

中金安心回报混合型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：华夏银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	42

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	44
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	45
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	45
10.8 其他重大事件	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金安心回报混合型证券投资基金	
基金简称	中金安心回报混合	
基金主代码	025771	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 11 月 17 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	151,550,803.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金安心回报混合 A	中金安心回报混合 C
下属分级基金的交易代码	025771	025772
报告期末下属分级基金的份额总额	57,266,954.24 份	94,283,849.57 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在综合分析国内外宏观经济和资本市场的基础上，通过定性和定量相结合的“自上而下”研究，形成对大类资产的预测，在基金合同约定的范围内确定债券、权益、现金等各类资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例。具体包括：1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、股票投资策略；4、可转换债券、可交换债券投资策略；5、信用衍生品投资策略；6、国债期货投资策略；7、股指期货投资策略；8、股票期权投资策略；9、融资业务投资策略；10、基金投资策略。详见《中金安心回报混合型证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中债新综合全价指数收益率×75%+中证 800 指数收益率×15%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×5%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金投资于港股通标的股票，还需面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰	赵伟婧
	联系电话	010-63211122	010-85237681
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	zhzsg@hxb.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95577
传真		010-66159121	010-85238680
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	北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号	北京市东城区建国门内大街 22

	国贸大厦 B 座 43 层	号 (100005)
邮政编码	100004	100005
法定代表人	李金泽	杨书剑

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金中期报告置备地点	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	中金安心回报混合 A	中金安心回报混合 C
本期已实现收益	3,035,444.48	4,340,227.58
本期利润	1,565,844.57	1,976,353.32
加权平均基金份额本期利润	0.0244	0.0198
本期加权平均净值利润率	2.06%	1.71%
本期基金份额净值增长率	1.83%	1.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	10,415,704.85	14,439,244.37
期末可供分配基金份额利润	0.1819	0.1531
期末基金资产净值	67,682,659.09	108,723,093.94
期末基金份额净值	1.1819	1.1531
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	2.24%	1.98%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

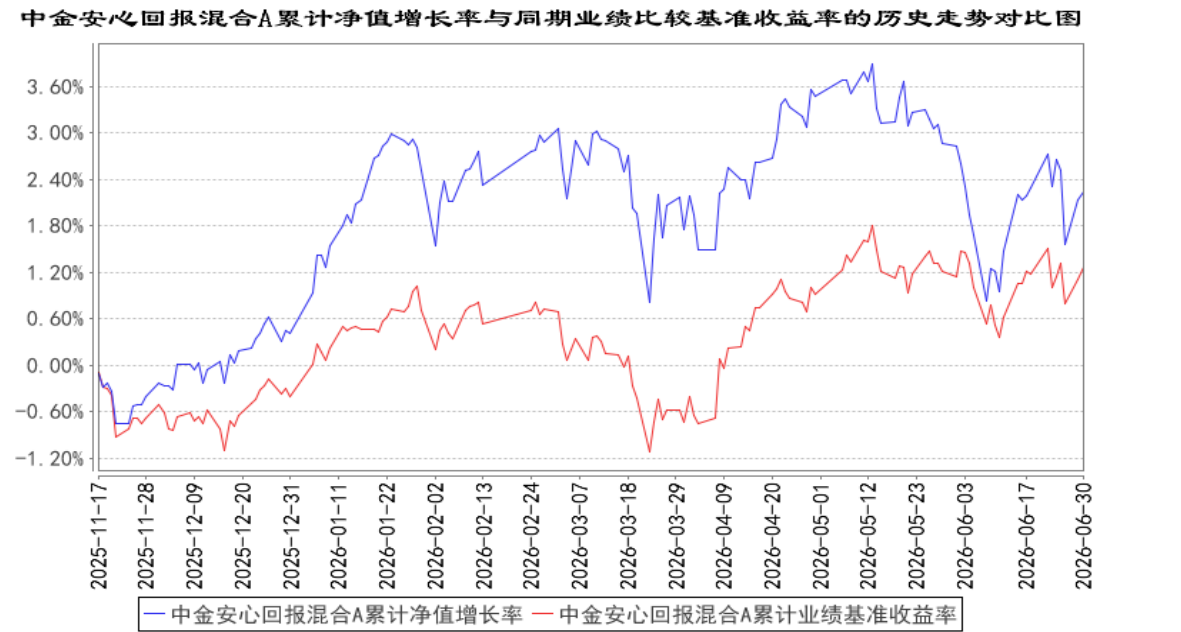
中金安心回报混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.48%	0.34%	2.02%	0.24%	-1.54%	0.10%
过去六个月	1.83%	0.35%	1.67%	0.23%	0.16%	0.12%
自基金合同生效起至今	2.24%	0.32%	1.26%	0.22%	0.98%	0.10%

