有色	400	1,020.00	0.00
669	002482	广田集团	300	1,005.00	0.00
670	600863	内蒙华电	400	984.00	0.00
671	000932	华菱钢铁	260	980.20	0.00
672	600277	亿利洁能	300	978.00	0.00
673	601969	海南矿业	200	976.00	0.00
674	000761	本钢板材	300	960.00	0.00
675	600545	卓郎智能	200	946.00	0.00
676	600968	海油发展	400	932.00	0.00
677	600335	国机汽车	200	924.00	0.00
678	002958	青农商行	200	886.00	0.00
679	600582	天地科技	300	879.00	0.00
680	000898	鞍钢股份	350	857.50	0.00
681	601106	中国一重	300	843.00	0.00

682	600657	信达地产	200	824.00	0.00
683	600869	智慧能源	200	800.00	0.00
684	600939	重庆建工	200	718.00	0.00
685	601608	中信重工	200	684.00	0.00
686	600339	中油工程	300	681.00	0.00
687	601333	广深铁路	300	675.00	0.00
688	000860	顺鑫农业	10	569.80	0.00
689	601326	秦港股份	200	502.00	0.00
690	600750	江中药业	30	379.20	0.00
691	600266	城建发展	72	365.04	0.00
692	000062	深圳华强	25	363.50	0.00
693	000009	中国宝安	40	340.40	0.00
694	600717	天津港	72	318.24	0.00
695	002807	江阴银行	80	314.40	0.00
696	603225	新凤鸣	20	199.60	0.00
697	002195	二三四五	40	112.40	0.00
698	600971	恒源煤电	20	91.40	0.00
699	600240	华业资本	200	82.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	600362	江西铜业	18,419,470.00	1.43
2	000651	格力电器	18,353,772.00	1.43
3	600036	招商银行	17,528,347.67	1.36
4	600426	华鲁恒升	17,203,036.32	1.34
5	600176	中国巨石	15,189,095.20	1.18
6	600547	山东黄金	14,651,371.55	1.14
7	00700	腾讯控股	14,392,364.89	1.12
8	002078	太阳纸业	13,779,937.60	1.07
9	000977	浪潮信息	13,600,552.24	1.06
10	601636	旗滨集团	13,375,364.59	1.04
11	600309	万华化学	13,180,676.53	1.03
12	600612	老凤祥	12,566,513.56	0.98
13	603899	晨光文具	12,347,023.62	0.96
14	002120	韵达股份	12,225,151.30	0.95
15	600754	锦江酒店	11,954,727.00	0.93
16	600887	伊利股份	11,695,434.00	0.91
17	601628	中国人寿	11,693,799.00	0.91
18	002508	老板电器	11,434,388.00	0.89

19	002367	康力电梯	11,216,055.68	0.87
20	600346	恒力股份	11,004,146.78	0.86

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	601636	旗滨集团	16,516,375.00	1.28
2	600547	山东黄金	14,306,362.97	1.11
3	603043	广州酒家	11,533,269.03	0.90
4	600036	招商银行	10,830,522.53	0.84
5	600426	华鲁恒升	9,968,358.00	0.78
6	600176	中国巨石	9,695,314.00	0.75
7	600600	青岛啤酒	9,341,205.00	0.73
8	300144	宋城演艺	8,777,529.80	0.68
9	600309	万华化学	8,519,292.00	0.66
10	002697	红旗连锁	8,517,379.23	0.66
11	600362	江西铜业	8,313,642.00	0.65
12	603187	海容冷链	8,238,834.05	0.64
13	002422	科伦药业	7,816,652.19	0.61
14	601601	中国太保	7,237,076.00	0.56
15	600346	恒力石化	7,235,048.59	0.56
16	002078	太阳纸业	7,049,118.01	0.55
17	600585	海螺水泥	6,878,121.42	0.54
18	000157	中联重科	6,791,657.44	0.53
19	601688	华泰证券	6,633,270.00	0.52
20	600754	锦江酒店	6,628,932.00	0.52

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	1,004,983,076.66
卖出股票收入（成交）总额	719,367,042.26

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	211,891,101.00	16.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	68,887,500.00	5.36
	其中：政策性金融债	68,887,500.00	5.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	280,778,601.00	21.84

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	200004	20 付息国债 04	1,700,000	164,866,000.00	12.82
2	019627	20 国债 01	450,000	45,022,500.00	3.50
3	018007	国开 1801	390,000	39,058,500.00	3.04
4	200205	20 国开 05	300,000	29,829,000.00	2.32
5	019547	16 国债 19	21,100	2,002,601.00	0.16

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策
无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

无。

7.12.2

无。

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	766,540.52
2	应收证券清算款	76,215.78
3	应收股利	82,029.44
4	应收利息	3,726,606.60
5	应收申购款	9,729,495.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,380,888.20

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	-	-	-	-

无。

7.12.5 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 (%)
中金安心回报 A 类份额	5,539	125,228.53	43,774,262.57	6.31	649,866,560.28	93.69
中金安心回报 C 类份额	2,484	132,385.18	45,804,525.54	13.93	283,040,271.20	86.07
合计	8,023	127,444.30	89,578,788.11	8.76	932,906,831.48	91.24

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	中金安心回报 A 类份额	615,914.27	0.09
	中金安心回报 C 类份额	0.00	0.0
	合计	615,914.27	0.06

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	中金安心回报 A 类份额	>=100
	中金安心回报 C 类份额	0
	合计	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	中金安心回报 A 类份额	10~50
	中金安心回报 C 类份额	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额
----	--------------	--------------

基金合同生效日 (2020 年 4 月 30 日) 基金份额总额	177,701,315.63	-
基金合同生效日 起至报告期期末 基金总申购份额	634,226,116.17	445,139,116.07
减: 基金合同生效 日起至报告期期 末基金总赎回份 额	118,286,608.95	116,294,319.33
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	693,640,822.85	328,844,796.74

§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。

本报告期内, 本基金托管人 2020 年 3 月 10 日发布公告, 陈秀良先生自 2020 年 3 月 10 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部总经理。本基金托管人已将上述变更事项报相关监管部门备案。

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）。

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	1,724,350,118.92	100.00%	745,341.60	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	67,152,461.30	100.00%	5,225,000,000.00	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	关于中金安心回报集合资产管理计划变更为中金安心回报灵活配置混合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 30 日
2	中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划基金开放日常申购（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 5 月 11 日
3	中国国际金融股份有限公司关于中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划托管费率调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 6 月 19 日
4	关于新增上海浦东发展银行股份有限公司为中金安心回报灵活配置混合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

注：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) 关于准予中金安心回报集合资产管理计划合同变更的回函
- (二) 中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书
- (四) 中金安心回报灵活配置混合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