

中金新盛 1 年定期开放债券型发起式证券  
投资基金  
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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责任。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年10月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年7月3日起至2020年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	中金新盛1年
基金主代码	009451
交易代码	009451
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年7月3日
报告期末基金份额总额	110,000,000.00份
投资目标	在严格控制风险的基础上，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	本基金将根据对政府债券、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，确定债券类属配置策略，并根据市场变化及时进行调整，从而选择既能匹配目标久期、同时又能获得较高持有期收益的类属债券配置比例。具体包括：1、债券类属配置策略；2、久期管理策略；3、收益率曲线策略；4、资产支持证券投资策略；5、国债期货投资策略；6、开放期投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年7月3日—2020年9月30日）
1. 本期已实现收益	724,838.64
2. 本期利润	445,673.38
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0041
4. 期末基金资产净值	110,445,673.38
5. 期末基金份额净值	1.0041

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。

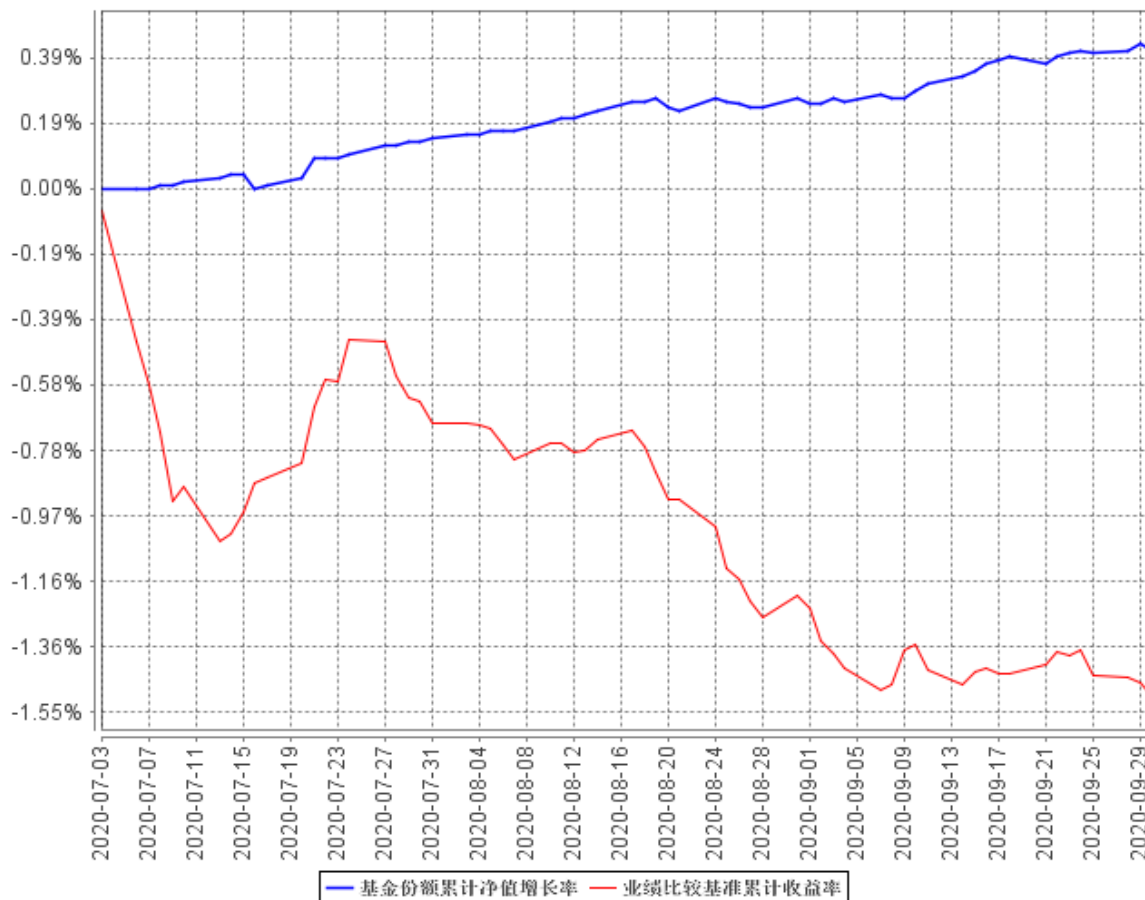
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	净值增长率 ①	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
自基金合同 生效起至今	0.41%	0.02%	-1.51%	0.08%	1.92%	-0.06%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

基金份额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2020年7月3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，截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石玉	本基金的基金经理	2020年7月3日	-	13年	石玉女士，管理学硕士。历任中国科技证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司职员；天弘基金管理有限公司金融工

					程分析师、固定收益研究员；中国国际金融股份有限公司资产管理部高级研究员、投资经理助理、投资经理。2016年7月加入中金基金管理有限公司，现任传统投资部基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、上述基金经理任职日期为本基金基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

#### 4.1.1 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遵规守信情况的说明

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》和其他有关法律法规及本基金合同的约定，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，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2020年三季度中国经济延续复苏修复态势，进出口数据表现佳，金融数据超市场预期，PPI同比继续改善，货币政策在三季度继续维持中性态度，债券市场质押式隔夜回购利率中枢相对二季度继续提升，围绕政策利率OMO上下波动，权益市场在7月出现大涨，债券市场在7月出现快速调整，存单发行利率缓慢上移，整体而言，三季度债券市场表现为震荡略下跌，中债-新综合财富（总值）指数下跌0.63%。

