

中加科丰价值精选混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 29 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月28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01月01日起至2024年06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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61

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	62
§9 开放式基金份额变动	62
§10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中加科丰价值精选混合型证券投资基金
基金简称	中加科丰价值精选混合
基金主代码	008356
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年05月08日
基金管理人	中加基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	227,127,422.56份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超过业绩比较基准的投资回报，力争实现资产的长期、稳健增值。
投资策略	本基金通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上，力争实现长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中债总全价（总值）指数收益率×60%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中加基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凌	滕菲菲
	联系电话	400-00-95526	4006800000
	电子邮箱	service@bobbs.com	tengfeifei@citicbank.com

客户服务电话	400-00-95526	95558
传真	010-83197627	010-85230024
注册地址	北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址	北京市西城区南纬路35号	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码	100050	100020
法定代表人	夏远洋	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bobbns.com
基金中期报告备置地点	基金管理人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35号

§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01月01日-2024年06月30日)
本期已实现收益	4,191,439.69
本期利润	2,652,120.28
加权平均基金份额本期利润	0.0082
本期加权平均净值利润率	0.74%
本期基金份额净值增长率	0.67%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末可供分配利润	17,277,085.13
期末可供分配基金份额利润	0.0761
期末基金资产净值	252,148,569.45
期末基金份额净值	1.1102
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	25.45%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、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收益。

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（为期末余额，不是当期发生额）。

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

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	-0.92%	0.17%	-0.90%	0.19%	-0.02%	-0.02%
过去三个月	-0.32%	0.18%	-0.23%	0.29%	-0.09%	-0.11%
过去六个月	0.67%	0.25%	1.82%	0.35%	-1.15%	-0.10%
过去一年	0.30%	0.19%	-2.11%	0.34%	2.41%	-0.15%
过去三年	6.45%	0.15%	-11.15%	0.41%	17.60%	-0.26%
自基金合同生效起至今	25.45%	0.20%	-1.65%	0.44%	27.10%	-0.24%

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



§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

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地种业（集团）有限公司6%、中国有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

本报告期内，本基金管理人共管理七十三只基金，分别是中加货币市场基金、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中加纯债债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金、中加丰润纯债债券型证券投资基金、中加丰尚纯债债券型证券投资基金、中加丰泽纯债债券型证券投资基金、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金、中加丰享纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、中加颐享纯债债券型证券投资基金、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金、中加颐信纯债债券型证券投资基金、中加颐睿纯债债券型证券投资基金、中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金、中加颐智纯

债债券型证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金、中加裕盈纯债债券型证券投资基金、中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金、中加恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金、中加颐瑾六个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中加民丰纯债债券型证券投资基金、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金、中加享润两年定期开放债券型证券投资基金、中加优选中高等级债券型证券投资基金、中加优享纯债债券型证券投资基金、中加瑞享纯债债券型证券投资基金、中加安瑞稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金、中加聚庆六个月定期开放混合型证券投资基金、中加核心智造混合型证券投资基金、中加优势企业混合型证券投资基金、中加博裕纯债债券型证券投资基金、中加新兴成长混合型证券投资基金、中加中证 500 指数增强型证券投资基金、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中加新兴消费混合型证券投资基金、中加穗盈纯债债券型证券投资基金、中加聚隆六个月持有期混合型证券投资基金、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加科鑫混合型证券投资基金、中加中债-1-5 年国开债券指数证券投资基金、中加聚优一年定期开放混合型证券投资基金、中加消费优选混合型证券投资基金、中加喜利回报一年持有期混合型证券投资基金、中加优悦一年定期开放债券型证券投资基金、中加中债-1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、中加邮益一年持有期混合型证券投资基金、中加龙头精选混合型证券投资基金、中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金、中加量化研选混合型证券投资基金、中加恒享三个月定期开放债券型证券投资基金、中加聚享增盈债券型证券投资基金、中加瑞鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加聚安 60 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中加博盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加中债-新综合债券指数发起式证券投资基金、中加医疗创新混合型发起式证券投资基金、中加安瑞积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中加睿盈纯债债券型证券投资基金、中加科技创新混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
于跃	原本基金基金经理	2020-05-13	2024-03-18	12	于跃先生，伦敦帝国理工大学金融数学硕士。2012年5

				<p>月至2015年5月，任职于民生证券股份有限公司，担任固收投资经理助理；2015年6月至2019年11月，任职于中信建投证券股份有限公司，任固定收益投资经理。2019年12月加入中加基金管理有限公司，曾任中加优享纯债债券型证券投资基金（2020年3月4日至2021年8月20日）、中加丰裕纯债债券型证券投资基金（2020年5月7日至2021年8月20日）、中加颐信纯债债券型证券投资基金（2020年3月4日至2021年12月21日）、中加瑞利纯债债券型证券投资基金（2020年3月4日至2022年3月28日）、中加瑞合纯债债券型证券投资基金（2020年11月25日至2022年11月15日）、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金（2020年3月3日至2022年12月29日）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金（2020年5月13日至2024年3月18日）、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金（2020年2月19日至2024年3月18日）、中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金（2022年6月20日至2024年4月1日）的基金经理，现任中加颐享纯债债券型</p>
--	--	--	--	--

					<p>证券投资基金（2020年3月3日至今）、中加颐睿纯债债券型证券投资基金（2021年12月15日至今）、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金（2022年4月29日至今）、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金（2022年5月13日至今）、中加博盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金（2022年9月13日至今）、中加博裕纯债债券型证券投资基金（2023年11月24日至今）、中加纯债债券型证券投资基金（2024年5月10日至今）的基金经理。</p>
钟伟	本基金基金经理	2023-02-15	-	14	<p>钟伟先生，复旦大学数学博士。2009年7月至2016年5月，先后在广发基金管理有限公司金融工程部、数量投资部任研究员、基金经理。2013年11月7日至2015年8月任广发中债金融债指数基金的基金经理。2015年2月至2016年5月任广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2016年5月至2020年3月，任吉富创业投资股份有限公司量化投资部总经理、基金经理。2020年3月加入中加基金管理有限公司，曾任中加紫金灵活配置混合型证</p>