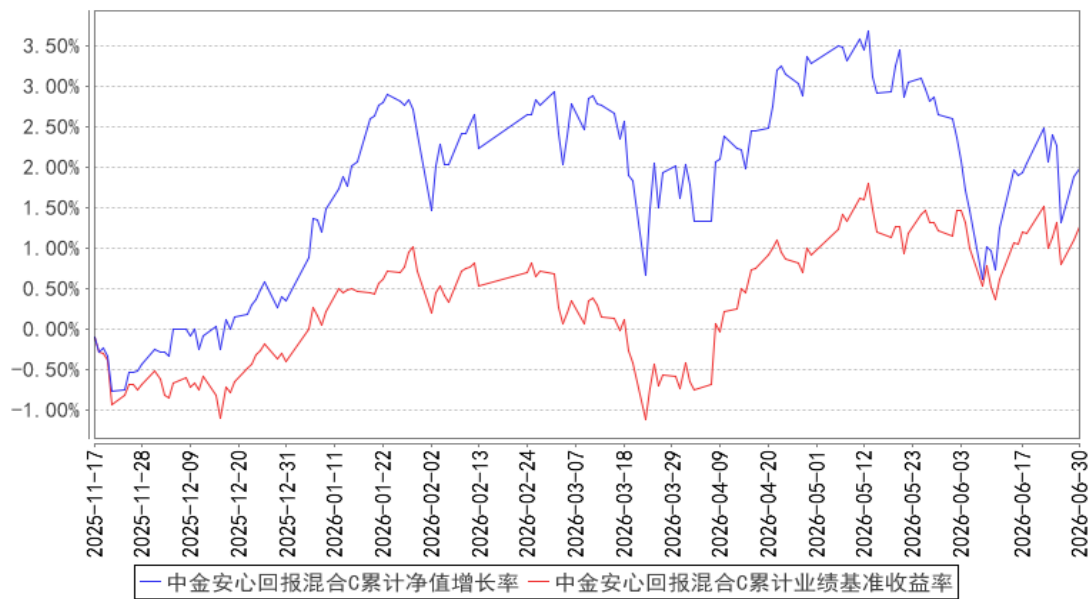
中金安心回报混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.37%	0.34%	2.02%	0.24%	-1.65%	0.10%
过去六个月	1.62%	0.35%	1.67%	0.23%	-0.05%	0.12%
自基金合同生效起至今	1.98%	0.32%	1.26%	0.22%	0.72%	0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



中金安心回报混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金由中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划变更而来，基金合同生效日为2025年11月17日。根据基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的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10亿元人民币。母公司中金公司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2026年6月30日，公司共管理79只公募基金，证券投资基金管理规模2,772.40亿元。

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		
于质冰	本基金基金经理	2025年11月17日	—	9年	于质冰先生，工程管理硕士。历任北京南车时代信息技术有限公司软件工程师；中钢期货股份有限公司研究员、投资经理；中钢鑫融贸易有限公司投资部投资总监；

					中信证券股份有限公司资产管理业务部权益投资经理。现任中金基金管理有限公司混合资产部基金经理。
丁杨	本基金基金经理	2025 年 11 月 17 日	-	10 年	丁杨先生，经济学硕士。历任蚂蚁集团分析师；中金基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理助理，权益部基金经理。现任中金基金管理有限公司混合资产部基金经理。
骆毅	本基金基金经理	2025 年 11 月 17 日	-	8 年	骆毅先生，北京师范大学本硕。历任国金基金管理有限公司交易部交易员；方正富邦基金管理有限公司固定收益基金投资部基金经理助理、基金经理。现任中金基金管理有限公司固定收益部基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人作出决定确定的任免日期填写；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

- 2、本基金无基金经理助理。
- 3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益行为。

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

2026 年上半年宏观经济在政策托底与新质生产力培育中延续总体平稳、向新向优的发展态势，国内生产总值按不变价格计算同比增长 4.7%。制造业投资保持韧性，规模以上工业增加值同比增长 5.4%，其中高技术制造业和装备制造业成为支撑工业增长的核心引擎。房地产市场仍处于调整期，全国房地产开发投资同比仍大幅下滑，但一线城市商品住宅销售价格出现环比上涨，市场出现边际改善信号。出口表现超预期强劲，机电产品出口支撑外贸结构优化。消费端受制于居民收入增长预期偏弱、储蓄意愿较高等因素，复苏动能温和。物价方面，CPI 同比上涨 1.0%，PPI 同比上涨 1.5%，GDP 平减指数三年来首次转正，企业盈利空间有所改善。

资金面方面，年初央行通过 MLF 增量投放、买断式逆回购等工具前置释放流动性，1 月中旬下调结构性货币政策工具利率 25BP，资金面延续宽松格局，DR001 曾下行至 1.2% 附近。进入 5 月至 6 月，央行“收长放短”，买断式逆回购连续缩量操作三个月，央行同步推进利率走廊机制改革，优化临时隔夜正逆回购工具，将利率走廊由 70BP 收窄至 50BP，推动资金利率围绕政策利率平稳运行。

