

中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型  
证券投资基金  
2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	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 .....	44
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 .....	44
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 .....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
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 .....	46
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	48
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</b>
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 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中金鑫瑞优选一年持有期
基金主代码	011703
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 7 月 13 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	213,081,821.84 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过把握债券、股票市场的投资机会，在控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”的分析方法，长期通过战略资产配置，利用股债长期负相关特征获取相对稳定的收益，中短期根据内部股债相对风险溢价和预期收益模型，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。严控信用风险，不过多下沉信用；股票投资追求安全边际，慎用衍生品。具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、普通债券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、可交换债券投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、证券公司短期公司债券投资策略；9、国债期货投资策略；10、股指期货投资策略；11、股票期权投资策略；12、融资业务投资策略；13、信用衍生品投资策略。详见《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×5%+中债-综合全价（总值）指数收益率×55%。
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。

### 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
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com
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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4

	国贸大厦 B 座 43 层	楼
邮政编码	100004	200120
法定代表人	胡长生	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	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-34,825,078.70
本期利润	-25,275,759.87
加权平均基金份额本期利润	-0.1188
本期加权平均净值利润率	-14.80%
本期基金份额净值增长率	-12.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-47,806,277.78
期末可供分配基金份额利润	-0.2244
期末基金资产净值	180,368,329.52
期末基金份额净值	0.8465
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-15.35%

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

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

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

4、本基金合同生效日为 2021 年 7 月 13 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

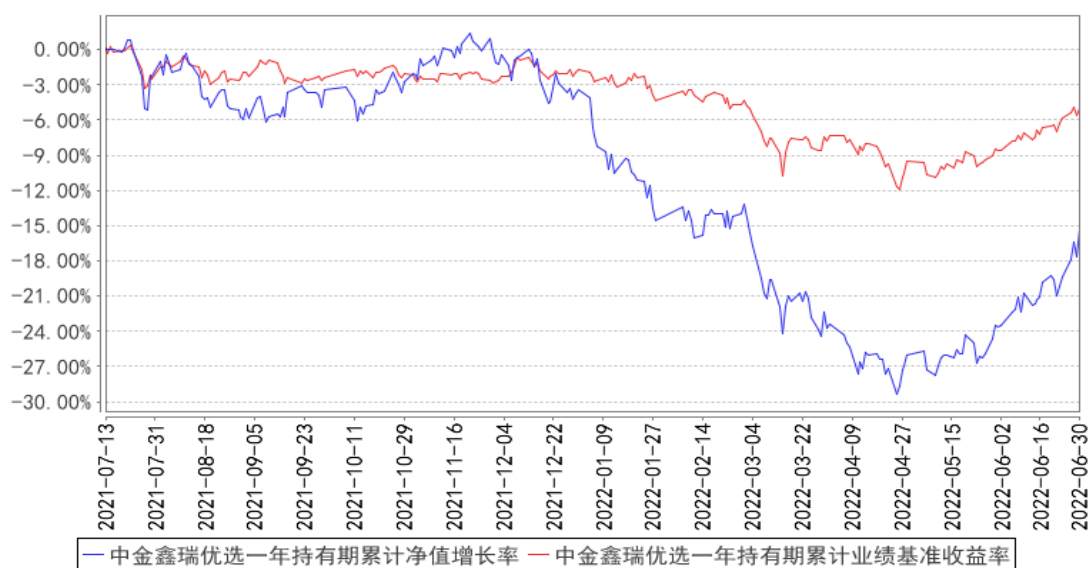
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	10.74%	1.26%	3.79%	0.49%	6.95%	0.77%
过去三个月	11.03%	1.29%	3.02%	0.64%	8.01%	0.65%
过去六个月	-12.33%	1.39%	-3.35%	0.66%	-8.98%	0.73%
自基金合同生效起至今	-15.35%	1.19%	-5.03%	0.56%	-10.32%	0.63%

#### 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

中金鑫瑞优选一年持有期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 2021 年 07 月 13 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。建仓期结束时及本报告期末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 5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 41 只公募基金，证券投资基金管理规模 914.35 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		
邱延冰	本基金基金经理、中金基金管理有限公司副总经理	2021 年 7 月 13 日	-	19 年	邱延冰先生，经济学博士。历任国家外汇管理局中央外汇业务中心战略研究处研究员，投资一处投资经理，投资二处副处长、处长（期间外派中国华安投资有限公司，担任副总经理兼投资部总监）；丝路基金有限责任公司投资决策委员会委员、研究部副总监（主持工作）；和泰人寿保险股份有限公司总经理助理（兼资产管理部总经理）、董事会秘书。现任中金基金管理有限公司副总经理、基金经理。
李滋源	本基金基金经理助理	2021 年 7 月 19 日	2022 年 4 月 22 日	3 年	李滋源先生，工程理学硕士。曾任中金基金管理有限公司组合投资部研究员、权益部基金经理助理。

