

中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	11
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等内容的真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
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	42
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	42
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	42

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	43
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	44
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	45
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	46
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.9 其他重大事件	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

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	
报告期末基金份 额总额	53,552,469.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中金兴元 6 个月持有混合 A	中金兴元 6 个月持有混合 C
下属分级基金的交 易代码	018628	018629
报告期末下属分级 基金的份额总额	12,222,588.87 份	41,329,880.71 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中金基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰
	联系电话	010-63211122
		龚小武
		021-52629999-212056

电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话	400-868-1166	95561
传真	010-66159121	021-62159217
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 B 座 43 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	100004	200120
法定代表人	李金泽	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	中金兴元 6 个月持有混合 A	中金兴元 6 个月持有混合 C
本期已实现收益	-204,993.04	-364,211.45
本期利润	315,076.99	1,353,034.13
加权平均基金份 额本期利润	0.0117	0.0153
本期加权平均净 值利润率	1.18%	1.54%
本期基金份额净 值增长率	1.93%	1.78%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-10,500.27	-154,583.36
期末可供分配基	-0.0009	-0.0037

金份额利润		
期末基金资产净值	12,336,726.06	41,594,999.30
期末基金份额净值	1.0093	1.0064
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	0.93%	0.64%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金兴元 6 个月持有混合 A

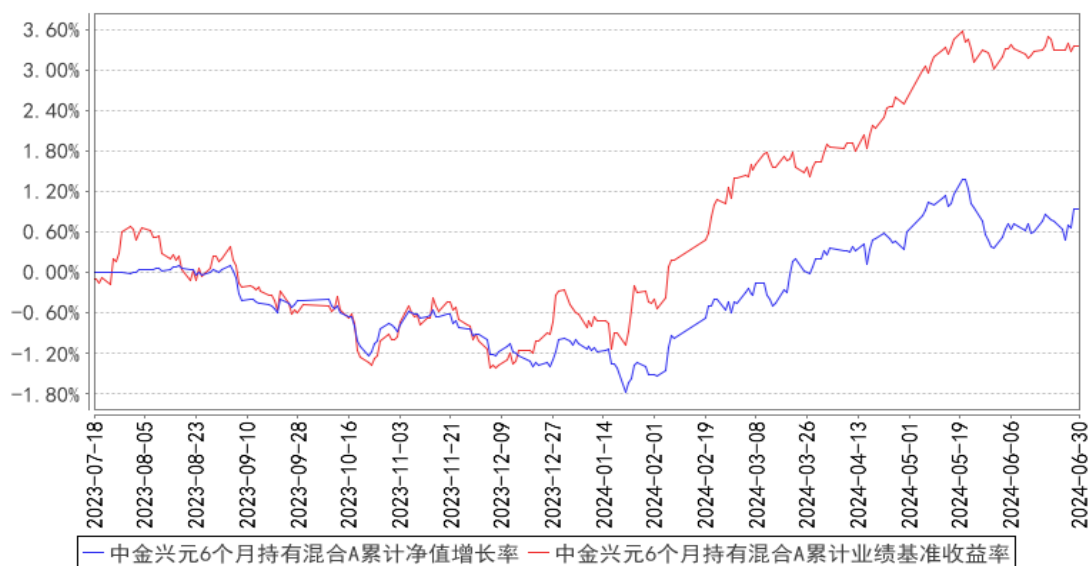
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.56%	0.12%	0.32%	0.08%	0.24%	0.04%
过去三个月	0.72%	0.12%	1.68%	0.11%	-0.96%	0.01%
过去六个月	1.93%	0.13%	3.62%	0.14%	-1.69%	-0.01%
自基金合同生效起至今	0.93%	0.10%	3.35%	0.14%	-2.42%	-0.04%

