

中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 7 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表..... | 15 |
| 6.2 利润表..... | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 17 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 18 |
| §7 投资组合报告..... | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 39 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 39 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 43 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 43 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 43 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 43 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 43 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 44 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 46 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 46 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 46 |
| 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的情况..... | 46 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 47 |
| §10 重大事件揭示..... | 48 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 48 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 48 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 48 |
| 10.8 其他重大事件..... | 49 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 51 |
| 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..... | 51 |

| | |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 51 |
| §12 备查文件目录..... | 52 |
| 12.1 备查文件目录..... | 52 |
| 12.2 存放地点..... | 52 |
| 12.3 查阅方式..... | 52 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 基金名称 | 中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中金瑞祥 | |
| 场内简称 | - | |
| 基金主代码 | 006279 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018 年 11 月 13 日 | |
| 基金管理人 | 中金基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 100,180,829.63 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 中金瑞祥 A | 中金瑞祥 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 006279 | 006280 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,389,627.54 份 | 97,791,202.09 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。 |
| 投资策略 | <p>（一）资产配置策略，基于宏观基本面研究，结合对各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等因素的评估确定各大类资产的中长期基本配置比例并进行调整。（二）普通债券投资策略，包括债券类属配置策略、期限结构配置策略、利率策略、信用债券投资策略、骑乘策略、息差策略。（三）中小企业私募债券的投资策略，重点分析信用风险及流动性风险，选择风险与收益相匹配的品种进行配置。（四）可转换债券投资策略，从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注。（五）可交换债券投资策略，选择具有较高投资价值的可交换债券进行投资，积极参与可交换债券新券的申购。（六）资产支持证券投资策略，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，制定周密的投资策略。（七）国债期货投资策略，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。（八）股票投资策略，主要采纳两种选股投资思路，一是纯粹的自下而上的个股精选策略，二是运用量化模型自上而下的选股策略。（九）股指期货投资策略，通过对证券市场和期货市场运行趋势的量化研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，并与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。（十）权证投资策略，通过对权证标的证券基本面的研究，辅助运用权证定价模型寻求其合理估值水平。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×50%+中债综合财富(总值)指数收益率×50% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 |

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 | | 中金基金管理有限公司 | 平安银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李虹 | 李帅帅 |
| | 联系电话 | 010-63211122 | 0755-25878287 |
| | 电子邮箱 | xxpl@ciccfund.com | LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-868-1166 | 95511-3 |
| 传真 | | 010-66159121 | 0755-82080387 |
| 注册地址 | | 北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室 | 广东省深圳市罗湖区深南东路5047号 |
| 办公地址 | | 北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层 | 深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼 |
| 邮政编码 | | 100004 | 518001 |
| 法定代表人 | | 楚钢 | 谢永林 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.ciccfund.com/ |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-------------------------|
| 注册登记机构 | 中金基金管理有限公司 | 北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层 |

§ 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

| 基金级别 | 中金瑞祥 A | 中金瑞祥 C |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日) | 报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 258,904.20 | 4,450,929.72 |
| 本期利润 | 547,107.90 | 4,081,070.25 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3381 | 0.0440 |
| 本期加权平均净值利润率 | 8.46% | 4.20% |
| 本期基金份额净值增长率 | 5.31% | 5.26% |
| 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 | 7,386,100.68 | 6,495,011.02 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 3.0909 | 0.0664 |
| 期末基金资产净值 | 10,023,795.06 | 107,594,803.89 |
| 期末基金份额净值 | 4.1947 | 1.1003 |
| 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 | 319.47% | 10.03% |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、本报告所列示的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 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

中金瑞祥 A

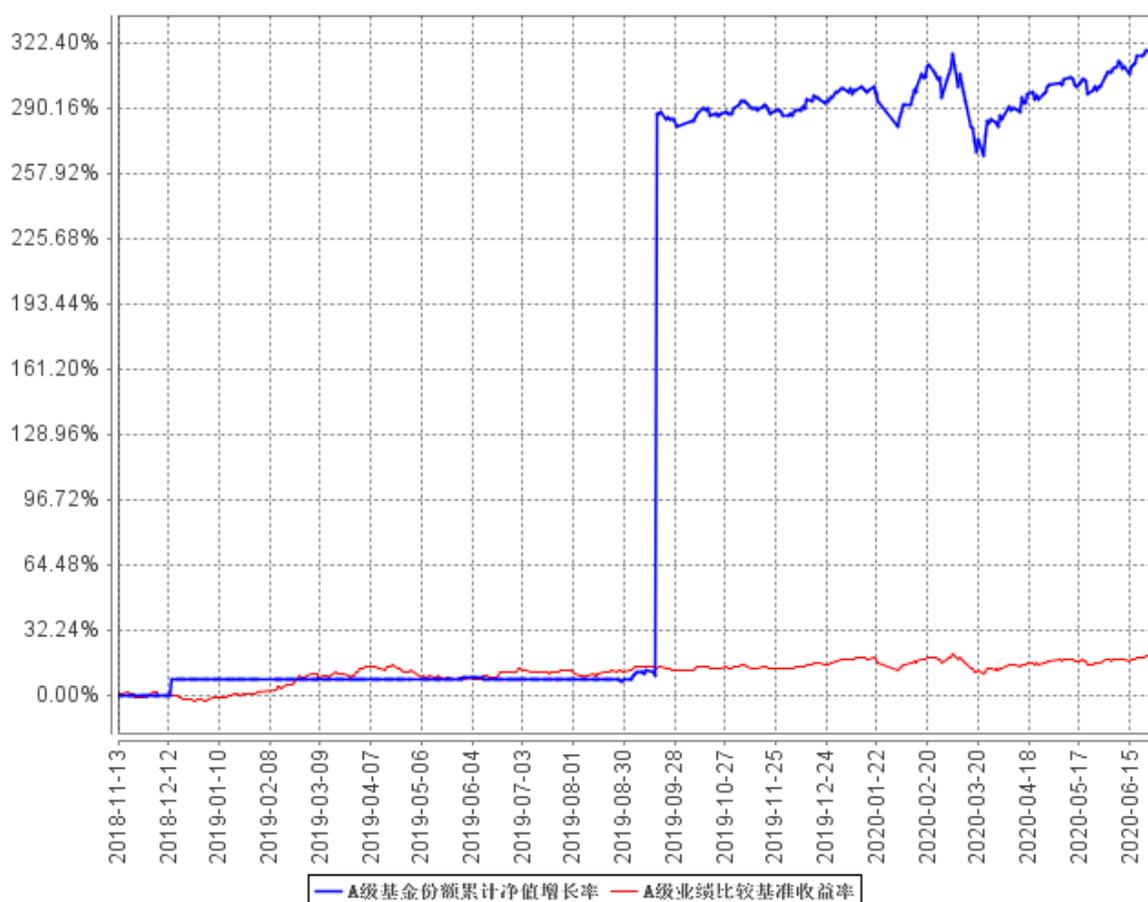
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月 | 4.80% | 0.54% | 3.44% | 0.44% | 1.36% | 0.10% |
| 过去三个月 | 9.73% | 0.60% | 6.23% | 0.45% | 3.50% | 0.15% |
| 过去六个月 | 5.31% | 1.00% | 2.37% | 0.74% | 2.94% | 0.26% |
| 过去一年 | 287.64% | 16.22% | 7.49% | 0.60% | 280.15% | 15.62% |
| 自基金合同生效起至今 | 319.47% | 12.68% | 19.88% | 0.65% | 299.59% | 12.03% |