债券市场方面，上半年债市整体呈现低波动、窄区间的特征，资金面持续宽松与“资产荒”格局贯穿始终，成为上半年最显著的预期差。10 年期国债收益率在 1.70% 至 1.90% 之间窄幅震荡，振幅较去年有所收窄。信用债整体跟随利率债波动，高息存款进入到期高峰，理财规模持续扩张，配置力量驱动信用利差压缩至历史低位水平。上半年，中债-新综合财富（总值）指数上涨 2.02%。

2026 年上半年，中金安心回报债券仓位以票息策略为主，精选中高等级、较好流动性的中短久期信用债，力争为组合提供相对稳健的底仓收益，并根据市场行情择机参与利率债的交易波段增厚组合收益。本基金股票部分根据基本面的景气信号，重点配置算力链条、锂电储能、半导体上游、出口机械设备、餐饮链等方向，期间市场整体估值水平处于历年中性偏高位置，景气方向的估值切换波动显著提升，且表现得更为结构化，这主要源于市场对景气方向在高预期下的兑现要求不断提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金安心回报混合 A 基金份额净值为 1.1819 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.83%，同期业绩基准收益率为 1.67%；中金安心回报混合 C 基金份额净值为 1.1531 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.62%，同期业绩基准收益率为 1.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

向后展望，下半年经济预计仍将处于新旧动能转换的过渡阶段，财政政策将保持强度，重点支持“两重”、“两新”领域及消费以旧换新扩容，加快专项债和超长期特别国债发行使用。货币政策维持适度宽松基调，但受中美利差倒挂、银行净息差约束等因素影响，降准降息概率不高，结构性工具的使用或占据主导。消费市场在政策激励下延续回暖，但物价偏弱格局或难以出现根本性扭转。出口端受全球贸易放缓及地缘扰动影响，外部不稳定不确定因素较多，国内有效需求偏弱，经济回升向好基础仍需加力巩固。

资金面方面，央行通过隔夜逆回购常态化操作明确了利率走廊框架，并多次强调继续引导隔夜利率在政策利率附近平稳运行、保持流动性充裕。基本面温和复苏格局下，预计下半年资金面维持均衡偏松，但需关注政府债供给高峰的时点性扰动。

综合来看，新旧动能转换仍在深化，融资需求偏弱，货币政策预计将保持稳健，预计下半年债市延续震荡格局，利率大幅上行风险可控。但政策面的力度及节奏或在边际上对债券市场形成一定扰动。基金经理将密切跟踪基本面的修复情况、资金面的变化及地缘政治局势的演变。

在权益市场方面，基金经理认为随着市场 2024 年以来的持续上涨，后市预计将逐步进入结构性行情阶段。从下半年来看，市场在一些景气赛道中的行业机会可能收敛为个股机会，而这些机会需要更多地在前期相对滞涨或是短期出现基本面重大变化的个股中挖掘。中金安心回报在下半年将按照上述的配置思路，重点关注三个趋势性方向下的成长机会，积极挖掘传统消费、AI 应用、稳健景气等方向的个股，力争在行业整体的波动中实现个股的超额收益。

其一，传统消费的复苏潜力。传统消费在下一阶段的复苏情况将是未来权益市场走向的重要变量。当前市场整体估值水平已对未来一段时间的盈利增长反映较为充分，而历经近 5 年的出清后，地产市场能否在后期逐步企稳并对居民财富效应实现有效托举成为内需消费的重要看点，消费板块的预期差或是本轮 A 股盈利周期上行空间与延续性的决定因素之一，我们将积极关注食品饮料、餐饮旅游乃至地产消费链的数据变化，当出现基本面明确改善的时点，沿景气线索积极配置该方向。

其二，AI 应用的落地。AI 算力基建的布局自 2023 年以来如火如荼并兑现了较高的景气度。下一阶段，科技方向的重要变量将是 AI 能力能否在消费和工业级应用层面上，真正产生具备有效盈利模式的“爆款”产品和公司。从历史经验来看，当基础建设完成后，商业模式的成型往往体现出非线性成长的特点，相关应用落地带来的产业链机会值得关注。

其三，高股息板块中的景气机会。随着 2026 年以来国债债券收益率的下行以及高股息个股的集中调整，防御、金融以及部分消费、周期为代表的板块股息率整体依然具有性价比。我们将按

照本账户的景气投资框架，在高股息板块中积极挖掘边际变化，在景气上行的估值保护下力争获取稳定股息收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

基金管理人建立并执行基金估值相关管理制度，设置估值委员会研究、指导基金估值业务。各估值委员会委员和基金会计均具有相关工作经历和专业胜任能力。参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期末实施利润分配。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金安心回报混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	10,470,473.05	10,122,509.21
结算备付金		221,818.83	2,488,653.43
存出保证金		75,847.10	50,736.18
交易性金融资产	6.4.7.2	222,516,530.69	191,227,299.27
其中：股票投资		52,388,798.80	59,716,972.00
基金投资		-	-
债券投资		170,127,731.89	131,510,327.27
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		129.85	167.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		233,284,799.52	203,889,365.87
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		56,302,227.76	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		214,949.76	426,490.87