注：1、上述基金经理任职日期为本基金基金合同生效日；上述基金经理助理的任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投



资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，A 股面临的内外部各种不确定性大幅上升，行情呈现先抑后扬走势。具体而言，1-4 月国内经济基本面和企业盈利受疫情反复影响趋势走弱，俄乌战争和美联储加息预期升温很大程度上降低了市场风险偏好，4 月底各类负面因素对 A 股的负面冲击集中体现后，市场在 5、6 月份拾级向上，反弹过程中，前期股价跌幅较深的成长股，如光伏、新能源车等表现十分突出。

为应对市场变化、改善投资业绩，本基金在坚守一直以来的投资框架和理念的基础上，于 4 月初对投资策略做出适当调整。基金经理认为，全球经济衰退的风险有所升高，在此环境下，构建投资组合不应片面追求高收益，而应追求相对韧性，通过更稳健的资产配置，寻求在市场波动期间获利。二季度，基金经理降低了在制造业的配置和在中小市值个股上的持仓，将投资风格朝以内需大消费板块为代表的高质量方向集中（注：“高质量风格”，指倾向于投资商业模式过硬、竞争壁垒高的上市公司，这些公司一般有高 ROE 和充沛的自由现金流），同时适当提升行业与个股集中度，并降低组合换手率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金的份额净值为 0.8465 元；本报告期基金份额净值增长率为-12.33%，业绩比较基准收益率为-3.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，基金经理对 A 股市场后市表现继续持中性观点，计划在核心持仓上坚持把握投资标的的韧性。基本上，7 月底政治局会议标志着政策面由松转稳，加上全球经济衰退风险，A 股面临的不确定性有所上升，但鉴于估值方面 A 股整体估值处于合理水平，基金经理对于后市 A 股并不悲观。在行业配置上，基金经理将重点围绕当前性价比较高的内需大消费板块做布局，也会适度围绕中国制造业全球比较优势和产业升级逻辑进行投资。

自下而上，基金经理将继续坚持研究企业的市场空间、竞争格局、商业模式和盈利的可持续性，遴选通过技术领先优势、成本控制能力、渠道力和品牌力等构筑出很深“护城河”的企业进行重点投资。

#### 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》、《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。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、投研部门、基金运营部、风险管理部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。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，本报告期内未实施利润分配。

#### 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量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《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合规守信、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：中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	23,677,349.19	26,210,901.71
结算备付金		1,214,395.91	2,519,621.48
存出保证金		104,460.34	91,159.69
交易性金融资产	6.4.7.2	155,800,772.14	156,122,651.30
其中：股票投资		155,148,477.95	156,122,651.30
基金投资		-	-
债券投资		652,294.19	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		34,842.81	20,782,265.76
应收股利		-	-

应收申购款		41,049.36	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	111,196.04
资产总计		180,872,869.75	205,837,795.98
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.47	0.50
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		207,668.98	265,292.72
应付托管费		34,611.51	44,215.47
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.02	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	262,256.25	462,410.33
负债合计		504,540.23	771,919.02
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	213,081,821.84	212,364,935.89
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-32,713,492.32	-7,299,058.93
净资产合计		180,368,329.52	205,065,876.96
负债和净资产总计		180,872,869.75	205,837,795.98

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8465 元，基金份额总额 213,081,821.84 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-23,698,269.90
1. 利息收入		170,203.07
其中：存款利息收入	6.4.7.13	65,839.47
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		104,363.60
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-33,417,791.80
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-34,981,784.29
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	81,984.62
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	1,482,007.87
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）	6.4.7.20	9,549,318.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-
<b>减：二、营业总支出</b>		1,577,489.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,273,232.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	212,205.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		0.99
8. 其他费用	6.4.7.23	92,050.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-25,275,759.87
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-25,275,759.87
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-25,275,759.87