中金瑞祥 C

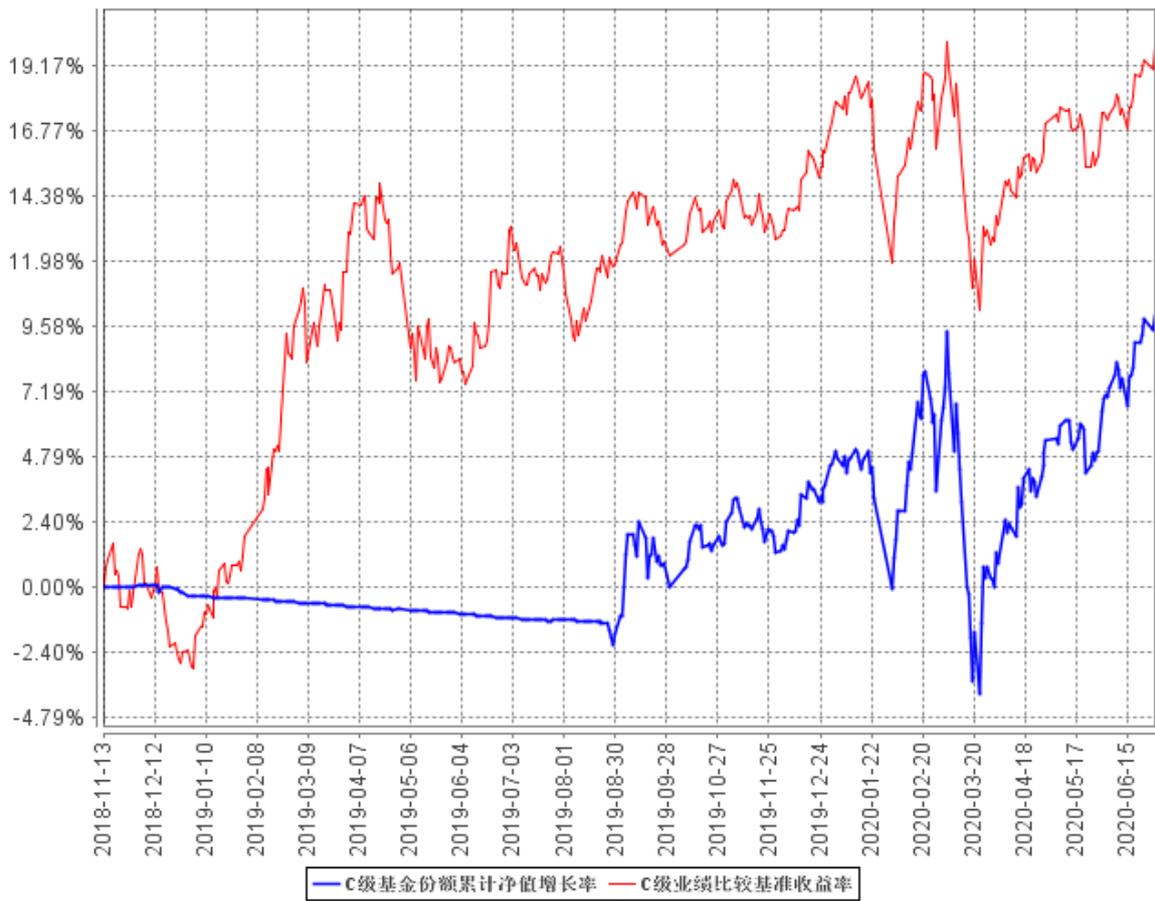
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 4.79% | 0.54% | 3.44% | 0.44% | 1.35% | 0.10% |
| 过去三个月 | 9.70% | 0.60% | 6.23% | 0.45% | 3.47% | 0.15% |
| 过去六个月 | 5.26% | 1.00% | 2.37% | 0.74% | 2.89% | 0.26% |
| 过去一年 | 11.27% | 0.74% | 7.49% | 0.60% | 3.78% | 0.14% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.03% | 0.58% | 19.88% | 0.65% | -9.85% | -0.07% |

