

国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资  
基金  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 日至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	46

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 .....	46
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 .....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
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 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金	
基金简称	国金鑫意医药消费	
基金主代码	009507	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年6月30日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	341,749,897.66份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金鑫意医药消费 A	国金鑫意医药消费 C
下属分级基金的交易代码	009507	009508
报告期末下属分级基金的份额总额	60,832,877.97份	280,917,019.69份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于医药和消费主题相关的具有持续增长潜力的优质上市公司，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、衍生品投资策略。</p> <p>资产配置策略部分，本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。</p> <p>股票投资策略部分，本基金投资股票将主要通过深度研究来精选个股，分享优秀公司的价值增长。本基金将从纵向和横向两个维度反复分析公司发展的前景，纵向研究行业发展历史和公司发展历史，判断公司未来的发展前景；横向比较对所研究标的的竞争对手、上下游关系进行比较分析，判断投资该公司风险收益比。本基金所指的医药消费主题是指医药行业和消费行业内具备较好的利润创造能力且估值水平合理的成长型上市公司股票。本基金从医药行业和消费行业两个特征对投资主题进行定义。固定收益品种投资策略包括，债券投资策略、可转换债券、可交换公司债券投资策略、资产支持证券投资策略、信用债投资策略。</p> <p>本基金其余主要投资策略详见本基金招募说明书及产品资料概要。</p>
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率*40%+中证内地消费主题指数收益率*40%+中证全债指数收益率*20%

风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险和预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。
--------	-------------------------------------------

### 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		国金基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张静	朱巍
	联系电话	010-88005695	0571-87659806
	电子邮箱	zhangjing@gfund.com	zsyhzctgb@czbank.com
客户服务电话		4000-2000-18	95527
传真		010-88005666	0571-88268688
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	杭州市萧山区鸿宁路 1788 号
办公地址		北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码		100020	310006
法定代表人		邵海波	陆建强

### 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.gfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 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)	
	国金鑫意医药消费 A	国金鑫意医药消费 C
本期已实现收益	-11,915,330.70	-57,970,684.15
本期利润	-6,148,470.03	-31,018,031.25
加权平均基金份额 本期利润	-0.0941	-0.0988
本期加权平均净 值利润率	-15.60%	-16.69%
本期基金份额净	-14.05%	-14.27%

值增长率		
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	-26,523,252.44	-125,622,381.21
期末可供分配基金份额利润	-0.4360	-0.4472
期末基金资产净值	34,309,625.53	155,294,638.48
期末基金份额净值	0.5640	0.5528
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	-43.60%	-44.72%

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. 期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 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

国金鑫意医药消费 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	-4.63%	0.95%	-5.76%	0.49%	1.13%	0.46%
过去三个月	-10.18%	1.09%	-6.48%	0.69%	-3.70%	0.40%
过去六个月	-14.05%	1.34%	-8.69%	0.89%	-5.36%	0.45%
过去一年	-19.76%	1.32%	-12.66%	0.82%	-7.10%	0.50%
过去三年	-52.01%	1.66%	-37.39%	1.02%	-14.62%	0.64%

自基金合同生效起至今	-43.60%	1.58%	-20.58%	1.11%	- 23.02%	0.47%
------------	---------	-------	---------	-------	-------------	-------

