

中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型
证券投资基金
2024 年中期报告

2024 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 30 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 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	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	10
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
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	37

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	37
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	37
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	37
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	38
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12	投资组合报告附注	38
§ 8	基金份额持有人信息	39
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
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	39
§ 9	开放式基金份额变动	39
§ 10	重大事件揭示	39
10.1	基金份额持有人大会决议	39
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	39
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4	基金投资策略的改变	40
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	40
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	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8	其他重大事件	41
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	42
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	42
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	42
§ 12	备查文件目录	42
12.1	备查文件目录	42
12.2	存放地点	42
12.3	查阅方式	42

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中金鑫瑞优选一年持有期
基金主代码	011703
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 7 月 13 日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	130,668,476.53 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过把握债券、股票市场的投资机会，在控制风险的基础上，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	本基金将采用“自上而下”的分析方法，长期通过战略资产配置，利用股债长期负相关特征获取相对稳定的收益，中短期根据内部股债相对风险溢价和预期收益模型，结合市场观点动态调整各大类资产的投资比例，把握市场时机，获取超额收益。严控信用风险，不过多下沉信用；股票投资追求安全边际，慎用衍生品。具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、普通债券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、可交换债券投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、证券公司短期公司债券投资策略；9、国债期货投资策略；10、股指期货投资策略；11、股票期权投资策略；12、融资业务投资策略；13、信用衍生品投资策略。详见《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×5%+中债-综合全价（总值）指数收益率×55%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金，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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰	龚小武
	联系电话	010-63211122	021-52629999-212056
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95561
传真		010-66159121	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼

邮政编码	100004	200120
法定代表人	李金泽	吕家进

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

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)
本期已实现收益	3,928,703.60
本期利润	1,264,993.48
加权平均基金份额本期利润	0.0093
本期加权平均净值利润率	1.42%
本期基金份额净值增长率	1.76%
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	-43,358,838.44
期末可供分配基金份额利润	-0.3318
期末基金资产净值	87,425,902.91
期末基金份额净值	0.6691
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	-33.09%

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、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

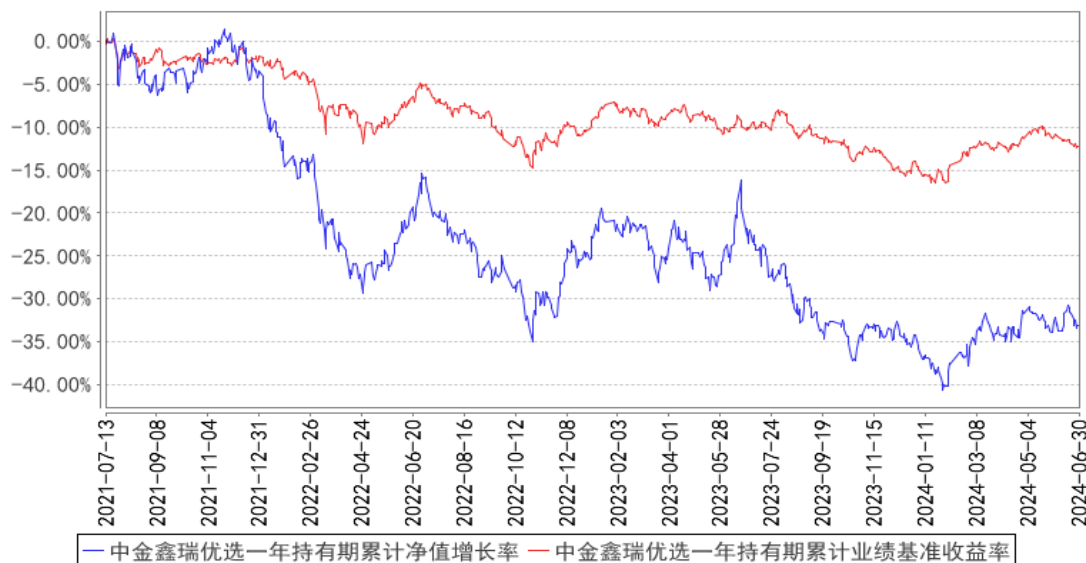
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.29%	1.01%	-1.05%	0.21%	2.34%	0.80%
过去三个月	1.58%	1.03%	0.16%	0.32%	1.42%	0.71%

