

中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发
起式基金中基金（FOF）
2023 年中期报告

2023 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 3 月 29 日起至 2023 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产 (基金净值) 变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	40
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	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41

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	41
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	41
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	42
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12	本报告期投资基金情况	42
7.13	投资组合报告附注	46
§ 8	基金份额持有人信息	46
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	47
§ 9	开放式基金份额变动	48
§ 10	重大事件揭示	48
10.1	基金份额持有人大会决议	48
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4	基金投资策略的改变	49
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	49
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.9	其他重大事件	50
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12	备查文件目录	51
12.1	备查文件目录	51
12.2	存放地点	51
12.3	查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	
基金简称	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起（FOF）	
基金主代码	018141	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 29 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,010,292.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起（FOF）A	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起（FOF）C
下属分级基金的交易代码	018141	018142
报告期末下属分级基金的份额总额	5,004,201.09 份	5,006,090.92 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过资产配置策略和基金优选策略，进行积极主动的投资管理，力争为持有人提供长期稳健的投资回报。
投资策略	本基金投资策略包括大类资产配置策略、基金投资策略、股票投资策略、债券投资策略及资产支持证券投资策略。在大类资产配置策略上，将通过战略资产配置策略（SAA）与战术资产配置策略（TAA）的有机结合，确定并优化投资组合的资产配置比例。在基金投资策略上，基金精选部分以长期可持续的超额收益能力作为核心目标，通过采用定量与定性相结合的研究方法进行基金筛选并完成组合构建，以获取基金精选层面的 α 收益。基金精选具体包括定量评估、定性评估、基金池管理和基金投资。在股票投资策略上，结合行业配置与个股选择，在景气度向上的行业中，选择具备内生性增长基础的价值创造型企业，并重点关注相关个股的安全边际及绝对收益机会。详见《中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》。
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率*85%+中证 800 指数收益率*10%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。 本基金投资于港股通标的股票，还需面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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		招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰	张姗
	联系电话	010-63211122	0755-83077987
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	400-868-1166		95555
传真	010-66159121		0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	100004	518040	
法定代表人	胡长生	缪建民	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) - 2023 年 6 月 30 日	
	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C
本期已实现收益	10,186.60	7,641.98
本期利润	-12,328.60	-14,877.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0025	-0.0030
本期加权平均净值利润率	-0.25%	-0.30%
本期基金份额净值增长率	-0.25%	-0.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-12,329.47	-14,878.41
期末可供分配基金份额利润	-0.0025	-0.0030
期末基金资产净值	4,991,871.62	4,991,212.51

期末基金份额净值	0.9975	0.9970
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-0.25%	-0.30%

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；

4、本基金合同生效日为 2023 年 3 月 29 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A

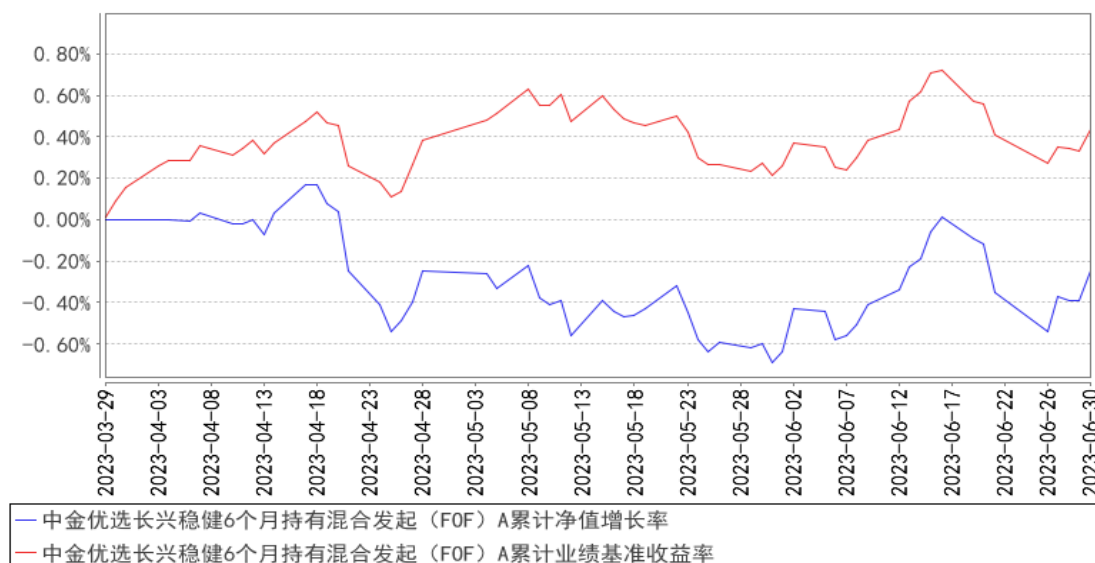
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.44%	0.12%	0.22%	0.09%	0.22%	0.03%
过去三个月	-0.25%	0.11%	0.28%	0.08%	-0.53%	0.03%
自基金合同生效起至今	-0.25%	0.10%	0.43%	0.08%	-0.68%	0.02%