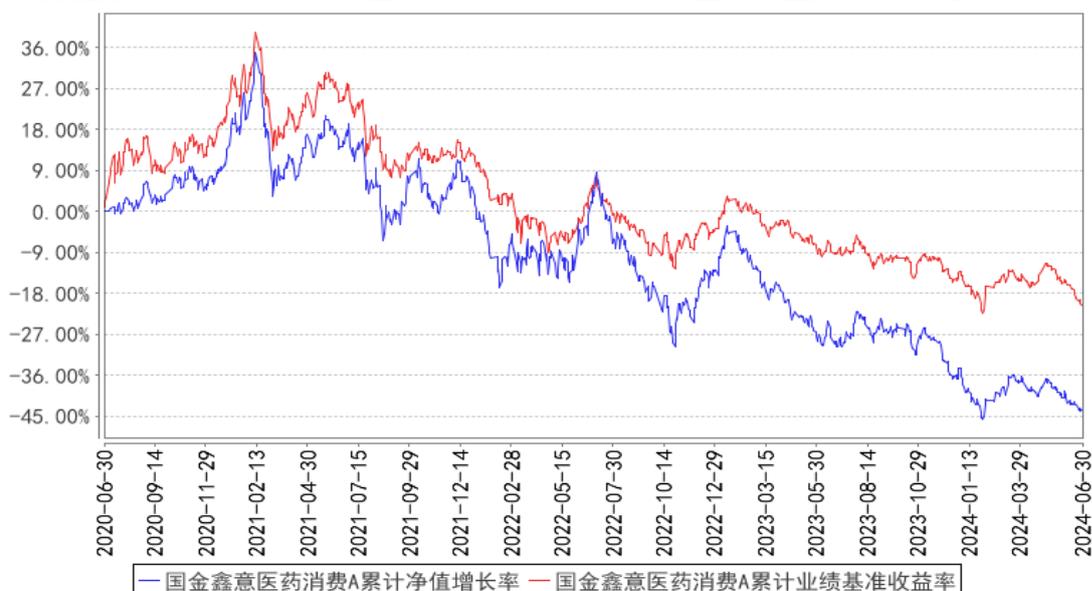
国金鑫意医药消费 C

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	-4.67%	0.95%	-5.76%	0.49%	1.09%	0.46%
过去三个月	-10.29%	1.09%	-6.48%	0.69%	-3.81%	0.40%
过去六个月	-14.27%	1.34%	-8.69%	0.89%	-5.58%	0.45%
过去一年	-20.17%	1.32%	-12.66%	0.82%	-7.51%	0.50%
过去三年	-52.72%	1.66%	-37.39%	1.02%	- 15.33%	0.64%
自基金合同生效起至今	-44.72%	1.58%	-20.58%	1.11%	- 24.14%	0.47%

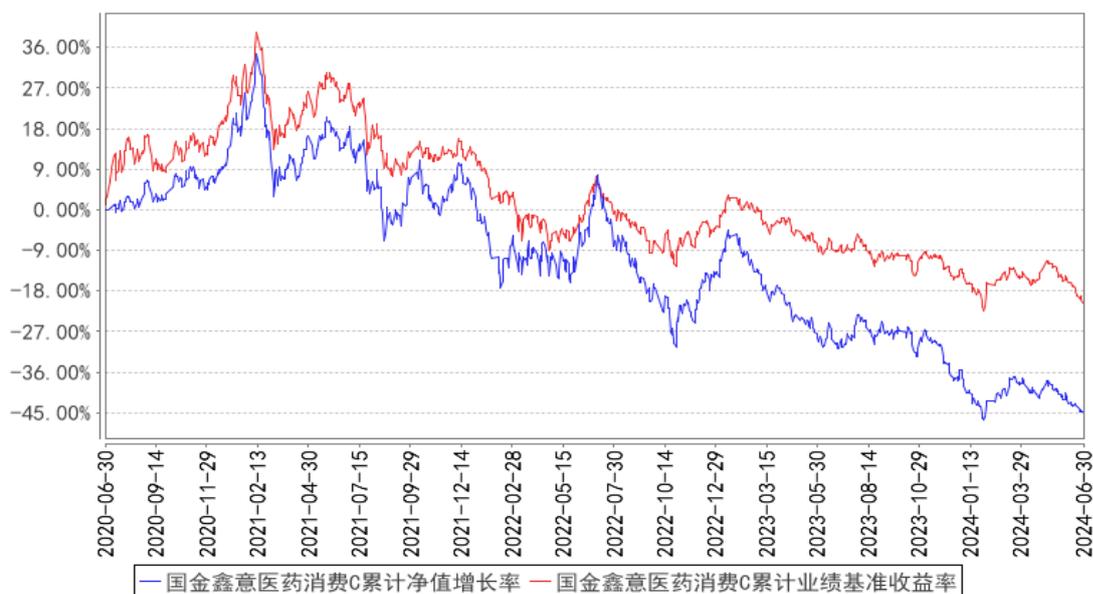
注：本基金的业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率×40%+中证内地消费主题指数收益率×40%+中证全债指数收益率×20%。

### 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

国金鑫意医药消费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



国金鑫意医药消费C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2020 年 6 月 30 日，图示日期为 2020 年 6 月 30 日至 2024 年 6 月 30 日。

### 3.3 其他指标

注：无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于 2011 年 11 月 2 日成立，总部设在北京。公司注册资本为 3.6 亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为 51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至 2024 年 6 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 26 只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深 300 指数增强证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠丰 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠享一

年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金 ESG 持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金、国金中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国金中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、国金智享量化选股混合型证券投资基金。

#### 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		
吕伟	本基金的基金经理	2021 年 11 月 5 日	-	16 年	吕伟先生，中国社会科学院工商管理硕士。2007 年 9 月至 2021 年 7 月先后在益民基金管理有限公司集中交易部、发展研究部、公募基金部担任交易员、行业研究员、基金经理等职务。2021 年 7 月加入国金基金管理有限公司，现任主动权益投资部总经理兼权益投资总监。

注：（1）任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写；（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》《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》和其他有关法律法规的规定，以及《国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控

等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

### 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。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 6 次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