过去六个月	1.76%	1.10%	2.08%	0.39%	-0.32%	0.71%
过去一年	-14.27%	1.09%	-2.44%	0.39%	-11.83%	0.70%
自基金合同生效起至今	-33.09%	1.19%	-12.22%	0.47%	-20.87%	0.72%

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

中金鑫瑞优选一年持有期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 6 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 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 51 只公募基金，证券投资基金管理规模 1631.27 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		

邱延冰	本基金基金经理、中金基金管理有限公司副总经理	2021年7月13日	-	22年	邱延冰先生，经济学博士。历任国家外汇管理局中央外汇业务中心战略研究处研究员，投资一处投资经理，投资二处副处长、处长（期间外派中国华安投资有限公司，担任副总经理兼投资部总监）；丝路基金有限责任公司投资决策委员会委员、研究部副总监（主持工作）；和泰人寿保险股份有限公司总经理助理（兼资产管理部总经理）、董事会秘书；中金基金管理有限公司副总经理、基金经理。
丁杨	本基金基金经理	2024年6月27日	-	9年	丁杨先生，经济学硕士。历任蚂蚁集团分析师，中金基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理助理。现任中金基金管理有限公司权益部基金经理。

注：1、上述首任基金经理任职日期为本基金基金合同生效日；非首任基金经理任职日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、管理人于 2024 年 7 月 12 日发布公告，邱延冰先生不再担任本基金基金经理；管理人于 2024 年 7 月 31 日发布公告，邱延冰先生自 2024 年 7 月 29 日起不再担任公司副总经理。

3、本基金无基金经理助理。

4、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

2024 年上半年，市场整体震荡调整。从基本面上来看，在地产模式转型阶段，相关工业企业盈利中枢下移，同时财富效应致使居民端消费受到影响。由于过去三年市场对地产相关链条物量的下降已经有了一定预期，因此本轮行情中，边际上受冲击较为严重的方向主要在白酒等可选消费领域。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金的份额净值为 0.6691 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.76%，业绩比较基准收益率为 2.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年行情，我们认为市场仍有望在震荡中保持中枢的平稳，结构而非仓位料继续成为配置的重心。对于消费端，财富效应的调整一般无法长期持续，因此我们倾向于认为消费结构持续发生进一步下移的风险较低，在当前环境下形成的平价消费格局将逐步稳固，符合时代消费主题的方向有望持续成长。对于地产链，本轮周期的观测重点将不再是价格而是新房和二手房的成交量，伴随着供给端的逐步出清，“剩者为王”的企业将有望在未来的新稳态中兑现价值。对于出口链，当前风险与机会并存，宏观叙事中的海外周期下行和贸易摩擦风险持续存在，但这个方向仍有望孕育出一批穿越重重困难的细分冠军。对于科技方向，AI 新周期正带来持续的新需求，其中硬科技方向有望成为这个阶段国内企业的主要受益方向。对于资源品和公用事业方向，其优质的需求刚性将在新环境下提供坚实的价格支撑，其中很有可能继续产生更多的估值切换机会。

从短期来看，地产带来的内需整体盈利调整仍在持续，新消费、出口链、硬科技、公用事业等方向中将有望产生更多的高景气方向，本基金将在这些方向中继续以景气线索为核心配置逻辑，在新环境中投资具备有效成长逻辑的基本面趋势，力争为投资人带来持续的超额收益。

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》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《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。

基金管理人建立并执行基金估值相关管理制度，设置估值委员会研究、指导基金估值业务。各估值委员会委员和基金会计均具有相关工作经历和专业胜任能力。参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金

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	5,453,988.52	6,160,791.80
结算备付金		51,230.39	166,075.96
存出保证金		46,878.06	40,621.16
交易性金融资产	6.4.7.2	61,058,879.20	60,166,581.09
其中：股票投资		61,058,879.20	60,166,581.09
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
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	21,000,000.00	29,382,631.12
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		2,311,053.16	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	506.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		89,922,029.33	95,917,207.40
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 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		-	-
应付清算款		2,260,106.26	-
应付赎回款		665.80	71,225.47
应付管理人报酬		86,947.33	98,229.94
应付托管费		14,491.23	16,371.67
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	133,915.80	202,958.15
负债合计		2,496,126.42	388,785.23
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	130,668,476.53	145,285,546.38
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-43,242,573.62	-49,757,124.21
净资产合计		87,425,902.91	95,528,422.17
负债和净资产总计		89,922,029.33	95,917,207.40

