

中金恒瑞债券型集合资产管理计划 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：中国国际金融股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	39
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	39
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	39

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	39
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.11 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	41
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金恒瑞债券型集合资产管理计划	
基金简称	集合-中金恒瑞债券	
基金主代码	920007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年6月3日	
基金管理人	中国国际金融股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,975,042,257.23份	
基金合同存续期	本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期至2024年12月31日。自2024年12月31日后,本集合计划是否存续按照中国证监会有关规定执行。	
下属分级基金的基金简称	集合-中金恒瑞债券 A	集合-中金恒瑞债券 C
下属分级基金的交易代码	920007	920927
报告期末下属分级基金的份额总额	115,403,504.38份	2,859,638,752.85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	本集合计划主要投资于债券资产,在保持集合计划资产流动性和严格控制集合计划资产风险的前提下,通过积极主动的管理,力争实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	采用资产配置策略,本集合计划将密切关注经济基本面、货币政策、财政政策、监管政策及国家产业政策的变化,分析资本市场环境,考量各类资产的市场流动性、风险收益特征,在各类资产之间进行动态配置,以实现集合计划资产的长期稳健增值。固定收益类策略包含债券投资策略、银行存款投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略和可转换债券/可交换债券投资策略。债券投资策略主要包括杠杆策略、久期策略、类属配置策略、期限结构策略和择券策略。
业绩比较基准	本集合计划采用“中债总全价指数收益率”作为业绩比较基准
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划,其预期收益和预期风险通常高于货币市场基金,低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、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	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	宋璐芳	王小飞

负责人	联系电话	010-65051166	021-60637103
	电子邮箱	songlf@cicc.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		010-65051166	021-60637228
传真		86(10)65059372	021-60637228
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	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100004	100032
法定代表人		陈亮	张金良

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	www.cicc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	集合--中金恒瑞债券 A	集合--中金恒瑞债券 C
本期已实现收益	2,494,859.88	54,524,331.82
本期利润	2,323,344.82	49,970,421.12
加权平均基金份额 本期利润	0.0196	0.0168
本期加权平均净 值利润率	1.64%	1.43%
本期基金份额净 值增长率	1.68%	1.48%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	22,915,384.93	487,823,042.98
期末可供分配基金份额利润	0.1986	0.1706
期末基金资产净值	138,318,889.31	3,380,292,629.28
期末基金份额净值	1.1986	1.1821
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	16.56%	15.80%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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-中金恒瑞债券 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	0.24%	0.01%	0.72%	0.04%	-0.48%	-0.03%
过去三个月	0.72%	0.02%	0.98%	0.09%	-0.26%	-0.07%
过去六个月	1.68%	0.02%	2.24%	0.09%	-0.56%	-0.07%
过去一年	3.24%	0.02%	3.05%	0.08%	0.19%	-0.06%
过去三年	10.18%	0.08%	6.26%	0.08%	3.92%	0.00%
自基金合同生效起至今	16.56%	0.16%	4.99%	0.09%	11.57%	0.07%

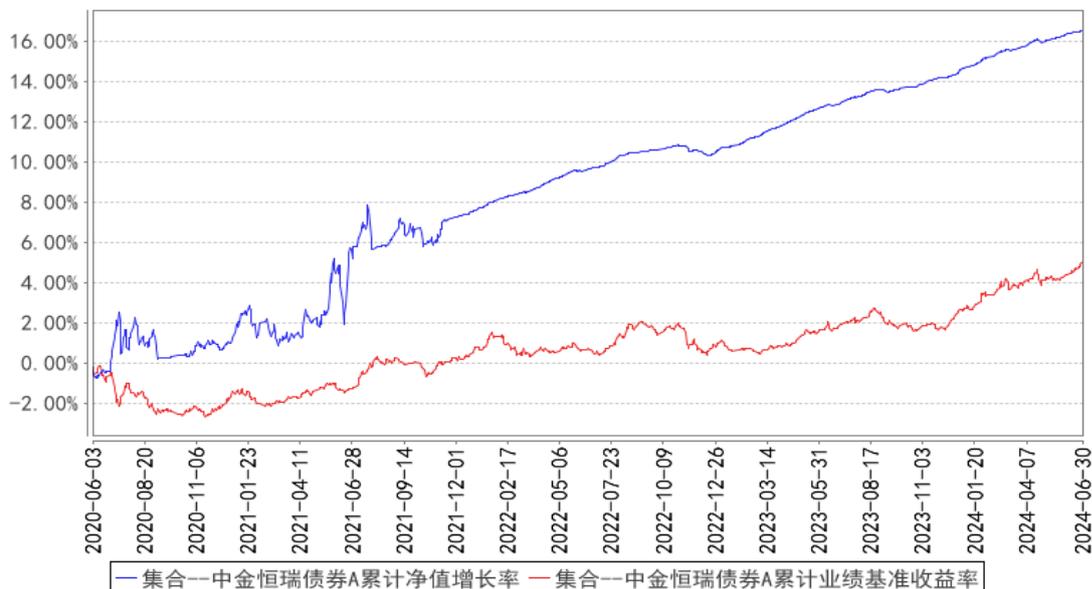
集合-中金恒瑞债券 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