## 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，医药和消费板块受到宏观背景和市场影响，尤其是医药板块呈现单边下跌态势。

宏观经济方面：内部环境层面，报告期内，作为工业生产预测性指标的 PMI 主要围绕荣枯线上下波动。市场主流观点认为经济正处于触底回升的温和通道，市场底部仍需进一步夯实，其中 5 月至 6 月的 PMI 连续低于预期，作为经济短周期的景气度观测指标，预示着目前宏观经济，尤其是制造业和服务业，或又回到底部震荡的区间内。GDP 的完成情况方面，2024 年第二季度表现不如年初，故自 6 月以来，A 股市场呈现出单边下跌的趋势。外部环境层面，美国 CPI 回落明显、就业指标表现持续强劲，市场主流观点认为 2024 年第三季度降息是小概率事件。中美十年期国债收益率利差仍然维持 200BP 上下波动，区间收窄仍需时日，因此压制人民币汇率的核心因素依然存在。基于以上情况，除了 PMI 以外，面对外部压力和内部经济的复杂性，报告期内宏观政策保持了一定的克制。

宏观经济方面：消费方面，居民提前还贷的情况持续发生，整体消费意愿有待调整。报告期内，飞天茅台批发价作为标杆指标持续下挫，白酒总体库存未见好转，其他微观消费指标仍需进一步观察，因此 A 股市场消费类板块也出现了较差的走势。医药方面，整体行业在国民经济中的定位愈发清晰，逐渐向以“服务人民”为核心转向，故无法按个别时段科技股的估值来看待。同时，指引未来几年政策方向的党的二十届三中全会于 7 月如期而至，因此我们对未来内生经济依然保有一定信心。

操作方面，本基金除了根据基金合同约定主要配置于医药和消费板块之外，还根据市场表现配置了具有消费属性的新能源板块和股价表现较为突出的银行股，前述配置思路主要是为降低风险、分散医药消费回调时对本基金回撤造成的压力。仓位方面，本基金在 PMI 回到荣枯线以下时，暂时调低部分仓位，亦是为更好地降低医药、消费受市场冲击带来的负反馈。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额单位净值为 0.5640 元，累计单位净值为 0.5640 元；本报

告期 A 类份额净值增长率为-14.05%，同期业绩比较基准增长率为-8.69%。

本基金 C 类份额单位净值为 0.5528 元，累计单位净值为 0.5528 元；本报告期 C 类份额净值增长率为-14.27%，同期业绩比较基准增长率为-8.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年第二季度经济数据发布后，GDP、社会融资等数据依然存在压力，或为开展标的投资、配置的较好时机。市场参与者对于政策的预期或由较为悲观逐步转向相对乐观，因此本基金也会尽量根据市场变化对板块节奏进行适度把握，积极面对市场的各种变化。

展望 2024 年下半年，本基金除根据基金合同主要配置于医药和消费板块标的外，还将从风险控制的角度对整体仓位进行控制，在经济数据基础夯实或政策方向明晰前，保持理性仓位。

#### 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，本基金管理人按照相关法律法规及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管人代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管人进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值工作小组成员，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，估值政策和估值方案最终由估值委员会决定，基金经理不具有表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配，不存在应分配而未分配的情况。

#### 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

本报告期，本基金无连续二十个工作日出现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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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

本报告期内，本基金的管理人——国金基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在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

本托管人依法对国金基金管理有限公司编制和披露的国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	70,846,972.88	14,198,163.17
结算备付金		913,178.18	2,707,745.90
存出保证金		257,739.11	279,387.83
交易性金融资产	6.4.7.2	121,782,616.63	267,064,215.46
其中：股票投资		120,271,390.47	265,355,319.57
基金投资		-	-
债券投资		1,511,226.16	1,708,895.89
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	-	-

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		-	559,200.49
应收股利		-	-
应收申购款		128,745.82	832,267.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		193,929,252.62	285,640,979.85
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,898,882.40	-
应付赎回款		711,253.22	1,067,684.94
应付管理人报酬		194,468.28	293,507.42
应付托管费		32,411.38	48,917.92
应付销售服务费		66,210.46	102,841.87
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	1,421,762.87	1,020,743.42
负债合计		4,324,988.61	2,533,695.57
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	341,749,897.66	437,827,096.72
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-152,145,633.65	-154,719,812.44
净资产合计		189,604,264.01	283,107,284.28
负债和净资产总计		193,929,252.62	285,640,979.85

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，国金鑫意医药消费 A 基金份额净值 0.5640 元，基金份额总额 60,832,877.97 份；国金鑫意医药消费 C 基金份额净值 0.5528 元，基金份额总额 280,917,019.69 份。国金鑫意医药消费份额总额合计为 341,749,897.66 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		-35,047,850.09	-73,796,880.22
1. 利息收入		39,397.11	63,357.45
其中：存款利息收入	6.4.7.13	39,397.11	63,357.45
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-67,861,952.78	2,617,395.58
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-69,905,317.62	-2,142,679.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	14,215.58	31,950.95
资产支持证券投资	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	-	1,256,369.09
股利收益	6.4.7.19	2,029,149.26	3,471,754.55
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	32,719,513.57	-76,837,227.56
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	55,192.01	359,594.31
<b>减：二、营业总支出</b>		2,118,651.19	4,296,719.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,343,384.74	2,969,513.14
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	223,897.48	395,935.17
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	461,861.37	838,096.58
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		-	3,774.07
8. 其他费用	6.4.7.23	89,507.60	89,400.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-37,166,501.28	-78,093,599.33
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-37,166,501.28	-78,093,599.33
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-37,166,501.28	-78,093,599.33