注：本基金合同生效日为 2021 年 7 月 13 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	212,364,935.89	-	-7,299,058.93	205,065,876.96
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	212,364,935.89	-	-7,299,058.93	205,065,876.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	716,885.95	-	-25,414,433.39	-24,697,547.44
(一)、综合收益总额	-	-	-25,275,759.87	-25,275,759.87
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	716,885.95	-	-138,673.52	578,212.43
其中:1.基金申购款	716,885.95	-	-138,673.52	578,212.43
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额	-	-	-	-

额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	213,081,821.84	-	-32,713,492.32	180,368,329.52

注：本基金合同生效日为 2021 年 7 月 13 日，无上年度可比期间数据。

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：

<u>孙菁</u>	二	<u>白娜</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置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 2021 年 1 月 8 日证监许可[2021]28 号文注册,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、《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置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、中金基金网上直销平台、兴业银行、安信证券股份有限公司、渤海银行股份有限公司及东方财富证券股份有限公司等共同销售,募集期为 2021 年 6 月 7 日起至 2021 年 7 月 9 日。经向中国证监会备案,《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基

金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2021 年 7 月 13 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 211,861,569.68 份(含利息转份额 115,555.57 份),发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行上市的股票)、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、债券(包括国债、央行、票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转换债券的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券、政府支持债券)、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、银行存款、同业存单、国债期货、股指期货、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)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,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要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外,本基金报告期所采用的会计政策、其他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

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和



2022 年中国证监会发布的修订的《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〉》。

#### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1)以摊余成本计量的金融资产；(2)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 156,122,651.30 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 156,122,651.30 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结

算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b)修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号)、财税[2014]81 号文《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(2)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下简称“营改增”)

试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

(4)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，其股息红利所得暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深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。基金通过沪港通/深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。

(5)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。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6)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。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	23,677,349.19
等于: 本金	23,675,281.59
加: 应计利息	2,067.60
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	23,677,349.19

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	140,219,338.59	-	155,148,477.95	14,929,139.36
贵金属投资-金交所	-	-	-	-

黄金合约					
债券	交易所市场	466,700.00	220.95	652,294.19	185,373.24
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	466,700.00	220.95	652,294.19	185,373.24
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	140,686,038.59	220.95	155,800,772.14	15,114,512.60	

#### 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 2022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	170,516.40
其中：交易所市场	170,516.40
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,739.85
合计	262,256.25

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	212,364,935.89	212,364,935.89
本期申购	716,885.95	716,885.95
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	213,081,821.84	213,081,821.84

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-12,864,726.85	5,565,667.92	-7,299,058.93
本期利润	-34,825,078.70	9,549,318.83	-25,275,759.87
本期基金份额交易产生的变动数	-116,472.23	-22,201.29	-138,673.52
其中：基金申购款	-116,472.23	-22,201.29	-138,673.52
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-47,806,277.78	15,092,785.46	-32,713,492.32

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	51,223.78
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	13,732.41
其他	883.28
合计	65,839.47

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-34,981,784.29
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	-34,981,784.29

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	228,110,130.76
减：卖出股票成本总额	262,465,803.67
减：交易费用	626,111.38
买卖股票差价收入	-34,981,784.29

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票出借差价收入。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	273.13
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	81,711.49
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	81,984.62

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	377,772.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	296,000.00
减：应计利息总额	60.34
减：交易费用	0.37
买卖债券差价收入	81,711.49

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持申购差价收入。



**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无其他衍生工具投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,482,007.87
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,482,007.87

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	9,549,318.83
股票投资	9,363,945.59
债券投资	185,373.24
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	9,549,318.83

#### 6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
划款手续费	230.00
其他	81.13
合计	92,050.98

#### 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、基金销售机构
兴业银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（“中金财富证券”，原“中国中投证券有限责任公司”）	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 2022年1月1日至2022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	476,299,484.39	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 2022年1月1日至2022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	377,772.20	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 2022年1月1日至2022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	1,052,000,000.00	100.00

###### 6.4.10.1.4 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。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022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	348,319.77	100.00	170,516.40	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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,273,232.52
其中：支付销售机构的客户维护费	451,136.23

注：1、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 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数；

2、本基金合同生效日为 2021 年 7 月 13 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	212,205.48

注：1、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 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数；

2、本基金合同生效日为 2021 年 7 月 13 日，无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期无销售服务费。

### 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

本基金在本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

## 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

## 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 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	23,677,349.19	51,223.78