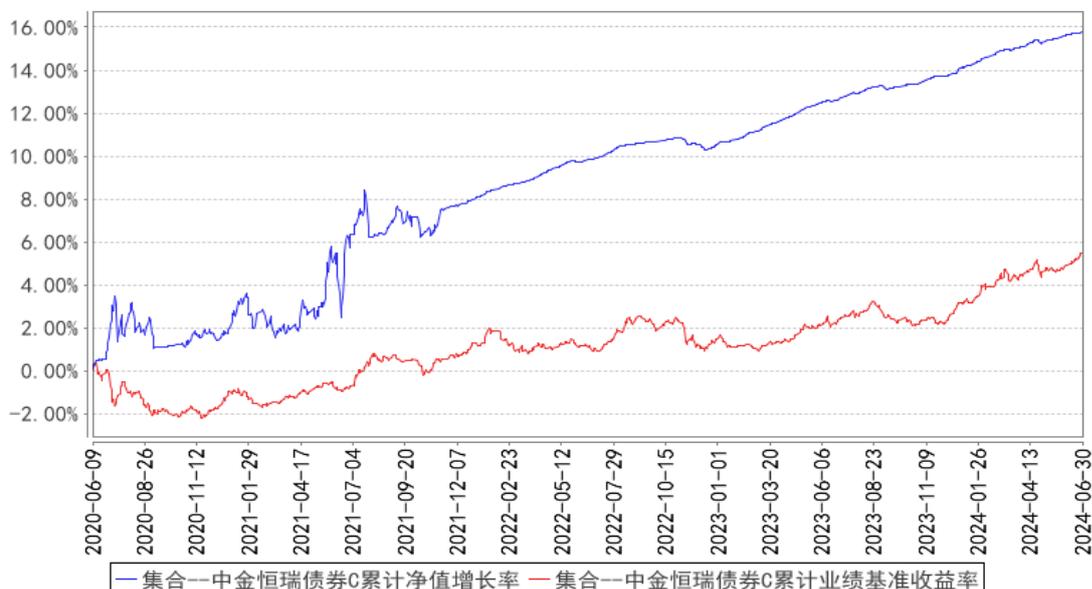
过去一个月	0.20%	0.01%	0.72%	0.04%	-0.52%	-0.03%
过去三个月	0.62%	0.02%	0.98%	0.09%	-0.36%	-0.07%
过去六个月	1.48%	0.02%	2.24%	0.09%	-0.76%	-0.07%
过去一年	2.82%	0.02%	3.05%	0.08%	-0.23%	-0.06%
过去三年	8.86%	0.08%	6.26%	0.08%	2.60%	0.00%
自基金合同生效起至今	15.80%	0.16%	5.51%	0.09%	10.29%	0.07%

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

集合-中金恒瑞债券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-中金恒瑞债券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



§ 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（中金公司，601995.SH，3908.HK）成立于 1995 年，总部位于北京。中金公司一直致力于为多元化的客户群体提供高质量金融增值服务，建立了以研究和信息技术为基础，投资银行、股票业务、固定收益、资产管理、私募股权和财富管理全方位发展的业务结构。2015 年，中金公司在香港联交所主板成功挂牌上市。2020 年，中金公司在上海证券交易所主板成功挂牌上市。

中金公司资产管理部成立于 2002 年，参照国际行业标准与国内监管要求，构建了面向境内外市场统一的资产管理业务平台，为客户提供高质量的投资管理服务，努力实现客户资产的长期增值。中金资管业务牌照齐全、产品丰富；拥有全国社保基金管理人、企业年金投资管理人、职业年金管理人、保险资金投资管理人、境内集合/单一资产管理计划、境内合格机构投资者（QDII）、人民币境内合格机构投资者（RQDII）、境外合格机构投资者（QFII）、人民币境外合格机构投资者（RQFII）等多项业务资格。中金公司在香港设立了独立的资产管理公司——中国国际金融香港资产管理有限公司（以下简称“中金香港资管公司”），拥有香港《证券及期货条例》下第 1 类（证券交易）、第 4 类（就证券提供意见）和第 9 类（提供资产管理）SFC 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 2024 年 6 月 30 日，旗下已有七只存续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、中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划、中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划、中金优势领航一年持有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		
安安	本基金的基金经理	2021 年 12 月 1 日	-	16 年	安安女士，2012 年加入中金公司固定收益部自营交易团队，从事利率债交易、利率互换、国债期货等衍生品交易，2018 年加入中金公司固收资管业务团队，现担任资产管理部固定收益投资总监。2008 年加入中银国际证券定息收益部自营交易

