

中金金元债券型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2021 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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 7 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 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..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| §7 投资组合报告..... | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 40 |
| 7.2 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..... | 40 |
| 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..... | 41 |
| 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..... | 41 |
| 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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 42 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 42 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 44 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 44 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 44 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 44 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 45 |
| §10 重大事件揭示..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 46 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 46 |
| 10.8 其他重大事件..... | 47 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 50 |

| | |
|-------------------------|-----------|
| §12 备查文件目录 | 51 |
| 12.1 备查文件目录..... | 51 |
| 12.2 存放地点..... | 51 |
| 12.3 查阅方式..... | 51 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------|-------------|
| 基金名称 | 中金金元债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中金金元 | |
| 基金主代码 | 006570 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018 年 11 月 8 日 | |
| 基金管理人 | 中金基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 7,785,185,091.70 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 中金金元 A | 中金金元 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 006570 | 006571 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 7,785,141,363.24 份 | 43,728.46 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持流动性的基础上，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 | <p>(一) 资产配置策略，基于对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场政策分析等宏观基本面研究，结合对各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等因素的评估，在约定的投资比例范围内确定各大类资产的中长期基本配置比例并进行调整。(二) 普通债券投资策略，具体包括债券类属配置策略、期限结构配置策略、利率策略、信用债券投资策略、骑乘策略、息差策略。(三) 中小企业私募债投资策略，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。(四) 可转换债券投资策略，对可转债所对应的基础股票进行分析和研究，从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注，对可转债投资价值进行有效的评估，选择投资价值较高的个券进行投资。(五) 可交换债券投资策略，对可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可交换债券进行投资，积极参与可交换债券新券的申购。(六) 资产支持证券投资策略，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，制定周密的投资策略。(七) 国债期货投资策略以套期保值为目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。</p> |
| 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，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。 |

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 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 赵璧 | 石立平 |
| | 联系电话 | 010-63211122 | 010-63639180 |
| | 电子邮箱 | xxpl@ciccfund.com | shiliping@cebbank.com |
| 客户服务电话 | | 400-868-1166 | 95595 |
| 传真 | | 010-66159121 | 010-63639132 |
| 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 | 北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心 |
| 办公地址 | | 北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层 | 北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心 |
| 邮政编码 | | 100004 | 100033 |
| 法定代表人 | | 胡长生 | 李晓鹏 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.ciccfund.com/ |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-------------------------|
| 注册登记机构 | 中金基金管理有限公司 | 北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别 | 中金金元 A | 中金金元 C |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日) | 报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 130,857,679.76 | 1,495.32 |
| 本期利润 | 192,647,788.98 | 2,166.59 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0247 | 0.0242 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.46% | 2.38% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.48% | 2.42% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 18,944,245.26 | 461.21 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0024 | 0.0105 |
| 期末基金资产净值 | 7,841,280,329.76 | 44,396.20 |
| 期末基金份额净值 | 1.0072 | 1.0153 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 8.66% | 9.46% |

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

中金金元 A

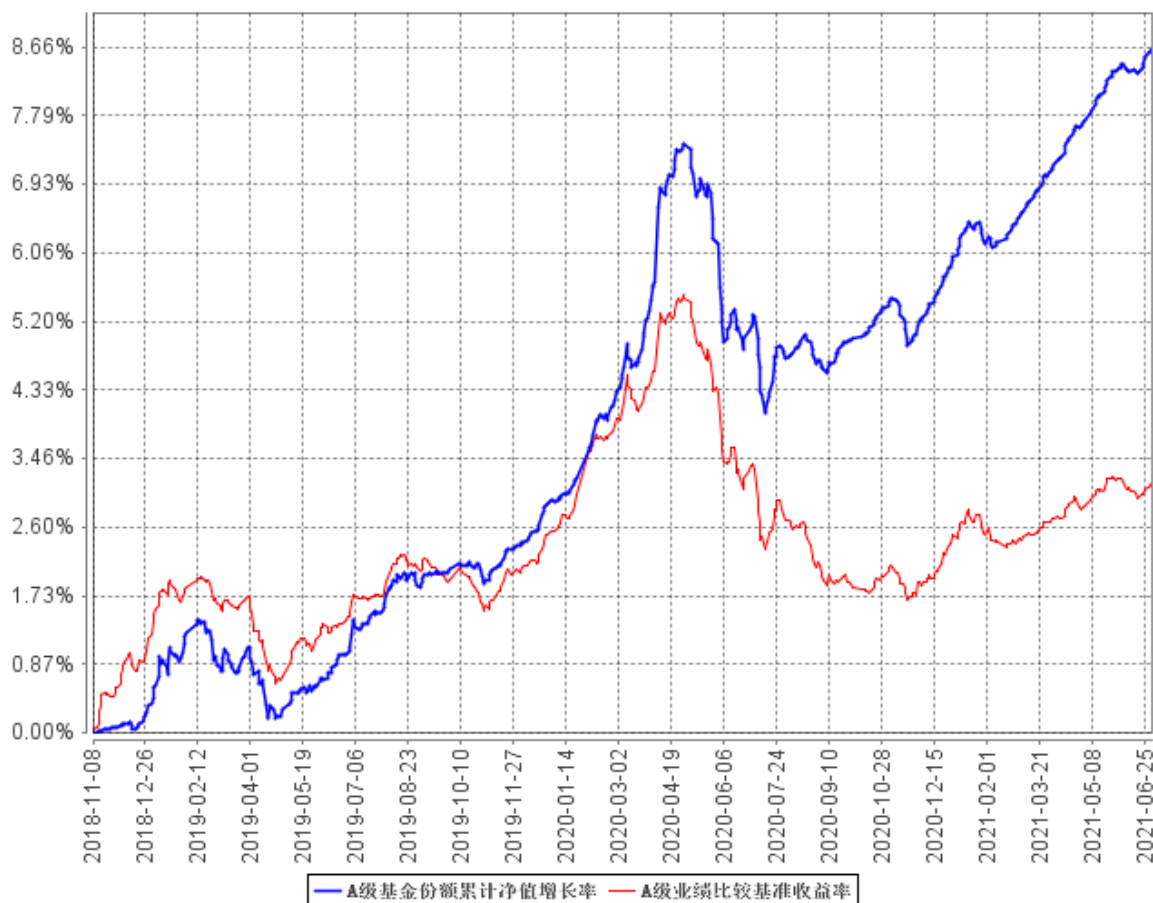
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 0.26% | 0.03% | -0.04% | 0.03% | 0.30% | 0.00% |
| 过去三个月 | 1.43% | 0.03% | 0.45% | 0.03% | 0.98% | 0.00% |
| 过去六个月 | 2.48% | 0.03% | 0.65% | 0.04% | 1.83% | -0.01% |
| 过去一年 | 3.36% | 0.05% | -0.20% | 0.06% | 3.56% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.66% | 0.08% | 3.16% | 0.07% | 5.50% | 0.01% |

