

中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵  
活配置混合型集合资产管理计划  
2020 年年度报告

基金管理人：中国国际金融股份有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 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及董事保证本报告中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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期自 2020 年 9 月 17 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
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	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	42
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	54
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	55
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	55
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	55
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
8.12 投资组合报告附注 .....	55
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>56</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	57
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>57</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>58</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
11.4 基金投资策略的改变 .....	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
11.8 其他重大事件 .....	59
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>60</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	60
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
13.1 备查文件目录 .....	60
13.2 存放地点 .....	61
13.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划	
基金简称	集合-中金汇越定开	
基金主代码	920012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 9 月 17 日	
基金管理人	中国国际金融股份有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	253,531,586.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	集合-中金汇越定开 A	集合-中金汇越定开 C
下属分级基金的交易代码	920012	920926
报告期末下属分级基金的份额总额	175,233,123.97 份	78,298,462.34 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	利用定量投资模型，灵活应用多种策略对冲投资组合的市场风险，谋求投资组合资产的长期增值，以期实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本集合计划根据沪深 300 股指期货当月及下月合约基差情况灵活调整股票资产的配置比例。</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>在力求有效控制投资风险的前提下，通过全市场选股构建预期收益高于市场回报的投资组合，同时利用股指期货等对冲工具对冲投资组合的市场风险，以求获得不依赖市场整体走向的比较稳定的长期资产增值。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本集合计划将保持适当的流动性，方便投资人安排投资，在遵守本集合计划有关投资限制与投资比例的前提下，将适当增加高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
业绩比较基准	<p>本集合计划的业绩比较基准为一年期金融机构人民币存款基准利率。</p> <p>本集合计划为以量化对冲为投资基础，主要市场风险已通过对冲策略剥离，收益特征为追求稳健的绝对收益，与股票市场市场和债券市场的走势相关性低，因此，选取一年期金融机构人民币存款基准利率作为本集合计划的业绩比较基准。</p> <p>在每个封闭期首日至下一个开放期的最后一日，适用的业绩比较基准为该封闭期首日（若为首个封闭期，则为集合计划合同生效</p>

	日) 中国人民银行公布并执行的一年期金融机构人民币存款基准利率。
风险收益特征	本集合计划为特殊的灵活配置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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	宋璐芳	徐静
	联系电话	010-65051166	4006800000
	电子邮箱	songlf@cicc.com.cn	xjing@citicbank.com
客户服务电话		010-65050105	95558
传真		010-65058035	010-85230024
注册地址		北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		北京朝阳区建国门外大街 1 号国贸 3 期 B 座 42 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100004	100020
法定代表人		沈如军	李庆萍

### 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cicc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 9 月 17 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日	
	集合-中金汇越定开 A	集合-中金汇越定开 C
本期已实现收益	-1,292,954.84	-696,582.44
本期利润	-8,199,538.73	-4,244,934.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0471	-0.0489

本期加权平均 净值利润率	-4.44%	-4.62%
本期基金份额 净值增长率	-4.09%	-4.35%
3.1.2 期末数 据和指标	2020 年末	
期末可供分配 利润	6,101,170.88	2,614,373.47
期末可供分配 基金份额利润	0.0348	0.0334
期末基金资产 净值	181,334,294.85	80,912,835.81
期末基金份额 净值	1.0348	1.0334
3.1.3 累计期 末指标	2020 年末	
基金份额累计 净值增长率	-4.09%	-4.35%

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

集合-中金汇越定开 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
过去三个月	-4.19%	0.20%	0.38%	0.01%	-4.57%	0.19%
自基金合同生效起 至今	-4.09%	0.19%	0.44%	0.01%	-4.53%	0.18%

集合-中金汇越定开 C

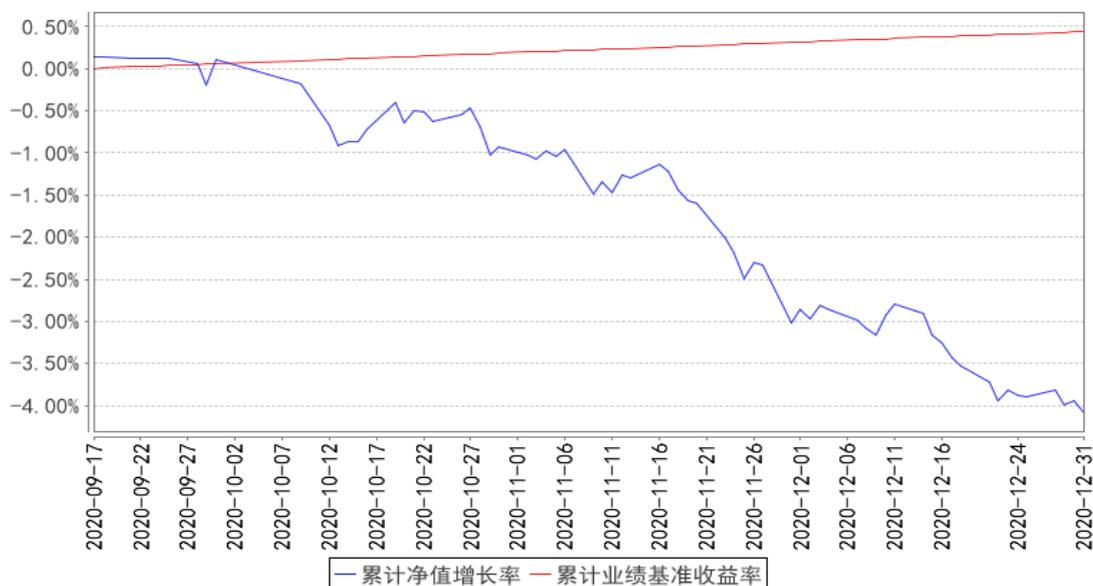
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.31%	0.20%	0.38%	0.01%	-4.69%	0.19%
自基金合同生效起至今	-4.35%	0.19%	0.44%	0.01%	-4.79%	0.18%

注：1、本基金基金合同于 2020 年 9 月 17 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

集合-中金汇越定开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



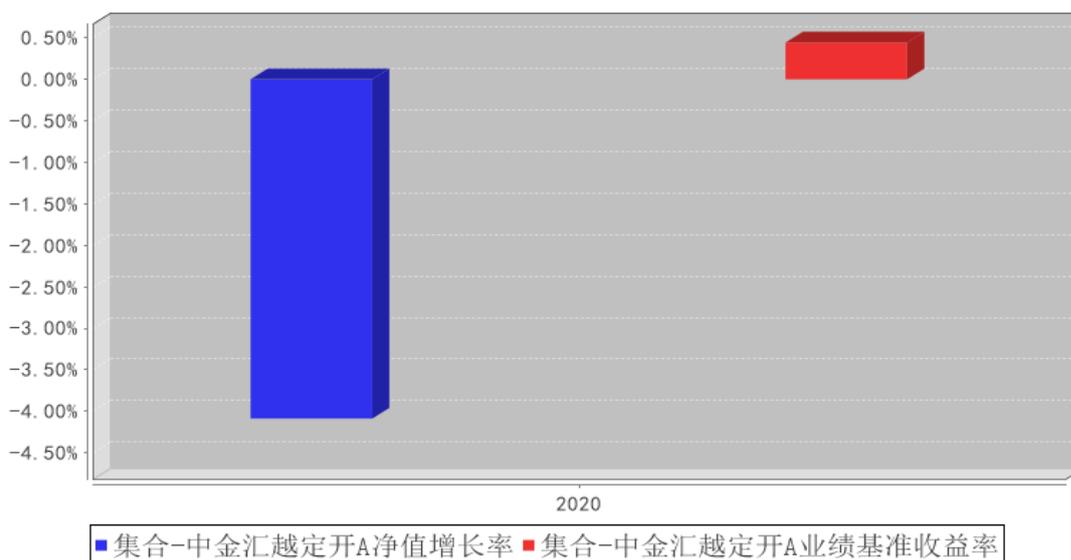
集合-中金汇越定开C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