应付管理人报酬		87,455.32	104,514.91
应付托管费		21,863.83	26,128.72
应付销售服务费		35,858.83	40,837.83
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,502.79	3,780.10
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	208,188.20	99,936.87
负债合计		56,879,046.49	701,689.30
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	151,550,803.81	177,417,882.50
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	24,854,949.22	25,769,794.07
净资产合计		176,405,753.03	203,187,676.57
负债和净资产总计		233,284,799.52	203,889,365.87

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，中金安心回报混合 A 的基金份额净值为 1.1819 元，期末份额总额为 57,266,954.24 份；中金安心回报混合 C 的基金份额净值为 1.1531 元，期末份额总额为 94,283,849.57 份。基金份额总额 151,550,803.81 份。

6.2 利润表

会计主体：中金安心回报混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		4,919,047.50
1. 利息收入		23,465.71
其中：存款利息收入	6.4.7.13	23,465.71
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		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,728,874.39
其中：股票投资收益	6.4.7.14	6,302,084.04
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	1,800,926.92
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	625,863.43
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	-3, 833, 474. 17
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	181. 57
减：二、营业总支出		1, 376, 849. 61
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	569, 831. 45
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	142, 457. 90
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	229, 049. 37
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		330, 056. 45
其中：卖出回购金融资产支出		330, 056. 45
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-
7. 税金及附加		5, 104. 32
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	100, 350. 12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3, 542, 197. 89
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3, 542, 197. 89
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		3, 542, 197. 89

6.3 净资产变动表

会计主体：中金安心回报混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	177, 417, 882. 50	-	25, 769, 794. 07	203, 187, 676. 57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	177, 417, 882. 50	-	25, 769, 794. 07	203, 187, 676. 57
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-25, 867, 078. 69	-	-914, 844. 85	-26, 781, 923. 54
（一）、综合收益总额	-	-	3, 542, 197. 89	3, 542, 197. 89
（二）、本期基金份额 交易产生的净资产变	-25, 867, 078. 69	-	-4, 457, 042. 74	-30, 324, 121. 43

动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	859,327.71	-	143,763.05	1,003,090.76
2. 基金赎回款	-26,726,406.40	-	-4,600,805.79	-31,327,212.19
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	151,550,803.81	-	24,854,949.22	176,405,753.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

宗喆

二

白娜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金安心回报混合型证券投资基金由中国国际金融股份有限公司旗下的中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“集合计划”）变更而成。根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2025 年 8 月 28 日证监许可[2025]1885 号文批复，集合计划已获准变更注册。集合计划自 2025 年 11 月 17 日起变更注册为中金安心回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），集合计划管理人由中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）变更为中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）。自 2025 年 11 月 17 日起，《中金安心回报混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）生效，《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。本基金为契约型开放式混合型，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为华夏银行股份有限公司（以下简称“华夏银行”）。

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《中金安心回报混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据申购费用、赎回费用收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，赎回时收取赎回费但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；投资者申购时不收取申购费用，赎回时收取赎回费但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类

和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金份额的基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择申购的基金份额类别。

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《中金安心回报混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金(包括全市场公开募集的股票型 ETF、基金管理人管理的股票型基金和计入权益类资产的混合型基金，不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的非基金中基金、货币市场基金)、国内依法发行上市的股票(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、证券公司短期公司债券、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据及其他经中国证监会允许投资的债券)、股指期货、国债期货、股票期权、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按

照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入,自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日,免征增值税;对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。自 2025 年 8 月 8 日起,对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入,恢复征收增值税,对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入,继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b)对投资者从本基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

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

(c)对本基金从上市公司、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。对本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。

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

对内地个人投资者通过沪港通、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。内地个人投资者通过沪港通、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。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得,按照上述规定计征个人所得税。

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

(d)本基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。对于本基金通过沪港通、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。

(e)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，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该内地基金分配利息时按照 7%的税率代扣代缴所得税，对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10%的税率代扣代缴所得税。

自 2026 年 1 月 1 日起，通过基金互认买卖内地基金份额取得的收入免征增值税。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	10,470,473.05
等于：本金	10,469,368.89
加：应计利息	1,104.16
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	10,470,473.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	54,756,481.41	-	52,388,798.80	-2,367,682.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所市	8,771,928.50	32,687.07	8,776,917.07	-27,698.50

	场				
	银行间市场	159,582,083.86	1,500,644.82	161,350,814.82	268,086.14
	合计	168,354,012.36	1,533,331.89	170,127,731.89	240,387.64
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		223,110,493.77	1,533,331.89	222,516,530.69	-2,127,294.97

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.16
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	118,637.92
其中：交易所市场	100,437.74
银行间市场	18,200.18
应付利息	-
预提费用	89,550.12
合计	208,188.20