中金金元 C

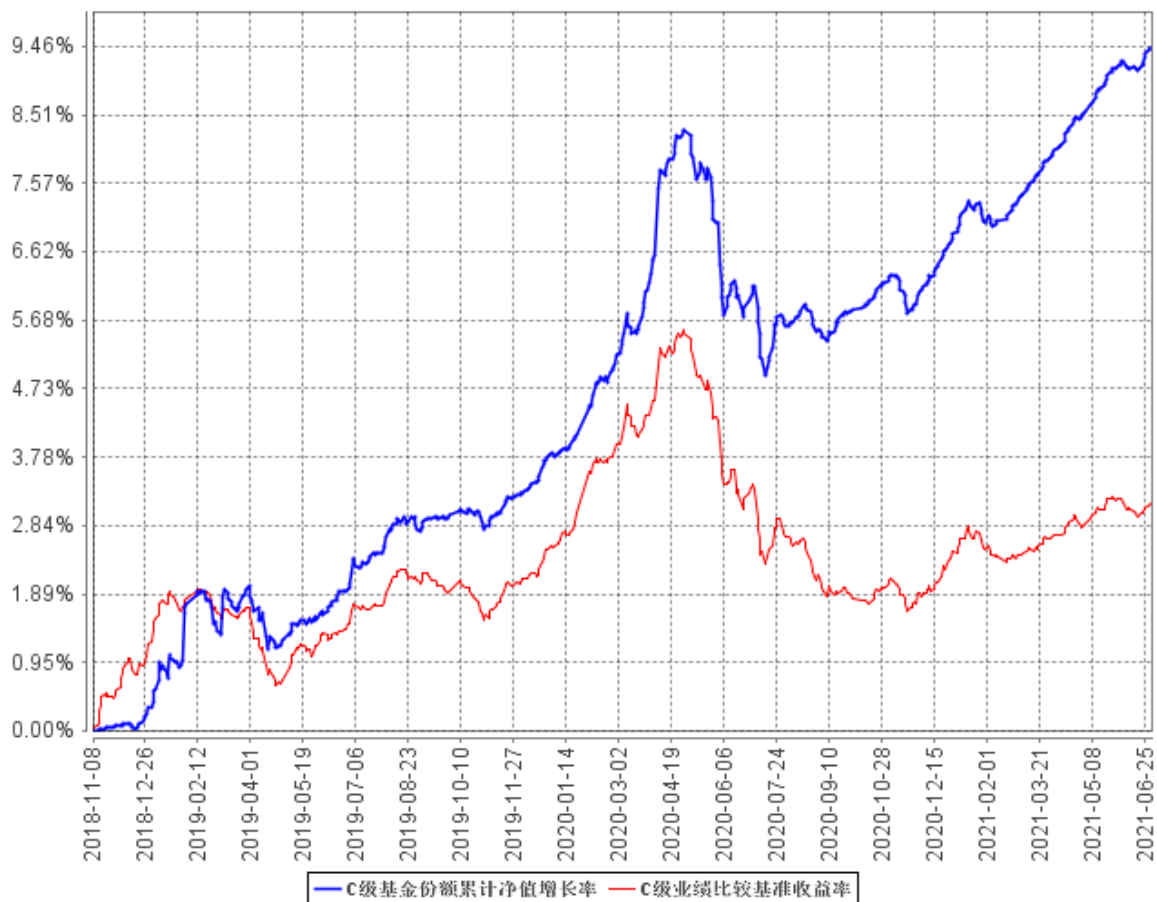
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 0.26% | 0.03% | -0.04% | 0.03% | 0.30% | 0.00% |
| 过去三个月 | 1.40% | 0.03% | 0.45% | 0.03% | 0.95% | 0.00% |
| 过去六个月 | 2.42% | 0.03% | 0.65% | 0.04% | 1.77% | -0.01% |
| 过去一年 | 3.26% | 0.05% | -0.20% | 0.06% | 3.46% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.46% | 0.08% | 3.16% | 0.07% | 6.30% | 0.01% |