中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C

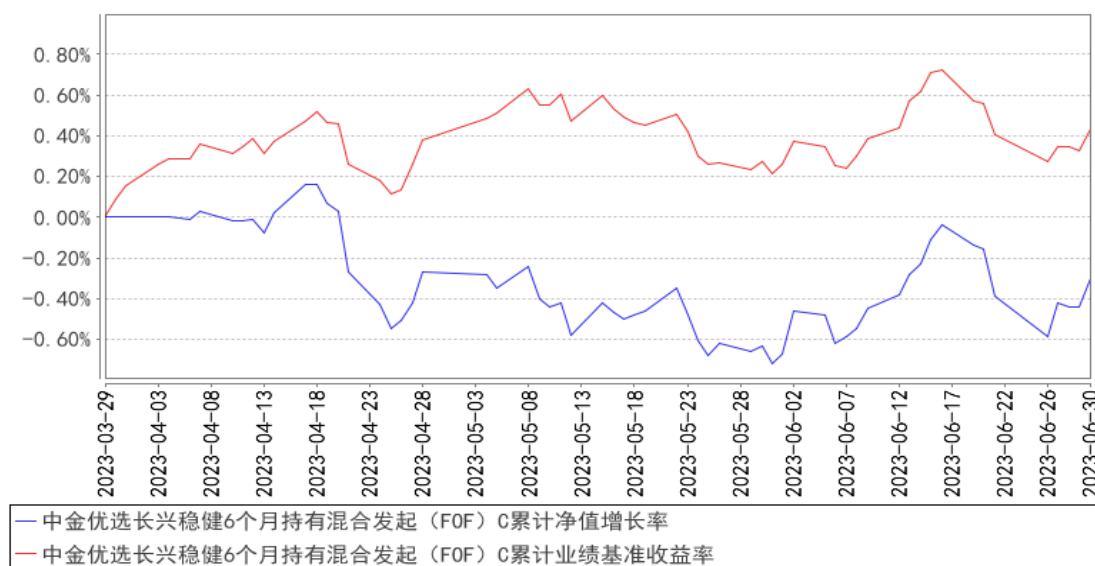
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.42%	0.12%	0.22%	0.09%	0.20%	0.03%
过去三个月	-0.30%	0.11%	0.28%	0.08%	-0.58%	0.03%
自基金合同生效起至今	-0.30%	0.10%	0.43%	0.08%	-0.73%	0.02%

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

中金优选长兴稳健6个月持有混合发起（FOF）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



中金优选长兴稳健6个月持有混合发起（FOF）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：本基金的基金合同生效日为2023年03月29日。按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

§ 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 5 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 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 45 只公募基金，证券投资基金管理规模 1208.29 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		
邢瑶	本基金基金经理	2023 年 3 月 29 日	-	5 年	邢瑶女士，经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司研究部量化研究员，中金基金管理有限公司量化指数部研究员。现任中金基金管理有限公司多资产部基金经理。