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金安心回报混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,086,081.64	72,086,081.64
本期申购	336,249.47	336,249.47
本期赎回（以“-”号填列）	-15,155,376.87	-15,155,376.87
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	57,266,954.24	57,266,954.24

中金安心回报混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	105,331,800.86	105,331,800.86
本期申购	523,078.24	523,078.24

本期赎回（以“-”号填列）	-11,571,029.53	-11,571,029.53
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	94,283,849.57	94,283,849.57

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

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中金安心回报混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,990,568.93	-8,408,821.23	11,581,747.70
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	19,990,568.93	-8,408,821.23	11,581,747.70
本期利润	3,035,444.48	-1,469,599.91	1,565,844.57
本期基金份额交易产生的变动数	-4,491,991.74	1,760,104.32	-2,731,887.42
其中：基金申购款	101,876.79	-40,866.80	61,009.99
基金赎回款	-4,593,868.53	1,800,971.12	-2,792,897.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,534,021.67	-8,118,316.82	10,415,704.85

中金安心回报混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,023,014.95	-3,834,968.58	14,188,046.37
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	18,023,014.95	-3,834,968.58	14,188,046.37
本期利润	4,340,227.58	-2,363,874.26	1,976,353.32
本期基金份额交易产生的变动数	-2,180,332.18	455,176.86	-1,725,155.32
其中：基金申购款	98,421.83	-15,668.77	82,753.06
基金赎回款	-2,278,754.01	470,845.63	-1,807,908.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,182,910.35	-5,743,665.98	14,439,244.37

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,634.27
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	727.67
其他	103.77
合计	23,465.71

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,302,084.04
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	6,302,084.04

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	196,769,380.57
减：卖出股票成本总额	190,173,136.05
减：交易费用	294,160.48
买卖股票差价收入	6,302,084.04

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

6.4.7.15 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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,991,278.23
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-190,351.31
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,800,926.92

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	145,602,821.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	143,767,336.00
减：应计利息总额	2,019,827.58
减：交易费用	6,009.50
买卖债券差价收入	-190,351.31

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.16 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

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	625,863.43
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	625,863.43

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,833,474.17
股票投资	-4,223,647.39
债券投资	390,173.22
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	-3,833,474.17

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	181.57
合计	181.57

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	21,042.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	19,500.00
上清所查询费	300.00
合计	100,350.12

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、关联关系

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、基金销售机构
华夏银行	基金托管人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司	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	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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末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

本基金本报告期无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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	569,831.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	188,873.61
应支付基金管理人的净管理费	380,957.84

注：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 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	142,457.90

注：支付基金托管人华夏银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金安心回报混合 A	中金安心回报混合 C	合计
中金财富证券	—	33,171.09	33,171.09
中金公司	—	122,498.47	122,498.47
合计	—	155,669.56	155,669.56

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

C 类基金份额日基金销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	中金安心回报混合 A	中金安心回报混合 C
基金合同生效日(2025 年 11 月 17 日) 持有的基金份额	—	53,399,786.40
报告期初持有的基金份额	—	53,399,786.40
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	—	53,399,786.40
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	56.64%

注：报告期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
华夏银行	10,470,473.05	22,634.27

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期在承销期内未参与认购关联方承销的证券。本基金基金合同生效日为 2025 年 11 月 17 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

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 56,302,227.76 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
102484000	24 云投 MTN014	2026 年 7 月 1 日	103.53	75,000	7,764,853.97
232680001	26 工行二级资本债 01BC	2026 年 7 月 1 日	101.12	70,000	7,078,361.64
242680007	26 民生银行永续债 01	2026 年 7 月 1 日	100.70	90,000	9,062,791.40
102581089	25 淮北建投 MTN002	2026 年 7 月 2 日	102.12	20,000	2,042,375.23
102581909	25 银川通联 MTN002	2026 年 7 月 2 日	101.98	90,000	9,177,960.33
102680544	26 国投租赁 MTN001	2026 年 7 月 7 日	101.14	100,000	10,114,263.01
102680897	26 海通恒信 MTN001	2026 年 7 月 7 日	100.90	100,000	10,089,726.03
102681716	26 宏桂资本 MTN002	2026 年 7 月 7 日	100.60	55,000	5,533,251.64
合计				600,000	60,863,583.25

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	33,586,075.78	77,943,609.03
AAA 以下	-	-
未评级	126,734,259.86	41,216,611.74
合计	160,320,335.64	119,160,220.77