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

A级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



C级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



§ 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 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 37 只公募基金，证券投资基金管理规模 680.27 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 董珊珊 | 本基金基金经理 | 2019 年 2 月 18 日 | - | 15 年 | 董珊珊女士，工商管理硕士。历任中国人寿资产管理有限公司固定收益部研究员、投资经理助理、投资经理。现任中金基金管理有限公司固定收益部基金经理。 |
| 闫雯雯 | 本基金基金经理 | 2021 年 1 月 25 日 | - | 12 年 | 闫雯雯女士，管理学硕士。曾任泰康资产管理有限公司国际投资部、信用评估部研究员。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对外披露的任免日期填写。

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。

4.1.3 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》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 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

2021 年上半年我国经济呈现平稳复苏态势，但增长动能呈现边际放缓迹象。基本面方面，投资需求触顶回落，居民消费有所恢复，出口强度有所下降，社融增速从去年 11 月份开始见顶回落。通胀方面，年初以来大宗商品价格快速上涨且波动加大，5 月 PPI 同比上涨 9%，创近 13 年新高，但对 CPI 传导有限。货币政策方面，央行保持流动性合理充裕，春节后央行以每日 OMO 操作 100 亿元的方式投放公开市场流动性，6 月末每日加量至 300 亿元，7 月中旬央行下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点释放长期资金约 1 万亿元，向市场释放流动性合理充裕信号。海外市场方面，美债收益率大幅波动，但对我国债市影响有限。债券市场方面，上半年地方债供给压力小，非银杠杆偏低，配置力量强劲，债券市场走势震荡偏强，10 年期国债利率整体在 3.0%-3.3% 之间波动，节奏上 2 月之前调整，随后回暖，6 月份出现小幅调整，市场的关注度主要集中在资金面的变化，对基本面及通胀的变化不敏感。上半年，中债-新综合财富（总值）指数上涨 2.14%

本报告期内，本基金操作策略上仍然以利率债和高等级信用债为主，维持中性久期，根据市场及组合规模变化做相应的调整，力争为组合带来相对确定和稳定的投资回报。此外，组合还适时进行利率债波段操作以增强收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金金元 A 基金份额净值为 1.0072 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.48%；截至本报告期末中金金元 C 基金份额净值为 1.0153 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.42%；同期业绩比较基准收益率为 0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济动能大概率延续下行趋势，消费和制造业投资缓慢修复，出口和房地产投资拉动作用减弱，虽然财政后置，但在严控地方债务的背景下基建投资仍存在不确定性。通胀方面，PPI 同比大概率见顶，下半年预计维持高位震荡，居民终端需求相对疲弱，CPI 受猪价拖累维持较低水平，全面通胀的压力较小。海外方面，一些国家疫情出现反复，虽然继续走向整体性复苏，但增速会放缓，美联储政策转向的进程将影响债券市场，但影响程度或低于 2013 年。货币政策方面，降准后还需同步观察 OMO、MLF、LPR 等关键利率的调整信号，货币政策是否进入全面宽松格局仍有待观察。债券市场方面，需求侧依然能对债券形成支撑，维持债券市场震荡偏强格局的判断，但需关注下半年地方债供给上行、基本面和政策面的可能变化、外部美联储政策转向进程、四季度全面降准的可能性等。

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、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，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

(1) 本基金的基金管理人于 2021 年 1 月 23 日发布《中金基金管理有限公司关于中金金元债券型证券投资基金 2021 年第一次分红公告》，收益分配基准日为 2021 年 1 月 19 日，本期 A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.0800 元，本期 C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.0800 元。

(2) 本基金的基金管理人于 2021 年 3 月 13 日发布《中金基金管理有限公司关于中金金元债

券型证券投资基金 2021 年第二次分红公告》，收益分配基准日为 2021 年 3 月 5 日，本期 A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.0350 元，本期 C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.0350 元。

(3) 本基金的基金管理人于 2021 年 4 月 15 日发布《中金基金管理有限公司关于中金金元债券型证券投资基金 2021 年第三次分红公告》，收益分配基准日为 2021 年 4 月 9 日，本期 A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.0520 元，本期 C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.0520 元。

(4) 本基金的基金管理人于 2021 年 6 月 18 日发布《中金基金管理有限公司关于中金金元债券型证券投资基金 2021 年第四次分红公告》，收益分配基准日为 2021 年 6 月 11 日，本期 A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.0750 元，本期 C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.0750 元。