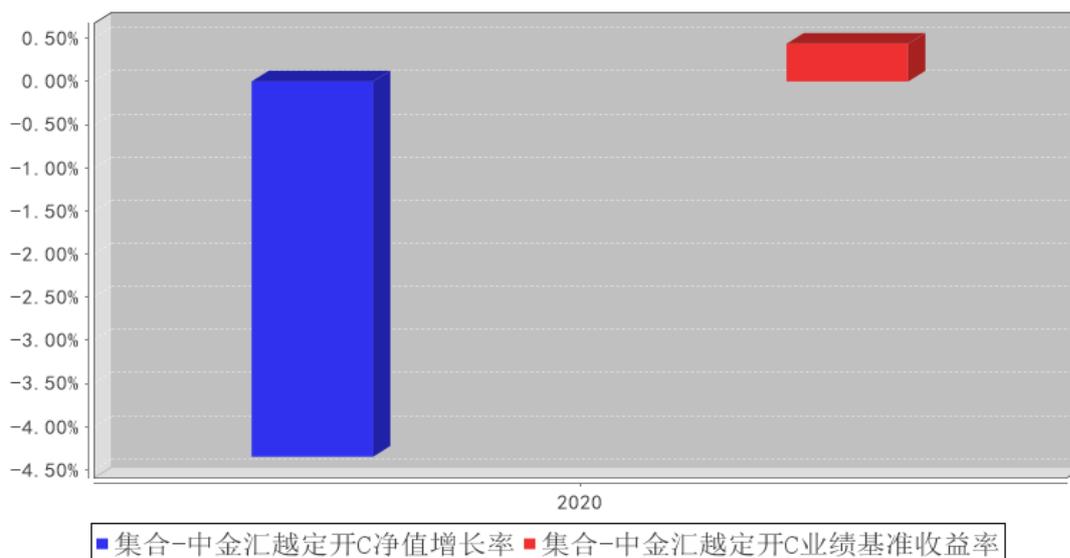
注：2020年9月17日中金汇越量化对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划C类基金份额为零。

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

集合-中金汇越定开A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



集合-中金汇越定开C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：报告期间无利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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12月31日，旗下已有六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、中金精选股票型集合资产管理计划、中金汇越量化对冲 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划、中金进取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		
方圆	本基金的基金经理	2019 年 11 月 8 日	-	4	北京大学数学学院数学与应用数学专业，学士、硕士。任中金公司资产管理部投资经理、副总经理，曾任职于中金公司量化分析组、固定收益部，及海外对冲基金。具有丰富的量化投研经验，投资业绩出色，投资风格稳健均衡。对股票、债券、商品及衍生品的量化投资均有深入研究。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《公平交易监控方案》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合

能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过交易组集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以管理人名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

本基金于 2020 年 9 月转公，9 月底开始运作，截至年底，市场延续上涨态势，后期抱团现象显著。资金抱团导致部分行业动量效应明显，有色、电新和食品饮料强势上涨，共 5 个行业涨幅超过 20%，12 个行业超过 10%；传媒和综合金融逆势下跌，跌幅超过 10%。风格因子中，动量、非线性市值因子溢价显著，达到 3.78%和-4.92%。

产品运作中，采用做多股票组合、做空股指期货的方式构造市场中性组合，其中股票组合通过统计套利量化选股策略构建，控制与基准指数的行业、风格、个股偏离及跟踪误差，目标为在跟踪指数的基础上获取超额收益，同时采用做空股指期货的方式，对冲掉基准指数的涨跌。在此构架下，产品收益可拆分为几部分：

产品收益 = 股票组合相对指数的超额收益 (alpha) - 股指期货基差贴水 (对冲成本) - 固定费用 (管理费、托管费等)

在股票组合构建过程中，严格控制其相对于股指期货所对应标的指数的偏离，包括行业偏离、风格偏离、个股偏离、跟踪误差等，选股超额收益来自于行业内选股，而且对市场、行业、风格的择时。在本报告期末，账户股票持仓行业分布与指数行业分布相差未超过 1.5%，风格偏离（市

值、估值、流动性指标等)与指数风格均值相差未超过 0.05。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日,本基金 A 类基金份额净值为 1.0348 元,份额累计净值为 1.2718 元,本基金 C 类基金份额净值为 1.0334 元,份额累计净值为 1.0334 元。报告期内,本基金 A 类基金份额净值增长率为-4.09%,同期业绩基准增长率 0.44%,本基金 C 类基金份额净值增长率为-4.35%,同期业绩基准增长率 0.44%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来关注市场情绪面、流动性变化等结构行情带来的超额机会,同时监控宏观基本面以及产业政策,对市场存在的预期差信息与模型相结合。同时推进上市公司负面信息研究,量化控制股票特质风险。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作,强化制度完善及对制度执行情况的监督检查,相关主要工作如下:1)紧密跟踪并组织落实法律法规、自律规则及监管要求,不断完善基金运作管理内部制度建设,促进依法合规展业;2)研究、投资交易方面,围绕内幕交易、利用未公开信息交易等重点防范的违法违规行为 and 各项最新监管要求,开展合规培训,进一步提高员工合规守法意识。3)营销与销售方面,持续对基金宣传推介材料、销售服务协议等材料文件进行合规审查,定期开展投资者适当性培训及销售业务专项培训,加强销售行为管理。4)基金运作保障方面,持续为注册登记、基金会计、资金清算等业务提供合规咨询,适时开展合规检查,为基金运营安全提供法律合规支持。5)信息披露方面,严格落实《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定,更新信息披露工作流程,认真做好本基金的信息披露工作,确保信息披露内容的真实、准确、完整、及时、规范。6)以中国证监会《季度监察稽核项目表》为基础,对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查,同时有重点地开展定期不定期的合规检查、内部稽核,促进公司合规运作。报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规,内部控制和风险防范措施不断完善,坚持维护基金份额持有人合法权益。本基金管理人将继续从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益,提高监察稽核工作的有效性。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《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，对中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划 2020 年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，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

本托管人认为，管理人中国国际金融股份有限公司在中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，管理人中国国际金融股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2020 年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(21)第 P01090 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划(以下简称“中金汇越定开”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年 9 月 17 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照财务报表附注二所述编制基础编制,公允反映了中金汇越定开 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 9 月 17 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中金汇越定开,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	我们提醒财务报表使用者关注财务报表附注二对编制基础的说明。中金汇越定开财务报表仅为满足监管合规要求之财务信息披露目的而编制,因此该财务报表可能不适用于其他用途。我们的报告仅用于上述目的,未经本所书面同意,不得用于其他任何目的。本段内容不影响已发表的审计意见。
其他事项	-
其他信息	中国国际金融股份有限公司(以下简称“基金管理人”)对其他信息负责。其他信息包括中金汇越定开年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人负责评估基金的持续经营能

