

中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：中国国际金融股份有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52

8.3 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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 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	57
8.7 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	58
8.8 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	58
8.9 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	58
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12 投资组合报告附注	58
§ 9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
9.3 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	60
§ 10 开放式基金份额变动	60
§ 11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
11.2 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	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
11.4 基金投资策略的改变	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8 其他重大事件	62
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	63
12.1 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	63
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 13 备查文件目录	63
13.1 备查文件目录	63
13.2 存放地点	63
13.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划	
基金简称	集合-中金安心回报	
基金主代码	920011	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 30 日	
基金管理人	中国国际金融股份有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	206,016,027.55 份	
基金合同存续期	本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期至 2024 年 12 月 31 日。自 2024 年 12 月 31 日后，本集合计划是否存续按照中国证监会有关规定执行。	
下属分级基金的基金简称	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额
下属分级基金的交易代码	920011	920921
报告期末下属分级基金的份额总额	116,673,161.52 份	89,342,866.03 份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券等大类资产中充分挖掘市场轮动机会、利用潜在投资价值，力求实现集合计划资产的持续稳定增值。
投资策略	依靠对大类资产配置和趋势研判的丰富实践与投资能力，结合系统化策略模型体系以及严格的风险预算机制，长期获取优异的绝对回报。大类资产配置层面，主要基于风险平价理念、长期资本市场预期收益和周期性动态资产配置确定资产摆布，在此基础上依赖短期战术配置模型调整权益敞口、债券久期等获取交易收益。大类资产内部，主要挖掘相对市场指数的超额收益。其中，股票资产内部主要通过风格、行业配置模型以及定性和定量相结合的选股策略获取超额收益；债券内部通过对不同类型、期限、评级以及信用个体的研判挖掘超额收益。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为中债新综合全价指数收益率×65%+中证 800 指数收益率×25%+恒生指数收益率×5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%
风险收益特征	本集合计划为混合型集合资产管理计划，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中国国际金融股份有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	宋璐芳	朱绍纲
	联系电话	010-65051166	(010) 85238309
	电子邮箱	songlf@cicc.com.cn	zhzsg@hxb.com.cn
客户服务电话		010-65051166	95577
传真		86(10) 65059372	(010) 85238680
注册地址		北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层	北京市东城区建国门内大街22号(100005)
办公地址		北京朝阳区建国门外大街1号国贸3期B座42层	北京市东城区建国门内大街22号(100005)
邮政编码		100004	100005
法定代表人		陈亮	李民吉

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cicc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路222号30楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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		2022 年		2021 年	
	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额	中金安心回 报 A 类份额	中金安心回 报 C 类份额
本期 已实现 收益	-7,819,796.92	-6,117,889.19	-58,817,625.18	-38,361,355.41	74,175,384. .21	41,254,162. 92
本期 利润	-6,787,611.65	-5,756,539.21	-63,017,226.16	-41,165,533.05	8,800,765. 62	4,160,537.1 4
加权 平均	-0.0491	-0.0572	-0.3200	-0.3233	0.0197	0.0148

基金份额 本期 利润						
本期 加权 平均 净值 利润 率	-4.63%	-5.48%	-25.96%	-26.47%	1.41%	1.06%
本期 基金 份额 净值 增长 率	-5.14%	-5.51%	-22.81%	-23.12%	-0.35%	-0.75%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末 可供 分配 利润	2,243,623.21	403,255.78	12,935,324.57	7,117,126.40	92,641,743 .84	57,735,983. 56
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.0192	0.0045	0.0744	0.0631	0.3919	0.3828
期末 基金 资产 净值	118,916,784.7 3	89,746,121.81	186,885,748.37	119,910,974.02	329,044,70 3.79	208,552,760 .16
期末 基金 份额 净值	1.0192	1.0045	1.0744	1.0631	1.3919	1.3828
3.1.3 累计 期末 指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金 份额	-13.91%	-17.95%	-9.25%	-13.17%	17.57%	12.95%

累计净值增长率						
---------	--	--	--	--	--	--

注：①所述集合计划业绩指标不包括持有人交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

③对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金安心回报 A 类份额

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
过去三个月	-1.03%	0.16%	-1.26%	0.24%	0.23%	-0.08%
过去六个月	-1.92%	0.16%	-2.55%	0.25%	0.63%	-0.09%
过去一年	-5.14%	0.45%	-1.88%	0.25%	-3.26%	0.20%
过去三年	-27.03%	0.64%	-6.83%	0.32%	-20.20%	0.32%
自基金合同生效起至今	-13.91%	0.64%	-1.28%	0.33%	-12.63%	0.31%

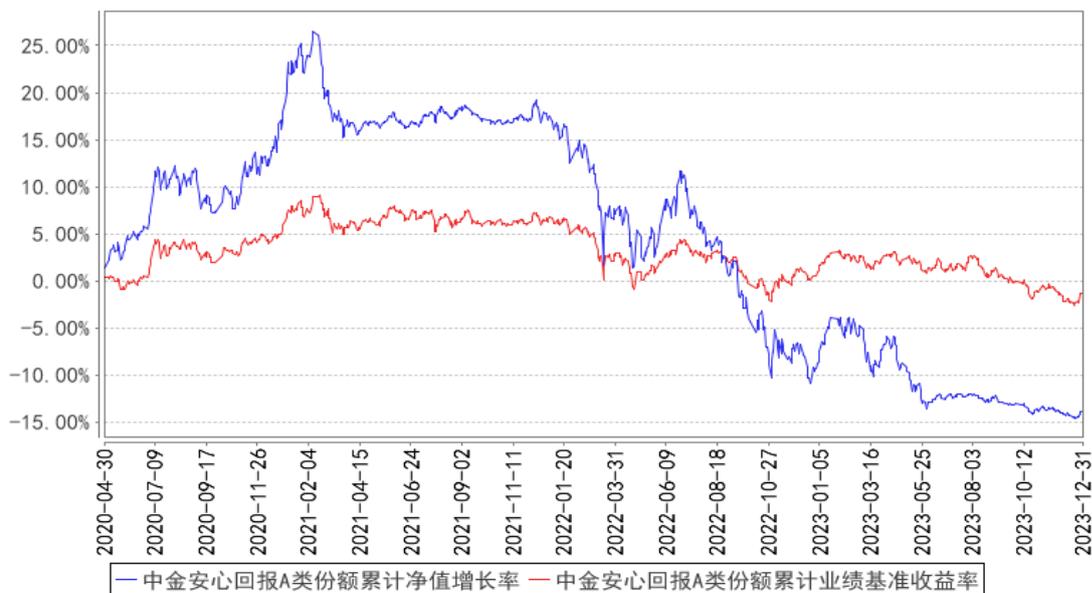
中金安心回报 C 类份额

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
过去三个月	-1.12%	0.16%	-1.26%	0.24%	0.14%	-0.08%
过去六个月	-2.12%	0.16%	-2.55%	0.25%	0.43%	-0.09%
过去一年	-5.51%	0.45%	-1.88%	0.25%	-3.63%	0.20%