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

A级基金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



C级基金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



§ 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

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 4 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司共管理 32 只开放式基金，证券投资基金管理规模 320.30 亿元。

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 | | |
| 魏宇 | 本基金的基金经理 | 2018 年 11 月 13 日 | - | 10 年 | 魏宇先生，统计学博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发。2014 年 11 月加入中金基金管理有限公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任量化公募投资部基金经理。 |

- 1、本基金基金经理的任职日期为基金合同生效日。
- 2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
- 3、本基金无基金经理助理。

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

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

报告期内，本基金采用量化的方法来进行资产配置和构建股票组合，主要配置了大盘股，并根据市场环境适时加减仓。

2020 年全球经济都受到新型冠状病毒疫情的影响。目前海外的不确定性上升，主要体现在两个方面，其一尽管欧洲等国复工进展已经较为领先，但新增确诊人数在美国和部分新兴市场仍未见顶，美国二季度 GDP 录得负增长 32.9%，创二战以来最大下滑。其二中美贸易摩擦争端再起，并且有继续升温迹象。国内方面，经济温和修复，需求端复苏的进度有所加快，工业生产回暖，政策保持相对定力。受益于前期疫情期间压制的需求滞后释放，二季度国内经济修复略超市场预期。工业生产的高频数据继续回升，整体受 6 月洪涝灾害影响不大。随着疫情得到较好的控制，复工复产持续推进，工业生产已逐渐接近回归正常水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金瑞祥 A 基金份额净值为 4.1947 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.31%；截至本报告期末中金瑞祥 C 基金份额净值为 1.1003 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.26%；同期业绩比较基准收益率为 2.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，虽然内外部风险因素仍多，市场结构性估值不低，但综合来看，中国疫情防控大幅领先，复工复产程度继续深化，基本面依然稳健，中国市场应会继续彰显韧性，对中期市场我

们依然持积极态度。政策方面，7月30日召开的政治局会议定调了下半年政策，强调需要加快形成国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进的新格局。在下半年的财政政策和货币政策方面，会议强调货币政策要更加灵活适度，财政政策要更加积极有为，保持货币供应量和社融合理增长。央行优化了资管新规安排，延长资管新规过渡期至2021年底以应对疫情带来的冲击，但不涉及标准的变动和调整，体现监管机构促进市场平稳发展的监管姿态。证监会召开年中工作会议，部署下一步工作包括保持IPO常态化、完善注册制和退市制度规则、构建境外上市监管制度体系等九大重点，旨在继续推进资本市场全面深化改革。未来继续看好消费升级与产业升级大趋势，内需与新经济是主线，关注泛消费类的行业，除前期表现较好的食品饮料及医药外，关注家电、汽车及零部件、酒店旅游、轻工家居、传媒互联网等，以及先进制造，如科技、新能源汽车产业链及光伏等；同时关注周期板块中的阶段性机会，如券商、建材等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金

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 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.6.1 | 8,784,478.57 | 10,453,180.47 |
| 结算备付金 | | 3,277,777.75 | 5,231,904.79 |
| 存出保证金 | | 5,354.15 | 136,554.82 |
| 交易性金融资产 | 6.4.6.2 | 71,656,479.31 | 68,698,690.71 |
| 其中：股票投资 | | 71,656,479.31 | 65,882,450.71 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 2,816,240.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.6.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 34,000,000.00 | 54,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 31,459.34 | 1,009,048.88 |
| 应收利息 | 6.4.6.5 | 2,433.45 | 44,167.75 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 212,407.04 | 79,986.80 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.6.6 | - | - |
| 资产总计 | | 117,970,389.61 | 139,653,534.22 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.6.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 194,857.69 | 58,155.95 |
| 应付管理人报酬 | | 47,330.04 | 58,158.46 |
| 应付托管费 | | 9,466.01 | 11,631.67 |
| 应付销售服务费 | | 8,666.60 | 11,452.00 |
| 应付交易费用 | 6.4.6.7 | 31,499.85 | 15,686.28 |
| 应交税费 | | - | 0.57 |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.6.8 | 59,970.47 | 35,045.59 |
| 负债合计 | | 351,790.66 | 190,130.52 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.6.9 | 100,180,829.63 | 131,566,244.58 |
| 未分配利润 | 6.4.6.10 | 17,437,769.32 | 7,897,159.12 |
| 所有者权益合计 | | 117,618,598.95 | 139,463,403.70 |
| 负债和所有者权益总计 | | 117,970,389.61 | 139,653,534.22 |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，中金瑞祥 A 基金份额净值 4.1947 元，基金份额总额 2,389,627.54 份；中金瑞祥 C 基金份额净值 1.1003 元，基金份额总额 97,791,202.09 份。中金瑞祥份额总额合计为 100,180,829.63 份。

6.2 利润表

会计主体：中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 5,155,311.27 | 29,353.61 |
| 1.利息收入 | | 368,653.06 | 11,552.57 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.6.11 | 53,087.03 | 11,114.41 |
| 债券利息收入 | | 27,859.27 | 438.16 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 287,706.76 | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 4,840,139.78 | -402.34 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.6.12 | 3,915,443.83 | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.6.13 | 27,675.51 | -402.34 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.6.13.3 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.6.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.6.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.6.16 | 897,020.44 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.6.17 | -81,655.77 | 12.84 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|-----------|--------------|-----------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.6.18 | 28,174.20 | 18,190.54 |
| 减：二、费用 | | 527,133.12 | 31,728.58 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.9.2.1 | 263,167.39 | 12,477.23 |
| 2. 托管费 | 6.4.9.2.2 | 52,633.49 | 1,247.72 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.9.2.3 | 49,448.15 | 230.21 |
| 4. 交易费用 | 6.4.6.19 | 102,211.68 | 17.33 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 0.07 | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.6.20 | 59,672.34 | 17,756.09 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 4,628,178.15 | -2,374.97 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 4,628,178.15 | -2,374.97 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1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） | 131,566,244.58 | 7,897,159.12 | 139,463,403.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 4,628,178.15 | 4,628,178.15 |
| 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） | -31,385,414.95 | 4,912,432.05 | -26,472,982.90 |
| 其中：1.基金申购款 | 51,480,290.24 | 11,087,429.09 | 62,567,719.33 |
| 2.基金赎回款 | -82,865,705.19 | -6,174,997.04 | -89,040,702.23 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的 | - | - | - |