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随时要求赎回其持有的基金份额，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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,469,368.89	-	-	1,104.16	10,470,473.05
结算备付金	221,797.33	-	-	21.50	221,818.83
存出保证金	75,839.70	-	-	7.40	75,847.10
交易性金融资产	26,945,030.00	141,649,370.00	-	53,922,130.69	222,516,530.69
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	129.85	129.85
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,712,035.92	141,649,370.00	-	53,923,393.60	233,284,799.52
负债					
卖出回购金融资产款	56,299,337.85	-	-	2,889.91	56,302,227.76
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	214,949.76	214,949.76
应付销售服务费	-	-	-	35,858.83	35,858.83
应付管理人报酬	-	-	-	87,455.32	87,455.32
应付托管费	-	-	-	21,863.83	21,863.83
应交税费	-	-	-	8,502.79	8,502.79
其他负债	-	-	-	208,188.20	208,188.20
负债总计	56,299,337.85	-	-	579,708.64	56,879,046.49
利率敏感度缺口	-18,587,301.93	141,649,370.00	-	53,343,684.96	176,405,753.03

上年度末 2025 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	10,121,446.86	-	-	1,062.35	10,122,509.21
结算备付金	2,488,387.23	-	-	266.20	2,488,653.43
存出保证金	50,730.79	-	-	5.39	50,736.18
交易性金融资产	20,400,090.00	109,646,900.00	-	61,180,309.27	191,227,299.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	167.78	167.78
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	33,060,654.88	109,646,900.00	-	61,181,810.99	203,889,365.87
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	426,490.87	426,490.87
应付销售服务费	-	-	-	40,837.83	40,837.83
应付管理人报酬	-	-	-	104,514.91	104,514.91
应付托管费	-	-	-	26,128.72	26,128.72
应交税费	-	-	-	3,780.10	3,780.10
其他负债	-	-	-	99,936.87	99,936.87
负债总计	-	-	-	701,689.30	701,689.30
利率敏感度缺口	33,060,654.88	109,646,900.00	-	60,480,121.69	203,187,676.57

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

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	762,448.69	420,202.84

	市场利率上升 25 个基点	-762, 448. 69	-420, 202. 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

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	52, 388, 798. 80	29. 70	59, 716, 972. 00	29. 39
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	52, 388, 798. 80	29. 70	59, 716, 972. 00	29. 39

6. 4. 13. 4. 3. 2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	52,388,798.80	59,716,972.00
第二层次	170,127,731.89	131,510,327.27
第三层次	—	—
合计	222,516,530.69	191,227,299.27

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	52,388,798.80	22.46
	其中：股票	52,388,798.80	22.46
2	基金投资	—	—

3	固定收益投资	170,127,731.89	72.93
	其中：债券	170,127,731.89	72.93
	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	10,692,291.88	4.58
8	其他各项资产	75,976.95	0.03
9	合计	233,284,799.52	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,437,946.90	22.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	70,092.00	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,144,492.00	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	1,107,456.00	0.63
H	住宿和餐饮业	731,640.00	0.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,725,605.90	0.98
J	金融业	3,816,806.00	2.16
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,626,453.00	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	1,055,362.00	0.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	672,945.00	0.38
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	52,388,798.80	29.70

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资产。

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	600885	宏发股份	94,700	3,266,203.00	1.85
2	603317	天味食品	239,020	3,109,650.20	1.76
3	603345	安井食品	33,400	2,678,346.00	1.52
4	000776	广发证券	101,000	2,363,400.00	1.34
5	300012	华测检测	134,700	1,866,942.00	1.06
6	000729	燕京啤酒	164,700	1,668,411.00	0.95
7	002946	新乳业	113,700	1,600,896.00	0.91
8	002415	海康威视	46,800	1,600,560.00	0.91
9	600150	中国船舶	43,000	1,452,970.00	0.82
10	603092	德力佳	19,600	1,057,812.00	0.60
11	301109	军信股份	84,700	1,055,362.00	0.60
12	300408	三环集团	5,900	984,710.00	0.56
13	002142	宁波银行	31,400	932,266.00	0.53
14	002563	森马服饰	167,000	841,680.00	0.48
15	601233	桐昆股份	38,800	840,020.00	0.48
16	002384	东山精密	3,200	839,520.00	0.48
17	301371	敷尔佳	30,960	804,960.00	0.46
18	603259	药明康德	6,100	759,511.00	0.43
19	300054	鼎龙股份	7,000	741,790.00	0.42
20	600258	首旅酒店	67,000	731,640.00	0.41
21	605117	德业股份	6,600	700,788.00	0.40
22	300857	协创数据	2,040	693,396.00	0.39
23	002867	周大生	61,600	686,840.00	0.39
24	301239	普瑞眼科	22,100	672,945.00	0.38
25	002956	西麦食品	32,200	668,472.00	0.38
26	688012	中微公司	1,341	628,258.50	0.36
27	002463	沪电股份	4,100	626,480.00	0.36
28	301358	湖南裕能	8,100	614,547.00	0.35
29	002120	韵达股份	92,400	587,664.00	0.33
30	688308	欧科亿	3,200	581,792.00	0.33
31	600186	莲花控股	40,400	565,600.00	0.32
32	002841	视源股份	15,400	531,762.00	0.30
33	300073	当升科技	11,000	528,440.00	0.30
34	603638	艾迪精密	22,400	525,280.00	0.30
35	002468	申通快递	35,700	519,792.00	0.29
36	688795	摩尔线程	700	501,543.00	0.28
37	688692	达梦数据	2,000	488,580.00	0.28
38	002154	报喜鸟	137,000	487,720.00	0.28
39	603808	歌力思	63,800	482,966.00	0.27
40	688256	寒武纪	298	475,473.90	0.27
41	688981	中芯国际	2,800	444,696.00	0.25
42	603699	纽威股份	8,700	437,610.00	0.25
43	688328	深科达	4,400	421,080.00	0.24