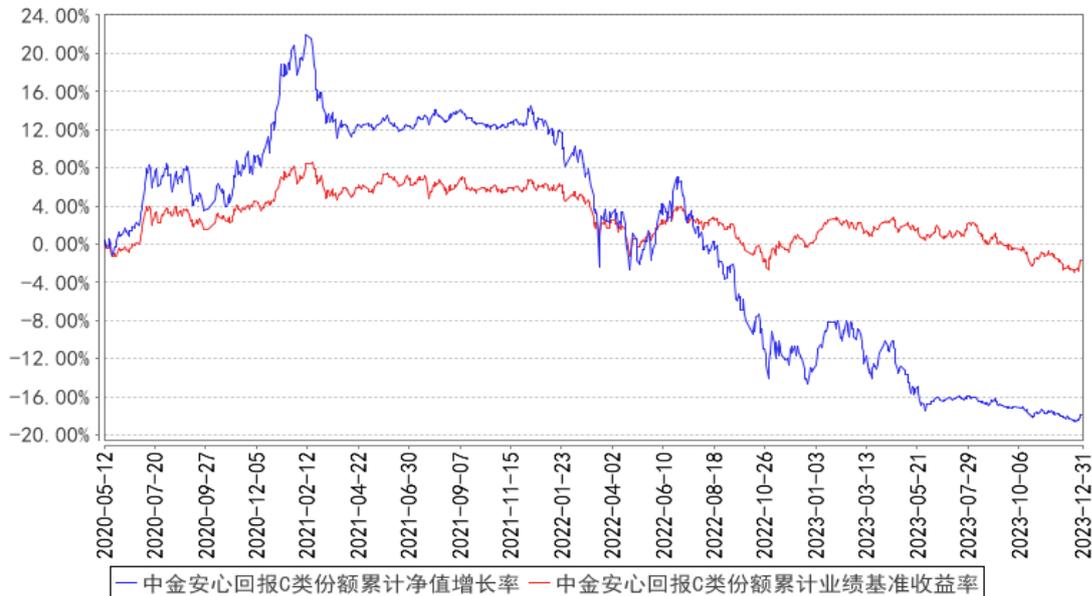
过去三年	-27.90%	0.64%	-6.83%	0.32%	-21.07%	0.32%
自基金合同生效起至今	-17.95%	0.64%	-1.67%	0.33%	-16.28%	0.31%

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

中金安心回报A类份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

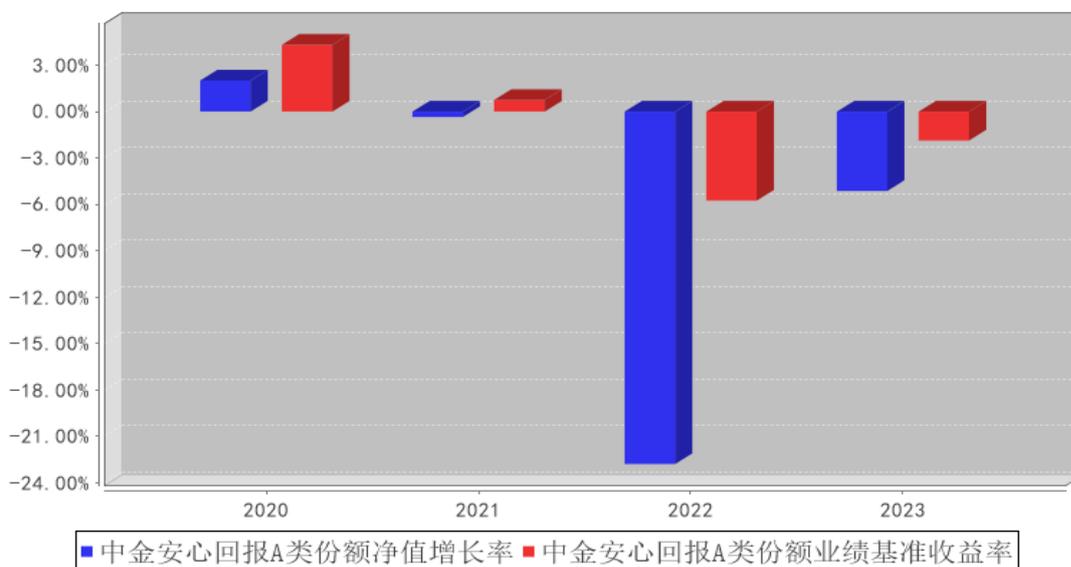


中金安心回报C类份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

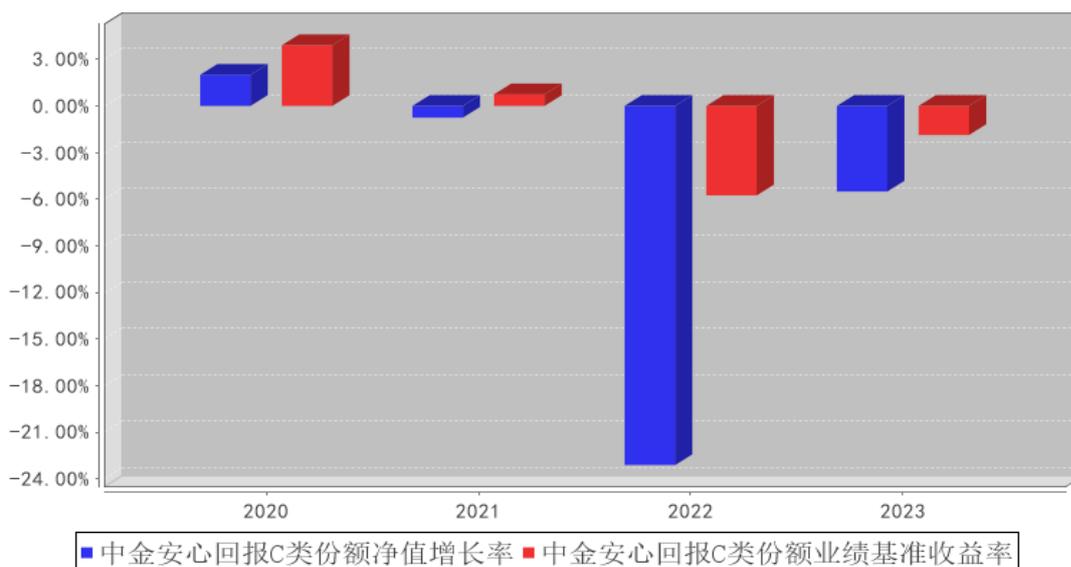


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金安心回报A类份额基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



中金安心回报C类份额基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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

中国国际金融股份有限公司（中金公司，601995.SH，3908.HK）成立于1995年，总部位于北京。中金公司一直致力于为多元化的客户群体提供高质量金融增值服务，建立了以研究和信息技术