					团队，历任交易员、高级经理。
臧子琪	本基金的基金经理	2021年12月1日	-	8.01年	臧子琪女士，2019年加入中金公司固收资管业务团队，现担任资产管理部固定收益投资经理。2016年加入创金合信基金，历任固定收益交易员、投资经理助理。
王铭薇	本基金的基金经理助理	2024年4月16日	-	3.96年	王铭薇女士，清华大学金融学硕士，2020年加入中国国际金融股份有限公司，曾任交易员、投资经理助理。现任中金恒瑞债券型集合资产管理计划基金经理助理、中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划基金经理助理、中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划基金经理助理。

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

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

(3) 本集合计划基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理；

(4) 证券从业的涵义参照行业的相关规定，包括资管相关从业经历；

(5) 从业年限按照实际从事相关工作起算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2024 年上半年，债券市场收益率整体震荡下行。具体来看，资金面整体保持平稳，存款利率下调引导银行存款流入非银机构，理财规模持续增长。市场结构性资产荒持续，各类机构配置需求较大，各类债券品种期限利差及信用利差持续收窄。本产品在上半年积极配置，精选性价比较高的中高评级信用债券，根据市场变化合理调整杠杆，获得一定的利差收益。同时，产品持续保持中短久期，并根据市场情况进行一定的灵活调整，在适当降低产品波动的前提下，力争保持较好的收益弹性。

后续本产品整体仍以中高评级信用债作为主要配置品种，视市场情况维持中短久期，合理平衡产品流动性与收益性，在控制产品回撤风险的前提下，努力获得超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1986 元，份额累计净值为 1.7993 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1821 元，份额累计净值为 1.2121 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 1.68%，同期业绩比较基准收益率为 2.24%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 1.48%，同期业绩比较基准收益率为 2.24%。

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 2024 年下半年，在货币政策保持稳健的前提下，结合基本面情况与机构配置需求，低利率环境或仍将延续。此外，下半年地方债供给或将放量，海外市场波动可能加大，债市扰动因素仍存。但总体来看，债券类资产仍具备配置价值。同时，在信用利差持续压缩的情况下，信用债配置仍需精耕细作，合理挑选高性价比品种，并根据市场波动合理调整组合久期。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据企业会计准则、中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，估值委员会负责组织制定所管理资管产品的估值政策和程序，以及特殊情况下的估值决策。定期对估值政策与程序进行评价，在发生影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时修订估值政策及程序。使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告

机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行利润分配。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金恒瑞债券型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	6,188,754.03	4,383,285.70
结算备付金		28,335,022.13	15,931,257.45

存出保证金		184,260.01	53,323.79
交易性金融资产	6.4.7.2	4,340,401,463.54	3,704,558,238.90
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,057,172,165.48	3,628,681,225.21
资产支持证券投资		283,229,298.06	75,877,013.69
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	49,972,348.65
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		74,284,404.82	431,662.07
应收股利		-	-
应收申购款		5,493,705.09	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,454,887,609.62	3,775,330,116.56
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2024年6月30日	2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		922,700,578.74	741,543,105.27
应付清算款		113,793.69	965,893.60
应付赎回款		10,409,505.65	1,759,034.92
应付管理人报酬		885,987.10	818,288.50
应付托管费		295,329.06	272,762.84
应付销售服务费		1,135,082.67	1,039,113.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		335,735.48	229,474.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	400,078.64	625,346.34
负债合计		936,276,091.03	747,253,019.05
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,975,042,257.23	2,597,953,970.78
未分配利润	6.4.7.12	543,569,261.36	430,123,126.73
净资产合计		3,518,611,518.59	3,028,077,097.51

负债和净资产总计		4,454,887,609.62	3,775,330,116.56
----------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,975,042,257.23 份，其中集合--中金恒瑞债券 A 基金份额总额 115,403,504.38 份，基金份额净值 1.1986 元；集合--中金恒瑞债券 C 基金份额总额 2,859,638,752.85 份，基金份额净值 1.1821 元。