	<p>力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人计划清算中金汇越定开、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中金汇越定开不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人就中金汇越定开的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	马晓波   韩云飞
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
审计报告日期	2021 年 03 月 29 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	1,077,959.60
结算备付金		16,536,463.52
存出保证金		18,120,902.78
交易性金融资产	7.4.7.2	129,345,019.59
其中：股票投资		129,343,019.59
基金投资		-
债券投资		2,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	98,701,169.61
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	-24,065.44
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		263,757,449.66
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		37,177.81
应付赎回款		-
应付管理人报酬		339,754.33
应付托管费		33,975.45
应付销售服务费		35,480.99
应付交易费用	7.4.7.7	296,991.82
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	766,938.60
负债合计		1,510,319.00
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	253,531,586.31
未分配利润	7.4.7.10	8,715,544.35
所有者权益合计		262,247,130.66
负债和所有者权益总计		263,757,449.66

注：1. 报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 253,531,586.31 份，其中 A 类基金份额净值 1.0348 元，基金份额总额 175,233,123.97 份；C 类基金份额净值 1.0334 元，基金份额总额 78,298,462.34 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 9 月 17 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。截至报告期末，本基金变更后的合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 9 月 17 日（基金合同 生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		-9,461,934.49
1. 利息收入		694,529.91
其中：存款利息收入	7.4.7.11	120,584.96
债券利息收入		18.05
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		573,926.90
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		220,172.15
其中：股票投资收益	7.4.7.12	6,332,126.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	33,783.01
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-6,226,084.66

股利收益	7.4.7.16	80,347.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-10,454,935.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	78,299.13
减：二、费用		2,982,538.47
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,208,806.17
2. 托管费	7.4.10.2.2	120,880.63
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	133,186.66
4. 交易费用	7.4.7.19	1,357,763.08
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		4,253.53
7. 其他费用	7.4.7.20	157,648.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,444,472.96
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,444,472.96

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	14,296,284.98	1,127,900.33	15,424,185.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,444,472.96	-12,444,472.96
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）	239,235,301.33	20,032,116.98	259,267,418.31
其中：1. 基金申购款	268,656,459.87	21,417,657.42	290,074,117.29
2. 基金赎回款	-29,421,158.54	-1,385,540.44	-30,806,698.98
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）	253, 531, 586. 31	8, 715, 544. 35	262, 247, 130. 66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告（序号）从 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划(以下简称“本基金”)由中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划变更而来。中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2010 年 8 月 9 日经中国证监会证监许可[2010]1080 号文核准设立，自 2010 年 11 月 15 日起开始募集，于 2010 年 12 月 24 日结束募集工作，并于 2010 年 12 月 29 日正式成立。由中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)、中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)作为推广机构，自 2010 年 11 月 15 日至 2010 年 12 月 24 日进行推广。中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划于 2010 年 12 月 29 日成立，成立之日集合计划实收份额为 300, 188, 991. 28 份（含利息转份额 159, 856. 20 份），发行价格为人民币 1. 00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所审验并出具验资报告。中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划于 2015 年 12 月 7 日发布了《关于中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划法律文件变更的公告》，名称由“中金消费指数集合资产管理计划”变更为“中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划”。

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，中金中铭量化对冲 1 号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 9 月 17 日起，《中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

本基金自基金合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本基金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(含

国债、地方政府债、金融债、公司债、企业债、公开发行次级债、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券以及中国证监会允许投资的其他债券)、股指期货、股票期权、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、现金等,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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资融券业务。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。基金的投资组合比例为:权益类资产占基金资产比例为 0%-85%,权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值,占基金资产净值比例范围 0%-10%。其中:权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值;权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值。开放期内,每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%封闭期内,可不受前述 5%的限制。本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第(一)项、第(三)项、第(五)项及第(七)项的限制。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。本基金的业绩比较基准为一年期金融机构人民币存款基准利率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

为满足监管合规要求之财务信息披露目的,本基金管理人的管理层编制了本财务报表。本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时在财务报表编制、具体会计核算和信息披露方面也遵循了中国证监会及中国证券投资基金业协会发布的关于证券投资基金财务报表编制的有关规定。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表按照 7.4.2 所述的编制基础编制,真实、完整地反映了按该编制基础列报的本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 9 月 17 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 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 9 月 17 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求, 本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项, 暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。本基金目前持有的分类为以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。其他金融资产划分为贷款和应收款项。

##### (2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求, 本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。其他金融负债主要包括各类应付款项。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 于交易日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; 支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息, 单独确认为应收项目。贷款及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。

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, 公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益; 贷款和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。

满足以下条件之一的金融资产, 予以最终确认: (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, 且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方; (3) 该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的, 才能终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额总额所对应的金额。申购、赎回及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日确认。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算确认。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

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的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

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。

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。

公允价值变动净收益/(损失)核算基金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。

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。

分红收益按宣告的分红比例计算的金额确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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确认。

投资交易时发生的交易费用于交易日确认并作为基金费用计入当期损益。

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。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

现金分红；

(3) 基金收益分配后基金净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(5) 由于本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额收取销售服务费，各类份额对应的可供分配利润将有所不同；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(7) 在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，无需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则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：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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。

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。

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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

本基金目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款,主要税项列示如下:

(1) 根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》,2018年1月1日起,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税;对资管产品在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分别按照资管产品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) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金从事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) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
活期存款	1,077,959.60
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	1,077,959.60

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	123,675,516.63	129,343,019.59	5,667,502.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,000.00	2,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	2,000.00	2,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	123,677,516.63	129,345,019.59	5,667,502.96

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-112,004,944.66	-	-	-
其中：股指期货投资	-112,004,944.66	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-112,004,944.66	-	-	-

注：1：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相

关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

于 2020 年 12 月 31 日, 本基金持有的股指期货合约情况如下:

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2103	沪深 300 期货 2103 合约	-82.00	-128,205,360.00	-16,200,415.34
减: 可抵销期货暂收款				-16,200,415.34
股指期货投资净额				-

注 2: 买入持仓量以正数表示, 卖出持仓量以负数表示。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中: 买断式逆回购
交易所市场	98,701,169.61	-
银行间市场	-	-
合计	98,701,169.61	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注: 无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	505.19
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	7,661.81
应收债券利息	0.04
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-32,317.73
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	85.25
合计	-24,065.44

#### 7.4.7.6 其他资产

注: 无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	296,991.82
银行间市场应付交易费用	-
合计	296,991.82

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	160,000.00
代扣代缴个人所得税	606,938.60
合计	766,938.60

注：代扣代缴个人所得税为原中金中铭量化对冲 1 号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。

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 集合-中金汇越定开 A

项目	本期 2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	14,296,284.98	14,296,284.98
本期申购	173,333,620.22	173,333,620.22
本期赎回（以“-”号填列）	-12,396,781.23	-12,396,781.23
-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	175,233,123.97	175,233,123.97