具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在中金金元债券型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《中金金元债券型证券投资基金 2021 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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：中金金元债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 636,225.53 | 1,194,967.57 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 7,383.71 | 67,096.12 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 8,298,469,900.00 | 9,908,696,971.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 7,683,330,500.00 | 9,174,891,500.00 |
| 资产支持证券投资 | | 615,139,400.00 | 733,805,471.00 |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 18,000,129.00 | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 110,059,410.86 | 180,254,193.30 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 50,000.00 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 8,427,173,049.10 | 10,090,263,227.99 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 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 | | 583,398,804.90 | 2,250,095,104.83 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | 501.68 |
| 应付管理人报酬 | | 1,292,884.36 | 1,323,125.89 |
| 应付托管费 | | 323,221.08 | 330,781.46 |
| 应付销售服务费 | | 12.06 | 2.23 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 56,315.24 | 89,863.68 |
| 应交税费 | | 470,082.83 | 434,530.02 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|-------------------|
| 应付利息 | | 196,344.02 | 1,022,039.87 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 110,658.65 | 174,000.00 |
| 负债合计 | | 585,848,323.14 | 2,253,469,949.66 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 7,785,185,091.70 | 7,784,909,300.09 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 56,139,634.26 | 51,883,978.24 |
| 所有者权益合计 | | 7,841,324,725.96 | 7,836,793,278.33 |
| 负债和所有者权益总计 | | 8,427,173,049.10 | 10,090,263,227.99 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，中金金元 A 基金份额净值 1.0072 元，基金份额总额 7,785,141,363.24 份；中金金元 C 基金份额净值 1.0153 元，基金份额总额 43,728.46 份。中金金元份额总额合计为 7,785,185,091.70 份。

6.2 利润表

会计主体：中金金元债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 216,604,245.63 | 229,162,088.81 |
| 1.利息收入 | | 162,809,930.02 | 187,317,042.72 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 5,442,427.07 | 2,538,201.15 |
| 债券利息收入 | | 143,079,127.28 | 172,762,584.73 |
| 资产支持证券利息收入 | | 14,272,403.84 | 9,310,123.62 |
| 买入返售金融资产收入 | | 15,971.83 | 2,706,133.22 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -7,996,923.66 | 67,462,026.57 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -3,049,202.55 | 67,462,026.57 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | -4,947,721.11 | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 61,790,780.49 | -25,617,191.77 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 458.78 | 211.29 |
| 减：二、费用 | | 23,954,290.06 | 24,911,162.14 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 7,770,758.85 | 8,850,114.81 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,942,689.68 | 2,212,528.68 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 68.38 | 546.66 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 15,524.90 | 69,626.43 |
| 5. 利息支出 | | 13,810,170.31 | 13,588,045.04 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 13,810,170.31 | 13,588,045.04 |
| 6. 税金及附加 | | 294,819.29 | 89,651.28 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.19 | 120,258.65 | 100,649.24 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 192,649,955.57 | 204,250,926.67 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 192,649,955.57 | 204,250,926.67 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金金元债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
|-----------------------------------|---------------------------------------|-----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 7,784,909,300.09 | 51,883,978.24 | 7,836,793,278.33 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 192,649,955.57 | 192,649,955.57 |
| 三、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） | 275,791.61 | 317.90 | 276,109.51 |
| 其中：1.基金申购款 | 764,052.78 | 8,641.42 | 772,694.20 |
| 2.基金赎回款 | -488,261.17 | -8,323.52 | -496,584.69 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的 | - | -188,394,617.45 | -188,394,617.45 |

债券型证券投资基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国光大银行股份有限公司（以下简称“光大银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台等共同销售，募集期为 2018 年 10 月 29 日起至 2018 年 11 月 5 日。经向中国证监会备案，《中金金元债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2018 年 11 月 8 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 203,047,444.60 份（含利息转份额 21,550.00 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《中金金元债券型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，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。由于基金销售费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别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。投资者可自行选择认购、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《中金金元债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不投资股票、权证等权益类资产。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况、

2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

本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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

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[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》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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）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。

(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。

(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 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 636, 225. 53 |
| 定期存款 | — |
| 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 | — |
| 合计： | 636, 225. 53 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 | | |
|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 705,996,921.09 | 707,336,000.00 |
| | 银行间市场 | 6,962,019,250.06 | 6,975,994,500.00 |
| | 合计 | 7,668,016,171.15 | 7,683,330,500.00 |
| 资产支持证券 | 617,416,852.10 | 615,139,400.00 | -2,277,452.10 |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 8,285,433,023.25 | 8,298,469,900.00 | 13,036,876.75 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 | |
|-------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 18,000,129.00 | - |
| 合计 | 18,000,129.00 | - |

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自买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|----------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 2,507.24 |
| 应收定期存款利息 | - |

| | |
|------------|----------------|
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | - |
| 应收债券利息 | 106,227,923.96 |
| 应收资产支持证券利息 | 3,825,899.88 |
| 应收买入返售证券利息 | 3,076.48 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 3.30 |
| 合计 | 110,059,410.86 |

注：“其他”为应收存出保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 56,315.24 |
| 合计 | 56,315.24 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021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 | - |
| 预提费用 | 110,658.65 |
| 合计 | 110,658.65 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 中金金元 A | |
|--------|----------------------------|
| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---------------|------------------|------------------|
| 上年度末 | 7,784,670,576.38 | 7,784,670,576.38 |
| 本期申购 | 483,947.68 | 483,947.68 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -13,160.82 | -13,160.82 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 7,785,141,363.24 | 7,785,141,363.24 |