					券投资基金（2022年4月22日至2023年6月30日）的基金经理，现任中加中证500指数增强型证券投资基金（2020年9月27日至今）、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（2021年8月13日至今）、中加量化研选混合型证券投资基金（2022年4月11日至今）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金（2023年2月15日至今）、中加聚享增盈债券型证券投资基金（2023年7月13日至今）的基金经理。
庞智桐	本基金基金经理	2024-03-18	-	6	庞智桐先生，中国科学技术大学理学学士，中国科学院大学金融硕士。2017年7月至2019年7月，任职于渤海证券有限公司债券销售交易总部，担任债券投资助理；2019年8月加入中加基金管理有限公司固定收益部从事债券投研工作。现任中加邮益一年持有期混合型证券投资基金（2024年2月1日至今）、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（2024年2月1日至今）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金（2024年3月18日至今）、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金（2024年3月18日至

					今)、中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2024年4月1日至今)、中加聚享增盈债券型证券投资基金(2024年6月28日至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注:

- 1、任职日期说明:本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日, 后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期。
- 2、离任日期说明:因工作安排, 于跃先生于2024年3月18日离任本基金基金经理。
- 3、证券从业年限的计算标准遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。
- 4、本基金无基金经理助理。

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, 基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益, 严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》, 对买卖债券时候的价格和市场价格差距较大, 可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期, 本基金的基金管理人不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 公司制定了同日反向交易控制的规则, 并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时, 公司利用公平交易分析系统, 对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控, 定期对组合间的同向交易进行分析。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%。投资组合间虽然存在同向交易行为, 但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果, 表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

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

债券部分：2024年以来，长债利率中枢再下一个台阶，债券市场依旧强势，对经济转型升级的再定价是重要宏观背景。

节奏上，1-2月有大行下调存款挂牌利率、降准、5年LPR下调等宽松货币政策的支持，以10年和30年国债为代表的长债利率下行近30bp，表现最为亮眼。至3月，政策利率迟迟不调整约束了利率的下行空间，与此同时PMI重返荣枯线，经济暂时性企稳，利率陷入震荡状态。

二季度影响债券走势的最核心因素是监管通过加强对“手工补息”、智能存款等银行的行为监管进一步压降银行存款付息成本，这推动了实体部门资产配置由银行存款转向银行理财、货币基金等非银产品，非银资产荒进一步加剧的带动下，信用债收益率快速下行，信用债的信用利差、期限利差、等级利差均在压缩。期间特别国债供给速度偏缓、政治局会议提出去库存的地产政策新思路均带来了阶段性的市场波动，但未改变利率运行趋势。

投资策略方面，上半年做好固收+的固收部分底仓配置工作，整体久期适度拉长，保证产品流动性，为权益投资提供安全垫；产品整体运行较为平稳，后续将继续做好信用品种挖掘工作，守护好底仓的同时择机参与利率债波段交易。

权益部分：2024年上半年，国内经济整体复苏偏弱，A股宽幅震荡，波动较大。市值风格分化明显，大盘风格表现显著好于小盘风格。偏防御属性的高股息方向表现较好，偏进攻的成长方向则表现不佳。

年初至2月初，在北向资金持续流出，“雪球”衍生品集中敲入等不利因素影响下，A股市场主要指数大幅下跌，小微盘股发生流动性危机，表现不佳。

2月初至5月，监管层出台多项稳定资本市场的举措，先后降准降息，稳定市场预期，市场流动性持续改善，市场主要指数触底反弹。4月中央政治局会议释放积极信号，首提消化存量房地产，地产政策预期强烈，在地产板块的带动下，市场震荡上行。

5月以来，随着经济数据的表现低于预期，市场对经济复苏的担忧加剧，市场也开始掉头下跌。虽然央行在5月中旬发布了取消个人住房贷款利率下限和下调公积金贷款利率等优化房地产市场政策措施，但地产相关的数据并未发生实质性改善，市场延续了震荡下行的走势。

在报告期内，沪深300、上证50和创业板指的涨跌幅分别为0.89%、2.95%和-10.99%，中证500的涨跌幅为-8.96%。

本基金采用量化多因子模型选股模型对股票投资价值做定量分析，在此基础上构建股票投资组合，基金的持股非常分散，报告期内基金的股票仓位变化不大，力求在较小的回撤幅度下获得稳健的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加科丰价值精选混合基金份额净值为1.1102元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.67%，同期业绩比较基准收益率为1.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券部分：站在现在的角度展望下半年债市行情，我们认为经济转型升级的宏观环境难以发生明显转变，资产荒格局或将延续，拉长时间维度来看，债券仍有较好投资价值。短期来看，央行突然降息打开了短端利率下限，如果仅是保持正常向上倾斜的收益率曲线意味着长端也将有一定性价比，但空间确实逼仄，更加考验交易能力。

权益部分：今年二季度GDP增速为4.7%，低于市场预期。中采制造业PMI数据连续三个月位于枯荣线以下，国内经济仍然处于弱复苏的阶段，面临需求不足的问题。三中全会结束之后，货币、财政和产业方面的一些支持政策也会陆续出台。海外市场由于通胀缓解，将逐步转向降息周期，有望缓解资金外流的压力。A股经过上半年的调整，目前估值水平整体处于底部区域，具备一定的安全边际。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组，由分管基金运营的公司领导任估值小组负责人，成员由分管风险合规的公司领导、固定收益部、权益投资部、基金运营部、风险管理部、法律合规与内控部、集中交易部等部门负责人及业务骨干组成，若估值小组认为必要，可适当增减小组成员，业务骨干由估值小组认定和调整。基金经理可依据专业判断就估值政策标准等议题参与讨论并提出意见建议，但不能参与最终估值决策。估值小组主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响，以及对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于人民币五千万元的情形。