## 集合-中金汇越定开 C

项目	本期 2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	95,322,839.65	95,322,839.65
本期赎回（以“-”号填列）	-17,024,377.31	-17,024,377.31
-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	78,298,462.34	78,298,462.34

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

集合-中金汇越定开 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	8,779,440.38	-7,651,540.05	1,127,900.33
本期利润	-1,292,954.84	-6,906,583.89	-8,199,538.73
本期基金份额交易产生的变动数	98,126,025.79	-84,953,216.51	13,172,809.28
其中：基金申购款	105,666,496.95	-91,904,580.18	13,761,916.77
基金赎回款	-7,540,471.16	6,951,363.67	-589,107.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	105,612,511.33	-99,511,340.45	6,101,170.88

集合-中金汇越定开 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	-696,582.44	-3,548,351.79	-4,244,934.23
本期基金份额交易产生的变动数	6,333,450.52	525,857.18	6,859,307.70
其中：基金申购款	7,661,633.67	-5,893.02	7,655,740.65
基金赎回款	-1,328,183.15	531,750.20	-796,432.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,636,868.08	-3,022,494.61	2,614,373.47

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	60,534.88
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	59,635.26
其他	414.82
合计	120,584.96

注：此处其他列示的是存出保证金利息收入。

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 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9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	919,599,068.52
减：卖出股票成本总额	913,266,942.12
买卖股票差价收入	6,332,126.40

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。

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 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9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	134,101.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	100,300.00
减：应收利息总额	18.69
买卖债券差价收入	33,783.01

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。

## 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：无。

## 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股指期货投资收益	-6,226,084.66

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	80,347.40
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	80,347.40

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	5,745,479.66
股票投资	5,745,479.66
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-16,200,415.34
权证投资	-
股指期货	-16,200,415.34
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-10,454,935.68

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	78,299.13
合计	78,299.13

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,357,763.08
银行间市场交易费用	-
合计	1,357,763.08

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
审计费用		36,448.40
信息披露费		120,000.00
证券出借违约金		-
银行费用		1,200.00
合计		157,648.40

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

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
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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

## 7.4.10 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。

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
中金公司	1,952,793,879.62	100.00

## 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
	2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日

	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
中金公司	134,083.01	100.00

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
中金公司	5,826,500,000.00	100.00

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 7.4.10.1.5 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9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31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	325,468.06	100.00	296,991.82	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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,208,806.17
其中：支付销售机构的客户维护费	459,553.63

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：

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

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	当期发生的基金应支付的托管费	120,880.63

注：支付托管人中信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×0.15%/当年天数。

## 7.4.10.2.3 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9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金汇越定开 A	中金汇越定开 C	合计
中金财富证券	0.00	120,425.59	120,425.59
中国国际金融股份有限公司	-	12,761.07	12,761.07
合计	0.00	133,186.66	133,186.66

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。

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

## 7.4.10.4 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

## 7.4.10.4.1 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

注：无。

## 7.4.10.4.2 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

注：无。

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日	2020年9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
	中金汇越定开 A	中金汇越定开 C
基金合同生效日（2020年9月17日）持有的基金份额	2,158,227.12	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	2,158,227.12	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.23%	0%

## 7.4.10.5.2 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

注：无

## 7.4.10.6 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9月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	1,077,959.60	60,534.88

注：本基金的银行存款由托管行中信银行保管，按同业利率或约定利率计息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

注：无。

## 7.4.12 期末(2020 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	15.18	15.18	129	1,958.22	1,958.22	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	110	1,679.70	1,679.70	-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年06月03日	首次公开发行限售	24.35	33.06	147	3,579.45	4,859.82	-
300913	兆龙互连	2020年11月27日	2021年06月07日	首次公开发行限售	13.21	23.94	259	3,421.39	6,200.46	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年06月21日	首次公开发行限售	18.78	31.94	116	2,178.48	3,705.04	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年06月25日	首次公开发行限售	16.05	31.58	152	2,439.60	4,800.16	-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年06月30日	首次公开发行限售	20.08	37.33	139	2,791.12	5,188.87	-
600919	江苏银行	2020年12月17日	2021年1月14日	配股流通受限	4.59	5.46	9,840	45,165.60	53,726.40	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	16.95	16.95	134	2,271.30	2,271.30	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113616	韦尔转债	2020年12月28日	2021年1月22日	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、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。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、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。

本基金的银行存款存放于中信银行，该行为本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。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 12 月 31 日，本基金仅持有少量债券投资，相应信用风险不重大。

#### 7.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-

AAA 以下	2,000.00
未评级	-
合计	2,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	1,077,959.60	-	-	-	1,077,959.60
结算备付金	16,536,463.52	-	-	-	16,536,463.52
存出保证金	18,120,902.78	-	-	-	18,120,902.78
交易性金融资产	-	-	2,000.00	129,343,019.59	129,345,019.59
买入返售金融资产	98,701,169.61	-	-	-	98,701,169.61
应收利息	-	-	-	-24,065.44	-24,065.44
<b>资产总计</b>	<b>134,436,495.51</b>	<b>-</b>	<b>2,000.00</b>	<b>129,318,954.15</b>	<b>263,757,449.66</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	339,754.33	339,754.33
应付托管费	-	-	-	33,975.45	33,975.45
应付证券清算款	-	-	-	37,177.81	37,177.81
应付销售服务费	-	-	-	35,480.99	35,480.99
应付交易费用	-	-	-	296,991.82	296,991.82
其他负债	-	-	-	766,938.60	766,938.60
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,510,319.00</b>	<b>1,510,319.00</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>134,436,495.51</b>	<b>-</b>	<b>2,000.00</b>	<b>127,808,635.15</b>	<b>262,247,130.66</b>

##### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：无

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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	129,343,019.59	49.32
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,000.00	0.00
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	129,345,019.59	49.32

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	6,467,250.98
	业绩比较基准下降 5%	-6,467,250.98

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (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

下表按公允价值三个层次列示了以公允价值计量的金融资产于 2020 年 12 月 31 日的账面价

值。

于 2020 年 12 月 31 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人民币 129,258,629.62，属于第二层次的余额为人民币 86,389.97 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证券，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，本基金分别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证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 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若。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	129,343,019.59	49.04
	其中：股票	129,343,019.59	49.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,000.00	0.00
	其中：债券	2,000.00	0.00
	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	98,701,169.61	37.42
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,614,423.12	6.68
8	其他各项资产	18,096,837.34	6.86
9	合计	263,757,449.66	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 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	2,062,881.00	0.79
B	采矿业	2,287,821.00	0.87
C	制造业	67,202,159.36	25.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,155,586.00	0.82
E	建筑业	1,794,713.00	0.68
F	批发和零售业	813,385.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	2,548,646.00	0.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,917,704.65	1.49
J	金融业	35,346,174.60	13.48
K	房地产业	4,836,264.04	1.84
L	租赁和商务服务业	1,927,872.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	1,038,546.98	0.40
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	270,501.00	0.10
Q	卫生和社会工作	2,045,914.00	0.78
R	文化、体育和娱乐业	1,094,850.96	0.42
S	综合	-	-
	合计	129,343,019.59	49.32