6.2 利润表

会计主体：中金恒瑞债券型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		76,048,510.33	101,266,034.30
1. 利息收入		575,738.05	1,435,235.66
其中：存款利息收入	6.4.7.13	299,558.49	202,936.48
债券利息收入		-	-
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		276,179.56	1,232,299.18
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		80,109,952.95	86,056,856.82
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	78,255,437.00	92,296,827.15
资产支持证券 投资收益	6.4.7.16	3,116,904.62	329,373.92
贵金属投资收 益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-1,262,388.67	-6,569,344.25
股利收益	6.4.7.19	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	6.4.7.20	-4,725,425.76	13,362,632.73
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.21	88,245.09	411,309.09
减：二、营业总支出		23,754,744.39	25,788,764.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,419,579.69	5,867,541.74

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,806,526.57	1,955,847.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,945,363.67	7,020,396.10
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		9,179,248.70	10,582,057.99
其中：卖出回购金融资产支出		9,179,248.70	10,582,057.99
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		254,762.73	224,133.42
8. 其他费用	6.4.7.23	149,263.03	138,787.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		52,293,765.94	75,477,270.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		52,293,765.94	75,477,270.17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		52,293,765.94	75,477,270.17

6.3 净资产变动表

会计主体：中金恒瑞债券型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,597,953,970.78	-	430,123,126.73	3,028,077,097.51
二、本期期初净资产	2,597,953,970.78	-	430,123,126.73	3,028,077,097.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	377,088,286.45	-	113,446,134.63	490,534,421.08
（一）、综合收益总额	-	-	52,293,765.94	52,293,765.94
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	377,088,286.45	-	61,152,368.69	438,240,655.14
其中：1. 基金申购款	1,952,857,184.80	-	337,975,816.09	2,290,833,000.89

2. 基金赎回款	-1,575,768,898.35	-	-276,823,447.40	-1,852,592,345.75
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,975,042,257.23	-	543,569,261.36	3,518,611,518.59
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,935,908,253.86	-	253,255,372.28	2,189,163,626.14
二、本期期初净资产	1,935,908,253.86	-	253,255,372.28	2,189,163,626.14
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,527,670,327.94	-	266,885,838.88	1,794,556,166.82
(一)、综合收益总额	-	-	75,477,270.17	75,477,270.17
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,527,670,327.94	-	191,408,568.71	1,719,078,896.65
其中:1. 基金申购款	5,355,576,500.98	-	739,066,824.42	6,094,643,325.40
2. 基金赎回款	-3,827,906,173.04	-	-547,658,255.71	-4,375,564,428.75
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,463,578,581.80	-	520,141,211.16	3,983,719,792.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

孙男

基金管理人负责人

蒙强敏

主管会计工作负责人

赵阳光

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金恒瑞债券型集合资产管理计划(以下简称“本基金”)由中金增强型债券收益集合资产管理计划变更而来。中金增强型债券收益集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划,于2008年12月10日经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]1388号文核准设立,自2009年1月5日起开始募集,于2009年2月20日结束募集工作,并于2009年2月26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”)和中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)作为推广机构,自2009年1月5日至2009年2月20日进行推广。中金增强型债券收益集合资产管理计划于2009年2月26日成立,成立之日基金实收份额为738,067,730.66份(含利息转份额998,043.01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。

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,中金增强型债券收益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6月3日起,《中金恒瑞债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效,原《中金增强型债券收益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至2024年12月31日。本基金自2024年12月31日后,按照中国证监会有关规定执行。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括债券(含国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等债券)、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)、国债期货、货币市场工具、现金等,以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金不直接买入股票等权益类资产,也不参与新股申购和新股增发,但可持有因可转换债券转股所形成的股票,该等股票应当在其可交易之日起15个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,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:债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;每个交易日日终,在扣除国债期货合约

需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。本基金采用“中债总全价指数收益率”作为业绩比较基准。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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的说明

本基金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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

本基金运作过程中涉及的各项纳税事项，依照财政部、国家税务总局的相关规定以及其他相关规定执行。主要税项列示如下：

(1)根据财政部和国家税务总局发布的《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016] 36 号)、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016] 140 号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017] 2 号)及《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017] 56 号)，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。

(2) 截至财务报表批准日，财政部和国家税务总局并未就本基金的所得税事项出台具体规定。本报告期内，本基金没有计提所得税费用。如果涉及本基金业务的有关税收法规在未来得以明确，财务报表就此所作出的估计可能会根据相关税务法规而作出调整。

(3) 本基金进行的证券交易所适用的印花税税率为 0.10%，根据《关于减半征收证券交易印花税的公告》（财政部税务总局公告 2023 年第 39 号），自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易所适用的印花税实施减半征收。根据财政部和国家税务总局的有关规定，证券（股票）交易印花税征收方式为单边征收，即仅对出让方征收印花税，对受让方不再征税。