金额单位：人民币元

| 中金金元 C | | |
|---------------|---------------------------------|-------------|
| 项目 | 本期 | |
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 238,723.71 | 238,723.71 |
| 本期申购 | 280,105.10 | 280,105.10 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -475,100.35 | -475,100.35 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 43,728.46 | 43,728.46 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 中金金元 A | | | |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 76,477,006.72 | -24,596,661.12 | 51,880,345.60 |
| 本期利润 | 130,857,679.76 | 61,790,109.22 | 192,647,788.98 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,831.89 | 1,273.16 | 4,105.05 |
| 其中：基金申购款 | 2,900.26 | 1,283.40 | 4,183.66 |
| 基金赎回款 | -68.37 | -10.24 | -78.61 |
| 本期已分配利润 | -188,393,273.11 | - | -188,393,273.11 |
| 本期末 | 18,944,245.26 | 37,194,721.26 | 56,138,966.52 |

单位：人民币元

| 中金金元 C |
|--------|
|--------|

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------|---------|-----------|
| 上年度末 | 4,418.86 | -786.22 | 3,632.64 |
| 本期利润 | 1,495.32 | 671.27 | 2,166.59 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,108.63 | 321.48 | -3,787.15 |
| 其中：基金申购款 | 3,817.99 | 639.77 | 4,457.76 |
| 基金赎回款 | -7,926.62 | -318.29 | -8,244.91 |
| 本期已分配利润 | -1,344.34 | - | -1,344.34 |
| 本期末 | 461.21 | 206.53 | 667.74 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 20,207.59 |
| 定期存款利息收入 | 5,421,111.11 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 884.19 |
| 其他 | 224.18 |
| 合计 | 5,442,427.07 |

注：“其他”为存出保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -3,049,202.55 |
| 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 | -3,049,202.55 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 2,724,257,094.34 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,660,521,114.62 |
| 减：应收利息总额 | 66,785,182.27 |
| 买卖债券差价收入 | -3,049,202.55 |

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 620,750,431.10 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 609,223,721.11 |
| 减：应收利息总额 | 16,474,431.10 |
| 资产支持证券投资收益 | -4,947,721.11 |

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 61,790,780.49 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 58,228,886.81 |
| ——资产支持证券投资 | 3,561,893.68 |

| | |
|----------------------------|---------------|
| ——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 | 61,790,780.49 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 458.78 |
| 合计 | 458.78 |

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 49.90 |
| 银行间市场交易费用 | 15,475.00 |
| 交易基金产生的费用 | - |
| 其中：申购费 | - |
| 赎回费 | - |
| 合计 | 15,524.90 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 审计费用 | 42,151.28 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 上交所查询费 | 600.00 |
| 帐户维护费 | 18,000.00 |

| | |
|-----|------------|
| 开户费 | - |
| 合计 | 120,258.65 |

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

本基金于 2021 年 8 月 23 日公告进行 2021 年度第五次分红，权益登记日为 2021 年 8 月 24 日，除息日为 2021 年 8 月 24 日，红利发放日为 2021 年 8 月 25 日，每 10 份 A 类基金份额派发红利 0.0640 元，每 10 份 C 类基金份额派发红利 0.0640 元。

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 |
|----------------------|-----------------------|
| 中金基金管理有限公司（“中金基金”） | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国光大银行股份有限公司（“光大银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中国国际金融股份有限公司（“中金公司”） | 基金管理人的股东 |

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | |
|-------|---------------------------------------|------------------|--|------------------|
| | 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 成交总额的比例 |
| 中金公司 | 49,822,772.60 | 100.00% | 1,282,969,466.14 | 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 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|-------|----------------------------|----------------|---------------------------------|----------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 中金公司 | - | - | 24,000,000.00 | 100.00% |

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间没有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 2021年1月1日至2021年6月30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 7,770,758.85 | 8,850,114.81 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 122.23 | 520.54 |

注：支付基金管理人中金基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,942,689.68 | 2,212,528.68 |

注：支付基金托管人光大银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05%/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 2021年1月1日至2021年6月30日 | | |
|----------------|---------------------------------|--------|------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中金金元 A | 中金金元 C | 合计 |
| 光大银行 | - | - | - |
| 中金基金 | - | - | - |
| 合计 | - | - | - |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中金金元 A | 中金金元 C | 合计 |
| 光大银行 | - | 0.88 | 0.88 |
| 中金基金 | - | 1.90 | 1.90 |
| 合计 | - | 2.78 | 2.78 |

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费。

2、支付销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.15%的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：C 类基金份额每日应计提的销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-----------|---------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 光大银行 | 636,225.53 | 20,207.59 | 24,468,777.97 | 148,847.69 |

注：1、本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金依法合规参与了基金托管人的关联方中国光大环境(集团)有限公司发行的“21 光大环境 MTN001BC”债券，债券面值 30,000,000 元，成交金额 29,962,062.33 元，平均成交净价 99.8045 元，具体情况请见本基金本报告期内发布的有关重大关联交易的公告。