术为基础，投资银行、股票业务、固定收益、资产管理、私募股权和财富管理全方位发展的业务结构。2015 年，中金公司在香港联交所主板成功挂牌上市。2020 年，中金公司在上海证券交易所主板成功挂牌上市。

中金公司资产管理部成立于 2002 年，参照国际行业标准与国内监管要求，构建了面向境内外市场统一的资产管理业务平台，为客户提供高质量的投资管理服务，努力实现客户资产的长期增值。中金资管业务牌照齐全、产品丰富；拥有全国社保基金管理人、企业年金投资管理人、职业年金管理人、保险资金投资管理人、境内集合/单一资产管理计划、境内合格机构投资者（QDII）、人民币境内合格机构投资者（RQDII）、境外合格机构投资者（QFII）、人民币境外合格机构投资者（RQFII）等多项业务资格。中金公司在香港设立了独立的资产管理公司——中国国际金融香港资产管理有限公司（以下简称“中金香港资管公司”），拥有香港《证券及期货条例》下第 1 类（证券交易）、第 4 类（就证券提供意见）和第 9 类（提供资产管理）SFC 牌照。

中金公司根据《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》的要求，截至 2023 年 12 月 31 日，旗下已有七只存续大集合产品完成公募化改造，分别为：中金恒瑞债券型集合资产管理计划、中金新锐股票型集合资产管理计划、中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划、中金精选股票型集合资产管理计划、中金进取回报灵活配置混合型集合资产管理计划、中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划、中金优势领航一年持有混合型集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
顾柔刚	本基金的基金经理	2023 年 6 月 1 日	-	11.98 年	管理学硕士，10 年以上证券基金从业经验。曾任瑞银集团研究助理，申万宏源证券研究所海外消费分析师，光大证券研究所海外消费首席分析师，多次获得新财富最佳分析师荣誉；2018 年 6 月加入鹏华基金管理有限公司，任国际业务部基金经理；2021 年 7 月加入中金公司，任资产管理部投资经理。
李飞	本基金的基金经理	2020 年 4 月 30 日	2023 年 5 月 31 日	12.70 年	李飞：2008 年获华中科技大学经济学学士和文学学士，2010 年获法国北方高等商学院理学硕士，2010 年—2015 年担任国家外汇管理局高级经理，负责全球资产配置工作；2016 年—2017 年担任中邮创业基金 QDII 投资经理，负责港股组合投资管理；2017 年—2018 年担任鹏扬基金

					多资产策略部执行总经理,负责股债混合策略投资管理;2018年6月加入中金公司资产管理部,担任执行总经理,负责资产配置和FOF业务。
安安	本基金的基金经理	2023年6月1日	-	15.50年	2012年加入中金公司固定收益部自营交易团队,从事利率债交易、利率互换、国债期货等衍生品交易,2018年加入中金公司固收资管业务团队,现担任资产管理部固定收益投资总监。2008年加入中银国际证券定息收益部自营交易团队,历任交易员、高级经理。

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

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

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.本集合计划投资经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

5.证券从业年限按照实际从事相关工作起算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责、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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,制定了《公平交易管理办法》,明确公平交易的适用范围、原则、管控措施、行为监控、信息披露等,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送,严禁利用所管理的投资组合为任何第三方谋取不正当利益。

公司建立了严谨的投资管理体系和规范的投资运作流程,通过制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现,并通过对投资交易行为的监控和分析评估,加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定公司内部公平交易制度，明确公平交易的适用范围、原则、管控措施、行为监控、信息披露等，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，严禁利用所管理的投资组合为任何第三方谋取不正当利益。

公司建立了严谨的投资管理体系和规范的投资运作流程，通过制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现，并通过对投资交易行为的监控和分析评估，加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内，公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和内部公平交易制度，未发现投资组合之间存在不公平交易的情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本产品根据市场变化变更了基金经理，由固收基金经理和权益基金经理分别负责相应资产的投资。更换基金经理以后，在投资风格上，在产品合同约定的投资范围内，采取了更加稳健均衡的权益投资配置思路。一方面，严格控制权益仓位，一方面在行业和投资主线上更加均衡，从而在下半年较好地控制了产品的整体回撤和波动。

展望 2024 年，我们会延续稳健的投资理念，权益仓位上根据市场情况进行小幅的调整，整体跟 2023 年下半年类似。行业配置上保持均衡，不过多的对单一行业或因子进行风险暴露。坚持积小胜成大胜的理念，力争在控制好波动和回撤的情况下，去获取优于市场的表现，并持续保持。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0192 元，份额累计净值为 2.0652 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0045 元，份额累计净值为 1.0045 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-5.14%，同期业绩比较基准收益率为-1.88%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-5.51%，同期业绩比较基准收益率为-1.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，宏观经济层面，我们认为考虑到中国庞大的人口数量，较低的人均收入情况，

以及日趋进步的制造业全球竞争力，内生性的经济增长韧性不可低估。此外，政府托底经济的能力和意愿也不可忽视。因此整体经济大概率将延续弱复苏的态势，出现经济衰退和硬着陆的极端悲观情境概率较小。

市场层面，跟 2023 年初相比，当前较为有利的方面在于市场情绪上较为保守，低于预期的概率和空间虽然存在，但相对有限，需要持续的跟踪观察。但如果经济基本面出现显著好转，则市场上行空间可能会打开，当前位置的整体赔率占优。而反观 2023 年，年初市场对经济复苏预期较高，二季度开始经济复苏和政策刺激弱于预期导致市场表现欠佳。展望全年，我们认为小概率情况下，市场出现重大的利好，比如但不限于超常规的财政刺激、全面改革等，则市场有望迎来反转，或出现大级别的上行空间。大概率情况下，经济弱复苏延续，市场震荡延续，或震荡下行，则需要基金经理具备较强的市场敏锐度和交易能力，在震荡中参与阶段性的投资机会获取收益。

中观角度，我们看好三条主线。一是出海链。跟传统意义上的出口代工有所区别，我们看好的出海链既包含实体产品也包括服务、产能等，不管是 to C 还是 to B 都需要有一定的竞争壁垒和较好的竞争格局，能够从海外市场持续获得更高的市场份额。我们认为中国的产业升级已经具备了较强的国际竞争力，也已经逐渐在国际市场展露头角，未来几年有机会看到在各个领域快速的渗透，复制日本在 90 年代以后的产业成长路径。二是稳健盈利、现金流和公司治理较好的上市公司。虽然通常市场会把这类资产称为高股息标的，但本质并非当期分红多高，而在于能否持续获得稳定的现金流，同时愿意与股东分享收益。我们认为，基于当前对经济环境的展望，能够赚取稳定现金流，提供较高派息的公司，或会对投资者产生越来越强的吸引力，从而实现股价的稳定增长。三是港股市场的高弹性标的。我们展望港股市场在今年可能会有阶段性的显著反弹机会，一方面是联储降息或带来资金的回归，一方面是中国经济企稳可能带来的预期修复，考虑到前期跌幅较深，反弹的空间可能会比较大，在反弹中选取科技、消费等相对高弹性的标的，也有可能成为今年超额收益的来源。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作，强化制度完善及对制度执行情况的监督检查，相关主要工作如下：1) 紧密跟踪并组织落实法律法规、自律规则及监管要求，不断完善基金运作管理内部制度建设，促进依法合规展业；2) 研究、投资交易方面，围绕内幕交易、利用未公开信息交易等重点防范的违法违规行为和各项最新监管要求，开展合规培训，进一步提高员工合规守法意识。3) 营销与销售方面，持续对基金宣传推介材料、销售服务协议等材料文件进行合规审查，定期开展投资者适当性培训及销售业务专项培训，加强销售行为管理。4) 基金运作保障方面，持续为注册登记、基金会计、资金清算等业务提供合规咨询，适时开