(4) 根据《中华人民共和国个人所得税法》、《国家税务总局关于加强企业债券利息个人所得税代扣代缴工作的通知》（国税函〔2003〕612 号）、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2012〕85 号）及《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〔2015〕101 号）、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局公告 2024 年第 8 号）及其他相关税务法规的规定，个人投资者直接投资股票或债券的，上市公司及债券兑付机构派发或支付给个人投资者的股息红利及债券利息收入应由上市公司及债券兑付机构对相应个人所得税进行代扣代缴。截至目前，由于没有专门针对本基金作为上述股息红利及债券利息个人所得税代扣代缴义务人的明确税务规定，经与托管行协商一致，本基金对本报告期内所取得的股息红利收入不计提股息红利个人所得税；本基金在实际取得债券利息收入时按收到的利息金额确认收入，不计提债券利息个人所得税。如果上述税务事项的最终认定结果与估计存在差异，该差异将可能对作出上述最终认定所对应期间的应代扣代缴所得税和净资产金额产生影响。

(5) 对本基金在运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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附加。

(6) 基金运作过程中如涉及境外投资的税项问题，根据《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2014〕81 号文）、《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税〔2016〕127 号文）及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	6,188,754.03
等于：本金	6,186,941.52
加：应计利息	1,812.51
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	6,188,754.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,201,806,060.00	34,789,209.59	1,235,531,209.59	-1,064,060.00
	银行间市场	2,764,283,482.19	57,013,955.89	2,821,640,955.89	343,517.81
	合计	3,966,089,542.19	91,803,165.48	4,057,172,165.48	-720,542.19
资产支持证券	278,552,300.00	4,075,098.06	283,229,298.06	601,900.00	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	4,244,641,842.19	95,878,263.54	4,340,401,463.54	-118,642.19	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2024 年 6 月 30 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	-
应付交易费用	299,032.44
其中：交易所市场	231,972.46
银行间市场	67,059.98
应付利息	-
预提费用	101,046.20
合计	400,078.64

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

集合-中金恒瑞债券 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	117,044,614.02	117,044,614.02
本期申购	31,434,291.21	31,434,291.21
本期赎回（以“-”号填列）	-33,075,400.85	-33,075,400.85
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	115,403,504.38	115,403,504.38

集合-中金恒瑞债券 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,480,909,356.76	2,480,909,356.76
本期申购	1,921,422,893.59	1,921,422,893.59
本期赎回（以“-”号填列）	-1,542,693,497.50	-1,542,693,497.50
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	2,859,638,752.85	2,859,638,752.85

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

集合-中金恒瑞债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,586,978.50	-5,654,687.03	20,932,291.47
本期期初	26,586,978.50	-5,654,687.03	20,932,291.47
本期利润	2,494,859.88	-171,515.06	2,323,344.82
本期基金份额交易产生的变动数	-438,491.45	98,240.09	-340,251.36
其中：基金申购款	7,428,027.93	-1,522,807.11	5,905,220.82
基金赎回款	-7,866,519.38	1,621,047.20	-6,245,472.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,643,346.93	-5,727,962.00	22,915,384.93

集合-中金恒瑞债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	377,501,921.37	31,688,913.89	409,190,835.26
本期期初	377,501,921.37	31,688,913.89	409,190,835.26
本期利润	54,524,331.82	-4,553,910.70	49,970,421.12
本期基金份额交易产生的变动数	55,796,789.79	5,695,830.26	61,492,620.05
其中：基金申购款	307,698,593.32	24,372,001.95	332,070,595.27
基金赎回款	-251,901,803.53	-18,676,171.69	-270,577,975.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	487,823,042.98	32,830,833.45	520,653,876.43

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	53,208.37
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	245,035.79
其他	1,314.33
合计	299,558.49

注：此处其他列示的是存出保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	72,303,610.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,951,826.98
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	78,255,437.00

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,108,301,112.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,978,876,768.02
减：应计利息总额	123,062,899.94
减：交易费用	409,617.91
买卖债券差价收入	5,951,826.98

注：卖出债券成交总额中扣除了债券投资收益中增值税的影响。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	3,117,904.72
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-1,000.10
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	3,116,904.62

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	4,534,508.22
减：卖出资产支持证券成本总额	4,448,700.00
减：应计利息总额	85,808.22
减：交易费用	1,000.10
资产支持证券投资收益	-1,000.10

注：卖出资产支持证券成交总额中扣除了资产支持证券投资收益中增值税的影响。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
国债期货投资收益	-1,262,388.67