### 6.3 净资产变动表

会计主体：国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金

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	437,827,096.72	-	154,719,812.44	283,107,284.28
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	437,827,096.72	-	154,719,812.44	283,107,284.28
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-96,077,199.06	-	2,574,178.79	-93,503,020.27
(一)、综合收益总额	-	-	-37,166,501.28	-37,166,501.28
(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)	-96,077,199.06	-	39,740,680.07	-56,336,518.99
其中：1. 基金申	58,534,620.23	-	-24,160,815.88	34,373,804.35

购款				
2. 基金赎回款	- 154,611,819.29	-	63,901,495.95	-90,710,323.34
(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	341,749,897.66	-	152,145,633.65	189,604,264.01
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	538,978,333.77	-	-74,139,444.86	464,838,888.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	538,978,333.77	-	-74,139,444.86	464,838,888.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,250,707.73	-	-88,629,772.85	-95,880,480.58
(一)、综合收益总额	-	-	-78,093,599.33	-78,093,599.33
(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)	-7,250,707.73	-	-10,536,173.52	-17,786,881.25
其中：1. 基金申购款	393,056,760.03	-	-70,350,024.59	322,706,735.44
2. 基金赎回款	- 400,307,467.76	-	59,813,851.07	-340,493,616.69

(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	531,727,626.04	-	162,769,217.71	368,958,408.33

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：

邰海波

聂武鹏

于晓莲

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

国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金系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[2020]777号文《关于准予国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由国金基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2020年6月30日生效，本基金首次募集规模为625,992,875.42份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

本基金投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板、及其他依法发行上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货、货币市场工具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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%，其中投资于本基金界定的医药行业和消费行业范围内股票合计不低于非现金基金资产的80%，消费行业范围内股

票不低于非现金基金资产的 30%，医药行业范围内股票不低于非现金基金资产的 30%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或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。如法律法规或中国证监会允许，基金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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率\*40%+中证内地消费主题指数收益率\*40%+中证全债指数收益率\*20%。

#### 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”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生

的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 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	70,846,972.88
等于：本金	70,842,928.96
加：应计利息	4,043.92
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	70,846,972.88

## 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	124,015,015.97	-	120,271,390.47	-3,743,625.50	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,497,650.00	10,626.16	1,511,226.16	2,950.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,497,650.00	10,626.16	1,511,226.16	2,950.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	125,512,665.97	10,626.16	121,782,616.63	-3,740,675.50	

## 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

注：无

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：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

注：无

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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

注：无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：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

注：无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.8 其他资产

注：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	15.89
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,332,239.38
其中：交易所市场	1,332,239.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
合计	1,421,762.87

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 国金鑫意医药消费 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	69,053,474.78	69,053,474.78
本期申购	1,742,613.51	1,742,613.51
本期赎回（以“-”号填列）	-9,963,210.32	-9,963,210.32
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	60,832,877.97	60,832,877.97

##### 国金鑫意医药消费 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	368,773,621.94	368,773,621.94
本期申购	56,792,006.72	56,792,006.72
本期赎回（以“-”号填列）	-144,648,608.97	-144,648,608.97
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	280,917,019.69	280,917,019.69

注：若本基金有分红及转换业务，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

注：无

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 国金鑫意医药消费 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,079,373.20	-18,659,500.15	-23,738,873.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-5,079,373.20	-18,659,500.15	-23,738,873.35
本期利润	-11,915,330.70	5,766,860.67	-6,148,470.03
本期基金份额交易产生的变动数	1,495,709.95	1,868,380.99	3,364,090.94
其中：基金申购款	-299,580.18	-388,256.20	-687,836.38
基金赎回款	1,795,290.13	2,256,637.19	4,051,927.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,498,993.95	-11,024,258.49	-26,523,252.44

## 国金鑫意医药消费 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-32,231,645.32	-98,749,293.77	-130,980,939.09
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-32,231,645.32	-98,749,293.77	-130,980,939.09
本期利润	-57,970,684.15	26,952,652.90	-31,018,031.25
本期基金份额交易产生的变动数	15,259,300.38	21,117,288.75	36,376,589.13
其中：基金申购款	-9,994,170.89	-13,478,808.61	-23,472,979.50
基金赎回款	25,253,471.27	34,596,097.36	59,849,568.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-74,943,029.09	-50,679,352.12	-125,622,381.21

## 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	25,769.25
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	11,212.53
其他	2,415.33
合计	39,397.11

## 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	-69,905,317.62
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	-69,905,317.62