中金兴元 6 个月持有混合 C

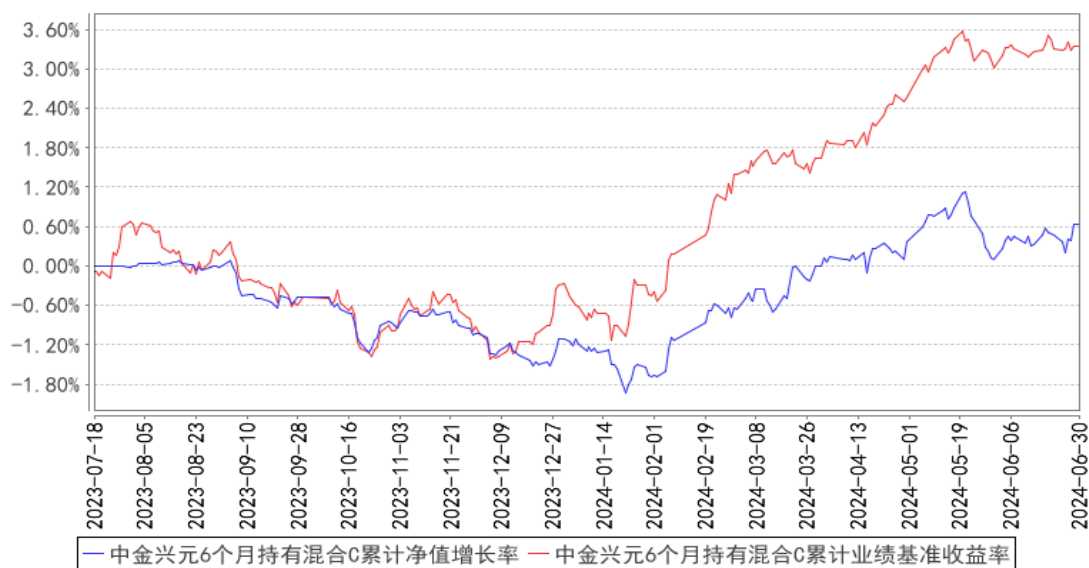
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.54%	0.12%	0.32%	0.08%	0.22%	0.04%
过去三个月	0.65%	0.12%	1.68%	0.11%	-1.03%	0.01%
过去六个月	1.78%	0.13%	3.62%	0.14%	-1.84%	-0.01%
自基金合同生效起至今	0.64%	0.10%	3.35%	0.14%	-2.71%	-0.04%

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

中金兴元6个月持有混合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



中金兴元6个月持有混合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 07 月 18 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。建仓期结束时本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股

的基金公司，注册资本 6 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 51 只公募基金，证券投资基金管理规模 1631.27 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
董珊珊	本基金基金经理	2023 年 7 月 18 日	-	18 年	董珊珊女士，工商管理硕士。历任中国人寿资产管理有限公司固定收益部研究员、投资经理助理、投资经理。现任中金基金管理有限公司固定收益部基金经理。
李亚寅	本基金基金经理	2023 年 7 月 18 日	-	11 年	李亚寅女士，经济学硕士。历任中信建投证券股份有限公司固定收益部投资风控经理，恒泰证券股份有限公司资产管理部固定收益投资经理、投资总监。现任中金基金管理有限公司固定收益部基金经理。
高大亮	本基金基金经理	2024 年 5 月 10 日	-	8 年	高大亮先生，金融硕士。历任华商基金管理有限公司研究部研究员，大家资产管理有限公司研究部研究员，中金基金管理有限公司权益部研究员、基金经理助理。现任中金基金管理有限公司权益部基金经理。

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

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的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