§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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《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，对中加科丰价值精选混合型证券投资基金2024年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，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

本托管人认为，中加基金管理有限公司在中加科丰价值精选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本托管人认为，中加基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2024年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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§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：中加科丰价值精选混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			

货币资金	6.4.7.1	5,204,775.19	3,185,890.86
结算备付金		560,582.24	971,954.62
存出保证金		19,620.30	39,483.11
交易性金融资产	6.4.7.2	294,199,325.71	475,893,203.45
其中：股票投资		41,963,001.39	63,646,481.78
基金投资		-	-
债券投资		252,236,324.32	412,246,721.67
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		22,172.56	18,228.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		300,006,476.00	480,108,760.94
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06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		47,035,435.68	59,100,870.21
应付清算款		-	-
应付赎回款		315,341.75	3,974,296.14
应付管理人报酬		147,135.93	217,842.34
应付托管费		24,522.64	36,307.03
应付销售服务费		-	-

应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,927.83	7,836.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	321,542.72	1,140,691.14
负债合计		47,857,906.55	64,477,842.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	227,127,422.56	376,872,717.90
未分配利润	6.4.7.8	25,021,146.89	38,758,200.16
净资产合计		252,148,569.45	415,630,918.06
负债和净资产总计		300,006,476.00	480,108,760.94

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额净值为1.1102元，基金份额总额227,127,422.56份。

6.2 利润表

会计主体：中加科丰价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		4,285,806.55	27,272,604.64
1.利息收入		55,268.22	940,603.04
其中：存款利息收入	6.4.7.9	45,806.31	636,000.04
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		9,461.91	304,603.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		5,761,386.13	17,236,114.61

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-381,485.51	7,122,662.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	5,389,013.29	8,555,404.19
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	753,858.35	1,558,048.09
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.15	-1,539,319.41	8,794,993.11
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	8,471.61	300,893.88
减：二、营业总支出		1,633,686.27	4,463,329.36
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,072,456.72	3,031,773.04
2.托管费	6.4.10.2.2	178,742.73	505,295.50
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		256,759.19	756,090.05
其中：卖出回购金融资产 支出		256,759.19	756,090.05
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		4,330.65	33,093.49
8.其他费用	6.4.7.18	121,396.98	137,077.28
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		2,652,120.28	22,809,275.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		2,652,120.28	22,809,275.28

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,652,120.28	22,809,275.28

6.3 净资产变动表

会计主体：中加科丰价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	376,872,717.90	38,758,200.16	415,630,918.06
二、本期期初净资产	376,872,717.90	38,758,200.16	415,630,918.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-149,745,295.34	-13,737,053.27	-163,482,348.61
（一）、综合收益总额	-	2,652,120.28	2,652,120.28
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-149,745,295.34	-16,389,173.55	-166,134,468.89
其中：1.基金申购款	3,398,459.74	383,732.90	3,782,192.64
2.基金赎回款	-153,143,755.08	-16,772,906.45	-169,916,661.53
（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	227,127,422.56	25,021,146.89	252,148,569.45
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,233,579,515.00	104,546,910.48	1,338,126,425.48
二、本期期初净资产	1,233,579,515.00	104,546,910.48	1,338,126,425.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-501,744,931.72	-26,313,733.91	-528,058,665.63
（一）、综合收益总额	-	22,809,275.28	22,809,275.28
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-501,744,931.72	-49,123,009.19	-550,867,940.91
其中：1.基金申购款	47,588,772.06	4,498,430.04	52,087,202.10
2.基金赎回款	-549,333,703.78	-53,621,439.23	-602,955,143.01
（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	731,834,583.28	78,233,176.57	810,067,759.85

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：

夏远洋

陈昕

陈昕

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

中加科丰价值精选混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")2019年11月7日证监许可[2019]2221号文准予募集注册《关于准予中加科丰价值精选混合型证券投资基金注册的批复》核准募集核准,由中加基金管理有限公司(以下简称"中加基金")依照《中华人民共和国证券投资基金法及配套规则》和《中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金,托管人为中信银行股份有限公司(以下简称"中信银行")。

本基金通过中加基金及基金代销机构共同销售,募集期为2020年4月28日至2020年4月30日。本基金于2020年5月8日成立,成立之日基金实收份额为350,071,562.96份(含利息转份额人民币31,204.87元),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、《中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金合同》和《中加科丰价值精选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、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)、货币市场工具(含同业存单)、债券回购、银行存款、资产支持证券、股指期货、国债期货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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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

本基金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要求，真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况、2024年度中期的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告所采用的会计政策、会计估计相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。本期财务报表的编制期间为2024年1月1日至2024年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

-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；

-该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融工具的初始确认

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

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(2)金融工具的后续计量

初始确认后，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

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

(3)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

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

(4)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

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

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加

但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资及资产支持证券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动(包括于估值日采用合同约定的估值汇率将外币折算为人民币所产生的折算差额)形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、基金可供分配利润为正的前提下，方可进行收益分配；
- 6、投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；
- 7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期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》、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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延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》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：