展合规检查，为基金运营安全提供法律合规支持。5) 信息披露方面，严格落实《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，更新信息披露工作流程，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露内容的真实、准确、完整、及时、规范。6) 以中国证监会《季度监察稽核项目表》为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，同时有重点地开展定期不定期的合规检查、内部稽核，促进公司合规运作。报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施不断完善，坚持维护基金份额持有人合法权益。本基金管理人将继续从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益，提高监察稽核工作的有效性。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据企业会计准则、中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，估值委员会负责组织制定所管理资管产品的估值政策和程序，以及特殊情况下的估值决策。定期对估值政策与程序进行评价，在发生影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时修订估值政策及程序。使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《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，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害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，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为,由基金管理人编制并经托管人复核的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(24)第 P00240 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划全体持有人
审计意见	<p>我们审计了中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注(以下简称“财务报表”)。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>中国国际金融股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划 2023 年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要</p>

	<p>报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重</p>

	大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	韩云飞	杨婧
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼	
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,362,310.62	36,544,523.21
结算备付金		1,424,283.39	17,500,164.99
存出保证金		77,991.32	1,573,832.92
交易性金融资产	7.4.7.2	200,664,441.72	265,001,267.27
其中：股票投资		35,590,952.38	243,619,577.53
基金投资		-	-
债券投资		165,073,489.34	21,381,689.74
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-769.82	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		5,569,311.73	-
应收股利		-	5,885.64
应收申购款		-	1,608.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		210,097,568.96	320,627,282.51
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1.44	9,938,524.37
应付赎回款		218,113.92	1,352,526.78
应付管理人报酬		177,395.92	265,140.26
应付托管费		26,609.36	39,771.06
应付销售服务费		30,473.13	41,387.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,293.21	140.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	977,775.44	2,193,069.79
负债合计		1,434,662.42	13,830,560.12
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	206,016,027.55	286,744,271.42
未分配利润	7.4.7.12	2,646,878.99	20,052,450.97
净资产合计		208,662,906.54	306,796,722.39
负债和净资产总计		210,097,568.96	320,627,282.51

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 206,016,027.55 份，其中中金安心回报 A 类基金份额总额 116,673,161.52 份，基金份额净值 1.0192 元。中金安心回报 C 类基金份额总额 89,342,866.03 份，基金份额净值 1.0045 元。

7.2 利润表

会计主体：中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-8,652,929.70	-98,558,113.86
1. 利息收入		276,434.24	597,054.31
其中：存款利息收入	7.4.7.13	184,697.38	583,937.61
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		91,736.86	13,116.70
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,324,713.77	-92,176,644.30

其中：股票投资收益	7.4.7.14	-13,935,266.78	-102,295,624.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,769,007.95	4,984,815.31
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	16,441.88	-335,364.22
股利收益	7.4.7.19	1,825,103.18	5,469,529.55
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填 列)	7.4.7.20	1,393,535.25	-7,003,778.62
4. 汇兑收益(损失以 “-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以 “-”号填列)	7.4.7.21	1,814.58	25,254.75
减：二、营业总支出		3,891,221.16	5,624,645.35
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,531,327.62	4,005,946.96
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	379,699.14	600,892.09
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	422,050.81	625,717.21
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		326,526.02	190,580.48
其中：卖出回购金融资 产支出		326,526.02	190,580.48
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		44,307.57	3,808.61
8. 其他费用	7.4.7.23	187,310.00	197,700.00
三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列)		-12,544,150.86	-104,182,759.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以 “-”号填列)		-12,544,150.86	-104,182,759.21
五、其他综合收益的税 后净额		-	-
六、综合收益总额		-12,544,150.86	-104,182,759.21

7.3 净资产变动表

会计主体：中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2023年1月1日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年12月31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	286,744,271.42	-	20,052,450.97	306,796,722.39
二、本期期初净资产	286,744,271.42	-	20,052,450.97	306,796,722.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-80,728,243.87	-	-17,405,571.98	-98,133,815.85
(一)、综合收益总额	-	-	-12,544,150.86	-12,544,150.86
(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)	-80,728,243.87	-	-4,861,421.12	-85,589,664.99
其中：1. 基金申购款	1,635,423.48	-	138,243.66	1,773,667.14
2. 基金赎回款	-82,363,667.35	-	-4,999,664.78	-87,363,332.13
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	206,016,027.55	-	2,646,878.99	208,662,906.54
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	387,219,736.55	-	150,377,727.40	537,597,463.95
二、本期期初净资产	387,219,736.55	-	150,377,727.40	537,597,463.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-	-230,800,741.56
	100,475,465.13		130,325,276.43	
(一)、综合收益总额	-	-	-	-104,182,759.21
			104,182,759.21	
(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)	-	-	-26,142,517.22	-126,617,982.35
	100,475,465.13			

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	3,356,261.81	-	909,911.20	4,266,173.01
2. 基金赎回款	- 103,831,726.94	-	-27,052,428.42	-130,884,155.36
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	286,744,271.42	-	20,052,450.97	306,796,722.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>孙男</u>	<u>赵阳光</u>	<u>赵阳光</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划(以下简称“本基金”)由中金安心回报集合资产管理计划转型而来。中金安心回报集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划,于 2010 年 1 月 14 日经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]53 号文核准设立,自 2010 年 3 月 8 日至 2010 年 3 月 24 日进行推广。于 2010 年 3 月 29 日成立。由中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)和华夏银行股份有限公司(以下简称“华夏银行”)作为推广机构,自 2010 年 3 月 8 日至 2010 年 3 月 24 日进行推广。中金安心回报集合资产管理计划于 2010 年 3 月 29 日成立,成立之日基金实收份额为 340,861,292.56 份(含利息转份额 97,847.56 份),发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所审验并出具验资报告。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》(证监会公告(2018)39 号)的规定,中金安心回报集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。经中国证监会批准,自 2020 年 4 月 30 日起,《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效,原《中金安心回报集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本基金自基金合同变更生效日起存续期至 2024 年 12 月 31 日。本基金自 2024 年 12 月 31 日后，按照中国证监会有关规定执行。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、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)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等)、股指期货、国债期货、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产比例为 0%-85%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%)；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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。同业存单占基金资产比例不超过 20%。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中债新综合全价指数收益率 \times 65%+ 中证 800 指数收益率 \times 25%+ 恒生指数收益率 \times 5%+ 金融机构人民币活期存款基准利率(税后) \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分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。