债券市场上半年整体市场呈现收益率下行趋势，组合积极顺势而为，通过高评级债券和利率债适度提高了整体组合久期。权益方面一季度适度提高了权益仓位，二季度进行了适度减仓。在本基金的管理中，我们坚持稳健低波的权益操作模式，因而在底仓构建中主要采取了类债策略和逆向布局的策略，对应了红利风格和低估值顺周期风格的持仓，同样为了分享高质量发展的红利而小仓位阶段性采取了高性价比策略，以布局有产业强逻辑的成长风格标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金兴元 6 个月持有混合 A 基金份额净值为 1.0093 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.93%，同期业绩基准收益率为 3.62%；中金兴元 6 个月持有混合 C 基金份额净值为 1.0064 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.78%，同期业绩基准收益率为 3.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观环境来看，上半年经济走势仍然处于提质增效的进程之中。尽管几个一线城市相继出台了放松地产的政策，但是居民杠杆率较高，地产产业链难有趋势性的修复，可能带动居民端内需面临一定压力。制造业仍然具有比较优势，在外需保持韧性的情况下，细分龙头仍然有望获得稳健的超额收益。因此下半年权益资产以阶段性、结构性机会为主；债券市场长端利率下行较多，但仍然保持中性乐观，未来重点关注财政发力情况的扰动；权益市场经历修复后持续调整，或需更多的稳增长举措来稳定预期。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	7,850,598.84	610,037.25
结算备付金		279,657.61	85,666.33
存出保证金		21,984.32	11,646.27
交易性金融资产	6.4.7.2	65,289,853.84	249,567,652.02
其中：股票投资		8,295,021.38	14,077,168.10
基金投资		53,699.80	7,667,564.60
债券投资		56,941,132.66	227,822,919.32
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	-	4,899,364.39
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		213,550.61	2,224,216.48
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		73,655,645.22	257,398,582.74
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		19,004,216.44	32,010,865.68
应付清算款		537,261.52	2,424,925.26
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		28,185.84	113,206.72
应付托管费		9,395.31	37,647.51
应付销售服务费		10,984.53	40,001.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,627.35	16,054.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	131,248.87	172,497.35
负债合计		19,723,919.86	34,815,198.65
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	53,552,469.58	225,010,235.91
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	379,255.78	-2,426,851.82
净资产合计		53,931,725.36	222,583,384.09
负债和净资产总计		73,655,645.22	257,398,582.74

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，中金兴元 6 个月持有混合 A 的基金份额净值为 1.0093 元，期末份额总额为 12,222,588.87 份；中金兴元 6 个月持有混合 C 的基金份额净值为 1.0064 元，期末份额总额为 41,329,880.71 份。基金份额总额 53,552,469.58 份。

6.2 利润表

会计主体：中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,657,613.66
1. 利息收入		43,694.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,668.70
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		33,025.48
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		376,603.87
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-20,328.19
基金投资收益	6.4.7.15	-406,130.89
债券投资收益	6.4.7.16	729,223.60
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	73,839.35
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	2,237,315.61
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	-
减：二、营业总支出		989,502.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	340,931.50
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	113,643.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	130,853.07
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		293,743.29
其中：卖出回购金融资产支出		293,743.29
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-
7. 税金及附加		4,636.96
8. 其他费用	6.4.7.25	105,693.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,668,111.12
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,668,111.12
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,668,111.12

6.3 净资产变动表

会计主体：中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	225,010,235.91	-	-2,426,851.82	222,583,384.09
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	225,010,235.91	-	-2,426,851.82	222,583,384.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-171,457,766.33	-	2,806,107.60	-168,651,658.73

(一)、综合收益总额	-	-	1,668,111.12	1,668,111.12
(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)	-171,457,766.33	-	1,137,996.48	-170,319,769.85
其中：1. 基金申购款	477,235.82	-	985.56	478,221.38
2. 基金赎回款	-171,935,002.15	-	1,137,010.92	-170,797,991.23
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	53,552,469.58	-	379,255.78	53,931,725.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

宗喆

二

白娜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金兴元 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《关于中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准，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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和

《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税 [2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税 [2014] 81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税 [2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关

于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2023〕39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(b) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	7,850,598.84
等于：本金	7,849,811.52
加：应计利息	787.32
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	7,850,598.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,803,006.60	-	8,295,021.38	492,014.78
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所市场	1,119,476.89	11,556.99	1,153,956.99	22,923.11

	银行间市场	55,043,653.84	638,675.67	55,787,175.67	104,846.16
	合计	56,163,130.73	650,232.66	56,941,132.66	127,769.27
资产支持证券		-	-	-	-
基金		54,146.40	-	53,699.80	-446.60
其他		-	-	-	-
合计		64,020,283.73	650,232.66	65,289,853.84	619,337.45

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	40,199.63
其中：交易所市场	22,255.64
银行间市场	17,943.99
应付利息	-
预提费用	91,049.24
合计	131,248.87