(1)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。

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

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。

(3)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。

(4)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。

(5)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06月30日
活期存款	5,204,775.19
等于：本金	5,203,350.28
加：应计利息	1,424.91
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	5,204,775.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	44,812,233.33	-	41,963,001.39	-2,849,231.94	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	248,287,858.32	2,920,374.32	252,236,324.32	1,028,091.68
	合计	248,287,858.32	2,920,374.32	252,236,324.32	1,028,091.68
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	293,100,091.65	2,920,374.32	294,199,325.71	-1,821,140.26	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	20.60
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	220,526.58
其中：交易所市场	200,923.88
银行间市场	19,602.70
应付利息	-
预提费用-审计费	32,323.20
预提费用-信息披露费	59,672.34
预提费用-账户维护费	9,000.00
合计	321,542.72

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	376,872,717.90	376,872,717.90
本期申购	3,398,459.74	3,398,459.74
本期赎回（以“-”号填列）	-153,143,755.08	-153,143,755.08
本期末	227,127,422.56	227,127,422.56

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,053,136.39	14,705,063.77	38,758,200.16
本期期初	24,053,136.39	14,705,063.77	38,758,200.16
本期利润	4,191,439.69	-1,539,319.41	2,652,120.28
本期基金份额交易产	-10,967,490.95	-5,421,682.60	-16,389,173.55

生的变动数			
其中：基金申购款	244,776.31	138,956.59	383,732.90
基金赎回款	-11,212,267.26	-5,560,639.19	-16,772,906.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,277,085.13	7,744,061.76	25,021,146.89

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入	40,484.59	
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	5,080.55	
其他	241.17	
合计	45,806.31	

6.4.7.10 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01月01日至2024年06月30日	
卖出股票成交总额	418,069,963.53	
减：卖出股票成本总额	417,989,037.49	
减：交易费用	462,411.55	
买卖股票差价收入	-381,485.51	

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
债券投资收益——利息收入	4,865,725.09	

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	523,288.20
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	5,389,013.29

6.4.7.11.2 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01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	870,758,121.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	860,784,167.85
减：应计利息总额	9,430,919.61
减：交易费用	19,745.37
买卖债券差价收入	523,288.20

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	753,858.35
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	753,858.35

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-1,539,319.41
——股票投资	-2,771,371.33
——债券投资	1,232,051.92
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,539,319.41

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	8,471.46
转换费收入	0.15
合计	8,471.61

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	32,323.20
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	10,801.44
上清所账户维护费	9,000.00
中债登账户维护费	9,000.00
其他费用	600.00
合计	121,396.98

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

本报告期不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。

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
中加基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人
北京银行股份有限公司	基金管理人股东

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,072,456.72	3,031,773.04

其中：应支付销售机构的客户维护费	114,062.39	347,139.52
应支付基金管理人的净管理费	958,394.33	2,684,633.52

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	178,742.73	505,295.50

注：支付基金托管人中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未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

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

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

报告期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01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	5,204,775.19	40,484.59	92,490,604.61	582,004.57

注：本基金的活期存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计提。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与各关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年06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**

于2024年6月30日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2024年6月30日，本基金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日止，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47,035,435.68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
2028040	20交通银行永续债	2024-07-01	106.61	100,000	10,660,918.03
2120045	21青岛银行二级02	2024-07-01	104.49	130,000	13,584,144.49
2128016	21民生银行永续债01	2024-07-01	104.62	200,000	20,923,830.14
240301	24进出01	2024-07-01	101.09	65,000	6,570,835.79
合计				495,000	51,739,728.45

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日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、法律合规与内控部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量

化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款主要存放在本基金的托管人和信用风险较低的商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	20,217,956.28	42,826,042.06
合计	20,217,956.28	42,826,042.06

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为期限在一年及以内的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的短期融资券。

3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	73,489,672.12	72,353,275.41
AAA以下	34,423,789.20	20,714,925.79
未评级	124,104,906.72	276,352,478.41
合计	232,018,368.04	369,420,679.61

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的债务融资工具。

3.以上数据不合同业存单及资产支持证券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额（如有）计息但该利息金额不重大以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12（如有）外，本基金未持

有其他重大流动性风险的投资品种。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

报告期内，本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性风险管理相关制度，对基金组合资产流动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率敏感度缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 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	5,204,775.19	-	-	-	5,204,775.19
结算备付金	559,828.10	-	-	754.14	560,582.24
存出保证金	19,620.30	-	-	-	19,620.30
交易性金融资产	33,128,187.57	192,392,079.77	26,716,056.98	41,963,001.39	294,199,325.71
应收申购款	-	-	-	22,172.56	22,172.56

资产总计	38,912,411.16	192,392,079.77	26,716,056.98	41,985,928.09	300,006,476.00
负债					
卖出回购金融资产款	47,035,435.68	-	-	-	47,035,435.68
应付赎回款	-	-	-	315,341.75	315,341.75
应付管理人报酬	-	-	-	147,135.93	147,135.93
应付托管费	-	-	-	24,522.64	24,522.64
应交税费	-	-	-	13,927.83	13,927.83
其他负债	-	-	-	321,542.72	321,542.72
负债总计	47,035,435.68	-	-	822,470.87	47,857,906.55
利率敏感度缺口	-8,123,024.52	192,392,079.77	26,716,056.98	41,163,457.22	252,148,569.45
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	3,185,890.86	-	-	-	3,185,890.86
结算备付金	971,954.62	-	-	-	971,954.62
存出保证金	39,483.11	-	-	-	39,483.11
交易性金融资产	94,189,085.89	297,803,355.56	20,254,280.22	63,646,481.78	475,893,203.45

应收申购款	-	-	-	18,228.90	18,228.90
资产总计	98,386,414.48	297,803,355.56	20,254,280.22	63,664,710.68	480,108,760.94
负债					
卖出回购金融资产款	59,100,870.21	-	-	-	59,100,870.21
应付赎回款	-	-	-	3,974,296.14	3,974,296.14
应付管理人报酬	-	-	-	217,842.34	217,842.34
应付托管费	-	-	-	36,307.03	36,307.03
应交税费	-	-	-	7,836.02	7,836.02
其他负债	-	-	-	1,140,691.14	1,140,691.14
负债总计	59,100,870.21	-	-	5,376,972.67	64,477,842.88
利率敏感度缺口	39,285,544.27	297,803,355.56	20,254,280.22	58,287,738.01	415,630,918.06