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，且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，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和各类应收款项。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件

的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应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，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回及红利再投资等事项导致本基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于本基金申购确认日或本基金赎回确认日确认，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

利息收入按相关金融资产的摊余成本与实际利率逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的金额确认，逐日确认债券利息并计入投资收益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认投资收益。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入并记入投资收益。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券投资收益。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 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等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率在回购期内逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一份基金份额享有同等分配权。本基金以现金形式分配，但基金持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的

未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

7.4.4.12 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。外币货币性项目，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汇兑损益科目。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，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

根据本基金内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 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《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》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 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，根据《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》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 根据中基协字[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》，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监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数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

本基金目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

(1) 根据财政部和国家税务总局 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，2018 年 1 月 1 日起，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税；对资管产品在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照资管产品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。

(2) 对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，暂不缴纳企业所得税。

(3) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；根据财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(4) 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、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税。

(5) 基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

活期存款	2,362,310.62	36,544,523.21
等于：本金	2,361,937.27	36,540,078.87
加：应计利息	373.35	4,444.34
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	2,362,310.62	36,544,523.21

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		36,899,126.22	-	35,590,952.38	-1,308,173.84
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	62,984,120.00	819,146.58	63,946,446.58	143,180.00
	银行间市场	99,782,520.00	885,042.76	101,127,042.76	459,480.00
	合计	162,766,640.00	1,704,189.34	165,073,489.34	602,660.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		199,665,766.22	1,704,189.34	200,664,441.72	-705,513.84
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		243,873,126.79	-	243,619,577.53	-253,549.26
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	23,058,906.66	58,320.64	21,381,689.74	-1,735,537.56
	银行间市	-	-	-	-

	场				
	合计	23,058,906.66	58,320.64	21,381,689.74	-1,735,537.56
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		266,932,033.45	58,320.64	265,001,267.27	-1,989,086.82

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				备注
	合同/名义 金额	公允价值			
		资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	
项目	上年度末 2022年12月31日				备注
	合同/名义 金额	公允价值			
		资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	
权益衍生工具	8,695,242.27	-	-	-	
其中： 股指期货投资	8,695,242.27	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	
合计	8,695,242.27	-	-	-	

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-769.82	-
银行间市场	-	-
合计	-769.82	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.60	0.32
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	71,453.74	1,276,748.37
其中：交易所市场	63,564.54	1,276,748.37
银行间市场	7,889.20	-
应付利息	-	-
预提费用	159,300.00	169,300.00
代扣代缴个人所得税	747,021.10	747,021.10
合计	977,775.44	2,193,069.79

注：代扣代缴个人所得税为原中金安心回报集合资产管理计划在以前年度派发股息红利及债券利息时代扣代缴的个人所得税。

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金安心回报 A 类份额

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	173,950,423.80	173,950,423.80
本期申购	839,308.28	839,308.28
本期赎回（以“-”号填列）	-58,116,570.56	-58,116,570.56
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	116,673,161.52	116,673,161.52

中金安心回报 C 类份额

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	112,793,847.62	112,793,847.62
本期申购	796,115.20	796,115.20

本期赎回(以“-”号填列)	-24,247,096.79	-24,247,096.79
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	89,342,866.03	89,342,866.03

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中金安心回报 A 类份额

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,326,260.36	-23,390,935.79	12,935,324.57
本期期初	36,326,260.36	-23,390,935.79	12,935,324.57
本期利润	-7,819,796.92	1,032,185.27	-6,787,611.65
本期基金份额交易产生的变动数	-11,227,451.84	7,323,362.13	-3,904,089.71
其中：基金申购款	168,317.45	-91,876.66	76,440.79
基金赎回款	-11,395,769.29	7,415,238.79	-3,980,530.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,279,011.60	-15,035,388.39	2,243,623.21

中金安心回报 C 类份额

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,203,177.84	-6,086,051.44	7,117,126.40
本期期初	13,203,177.84	-6,086,051.44	7,117,126.40
本期利润	-6,117,889.19	361,349.98	-5,756,539.21
本期基金份额交易产生的变动数	-2,356,495.65	1,399,164.24	-957,331.41
其中：基金申购款	89,796.02	-27,993.15	61,802.87
基金赎回款	-2,446,291.67	1,427,157.39	-1,019,134.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,728,793.00	-4,325,537.22	403,255.78

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	88,214.32	262,806.64
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	92,452.89	312,305.03

其他	4,030.17	8,825.94
合计	184,697.38	583,937.61

注：此处其他列示的是存出保证金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-13,935,266.78	-102,295,624.94
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	-13,935,266.78	-102,295,624.94

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	1,056,528,889.51	3,907,580,294.59
减：卖出股票成本 总额	1,067,345,597.82	3,999,449,717.47
减：交易费用	3,118,558.47	10,426,202.06
买卖股票差价收 入	-13,935,266.78	-102,295,624.94

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月 31日	2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利息收入	3,646,217.07	1,383,162.77
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,877,209.12	3,601,652.54
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	1,769,007.95	4,984,815.31

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	297,796,841.31	412,545,157.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	295,218,664.60	404,207,163.53
减：应计利息总额	4,425,456.74	4,711,010.53
减：交易费用	29,929.09	25,331.20
买卖债券差价收入	-1,877,209.12	3,601,652.54

注：卖出债券成交总额中扣除了债券投资收益中增值税的影响。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
国债期货投资收益	-105,886.51	-9,388.84
股指期货投资收益	122,328.39	-325,975.38

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股票投资产生的股利 收益	1,825,103.18	5,469,529.55
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	1,825,103.18	5,469,529.55

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	1,283,572.98	-6,893,816.35
股票投资	-1,054,624.58	-476,954.79
债券投资	2,338,197.56	-6,416,861.56
资产支持证券投资	0.00	-
基金投资	0.00	-
贵金属投资	0.00	-
其他	-	-
2. 衍生工具	109,962.27	-109,962.27
权证投资	0.00	-
期货投资	109,962.27	-109,962.27
3. 其他	0.00	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	0.00	-
合计	1,393,535.25	-7,003,778.62

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	1,619.94	22,958.58
基金转换费收入	194.64	2,296.17
合计	1,814.58	25,254.75

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	30,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	260.00	800.00
银行间账户维护费	37,050.00	36,900.00
合计	187,310.00	197,700.00