基金招募说明书》和《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）。

本基金通过中金基金直销中心及管理人指定的其他投资机构向投资者公开发售，募集期为 2018 年 8 月 8 日起至 2018 年 11 月 7 日。经向中国证监会备案，《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 11 月 13 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 203,953,024.20 份（含利息转份额 9,685.62 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（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据经中国证监会备案的《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购 / 申购时，收取认购 / 申购费用，但从本类别基金资产中不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取认购 / 申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、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）、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 06 月 30 日的财务状况、2020 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部 国家税务总局 证监会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 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,暂不征收企业所得税。

(2) 自 2016 年 5 月 1 日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称“营改增”)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日(含)以后,资管产品管理人(以下称“管理人”)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以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 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(3) 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、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

(5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 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 | 8,784,478.57 |
| 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： | 8,784,478.57 |

6.4.6.2 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 | 67,698,610.76 | 71,656,479.31 | 3,957,868.55 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 67,698,610.76 | 71,656,479.31 | 3,957,868.55 |

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产**6.4.6.4.1 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 | 34,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 34,000,000.00 | - |

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 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 | 956.05 |
| 应收定期存款利息 | - |

| | |
|------------|----------|
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 1,475.00 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 2.40 |
| 合计 | 2,433.45 |

6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.6.7 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 | 31,499.85 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 31,499.85 |

6.4.6.8 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 | 298.13 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 59,672.34 |
| 合计 | 59,970.47 |

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 中金瑞祥 A | | |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
| 项目 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 657,911.48 | 657,911.48 |
| 本期申购 | 3,247,740.55 | 3,247,740.55 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -1,516,024.49 | -1,516,024.49 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 2,389,627.54 | 2,389,627.54 |

金额单位：人民币元

| 中金瑞祥 C | | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| 项目 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 130,908,333.10 | 130,908,333.10 |
| 本期申购 | 48,232,549.69 | 48,232,549.69 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -81,349,680.70 | -81,349,680.70 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 97,791,202.09 | 97,791,202.09 |

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

| 中金瑞祥 A | | | |
|----------------|---------------|------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 1,918,630.57 | 44,130.36 | 1,962,760.93 |
| 本期利润 | 258,904.20 | 288,203.70 | 547,107.90 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 5,208,565.91 | -84,267.22 | 5,124,298.69 |
| 其中：基金申购款 | 9,772,667.54 | -91,958.05 | 9,680,709.49 |
| 基金赎回款 | -4,564,101.63 | 7,690.83 | -4,556,410.80 |

| | | | |
|---------|--------------|------------|--------------|
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 7,386,100.68 | 248,066.84 | 7,634,167.52 |

单位：人民币元

| 中金瑞祥 C | | | |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 2,765,166.74 | 3,169,231.45 | 5,934,398.19 |
| 本期利润 | 4,450,929.72 | -369,859.47 | 4,081,070.25 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -721,085.44 | 509,218.80 | -211,866.64 |
| 其中：基金申购款 | 2,229,576.15 | -822,856.55 | 1,406,719.60 |
| 基金赎回款 | -2,950,661.59 | 1,332,075.35 | -1,618,586.24 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 6,495,011.02 | 3,308,590.78 | 9,803,601.80 |

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 29,613.77 |
| 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 | 23,076.72 |
| 其他 | 396.54 |
| 合计 | 53,087.03 |

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 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1月1日至2020年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 33,942,499.19 |
| 减：卖出股票成本总额 | 30,027,055.36 |
| 买卖股票差价收入 | 3,915,443.83 |

6.4.6.13 债券投资收益**6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 27,675.51 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 27,675.51 |

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 3,005,553.82 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,906,290.00 |
| 减：应收利息总额 | 71,588.31 |
| 买卖债券差价收入 | 27,675.51 |

6.4.6.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.14 贵金属投资收益**6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期末未持有贵金属。

6.4.6.15 衍生工具收益

本基金在本期及上年度均无衍生工具投资收益。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 897,020.44 |

| | |
|---------------|------------|
| 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 | 897,020.44 |

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -81,655.77 |
| ——股票投资 | -80,305.77 |
| ——债券投资 | -1,350.00 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——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 | - |
| 合计 | -81,655.77 |

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 28,174.20 |
| 006279 | - |
| 合计 | 28,174.20 |

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 102,211.68 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 交易基金产生的费用 | - |
| 其中：申购费 | - |

| | |
|-----|------------|
| 赎回费 | - |
| 合计 | 102,211.68 |

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 19,890.78 |
| 信息披露费 | 39,781.56 |
| 证券出借违约金 | - |
| 开户费 | - |
| 合计 | 59,672.34 |

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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未发生变化。

6.4.8.2 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 |
|--|------------------------|
| 中金基金 | 基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构 |
| 中国中金财富证券有限责任公司（“中金财富证券”，原“中国中投证券有限责任公司”） | 基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构 |
| 平安银行 | 基金托管人 |
| 中国国际金融股份有限公司（“中金公司”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 | | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日 | |
|--------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |
| 中金财富证券 | 66,540,295.95 | 100.00% | - | - |