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,527,892.98	1,901,981.84
	市场利率上升25个基点	-1,527,892.98	-1,901,981.84

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格的风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06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	41,963,001.39	16.64	63,646,481.78	15.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	252,236,324.32	100.03	412,246,721.67	99.19
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	294,199,325.71	116.67	475,893,203.45	114.50

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	3,706,328.11	5,718,848.40
	业绩比较基准下降5%	-3,706,328.11	-5,718,848.40

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06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	41,963,001.39	63,646,481.78
第二层次	252,236,324.32	412,246,721.67
第三层次	-	-
合计	294,199,325.71	475,893,203.45

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

于2024年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2023年12月31日：无）。

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

于2024年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	41,963,001.39	13.99
	其中：股票	41,963,001.39	13.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	252,236,324.32	84.08
	其中：债券	252,236,324.32	84.08
	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	5,765,357.43	1.92
8	其他各项资产	41,792.86	0.01

9	合计	300,006,476.00	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

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	2,613.00	0.00
B	采矿业	1,175,654.00	0.47
C	制造业	27,121,218.58	10.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,061,736.00	0.82
E	建筑业	428,225.00	0.17
F	批发和零售业	1,845,176.36	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	581,295.00	0.23
H	住宿和餐饮业	17,290.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,231,544.00	0.89
J	金融业	3,672,111.85	1.46
K	房地产业	632,915.00	0.25
L	租赁和商务服务业	992,231.60	0.39
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	96,024.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,320.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,047,591.00	0.42
S	综合	45,056.00	0.02
	合计	41,963,001.39	16.64

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	002532	天山铝业	117,500	952,925.00	0.38
2	601989	中国重工	176,700	871,131.00	0.35
3	000883	湖北能源	144,300	867,243.00	0.34
4	600219	南山铝业	218,700	833,247.00	0.33
5	000725	京东方A	200,900	821,681.00	0.33
6	002152	广电运通	76,400	799,144.00	0.32
7	603160	汇顶科技	11,300	776,875.00	0.31
8	603039	泛微网络	23,800	755,888.00	0.30
9	000030	富奥股份	151,800	745,338.00	0.30
10	600429	三元股份	190,700	711,311.00	0.28
11	688819	天能股份	27,437	654,646.82	0.26
12	688571	杭华股份	121,400	642,206.00	0.25
13	002465	海格通信	61,700	639,212.00	0.25
14	688249	晶合集成	43,200	633,744.00	0.25
15	600050	中国联通	133,300	626,510.00	0.25
16	600998	九州通	124,697	608,521.36	0.24
17	600909	华安证券	142,700	600,767.00	0.24
18	600623	华谊集团	103,500	598,230.00	0.24
19	002128	电投能源	26,400	557,040.00	0.22
20	300441	鲍斯股份	91,500	542,595.00	0.22
21	603368	柳药集团	30,800	539,000.00	0.21
22	000921	海信家电	16,200	522,288.00	0.21
23	000703	恒逸石化	73,400	520,406.00	0.21
24	688036	传音控股	6,720	514,348.80	0.20
25	002010	传化智联	124,700	478,848.00	0.19
26	688567	孚能科技	48,166	462,393.60	0.18
27	600812	华北制药	111,100	457,732.00	0.18
28	600095	湘财股份	73,200	436,272.00	0.17

29	601128	常熟银行	55,470	419,907.90	0.17
30	000825	太钢不锈	122,800	415,064.00	0.16
31	601058	赛轮轮胎	29,000	406,000.00	0.16
32	600458	时代新材	39,600	399,960.00	0.16
33	603277	银都股份	13,300	399,532.00	0.16
34	601098	中南传媒	31,700	393,714.00	0.16
35	002500	山西证券	81,700	383,990.00	0.15
36	600157	永泰能源	318,000	375,240.00	0.15
37	688516	奥特维	8,640	361,238.40	0.14
38	688136	科兴制药	21,400	358,664.00	0.14
39	600208	新湖中宝	199,800	315,684.00	0.13
40	601717	郑煤机	21,100	312,280.00	0.12
41	601700	风范股份	67,600	296,764.00	0.12
42	601728	中国电信	47,300	290,895.00	0.12
43	601555	东吴证券	49,300	290,870.00	0.12
44	002302	西部建设	55,800	290,160.00	0.12
45	002028	思源电气	4,300	287,670.00	0.11
46	002429	兆驰股份	57,400	276,094.00	0.11
47	601567	三星医疗	7,500	262,500.00	0.10
48	600517	国网英大	58,300	252,439.00	0.10
49	300251	光线传媒	29,500	248,095.00	0.10
50	600038	中直股份	6,000	246,660.00	0.10
51	000050	深天马A	33,300	242,424.00	0.10
52	600582	天地科技	34,800	239,772.00	0.10
53	600380	健康元	21,400	239,038.00	0.09
54	601868	中国能建	112,600	238,712.00	0.09
55	002027	分众传媒	39,100	236,946.00	0.09
56	600885	宏发股份	8,540	236,387.20	0.09
57	000709	河钢股份	121,800	236,292.00	0.09
58	600999	招商证券	16,800	233,688.00	0.09
59	002073	软控股份	31,500	232,785.00	0.09