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国国际金融股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
华夏银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中央汇金投资有限责任公司	基金管理人的控股股东
中国中金财富证券有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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 (%)
中金公司	1,915,779,549.35	100.00	7,910,894,461.84	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
中金公司	123,396,447.94	100.00	147,484,813.29	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例(%)
中金公司	944,420,000.00	100.00	40,000,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	1,560,017.41	100.00	63,564.54	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	4,262,037.76	100.00	1,276,748.37	100.00

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,531,327.62	4,005,946.96
其中：应支付销售机构的客户维 护费	1,229,588.53	1,891,863.64
应支付基金管理人的净管理费	1,301,739.09	2,114,083.32

注：支付基金管理人中金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的1.00%的年费率计提，逐日计提并按月支付。其计算公式为：日管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	379,699.14	600,892.09

注：支付托管人华夏银行的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，逐日计提并按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额	合计
	额	额	
中国中金财富证券有限公司	0.00	149,797.74	149,797.74
合计	0.00	149,797.74	149,797.74
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额	合计
	额	额	
中国中金财富证券有限公司	0.00	238,518.91	238,518.91
合计	0.00	238,518.91	238,518.91

注：支付销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.40% 的年费率计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 0.40% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费

率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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1月1日至2023年12月31日	本期 2023年1月1日至2023年12月31日
		中金安心回报A类份额
基金合同生效日（2020年4月30日）持有的基金份额	11,917,189.06	0.00
报告期初持有的基金份额	11,917,189.06	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	11,917,189.06	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
		中金安心回报A类份额
基金合同生效日（2020年4月30日）持有的基金份额	11,917,189.06	0.00
报告期初持有的基金份额	11,917,189.06	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	11,917,189.06	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.8509%	0.0000%

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 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1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行	2,362,310.62	88,214.32	36,544,523.21	262,806.64

注：本基金的银行存款由本基金托管人华夏银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复 牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
688337	普源精电	2023年12月25日	重大事项停牌	43.87	2024年1月9日	41.72	19,609	899,765.35	860,246.83	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的货币资金存放在本基金托管人华夏银行,因而与货币资金相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	13,184,564.38	-
合计	13,184,564.38	-

注:未评级债券包括期限一年以内的国债。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	61,021,160.89	3,107,972.32
AAA 以下	-	18,273,717.42
未评级	90,867,764.07	-
合计	151,888,924.96	21,381,689.74

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包括期限一年以上的国债和政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的资产管理人通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	2,361,937.27	-	-	373.35	2,362,310.62
结算备付金	1,423,589.97	-	-	693.42	1,424,283.39
存出保证金	77,952.71	-	-	38.61	77,991.32
交易性金融资产	33,100,300.00	100,305,000.00	29,964,000.00	37,295,141.72	200,664,441.72
买入返售金融资产	-	-	-	-769.82	-769.82
应收清算款	-	-	-	5,569,311.73	5,569,311.73
资产总计	36,963,779.95	100,305,000.00	29,964,000.00	42,864,789.01	210,097,568.96

负债					
应付赎回款	-	-	-	218,113.92	218,113.92
应付管理人报酬	-	-	-	177,395.92	177,395.92
应付托管费	-	-	-	26,609.36	26,609.36
应付清算款	-	-	-	1.44	1.44
应付销售服务费	-	-	-	30,473.13	30,473.13
应交税费	-	-	-	4,293.21	4,293.21
其他负债	-	-	-	977,775.44	977,775.44
负债总计	-	-	-	1,434,662.42	1,434,662.42
利率敏感度缺口	36,963,779.95	100,305,000.00	29,964,000.00	41,430,126.59	208,662,906.54
上年度末 2022 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	36,540,078.87	-	-	4,444.34	36,544,523.21
结算备付金	17,492,586.49	-	-	7,578.50	17,500,164.99
存出保证金	1,573,563.97	-	-	268.95	1,573,832.92
交易性金融资产	21,323,369.10	-	-	-243,677,898.17	265,001,267.27
应收股利	-	-	-	5,885.64	5,885.64
应收申购款	-	-	-	1,608.48	1,608.48
资产总计	76,929,598.43	-	-	-243,697,684.08	320,627,282.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,352,526.78	1,352,526.78
应付管理人报酬	-	-	-	265,140.26	265,140.26
应付托管费	-	-	-	39,771.06	39,771.06
应付清算款	-	-	-	9,938,524.37	9,938,524.37
应付销售服务费	-	-	-	41,387.47	41,387.47
应交税费	-	-	-	140.39	140.39
其他负债	-	-	-	2,193,069.79	2,193,069.79
负债总计	-	-	-	13,830,560.12	13,830,560.12
利率敏感度缺口	76,929,598.43	-	-	-229,867,123.96	306,796,722.39

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。	
	2. 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。	
	3. 此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末 (2023 年 12 月 31 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
		市场利率下降 25 个基点	1,268,650.00
市场利率上升 25 个基点	-1,268,650.00	-	

7.4.13.4.2 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。

本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人定期对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	6,507,597.55	-	6,507,597.55
资产合计	-	6,507,597.55	-	6,507,597.55
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	6,507,597.55	-	6,507,597.55
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	55,801,784.57	-	55,801,784.57

应收股利	-	5,885.64	-	5,885.64
资产合计	-	55,807,670.21	-	55,807,670.21
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	55,807,670.21	-	55,807,670.21

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	港币相对人民币升值5%	325,379.88	2,790,383.51
	港币相对人民币贬值5%	-325,379.88	-2,790,383.51

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022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	35,590,952.38	17.06	243,619,577.53	79.41
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	165,073,489.34	79.11	21,381,689.74	6.97

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	200,664,441.72	96.17	265,001,267.27	86.38

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若对市场价格敏感的交易性金融资产的市场价格上升或下降 5%		
	2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	交易性金融资产的市场价格上升 5%	10,033,222.09	13,250,063.36
	交易性金融资产的市场价格下降 5%	-10,033,222.09	-13,250,063.36

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- (1) 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- (2) 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；
- (3) 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	34,730,705.55	265,001,267.27
第二层次	165,933,736.17	-

第三层次	-	-
合计	200,664,441.72	265,001,267.27

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	35,590,952.38	16.94
	其中：股票	35,590,952.38	16.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	165,073,489.34	78.57
	其中：债券	165,073,489.34	78.57
	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	-769.82	-0.00
	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	3,786,594.01	1.80
8	其他各项资产	5,647,303.05	2.69
9	合计	210,097,568.96	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 6,507,597.55 元，占期末净值比例为 3.12%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	2,862,900.00	1.37
B	采矿业	801,450.00	0.38
C	制造业	16,882,688.83	8.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,130,800.00	0.54
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,374,300.00	0.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,605,810.00	1.25
J	金融业	1,087,550.00	0.52
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,683,016.00	0.81
M	科学研究和技术服务业	654,840.00	0.31
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	29,083,354.83	13.94

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	910,737.51	0.44
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-

能源	1,001,373.10	0.48
金融	-	-
医疗保健	456,734.88	0.22
工业	-	-
信息技术	2,024,722.04	0.97
电信服务	2,114,030.02	1.01
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	6,507,597.55	3.12