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.6691 元，基金份额总额 130,668,476.53 份。

6.2 利润表

会计主体：中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金

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		1,959,325.52	5,710,948.76
1. 利息收入		110,778.59	43,949.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	54,178.98	41,187.20
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		56,599.61	2,762.74
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,512,257.05	88,364.36
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,935,639.73	-460,809.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	576,617.32	549,174.08
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-	-
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	-2,663,710.12	5,578,634.46
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	-	-
减：二、营业总支出		694,332.04	1,188,912.43

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	532,332.95	949,997.54
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	88,722.19	158,332.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	73,276.90	80,581.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,264,993.48	4,522,036.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,264,993.48	4,522,036.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,264,993.48	4,522,036.33

6.3 净资产变动表

会计主体：中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金

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	145,285,546.38	-	-49,757,124.21	95,528,422.17
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	145,285,546.38	-	-49,757,124.21	95,528,422.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-14,617,069.85	-	6,514,550.59	-8,102,519.26
（一）、综合收益总额	-	-	1,264,993.48	1,264,993.48
（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）	-14,617,069.85	-	5,249,557.11	-9,367,512.74
其中：1. 基金申购款	435,122.40	-	-158,353.50	276,768.90

2. 基金赎回款	-15,052,192.25	-	5,407,910.61	-9,644,281.64
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	130,668,476.53	-	-43,242,573.62	87,425,902.91
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	174,054,550.00	-	-42,968,695.90	131,085,854.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	174,054,550.00	-	-42,968,695.90	131,085,854.10
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-15,708,539.72	-	8,213,799.44	-7,494,740.28
(一)、综合收益总额	-	-	4,522,036.33	4,522,036.33
(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)	-15,708,539.72	-	3,691,763.11	-12,016,776.61
其中：1. 基金申购款	544,877.47	-	-127,214.02	417,663.45
2. 基金赎回款	-16,253,417.19	-	3,818,977.13	-12,434,440.06
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	158,346,010.28	-	-34,754,896.46	123,591,113.82

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：

宗喆

二

白娜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2021 年 1 月 8 日证监许可[2021]28 号文注册,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式混合型证券投资基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金,托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、兴业银行、安信证券股份有限公司、渤海银行股份有限公司及东方财富证券股份有限公司等共同销售,募集期为 2021 年 6 月 7 日起至 2021 年 7 月 9 日。经向中国证监会备案,《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2021 年 7 月 13 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 211,861,569.68 份(含利息转份额 115,555.57 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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要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或注册发行上市的股票)、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、债券(包括国债、央行、票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转换债券的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券、政府支持债券)、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、银行存款、同业存单、国债期货、股指期货、股票期权、信用衍生品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

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金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和

《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“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〈年度报告和中期报告〉》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附注 6.4.2 中所列示的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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

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会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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《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《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 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》、财税[2014]81 号文《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》、财税[2016]127 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》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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信[2021]20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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：

(a) 资管产品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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券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。

(b) 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。

对证券投资基金从中国内地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，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过

基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(e) 对基金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附加。

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	5,453,988.52
等于：本金	5,451,337.85
加：应计利息	2,650.67
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	5,453,988.52

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	60,209,514.03	-	61,058,879.20	849,365.17
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	60,209,514.03	-	61,058,879.20	849,365.17

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	21,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	21,000,000.00	-

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.4.3 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

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

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

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	61,811.04
其中：交易所市场	61,811.04
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	72,104.76
合计	133,915.80

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	145,285,546.38	145,285,546.38
本期申购	435,122.40	435,122.40
本期赎回（以“-”号填列）	-15,052,192.25	-15,052,192.25
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	130,668,476.53	130,668,476.53

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-52,957,001.55	3,199,877.34	-49,757,124.21
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-52,957,001.55	3,199,877.34	-49,757,124.21
本期利润	3,928,703.60	-2,663,710.12	1,264,993.48