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金兴元 6 个月持有混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	65,939,891.34	65,939,891.34
本期申购	7,045.15	7,045.15
本期赎回（以“-”号填列）	-53,724,347.62	-53,724,347.62
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	12,222,588.87	12,222,588.87

中金兴元 6 个月持有混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	159,070,344.57	159,070,344.57
本期申购	470,190.67	470,190.67

本期赎回（以“-”号填列）	-118,210,654.53	-118,210,654.53
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	41,329,880.71	41,329,880.71

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

中金兴元 6 个月持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-174,140.70	-474,119.18	-648,259.88
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-174,140.70	-474,119.18	-648,259.88
本期利润	-204,993.04	520,070.03	315,076.99
本期基金份额交易产生的变动数	368,633.47	78,686.61	447,320.08
其中：基金申购款	-14.79	58.46	43.67
基金赎回款	368,648.26	78,628.15	447,276.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,500.27	124,637.46	114,137.19

中金兴元 6 个月持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-634,026.55	-1,144,565.39	-1,778,591.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-634,026.55	-1,144,565.39	-1,778,591.94
本期利润	-364,211.45	1,717,245.58	1,353,034.13
本期基金份额交易产生的变动数	843,654.64	-152,978.24	690,676.40
其中：基金申购款	-2,904.63	3,846.52	941.89
基金赎回款	846,559.27	-156,824.76	689,734.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-154,583.36	419,701.95	265,118.59

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,790.06
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	1,730.26
其他	148.38
合计	10,668.70

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-20,328.19
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	-20,328.19

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	63,770,980.55
减：卖出股票成本总额	63,709,479.12
减：交易费用	81,829.62
买卖股票差价收入	-20,328.19

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	7,862,298.50
减：卖出/赎回基金成本总额	8,268,100.68
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	-
减：交易费用	328.71
基金投资收益	-406,130.89

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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,824,914.52
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,095,690.92
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	729,223.60

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	289,189,235.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	287,072,546.31
减：应计利息总额	3,203,138.09
减：交易费用	9,241.83
买卖债券差价收入	-1,095,690.92

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	73,839.35
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	73,839.35

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,237,315.61
股票投资	389,223.28
债券投资	1,549,945.05
资产支持证券投资	-
基金投资	298,147.28
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,237,315.61

6.4.7.22 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	3,873.73
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	774.53

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
划款手续费	5,044.58
其他	600.04
合计	105,693.86

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
中金财富证券	121,309,089.67	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例(%)
中金财富证券	12,380,682.21	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例(%)
中金财富证券	173,186,000.00	100.00

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例(%)
中金财富证券	8,218,387.10	100.00

6.4.10.1.5 权证交易

本基金本报告期未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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金财富证券	42,120.51	100.00	22,255.64	100.00

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还获得证券研究综合服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	当期发生的基金应支付的管理费	340,931.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	164,385.25	
应支付基金管理人的净管理费	176,546.25	

注：1、本基金对持有的基金管理人自身管理的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本基金持有的基金管理人自身管理的其他基金部分后的余额的 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费 = 前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他基金部分后的余额 × 0.60% / 当年天数。

2、本基金合同生效日为 2023 年 7 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	当期发生的基金应支付的托管费	113,643.86

注：1、本基金对持有的基金托管人自身托管的基金部分不收取托管费。支付基金托管人兴业银行的基金托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金部分后的余额的 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金部分后的余额 × 0.20% / 当年天数。

2、本基金合同生效日为 2023 年 7 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金兴元 6 个月持有混 合 A	中金兴元 6 个月持有混 合 C	合计
兴业银行	-	62,748.31	62,748.31
中金财富证券	-	67,980.83	67,980.83
合计	-	130,729.14	130,729.14

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C 类基金日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2023 年 7 月 18 日，无上年度可比期间数据。

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固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入

兴业银行	7,850,598.84	8,790.06
------	--------------	----------

注：本基金的活期银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。本基金基金合同生效日为 2023 年 7 月 18 日，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期无其他关联交易事项。