44	688521	芯原股份	1,100	408,254.00	0.23
45	002216	三全食品	33,700	388,561.00	0.22
46	600499	科达制造	27,800	383,640.00	0.22
47	301031	中熔电气	3,108	371,250.60	0.21
48	601009	南京银行	36,000	356,040.00	0.20
49	688002	睿创微纳	2,200	340,318.00	0.19
50	605016	百龙创园	12,300	317,955.00	0.18
51	688087	英科再生	9,200	307,464.00	0.17
52	002603	以岭药业	20,000	300,000.00	0.17
53	002821	凯莱英	1,800	291,600.00	0.17
54	688690	纳微科技	6,600	291,060.00	0.16
55	000404	长虹华意	34,400	270,384.00	0.15
56	688410	山外山	17,975	258,121.00	0.15
57	300681	英搏尔	8,900	254,718.00	0.14
58	300972	万辰集团	1,400	242,774.00	0.14
59	301345	涛涛车业	1,000	231,000.00	0.13
60	600801	华新建材	14,700	229,320.00	0.13
61	002979	雷赛智能	4,000	223,120.00	0.13
62	002780	三夫户外	17,700	214,878.00	0.12
63	301217	铜冠铜箔	1,300	214,591.00	0.12
64	605305	中际联合	5,000	209,600.00	0.12
65	600522	中天科技	3,400	206,312.00	0.12
66	603283	赛腾股份	2,470	200,020.60	0.11
67	603799	华友钴业	3,700	178,562.00	0.10
68	000938	紫光股份	6,000	173,160.00	0.10
69	002948	青岛银行	32,500	165,100.00	0.09
70	603600	永艺股份	18,100	160,547.00	0.09
71	002810	山东赫达	6,400	158,080.00	0.09
72	603026	石大胜华	1,700	151,929.00	0.09
73	603906	龙蟠科技	5,600	148,568.00	0.08
74	688536	思瑞浦	400	145,636.00	0.08
75	688155	先惠技术	1,800	145,602.00	0.08
76	600685	中船防务	5,600	142,464.00	0.08
77	603606	东方电缆	3,380	140,303.80	0.08
78	688127	蓝特光学	1,400	136,640.00	0.08
79	002701	奥瑞金	31,700	135,042.00	0.08
80	603179	新泉股份	2,660	132,069.00	0.07
81	300308	中际旭创	100	127,000.00	0.07
82	301219	腾远钴业	2,210	121,108.00	0.07
83	605189	富春染织	9,600	115,680.00	0.07
84	603893	瑞芯微	600	113,016.00	0.06
85	300302	同有科技	2,200	112,574.00	0.06
86	603338	浙江鼎力	2,600	110,500.00	0.06

87	001332	锡装股份	2,660	104,458.20	0.06
88	688220	翱捷科技	800	99,456.00	0.06
89	688095	福昕软件	1,600	95,088.00	0.05
90	001389	广合科技	400	94,900.00	0.05
91	300428	立中集团	4,000	72,720.00	0.04
92	601991	大唐发电	9,900	70,092.00	0.04
93	605099	共创草坪	2,100	67,620.00	0.04
94	300373	扬杰科技	400	62,892.00	0.04
95	688472	阿特斯	5,800	62,756.00	0.04
96	688036	传音控股	1,000	58,950.00	0.03
97	603195	公牛集团	1,200	46,980.00	0.03
98	603890	春秋电子	1,700	46,954.00	0.03
99	600096	云天化	1,400	42,560.00	0.02
100	000683	博源化工	7,100	40,896.00	0.02
101	000933	神火股份	900	19,080.00	0.01
102	600398	海澜之家	2,000	10,460.00	0.01

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	300012	华测检测	7,292,648.00	3.59
2	000729	燕京啤酒	6,128,141.00	3.02
3	002948	青岛银行	5,475,813.00	2.69
4	600066	宇通客车	4,751,105.00	2.34
5	000792	盐湖股份	4,588,335.00	2.26
6	603345	安井食品	4,518,530.00	2.22
7	603317	天味食品	3,862,530.60	1.90
8	002911	佛燃能源	3,725,867.02	1.83
9	300750	宁德时代	3,587,467.20	1.77
10	603558	健盛集团	3,417,976.00	1.68
11	600885	宏发股份	3,106,050.20	1.53
12	603092	德力佳	3,008,891.00	1.48
13	605098	行动教育	2,660,971.57	1.31
14	000776	广发证券	2,545,277.03	1.25
15	603288	海天味业	2,435,088.60	1.20
16	603259	药明康德	2,267,147.00	1.12
17	300685	艾德生物	2,225,040.00	1.10
18	002946	新乳业	2,070,445.00	1.02
19	600887	伊利股份	2,055,948.00	1.01
20	002415	海康威视	2,046,479.00	1.01

