

中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告出具日期：2024 年 12 月 26 日

1 重要提示

中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“中金兴元 6 个月持有混合”）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〔2023〕908 号文注册，2023 年 7 月 18 日基金合同生效。本基金的基金管理人为中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”），本基金托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。”

截至 2024 年 12 月 17 日日终，中金兴元 6 个月持有混合达到连续 50 个工作日规模低于 5000 万元，触发上述基金合同终止情形，本基金将根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会。

本基金自 2024 年 12 月 18 日起进入清算期，由基金管理人中金基金、基金托管人兴业银行、信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金
基金简称	中金兴元 6 个月持有混合
基金主代码	018628
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 7 月 18 日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
最后运作日（2024 年 12 月 17 日）基金份额总额	38,885,742.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在分析宏观经济周期的基础上，结合政策面、资金面等多种因素，研判所处经济周期的位置及未来发展方向，在控制风险的前提下，确定组合中股票、债券、基金、货币市场工具及其他金融工具的比例，结合市场观点动态调整各大类资产的投资比例，把握市场时机，获取超额收益。具体包括：1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、股票投资策略；4、基金投资策略；5、衍生品投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、融资业务投资策略；8、存托凭证投资策略。详见《中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中债-综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*5%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。 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。

3 基金最后运作日财务会计报告（经审计）

资产负债表

会计主体：中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 17 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2024 年 12 月 17 日 (基金最后运作日)
资产:	
货币资金	6,024,871.34
结算备付金	758,424.49
存出保证金	25,494.26
交易性金融资产	38,848,586.43
其中: 股票投资	4,134,339.64
基金投资	-
债券投资	34,714,246.79
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收清算款	3,457,940.84
应收股利	-
应收申购款	121.88
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	49,115,439.24
负债和所有者权益	本期末 2024 年 12 月 17 日 (基金最后运作日)
负债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	7,200,414.25
应付清算款	-
应付赎回款	2,457,071.17
应付管理人报酬	12,287.46
应付托管费	4,095.82
应付销售服务费	3,357.83
应交税费	538.63
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	171,439.88
负债合计	9,849,205.04
所有者权益:	
实收基金	38,885,742.99
未分配利润	380,491.21
净资产合计	39,266,234.20
负债和净资产总计	49,115,439.24

注：报告截止日 2024 年 12 月 17 日，中金兴元 6 个月持有混合 A 基金份额净值 1.0120 元，基金份额总额 18,644,281.74 份；中金兴元 6 个月持有混合 C 基金份额净值 1.0077 元，基金份额总额 20,241,461.25 份。中金兴元 6 个月持有混合份额总额合计为 38,885,742.99 份。

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2023 年 4 月 23 日证监许可 [2023] 908 号《关于准予中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》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、《中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》和《中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式混合型证券投资基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销系统、兴业银行、中国中金财富证券有限公司（以下简称“中金财富证券”）、中国银河证券股份有限公司及中信建投证券股份有限公司等共同销售，募集期为 2023 年 6 月 5 日起至 2023 年 7 月 14 日止。经向中国证监会备案，《中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2023 年 7 月 18 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 224,941,447.87 份（含利息转份额 96,946.06 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《中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金份额时，收取认购/申购费用，赎回时收取赎回费而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购申购基金份额时，不收取认购/申购费用，赎回时收取赎回费且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。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《中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工

具，包括国内经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（不含香港互认基金、QDII 基金、基金中基金、可投资基金的非基金中基金和货币市场基金）、国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板及其他依法发行上市的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、含超短期融资券、公开发行的次级债、地方政府债、证券公司短期公司债券、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务。

4.2 清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。”

截至 2024 年 12 月 17 日日终，中金兴元 6 个月持有混合达到连续 50 个工作日规模低于 5000 万元，触发上述基金合同终止情形，本基金将根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会。

4.3 清算起始日

本基金于 2024 年 12 月 18 日起进入清算期，清算期为 2024 年 12 月 18 日至 2024 年 12 月 23 日。本基金将清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

4.4 清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》、《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