## 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	90,940	7,909,961.20	3.02
2	600519	贵州茅台	2,900	5,794,200.00	2.21
3	000858	五粮液	19,748	5,763,453.80	2.20
4	000333	美的集团	50,111	4,932,926.84	1.88
5	600036	招商银行	103,600	4,553,220.00	1.74
6	600276	恒瑞医药	38,665	4,309,600.90	1.64
7	000651	格力电器	49,100	3,041,254.00	1.16

8	600887	伊利股份	62,256	2,762,298.72	1.05
9	601166	兴业银行	129,600	2,704,752.00	1.03
10	002475	立讯精密	43,614	2,447,617.68	0.93
11	300059	东方财富	73,600	2,281,600.00	0.87
12	000002	万科A	69,800	2,003,260.00	0.76
13	000001	平安银行	95,500	1,846,970.00	0.70
14	600900	长江电力	90,600	1,735,896.00	0.66
15	000568	泸州老窖	7,300	1,650,968.00	0.63
16	300015	爱尔眼科	21,600	1,617,624.00	0.62
17	601398	工商银行	312,600	1,559,874.00	0.59
18	601012	隆基股份	16,300	1,502,860.00	0.57
19	000661	长春高新	3,000	1,346,730.00	0.51
20	002352	顺丰控股	13,300	1,173,459.00	0.45
21	002714	牧原股份	15,200	1,171,920.00	0.45
22	600016	民生银行	223,300	1,161,160.00	0.44
23	601688	华泰证券	61,500	1,107,615.00	0.42
24	601668	中国建筑	218,600	1,086,442.00	0.41
25	300124	汇川技术	10,900	1,016,970.00	0.39
26	002027	分众传媒	99,600	983,052.00	0.37
27	601888	中国中免	3,300	932,085.00	0.36
28	600104	上汽集团	37,800	923,832.00	0.35
29	600030	中信证券	30,700	902,580.00	0.34
30	002241	歌尔股份	22,900	854,628.00	0.33
31	300498	温氏股份	46,700	851,341.00	0.32
32	601211	国泰君安	47,400	830,922.00	0.32
33	000338	潍柴动力	48,500	765,815.00	0.29
34	300014	亿纬锂能	9,300	757,950.00	0.29
35	601169	北京银行	155,500	752,620.00	0.29
36	600031	三一重工	21,500	752,070.00	0.29
37	603288	海天味业	3,573	716,529.42	0.27
38	600000	浦发银行	70,700	684,376.00	0.26
39	002415	海康威视	14,000	679,140.00	0.26
40	300601	康泰生物	3,702	645,999.00	0.25
41	002230	科大讯飞	15,800	645,746.00	0.25
42	601601	中国太保	16,400	629,760.00	0.24
43	002594	比亚迪	3,200	621,760.00	0.24
44	600588	用友网络	13,500	592,245.00	0.23
45	000538	云南白药	5,100	579,360.00	0.22
46	000725	京东方A	95,500	573,000.00	0.22
47	002271	东方雨虹	14,700	570,360.00	0.22
48	600837	海通证券	43,800	563,268.00	0.21
49	600028	中国石化	137,600	554,528.00	0.21

50	002493	荣盛石化	19,900	549,439.00	0.21
51	601288	农业银行	169,200	531,288.00	0.20
52	002311	海大集团	8,039	526,554.50	0.20
53	603259	药明康德	3,900	525,408.00	0.20
54	002304	洋河股份	2,200	519,178.00	0.20
55	600309	万华化学	5,700	518,928.00	0.20
56	000776	广发证券	31,000	504,680.00	0.19
57	300413	芒果超媒	6,900	500,250.00	0.19
58	000166	申万宏源	94,045	496,557.60	0.19
59	000895	双汇发展	10,500	492,870.00	0.19
60	000876	新希望	21,600	483,840.00	0.18
61	600048	保利地产	30,200	477,764.00	0.18
62	601899	紫金矿业	51,400	477,506.00	0.18
63	601939	建设银行	70,100	440,228.00	0.17
64	600585	海螺水泥	8,500	438,770.00	0.17
65	600958	东方证券	37,300	433,799.00	0.17
66	001979	招商蛇口	31,600	419,964.00	0.16
67	002736	国信证券	30,500	416,020.00	0.16
68	300433	蓝思科技	13,500	413,235.00	0.16
69	300408	三环集团	10,400	387,400.00	0.15
70	601225	陕西煤业	41,200	384,808.00	0.15
71	600438	通威股份	9,600	369,024.00	0.14
72	300003	乐普医疗	12,800	347,904.00	0.13
73	600999	招商证券	14,560	339,830.40	0.13
74	600809	山西汾酒	900	337,761.00	0.13
75	000100	TCL 科技	47,100	333,468.00	0.13
76	601155	新城控股	9,300	323,919.00	0.12
77	300347	泰格医药	1,900	307,059.00	0.12
78	002841	视源股份	2,600	299,078.00	0.11
79	600436	片仔癀	1,100	294,261.00	0.11
80	002460	赣锋锂业	2,900	293,480.00	0.11
81	000063	中兴通讯	8,700	292,755.00	0.11
82	300033	同花顺	2,300	285,154.00	0.11
83	300144	宋城演艺	15,800	279,976.00	0.11
84	601229	上海银行	35,400	277,536.00	0.11
85	002563	森马服饰	27,200	272,544.00	0.10
86	002607	中公教育	7,700	270,501.00	0.10
87	600009	上海机场	3,500	264,810.00	0.10
88	002926	华西证券	20,900	260,832.00	0.10
89	601799	星宇股份	1,300	260,650.00	0.10
90	002368	太极股份	9,900	258,489.00	0.10
91	300676	华大基因	2,000	257,120.00	0.10

92	002745	木林森	17,600	256,784.00	0.10
93	000681	视觉中国	19,700	256,100.00	0.10
94	300012	华测检测	9,354	256,018.98	0.10
95	002396	星网锐捷	11,100	255,966.00	0.10
96	300168	万达信息	11,800	255,942.00	0.10
97	002019	亿帆医药	13,400	253,662.00	0.10
98	002233	塔牌集团	19,900	253,526.00	0.10
99	300316	晶盛机电	8,400	252,672.00	0.10
100	002373	千方科技	13,200	252,384.00	0.10
101	002410	广联达	3,200	251,968.00	0.10
102	300630	普利制药	6,000	251,340.00	0.10
103	002985	北摩高科	1,300	251,290.00	0.10
104	300010	豆神教育	25,700	250,832.00	0.10
105	002384	东山精密	9,600	249,600.00	0.10
106	000932	华菱钢铁	52,200	249,516.00	0.10
107	300146	汤臣倍健	10,300	248,745.00	0.09
108	600196	复星医药	4,600	248,354.00	0.09
109	000778	新兴铸管	67,300	247,664.00	0.09
110	002212	天融信	11,700	245,817.00	0.09
111	002244	滨江集团	53,500	245,565.00	0.09
112	002648	卫星石化	9,400	245,528.00	0.09
113	002465	海格通信	22,500	243,675.00	0.09
114	002124	天邦股份	16,600	242,360.00	0.09
115	000050	深天马A	16,400	241,736.00	0.09
116	001914	招商积余	11,100	238,983.00	0.09
117	601988	中国银行	74,900	238,182.00	0.09
118	600893	航发动力	4,000	237,400.00	0.09
119	600153	建发股份	28,900	237,269.00	0.09
120	002600	领益智造	19,700	236,203.00	0.09
121	000559	万向钱潮	44,000	235,400.00	0.09
122	000513	丽珠集团	5,800	234,900.00	0.09
123	002690	美亚光电	5,200	230,256.00	0.09
124	002129	中环股份	9,020	230,010.00	0.09
125	002463	沪电股份	12,200	229,238.00	0.09
126	601818	光大银行	57,200	228,228.00	0.09
127	601766	中国中车	42,900	227,799.00	0.09
128	002653	海思科	13,000	227,760.00	0.09
129	600703	三安光电	8,400	226,884.00	0.09
130	600660	福耀玻璃	4,700	225,835.00	0.09
131	002157	正邦科技	13,200	224,928.00	0.09
132	000623	吉林敖东	13,600	223,992.00	0.09
133	601628	中国人寿	5,800	222,662.00	0.08