注：1、本基金的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；

2、本基金合同生效日为2021年7月13日，无上年度可比期间数据。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
中金公司	688225	亚信安全	网下	2,115	64,528.65
中金公司	688282	理工导航	网下	1,176	76,686.96
中金公司	301216	万凯新材	网下	1,865	66,543.20
中金公司	688295	中复神鹰	网下	2,600	76,258.00
中金公司	688125	安达智能	网下	1,509	91,369.95
中金公司	600938	中国海油	网上	3,000	32,400.00
中金公司	301150	中一科技	网下	399	65,260.44
中金公司	603206	嘉环科技	网下	1,210	17,581.30
中金公司	688400	凌云光	网下	2,938	64,430.34

注：本基金基金合同生效日为2021年7月13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

无。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

## 6.4.12 期末(2022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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

301102	兆讯传媒	2022年 3月15日	6个月	新股流 通受限	39.88	31.09	184	7,337.92	5,720.56	-
301103	何氏眼科	2022年 3月14日	6个月	新股流 通受限	32.67	32.02	186	6,077.50	5,955.72	数量包含 期间送股
301109	军信股份	2022年 4月6日	6个月	新股流 通受限	23.24	16.14	367	8,528.45	5,923.38	数量包含 期间送股
301110	青木股份	2022年 3月4日	6个月	新股流 通受限	63.10	39.85	96	6,057.60	3,825.60	-
301120	新特电气	2022年 4月11日	6个月	新股流 通受限	13.73	15.49	729	10,009.17	11,292.21	-
301130	西点药业	2022年 2月16日	6个月	新股流 通受限	22.55	37.70	227	5,118.85	8,557.90	-
301135	瑞德智能	2022年 4月1日	6个月	新股流 通受限	31.98	26.26	190	6,076.20	4,989.40	-
301137	哈焊华通	2022年 3月14日	6个月	新股流 通受限	15.37	15.99	412	6,332.44	6,587.88	-
301139	元道通信	2022年 6月30日	1个月 内(含)	新股流 通受限	38.46	38.46	1,830	70,381.80	70,381.80	-
301139	元道通信	2022年 6月30日	6个月	新股流 通受限	38.46	38.46	204	7,845.84	7,845.84	-
301148	嘉戎技术	2022年 4月14日	6个月	新股流 通受限	38.39	23.90	219	8,407.41	5,234.10	-
301150	中一科技	2022年 4月14日	6个月	新股流 通受限	109.04	82.76	60	6,542.40	4,965.60	数量包含 期间送股
301151	冠龙节能	2022年 3月30日	6个月	新股流 通受限	30.82	21.46	211	6,503.02	4,528.06	-
301163	宏德股份	2022年 4月11日	6个月	新股流 通受限	26.27	32.33	249	6,541.23	8,050.17	-
301187	欧圣电气	2022年 4月13日	6个月	新股流 通受限	21.33	22.54	392	8,361.36	8,835.68	-
301200	大族数控	2022年 2月18日	6个月	新股流 通受限	76.56	51.92	120	9,187.20	6,230.40	-

		日									
301215	中汽股份	2022年 2月28 日	6个月	新股流 通受限	3.80	6.39	2,119	8,052.20	13,540.41		-
301216	万凯新材	2022年 3月21 日	6个月	新股流 通受限	35.68	29.84	187	6,672.16	5,580.08		-
301219	腾远钴业	2022年 3月10 日	6个月	新股流 通受限	97.67	87.82	57	5,567.36	5,005.74	数量包含 期间送股	-
301222	浙江恒威	2022年 3月2日	6个月	新股流 通受限	33.98	28.96	184	6,252.32	5,328.64		-
301233	盛帮股份	2022年 6月24 日	1个月 内(含)	新股流 通受限	41.52	41.52	1,312	54,474.24	54,474.24		-
301233	盛帮股份	2022年 6月24 日	6个月	新股流 通受限	41.52	41.52	146	6,061.92	6,061.92		-
301236	软通动力	2022年 3月8日	6个月	新股流 通受限	48.69	31.38	229	11,150.64	7,186.02	数量包含 期间送股	-
301237	和顺科技	2022年 3月16 日	6个月	新股流 通受限	56.69	41.86	114	6,462.66	4,772.04		-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22 日	1个月 内(含)	新股流 通受限	33.65	33.65	1,853	62,353.45	62,353.45		-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22 日	6个月	新股流 通受限	33.65	33.65	206	6,931.90	6,931.90		-
301256	华融化学	2022年 3月14 日	6个月	新股流 通受限	8.05	10.08	757	6,093.85	7,630.56		-
301258	富士莱	2022年 3月21 日	6个月	新股流 通受限	48.30	41.68	111	5,361.30	4,626.48		-
301263	泰恩康	2022年 3月22 日	6个月	新股流 通受限	19.93	31.38	300	5,979.00	9,414.00		-
301279	金道科技	2022年 4月6日	6个月	新股流 通受限	31.20	22.81	182	5,678.40	4,151.42		-
301288	清研环境	2022年 4月14 日	6个月	新股流 通受限	19.09	19.98	441	8,418.69	8,811.18		-
688153	唯捷创芯	2022年	6个月	新股流	66.60	44.24	1,357	90,376.20	60,033.68		-