注：1、上述基金经理任职日期为本基金基金合同生效日。

2、本基金无基金经理助理。

3、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

上半年国内经济增长平稳，景气度有所下滑，流动性相对宽松。A 股市场上半年呈震荡走势，年初随着经济预期的好转市场迎来上涨，进入二季度后，预期转弱，市场随之震荡调整。风格方面，价值优于成长，小盘略好于大盘。在流动性宽裕，经济复苏平稳情况下，人工智能、低估值国企等主题投资活跃。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A 基金份额净值为 0.9975 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.25%，同期业绩基准收益率为 0.43%；中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C 基金份额净值为 0.9970 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.30%，同期业绩基准收益率为 0.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一段时间，随着政治局会议向“稳增长”倾斜的表态，预计后续将有相关政策的推出。虽然经济增长仍面临国内外复杂环境的挑战，但预计整体将企稳走强，因此对于后续经济复苏的持续性不必过于悲观。上半年国内降息的落地以及二季度股票市场的调整，使得权益市场的配置性价比上升。随着疫情对上市公司盈利带来的扰动不断淡化，市场有望从主题投资的热潮逐步转向对公司基本面的重视。

我们坚持“识别风格、甄别能力”的投资理念，通过自上而下的配置以及自下而上的选基进行分散化投资，力争获得较高的风险调整收益。下半年，我们在风格配置上保持相对均衡，避免单一风格给组合带来较大的波动。选基方面，在不同风格的基金产品中力争精选有稳定投资风格和稳健选股能力的基金。

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，本基金本报告期未实施利润分配。

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

本基金为发起式基金，截止本报告期末，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

§ 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
资产:		
银行存款	6.4.7.1	709,076.03
结算备付金		199.52
存出保证金		124.60
交易性金融资产	6.4.7.2	9,273,766.58
其中: 股票投资		-
基金投资		9,273,766.58
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	-
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		-
应收股利		6,053.66
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		9,989,220.39
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 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		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		4,098.71
应付托管费		1,217.82
应付销售服务费		819.73
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	-
负债合计		6,136.26
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	10,010,292.01
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-27,207.88
净资产合计		9,983,084.13
负债和净资产总计		9,989,220.39

注：1、报告截止日 2023 年 06 月 30 日，中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (F0F) A 的基金份额净值为 0.9975 元，期末份额总额为 5,004,201.09 份；中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (F0F) C 的基金份额净值为 0.9970 元，期末份额总额为 5,006,090.92 份。基金份额总额 10,010,292.01 份；

2、本基金合同于 2023 年 3 月 29 日生效，本报告期自 2023 年 3 月 29 日至 2023 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (F0F)

本报告期：2023 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2023 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-6,169.88
1. 利息收入		3,208.78
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,208.78
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		35,656.32
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益	6.4.7.15	-8,621.56
债券投资收益	6.4.7.16	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	44,277.88
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)	6.4.7.21	-45,035.00
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.22	0.02
减: 二、营业总支出		21,036.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,714.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,783.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,543.15
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	6.4.7.24	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.25	1,995.00
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-27,206.42
减: 所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-27,206.42
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-27,206.42

注: 本基金合同于 2023 年 3 月 29 日生效, 本报告期自 2023 年 3 月 29 日至 2023 年 6 月 30 日。

6.3 净资产 (基金净值) 变动表

会计主体: 中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

本报告期: 2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 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 (基金净值)	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	10,009,940.63	-	-	10,009,940.63
三、本期增减变动额 (减少以“-”	351.38	-	-27,207.88	-26,856.50

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-27,206.42	-27,206.42
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	351.38	-	-1.46	349.92
其中: 1. 基金申购款	351.38	-	-1.46	349.92
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	10,010,292.01	-	-27,207.88	9,983,084.13

注: 本基金合同于 2023 年 3 月 29 日生效, 本报告期自 2023 年 3 月 29 日至 2023 年 6 月 30 日。

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:

赵璧

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

中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) (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 2023 年 2 月 24 日证监许可[2023]396 号文《关于准予中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 注册的批复》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、《中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书》和《中