6.4.11 利润分配情况

中金金元 A

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份 基金份额分红 数 | 现金形式 发放总额 | 再投资形式 发放总额 | 本期利润分配 合计 | 备注 |
|----|--------------------|-----|--------------------|-----------------------|---------------|---------------|---------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2021年 6月21 日 | - | 2021年 6月21 日 | 0.0750 | 58,385,248.57 | 3,275.89 | 58,388,524.46 | |
| 2 | 2021年 4月15 日 | - | 2021年 4月15 日 | 0.0520 | 40,480,403.69 | 617.38 | 40,481,021.07 | |
| 3 | 2021年 3月15 日 | - | 2021年 3月15 日 | 0.0350 | 27,246,340.31 | 10.51 | 27,246,350.82 | |
| 4 | 2021年 1月26 日 | - | 2021年 1月26 日 | 0.0800 | 62,277,360.61 | 16.15 | 62,277,376.76 | |

| | | | | | | | |
|----|---|---|--------|----------------|----------|----------------|--|
| 合计 | - | - | 0.2420 | 188,389,353.18 | 3,919.93 | 188,393,273.11 | |
|----|---|---|--------|----------------|----------|----------------|--|

中金金元 C

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益 登记日 | 除息日 | | 每 10 份 基金份额分 红数 | 现金形式 发放总额 | 再投资形式 发放总额 | 本期利润 分配 合计 | 备注 |
|----|--------------------|-----|--------------------|-----------------------|--------------|---------------|------------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2021 年 6 月 21 日 | - | 2021 年 6 月 21 日 | 0.0750 | 178.40 | 148.44 | 326.84 | |
| 2 | 2021 年 4 月 15 日 | - | 2021 年 4 月 15 日 | 0.0520 | 124.71 | 102.39 | 227.10 | |
| 3 | 2021 年 3 月 15 日 | - | 2021 年 3 月 15 日 | 0.0350 | 76.36 | 68.68 | 145.04 | |
| 4 | 2021 年 1 月 26 日 | - | 2021 年 1 月 26 日 | 0.0800 | 645.36 | - | 645.36 | |
| 合计 | - | - | - | 0.2420 | 1,024.83 | 319.51 | 1,344.34 | |

6.4.12 期末（2021 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/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 2021 年 6 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人民币 583,398,804.90 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 |
|--------|----------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 180212 | 18 国开 12 | 2021 年 7 月 2 日 | 100.33 | 220,000 | 22,072,600.00 |
| 140211 | 14 国开 11 | 2021 年 7 月 1 日 | 107.04 | 3,422,000 | 366,290,880.00 |
| 190305 | 19 进出 05 | 2021 年 7 月 2 日 | 100.68 | 2,500,000 | 251,700,000.00 |
| 合计 | | | | 6,142,000 | 640,063,480.00 |

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

本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。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。

本基金的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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 | 上年度末 |
|--------|-----|------|
|--------|-----|------|

| | 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-----------------|------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | - | 150,133,000.00 |
| 合计 | - | 150,133,000.00 |

注：以上按短期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据。

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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 96,990,000.00 | 1,460,770,000.00 |
| 合计 | 96,990,000.00 | 1,460,770,000.00 |

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 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 2,497,890,000.00 | 2,127,323,000.00 |
| AAA 以下 | 2,867,152,000.00 | 3,052,824,500.00 |
| 未评级 | 39,788,000.00 | - |
| 合计 | 5,404,830,000.00 | 5,180,147,500.00 |

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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 595,127,400.00 | 678,971,971.00 |
| AAA 以下 | 20,012,000.00 | 54,833,500.00 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 615,139,400.00 | 733,805,471.00 |

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 2021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 | 636,225.53 | - | - | - | 636,225.53 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | 7,383.71 | - | - | - | 7,383.71 |
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券、资产支持证券投资 | 870,062,900.00 | 6,877,666,000.00 | 550,741,000.00 | - | 8,298,469,900.00 |
| 买入返售金融资产 | 18,000,129.00 | - | - | - | 18,000,129.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 110,059,410.86 | 110,059,410.86 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 888,706,638.24 | 6,877,666,000.00 | 550,741,000.00 | 110,059,410.86 | 8,427,173,049.10 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 583,398,804.90 | - | - | - | 583,398,804.90 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 12.06 | 12.06 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,292,884.36 | 1,292,884.36 |
| 应付托管费 | - | - | - | 323,221.08 | 323,221.08 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 56,315.24 | 56,315.24 |
| 应交税费 | - | - | - | 470,082.83 | 470,082.83 |
| 应付利息 | - | - | - | 196,344.02 | 196,344.02 |
| 其他负债 | - | - | - | 110,658.65 | 110,658.65 |
| 负债总计 | 583,398,804.90 | - | - | 2,449,518.24 | 585,848,323.14 |
| 利率敏感度缺口 | 305,307,833.34 | 6,877,666,000.00 | 550,741,000.00 | 107,609,892.62 | 7,841,324,725.96 |
| 上年度末 2020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 | 1,194,967.57 | - | - | - | 1,194,967.57 |