本期基金份额交易产生的变动数	5,669,459.51	-419,902.40	5,249,557.11
其中：基金申购款	-172,078.01	13,724.51	-158,353.50
基金赎回款	5,841,537.52	-433,626.91	5,407,910.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-43,358,838.44	116,264.82	-43,242,573.62

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		48,866.87
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		4,959.67
其他		352.44
合计		54,178.98

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

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		3,935,639.73
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		3,935,639.73

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		151,237,492.16
减：卖出股票成本总额		147,099,431.53
减：交易费用		202,420.90
买卖股票差价收入		3,935,639.73

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

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

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**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	576,617.32
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	576,617.32

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	-2,663,710.12
股票投资	-2,663,710.12
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	-
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	-2,663,710.12

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

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	12,432.42
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
划款手续费	1,172.14
合计	73,276.90

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 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未发生变化。

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
中金基金	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
兴业银行	基金托管人、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司(以下简称“中金财富证券”)	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	301,892,931.92	100.00	298,154,551.84	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

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 (%)
中金财富证券	523,000,000.00	100.00	11,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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 (%)
中金财富证券	107,432.42	100.00	61,811.04	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 (%)
中金财富证券	218,039.84	100.00	76,095.94	100.00

注：1、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。

2、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。

6.4.10.2 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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	532,332.95	949,997.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	265,884.12	409,506.94
应支付基金管理人的净管理费	266,448.83	540,490.60

注：支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值乘以约定的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×管理费率/当年天数。2023 年 7 月 31 日前，本基金管理费率为 1.50%。本基金管理人自 2023 年 7 月 31 日起对本基金实施调整后的基金管理费率，调整后的基金管理费率为 1.20%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	88,722.19	158,332.93

注：支付基金托管人兴业银行的基金托管费按前一日基金资产净值乘以约定的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×托管费率/当年天数。2023 年 7 月 31 日前，本基金托管费率为 0.25%。本基金管理人自 2023 年 7 月 31 日起对本基金实施调整后的基金托管费率，调整后的基金托管费率为 0.20%。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金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
兴业银行	5,453,988.52	48,866.87	17,406,945.97	39,465.70

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，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

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024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:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023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:股/张)	总金额
中金公司	688486	龙迅股份	网下	666	43,130.16
中金公司	688502	茂莱光学	网下	549	38,276.28

注：本基金本报告期在承销期内未参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未实施利润分配。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

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

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日，本基金无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有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

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。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 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 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）

6.4.13.2.2 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）

6.4.13.2.3 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）

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.5 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）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 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》，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、流动性压力测试、流动性风险预警、指标超标及危机的处理、流动性风险管理工具、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投资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指标进行监控。

6.4.13.3.1 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在其持有的基金份额锁定期满后随时要求赎回，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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	5,451,337.85	-	-	2,650.67	5,453,988.52
结算备付金	51,207.39	-	-	23.00	51,230.39
存出保证金	46,856.96	-	-	21.10	46,878.06
交易性金融资产	-	-	-	61,058,879.20	61,058,879.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	21,000,000.00	-	-	-	21,000,000.00
应收清算款	-	-	-	2,311,053.16	2,311,053.16
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	26,549,402.20	-	-	63,372,627.13	89,922,029.33
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	2,260,106.26	2,260,106.26
应付赎回款	-	-	-	665.80	665.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	86,947.33	86,947.33
应付托管费	-	-	-	14,491.23	14,491.23
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	133,915.80	133,915.80
负债总计	-	-	-	2,496,126.42	2,496,126.42
利率敏感度缺口	26,549,402.20	-	-	60,876,500.71	87,425,902.91
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	6,158,096.04	-	-	2,695.76	6,160,791.80
结算备付金	165,993.79	-	-	82.17	166,075.96
存出保证金	40,601.03	-	-	20.13	40,621.16
交易性金融资产	-	-	-	60,166,581.09	60,166,581.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	29,374,000.00	-	-	8,631.12	29,382,631.12
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	506.27	506.27
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	35,738,690.86	-	-	60,178,516.54	95,917,207.40
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	71,225.47	71,225.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	98,229.94	98,229.94
应付托管费	-	-	-	16,371.67	16,371.67
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	202,958.15	202,958.15
负债总计	-	-	-	388,785.23	388,785.23
利率敏感度缺口	35,738,690.86	-	-	59,789,731.31	95,528,422.17