金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 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基金中基金, 存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金, 托管人为招商银行股份有限公司 (以下简称“招商银行”)。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台及蚂蚁(杭州)基金销售有限公司共同销售, 募集期为 2023 年 3 月 23 日起至 2023 年 3 月 27 日。经向中国证监会备案, 《中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》(以下简称“基金合同”) 于 2023 年 3 月 29 日正式生效, 基金合同生效日基金实收份额为 10,009,940.63 份(含利息转份额 900.57 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《中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书》的相关内容, 本基金根据认购、申购费用收取方式的不同, 将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用, 而不计提销售服务费的, 称为 A 类基金份额; 在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用, 而是从本类别基金资产中计提销售服务费的, 称为 C 类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书及基金产品资料概要中具体列示。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同, 本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。计算公式为计算日某类基金份额净值 = 计算日该类基金份额的基金资产净值 / 计算日该类基金份额余额总数。投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。

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《中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书》的有关规定, 本基金的投资范围为经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(包括商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF, 下同)、QDII 基金和香港互认基金等)。本基金还可投资于股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场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。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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》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和《资产管理产品相关会计处理规定》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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表是本基金的首份财务报表,实际编制期间为自 2023 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征,在初始确认时将金融资产分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

本基金持有的股票投资、基金投资及债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式,在此情形下,所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类,否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,分类为以摊余成本计量的金融资产:

(1) 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标;

(2) 该金融资产的合同条款规定, 在特定日期产生的现金流量, 仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外, 本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在初始确认时, 如果能够消除或显著减少会计错配, 本基金可以将本应以摊余成本计量的金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

管理金融资产的业务模式, 是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础, 确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估, 以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中, 本金是指金融资产在初始确认时的公允价值; 利息包括对货币时间价值、与特定期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外, 本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估, 以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债 (含属于金融负债的衍生工具) 和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

(2) 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后, 对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时, 于资产负债表内确认。

在初始确认时, 金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入

当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

(2) 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

(3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

(4) 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

(1) 所转移金融资产的账面价值；

(2) 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

(1) 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

(2) 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为企面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收账款，本基金始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

除应收账款外，本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- (1) 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- (2) 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包

含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认并计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认为当期损益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，计算利息计入当期损益。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息计入当期损益。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的收入差异较小的可采用合同利率。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值；即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期末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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《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)、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》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)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 暂不征收企业所得税。

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

自 2018 年 1 月 1 日起, 资管产品管理人 (以下称管理人) 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。

2018 年 1 月 1 日 (含) 以后, 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、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税; 对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税; 同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价, 暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

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

(e) 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。

(f) 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。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日 (含) 以后运营过程中缴纳的增值税, 分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率, 计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	709,076.03
等于: 本金	708,930.80
加: 应计利息	145.23

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	709,076.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	9,318,801.58	-	9,273,766.58	-45,035.00
其他	-	-	-	-
合计	9,318,801.58	-	9,273,766.58	-45,035.00

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

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。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

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。

6.4.7.7.2 报告期末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

本基金本报告期末无其他负债。

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A

项目	本期 2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	5,003,970.30	5,003,970.30
本期申购	230.79	230.79
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
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	5,004,201.09	5,004,201.09

中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C

项目	本期 2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	5,005,970.33	5,005,970.33
本期申购	120.59	120.59
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
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	5,006,090.92	5,006,090.92

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

中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	10,186.60	-22,515.20	-12,328.60
本期基金份额交易产生的变动数	-0.03	-0.84	-0.87
其中：基金申购款	-0.03	-0.84	-0.87
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,186.57	-22,516.04	-12,329.47

中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	7,641.98	-22,519.80	-14,877.82
本期基金份额交易产生的变动数	-0.10	-0.49	-0.59
其中：基金申购款	-0.10	-0.49	-0.59
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,641.88	-22,520.29	-14,878.41

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,200.49
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	7.93
其他	0.36
合计	3,208.78

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

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票买卖差价收入。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	30,812.00
减：卖出/赎回基金成本总额	33,386.25
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	6,047.31
基金投资收益	-8,621.56

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.16.2 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。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 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。

6.4.7.17.4 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。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 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。

6.4.7.19.2 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。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	44,277.88
合计	44,277.88