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

本基金本报告期末未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

本基金本报告期未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日，本基金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 19,004,216.44 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101901658	19 龙城投资 MTN001	2024 年 7 月 1 日	102.00	50,000	5,100,240.44
102101667	21 栖霞建设 MTN001	2024 年 7 月 1 日	104.58	40,000	4,183,237.16
102280411	22 桂交投 MTN001	2024 年 7 月 1 日	101.86	50,000	5,093,134.25
102381186	23 银川通联 MTN003	2024 年 7 月 1 日	103.43	30,000	3,102,912.33
102480903	24 坪山城投 MTN002	2024 年 7 月 1 日	101.78	8,000	814,232.99
102481549	24 河钢集	2024 年 7 月 1 日	101.37	30,000	3,041,116.44

	MTN005	日			
合计				208,000	21,334,873.61

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	7,044,708.20
合计	-	7,044,708.20

注：以上按短期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
	2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
AAA	20,553,931.77	124,712,492.60
AAA 以下	4,183,237.16	11,829,615.24
未评级	20,447,273.87	71,137,901.64
合计	45,184,442.80	207,680,009.48

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性压力测试、流动性风险预警、指标超标及危机的处理、流动性风险管理工具、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司投资风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性指标进行监控。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可在其持有的基金份额锁定期满后随时要求赎回，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5%的

现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,849,811.52	-	-	787.32	7,850,598.84
结算备付金	279,526.92	-	-	130.69	279,657.61
存出保证金	21,974.39	-	-	9.93	21,984.32
交易性金融资产	29,355,000.00	20,342,000.00	6,593,900.00	8,998,953.84	65,289,853.84
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	213,550.61	213,550.61
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,506,312.83	20,342,000.00	6,593,900.00	9,213,432.39	73,655,645.22
负债					
卖出回购金融资产款	18,999,790.50	-	-	4,425.94	19,004,216.44

应付清算款	-	-	-	537,261.52	537,261.52
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	10,984.53	10,984.53
应付管理人报酬	-	-	-	28,185.84	28,185.84
应付托管费	-	-	-	9,395.31	9,395.31
应交税费	-	-	-	2,627.35	2,627.35
其他负债	-	-	-	131,248.87	131,248.87
负债总计	18,999,790.50	-	-	724,129.36	19,723,919.86
利率敏感度缺口	18,506,522.33	20,342,000.00	6,593,900.00	8,489,303.03	53,931,725.36
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	609,875.66	-	-	161.59	610,037.25
结算备付金	85,623.98	-	-	42.35	85,666.33
存出保证金	11,640.55	-	-	5.72	11,646.27
交易性金融资产	191,312,100.00	33,050,538.20	1,283,071.80	23,921,942.02	249,567,652.02
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	4,900,000.00	-	-	-635.61	4,899,364.39
应收清算款	-	-	-	2,224,216.48	2,224,216.48
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	196,919,240.19	33,050,538.20	1,283,071.80	26,145,732.55	257,398,582.74
负债					
卖出回购金融资产款	31,999,632.00	-	-	11,233.68	32,010,865.68
应付清算款	-	-	-	2,424,925.26	2,424,925.26
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	40,001.15	40,001.15
应付管理人报酬	-	-	-	113,206.72	113,206.72
应付托管费	-	-	-	37,647.51	37,647.51
应交税费	-	-	-	16,054.98	16,054.98
其他负债	-	-	-	172,497.35	172,497.35
负债总计	31,999,632.00	-	-	2,815,566.65	34,815,198.65
利率敏感度缺口	164,919,608.19	33,050,538.20	1,283,071.80	23,330,165.90	222,583,384.09

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。

6.4.13.4.1.2 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	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	307,725.60	418,063.62
	市场利率上升 25 个基点	-307,725.60	-418,063.62

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	33,988.20	-	33,988.20
资产合计	-	33,988.20	-	33,988.20
以外币计价的负债				
应付清算款	-	0.01	-	0.01
负债合计	-	0.01	-	0.01
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	33,988.19	-	33,988.19
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计

以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
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	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 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，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	港币相对人民币升值 5%	1,699.41	-
	港币相对人民币贬值 5%	-1,699.41	-