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资（不含可转换债券、可交换债券）和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（上年度末：同）

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

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。

6.4.13.4.3.1 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	61,058,879.20	69.84	60,166,581.09	62.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	61,058,879.20	69.84	60,166,581.09	62.98

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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）
	业绩比较基准上升5%	7,975,987.77	8,824,283.89
业绩比较基准下降5%	-7,975,987.77	-8,824,283.89	

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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	61,058,879.20	60,166,581.09

第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	61,058,879.20	60,166,581.09

6.4.14.2.2 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。

对于本基金投资的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时，本基金不会于停牌期间、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。本基金综合考虑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的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末无非持续的以公允价值计量的金融工具。

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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 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	61,058,879.20	67.90
	其中：股票	61,058,879.20	67.90
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	21,000,000.00	23.35
	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	5,505,218.91	6.12
8	其他各项资产	2,357,931.22	2.62
9	合计	89,922,029.33	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	235,456.00	0.27
B	采矿业	1,312,348.00	1.50
C	制造业	54,576,307.20	62.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,358,990.00	2.70
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	98,021.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,734,258.00	1.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	743,499.00	0.85
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	61,058,879.20	69.84

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688408	中信博	29,700	2,734,776.00	3.13
2	003006	百亚股份	107,300	2,543,010.00	2.91
3	600660	福耀玻璃	44,300	2,121,970.00	2.43
4	002984	森麒麟	85,800	2,066,922.00	2.36
5	301498	乖宝宠物	37,400	2,012,120.00	2.30
6	002035	华帝股份	309,200	1,926,316.00	2.20
7	688076	诺泰生物	22,700	1,776,956.00	2.03
8	002463	沪电股份	41,200	1,503,800.00	1.72
9	600690	海尔智家	52,000	1,475,760.00	1.69
10	002371	北方华创	4,400	1,407,516.00	1.61
11	600285	羚锐制药	56,600	1,370,286.00	1.57

12	601633	长城汽车	51,200	1,295,360.00	1.48
13	601766	中国中车	167,900	1,260,929.00	1.44
14	688766	普冉股份	12,500	1,214,625.00	1.39
15	002126	银轮股份	67,600	1,176,916.00	1.35
16	600011	华能国际	115,600	1,112,072.00	1.27
17	601717	郑煤机	65,000	962,000.00	1.10
18	002922	伊戈尔	40,300	880,958.00	1.01
19	600161	天坛生物	36,020	878,888.00	1.01
20	600125	铁龙物流	146,800	876,396.00	1.00
21	688578	艾力斯	13,300	847,742.00	0.97
22	000913	钱江摩托	51,800	816,368.00	0.93
23	603507	振江股份	24,600	807,372.00	0.92
24	000544	中原环保	101,900	801,953.00	0.92
25	002053	云南能投	65,800	795,522.00	0.91
26	000786	北新建材	26,700	791,922.00	0.91
27	688253	英诺特	20,600	785,066.00	0.90
28	603786	科博达	11,800	756,970.00	0.87
29	600938	中国海油	22,700	749,100.00	0.86
30	300842	帝科股份	19,020	737,976.00	0.84
31	600066	宇通客车	28,500	735,300.00	0.84
32	600114	东睦股份	50,800	731,012.00	0.84
33	603871	嘉友国际	40,000	707,600.00	0.81
34	603983	丸美股份	25,200	693,756.00	0.79
35	603365	水星家纺	44,000	688,600.00	0.79
36	003000	劲仔食品	57,000	686,850.00	0.79
37	000528	柳工	60,800	680,352.00	0.78
38	688336	三生国健	32,000	651,200.00	0.74
39	300394	天孚通信	7,260	641,929.20	0.73
40	300638	广和通	37,000	632,700.00	0.72
41	002318	久立特材	25,700	599,581.00	0.69
42	300673	佩蒂股份	43,900	575,968.00	0.66
43	603727	博迈科	42,800	563,248.00	0.64
44	688092	爱科科技	25,400	542,290.00	0.62
45	600183	生益科技	25,700	541,242.00	0.62
46	300115	长盈精密	44,400	532,356.00	0.61
47	300054	鼎龙股份	23,400	530,712.00	0.61
48	601128	常熟银行	67,000	507,190.00	0.58
49	603486	科沃斯	10,200	481,236.00	0.55
50	301301	川宁生物	37,000	472,860.00	0.54
51	688019	安集科技	3,700	465,460.00	0.53
52	688226	威腾电气	25,000	437,000.00	0.50
53	688150	莱特光电	22,000	426,800.00	0.49
54	300207	欣旺达	27,700	420,209.00	0.48