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

8.3 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	00941	中国移动	36,000	2,114,030.02	1.01
2	600079	人福医药	83,200	2,068,352.00	0.99
3	00981	中芯国际	112,500	2,024,722.04	0.97
4	300498	温氏股份	90,000	1,805,400.00	0.87
5	002027	分众传媒	266,300	1,683,016.00	0.81
6	688539	高华科技	30,300	1,327,140.00	0.64
7	600486	扬农化工	20,900	1,319,208.00	0.63
8	600761	安徽合力	70,000	1,274,700.00	0.61
9	002371	北方华创	5,000	1,228,550.00	0.59
10	600027	华电国际	220,000	1,130,800.00	0.54
11	000998	隆平高科	75,000	1,057,500.00	0.51
12	00883	中国海洋石油	85,000	1,001,373.10	0.48
13	002415	海康威视	27,000	937,440.00	0.45
14	600522	中天科技	73,000	911,770.00	0.44
15	01818	招金矿业	103,500	910,737.51	0.44
16	002332	仙琚制药	71,000	906,670.00	0.43
17	688579	山大地纬	70,000	889,000.00	0.43
18	000951	中国重汽	66,300	885,768.00	0.42
19	688111	金山办公	2,800	885,360.00	0.42
20	603855	华荣股份	44,000	878,240.00	0.42
21	603871	嘉友国际	55,000	872,300.00	0.42
22	600161	天坛生物	28,100	869,414.00	0.42
23	688337	普源精电	19,609	860,246.83	0.41
24	601001	晋控煤业	65,000	801,450.00	0.38
25	603259	药明康德	9,000	654,840.00	0.31
26	601555	东吴证券	80,000	584,800.00	0.28
27	002837	英维克	20,000	549,600.00	0.26
28	002984	森麒麟	18,000	519,300.00	0.25

29	002465	海格通信	40,000	514,000.00	0.25
30	000933	神火股份	30,000	504,000.00	0.24
31	002142	宁波银行	25,000	502,750.00	0.24
32	601021	春秋航空	10,000	502,000.00	0.24
33	002777	久远银海	19,000	477,090.00	0.23
34	002050	三花智控	16,000	470,400.00	0.23
35	02273	固生堂	10,000	456,734.88	0.22
36	002011	盾安环境	32,000	440,000.00	0.21
37	688376	美埃科技	11,000	417,890.00	0.20
38	002368	太极股份	12,000	354,360.00	0.17

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000933	神火股份	16,364,088.00	5.33
2	601899	紫金矿业	13,401,239.00	4.37
2	02899	紫金矿业	779,020.84	0.25
3	01347	华虹半导体	12,935,899.47	4.22
4	600519	贵州茅台	12,650,512.00	4.12
5	002027	分众传媒	12,392,481.00	4.04
6	000568	泸州老窖	11,729,053.00	3.82
7	00700	腾讯控股	11,629,874.03	3.79
8	00883	中国海洋石油	11,480,608.04	3.74
9	00857	中国石油股份	10,399,580.41	3.39
10	002493	荣盛石化	9,916,252.00	3.23
11	000516	国际医学	9,499,809.00	3.10
12	002078	太阳纸业	9,428,230.00	3.07
13	002372	伟星新材	9,324,414.00	3.04
14	300144	宋城演艺	9,068,678.00	2.96
15	300750	宁德时代	8,948,161.80	2.92
16	01099	国药控股	8,709,729.43	2.84
17	00291	华润啤酒	8,690,880.42	2.83
18	00168	青岛啤酒股份	4,736,134.16	1.54
18	600600	青岛啤酒	3,952,648.50	1.29
19	600754	锦江酒店	8,688,182.70	2.83
20	600426	华鲁恒升	8,308,635.36	2.71
21	002648	卫星化学	8,244,820.40	2.69
22	300408	三环集团	8,139,219.00	2.65
23	000786	北新建材	7,937,220.00	2.59

24	00728	中国电信	7,758,000.68	2.53
25	01088	中国神华	7,543,072.27	2.46
26	600309	万华化学	7,541,443.00	2.46
27	688665	四方光电	7,365,197.11	2.40
28	600919	江苏银行	7,305,132.00	2.38
29	300285	国瓷材料	7,266,207.00	2.37
30	002352	顺丰控股	7,191,950.80	2.34
31	002415	海康威视	7,066,141.00	2.30
32	002837	英维克	6,883,679.68	2.24
33	300633	开立医疗	6,832,494.39	2.23
34	688212	澳华内镜	6,757,130.18	2.20
35	000683	远兴能源	6,738,588.00	2.20
36	605123	派克新材	6,663,249.55	2.17
37	002142	宁波银行	6,661,090.00	2.17
38	01789	爱康医疗	6,604,092.13	2.15
39	688337	普源精电	6,472,922.27	2.11
40	603338	浙江鼎力	6,300,120.00	2.05
41	600079	人福医药	6,278,600.00	2.05
42	300327	中颖电子	6,272,726.68	2.04
43	06078	海吉亚医疗	6,246,571.08	2.04
44	01787	山东黄金	6,231,773.96	2.03
45	603008	喜临门	6,201,501.00	2.02
46	300593	新雷能	6,198,174.00	2.02

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	600519	贵州茅台	23,409,787.00	7.63
2	00883	中国海洋石油	20,369,205.25	6.64
3	601899	紫金矿业	19,481,921.00	6.35
3	02899	紫金矿业	774,037.30	0.25
4	000933	神火股份	17,745,401.00	5.78
5	00857	中国石油股份	16,932,179.77	5.52
6	00700	腾讯控股	16,042,559.41	5.23
7	002352	顺丰控股	14,919,838.00	4.86
8	000568	泸州老窖	14,736,348.00	4.80
9	01088	中国神华	13,582,948.35	4.43
9	601088	中国神华	1,099,666.00	0.36
10	002078	太阳纸业	13,962,240.00	4.55
11	002027	分众传媒	13,524,154.00	4.41