134	002602	世纪华通	31,000	220,410.00	0.08
135	002701	奥瑞金	44,200	218,348.00	0.08
136	603986	兆易创新	1,100	217,250.00	0.08
137	601088	中国神华	12,000	216,120.00	0.08
138	000975	银泰黄金	24,900	214,389.00	0.08
139	600760	中航沈飞	2,700	211,086.00	0.08
140	600606	绿地控股	36,200	211,046.00	0.08
141	600406	国电南瑞	7,900	209,903.00	0.08
142	002422	科伦药业	10,600	206,064.00	0.08
143	600346	恒力石化	7,300	204,181.00	0.08
144	603799	华友钴业	2,500	198,250.00	0.08
145	600919	江苏银行	35,640	194,594.40	0.07
146	002966	苏州银行	25,300	194,304.00	0.07
147	601919	中远海控	15,900	194,139.00	0.07
148	600019	宝钢股份	32,400	192,780.00	0.07
149	002867	周大生	7,200	191,880.00	0.07
150	000157	中联重科	19,300	191,070.00	0.07
151	002120	韵达股份	12,000	188,400.00	0.07
152	000625	长安汽车	8,600	188,168.00	0.07
153	000768	中航西飞	4,800	176,064.00	0.07
154	601009	南京银行	21,500	173,720.00	0.07
155	002007	华兰生物	4,100	173,184.00	0.07
156	000961	中南建设	18,800	166,004.00	0.06
157	002371	北方华创	900	162,666.00	0.06
158	002001	新和成	4,800	161,664.00	0.06
159	600741	华域汽车	5,600	161,392.00	0.06
160	002050	三花智控	6,500	160,225.00	0.06
161	002555	三七互娱	5,100	159,273.00	0.06
162	601100	恒立液压	1,400	158,200.00	0.06
163	002179	中航光电	2,000	156,580.00	0.06
164	603993	洛阳钼业	25,000	156,250.00	0.06
165	601633	长城汽车	4,100	155,021.00	0.06
166	000656	金科股份	21,700	153,853.00	0.06
167	601877	正泰电器	3,900	152,724.00	0.06
168	601390	中国中铁	28,900	152,303.00	0.06
169	600050	中国联通	33,100	147,626.00	0.06
170	601377	兴业证券	16,800	145,824.00	0.06
171	002202	金风科技	10,200	145,350.00	0.06
172	000860	顺鑫农业	2,000	145,080.00	0.06
173	601857	中国石油	34,100	141,515.00	0.05
174	000401	冀东水泥	10,000	141,500.00	0.05
175	600176	中国巨石	7,000	139,720.00	0.05

176	600089	特变电工	13,700	139,055.00	0.05
177	603501	韦尔股份	600	138,660.00	0.05
178	600109	国金证券	8,500	138,295.00	0.05
179	600015	华夏银行	22,000	137,500.00	0.05
180	601901	方正证券	13,100	135,847.00	0.05
181	601006	大秦铁路	21,000	135,660.00	0.05
182	601989	中国重工	32,200	134,918.00	0.05
183	002938	鹏鼎控股	2,600	129,142.00	0.05
184	300271	华宇软件	5,400	128,898.00	0.05
185	601186	中国铁建	16,300	128,770.00	0.05
186	600745	闻泰科技	1,300	128,700.00	0.05
187	002236	大华股份	6,400	127,296.00	0.05
188	603369	今世缘	2,200	126,236.00	0.05
189	601788	光大证券	6,800	125,936.00	0.05
190	300257	开山股份	9,200	125,580.00	0.05
191	600352	浙江龙盛	9,100	123,942.00	0.05
192	002939	长城证券	9,600	123,552.00	0.05
193	600926	杭州银行	8,200	122,344.00	0.05
194	002044	美年健康	10,700	121,231.00	0.05
195	002773	康弘药业	2,500	120,375.00	0.05
196	000786	北新建材	3,000	120,150.00	0.05
197	002250	联化科技	5,000	119,950.00	0.05
198	603019	中科曙光	3,500	119,805.00	0.05
199	002008	大族激光	2,800	119,700.00	0.05
200	000066	中国长城	6,300	119,637.00	0.05
201	002146	荣盛发展	18,000	117,540.00	0.04
202	000783	长江证券	13,900	116,760.00	0.04
203	603899	晨光文具	1,300	115,128.00	0.04
204	601108	财通证券	9,100	115,115.00	0.04
205	600183	生益科技	3,900	109,824.00	0.04
206	000596	古井贡酒	400	108,800.00	0.04
207	601985	中国核电	22,000	108,240.00	0.04
208	002601	龙鳞佰利	3,500	107,695.00	0.04
209	000671	阳光城	16,500	107,580.00	0.04
210	601555	东吴证券	10,900	107,474.00	0.04
211	600383	金地集团	7,900	106,650.00	0.04
212	600111	北方稀土	8,100	106,029.00	0.04
213	601669	中国电建	27,300	105,924.00	0.04
214	300496	中科创达	900	105,300.00	0.04
215	002024	苏宁易购	13,600	104,856.00	0.04
216	002153	石基信息	3,200	99,488.00	0.04
217	000977	浪潮信息	3,700	99,456.00	0.04

218	000069	华侨城 A	14,000	99,260.00	0.04
219	601138	工业富联	7,100	97,199.00	0.04
220	601933	永辉超市	13,500	96,930.00	0.04
221	300136	信维通信	2,700	96,876.00	0.04
222	601878	浙商证券	6,300	96,390.00	0.04
223	600029	南方航空	16,100	95,956.00	0.04
224	000425	徐工机械	17,700	95,049.00	0.04
225	600010	包钢股份	80,400	94,068.00	0.04
226	603160	汇顶科技	600	93,330.00	0.04
227	600795	国电电力	41,400	93,150.00	0.04
228	600522	中天科技	8,500	92,140.00	0.04
229	002624	完美世界	3,100	91,450.00	0.03
230	002456	欧菲光	6,900	90,942.00	0.03
231	601800	中国交建	12,500	90,750.00	0.03
232	000963	华东医药	3,400	90,304.00	0.03
233	600061	国投资本	6,300	87,129.00	0.03
234	000728	国元证券	9,600	86,016.00	0.03
235	600705	中航资本	19,500	85,410.00	0.03
236	601838	成都银行	8,000	85,360.00	0.03
237	601600	中国铝业	23,400	84,942.00	0.03
238	000703	恒逸石化	6,400	81,920.00	0.03
239	600066	宇通客车	4,800	81,216.00	0.03
240	600886	国投电力	9,400	81,216.00	0.03
241	603833	欧派家居	600	80,700.00	0.03
242	000708	中信特钢	3,700	80,623.00	0.03
243	601111	中国国航	10,700	80,143.00	0.03
244	600219	南山铝业	25,100	79,316.00	0.03
245	600115	东方航空	16,600	77,688.00	0.03
246	601607	上海医药	4,000	76,800.00	0.03
247	600362	江西铜业	3,800	75,810.00	0.03
248	601066	中信建投	1,800	75,600.00	0.03
249	601236	红塔证券	4,000	74,360.00	0.03
250	600340	华夏幸福	5,700	73,701.00	0.03
251	601162	天风证券	12,000	73,200.00	0.03
252	300628	亿联网络	1,000	73,120.00	0.03
253	603658	安图生物	500	72,590.00	0.03
254	601021	春秋航空	1,300	72,059.00	0.03
255	601618	中国中冶	25,800	70,434.00	0.03
256	601727	上海电气	13,000	70,200.00	0.03
257	000501	鄂武商 A	6,000	69,900.00	0.03
258	600011	华能国际	15,500	69,440.00	0.03
259	002508	老板电器	1,700	69,326.00	0.03