55	000999	华润三九	9,500	404,510.00	0.46
56	300628	亿联网络	10,800	397,116.00	0.45
57	002897	意华股份	10,300	387,898.00	0.44
58	002979	雷赛智能	20,400	371,280.00	0.42
59	603501	韦尔股份	3,700	367,669.00	0.42
60	002557	洽洽食品	12,700	358,013.00	0.41
61	300857	协创数据	5,700	324,900.00	0.37
62	603088	宁波精达	42,700	321,531.00	0.37
63	002601	龙佰集团	17,000	315,690.00	0.36
64	300791	仙乐健康	11,700	294,840.00	0.34
65	000899	赣能股份	26,200	253,354.00	0.29
66	300761	立华股份	10,400	235,456.00	0.27
67	605305	中际联合	8,600	221,794.00	0.25
68	300623	捷捷微电	12,700	219,710.00	0.25
69	688016	心脉医疗	2,200	215,710.00	0.25
70	002422	科伦药业	7,000	212,310.00	0.24
71	603579	荣泰健康	13,700	211,802.00	0.24
72	002241	歌尔股份	10,700	208,757.00	0.24
73	300181	佐力药业	13,100	198,072.00	0.23
74	000887	中鼎股份	15,700	192,168.00	0.22
75	600642	申能股份	21,700	191,611.00	0.22
76	002139	拓邦股份	17,700	187,974.00	0.22
77	002340	格林美	27,700	176,449.00	0.20
78	603606	东方电缆	3,500	170,835.00	0.20
79	000703	恒逸石化	22,700	160,943.00	0.18
80	688008	澜起科技	2,800	160,048.00	0.18
81	002948	青岛银行	45,700	154,009.00	0.18
82	603515	欧普照明	7,100	123,114.00	0.14
83	688138	清溢光电	5,700	122,550.00	0.14
84	301061	匠心家居	2,300	108,008.00	0.12
85	300666	江丰电子	2,200	104,632.00	0.12
86	605599	菜百股份	7,700	98,021.00	0.11
87	002444	巨星科技	3,600	88,920.00	0.10
88	002045	国光电器	6,300	85,869.00	0.10
89	600000	浦发银行	10,000	82,300.00	0.09
90	002928	华夏航空	12,100	76,714.00	0.09
91	601333	广深铁路	22,700	73,548.00	0.08
92	603129	春风动力	500	71,170.00	0.08
93	002311	海大集团	1,500	70,575.00	0.08
94	300274	阳光电源	1,100	68,233.00	0.08
95	605319	无锡振华	3,700	65,490.00	0.07
96	603337	杰克股份	2,200	57,904.00	0.07
97	300458	全志科技	2,400	56,424.00	0.06

98	605088	冠盛股份	2,700	56,268.00	0.06
99	688041	海光信息	800	56,256.00	0.06
100	000977	浪潮信息	1,500	54,555.00	0.06
101	605183	确成股份	3,500	54,110.00	0.06
102	002429	兆驰股份	11,000	52,910.00	0.06
103	603992	松霖科技	2,700	49,653.00	0.06
104	600398	海澜之家	3,700	34,188.00	0.04