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 | | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日 | |
|--------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 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 成交总额的比例 |
| 中金财富证券 | 234,002.97 | 100.00% | 1,195,098.00 | 100.00% |

6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 | | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日 | |
|--------|----------------------------|--------------------|---------------------------------|--------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回 购成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券回 购成交总额的比例 |
| 中金财富证券 | 2,651,500,000.00 | 100.00% | - | - |

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 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1月1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 |
| 中金财富证券 | 48,661.46 | 100.00% | 31,499.85 | 100.00% |

注：1、本基金在上期间没有应支付关联方的佣金。

2、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。

3、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还获得证券研究综合服务。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 263,167.39 | 12,477.23 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 16,976.65 | 2,607.39 |

注：支付基金管理人中金基金管理有限公司的基本管理费按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基本管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 52,633.49 | 1,247.72 |

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.9.2.3 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1月1日至2020年6月30日 | | |
|----------------|---------------------------------|-----------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中金瑞祥 A | 中金瑞祥 C | 合计 |
| 中金基金 | - | 36,316.42 | 36,316.42 |
| 中金财富证券 | - | 13,065.55 | 13,065.55 |
| 合计 | - | 49,381.97 | 49,381.97 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中金瑞祥 A | 中金瑞祥 C | 合计 |
| 中金财富证券 | - | 9.59 | 9.59 |
| 合计 | - | 9.59 | 9.59 |

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；

2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.9.4 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

本基金在本期及上期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.9.5.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.9.6 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1月1日至2020年6月30日 | | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-----------|---------------------------------|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 平安银行 | 8,784,478.57 | 29,613.77 | 2,231,405.83 | 7,859.10 |

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 | | | | | |
|----------------------------|--------|------|--------|-----------|------------|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：份） | 总金额 |
| 中金公司 | 688100 | 威胜信息 | 网下新股发行 | 6,210 | 85,573.80 |
| 中金公司 | 688158 | 优刻得 | 网下新股发行 | 4,255 | 141,393.65 |
| 中金公司 | 688266 | 泽璟制药 | 网下新股发行 | 7,172 | 242,126.72 |
| 中金公司 | 688200 | 华峰测控 | 网下新股发行 | 588 | 63,157.08 |
| 中金公司 | 688222 | 成都先导 | 网下新股发行 | 2,267 | 46,518.84 |
| 中金公司 | 688365 | 光云科技 | 网下新股发行 | 3,032 | 32,745.60 |
| 中金公司 | 688505 | 复旦张江 | 网下新股发行 | 5,195 | 46,495.25 |
| 中金公司 | 688520 | 神州细胞 | 网下新股发行 | 2,744 | 70,356.16 |

注：本基金上年度可比期末在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.11 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|---------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 688277 | 天智航 | 2020年6月24日 | 2020年7月 | 新股流通受限 | 12.04 | 12.04 | 5,298 | 63,787.92 | 63,787.92 | |

| | | | | | | | | | | |
|--------|----------|-----------------------|---------------------------|------------|-------|-------|--------|------------|------------|---|
| | | 日 | 7 日 | | | | | | | |
| 688528 | 秦川 物联 | 2020 年 6 月 19 日 | 2020 年 7 月 1 日 | 新股流 通受限 | 11.33 | 11.33 | 4,741 | 53,715.53 | 53,715.53 | - |
| 688027 | 国盾 量子 | 2020 年 6 月 30 日 | 2020 年 7 月 9 日 | 新股流 通受限 | 36.18 | 36.18 | 1,320 | 47,757.60 | 47,757.60 | - |
| 688600 | 皖仪 科技 | 2020 年 6 月 23 日 | 2020 年 7 月 3 日 | 新股流 通受限 | 15.50 | 15.50 | 2,962 | 45,911.00 | 45,911.00 | - |
| 688278 | 特宝 生物 | 2020 年 1 月 9 日 | 2020 年 7 月 17 日 | 新股流 通受限 | 8.24 | 67.73 | 8,636 | 71,160.64 | 584,916.28 | - |
| 688158 | 优刻 得 | 2020 年 1 月 10 日 | 2020 年 7 月 20 日 | 新股流 通受限 | 33.23 | 68.38 | 4,255 | 141,393.65 | 290,956.90 | - |
| 688599 | 天合 光能 | 2020 年 6 月 2 日 | 2020 年 12 月 10 日 | 新股流 通受限 | 8.16 | 13.91 | 11,363 | 92,722.08 | 158,059.33 | - |

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风

险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制控制在合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | - | 113,000.00 |
| 未评级 | - | - |

| | | |
|----|---|------------|
| 合计 | - | 113,000.00 |
|----|---|------------|

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，针对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性风险预警及危机的处理、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性风险指标进行监控。

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 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 | 8,784,478.57 | - | - | - | 8,784,478.57 |
| 结算备付金 | 3,277,777.75 | - | - | - | 3,277,777.75 |
| 存出保证金 | 5,354.15 | - | - | - | 5,354.15 |
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | - | 71,656,479.31 | 71,656,479.31 |
| 交易性金融资产-债券投资、资产支持 证券 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 34,000,000.00 | - | - | - | 34,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 31,459.34 | 31,459.34 |
| 应收利息 | - | - | - | 2,433.45 | 2,433.45 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 212,407.04 | 212,407.04 |
| 资产总计 | 46,067,610.47 | - | - | 71,902,779.14 | 117,970,389.61 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 194,857.69 | 194,857.69 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 47,330.04 | 47,330.04 |
| 应付托管费 | - | - | - | 9,466.01 | 9,466.01 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 31,499.85 | 31,499.85 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 8,666.60 | 8,666.60 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 59,970.47 | 59,970.47 |
| 负债总计 | - | - | - | 351,790.66 | 351,790.66 |
| 利率敏感度缺口 | 46,067,610.47 | - | - | -71,550,988.48 | 117,618,598.95 |
| 上年度末 2019年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 10,453,180.47 | - | - | - | 10,453,180.47 |