#### 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	1,106,793,305.85
减：卖出股票成本总额	1,174,454,044.97
减：交易费用	2,244,578.50
买卖股票差价收入	-69,905,317.62

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：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	10,079.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,136.00
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	14,215.58

##### 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	1,213,013.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,195,560.00
减：应计利息总额	13,317.53

减：交易费用	-
买卖债券差价收入	4,136.00

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：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

注：无

##### 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

注：无

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：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

注：无

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：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

注：无

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

#### 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	2,029,149.26
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	2,029,149.26

#### 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	32,719,513.57
股票投资	32,719,453.57
债券投资	60.00
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	32,719,513.57

#### 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	34,664.94
基金转换费收入	20,527.07
合计	55,192.01

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：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	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
合计	89,507.60

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大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

本报告期内未发生变化。

##### 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
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
浙商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：下述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 (%)
国金证券股份有限公司	834,662,308.38	39.68	596,559,748.07	38.46

##### 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 (%)
国金证券股份有限公司	-	-	3,655,789.44	100.00

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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 (%)
国金证券股份有限公司	622,579.88	40.00	622,579.88	46.73
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 (%)
国金证券股份有限公司	436,262.59	38.46	79,765.59	34.28

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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	1,343,384.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	530,674.08	1,201,778.22
应支付基金管理人的净管理费	812,710.66	1,767,734.92

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 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	223,897.48	395,935.17

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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		
	国金鑫意医药消费 A	国金鑫意医药消费 C	合计
国金基金管理有限公司	-	497.79	497.79
国金证券股份有限公司	-	1,408.57	1,408.57

浙商银行股份有限公司	-	25,477.32	25,477.32
合计	-	27,383.68	27,383.68
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		
	国金鑫意医药消费 A	国金鑫意医药消费 C	合计
国金基金管理有限公司	-	637.07	637.07
国金证券股份有限公司	-	2,065.17	2,065.17
浙商银行股份有限公司	-	37,466.12	37,466.12
合计	-	40,168.36	40,168.36

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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

注：无

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无

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

注：无

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	国金鑫意医药消费 A	国金鑫意医药消费 C
基金合同生效日（2020 年 6 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,002,700.27	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,002,700.27	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.4429%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	国金鑫意医药消费 A	国金鑫意医药消费 C
基金合同生效日（2020 年 6 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,002,700.27	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,002,700.27	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.8357%	-

注：1. 基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2. 若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 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

注：无

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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

浙商银行股份有 限公司-活期存 款	70,846,972.88	25,769.25	35,238,922.35	39,891.19
-------------------------	---------------	-----------	---------------	-----------

注：本基金的上述存款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

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

#### 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

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

注：无

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无

##### 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

注：无

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理办公会负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理办公会下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的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。

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，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有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**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有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

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并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。

##### 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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	70,846,972.88	-	-	-	-	-	70,846,972.88
结算备付金	913,178.18	-	-	-	-	-	913,178.18
存出保证金	257,739.11	-	-	-	-	-	257,739.11
交易性金融资产	507,807.53	-1,003,418.63	-	-	-120,271,390.47	121,782,616.63	
应收申购款	-	-	-	-	-	128,745.82	128,745.82
资产总计	72,525,697.70	-1,003,418.63	-	-	-120,400,136.29	193,929,252.62	
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	1,898,882.40	1,898,882.40
应付赎回款	-	-	-	-	-	711,253.22	711,253.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	194,468.28	194,468.28
应付托管费	-	-	-	-	-	32,411.38	32,411.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-	66,210.46	66,210.46
其他负债	-	-	-	-	-	1,421,762.87	1,421,762.87
负债总计	-	-	-	-	-	4,324,988.61	4,324,988.61
利率敏感度缺口	72,525,697.70	-1,003,418.63	-	-	-116,075,147.68	189,604,264.01	
上年度末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	14,198,163.17	-	-	-	-	-	14,198,163.17
结算备付金	2,707,745.90	-	-	-	-	-	2,707,745.90
存出保证金	279,387.83	-	-	-	-	-	279,387.83
交易性金融资产	-	-1,708,895.89	-	-	-265,355,319.57	267,064,215.46	
应收清算款	-	-	-	-	-	559,200.49	559,200.49

应收申购款	-	-	-	-	832,267.00	832,267.00
资产总计	17,185,296.90	-1,708,895.89	-	-	-266,746,787.06	285,640,979.85
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,067,684.94	1,067,684.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	293,507.42	293,507.42
应付托管费	-	-	-	-	48,917.92	48,917.92
应付销售服务费	-	-	-	-	102,841.87	102,841.87
其他负债	-	-	-	-	1,020,743.42	1,020,743.42
负债总计	-	-	-	-	2,533,695.57	2,533,695.57
利率敏感度缺口	17,185,296.90	-1,708,895.89	-	-	-264,213,091.49	283,107,284.28