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-45,035.00
股票投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-45,035.00
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	-45,035.00

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
募集期利息	0.02
合计	0.02

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用
	2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)	1,051.47
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	9,501.08
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	2,356.38

注：上述当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。该三项费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用。

6.4.7.24 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
划款手续费	1,995.00
合计	1,995.00

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、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
招商银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东

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

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)
中金公司	776,847.90	100.00

6.4.10.1.5 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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 2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	4.65

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。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扣除所持有本基金管理人自身管理的其他基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人自身管理的其他基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）×0.50%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金托管人自身托管的其他基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值扣除所持有本基金托管人自身托管的其他基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）×0.15%/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 2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C	合计
中金基金	-	2,540.47	2,540.47
合计	-	2,540.47	2,540.47

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

2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.20% 的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末。其计算公式为：

C 类基金份额每日应计提的销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.20% / 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
		中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A
基金合同生效日 (2023 年 3 月	5,000,450.00	5,000,450.00

29 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	5,000,450.00	5,000,450.00
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	5,000,450.00	5,000,450.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	99.9250%	99.8873%

注: 报告期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额, 基金总赎回份额含转换出份额。

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

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 2023 年 3 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	709,076.03	3,200.49

注: 本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管, 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

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期末持有基金管理人以及管理人关联方所管理的基金。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未实施利润分配。

6.4.12 期末 (2023 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 2023 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 2023 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 2023 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

本基金为混合型基金中基金, 其预期风险和预期收益水平高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金, 低于股票型基金和股票型基金中基金。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。

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。

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。

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。

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。

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。

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，本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF 联接基金除外)不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。在基金方面无高度集中的特征。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，且本基金投资于流通受限

基金不高于本基金资产净值的 10%，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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	708,930.80	-	-	145.23	709,076.03
结算备付金	199.42	-	-	0.10	199.52
存出保证金	124.50	-	-	0.10	124.60
交易性金融资产	-	-	-	9,273,766.58	9,273,766.58
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	6,053.66	6,053.66
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	709,254.72	-	-	9,279,965.67	9,989,220.39
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	819.73	819.73
应付管理人报酬	-	-	-	4,098.71	4,098.71
应付托管费	-	-	-	1,217.82	1,217.82
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	6,136.26	6,136.26
利率敏感度缺口	709,254.72	-	-	9,273,829.41	9,983,084.13

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。

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。本基金主要投资于公开募集的基金，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 2023 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	—	—
交易性金融资产—基金投资	9,273,766.58	92.89
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	9,273,766.58	92.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	9,273,766.58
第二层次	-
第三层次	-
合计	9,273,766.58

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应收款项和其他金融负债，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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	9,273,766.58	92.84

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	-	-
	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	709,275.55	7.10
8	其他各项资产	6,178.26	0.06
9	合计	9,989,220.39	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资产。

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

本基金本报告期末未持有股票资产。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内无股票交易。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内无股票交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无股票交易。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

基金投资以长期可持续的超额收益能力作为核心目标，通过采用定量与定性相结合的研究方法进行基金筛选并完成组合构建，以获取基金精选层面的 α 收益。基金精选具体包括定量评估、定性评估、基金池管理和基金投资。具体为：

(1) 定量评估

对于主动管理型产品，基金管理人主要对基金经理的能力和风格进行定量分析。对可比基金进行对比分析，确定投资对象。被动管理类基金是资产配置的工具类产品，在基金筛选中更关注流动性以及跟踪误差。

主动管理权益类基金的研究首先是进行合理分类，我们将主动权益基金分为综合基金和行业性基金，在对比研究确定基金品种时，综合基金的可比基金是全部综合基金，而行业性基金的可比基金是同行业的基金产品。产品评估维度主要分为业绩评估、能力评估和投资风格评估。其中业绩评估主要关注历史 1 年、3 年维度的年化收益率、年化波动率、最大回撤、下行风险、夏普比例等指标。而能力维度主要对基金经理选股能力、择时能力、行业配置能力、风险控制能力进行评价。风格评价主要包括持仓风格和交易特征的评价，持仓风格主要包含行业配置特征、个股特征，交易特征主要包括换手率、集中度等。最终在可比基金中选取能力维度更优，风格维度更符合投资需求的产品。