5 清算情况

自 2024 年 12 月 18 日至 2024 年 12 月 23 日止为本基金清算报告期，基金财产清算小组对本

基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 清算费用

按照《基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

5.2 资产处置情况

(1) 货币资金、保证金及应收款项资产处置情况

序号	项目	运作终止日账面价值	清算金额	清算期期末账面价值
1	货币资金（注 1）	6,024,871.34	10,226,214.03	16,251,085.37
2	结算备付金（注 1）	758,424.49	-388,706.72	369,717.77
3	存出保证金（注 1）	25,494.26	-89.54	25,404.72

注 1：以上结算备付金、存出保证金及货币资金账面价值均包含应收利息金额，其中结算备付金、存出保证金及货币资金中所包含应收利息部分由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(2) 金融资产处置情况

序号	项目	运作终止日账面价值	清算期内最后处置日	清算金额	清算期期末账面价值
1	股票投资	4,134,339.64	2024/12/18	-4,134,339.64	0.00
2	债券投资	34,714,246.79	2024/12/23	-34,714,246.79	0.00

(3) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 3,457,940.84 元，已于清算期间划至托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 121.88 元，已于清算期间划至托管账户。

5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 2,457,071.17 元，已于 2024 年 12 月 18 日支付。

(2) 本基金自 2024 年 12 月 18 日进入清算期，按照《基金合同》第六部分“基金份额的申购与赎回”的规定，2024 年 12 月 18 日确认的赎回申请为人民币 22,672,801.62 元，该款项已于 2024 年 12 月 19 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付管理费为人民币 12,287.46 元，该款项已于 2024 年 12 月 19 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 4,095.82 元，该款项已于 2024 年 12 月 19 日支

付。

(5) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 3,357.83 元, 该款项已于 2024 年 12 月 19 日支付。

(6) 本基金最后运作日应交税费为人民币 538.63 元及清算期间产生的应交税费 34.84 元, 该款项已于 2024 年 12 月 24 日支付。

(7) 卖出回购金融资产款 7,200,414.25 元已于 2024 年 12 月 18 日到期清算。

(8) 本基金最后运作日其他负债人民币 171,439.88 元, 其中应付佣金 46,124.24 元及清算期间产生应付佣金 1,855.72 元, 已于 2024 年 12 月 20 日支付; 预提清盘律师费 20,000.00 元, 已于 2024 年 12 月 19 日支付; 预提清盘审计费 5,000.00 元, 已于 2024 年 12 月 24 日支付; 外汇交易中心交易费用 705.64 元及清算期间产生的外汇交易中心交易费用 77.50 元, 已于 2024 年 12 月 25 日支付; 预提信披费 80,000.00 元、预提账户维护费 9,300.00 元、其他交易费用 10,310.00 元及清算期间产生其他交易费用 900.00 元, 相关费用将由基金管理人在清算款划出前扣除。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	本期 2024年12月18日(基金清算起始日)至2024 年12月23日(基金清算结束日)止期间
一、资产处置损益	-54,087.13
1. 利息收入	1,091.76
2. 投资收益(损失以“-”填列)	158,033.46
其中: 股票投资收益	-69,558.82
债券投资收益	231,802.48
债券利息收入	1,155.21
股利收益	-
交易费用	-5,365.41
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-213,212.35
4. 其他收入(损失以“-”号填列)	-
二、清算费用	-860.34
1. 其他费用	-856.61
2. 税金及附加	-3.73
三、清算净损益(净亏损以“-”号填列)	-54,947.47

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位: 人民币元

项目	金额
一、最后运作日2024年12月17日基金净资产	39,266,234.20

加：清算期间净收益	-54,947.47
减：基金净赎回金额	22,672,801.62
二、2024年12月23日基金净资产	16,538,485.11

资产处置及负债清偿后，于 2024 年 12 月 23 日本基金剩余财产为人民币 16,538,485.11 元。根据《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自本次清算期结束日次日 2024 年 12 月 24 日至清算款项支付日前一日的存款利息归基金份额持有人所有。于清算划款日的应收利息余额由基金管理人以自有资金先行垫付，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。垫付资金及其孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

5.6 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- (1) 中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金审计报告
- (2) 《中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二四年十二月二十六日