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日、行权日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有交易性债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇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。本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的证券等，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量 and 测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	120,271,390.47	63.43	265,355,319.57	93.73

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,511,226.16	0.80	1,708,895.89	0.60
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	121,782,616.63	64.23	267,064,215.46	94.33

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数（000300.SH）变化 5%，其他变量不变；		
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 指数的相关性。		
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）
	+5%	11,502,321.61	15,530,266.39
	-5%	-11,502,321.61	-15,530,266.39

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 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：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 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	120,271,390.47	265,215,192.47
第二层次	1,511,226.16	1,708,895.89
第三层次	-	140,127.10
合计	121,782,616.63	267,064,215.46

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### 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均未持有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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 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	120,271,390.47	62.02
	其中：股票	120,271,390.47	62.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,511,226.16	0.78
	其中：债券	1,511,226.16	0.78
	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	-	-
	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	71,760,151.06	37.00
8	其他各项资产	386,484.93	0.20
9	合计	193,929,252.62	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

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	-	-
C	制造业	97,013,375.83	51.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	380,046.00	0.20
F	批发和零售业	412,580.64	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	22,465,388.00	11.85
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	120,271,390.47	63.43

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

## 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	000333	美的集团	249,200	16,073,400.00	8.48
2	600211	西藏药业	481,692	15,693,525.36	8.28
3	601038	一拖股份	991,100	15,669,291.00	8.26
4	605117	德业股份	209,851	15,600,323.34	8.23
5	601398	工商银行	2,578,500	14,697,450.00	7.75
6	300298	三诺生物	348,200	8,823,388.00	4.65
7	601939	建设银行	764,700	5,658,780.00	2.98
8	600398	海澜之家	607,600	5,614,224.00	2.96
9	000513	丽珠集团	123,900	4,610,319.00	2.43
10	002572	索菲亚	259,200	3,973,536.00	2.10
11	600750	江中药业	119,100	2,752,401.00	1.45
12	300274	阳光电源	33,760	2,094,132.80	1.10
13	601658	邮储银行	405,000	2,053,350.00	1.08
14	002737	葵花药业	83,700	1,956,906.00	1.03
15	002019	亿帆医药	132,900	1,642,644.00	0.87
16	600820	隧道股份	58,200	380,046.00	0.20
17	603392	万泰生物	3,000	197,640.00	0.10
18	002773	康弘药业	8,000	173,200.00	0.09
19	600129	太极集团	5,900	170,628.00	0.09
20	000596	古井贡酒	800	168,856.00	0.09
21	600522	中天科技	10,400	164,840.00	0.09
22	600332	白云山	5,100	149,583.00	0.08
23	600519	贵州茅台	100	146,739.00	0.08
24	601865	福莱特	7,100	142,710.00	0.08
25	600976	健民集团	2,700	136,350.00	0.07
26	603589	口子窖	3,453	135,323.07	0.07
27	603883	老百姓	6,799	124,829.64	0.07
28	300760	迈瑞医疗	400	116,364.00	0.06
29	002727	一心堂	7,300	110,157.00	0.06
30	603345	安井食品	1,402	104,182.62	0.05
31	603298	杭叉集团	4,260	83,666.40	0.04
32	002271	东方雨虹	6,300	77,742.00	0.04
33	300750	宁德时代	400	72,012.00	0.04
34	000568	泸州老窖	500	71,745.00	0.04
35	300308	中际旭创	480	66,182.40	0.03
36	603899	晨光股份	2,000	62,560.00	0.03
37	601288	农业银行	12,800	55,808.00	0.03
38	000848	承德露露	5,500	43,230.00	0.02
39	600329	达仁堂	1,300	42,107.00	0.02
40	603939	益丰药房	1,680	41,244.00	0.02
41	603806	福斯特	2,660	39,102.00	0.02
42	000858	五粮液	300	38,412.00	0.02
43	002078	太阳纸业	2,600	36,270.00	0.02

44	000999	华润三九	780	33,212.40	0.02
45	002311	海大集团	700	32,935.00	0.02
46	603369	今世缘	574	26,518.80	0.01
47	600285	羚锐制药	992	24,016.32	0.01
48	600809	山西汾酒	100	21,088.00	0.01
49	600276	恒瑞医药	532	20,460.72	0.01
50	000933	神火股份	700	14,161.00	0.01
51	002847	盐津铺子	280	11,975.60	0.01
52	603198	迎驾贡酒	200	11,500.00	0.01
53	000400	许继电气	300	10,323.00	0.01