12	01347	华虹半导体	13,150,534.25	4.29
13	002372	伟星新材	12,452,337.20	4.06
14	300408	三环集团	12,316,919.00	4.01
15	600426	华鲁恒升	12,177,205.40	3.97
16	00291	华润啤酒	12,002,317.78	3.91
17	600309	万华化学	11,757,106.90	3.83
18	002493	荣盛石化	11,615,489.00	3.79
19	000683	远兴能源	11,455,504.00	3.73
20	00168	青岛啤酒股份	7,055,287.16	2.30
20	600600	青岛啤酒	3,949,603.00	1.29
21	300124	汇川技术	10,283,002.00	3.35
22	300327	中颖电子	10,236,018.70	3.34
23	01099	国药控股	10,075,864.87	3.28
24	002142	宁波银行	9,999,280.90	3.26
25	002837	英维克	9,368,357.10	3.05
26	600919	江苏银行	9,343,396.00	3.05
27	002271	东方雨虹	9,204,220.41	3.00
28	600754	锦江酒店	9,041,880.88	2.95
29	01789	爱康医疗	8,986,100.92	2.93
30	603008	喜临门	8,868,220.00	2.89
31	300274	阳光电源	8,807,572.60	2.87
32	000786	北新建材	8,776,515.00	2.86
33	000516	国际医学	8,737,854.00	2.85
34	300750	宁德时代	8,731,773.00	2.85
35	603338	浙江鼎力	8,395,913.00	2.74
36	300144	宋城演艺	8,300,365.63	2.71
37	002415	海康威视	8,160,812.00	2.66
38	002648	卫星化学	8,111,228.40	2.64
39	06078	海吉亚医疗	7,989,178.77	2.60
40	01787	山东黄金	7,085,181.35	2.31
40	600547	山东黄金	778,464.00	0.25
41	002138	顺络电子	7,803,043.00	2.54
42	00728	中国电信	7,560,276.91	2.46
43	688390	固德威	7,374,607.19	2.40
44	600176	中国巨石	7,180,921.44	2.34
45	688665	四方光电	7,143,136.47	2.33
46	01109	华润置地(五百)	7,011,289.22	2.29
47	688212	澳华内镜	6,999,985.68	2.28
48	300285	国瓷材料	6,902,191.00	2.25
49	03320	华润医药	6,728,122.03	2.19
50	601225	陕西煤业	6,720,155.00	2.19
51	300633	开立医疗	6,714,093.00	2.19

52	000983	山西焦煤	6,466,036.00	2.11
53	300896	爱美客	6,403,099.00	2.09
54	300015	爱尔眼科	6,400,145.31	2.09
55	600079	人福医药	6,334,946.84	2.06
56	002430	杭氧股份	6,295,717.00	2.05
57	603806	福斯特	6,267,505.80	2.04
58	605123	派克新材	6,242,804.98	2.03

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	860,107,472.73
卖出股票收入（成交）总额	1,056,528,889.51

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用

8.5 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	83,704,000.58	40.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,020,247.66	29.24
	其中：政策性金融债	20,348,327.87	9.75
4	企业债券	20,349,241.10	9.75
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	165,073,489.34	79.11

8.6 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	230025	23 付息国债 25	300,000	30,182,073.77	14.46
2	230208	23 国开 08	200,000	20,348,327.87	9.75
3	230022	23 付息国债 22	200,000	20,252,688.52	9.71
4	230018	23 付息国债 18	200,000	20,084,673.91	9.63
5	019703	23 国债 10	130,000	13,184,564.38	6.32

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本集合计划将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本集合计划参与国债期货投资用于管理债券组合的久期、流动性和风险水平，以套期保值为主要目的。本集合计划构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

8.11.2 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投资。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 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中，中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及合同的要求。

8.12.2 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。

8.12.3 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	77,991.32
2	应收清算款	5,569,311.73
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	5,647,303.05

8.12.4 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。

8.12.5 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情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
中金安心回报 A 类份额	3,848	30,320.47	1,994,672.57	1.71	114,678,488.95	98.29
中金安心回报 C 类份额	2,599	34,375.86	4,358,713.81	4.88	84,984,152.22	95.12
合计	6,368	32,351.76	6,353,386.38	3.08	199,662,641.17	96.92

9.2 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	中金安心回报 A 类份额	435,411.73	0.3732
	中金安心回报 C 类份额	72.59	0.0001

	合计	435,484.32	0.2114
--	----	------------	--------

9.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	中金安心回报 A 类份额	10~50
	中金安心回报 C 类份额	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中金安心回报 A 类份额	0
	中金安心回报 C 类份额	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金安心回报 A 类份额	中金安心回报 C 类份额
基金合同生效日（2020 年 4 月 30 日）基金份额总额	177,701,315.63	-
本报告期期初基金份额总额	173,950,423.80	112,793,847.62
本报告期基金总申购份额	839,308.28	796,115.20
减：本报告期基金总赎回份额	58,116,570.56	24,247,096.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	116,673,161.52	89,342,866.03

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人发生以下重大人事变动：

2023 年 4 月 12 日，孙男先生兼任资产管理部负责人，徐翌成先生不再担任资产管理部负责人。

2023 年 9 月 20 日，由公司管理委员会成员胡长生先生负责资产管理业务，分管资产管理

部，由董事会秘书孙男先生协助负责资产管理业务，协助分管资产管理部。

2023 年 10 月 22 日，沈如军先生不再担任公司董事长、非执行董事、董事会战略与 ESG 委员会主席及提名与公司治理委员会成员职务，黄朝晖先生不再担任公司执行董事、董事会战略与 ESG 委员会成员、风险控制委员会成员、总裁（首席执行官）及管理委员会主席职务。陈亮先生担任公司管理委员会主席，吴波先生代为履行公司总裁（首席执行官）职责。

2023 年 11 月 10 日，陈亮先生担任公司董事长、法定代表人、董事会战略与 ESG 委员会主席及提名与公司治理委员会成员，吴波先生担任公司总裁。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 2 月 23 日发布公告，胡捷先生自 2023 年 2 月 23 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 4 月 7 日发布公告，朱绍纲先生自 2023 年 4 月 4 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 7 月 3 日发布公告，郑鹏先生自 2023 年 5 月 16 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部风险总监。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 7 月 27 日发布公告，国然女士自 2023 年 7 月 18 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

11.3 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管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 30,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人资产管理业务及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中金公司	2	1,915,779,549.35	100.00	1,560,017.41	100.00	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中金公司	123,396,447.94	100.00	944,420,000.00	100.00	-	-

11.8 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	中国国际金融股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年04月14日
2	中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划暂停申购、转换转入、定期定额投资的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年04月20日
3	中国国际金融股份有限公司关于中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年04月27日
4	中金公司持股5%以上股东减持股份计划公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年5月8日
5	中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划恢复申购、转换转入、定期定额投资的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年05月16日
6	中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年06月01日
7	中国国际金融股份有限公司关于新增腾安基金销售(深圳)有限公司为旗下部分大集合产品代销机构的公告	中国证监会规定网站	2023年9月6日
8	中国国际金融股份有限公司高级管	中国证监会规定报刊及	2023年09月22日

	理人员变更公告	网站	
9	中国国际金融股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 24 日
10	中国国际金融股份有限公司董事长及高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 11 月 11 日
11	中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划暂停申购、转换转入、定期定额投资的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 21 日
12	中国国际金融股份有限公司关于中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 22 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 关于准予中金安心回报集合资产管理计划合同变更的回函
- (二) 中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书
- (四) 中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议
- (五) 法律意见书
- (六) 管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 报告期内披露的各项公告

13.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸 3 期 B 座 42 层。

13.3 查阅方式

投资者可到管理人办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

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

公司网址：www.cicc.com

中国国际金融股份有限公司

2024 年 3 月 30 日