主动管理债券类基金的研究主要从业绩分析、投资特征分析、业绩归因与能力分析等维度展开。其中业绩评估主要关注历史 1 年、3 年维度的年化收益率、年化波动率、最大回撤、下行风险、夏普比例等指标。投资特征分析主要从杠杆、券种、久期、评级等维度进行组合特征分析。业绩归因与能力分析主要就择券能力、杠杆择时、久期择时等能力进行分析。选取符合投资需求

的债券产品。

(2) 定性评估

通过尽职调查进行定性评估，了解基金经理的投资框架、投资理念、投资特征等，重点在于分析基金经理的投资策略与框架的有效性。

尽职调查主要就公司投资理念、投资流程、投研团队、风险管理框架与方法、投资策略等角度展开。

(3) 基金池管理

对于符合定量和定性筛选标准的基金将进入基金池。目前中金基金池包含二级基金池——基础池、重点池，其中重点池从属于基础池。为使得基金池中的基金符合定量和定性筛选标准，对入池基金产品进行持续跟踪并及时调整。

建立完善的基金池管理制度，规范基金池的出入池标准和程序。对基金池及基金投资过程中存在的问题由相关投研人员共同商议，确保基金投资风险可控。对于基金重点池基金进行定期跟踪分析，关注近期风险，确保基金符合投资标准。

(4) 基金组合管理

基金组合的构建通过“核心-卫星”模式实施。“核心”策略是根据配置思路，选取具备长期配置价值的公募基金产品；“卫星”策略是根据阶段性机会精选行业、主题、风格等公募基金产品。

本基金为混合型基金中基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

本基金投资于港股通标的股票，还需面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	006965	财通安瑞短债 A	契约型开放式	532,970.11	616,166.74	6.17	否
2	110052	易方达安源中短债 C	契约型开放式	571,732.43	616,156.04	6.17	否
3	006804	富国短债 A	契约型开放式	537,957.83	615,692.74	6.17	否

4	007823	天弘弘择短债 A	契约型开放式	546,167.29	614,165.12	6.15	否
5	003327	万家鑫璟纯债 A	契约型开放式	498,719.06	606,741.61	6.08	否
6	008022	建信短债 F	契约型开放式	545,729.93	604,723.34	6.06	否
7	511360	海富通中证短融 ETF	交易型开放式	5,400.00	580,483.80	5.81	否
8	003949	兴全稳泰 A	契约型开放式	358,627.21	406,073.59	4.07	否
9	000032	易方达信用债 A	契约型开放式	360,069.82	404,646.46	4.05	否
10	000191	富国信用债 A	契约型开放式	327,202.39	404,323.99	4.05	否
11	050027	博时信用债纯债 A	契约型开放式	357,435.01	402,722.03	4.03	否
12	110007	易方达稳健收益 A	契约型开放式	289,115.48	399,123.92	4.00	否
13	000385	景顺长城景颐双利 A	契约型开放式	253,000.74	398,729.17	3.99	否
14	000402	工银瑞信纯债 A	契约型开放式	339,039.21	397,455.67	3.98	否
15	002636	广发集裕 A	契约型开放式	311,356.86	391,375.57	3.92	否
16	420002	天弘永利债券 A	契约型开放式	331,057.09	390,912.21	3.92	否
17	000107	富国稳健增强 AB	契约型开放式	308,209.87	381,872.03	3.83	否
18	000242	景顺长城策略精选	契约型开放式	23,787.95	70,293.39	0.70	否
19	001955	中欧养老产业 A	契约型开放式	19,746.48	63,873.94	0.64	否
20	008328	诺安新兴产业	契约型开放式	36,546.03	62,625.28	0.63	否
21	000880	富国研究精选 A	契约型开放式	24,150.48	61,269.77	0.61	否