| | | | | | |
|--------------|---------------|---|------------|---------------|----------------|
| 结算备付金 | 5,231,904.79 | - | - | - | 5,231,904.79 |
| 存出保证金 | 136,554.82 | - | - | - | 136,554.82 |
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | - | 65,882,450.71 | 65,882,450.71 |
| 交易性金融资产-债券投资 | 2,703,240.00 | - | 113,000.00 | - | 2,816,240.00 |
| 买入返售金融资产 | 54,000,000.00 | - | - | - | 54,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,009,048.88 | 1,009,048.88 |
| 应收利息 | - | - | - | 44,167.75 | 44,167.75 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 79,986.80 | 79,986.80 |
| 资产总计 | 72,524,880.08 | - | 113,000.00 | 67,015,654.14 | 139,653,534.22 |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 58,155.95 | 58,155.95 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 58,158.46 | 58,158.46 |
| 应付托管费 | - | - | - | 11,631.67 | 11,631.67 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 15,686.28 | 15,686.28 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 11,452.00 | 11,452.00 |
| 应交税费 | - | - | - | 0.57 | 0.57 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 35,045.59 | 35,045.59 |
| 负债总计 | - | - | - | 190,130.52 | 190,130.52 |
| 利率敏感度缺口 | 72,524,880.08 | - | 113,000.00 | 66,825,523.62 | 139,463,403.70 |

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。

6.4.12.4.1.2 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。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2020年6月30日） | 上年度末（2019年12月31日） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | - | 2,634.98 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | - | -2,634.98 |

注：本期末本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.12.4.2 外汇风险

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

6.4.12.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金部分投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.4.12.4.3.1 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 | | 上年度末 2019年12月31日 | |
|---------------|-------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 71,656,479.31 | 60.92 | 65,882,450.71 | 47.24 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | 2,816,240.00 | 2.02 |
| 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 | 71,656,479.31 | 60.92 | 68,698,690.71 | 49.26 |

6.4.12.4.3.2 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 | | |
|-------------|----------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2020年6月30日） | 上年度末（2019年12月31日） |
| | 业绩比较基准上升 5% | 6,395,176.00 | 1,203,917.36 |
| 业绩比较基准下降 5% | -6,395,176.00 | -1,203,917.36 | |

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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 | 71,656,479.31 | 60.74 |
| | 其中：股票 | 71,656,479.31 | 60.74 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 34,000,000.00 | 28.82 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 12,062,256.32 | 10.22 |
| 8 | 其他各项资产 | 251,653.98 | 0.21 |
| 9 | 合计 | 117,970,389.61 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 2,588,489.00 | 2.20 |
| C | 制造业 | 26,248,022.02 | 22.32 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,766.32 | 0.01 |
| E | 建筑业 | 1,676,708.00 | 1.43 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,094,496.00 | 0.93 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,664,106.90 | 1.41 |
| J | 金融业 | 34,165,789.80 | 29.05 |
| K | 房地产业 | 1,268,523.06 | 1.08 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,726,214.21 | 1.47 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,211,364.00 | 1.03 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 71,656,479.31 | 60.92 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