260	600177	雅戈尔	9,500	68,305.00	0.03
261	600118	中国卫星	2,100	67,578.00	0.03
262	600867	通化东宝	5,000	66,900.00	0.03
263	600487	亨通光电	4,700	65,753.00	0.03
264	600637	东方明珠	7,300	65,262.00	0.02
265	600369	西南证券	12,000	64,560.00	0.02
266	002673	西部证券	6,300	63,882.00	0.02
267	600068	葛洲坝	9,700	63,826.00	0.02
268	601997	贵阳银行	8,000	63,600.00	0.02
269	600038	中直股份	1,000	62,710.00	0.02
270	601198	东兴证券	4,700	62,604.00	0.02
271	601216	君正集团	12,200	60,390.00	0.02
272	601816	京沪高铁	10,500	59,430.00	0.02
273	002252	上海莱士	8,000	59,200.00	0.02
274	600489	中金黄金	6,700	59,027.00	0.02
275	601881	中国银河	4,700	58,797.00	0.02
276	002739	万达电影	3,237	58,524.96	0.02
277	600332	白云山	2,000	58,500.00	0.02
278	600390	五矿资本	8,300	57,934.00	0.02
279	600004	白云机场	4,100	57,933.00	0.02
280	600516	方大炭素	8,100	57,267.00	0.02
281	002958	青农商行	11,200	57,008.00	0.02
282	600018	上港集团	12,400	56,668.00	0.02
283	600498	烽火通信	2,300	55,384.00	0.02
284	601360	三六零	3,500	54,985.00	0.02
285	600233	圆通速递	4,700	54,050.00	0.02
286	002916	深南电路	500	54,030.00	0.02
287	002093	国脉科技	7,400	53,946.00	0.02
288	600372	中航电子	2,700	53,055.00	0.02
289	601319	中国人保	7,700	50,589.00	0.02
290	600271	航天信息	4,000	50,400.00	0.02
291	600655	豫园股份	5,600	49,784.00	0.02
292	601117	中国化学	8,400	49,308.00	0.02
293	600208	新湖中宝	15,300	47,430.00	0.02
294	600998	九州通	2,600	47,216.00	0.02
295	600170	上海建工	15,600	46,956.00	0.02
296	002032	苏泊尔	600	46,794.00	0.02
297	603156	养元饮品	1,800	46,512.00	0.02
298	600085	同仁堂	1,900	45,410.00	0.02
299	601658	邮储银行	9,500	45,410.00	0.02
300	601238	广汽集团	3,400	45,186.00	0.02
301	601231	环旭电子	2,200	42,548.00	0.02

302	600482	中国动力	2,300	41,216.00	0.02
303	600297	广汇汽车	14,100	40,326.00	0.02
304	600848	上海临港	2,000	40,040.00	0.02
305	000998	隆平高科	2,000	39,620.00	0.02
306	600027	华电国际	11,500	39,100.00	0.01
307	002558	巨人网络	2,200	38,346.00	0.01
308	601577	长沙银行	3,700	35,224.00	0.01
309	601992	金隅集团	11,800	35,046.00	0.01
310	000627	天茂集团	6,900	33,603.00	0.01
311	000709	河钢股份	14,800	33,152.00	0.01
312	600989	宝丰能源	2,800	32,760.00	0.01
313	601916	浙商银行	7,900	32,232.00	0.01
314	600188	兖州煤业	3,200	32,224.00	0.01
315	000723	美锦能源	4,500	30,060.00	0.01
316	600398	海澜之家	4,500	28,890.00	0.01
317	600025	华能水电	6,400	28,544.00	0.01
318	600928	西安银行	5,100	28,356.00	0.01
319	601808	中海油服	2,100	26,817.00	0.01
320	601698	中国卫通	1,400	25,396.00	0.01
321	002468	申通快递	2,200	22,176.00	0.01
322	603260	合盛硅业	600	20,064.00	0.01
323	601077	渝农商行	4,200	18,900.00	0.01
324	600968	海油发展	7,300	17,447.00	0.01
325	601298	青岛港	2,500	16,075.00	0.01
326	002945	华林证券	1,000	15,070.00	0.01
327	601828	美凯龙	1,500	12,735.00	0.00
328	600299	安迪苏	1,000	11,510.00	0.00
329	002683	宏大爆破	200	7,190.00	0.00
330	003026	中晶科技	152	7,168.32	0.00
331	300913	兆龙互连	259	6,200.46	0.00
332	300925	法本信息	139	5,188.87	0.00
333	300911	亿田智能	147	4,859.82	0.00
334	300922	天秦装备	152	4,800.16	0.00
335	003029	吉大正元	177	4,626.78	0.00
336	003028	振邦智能	108	4,502.52	0.00
337	300917	特发服务	116	3,705.04	0.00
338	002281	光迅科技	100	2,904.00	0.00
339	605277	新亚电子	134	2,271.30	0.00
340	003030	祖名股份	129	1,958.22	0.00
341	003031	中瓷电子	110	1,679.70	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	600519	贵州茅台	19,458,848.00	7.42
2	000333	美的集团	18,164,581.20	6.93
3	002415	海康威视	16,685,791.51	6.36
4	601318	中国平安	15,097,443.01	5.76
5	600900	长江电力	14,556,476.00	5.55
6	002475	立讯精密	14,360,037.00	5.48
7	601012	隆基股份	13,956,398.16	5.32
8	000651	格力电器	12,620,141.70	4.81
9	300059	东方财富	12,127,595.00	4.62
10	002493	荣盛石化	11,871,677.24	4.53
11	600887	伊利股份	11,474,984.60	4.38
12	000858	五粮液	11,134,773.96	4.25
13	600809	山西汾酒	11,039,432.88	4.21
14	603288	海天味业	10,912,426.05	4.16
15	601601	中国太保	10,721,669.00	4.09
16	300014	亿纬锂能	10,179,951.00	3.88
17	600009	上海机场	10,175,320.79	3.88
18	300413	芒果超媒	9,921,919.16	3.78
19	600276	恒瑞医药	9,668,190.50	3.69
20	601166	兴业银行	9,380,244.00	3.58
21	600309	万华化学	8,673,208.11	3.31
22	600104	上汽集团	8,274,983.00	3.16
23	603799	华友钴业	8,203,942.00	3.13
24	600588	用友网络	8,168,436.62	3.11
25	600438	通威股份	7,988,318.00	3.05
26	601939	建设银行	7,892,525.00	3.01
27	600036	招商银行	7,800,253.53	2.97
28	002841	视源股份	7,684,231.50	2.93
29	600674	川投能源	7,571,917.00	2.89
30	000568	泸州老窖	7,457,976.00	2.84
31	001979	招商蛇口	7,209,417.00	2.75
32	601155	新城控股	7,149,898.02	2.73
33	000876	新希望	7,085,674.00	2.70
34	601398	工商银行	6,952,499.00	2.65
35	002241	歌尔股份	6,911,199.00	2.64
36	300033	同花顺	6,851,681.12	2.61
37	601225	陕西煤业	6,800,452.00	2.59