22	000893	工银瑞信 创新动力	契约型开放 式	56,420.70	60,313.73	0.60	否
23	004674	富国新机 遇 A	契约型开放 式	34,658.27	57,141.09	0.57	否
24	007449	兴全多维 价值 A	契约型开放 式	31,025.17	56,890.85	0.57	否
25	090013	大成竞争 优势	契约型开放 式	34,992.23	55,896.59	0.56	否
26	270008	广发核心 精选	契约型开放 式	12,944.52	55,713.21	0.56	否
27	000326	南方中小 盘成长	契约型开放 式	44,566.44	54,723.13	0.55	否
28	519688	交银精选	契约型开放 式	61,641.16	53,664.79	0.54	否
29	159850	华夏恒生 中国企业 ETF	交易型开放 式	78,400.00	49,548.80	0.50	否
30	513180	华夏恒生 科技 ETF	交易型开放 式	89,900.00	48,096.50	0.48	否
31	512480	国联安中 证全指半 导体 ETF	交易型开放 式	47,000.00	42,018.00	0.42	否
32	007130	中庚小盘 价值	契约型开放 式	15,307.04	36,071.04	0.36	否
33	260112	景顺长城 能源基建	契约型开放 式	16,415.20	35,095.70	0.35	否
34	000940	富国中小 盘精选 A	契约型开放 式	11,015.51	32,352.55	0.32	否
35	011099	富国价值 创造 A	契约型开放 式	42,186.07	31,441.28	0.31	否
36	000979	景顺长城 沪港深精 选	契约型开放 式	13,455.44	25,457.69	0.26	否
37	159915	创业板	交易型开放 式	11,500.00	24,886.00	0.25	否
38	011649	易方达逆	契约型开放	22,671.94	23,195.66	0.23	否

		向投资 A	式				
39	510880	华泰柏瑞 红利 ETF	交易型开放 式	7,600.00	22,328.80	0.22	否
40	006551	中庚价值 领航	契约型开放 式	8,688.09	19,504.76	0.20	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	124.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	6,053.66
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	6,178.26

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A	10	500,420.11	5,000,450.00	99.93	3,751.09	0.07
中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C	9	556,232.32	5,000,450.00	99.89	5,640.92	0.11
合计	19	526,857.47	10,000,900.00	99.91	9,392.01	0.09

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A	10.04	0.0002
	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C	100.50	0.0020
	合计	110.54	0.0011

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	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A	0
	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A	0
	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C	0
	合计	0

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	10,000,900.00	99.91	10,000,900.00	99.91	自基金合同生效之日起

金					不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,900.00	99.91	10,000,900.00	99.91	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金优选长兴稳健6个月持有混合发起 (FOF) A	中金优选长兴稳健6个月持有混合发起 (FOF) C
基金合同生效日 (2023 年 3 月 29 日) 基金份额总额	5,003,970.30	5,005,970.33
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	230.79	120.59
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,004,201.09	5,006,090.92

§ 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

2023 年 1 月 20 日，本基金管理人发布公告，赵璧先生自 2023 年 1 月 18 日起担任公司总经理、董事，同日起不再担任公司副总经理；孙菁女士自 2023 年 1 月 18 日起不再担任公司总经理、董事。

(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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及表决意见等重大影响事件。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	-	-	-	-	-

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；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。

10.8.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中金公司	-	-	-	-	-	-	776,847.90	100.00

10.9 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	中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2023-03-20
2	中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-03-20
3	中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书	中国证监会规定媒介	2023-03-20
4	中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2023-03-20
5	中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同	中国证监会规定媒介	2023-03-20
6	中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 托管协议	中国证监会规定媒介	2023-03-20
7	中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2023-03-30
8	关于中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 开放申购和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-17

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过 20%的时间区间					(%)
自有资金	1	2023 年 03 月 29 日-2023 年 06 月 30 日	0.00	10,000,900.00	0.00	10,000,900.00	99.91
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形。如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响;极端情况下可能引发基金的流动性风险,发生暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形;在特定情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平,从而可能面临基金合同终止等基金合同中约定的情形。</p>							

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优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 募集注册的文件
- 2、《中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》
- 3、《中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 托管协议》
- 4、《中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书》及其更新
- 5、中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 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、报告期内中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 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

2023 年 8 月 31 日