6.4.7.19 股利收益

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,737,060.83
股票投资	-
债券投资	-5,302,560.83
资产支持证券投资	565,500.00
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-11,635.07
合计	-4,725,425.76

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	87,309.47
其他	935.62
合计	88,245.09

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	32,073.86
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	38,916.83
银行间账户维护费	18,600.00
合计	149,263.03

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国国际金融股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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（%）
中金公司	3,655,804,670.00	100.00	1,392,357,865.00	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例（%）
中金公司	31,348,097,000.00	100.00	14,470,221,368.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	659,861.48	100.00	231,972.46	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	-	-	-	-

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。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等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,419,579.69	5,867,541.74
其中：应支付销售机构的客户维 护费	2,626,079.87	2,722,432.40
应支付基金管理人的净管理费	2,793,499.82	3,145,109.34

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 0.30% 的年费率计提，逐日计提并按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,806,526.57	1,955,847.25

注：支付托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，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×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	集合--中金恒瑞债券 A	集合--中金恒瑞债券 C	合计
中国中金财富证券有限公司	0.00	6,658,561.54	6,658,561.54
合计	0.00	6,658,561.54	6,658,561.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	集合--中金恒瑞债券 A	集合--中金恒瑞债券 C	合计
中国中金财富证券有限公司	0.00	6,745,702.41	6,745,702.41
中金公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	6,745,702.41	6,745,702.41

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 0.40% 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 类基金份额资产净值 × 0.40% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国建设银行股份有限公司	6,188,754.03	53,208.37	25,627,596.85	107,120.17

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量（张）	期末估值总额
220214	22 国开 14	2024年7月 1日	100.45	1,388,000	139,428,070.00
230214	23 国开 14	2024年7月 1日	101.15	348,000	35,200,379.67
240214	24 国开 14	2024年7月	101.37	2,100,000	212,879,826.92

		1 日			
2020043	20 苏州银行二级	2024 年 7 月 5 日	106.90	122,000	13,042,160.00
2022025	20 招银租赁二级	2024 年 7 月 5 日	106.34	700,000	74,435,073.77
2180219	21 温州铁投债 02	2024 年 7 月 5 日	100.73	231,000	23,268,092.05
合计				4,889,000	498,253,602.41

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 459,604,018.46 元，于 2024 年 7 月 1 日、2024 年 7 月 2 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人在公司层面建立了包括董事会(下设风险控制委员会)、管理委员会(下设风险委员会)、首席风险官、风险管理执行部门及内部审计部在内的全面风险管理组织架构。其中董事会是风险管理最高决策机构，审议公司风险管理总体目标、风险偏好、制度、风险评估报告、机构设置及其职责，以及根据法律法规和公司章程等规定的其他职责；管理委员会对公司全面风险管理的有效性承担主要责任；风险管理执行部门包括资产管理部等业务部门及风险管理部、法律合规部等中后台内控部门，业务部门承担风险管理第一道防线的职责，中后台内控部门从各自职能角度独立管理风险；内部审计部独立负责检查及监控公司内部控制执行情况。

本基金管理人在资产管理部层面建立了由风险管理委员会、风控组、相关业务组共同构成的多层次风险管理体系。在风险管理委员会的统一领导下，风控组独立开展工作，对风险进行统一管理，并对各业务岗位的风险控制与合规管理工作进行监督和指导。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致计划资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的货币资金存放在本基金托管人建设银行，因而与货币资金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，违约风险可能性很小；在银行间同

业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	61,204,314.20	192,805,543.90
合计	61,204,314.20	192,805,543.90

注：未评级债券包括期限一年以内的短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	196,691,832.33	-
合计	196,691,832.33	-

注：未评级债券包括期限一年以内的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	1,368,352,196.37	2,612,958,464.22
AAA 以下	1,059,582,120.25	345,348,644.76
未评级	1,371,341,702.33	477,568,572.33
合计	3,799,276,018.95	3,435,875,681.31

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包括期限一年以上的政策性金融债、公司债及中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	29,791,410.11	9,002,958.90

AAA 以下	253,437,887.95	66,874,054.79
未评级	-	-
合计	283,229,298.06	75,877,013.69

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，导致不能以适当的价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金的流动性风险一方面来自于计划委托人于约定开放日要求退出计划，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难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。

针对资产层面的流动性风险，本基金管理人通过限制投资集中度等方式来管理投资品种变现的流动性风险，根据市场运行情况制订合适的风险控制目标和方法，通过各类风险控制指标对流动性风险进行监控和防范。本基金所持大部分交易性金融资产在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，未持有其他有重大流动性风险的投资品种。针对由于委托人退出造成的流动性风险，本基金管理人采取一系列措施防范风险，如规定在开放期内方可办理退出、保持一定比例的现金、在极端情况下启用暂停退出的机制。总体来说，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