		4月1日		通受限						
688237	超卓航科	2022年 6月24 日	6个月	新股流 通受限	41.27	41.27	1,557	64,257.39	64,257.39	-
688400	凌云光	2022年 6月27 日	1个月 内(含)	新股流 通受限	21.93	21.93	2,938	64,430.34	64,430.34	-

#### 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末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高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制 在合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。



### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

#### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	652,294.19	-
未评级	-	-
合计	652,294.19	-

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 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	23,675,281.59			2,067.60	23,677,349.19
结算备付金	1,213,849.71			546.20	1,214,395.91
存出保证金	104,413.34			47.00	104,460.34
交易性金融资产-股票投资				155,148,477.95	155,148,477.95
交易性金融资产-债	-	-	652,073.24	220.95	652,294.19

券投资、资产支持证券					
买入返售金融资产	-				-
应收证券清算款				34,842.81	34,842.81
应收股利				-	-
其他资产				-	-
应收申购款				41,049.36	41,049.36
资产总计	24,993,544.64	-	652,073.24	155,227,251.87	180,872,869.75
负债					
卖出回购金融资产款	-				-
应付证券清算款				0.47	0.47
应付赎回款				-	-
应付管理人报酬				207,668.98	207,668.98
应付托管费				34,611.51	34,611.51
应付销售服务费				-	-
应交税费				3.02	3.02
其他负债				262,256.25	262,256.25
负债总计	-	-	-	504,540.23	504,540.23
利率敏感度缺口	24,993,544.64	-	652,073.24	154,722,711.64	180,368,329.52
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	26,210,901.71	-	-	-	26,210,901.71
结算备付金	2,519,621.48	-	-	-	2,519,621.48
存出保证金	91,159.69	-	-	-	91,159.69
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	156,122,651.30	156,122,651.30
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	20,782,265.76	20,782,265.76
应收利息	-	-	-	-4,359.53	-4,359.53
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	115,555.57	115,555.57
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	28,821,682.88	-	-	177,016,113.10	205,837,795.98
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	0.50	0.50
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	265,292.72	265,292.72
应付托管费	-	-	-	44,215.47	44,215.47
应付交易费用	-	-	-	312,410.33	312,410.33

应付销售服务费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
其他负债	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	771,919.02	771,919.02
利率敏感度缺口	28,821,682.88	-	-176,244,194.08	205,065,876.96

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.36%，上年度末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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 2022年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	2,151,099.77	-	2,151,099.77
资产合计	-	2,151,099.77	-	2,151,099.77
以外币计价的 负债				
应付证券清算 款	-	0.47	-	0.47
负债合计	-	0.47	-	0.47
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	2,151,099.30	-	2,151,099.30
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币元	折合人民币元	折合人民币元	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	2,425,532.71	-	2,425,532.71
资产合计	-	2,425,532.71	-	2,425,532.71
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	0.50	-	0.50
负债合计	-	0.50	-	0.50
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,425,532.21	-	2,425,532.21

#### 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。		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	港币相对人民币升值 5%	107,554.97	121,276.61
	港币相对人民币贬值 5%	-107,554.97	-121,276.61

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。

本基金部分投资于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 2022年6月30日		上年度末 2021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	155,148,477.95	86.02	156,122,651.30	76.13
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	155,148,477.95	86.02	156,122,651.30	76.13

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	-	-
	业绩比较基准下降5%	-	-

注：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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	155,237,258.35	156,122,651.30
第二层次	336,736.88	-
第三层次	226,776.91	-
合计	155,800,772.14	156,122,651.30