注：表中列示了以外币计价的资产中主要币种的汇率变动对基金资产净值的影响。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金部分主要投资于公开募集的基金及证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	8,295,021.38	15.38	14,077,168.10	6.32
交易性金融资产—基金投资	53,699.80	0.10	7,667,564.60	3.44

交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,348,721.18	15.48	21,744,732.70	9.76

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

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	8,348,721.18	25,727,370.59
第二层次	56,941,132.66	223,840,281.43
第三层次	-	-
合计	65,289,853.84	249,567,652.02

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入

值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	8,295,021.38	11.26
	其中：股票	8,295,021.38	11.26
2	基金投资	53,699.80	0.07
3	固定收益投资	56,941,132.66	77.31
	其中：债券	56,941,132.66	77.31
	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	8,130,256.45	11.04
8	其他各项资产	235,534.93	0.32
9	合计	73,655,645.22	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	747,160.00	1.39
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,904,657.18	7.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,370,808.00	2.54
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	223,368.00	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	812,180.00	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	338,022.00	0.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	864,838.00	1.60
S	综合	-	-
	合计	8,261,033.18	15.32

7.2.2 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	-	-
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	33,988.20	0.06
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	33,988.20	0.06

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	47,400	1,370,808.00	2.54
2	600757	长江传媒	107,300	864,838.00	1.60
3	002714	牧原股份	13,500	588,600.00	1.09
4	688981	中芯国际	12,279	566,061.90	1.05
5	601156	东航物流	27,000	549,450.00	1.02
6	603986	兆易创新	5,100	487,662.00	0.90
7	002384	东山精密	21,700	449,190.00	0.83

8	002475	立讯精密	11,200	440,272.00	0.82
9	000333	美的集团	5,400	348,300.00	0.65
10	002241	歌尔股份	17,700	345,327.00	0.64
11	002322	理工能科	21,100	338,022.00	0.63
12	601000	唐山港	55,900	262,730.00	0.49
13	002371	北方华创	800	255,912.00	0.47
14	000829	天音控股	24,600	223,368.00	0.41
15	688012	中微公司	1,228	173,467.28	0.32
16	603228	景旺电子	5,400	171,720.00	0.32
17	603225	新凤鸣	10,700	166,813.00	0.31
18	000529	广弘控股	27,400	161,112.00	0.30
19	300498	温氏股份	8,000	158,560.00	0.29
20	300856	科思股份	4,600	147,246.00	0.27
21	000680	山推股份	12,400	114,948.00	0.21
22	600690	海尔智家	2,700	76,626.00	0.14
23	00700	腾讯控股	100	33,988.20	0.06

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002714	牧原股份	1,841,813.40	0.83
2	603566	普莱柯	1,646,707.00	0.74
3	000729	燕京啤酒	1,600,389.00	0.72
4	600757	长江传媒	1,341,971.00	0.60
5	002557	洽洽食品	1,275,369.40	0.57
6	601390	中国中铁	1,252,244.00	0.56
7	300871	回盛生物	1,195,962.00	0.54
8	300133	华策影视	1,124,487.00	0.51
9	601988	中国银行	1,101,211.00	0.49
10	601838	成都银行	1,097,362.00	0.49
11	688256	寒武纪	1,000,289.16	0.45
12	002223	鱼跃医疗	953,543.00	0.43
13	301313	凡拓数创	880,697.00	0.40
14	688981	中芯国际	834,315.97	0.37
15	688700	东威科技	831,076.40	0.37
16	000529	广弘控股	767,558.00	0.34
17	300213	佳讯飞鸿	759,567.00	0.34
18	600975	新五丰	757,977.00	0.34
19	603589	口子窖	740,975.00	0.33
20	601138	工业富联	732,778.00	0.33