除卖出回购金融资产款外，其他金融负债的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎

回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的资产管理人通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有货币资金、结算备付金、存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,186,941.52	-	-	1,812.51	6,188,754.03
结算备付金	28,322,682.08	-	-	12,340.05	28,335,022.13
存出保证金	184,177.21	-	-	82.80	184,260.01
交易性金融资产	3,444,963,200.00	799,560,000.00	-	95,878,263.54	4,340,401,463.54
应收申购款	-	-	-	5,493,705.09	5,493,705.09
应收清算款	-	-	-	74,284,404.82	74,284,404.82
资产总计	3,479,657,000.81	799,560,000.00	-	175,670,608.81	4,454,887,609.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,409,505.65	10,409,505.65
应付管理人报酬	-	-	-	885,987.10	885,987.10
应付托管费	-	-	-	295,329.06	295,329.06
应付清算款	-	-	-	113,793.69	113,793.69
卖出回购金融资产款	922,592,992.51	-	-	107,586.23	922,700,578.74
应付销售服务费	-	-	-	1,135,082.67	1,135,082.67
应交税费	-	-	-	335,735.48	335,735.48
其他负债	-	-	-	400,078.64	400,078.64
负债总计	922,592,992.51	-	-	13,683,098.52	936,276,091.03
利率敏感度缺口	2,557,064,008.30	799,560,000.00	-	-161,987,510.29	3,518,611,518.59
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	4,376,046.04	-	-	7,239.66	4,383,285.70
结算备付金	15,923,381.77	-	-	7,875.68	15,931,257.45
存出保证金	53,297.39	-	-	26.40	53,323.79
交易性金融资产	2,510,180,300.00	683,233,000.00	453,705,000.00	57,439,938.90	3,704,558,238.90
买入返售金融资产	49,938,499.38	-	-	33,849.27	49,972,348.65
应收清算款	-	-	-	431,662.07	431,662.07
资产总计	2,580,471,524.58	683,233,000.00	453,705,000.00	57,920,591.98	3,775,330,116.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,759,034.92	1,759,034.92
应付管理人报酬	-	-	-	818,288.50	818,288.50
应付托管费	-	-	-	272,762.84	272,762.84
应付清算款	-	-	-	965,893.60	965,893.60
卖出回购金融资产款	741,253,587.39	-	-	289,517.88	741,543,105.27
应付销售服务费	-	-	-	1,039,113.05	1,039,113.05
应交税费	-	-	-	229,474.53	229,474.53
其他负债	-	-	-	625,346.34	625,346.34
负债总计	741,253,587.39	-	-	5,999,431.66	747,253,019.05
利率敏感度缺口	1,839,217,937.19	683,233,000.00	453,705,000.00	51,921,160.32	3,028,077,097.51

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2. 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3. 此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	9,314,675.00	7,891,725.00
	市场利率上升 25 个基点	-9,314,675.00	-7,891,725.00

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指本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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的资产管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过建立风险管理组织体系，对其他价格风险进行持续的度量和分析，以对该风险进行有效地管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	4,340,401,463.54	123.36	3,704,558,238.90	122.34
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	4,340,401,463.54	123.36	3,704,558,238.90	122.34

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若对市场价格敏感的交易性金融资产的市价上升或下降 5%。		
	2. 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	交易性金融资产的市价上升 5%	217,020,073.18	185,227,911.95
	交易性金融资产的市价下降 5%	-217,020,073.18	-185,227,911.95

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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：

- (1) 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- (2) 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；
- (3) 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	4,340,401,463.54	3,704,558,238.90
第三层次	-	-
合计	4,340,401,463.54	3,704,558,238.90

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,340,401,463.54	97.43
	其中：债券	4,057,172,165.48	91.07
	资产支持证券	283,229,298.06	6.36
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	34,523,776.16	0.77
8	其他各项资产	79,962,369.92	1.79
9	合计	4,454,887,609.62	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	806,893,852.43	22.93
	其中：政策性金融债	555,395,549.75	15.78
4	企业债券	1,265,749,510.96	35.97
5	企业短期融资券	61,204,314.20	1.74
6	中期票据	1,726,632,655.56	49.07
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	196,691,832.33	5.59
9	其他	-	-
10	合计	4,057,172,165.48	115.31