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

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

## 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末无非持续的以公允价值计量的金融工具。

## 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	155,148,477.95	85.78
	其中：股票	155,148,477.95	85.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	652,294.19	0.36
	其中：债券	652,294.19	0.36

	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	24,891,745.10	13.76
8	其他各项资产	180,352.51	0.10
9	合计	180,872,869.75	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 2,151,099.77 元，占基金资产净值比例为 1.19%。

## 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	-	-
B	采矿业	4,871,588.00	2.70
C	制造业	143,364,450.53	79.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,414.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	781,348.00	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,520,399.26	1.95
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,720.56	0.00
M	科学研究和技术服务业	358,059.28	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	11,157.48	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	75,241.07	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	152,997,378.18	84.82

### 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	2,151,099.77	1.19
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	2,151,099.77	1.19

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	600519	贵州茅台	6,800	13,906,000.00	7.71
2	600132	重庆啤酒	83,800	12,285,080.00	6.81
3	002304	洋河股份	63,900	11,703,285.00	6.49
4	000858	五粮液	56,349	11,378,553.57	6.31
5	002271	东方雨虹	207,067	10,657,738.49	5.91
6	603369	今世缘	190,600	9,720,600.00	5.39
7	603288	海天味业	101,838	9,202,081.68	5.10
8	002129	TCL 中环	152,100	8,957,169.00	4.97
9	600887	伊利股份	211,000	8,218,450.00	4.56
10	300725	药石科技	81,038	8,021,951.62	4.45
11	601058	赛轮轮胎	660,700	7,446,089.00	4.13
12	000568	泸州老窖	30,200	7,445,508.00	4.13
13	300751	迈为股份	10,000	4,909,000.00	2.72
14	600256	广汇能源	462,200	4,871,588.00	2.70
15	002594	比亚迪	11,400	3,801,786.00	2.11
16	603517	绝味食品	63,400	3,665,788.00	2.03
17	002241	歌尔股份	104,600	3,514,560.00	1.95
18	600406	国电南瑞	127,080	3,431,160.00	1.90
19	688305	科德数控	36,724	2,804,611.88	1.55
20	000657	中钨高新	177,000	2,655,000.00	1.47
21	09992	泡泡玛特	66,368	2,151,099.77	1.19
22	603916	苏博特	64,900	1,654,301.00	0.92
23	002430	杭氧股份	26,200	819,012.00	0.45
24	002120	韵达股份	45,800	781,348.00	0.43
25	603259	药明康德	3,313	344,518.87	0.19
26	688349	三一重能	3,265	133,048.75	0.07
27	301139	元道通信	2,034	78,227.64	0.04

28	301239	普瑞眼科	2,059	69,285.35	0.04
29	688400	凌云光	2,938	64,430.34	0.04
30	688237	超卓航科	1,557	64,257.39	0.04
31	301233	盛帮股份	1,458	60,536.16	0.03
32	688153	唯捷创芯	1,357	60,033.68	0.03
33	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.03
34	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
35	301215	中汽股份	2,119	13,540.41	0.01
36	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
37	301120	新特电气	729	11,292.21	0.01
38	301263	泰恩康	300	9,414.00	0.01
39	301187	欧圣电气	392	8,835.68	0.00
40	301288	清研环境	441	8,811.18	0.00
41	301130	西点药业	227	8,557.90	0.00
42	301163	宏德股份	249	8,050.17	0.00
43	301256	华融化学	757	7,630.56	0.00
44	301236	软通动力	229	7,186.02	0.00
45	301137	哈焊华通	412	6,587.88	0.00
46	301200	大族数控	120	6,230.40	0.00
47	301103	何氏眼科	186	5,955.72	0.00
48	301109	军信股份	367	5,923.38	0.00
49	301102	兆讯传媒	184	5,720.56	0.00
50	301216	万凯新材	187	5,580.08	0.00
51	301222	浙江恒威	184	5,328.64	0.00
52	301148	嘉戎技术	219	5,234.10	0.00
53	301219	腾远钴业	57	5,005.74	0.00
54	301135	瑞德智能	190	4,989.40	0.00
55	301150	中一科技	60	4,965.60	0.00
56	301237	和顺科技	114	4,772.04	0.00
57	301258	富士莱	111	4,626.48	0.00
58	301151	冠龙节能	211	4,528.06	0.00
59	301279	金道科技	182	4,151.42	0.00
60	301110	青木股份	96	3,825.60	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	600519	贵州茅台	11,961,181.00	5.83
2	002304	洋河股份	11,639,557.00	5.68
3	600132	重庆啤酒	10,019,574.00	4.89
4	002271	东方雨虹	9,538,918.11	4.65