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 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 131,802 | 9,410,662.80 | 8.00 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 6,100 | 8,923,568.00 | 7.59 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 126,700 | 4,272,324.00 | 3.63 |
| 4 | 600276 | 恒瑞医药 | 45,093 | 4,162,083.90 | 3.54 |
| 5 | 600030 | 中信证券 | 101,400 | 2,444,754.00 | 2.08 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 152,665 | 2,409,053.70 | 2.05 |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 73,800 | 2,297,394.00 | 1.95 |
| 8 | 601398 | 工商银行 | 418,700 | 2,085,126.00 | 1.77 |
| 9 | 601888 | 中国中免 | 11,207 | 1,726,214.21 | 1.47 |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 331,500 | 1,700,595.00 | 1.45 |
| 11 | 600585 | 海螺水泥 | 28,900 | 1,529,099.00 | 1.30 |
| 12 | 600000 | 浦发银行 | 142,785 | 1,510,665.30 | 1.28 |
| 13 | 600016 | 民生银行 | 258,500 | 1,465,695.00 | 1.25 |
| 14 | 600031 | 三一重工 | 70,600 | 1,324,456.00 | 1.13 |
| 15 | 601012 | 隆基股份 | 32,200 | 1,311,506.00 | 1.12 |
| 16 | 601688 | 华泰证券 | 68,600 | 1,289,680.00 | 1.10 |
| 17 | 600048 | 保利地产 | 85,827 | 1,268,523.06 | 1.08 |
| 18 | 603259 | 药明康德 | 12,540 | 1,211,364.00 | 1.03 |
| 19 | 600837 | 海通证券 | 96,200 | 1,210,196.00 | 1.03 |
| 20 | 601668 | 中国建筑 | 253,200 | 1,207,764.00 | 1.03 |
| 21 | 601288 | 农业银行 | 349,000 | 1,179,620.00 | 1.00 |
| 22 | 601601 | 中国太保 | 38,100 | 1,038,225.00 | 0.88 |
| 23 | 600309 | 万华化学 | 19,100 | 954,809.00 | 0.81 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 24 | 601211 | 国泰君安 | 54,000 | 932,040.00 | 0.79 |
| 25 | 601988 | 中国银行 | 255,400 | 888,792.00 | 0.76 |
| 26 | 600009 | 上海机场 | 12,100 | 872,047.00 | 0.74 |
| 27 | 600588 | 用友网络 | 18,900 | 833,490.00 | 0.71 |
| 28 | 600690 | 海尔智家 | 46,000 | 814,200.00 | 0.69 |
| 29 | 600703 | 三安光电 | 30,800 | 770,000.00 | 0.65 |
| 30 | 600104 | 上汽集团 | 42,684 | 725,201.16 | 0.62 |
| 31 | 601818 | 光大银行 | 192,700 | 689,866.00 | 0.59 |
| 32 | 600745 | 闻泰科技 | 5,300 | 667,535.00 | 0.57 |
| 33 | 600028 | 中国石化 | 162,300 | 634,593.00 | 0.54 |
| 34 | 688278 | 特宝生物 | 8,636 | 584,916.28 | 0.50 |
| 35 | 601088 | 中国神华 | 40,300 | 578,708.00 | 0.49 |
| 36 | 600547 | 山东黄金 | 15,500 | 567,610.00 | 0.48 |
| 37 | 601628 | 中国人寿 | 20,300 | 552,363.00 | 0.47 |
| 38 | 600050 | 中国联通 | 111,500 | 539,660.00 | 0.46 |
| 39 | 601857 | 中国石油 | 117,500 | 492,325.00 | 0.42 |
| 40 | 603160 | 汇顶科技 | 2,200 | 490,380.00 | 0.42 |
| 41 | 600196 | 复星医药 | 14,346 | 485,612.10 | 0.41 |
| 42 | 601186 | 中国铁建 | 55,900 | 468,442.00 | 0.40 |
| 43 | 601336 | 新华保险 | 10,100 | 447,228.00 | 0.38 |
| 44 | 601989 | 中国重工 | 110,600 | 442,400.00 | 0.38 |
| 45 | 601138 | 工业富联 | 23,800 | 360,570.00 | 0.31 |
| 46 | 603993 | 洛阳钼业 | 85,900 | 315,253.00 | 0.27 |
| 47 | 688158 | 优刻得 | 4,255 | 290,956.90 | 0.25 |
| 48 | 601066 | 中信建投 | 6,000 | 236,280.00 | 0.20 |
| 49 | 601816 | 京沪高铁 | 35,600 | 221,788.00 | 0.19 |
| 50 | 601319 | 中国人保 | 25,200 | 162,288.00 | 0.14 |
| 51 | 688599 | 天合光能 | 11,363 | 158,059.33 | 0.13 |
| 52 | 601658 | 邮储银行 | 32,500 | 148,525.00 | 0.13 |
| 53 | 601236 | 红塔证券 | 4,700 | 91,180.00 | 0.08 |
| 54 | 688277 | 天智航 | 5,298 | 63,787.92 | 0.05 |
| 55 | 688528 | 秦川物联 | 4,741 | 53,715.53 | 0.05 |
| 56 | 688027 | 国盾量子 | 1,320 | 47,757.60 | 0.04 |
| 57 | 688600 | 皖仪科技 | 2,962 | 45,911.00 | 0.04 |
| 58 | 603087 | 甘李药业 | 344 | 34,503.20 | 0.03 |
| 59 | 600956 | 新天绿能 | 2,533 | 12,766.32 | 0.01 |
| 60 | 601111 | 中国国航 | 100 | 661.00 | 0.00 |
| 61 | 601939 | 建设银行 | 100 | 631.00 | 0.00 |
| 62 | 601766 | 中国中车 | 100 | 557.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|--------|------|
| 63 | 601390 | 中国中铁 | 100 | 502.00 | 0.00 |
|----|--------|------|-----|--------|------|

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 4,666,584.76 | 3.35 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 3,058,423.00 | 2.19 |
| 3 | 601601 | 中国太保 | 2,769,427.00 | 1.99 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 1,447,756.00 | 1.04 |
| 5 | 601398 | 工商银行 | 1,256,746.00 | 0.90 |
| 6 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,128,168.00 | 0.81 |
| 7 | 601336 | 新华保险 | 1,039,458.00 | 0.75 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 1,005,760.00 | 0.72 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 924,389.00 | 0.66 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 750,607.00 | 0.54 |
| 11 | 600588 | 用友网络 | 707,322.00 | 0.51 |
| 12 | 600585 | 海螺水泥 | 680,724.00 | 0.49 |
| 13 | 601688 | 华泰证券 | 611,052.00 | 0.44 |
| 14 | 600745 | 闻泰科技 | 584,378.00 | 0.42 |
| 15 | 600016 | 民生银行 | 572,978.00 | 0.41 |
| 16 | 601328 | 交通银行 | 565,712.00 | 0.41 |
| 17 | 600048 | 保利地产 | 554,816.00 | 0.40 |
| 18 | 601288 | 农业银行 | 527,361.00 | 0.38 |
| 19 | 600000 | 浦发银行 | 474,011.00 | 0.34 |
| 20 | 601668 | 中国建筑 | 466,877.00 | 0.33 |

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 4,091,016.14 | 2.93 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 2,339,869.00 | 1.68 |
| 3 | 601601 | 中国太保 | 2,318,830.00 | 1.66 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 1,088,408.00 | 0.78 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 1,061,462.00 | 0.76 |
| 6 | 601336 | 新华保险 | 948,625.00 | 0.68 |
| 7 | 600276 | 恒瑞医药 | 864,958.00 | 0.62 |
| 8 | 601766 | 中国中车 | 828,754.00 | 0.59 |
| 9 | 601288 | 农业银行 | 775,072.00 | 0.56 |
| 10 | 600016 | 民生银行 | 652,681.00 | 0.47 |
| 11 | 601939 | 建设银行 | 639,246.00 | 0.46 |
| 12 | 601390 | 中国中铁 | 638,107.00 | 0.46 |
| 13 | 600030 | 中信证券 | 583,486.00 | 0.42 |
| 14 | 600887 | 伊利股份 | 561,417.00 | 0.40 |
| 15 | 688266 | 泽璟制药 | 459,195.91 | 0.33 |
| 16 | 600048 | 保利地产 | 432,172.00 | 0.31 |
| 17 | 601328 | 交通银行 | 412,289.00 | 0.30 |
| 18 | 600340 | 华夏幸福 | 405,402.00 | 0.29 |
| 19 | 688588 | 凌志软件 | 384,185.65 | 0.28 |
| 20 | 601668 | 中国建筑 | 348,418.00 | 0.25 |