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	688036	传音控股	5,262,389.56	5.51
2	601138	工业富联	3,640,099.00	3.81
3	688017	绿的谐波	3,623,383.24	3.79
4	603199	九华旅游	3,126,458.00	3.27
5	603099	长白山	3,126,343.00	3.27
6	688408	中信博	2,770,766.59	2.90
7	002648	卫星化学	2,718,323.80	2.85
8	605196	华通线缆	2,662,588.00	2.79
9	688143	长盈通	2,656,238.36	2.78
10	300502	新易盛	2,644,135.00	2.77
11	603507	振江股份	2,595,380.00	2.72
12	003006	百亚股份	2,568,801.00	2.69
13	603786	科博达	2,507,464.00	2.62
14	603908	牧高笛	2,223,394.35	2.33
15	603501	韦尔股份	2,107,414.00	2.21
16	600660	福耀玻璃	2,105,409.00	2.20
17	002984	森麒麟	2,080,046.00	2.18
18	301498	乖宝宠物	2,019,534.00	2.11
19	002035	华帝股份	1,962,731.00	2.05
20	603918	金桥信息	1,847,725.00	1.93

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	688169	石头科技	6,938,486.76	7.26
2	300308	中际旭创	6,917,789.20	7.24
3	600519	贵州茅台	5,973,981.00	6.25
4	300502	新易盛	4,231,097.60	4.43
5	300394	天孚通信	4,034,391.40	4.22
6	300037	新宙邦	3,976,931.00	4.16

7	002463	沪电股份	3,915,309.00	4.10
8	601138	工业富联	3,792,841.00	3.97
9	688036	传音控股	3,571,125.06	3.74
10	688017	绿的谐波	3,288,045.99	3.44
11	300633	开立医疗	3,246,661.07	3.40
12	605196	华通线缆	3,215,721.00	3.37
13	002223	鱼跃医疗	3,193,439.00	3.34
14	002475	立讯精密	3,044,512.00	3.19
15	603099	长白山	3,004,513.00	3.15
16	603199	九华旅游	2,930,699.18	3.07
17	688143	长盈通	2,916,125.59	3.05
18	688025	杰普特	2,712,466.29	2.84
19	301004	嘉益股份	2,669,203.37	2.79
20	002648	卫星化学	2,567,099.54	2.69
21	002810	山东赫达	2,548,025.00	2.67
22	603507	振江股份	2,499,210.00	2.62
23	605117	德业股份	2,329,068.00	2.44
24	301171	易点天下	2,103,532.00	2.20
25	300760	迈瑞医疗	2,066,829.00	2.16
26	300443	金雷股份	2,015,053.00	2.11
27	601001	晋控煤业	1,975,611.00	2.07

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	150,655,439.76
卖出股票收入（成交）总额	151,237,492.16

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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投资。

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 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

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 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	46,878.06
2	应收清算款	2,311,053.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,357,931.22

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处于转股期的可转换债券。

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中不存在流通受限股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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

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 (%)
1,627	80,312.52	98,933.23	0.08	130,569,543.30	99.92

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	22.02	0.000017

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 7 月 13 日) 基金份额总额	211,861,569.68
本报告期期初基金份额总额	145,285,546.38
本报告期基金总申购份额	435,122.40
减：本报告期基金总赎回份额	15,052,192.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	130,668,476.53

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 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

2024 年 1 月 20 日，本基金管理人发布公告，李金泽先生自 2024 年 1 月 19 日起担任公司董事长、法定代表人；宗喆先生自 2024 年 1 月 19 日起担任公司总经理、董事；胡长生先生自

2024 年 1 月 19 日起不再担任公司董事长、法定代表人，不再代履公司总经理职务。

2024 年 3 月 2 日，本基金管理人发布公告，宗喆先生自 2024 年 2 月 29 日起担任公司财务负责人。

(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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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未受到监管部门的稽查或处罚。

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	301,892,931.92	100.00	107,432.42	100.00	-
开源证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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	-	-	523,000,000.00	100.00	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-

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旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-1-19
2	中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-1-19
3	中金基金管理有限公司董事长、高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024-1-20
4	中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024-3-2
5	中金基金管理有限公司关于不法分子假冒“中金基金”名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2024-3-22
6	中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-3-29
7	中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-3-29
8	中金基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-4-20
9	中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-4-20
10	中金基金管理有限公司关于上海分公司负责人及注册地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-5-15
11	中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资	中国证监会规定媒介	2024-6-24

	资基金基金产品资料概要更新		
12	中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2024-6-28
13	中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2024-6-28
14	中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2024-6-28

§ 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

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有份额比例达到或超过总份额 20%的情况。

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、中国证监会准予中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金申请募集注册的法律意见书
- 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、报告期内中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人和/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或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

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

2024 年 8 月 31 日