本基金成立于7月初，成立时债券市场有所调整，但是调整速度较慢，尤其是短端资产，本基金投资策略以获取绝对收益为主，鉴于对债券市场中性略悲观预期，本基金操作较为保守，以久期较短的资产为主，投资标的上，主要为信用资质较好的商业银行金融债、存单和利率债，在3季度债券市场震荡略下跌格局下，本基金表现出净值平稳增长，波动率较低特点。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0041元；本报告期基金份额净值增长率为0.41%，业绩比较基准收益率为-1.51%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，截止本报告期末，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	74,152,200.00	67.09
	其中：债券	74,152,200.00	67.09

	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	28,030,239.05	25.36
	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	6,974,119.02	6.31
8	其他资产	1,373,799.94	1.24
9	合计	110,530,358.01	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 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。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,577,000.00	54.85
	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）	-	-
8	同业存单	13,575,200.00	12.29
9	其他	-	-
10	合计	74,152,200.00	67.14

**5.5 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债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1828014	18 兴业绿色金融 01	100,000	10,155,000.00	9.19
2	1828016	18 民生银行 01	100,000	10,133,000.00	9.17
3	1820038	18 南京银行 01	100,000	10,103,000.00	9.15
4	1920001	19 宁波银行 01	100,000	10,073,000.00	9.12
5	1628022	16 交行绿色金融债 02	100,000	10,059,000.00	9.11

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

**5.7 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。

**5.8 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权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****5.9.1 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。

**5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**5.9.3 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。



## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除北京银行股份有限公司（20 北京银行 CD078）、交通银行股份有限公司（16 交行绿色金融债 02）、南京银行股份有限公司（18 南京银行 01）、中国民生银行股份有限公司（18 民生银行 01）、宁波银行股份有限公司（19 宁波银行 01）、杭州银行股份有限公司（19 杭州银行双创金融债）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2020 年 7 月 16 日，北京银保监局发布行政处罚决定书（京银保监罚决字〔2020〕23 号），对北京银行股份有限公司同业投资对资产转让业务承担回购义务；同业投资资产风险分类调整不及时、延缓风险暴露；收费管理政策执行不严、违规收取相关费用等违法违规事实进行处罚。2019 年 10 月 8 日，北京银保监局发布行政处罚决定书（京银保监罚决字〔2019〕38 号），对北京银行股份有限公司员工大额消费贷款违规行为长期未有效整改、同业业务专营部门制改革不到位、同业投资违规接受第三方金融机构信用担保等违法违规事实进行处罚。

2020 年 5 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监罚决字〔2020〕6 号），对交通银行股份有限公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在理财产品数量漏报、资金交易信息漏报严重等违法违规事实进行处罚。

2020 年 6 月 5 日，中国银行保险监督管理委员会江苏监管局发布行政处罚决定书（苏银保监罚决字〔2019〕86 号），对南京银行股份有限公司未将部分银行承担风险的业务纳入统一授信管理；同业投资资金违规用于支付土地出让金；同业投资资金违规用于上市公司定向增发等违法违规事实进行处罚。

2020 年 2 月 14 日，中国人民银行发布行政处罚决定书（银罚字〔2020〕1 号），对中国民生银行股份有限公司未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告等违法违规事实进行处罚。2019 年 12 月 20 日，中国银行保险监督管理委员会北京银保监局发布行政处罚决定书（京银保监罚决字〔2019〕56 号），对中国民生银行股份有限公司同业票据业务管理失控、违反内控指引要求计量转贴现卖断业务信用风险加权资产、案件风险信息报送管理不到位等违法违规事实进行处罚。

2019 年 12 月 13 日，宁波银保监局发布行政处罚决定书（甬银保监罚决字〔2019〕67 号），对宁波银行股份有限公司设立时点性规模考核指标，股权质押管理不合规等违法违规事实进行处罚。

2020 年 1 月 14 日，中国银保监会浙江监管局发布行政处罚决定书（浙银保监罚决字〔2020〕

5号),对杭州银行股份有限公司贷后管理不到位,流动资金贷款挪用入房地产企业等违法违规事实进行处罚。2020年1月23日,中国银保监会浙江监管局发布行政处罚决定书(浙银保监罚决字(2020)12号),对杭州银行股份有限公司虚增存贷款;个人经营性贷款管理不审慎,贷款资金被挪用于购房;向资本金比例不足的房地产项目提供融资等违法违规事实进行处罚。

该事项对北京银行、交通银行、南京银行、民生银行、宁波银行、杭州银行的经营不会产生重大影响,短期来看上述公司盈利体量较大,处罚金额对其净利润基本没有影响;对上述公司各项涉及业务的正常开展基本没有影响。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,373,799.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,373,799.94

### 5.10.4 报告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。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.10.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年7月3日）基金份额总额	110,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	110,000,000.00

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	10,000,000.00	9.09	10,000,000.00	9.09	自基金合同生效之日起不少于三年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	9.09	10,000,000.00	9.09	-

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	2020 年 07 月 03 日-2020 年 09 月 30 日	100,000,000.00	0.00	0.00	100,000,000.00	90.91%
产品特有风险							
<p>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，从而可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

### 9.2 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。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金新盛1年定期开放债券型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金新盛1年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金新盛1年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金新盛1年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- 5、本基金申请募集注册的法律意见书

- 6、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 8、中金新盛1年定期开放债券型发起式证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

## 10.2 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。

## 10.3 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

2020年10月28日