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 | 35,881,389.73 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 33,942,499.19 |

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除中国工商银行股份有限公司（工商银行）、交通银行股份有限公司（交通银行）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2020 年 5 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监罚决字（2020）7 号），对中国工商银行股份有限公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在理财产品数量漏报、资金交易信息漏报严重、信贷资产转让业务漏报、贷款核销业务漏报、分户账明细记录应报未报等违法违规事实进行处罚。

2020 年 5 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监罚决字（2020）6 号），对交通银行股份有限公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在理财产品数量漏报、资金交易信息漏报严重、贸易融资业务漏报、信贷业务担保合同漏报、分户账明细记录应报未报等违法违规事实进行处罚。

本基金采用量化的方式进行资产配置和选股，其中股票仓位通常会以某个指数作为基准，银行业在上证 50 指数成分股和沪深 300 指数成分股中都占有很大比重，故很多时候股票组合中持有多家银行，同时我们认为工商银行、交通银行所受处罚并未对其投资价值产生实质性的负面影响，所以依然持有该股票并未进行专门的减仓操作。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 5,354.15 |
| 2 | 应收证券清算款 | 31,459.34 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,433.45 |

| | | |
|---|-------|------------|
| 5 | 应收申购款 | 212,407.04 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 251,653.98 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§ 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 |
| 中金瑞祥 A | 4,854 | 492.30 | 2,320,593.97 | 97.11% | 69,033.57 | 2.89% |
| 中金瑞祥 C | 40 | 2,444,780.05 | 95,402,559.17 | 97.56% | 2,388,642.92 | 2.44% |
| 合计 | 4,894 | 20,470.13 | 97,723,153.14 | 97.55% | 2,457,676.49 | 2.45% |

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 | 中金瑞祥 A | 100.40 | 0.0042% |
| | 中金瑞祥 C | 0.00 | 0.0000% |
| | 合计 | 100.40 | 0.0001% |

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的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中金瑞祥 A | 中金瑞祥 C |
|---------------------------------|--------------|----------------|
| 基金合同生效日（2018 年 11 月 13 日）基金份额总额 | 8,130,113.21 | 195,822,910.99 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 657,911.48 | 130,908,333.10 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,247,740.55 | 48,232,549.69 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,516,024.49 | 81,349,680.70 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 2,389,627.54 | 97,791,202.09 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2020年5月28日，本基金管理人发布公告，公司产生第三届董事会，由以下九名董事组成：楚钢先生、黄劲峰先生、徐翌成先生、孙菁女士、赵璧先生、汤琰女士、冒大卫先生（独立董事）、王元先生（独立董事）、江勇先生（独立董事）。原第二届董事会成员陈刚先生、李永先生、张春先生（独立董事）不再担任公司董事职务。

2020年6月30日，本基金管理人发布公告，邱延冰先生自2020年6月30日起担任公司副总经理，分管公司投资研究业务；李永先生自同日起不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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

本基金本报告期内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

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

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 | |
| 中金财富证券 | 2 | 66,540,295.95 | 100.00% | 48,661.46 | 100.00% | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|-------|---|---|---|---|---|---|
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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 |
| 中金财富证券 | 234,002.97 | 100.00% | 2,651,500,000.00 | 100.00% | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|-----------|------------|
| 1 | 中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020年1月11日 |
| 2 | 中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020年1月11日 |
| 3 | 中金基金管理有限公司旗下部分基金2019年第4季度报告提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020年1月18日 |
| 4 | 中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金2019年第4季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2020年1月18日 |
| 5 | 中金基金管理有限公司关于旗下28只基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同和托管协议的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020年1月18日 |
| 6 | 中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同、托管协议 | 中国证监会规定媒介 | 2020年1月18日 |
| 7 | 中金基金管理有限公司关于 | 中国证监会规定媒介 | 2020年1月18日 |

| | | | |
|----|---|-----------|-----------------|
| | 旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 介 | |
| 8 | 中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书及其摘要（2020 年第 1 号） | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 1 月 21 日 |
| 9 | 关于 2020 年春节假期延长及休市的相关通知 | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 1 月 31 日 |
| 10 | 中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 2 月 12 日 |
| 11 | 中金基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 3 月 21 日 |
| 12 | 中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 4 月 4 日 |
| 13 | 中金基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 4 月 21 日 |
| 14 | 中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告及其摘要 | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 4 月 21 日 |
| 15 | 中金基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 4 月 22 日 |
| 16 | 中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 4 月 22 日 |
| 17 | 中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 4 月 23 日 |
| 18 | 中金基金管理有限公司关于董事变更的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 5 月 28 日 |
| 19 | 中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 6 月 11 日 |
| 20 | 中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 6 月 18 日 |
| 21 | 中金基金管理有限公司副总经理变更公告 | 中国证监会规定媒介 | 2020 年 6 月 30 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--------|----------------|------------------------------------|---------------|---------------|------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2020 年 04 月 16 日至 2020 年 06 月 30 日 | 0.00 | 46,138,902.38 | 0.00 | 46,138,902.38 | 46.06% |
| | 2 | 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 | 49,622,866.22 | 0.00 | 0.00 | 49,622,866.22 | 49.53% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形。如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，从而可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金募集的注册文件
- 2、《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、本报告期内在指定媒介上披露的有关本基金的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金合同、托管协议及其余备查文件存放在基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件和复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2020年8月29日