## 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	605117	德业股份	44,261,773.31	15.63
2	300274	阳光电源	43,962,971.58	15.53
3	601038	一拖股份	39,216,900.04	13.85
4	300896	爱美客	33,668,009.33	11.89
5	600276	恒瑞医药	30,259,582.30	10.69
6	603806	福斯特	27,085,617.43	9.57
7	002422	科伦药业	26,842,241.50	9.48
8	603198	迎驾贡酒	26,732,106.00	9.44
9	603259	药明康德	26,515,222.15	9.37
10	600211	西藏药业	26,306,781.00	9.29
11	600612	老凤祥	25,666,437.81	9.07
12	603589	口子窖	22,544,438.00	7.96
13	603939	益丰药房	22,029,041.40	7.78
14	300759	康龙化成	21,166,323.75	7.48
15	300015	爱尔眼科	21,101,894.63	7.45
16	601865	福莱特	21,035,003.88	7.43
17	688331	荣昌生物	20,996,322.08	7.42
18	300750	宁德时代	20,597,812.33	7.28
19	300760	迈瑞医疗	18,430,698.00	6.51
20	300298	三诺生物	18,390,887.00	6.50
21	603233	大参林	17,962,281.17	6.34
22	600332	白云山	16,580,536.00	5.86
23	603883	老百姓	16,451,719.05	5.81
24	601398	工商银行	16,245,727.00	5.74
25	000333	美的集团	16,240,169.00	5.74
26	002727	一心堂	13,763,946.00	4.86
27	300122	智飞生物	13,470,245.65	4.76
28	600438	通威股份	11,804,768.00	4.17

29	002847	盐津铺子	11,301,582.00	3.99
30	600285	羚锐制药	9,749,691.00	3.44
31	603606	东方电缆	9,330,748.00	3.30
32	300765	新诺威	9,197,649.00	3.25
33	002019	亿帆医药	8,397,704.00	2.97
34	002594	比亚迪	8,386,713.00	2.96
35	000848	承德露露	8,222,045.96	2.90
36	603899	晨光股份	7,816,238.00	2.76
37	688472	阿特斯	7,786,872.51	2.75
38	601939	建设银行	7,072,669.00	2.50
39	002653	海思科	6,959,933.70	2.46
40	600188	兖矿能源	6,638,031.00	2.34
41	300014	亿纬锂能	6,618,648.00	2.34
42	000933	神火股份	6,549,115.00	2.31
43	688223	晶科能源	6,461,728.11	2.28
44	600329	达仁堂	6,402,830.00	2.26
45	603345	安井食品	6,299,352.00	2.23
46	000999	华润三九	6,081,327.36	2.15
47	002294	信立泰	6,071,562.00	2.14
48	600129	太极集团	5,981,249.00	2.11
49	300498	温氏股份	5,963,424.00	2.11
50	688575	亚辉龙	5,736,600.66	2.03

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超初期基金资产净值 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	300274	阳光电源	43,255,107.71	15.28
2	300896	爱美客	34,479,207.44	12.18
3	000858	五粮液	30,729,719.64	10.85
4	603369	今世缘	30,419,298.45	10.74
5	600276	恒瑞医药	29,578,949.32	10.45
6	603259	药明康德	29,324,304.00	10.36
7	605117	德业股份	29,194,818.38	10.31
8	300759	康龙化成	29,031,271.06	10.25
9	603198	迎驾贡酒	28,890,277.22	10.20
10	600809	山西汾酒	28,680,709.00	10.13
11	002422	科伦药业	26,660,113.00	9.42
12	603806	福斯特	26,176,698.96	9.25
13	002304	洋河股份	24,904,200.00	8.80
14	000568	泸州老窖	24,589,543.00	8.69
15	600612	老凤祥	24,297,454.00	8.58
16	601038	一拖股份	22,765,215.00	8.04

17	603589	口子窖	22,509,767.00	7.95
18	603939	益丰药房	22,462,321.80	7.93
19	300015	爱尔眼科	21,695,143.72	7.66
20	601865	福莱特	21,206,719.32	7.49
21	688331	荣昌生物	20,208,443.97	7.14
22	600519	贵州茅台	20,103,300.00	7.10
23	300750	宁德时代	19,515,355.80	6.89
24	000596	古井贡酒	19,228,570.20	6.79
25	300760	迈瑞医疗	17,984,016.00	6.35
26	603233	大参林	17,933,746.48	6.33
27	603883	老百姓	16,397,393.60	5.79
28	600332	白云山	16,125,078.00	5.70
29	002727	一心堂	14,533,999.00	5.13
30	300122	智飞生物	14,443,121.81	5.10
31	002821	凯莱英	13,352,903.92	4.72
32	600438	通威股份	11,601,147.04	4.10
33	002847	盐津铺子	11,106,113.00	3.92
34	300347	泰格医药	10,775,047.16	3.81
35	600285	羚锐制药	10,211,818.43	3.61
36	600211	西藏药业	10,137,600.30	3.58
37	300363	博腾股份	9,628,273.00	3.40
38	603606	东方电缆	9,469,256.00	3.34
39	300765	新诺威	9,002,611.00	3.18
40	688197	首药控股	8,801,950.98	3.11
41	002594	比亚迪	8,584,746.00	3.03
42	000848	承德露露	8,335,744.00	2.94
43	300298	三诺生物	7,841,293.00	2.77
44	603899	晨光股份	7,395,628.26	2.61
45	688472	阿特斯	7,392,226.47	2.61
46	002019	亿帆医药	7,257,559.00	2.56
47	002653	海思科	6,954,077.00	2.46
48	600188	兖矿能源	6,551,236.00	2.31
49	002294	信立泰	6,525,283.86	2.30
50	688223	晶科能源	6,363,914.13	2.25
51	300014	亿纬锂能	6,347,391.00	2.24
52	600329	达仁堂	6,305,685.00	2.23
53	000933	神火股份	6,188,606.60	2.19
54	603345	安井食品	6,149,292.54	2.17
55	000999	华润三九	6,127,213.00	2.16
56	688575	亚辉龙	6,120,201.88	2.16
57	300498	温氏股份	5,841,414.00	2.06