| | | | | | |
|---------------------|------------------|------------------|----------------|----------------|-------------------|
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | 67,096.12 | - | - | - | 67,096.12 |
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券、资产支持证券投资 | 3,002,689,471.00 | 6,742,590,500.00 | 163,417,000.00 | - | 9,908,696,971.00 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 180,254,193.30 | 180,254,193.30 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 50,000.00 | 50,000.00 |
| 资产总计 | 3,003,951,534.69 | 6,742,590,500.00 | 163,417,000.00 | 180,304,193.30 | 10,090,263,227.99 |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 2,250,095,104.83 | - | - | - | 2,250,095,104.83 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 501.68 | 501.68 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 2.23 | 2.23 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,323,125.89 | 1,323,125.89 |
| 应付托管费 | - | - | - | 330,781.46 | 330,781.46 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 89,863.68 | 89,863.68 |
| 应交税费 | - | - | - | 434,530.02 | 434,530.02 |
| 应付利息 | - | - | - | 1,022,039.87 | 1,022,039.87 |
| 其他负债 | - | - | - | 174,000.00 | 174,000.00 |
| 负债总计 | 2,250,095,104.83 | - | - | 3,374,844.83 | 2,253,469,949.66 |
| 利率敏感度缺口 | 753,856,429.86 | 6,742,590,500.00 | 163,417,000.00 | 176,929,348.47 | 7,836,793,278.33 |

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（2021 年 6 月 30 日） | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 41,721,832.63 | 47,030,629.56 |

| | | | |
|--|---------------|----------------|----------------|
| | 市场利率上升 25 个基点 | -41,721,832.63 | -47,030,629.56 |
|--|---------------|----------------|----------------|

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。本基金本报告期末主要投资于证券交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，未持有交易性权益类投资品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 8,298,469,900.00 | 98.47 |
| | 其中：债券 | 7,683,330,500.00 | 91.17 |
| | 资产支持证券 | 615,139,400.00 | 7.30 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 18,000,129.00 | 0.21 |
| | 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 | 636,225.53 | 0.01 |
| 8 | 其他各项资产 | 110,066,794.57 | 1.31 |
| 9 | 合计 | 8,427,173,049.10 | 100.00 |

7.2 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

本基金本报告期末未持有股票资产。

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投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票资产。

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

本基金本报告期内无股票交易。

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

本基金本报告期内无股票交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无股票交易。

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 | 4,068,762,500.00 | 51.89 |
| | 其中：政策性金融债 | 2,181,510,500.00 | 27.82 |
| 4 | 企业债券 | 771,306,000.00 | 9.84 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 2,746,272,000.00 | 35.02 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 96,990,000.00 | 1.24 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 7,683,330,500.00 | 97.99 |

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 | 140211 | 14 国开 11 | 6,900,000 | 738,576,000.00 | 9.42 |
| 2 | 2028029 | 20 交通银行 01 | 4,000,000 | 402,480,000.00 | 5.13 |
| 3 | 2120025 | 21 杭州银行小微债 01 | 3,000,000 | 302,310,000.00 | 3.86 |
| 4 | 190305 | 19 进出 05 | 2,500,000 | 251,700,000.00 | 3.21 |
| 5 | 190409 | 19 农发 09 | 2,500,000 | 251,225,000.00 | 3.20 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|---------|-----------------|-----------|----------------|---------------|
| 1 | 2189198 | 21 杭盈 2A2 | 1,500,000 | 137,025,000.00 | 1.75 |
| 2 | 2189200 | 21 邮元家和 2 优先_bc | 1,600,000 | 131,472,000.00 | 1.68 |
| 3 | 2189185 | 21 海元 1 优先 | 1,300,000 | 118,261,000.00 | 1.51 |
| 4 | 159889 | 东花 07A1 | 900,000 | 90,144,000.00 | 1.15 |
| 5 | 139944 | 蚁信 09A | 720,000 | 72,410,400.00 | 0.92 |
| 6 | 2189166 | 21 建元 6A2_bc | 500,000 | 45,815,000.00 | 0.58 |
| 7 | 1989482 | 19 上和 4B | 200,000 | 20,012,000.00 | 0.26 |

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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，除国家开发银行（14 国开 11、18 国开 10）、中国民生银行股份有限公司（20 民生银行二级）、交通银行股份有限公司（20 交通银行 01）、杭州银行股份有限公司（21 杭州银行小微债 01、21 杭盈 2A2）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 12 月 25 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）67 号），对国家开发银行为违规的政府购买服务项目提供融资，项目资本金管理不到位、棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况等违法违规事实进行处罚。

2020 年 9 月 4 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）43 号），对中国民生银行股份有限公司违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资、为“四证”不全的房地产项目提供融资等违法违规事实进行处罚。

2021 年 1 月 15 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局发布行政处罚决定书（沪银保监罚决字（2021）10 号），对交通银行股份有限公司代理销售业务管理严重违反审慎经营规则的违法违规事实进行处罚。

2021 年 5 月 24 日，中国银行保险监督管理委员会浙江监管局发布行政处罚决定书（浙银保监罚决字（2021）25 号），对杭州银行股份有限公司房地产项目融资业务不审慎，流动资金贷款管理不审慎，资金被挪用于支付土地出让金等违法违规事实进行处罚。2021 年 1 月 19 日，中国人民银行杭州市中心支行发布行政处罚决定书（杭银处罚字（2021）6 号），对杭州银行股份有限

公司经收的海关税款存在延压情况、零余额账户退库资金存在被占压情况等违法违规事实进行处罚。

本管理人认为上述事项对国开行、民生银行、交通银行、杭州银行的经营不会产生重大影响，短期来看公司盈利体量较大，处罚金额对其净利润基本没有影响；对公司各项涉及业务的正常开展基本没有影响。