60	000598	兴蓉环境	30,900	232,368.00	0.09
61	000720	新能泰山	95,900	231,119.00	0.09
62	688289	圣湘生物	13,000	228,540.00	0.09
63	601916	浙商银行	82,700	228,252.00	0.09
64	000930	中粮科技	45,200	227,356.00	0.09
65	600664	哈药股份	80,200	211,728.00	0.08
66	600989	宝丰能源	11,800	204,494.00	0.08
67	601665	齐鲁银行	40,745	200,057.95	0.08
68	600361	创新新材	45,900	184,977.00	0.07
69	000156	华数传媒	29,400	184,632.00	0.07
70	601609	金田股份	32,600	184,516.00	0.07
71	002966	苏州银行	23,800	178,500.00	0.07
72	601801	皖新传媒	24,100	167,013.00	0.07
73	600398	海澜之家	17,900	165,396.00	0.07
74	002498	汉缆股份	50,100	164,829.00	0.07
75	600746	江苏索普	27,700	163,153.00	0.06
76	000830	鲁西化工	13,700	158,783.00	0.06
77	002353	杰瑞股份	4,300	150,844.00	0.06
78	603590	康辰药业	5,900	150,686.00	0.06
79	002185	华天科技	18,000	146,700.00	0.06
80	600959	江苏有线	55,200	145,728.00	0.06
81	000937	冀中能源	21,700	145,390.00	0.06
82	600826	兰生股份	27,020	145,367.60	0.06
83	600707	彩虹股份	21,200	144,372.00	0.06
84	600710	苏美达	17,500	142,625.00	0.06
85	600699	均胜电子	9,500	140,790.00	0.06
86	000999	华润三九	3,290	140,088.20	0.06
87	600498	烽火通信	8,800	139,920.00	0.06
88	000636	风华高科	10,700	139,742.00	0.06
89	601018	宁波港	39,200	133,280.00	0.05
90	600497	驰宏锌锗	24,900	132,966.00	0.05

91	605007	五洲特纸	10,400	131,352.00	0.05
92	603228	景旺电子	4,100	130,380.00	0.05
93	603317	天味食品	11,300	128,933.00	0.05
94	600252	中恒集团	59,300	128,681.00	0.05
95	601608	中信重工	33,700	128,397.00	0.05
96	601139	深圳燃气	19,000	126,920.00	0.05
97	688281	华秦科技	1,500	124,980.00	0.05
98	300253	卫宁健康	21,100	124,490.00	0.05
99	000960	锡业股份	8,000	123,920.00	0.05
100	600150	中国船舶	3,000	122,130.00	0.05
101	600713	南京医药	28,700	121,114.00	0.05
102	600956	新天绿能	14,200	116,014.00	0.05
103	000415	渤海租赁	43,900	111,945.00	0.04
104	600350	山东高速	12,400	109,740.00	0.04
105	600535	天士力	8,700	109,446.00	0.04
106	688475	萤石网络	3,200	109,152.00	0.04
107	300724	捷佳伟创	2,000	108,020.00	0.04
108	601880	辽港股份	84,300	103,689.00	0.04
109	600141	兴发集团	5,400	103,032.00	0.04
110	002683	广东宏大	5,100	102,663.00	0.04
111	603658	安图生物	2,200	101,354.00	0.04
112	002294	信立泰	3,800	101,194.00	0.04
113	300919	中伟股份	3,200	99,168.00	0.04
114	002939	长城证券	14,700	98,490.00	0.04
115	603056	德邦股份	7,500	98,250.00	0.04
116	603567	珍宝岛	9,300	97,929.00	0.04
117	600021	上海电力	9,900	97,911.00	0.04
118	002083	孚日股份	22,600	95,598.00	0.04
119	601702	华峰铝业	5,200	94,952.00	0.04
120	600933	爱柯迪	6,400	94,656.00	0.04
121	000639	西王食品	37,700	89,726.00	0.04

122	603408	建霖家居	6,800	89,692.00	0.04
123	600820	隧道股份	13,700	89,461.00	0.04
124	603501	韦尔股份	900	89,433.00	0.04
125	300144	宋城演艺	11,000	88,330.00	0.04
126	600433	冠豪高新	33,200	87,980.00	0.03
127	600655	豫园股份	16,700	86,005.00	0.03
128	688778	厦钨新能	2,674	83,535.76	0.03
129	601568	北元集团	22,300	82,733.00	0.03
130	601016	节能风电	27,500	82,225.00	0.03
131	600170	上海建工	37,000	79,550.00	0.03
132	600158	中体产业	10,300	79,207.00	0.03
133	603993	洛阳钼业	9,200	78,200.00	0.03
134	600739	辽宁成大	9,100	76,167.00	0.03
135	603486	科沃斯	1,600	75,488.00	0.03
136	600967	内蒙一机	10,400	74,880.00	0.03
137	688002	睿创微纳	2,600	72,722.00	0.03
138	603568	伟明环保	3,500	72,030.00	0.03
139	000967	盈峰环境	17,000	71,910.00	0.03
140	600373	中文传媒	4,800	71,232.00	0.03
141	300866	安克创新	1,000	71,210.00	0.03
142	300181	佐力药业	4,700	71,064.00	0.03
143	300394	天孚通信	800	70,736.00	0.03
144	603786	科博达	1,100	70,565.00	0.03
145	000959	首钢股份	25,800	70,176.00	0.03
146	600987	航民股份	9,900	69,894.00	0.03
147	002025	航天电器	1,500	69,570.00	0.03
148	600511	国药股份	2,200	67,738.00	0.03
149	600642	申能股份	7,600	67,108.00	0.03
150	601598	中国外运	11,900	66,997.00	0.03
151	603379	三美股份	1,700	66,538.00	0.03
152	601375	中原证券	18,900	64,449.00	0.03