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	996,650,662.30
卖出股票收入（成交）总额	1,106,793,305.85

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,511,226.16	0.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,511,226.16	0.80

## 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	019740	24 国债 09	10,000	1,003,418.63	0.53
2	019709	23 国债 16	5,000	507,807.53	0.27

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

## 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

注：无

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

注：无

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未参与股指期货投资。

## 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

本基金报告期内未参与国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

## 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，根据三诺生物传感股份有限公司于 2023 年 11 月 20 日发布的公告，其受到大通区市场监管局给予罚款 2000 元的行政处罚。根据中国建设银行股份有限公司于 2023 年 12 月 01 日发布的公告，其受到国家金融监督管理总局给予没收违法所得并处罚款合计 3791.879382 万元（其中，总行 2041.879382 万元，分支机构 1750 万元）的行政处罚；根据其于 2024 年 01 月 05 日发布的公告，其受到国家金融监督管理总局给予罚款 170 万元的行政处罚。

除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体未出现本期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。本基金投资上述主体的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

### 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

本报告期，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	257,739.11
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	128,745.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	386,484.93

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无



本开放式基金	国金鑫意医药消费 C	10~50
	合计	10~50

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,700.27	2.93	10,002,700.27	2.93	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	3 年
基金经理等人员	-	-	-	-	3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	3 年
其他	-	-	-	-	3 年
合计	10,002,700.27	2.93	10,002,700.27	2.93	3 年

注：本基金成立后有 10,002,700.27 份额为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 3 年，自 2020 年 6 月 30 日起至 2023 年 6 月 29 日止。自 2023 年 6 月 30 日起发起份额承诺持有期限届满，发起份额可以自由申请赎回退出。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金鑫意医药消费 A	国金鑫意医药消费 C
基金合同生效日 (2020 年 6 月 30 日) 基金份额总额	436,977,736.82	189,015,138.60
本报告期期初基金份额总额	69,053,474.78	368,773,621.94
本报告期基金总申购份额	1,742,613.51	56,792,006.72
减：本报告期基金总赎回份额	9,963,210.32	144,648,608.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	60,832,877.97	280,917,019.69

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，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

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金无投资策略的重大变更。

### 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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 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

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 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 (%)	
国金证券	2	834,662,308.38	39.68	622,579.88	40.00	-
中邮证券	1	458,588,581.49	21.80	329,977.03	21.20	-
东方财富证券	1	312,840,323.07	14.87	232,782.57	14.96	-

兴业证券	1	250,610,886 .13	11.91	186,932.36	12.01	-
首创证券	1	244,686,686 .08	11.63	182,507.83	11.73	-
东方证券	1	2,055,183.0 0	0.10	1,532.94	0.10	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用了基金专用交易席位。

(1) 基金专用交易席位的选择标准如下：

- ① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③ 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需要；
- ④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；
- ⑤ 交易佣金收取标准合理。

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

## 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(%)
国金证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
东方财	607,877.26	27.46	-	-	-	-

富证券						
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	1,606,204. 49	72.54	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-

### 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	《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年01月11日
2	《国金基金管理有限公司关于本公司办公地址变更的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年01月19日
3	《国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年01月20日
4	《国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年02月08日
5	《国金鑫意医药消费混合型证券投资基金（国金鑫意医药消费 A 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年02月08日
6	《国金鑫意医药消费混合型证券投资基金（国金鑫意医药消费 C 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年02月08日
7	《国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年03月29日
8	《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年04月16日
9	《国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年04月20日
10	《国金基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份资料信息的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年04月30日
11	《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年05月23日
12	《国金基金管理有限公司旗下基金	指定披露媒体和本基金	2024年06月22日

	调整股票估值方法的提示性公告》	基金管理人网站	
13	《国金鑫意医药消费混合型证券投资基金（国金鑫意医药消费 A 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 06 月 25 日
14	《国金鑫意医药消费混合型证券投资基金（国金鑫意医药消费 C 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 06 月 25 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：无

### 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

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。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。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日