7.11.2 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。

7.11.3 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 | 7,383.71 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 110,059,410.86 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 110,066,794.57 |

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 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 |
| 中金金元 A | 180 | 43,250,785.35 | 7,784,855,335.27 | 99.9963% | 286,027.97 | 0.0037% |
| 中金金元 C | 27 | 1,619.57 | 0.00 | 0.0000% | 43,728.46 | 100.0000% |
| 合计 | 207 | 37,609,589.81 | 7,784,855,335.27 | 99.9958% | 329,756.43 | 0.0042% |

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 | 中金金元 A | 2,651.96 | 0.00003% |
| | 中金金元 C | 1,666.38 | 3.81074% |
| | 合计 | 4,318.34 | 0.00006% |

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的情况

| 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 | 中金金元 A | 0~10 |
| | 中金金元 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中金金元 A | 0~10 |
| | 中金金元 C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中金金元 A | 中金金元 C |
|--------------------------------|------------------|------------|
| 基金合同生效日（2018 年 11 月 8 日）基金份额总额 | 203,027,044.60 | 20,400.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 7,784,670,576.38 | 238,723.71 |
| 本报告期基金总申购份额 | 483,947.68 | 280,105.10 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 13,160.82 | 475,100.35 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 7,785,141,363.24 | 43,728.46 |

§ 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

2021 年 3 月 5 日，本基金管理人发布公告，赵璧先生自 2021 年 3 月 3 日担任公司督察长；李虹女士同日起不再担任公司督察长。同日，本基金管理人发布公告，公司股东中金公司于 2021 年 3 月作出股东决定，赵璧先生不再担任公司第三届董事会董事，任命邱延冰先生担任公司第三届董事会董事。

2021 年 6 月 2 日，本基金管理人发布公告，杨毓莹女士自 2021 年 6 月 1 日起担任公司独立董事；王元先生同日起不再担任公司独立董事。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 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 | |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |

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、全面地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殊要求，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) 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。

3、本基金报告期内无新增或减少交易单元。

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 |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 49,822,772.60 | 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关于设立上海分公司的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021年1月16日 |
| 2 | 中金基金管理有限公司旗下基金2020年第4季度报告提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021年1月22日 |
| 3 | 中金金元债券型证券投资基金2020年第4季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2021年1月22日 |
| 4 | 中金基金管理有限公司关于中金金元债券型证券投资基金2021年第1次分红公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021年1月23日 |
| 5 | 中金金元债券型证券投资基金基金经理变更公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021年1月26日 |
| 6 | 中金金元债券型证券投资基 | 中国证监会规定媒介 | 2021年1月28日 |

| | | | |
|----|--|-----------|-----------------|
| | 金更新招募说明书 2021 年第 1 号 | | |
| 7 | 中金金元债券型证券投资基金基金产品资料概要(更新) | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 1 月 28 日 |
| 8 | 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 | 2021 年 3 月 5 日 |
| 9 | 中金基金管理有限公司关于董事变更的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 3 月 5 日 |
| 10 | 中金基金管理有限公司关于设立厦门分公司的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 3 月 6 日 |
| 11 | 中金基金管理有限公司关于中金金元债券型证券投资基金 2021 年第 2 次分红公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 3 月 13 日 |
| 12 | 中金基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 13 | 中金金元债券型证券投资基金 2020 年年度报告及摘要 | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 14 | 中金基金管理有限公司关于中金金元债券型证券投资基金 2021 年第 3 次分红公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 4 月 15 日 |
| 15 | 中金基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 16 | 中金金元债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 17 | 中金基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》修改基金合同及托管协议的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 4 月 30 日 |
| 18 | 中金基金管理有限公司中金金元债券型证券投资基金基金合同及托管协议 | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 4 月 30 日 |
| 19 | 中金金元债券型证券投资基金更新招募说明书 2021 年第 2 号 | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 4 月 30 日 |
| 20 | 中金金元债券型证券投资基金基金产品资料概要(更新) | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 4 月 30 日 |
| 21 | 关于不法分子假冒“中金基金”名义进行诈骗的风险提示 | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 5 月 26 日 |
| 22 | 关于不法分子假冒“中金基金”名义虚构“中金基金静 | 中国证监会规定媒介 | 2021 年 5 月 27 日 |

| | | | |
|----|---|-----------|------------|
| | 态战略投资项目”进行诈骗活动的风险提示 | | |
| 23 | 中金基金管理有限公司关于公司独立董事变更的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021年6月2日 |
| 24 | 中金基金管理有限公司关于中金金元债券型证券投资基金 2021 年第 4 次分红公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021年6月18日 |
| 25 | 中金金元债券型证券投资基金关联交易公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021年6月23日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|------------------------------------|------------------|------|------|------------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2021 年 01 月 01 日 -2021 年 06 月 30 日 | 7,784,604,717.38 | 0.00 | 0.00 | 7,784,604,717.38 | 99.9925% |

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、中国证监会准予中金金元债券型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金金元债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金金元债券型证券投资基金托管协议》
- 4、本基金申请募集注册的法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 7、报告期内中金金元债券型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告
- 8、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，可咨询基金管理人中金基金管理有限公司。

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

2021 年 8 月 31 日