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	000792	盐湖股份	7,278,358.00	3.58
2	300012	华测检测	5,545,874.00	2.73
3	002948	青岛银行	5,272,797.00	2.60
4	600066	宇通客车	4,567,380.00	2.25
5	002293	罗莱生活	4,554,712.00	2.24
6	603365	水星家纺	3,799,583.00	1.87
7	300750	宁德时代	3,765,640.00	1.85
8	603558	健盛集团	3,750,263.00	1.85
9	002911	佛燃能源	3,633,913.00	1.79
10	000729	燕京啤酒	3,565,999.00	1.76
11	600011	华能国际	3,274,838.00	1.61
12	601336	新华保险	3,246,234.94	1.60
13	605098	行动教育	2,581,211.00	1.27
14	603288	海天味业	2,377,396.00	1.17
15	600361	创新新材	2,324,648.00	1.14
16	300685	艾德生物	2,201,989.00	1.08
17	002028	思源电气	2,187,204.00	1.08
18	301087	可孚医疗	2,111,539.00	1.04
19	002668	TCL 智家	2,098,832.00	1.03
20	300957	贝泰妮	2,076,197.00	1.02

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	187,068,610.24
卖出股票收入（成交）总额	196,769,380.57

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	1,711,019.26	0.97
2	央行票据	—	—
3	金融债券	24,237,530.03	13.74
	其中：政策性金融债	8,096,376.99	4.59
4	企业债券	17,332,859.45	9.83
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	126,846,323.15	71.91
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	170,127,731.89	96.44

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

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	102482913	24 津城建 MTN026	100,000	10,576,785.21	6.00
2	102401023	24 长寿投资 MTN003	100,000	10,445,056.44	5.92
3	1880163	18 首旅债 01	100,000	10,266,961.64	5.82
4	102481269	24 冀中能源 MTN006(科创票据)	100,000	10,230,958.90	5.80
5	102581089	25 淮北建投 MTN002	100,000	10,211,876.16	5.79

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 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中，民生银行股份有限公司本期出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

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	75,847.10
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	129.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,976.95

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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
中金安心回报混合 A	2,804	20,423.31	1,920,124.92	3.35	55,346,829.32	96.65
中金安心回报混合 C	1,855	50,826.87	53,399,786.40	56.64	40,884,063.17	43.36
合计	4,659	32,528.61	55,319,911.32	36.50	96,230,892.49	63.50

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金安心回报混合 A	0.00	0.0000
	中金安心回报混合 C	0.00	0.0000
	合计	0.00	0.0000

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金安心回报混合 A	0
	中金安心回报混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中金安心回报混合 A	0
	中金安心回报混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金安心回报混合 A	中金安心回报混合 C
基金合同生效日（2025 年 11 月 17 日）基金份额总额	75,153,465.82	107,716,066.17
本报告期期初基金份额总额	72,086,081.64	105,331,800.86
本报告期基金总申购份额	336,249.47	523,078.24
减：本报告期基金总赎回份额	15,155,376.87	11,571,029.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	57,266,954.24	94,283,849.57

§ 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

(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，本基金托管人于 2026 年 3 月 12 日发布公告，朱绍纲先生自 2026 年 3 月 9 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人于 2026 年 4 月 21 日发布公告，陈秀良先生自 2026 年 3 月 16 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部总经理。

本报告期内，本基金托管人于 2026 年 6 月 22 日发布公告，赵伟婧女士自 2026 年 6 月 22 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本基金管理人在本报告期内未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本基金管理人相关从业人员在本报告期内未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未有受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员未有受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
兴业证券	4	383,837,990.81	100.00	171,161.93	100.00	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好，资本充足，财务指标等符合监管要求；
- (2) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 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；
- (4) 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；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) 本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》《证券综合服务协议》

(注：被动股票型基金不通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用)。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
兴业证券	17,193,066.00	100.00	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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关于旗下部分基金投资北交所股票及相关风险提示的公告	中国证监会规定媒介	2026-02-07
2	中金基金管理有限公司关于新增基金直销账户的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-21
3	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-26
4	中金基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金估值调整情况的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-27

§ 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 (%)
自有资金	1	2026 年 01 月 01 日 - 2026 年 06 月 30 日	53,399,786.40	0.00	0.00	53,399,786.40	35.24
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形。如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回							

款项的情形；在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，从而可能面临基金合同终止等基金合同中约定的情形。

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、中金安心回报混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中金安心回报混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金安心回报混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中金安心回报混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 8、报告期内中金安心回报混合型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日