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	240214	24 国开 14	2,100,000	212,879,826.92	6.05
2	220214	22 国开 14	2,000,000	200,905,000.00	5.71
3	230214	23 国开 14	1,400,000	141,610,722.83	4.02
4	102103131	21 衡阳城投 MTN003	1,100,000	113,103,923.50	3.21
5	112402037	24 工商银行 CD037	1,000,000	98,365,713.97	2.80

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量 (份)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	261617	漳州 010A	700,000	71,258,542.47	2.03
2	262094	漳州 11A	600,000	60,325,923.29	1.71
3	260374	漳州 09A	500,000	51,246,506.85	1.46
4	143930	庐陵二 3A	350,000	35,639,771.23	1.01
5	143305	庐陵二 1A	260,000	26,933,221.92	0.77
6	261686	陕焦 04 优	150,000	15,146,732.88	0.43
7	144209	先投贰 1A	100,000	10,059,465.75	0.29
8	262190	莆投 02 优	80,000	8,033,922.19	0.23
9	143906	科租 9A1	90,000	4,585,211.48	0.13

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国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货的投资交易，选择流动性较好、交易较活跃的合约进行交易，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，并力求实现资产的长期稳健增值。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金参与国债期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对可控。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

7.11.3 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	184,260.01
2	应收清算款	74,284,404.82
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,493,705.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,962,369.92

7.11.4 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的处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
集合--中金恒瑞债券 A	663	174,062.60	31,039,795.02	26.90	84,363,709.36	73.10
集合--中金恒瑞债券 C	21,482	133,117.90	183,993,752.12	6.43	2,675,645,000.73	93.57
合计	22,014	135,143.19	215,033,547.14	7.23	2,760,008,710.09	92.77

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	集合--中金恒瑞债券 A	19,572.37	0.0170
	集合--中金恒瑞债券 C	496,026.22	0.0173
	合计	515,598.59	0.0173

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	集合--中金恒瑞债券 A	0
	集合--中金恒瑞债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	集合--中金恒瑞债券 A	0
	集合--中金恒瑞债券 C	10~50
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	集合--中金恒瑞债券 A	集合--中金恒瑞债券 C
基金合同生效日 (2020 年 6 月 3 日) 基金份额总额	104,512,919.77	-
本报告期期初基金 份额总额	117,044,614.02	2,480,909,356.76
本报告期基金总申 购份额	31,434,291.21	1,921,422,893.59
减: 本报告期基金 总赎回份额	33,075,400.85	1,542,693,497.50
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金 份额总额	115,403,504.38	2,859,638,752.85

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内, 本集合计划未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内, 基金管理人发生以下重大人事变动:

自 2024 年 1 月 16 日起, 由孙男先生负责资产管理业务, 分管资产管理部。

自 2024 年 4 月 10 日起, 吴波先生不再担任公司总裁、首席财务官及管理委员会成员职务; 由董事长陈亮先生代为履行总裁职责, 至公司聘任新任总裁之日止。

本报告期内, 无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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资产管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内, 本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2024 年 5 月 10 日, 北京证监局对中金公司采取责令改正的行政监管措施, 指出公司在开展

资产管理业务时存在因操作风险造成流动性缺口、违规提供通道服务、同日反向交易未列明决策依据、产品账户间互相发生交易等问题。同时就违规提供通道服务的问题对时任分管上述业务的高级管理人员徐翌成采取出具警示函的行政监管措施。

对于前述行政监管措施，公司高度重视，已采取有效措施积极落实整改，提升资管业务合规运作水平。此次行政监管措施不影响公司资产管理业务正常开展，公司将继续严格落实监管要求，审慎开展相关业务，保障业务运行规范。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中金公司	2	-	-	659,861.48	100.00	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中金公司	3,655,804,670.00	100.00	31,348,097,000.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金恒瑞债券型集合资产管理计划恢复申购、转换转入、定期定额投资以及暂停大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年1月15日
2	中国国际金融股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年1月17日
3	中金恒瑞债券型集合资产管理计划暂停大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年3月13日

4	中国国际金融股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 4 月 12 日
5	中国国际金融股份有限公司关于基金经理休假期间由他人代为履行职责的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 5 月 16 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 关于准予中金增强型债券收益集合资产管理计划合同变更的回函
- (二) 中金恒瑞债券型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 中金恒瑞债券型集合资产管理计划招募说明书
- (四) 中金恒瑞债券型集合资产管理计划托管协议
- (五) 法律意见书
- (六) 管理人业务资格批复件、营业执照
- (七) 托管人业务资格批复件、营业执照
- (八) 报告期内披露的各项公告

12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸 3 期 B 座 42 层。

12.3 查阅方式

投资者可到管理人办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

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

公司网址：www.cicc.com

中国国际金融股份有限公司

2024 年 8 月 28 日