153	601966	玲珑轮胎	3,500	64,295.00	0.03
154	002414	高德红外	10,900	64,201.00	0.03
155	001872	招商港口	3,300	63,525.00	0.03
156	600399	抚顺特钢	11,200	63,056.00	0.03
157	300529	健帆生物	2,300	62,583.00	0.02
158	603712	七一二	3,300	60,027.00	0.02
159	603883	老百姓	3,250	59,670.00	0.02
160	000009	中国宝安	6,900	59,340.00	0.02
161	603093	南华期货	6,800	58,888.00	0.02
162	600968	海油发展	14,200	58,504.00	0.02
163	688375	国博电子	824	58,207.36	0.02
164	002064	华峰化学	8,100	58,077.00	0.02
165	003022	联泓新科	4,200	57,582.00	0.02
166	600663	陆家嘴	6,500	57,330.00	0.02
167	600499	科达制造	6,800	57,324.00	0.02
168	688772	珠海冠宇	3,800	56,620.00	0.02
169	601113	华鼎股份	17,000	55,760.00	0.02
170	002653	海思科	1,800	55,260.00	0.02
171	002203	海亮股份	6,800	54,264.00	0.02
172	600566	济川药业	1,700	53,907.00	0.02
173	688779	长远锂科	11,600	53,708.00	0.02
174	002273	水晶光电	3,100	52,638.00	0.02
175	688349	三一重能	2,100	52,164.00	0.02
176	603737	三棵树	1,400	50,778.00	0.02
177	002557	洽洽食品	1,800	50,742.00	0.02
178	600801	华新水泥	3,600	49,500.00	0.02
179	001203	大中矿业	5,100	49,011.00	0.02
180	603728	鸣志电器	1,200	48,276.00	0.02
181	688063	派能科技	1,200	47,652.00	0.02
182	600282	南钢股份	9,500	47,310.00	0.02
183	601636	旗滨集团	7,200	46,440.00	0.02

184	603233	大参林	3,200	45,760.00	0.02
185	300677	英科医疗	1,700	45,577.00	0.02
186	600673	东阳光	6,400	45,056.00	0.02
187	601198	东兴证券	5,100	40,596.00	0.02
188	603517	绝味食品	2,600	40,040.00	0.02
189	300682	朗新集团	4,500	38,295.00	0.02
190	600928	西安银行	11,300	36,951.00	0.01
191	601216	君正集团	9,500	35,055.00	0.01
192	688032	禾迈股份	298	34,204.44	0.01
193	002531	天顺风能	3,800	33,972.00	0.01
194	600871	石化油服	19,500	33,930.00	0.01
195	603238	诺邦股份	3,400	33,864.00	0.01
196	600352	浙江龙盛	3,800	32,642.00	0.01
197	000589	贵州轮胎	6,400	32,448.00	0.01
198	600299	安迪苏	3,300	32,010.00	0.01
199	000523	红棉股份	12,200	31,598.00	0.01
200	002423	中粮资本	4,200	31,458.00	0.01
201	688153	唯捷创芯	800	29,600.00	0.01
202	000031	大悦城	12,300	28,782.00	0.01
203	688425	铁建重工	7,800	28,704.00	0.01
204	600578	京能电力	8,800	28,512.00	0.01
205	000027	深圳能源	3,900	28,470.00	0.01
206	688276	百克生物	1,000	28,370.00	0.01
207	002831	裕同科技	1,100	28,149.00	0.01
208	000997	新大陆	2,000	27,820.00	0.01
209	600737	中粮糖业	2,800	26,852.00	0.01
210	600827	百联股份	3,500	25,830.00	0.01
211	600177	雅戈尔	3,500	24,920.00	0.01
212	688209	英集芯	2,000	24,820.00	0.01
213	000987	越秀资本	5,000	24,800.00	0.01
214	002563	森马服饰	4,200	24,402.00	0.01

215	002266	浙富控股	8,600	23,994.00	0.01
216	600066	宇通客车	900	23,220.00	0.01
217	000728	国元证券	3,800	23,028.00	0.01
218	000513	丽珠集团	600	22,326.00	0.01
219	000800	一汽解放	2,800	21,924.00	0.01
220	603680	今创集团	3,300	21,780.00	0.01
221	601727	上海电气	5,800	21,460.00	0.01
222	603707	健友股份	1,800	21,384.00	0.01
223	600126	杭钢股份	5,100	20,961.00	0.01
224	600970	中材国际	1,700	20,502.00	0.01
225	300558	贝达药业	600	19,530.00	0.01
226	601158	重庆水务	4,000	19,200.00	0.01
227	601828	美凯龙	7,500	19,125.00	0.01
228	000559	万向钱潮	4,200	18,732.00	0.01
229	000887	中鼎股份	1,500	18,360.00	0.01
230	600893	航发动力	500	18,275.00	0.01
231	601168	西部矿业	1,000	17,950.00	0.01
232	600271	航天信息	2,400	17,664.00	0.01
233	600258	首旅酒店	1,400	17,290.00	0.01
234	000652	泰达股份	5,700	16,986.00	0.01
235	600500	中化国际	4,100	14,309.00	0.01
236	000526	学大教育	200	12,320.00	0.00
237	002439	启明星辰	700	12,082.00	0.00
238	603179	新泉股份	300	11,772.00	0.00
239	600027	华电国际	1,400	9,716.00	0.00
240	600528	中铁工业	1,100	8,052.00	0.00
241	688777	中控技术	200	7,540.00	0.00
242	603185	弘元绿能	400	6,836.00	0.00
243	600626	申达股份	2,700	6,534.00	0.00
244	601231	环旭电子	400	6,420.00	0.00
245	600023	浙能电力	900	6,399.00	0.00