5	002594	比亚迪	8,837,074.72	4.31
6	603288	海天味业	8,446,622.20	4.12
7	300750	宁德时代	8,436,510.00	4.11
8	300725	药石科技	7,836,985.47	3.82
9	600887	伊利股份	7,754,284.00	3.78
10	603259	药明康德	7,714,837.15	3.76
11	002371	北方华创	7,504,108.90	3.66
12	000858	五粮液	7,429,534.37	3.62
13	603517	绝味食品	7,386,565.64	3.60
14	603043	广州酒家	6,841,001.90	3.34
15	000596	古井贡酒	6,277,515.00	3.06
16	000568	泸州老窖	6,221,491.00	3.03
17	002129	TCL 中环	6,211,642.00	3.03
18	000333	美的集团	5,904,853.36	2.88
19	600276	恒瑞医药	5,885,460.56	2.87
20	002216	三全食品	5,451,468.50	2.66
21	603369	今世缘	4,958,931.02	2.42
22	300751	迈为股份	4,898,579.60	2.39
23	600660	福耀玻璃	4,788,491.00	2.34

#### 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	601012	隆基绿能	13,454,363.60	6.56
2	002594	比亚迪	10,431,771.00	5.09
3	600038	中直股份	9,246,871.00	4.51
4	603043	广州酒家	6,491,397.32	3.17
5	300750	宁德时代	6,423,852.26	3.13
6	603259	药明康德	6,396,536.00	3.12
7	000596	古井贡酒	6,383,711.00	3.11
8	002371	北方华创	6,255,797.75	3.05
9	002216	三全食品	5,631,882.20	2.75
10	603501	韦尔股份	5,532,368.00	2.70
11	002475	立讯精密	5,377,690.00	2.62
12	002013	中航机电	5,374,653.00	2.62
13	688536	思瑞浦	5,370,479.50	2.62
14	000887	中鼎股份	4,943,949.00	2.41
15	603517	绝味食品	4,617,154.00	2.25
16	300088	长信科技	4,526,854.00	2.21
17	000333	美的集团	4,487,226.00	2.19
18	000988	华工科技	4,257,934.00	2.08
19	600309	万华化学	3,807,753.05	1.86

20	002139	拓邦股份	3,788,831.36	1.85
----	--------	------	--------------	------

#### 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	252,127,684.73
卖出股票收入（成交）总额	228,110,130.76

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	652,294.19	0.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	652,294.19	0.36

#### 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	123145	药石转债	4,667	652,294.19	0.36

#### 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投资。

#### 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 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体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 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。

### 7.12.3 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	104,460.34
2	应收清算款	34,842.81
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	41,049.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	180,352.51

### 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股票。

### 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

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 (%)
2,495	85,403.54	98,933.23	0.05	212,982,888.61	99.95

### 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	22.02	0.00

### 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 7 月 13 日) 基金份额总额	211,861,569.68
本报告期期初基金份额总额	212,364,935.89
本报告期基金总申购份额	716,885.95
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	213,081,821.84

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金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

2022 年 6 月 21 日，本基金管理人发布公告，赵璧先生自 2022 年 6 月 20 日起担任公司副总经理、财务负责人，同日起不再担任公司督察长；席晓峰先生自 2022 年 6 月 20 日起担任公司督察长，同日起不再担任公司副总经理。

#### (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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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 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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

### 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 (%)	
中金财富证券	2	476,299,484.39	100.00	348,319.77	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服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- （1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- （2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中金财富证券	377,772.20	100.00	1,052,000,000.00	100.00	-	-

## 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	中金基金管理有限公司旗下公募基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-01-24
2	中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-24
3	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-27
4	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-11
5	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-22
6	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-29
7	中金基金管理有限公司旗下公募基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-03-31
8	中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-31
9	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-09
10	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-15
11	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-15
12	中金基金管理有限公司旗下公募基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
13	中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
14	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-23
15	中金基金管理有限公司关于变更基金经理助理的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-23



16	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	2022-06-21
17	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-28

## § 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鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、关于申请募集中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- 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、本报告期内在规定媒介上披露的有关中金鑫瑞优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金的各项公告
- 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

投资者营业时间内可到基金管理人和/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和复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

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

2022 年 8 月 31 日