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601006	大秦铁路	2,900,006.00	1.30
2	002241	歌尔股份	2,449,313.00	1.10
3	002432	九安医疗	2,411,419.00	1.08
4	300133	华策影视	1,727,868.00	0.78
5	300213	佳讯飞鸿	1,614,679.00	0.73
6	002223	鱼跃医疗	1,598,469.00	0.72
7	000729	燕京啤酒	1,567,880.00	0.70
8	603566	普莱柯	1,342,467.00	0.60
9	601390	中国中铁	1,314,395.00	0.59
10	002557	洽洽食品	1,303,356.00	0.59
11	002714	牧原股份	1,244,754.00	0.56
12	300871	回盛生物	1,237,498.00	0.56
13	601988	中国银行	1,218,482.00	0.55
14	601838	成都银行	1,146,001.00	0.51
15	002045	国光电器	1,095,198.00	0.49
16	601000	唐山港	1,028,742.00	0.46
17	688256	寒武纪	994,404.99	0.45
18	601138	工业富联	951,454.00	0.43
19	600975	新五丰	803,569.00	0.36
20	688700	东威科技	793,938.24	0.36

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	57,538,109.12
卖出股票收入（成交）总额	63,770,980.55

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	1,153,956.99	2.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,863,532.35	33.12
	其中：政策性金融债	10,602,732.87	19.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	37,923,643.32	70.32
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,941,132.66	105.58

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	210205	21 国开 05	50,000	5,512,667.12	10.22
2	102000033	20 陕有色 MTN001	50,000	5,151,775.41	9.55
3	101901658	19 龙城投资 MTN001	50,000	5,100,240.44	9.46
4	102481280	24 深圳特发 MTN002	50,000	5,095,195.62	9.45
5	102280411	22 桂交投 MTN001	50,000	5,093,134.25	9.44

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

本期基金投资以封低配置宽基指数的操作策略为主。

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	是否属于基金管理人及管理人关联
----	------	------	------	---------	---------	--------	-----------------

						值比例 (%)	方所管理的基金
1	510300	华泰柏瑞沪深300ETF	交易型开放式(ETF)	15,400.00	53,699.80	0.10	否

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

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中，浙商银行股份有限公司本期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。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

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	21,984.32
2	应收清算款	213,550.61
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	235,534.93

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

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 (%)
中金兴元 6 个月持 有混合 A	137	89,215.98	0.00	0.00	12,222,588.87	100.00
中金兴元 6 个月持 有混合 C	263	157,147.84	2,701,699.16	6.54	38,628,181.55	93.46
合计	400	133,881.17	2,701,699.16	5.04	50,850,770.42	94.96

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	中金兴元 6 个月持有混合 A	210,632.32	1.7233
	中金兴元 6 个月持有混合 C	60,100.64	0.1454
	合计	270,732.96	0.5055

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	中金兴元 6 个月持有混合 A	10~50
	中金兴元 6 个月持有混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本 开放式基金	中金兴元 6 个月持有混合 A	10~50
	中金兴元 6 个月持有混合 C	0~10
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金兴元 6 个月持有混合 A	中金兴元 6 个月持有混合 C
基金合同生效日 (2023 年 7 月 18 日) 基金份额总额	65,875,851.19	159,065,596.68

本报告期期初基金份额总额	65,939,891.34	159,070,344.57
本报告期基金总申购份额	7,045.15	470,190.67
减：本报告期基金总赎回份额	53,724,347.62	118,210,654.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,222,588.87	41,329,880.71

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

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

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

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无重大影响事件。

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

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.8 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 (%)	
中金财富证券	2	121,309,089.67	100.00	42,120.51	100.00	-

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；能根据基金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	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)

				(%)		成交总额的 比例 (%)		
中金财富证券	12,380,682.21	100.00	173,186,000.00	100.00	-	-	8,218,387.10	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	关于中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金开放赎回及转换转出业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-1-15
2	中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-1-19
3	中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-1-19
4	中金基金管理有限公司董事长、高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024-1-20
5	中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024-3-2
6	中金基金管理有限公司关于不法分子假冒“中金基金”名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2024-3-22
7	中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-3-29
8	中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-3-29
9	中金基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-4-20
10	中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-4-20
11	中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金更新招募说明书（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2024-5-10
12	中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2024-5-10

13	中金基金管理有限公司关于上海分公司负责人及注册地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-5-15
14	中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-6-24

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金申请募集注册的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、报告期内中金兴元 6 个月持有期混合型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日