246	601990	南京证券	700	5,376.00	0.00
247	601298	青岛港	500	4,780.00	0.00
248	000600	建投能源	700	4,410.00	0.00
249	002078	太阳纸业	300	4,185.00	0.00
250	002945	华林证券	400	3,992.00	0.00
251	600315	上海家化	200	3,556.00	0.00
252	301165	锐捷网络	100	2,984.00	0.00
253	002299	圣农发展	100	1,364.00	0.00
254	600598	北大荒	100	1,249.00	0.00
255	600269	赣粤高速	200	1,034.00	0.00

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	002203	海亮股份	3,063,605.00	0.74
2	000725	京东方A	2,846,708.00	0.68
3	600739	辽宁成大	2,755,744.00	0.66
4	688819	天能股份	2,471,478.43	0.59
5	002044	美年健康	2,361,164.00	0.57
6	600967	内蒙一机	2,319,673.00	0.56
7	600918	中泰证券	2,307,657.00	0.56
8	600637	东方明珠	2,254,560.00	0.54
9	600050	中国联通	2,204,904.00	0.53
10	000166	申万宏源	2,029,594.00	0.49
11	603225	新凤鸣	2,028,977.00	0.49
12	601019	山东出版	2,007,788.00	0.48
13	000030	富奥股份	2,001,472.00	0.48
14	002152	广电运通	1,994,841.00	0.48

15	605222	起帆电缆	1,947,438.00	0.47
16	600999	招商证券	1,924,865.80	0.46
17	601727	上海电气	1,917,506.00	0.46
18	601609	金田股份	1,907,210.00	0.46
19	600909	华安证券	1,875,150.00	0.45
20	002532	天山铝业	1,870,835.00	0.45

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	600967	内蒙一机	3,703,786.00	0.89
2	002064	华峰化学	3,506,757.00	0.84
3	600918	中泰证券	3,200,469.00	0.77
4	002203	海亮股份	3,004,514.00	0.72
5	600739	辽宁成大	2,994,118.00	0.72
6	601019	山东出版	2,790,397.00	0.67
7	601577	长沙银行	2,603,638.00	0.63
8	600637	东方明珠	2,557,797.00	0.62
9	002044	美年健康	2,337,121.00	0.56
10	601311	骆驼股份	2,320,856.60	0.56
11	600998	九州通	2,252,085.26	0.54
12	603225	新凤鸣	2,218,845.00	0.53
13	601609	金田股份	2,075,135.00	0.50
14	300001	特锐德	2,073,966.00	0.50
15	000166	申万宏源	2,072,579.00	0.50
16	600459	贵研铂业	2,056,558.00	0.49
17	000725	京东方A	1,991,711.00	0.48
18	601607	上海医药	1,986,640.00	0.48
19	000960	锡业股份	1,950,847.00	0.47

20	000089	深圳机场	1,926,107.00	0.46
----	--------	------	--------------	------

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	399,076,928.43
卖出股票收入（成交）总额	418,069,963.53

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	117,745,811.20	46.70
	其中：政策性金融债	51,484,874.82	20.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	134,490,513.12	53.34
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	252,236,324.32	100.03

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	092280080	22光大银行二级资本债01A	200,000	21,092,043.72	8.36
2	2128016	21民生银行永续债01	200,000	20,923,830.1	8.30

				4	
3	102481687	24洛阳城乡MTN001	200,000	20,234,338.63	8.02
4	240301	24进出01	200,000	20,217,956.28	8.02
5	240205	24国开05	160,000	16,630,002.19	6.60

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投资。

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

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行处罚。交通银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行处罚。光大银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。民生银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。中国进出口银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。青岛银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。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基金合同的要求。其他主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期内，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。

7.12.3 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	19,620.30
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,172.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,792.86

7.12.4 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。

7.12.5 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的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§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

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
22,010	10,319.28	157,525,230.68	69.36%	69,602,191.88	30.64%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	73,150.37	0.03%
------------------	-----------	-------

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	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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年05月08日)基金份额总额	350,071,562.96
本报告期期初基金份额总额	376,872,717.90
本报告期基金总申购份额	3,398,459.74
减：本报告期基金总赎回份额	153,143,755.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	227,127,422.56

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金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

基金管理人本报告期内重大人事变动情况：本报告期内，孙小妹女士于2024年4月19日就任公司财务负责人，李莹女士于2024年6月18日就任公司总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日起至今聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 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，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	817,146,891.96	100.00%	200,923.88	100.00%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-

注：1.公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

- （1）基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；
- （2）公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；
- （3）研究服务实力。

2.券商及交易单元的选择流程如下：

（1）权益投资部根据日常券商研究服务情况提议开立（含首次开立和新增开立）或关闭相关席位，挑选时应考虑在证券交易所都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；

（2）总经理办公会负责审批、确定券商席位的首次开立事宜，投资决策委员会负责审

批券商除首次开立以外新增及关闭席位事宜；

(3) 券商名单及相应的席位租用安排确定后,权益投资部负责协调办理咨询服务协议或研究服务协议签署等相关事宜,集中交易部负责协调办理正式租用席位协议签署等相关事宜。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	2,040,408.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024-03-21
2	中加科丰价值精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2024-03-21
3	中加科丰价值精选混合型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024-03-28
4	中加科丰价值精选混合型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-19
5	中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024-06-20

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240101-20240630	94,055,587.36	0.00	0.00	94,055,587.36	41.41%
	2	20240101-20240630	80,508,191.39	0.00	30,000,000.00	50,508,191.39	22.24%
产品特有风险							
本基金报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该投资者所持有的基金份额的占比较大，该投资者在赎回所持有的基金份额时，存在基金份额净值波动的风险；另外，该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时，基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录**12.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会批准中加科丰价值精选混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加科丰价值精选混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

基金管理人处

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：www.bobbns.com

中加基金管理有限公司
二〇二四年八月二十九日