38	300015	爱尔眼科	6,764,073.70	2.58
39	002714	牧原股份	6,552,528.92	2.50
40	600886	国投电力	5,916,328.00	2.26
41	002027	分众传媒	5,914,294.00	2.26
42	002736	国信证券	5,872,664.58	2.24
43	601088	中国神华	5,852,732.00	2.23
44	002032	苏泊尔	5,846,568.68	2.23
45	601688	华泰证券	5,838,930.87	2.23
46	601066	中信建投	5,806,778.00	2.21
47	000002	万科A	5,643,672.00	2.15
48	600031	三一重工	5,585,370.71	2.13
49	002157	正邦科技	5,545,357.00	2.11
50	600016	民生银行	5,453,023.80	2.08
51	002601	龙蟠佰利	5,448,717.00	2.08
52	002739	万达电影	5,431,104.50	2.07
53	002460	赣锋锂业	5,280,551.68	2.01

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 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	002415	海康威视	16,012,500.86	6.11
2	000333	美的集团	14,741,717.00	5.62
3	600519	贵州茅台	14,692,654.06	5.60
4	600900	长江电力	12,967,606.32	4.94
5	601012	隆基股份	12,624,249.24	4.81
6	002475	立讯精密	11,730,714.16	4.47
7	002493	荣盛石化	11,653,889.91	4.44
8	600809	山西汾酒	10,817,845.02	4.13
9	000651	格力电器	10,379,605.00	3.96
10	300059	东方财富	10,374,421.00	3.96
11	603288	海天味业	10,332,100.00	3.94
12	600009	上海机场	10,054,416.96	3.83
13	601601	中国太保	10,010,946.44	3.82
14	300014	亿纬锂能	9,576,916.00	3.65
15	300413	芒果超媒	9,409,996.68	3.59
16	600887	伊利股份	8,874,602.00	3.38
17	603799	华友钴业	8,590,261.00	3.28
18	601318	中国平安	8,447,635.40	3.22
19	600309	万华化学	7,987,266.92	3.05
20	600588	用友网络	7,627,762.77	2.91
21	600438	通威股份	7,609,833.00	2.90

22	600674	川投能源	7,531,875.59	2.87
23	600104	上汽集团	7,488,305.00	2.86
24	002841	视源股份	7,405,774.67	2.82
25	601939	建设银行	7,368,889.00	2.81
26	601166	兴业银行	7,205,050.18	2.75
27	000858	五粮液	6,869,389.00	2.62
28	601155	新城控股	6,817,609.23	2.60
29	601225	陕西煤业	6,697,456.00	2.55
30	001979	招商蛇口	6,634,458.00	2.53
31	000876	新希望	6,417,075.20	2.45
32	300033	同花顺	6,329,235.86	2.41
33	000568	泸州老窖	5,906,269.20	2.25
34	002241	歌尔股份	5,895,444.62	2.25
35	600886	国投电力	5,762,750.76	2.20
36	300015	爱尔眼科	5,738,635.92	2.19
37	601066	中信建投	5,733,699.50	2.19
38	002032	苏泊尔	5,721,749.20	2.18
39	601088	中国神华	5,705,991.20	2.18
40	600276	恒瑞医药	5,588,603.33	2.13
41	002736	国信证券	5,470,214.00	2.09
42	002050	三花智控	5,459,493.70	2.08
43	601398	工商银行	5,428,397.00	2.07
44	002714	牧原股份	5,389,860.20	2.06
45	002739	万达电影	5,342,187.33	2.04
46	002601	龙鳞佰利	5,271,974.00	2.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,033,657,538.68
卖出股票收入（成交）总额	919,599,068.52

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,000.00	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,000.00	-

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113616	韦尔转债	20	2,000.00	-

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2103	IF2103	-82	-128,205,360.00	-16,200,415.34	-
公允价值变动总额合计（元）					-16,200,415.34
股指期货投资本期收益（元）					-6,226,084.66
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-16,200,415.34

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本集合计划将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

本集合投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内

受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本集合对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及合同的要求。

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	18,120,902.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-24,065.44
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,096,837.34

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
汇越定开A类	1,437	121,943.72	4,975,061.37	2.84	170,258,062.60	97.16
汇越	380	206,048.59	27,494,117.48	35.11	50,804,344.86	64.89

定开 C 类						
合计	1,809	140,150.13	32,469,178.85	12.81	221,062,407.46	87.19

### 9.2 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	汇越定开 A 类	944,750.96	0.54
	汇越定开 C 类	0.00	0
	合计	944,750.96	0.37

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	汇越定开 A 类	0
	汇越定开 C 类	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇越定开 A 类	50~100
	汇越定开 C 类	0
	合计	50~100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	集合-中金汇越定开 A	集合-中金汇越定开 C
基金合同生效日 (2020 年 9 月 17 日) 基金份额总额	14,296,284.98	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	173,333,620.22	95,322,839.65
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	12,396,781.23	17,024,377.31
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）		
本报告期末基金份额总额	175,233,123.97	78,298,462.34

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

王晟先生，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，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，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，中信银行股份有限公司根据工作需要，于 2020 年 10 月 9 日，任命杨璋琪先生担任本行资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，中信银行股份有限公司托管业务未涉及诉讼

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未变化。

### 11.5 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为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 40,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	1,952,793,879.62	100.00%	325,468.06	100.00%	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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	134,083.01	100.00%	5,826,500,000.00	100.00%	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金汇越量化对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务和规模控制安排公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年9月17日
2	关于中金中铭量化对冲1号集合资产管理计划变更为中金汇越量化对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型集	中国证监会指定报刊及网站	2020年9月17日

	合资产管理计划及法律文件变更生效的公告		
3	中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划首个开放期申购申请比例确认公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 9 月 24 日
4	中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务和规模控制安排公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 11 月 27 日
5	关于新增上海天天基金销售有限公司为中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放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 11 月 30 日
6	关于新增京东肯特瑞基金销售有限公司为中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放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 11 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一) 关于准予中金中铭量化对冲 1 号集合资产管理计划合同变更的回函
- (二) 中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明

书

- (四) 中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放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

### 13.2 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。

### 13.3 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](http://www.cicc.com)

中国国际金融股份有限公司

2021 年 3 月 30 日