

中金浙金 6 个月定期开放债券型发起式证
券投资基金
2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 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：2023 年 4 月 21 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 2023 年 4 月 20 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。

本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或超过 50%，本基金不向个人投资者销售。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 中金浙金 |
| 基金主代码 | 006096 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 6 月 21 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,468,578,539.31 份 |
| 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 | 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、封闭期投资策略：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) 信用债券投资策略；5) 中小企业私募债券投资策略；6) 国债期货投资策略；7) 资产支持证券投资策略；2、开放期投资策略。详见《中金浙金 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富(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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 10,977,703.51 |
| 2. 本期利润 | 11,584,125.43 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0079 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,476,817,366.68 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0056 |

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。

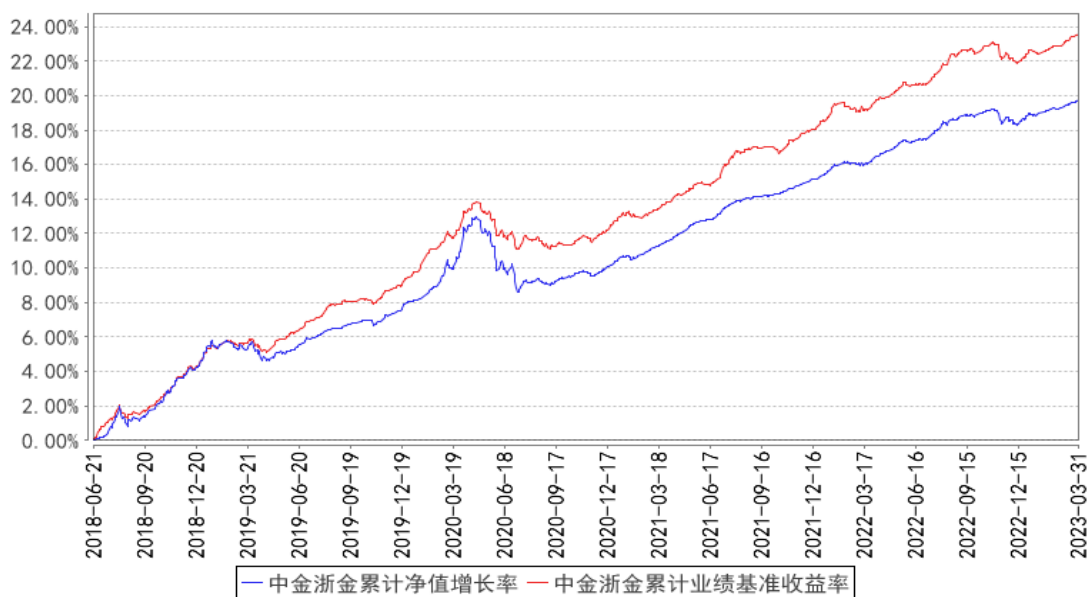
3.2 基金净值表现

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 |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.79% | 0.03% | 0.95% | 0.03% | -0.16% | 0.00% |
| 过去六个月 | 0.81% | 0.05% | 0.92% | 0.06% | -0.11% | -0.01% |
| 过去一年 | 3.04% | 0.04% | 3.49% | 0.05% | -0.45% | -0.01% |
| 过去三年 | 8.05% | 0.07% | 10.03% | 0.06% | -1.98% | 0.01% |
| 自基金合同 生效起至今 | 19.75% | 0.07% | 23.56% | 0.06% | -3.81% | 0.01% |

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

中金浙金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 | | |
| 闫雯雯 | 本基金基金经理 | 2021年1月25日 | - | 13年 | 闫雯雯女士，管理学硕士。历任泰康资产管理有限公司国际投资部、信用评估部研究员；中金基金管理有限公司研究部研究员。现任中金基金管理有限公司固定收益部基金经理。 |

注：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。

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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年一季度，海外经济方面，地缘政治局势复杂，银行流动性风险事件发酵，大宗商品价格有所回落，美联储加息节奏放缓。国内经济方面，“两会”确定经济增长目标，稳增长政策陆续显效，基建持续高增，地产销售逐步回温，消费有所好转，但工业企业利润仍面临考验，拿地低迷掣肘地产景气修复，加之海外需求疲软，出口持续回落，经济基本面偏弱复苏。金融数据方面，社融信贷总量持续走强，结构有待改善，居民储蓄仍在高位，中长期贷款需求修复尚需时间。货币政策方面，降准意外落地，中期借贷便利（MLF）超量续做，加之央行灵活投放公开市场操作（OMO）持续呵护资金面平稳，政策基调保持稳健。信用债方面，随着理财规模逐步企稳，信用利差整体向下修复。

整体而言，一季度债券市场收益率呈现先上后下、总体震荡上行的走势，信用债表现优于利率债。截至一季度末，1 年期和 10 年期国开债到期收益率较去年四季度末相比分别上行 16BPs、3BPs；1 年期和 3 年期 AAA 中债中短期票据到期收益率较去年四季度末分别变动 6BPs、-11BPs。1 月，中期借贷便利（MLF）等价超额续作，降准降息预期落空，加之税期+春节季节性效应，资金面边际收敛，债市收益率震荡上行；2 月，春节后高频数据温和回暖，税期扰动+银行超储偏低+中期借贷便利（MLF）超额续作规模有限，资金面波动加剧，债市收益率震荡上行；3 月，两会目标设定整体温和，叠加中期借贷便利（MLF）等价超额续作+降准意外落地+公开市场操作（OMO）灵活投放，债市收益率震荡下行。一季度，中债-综合财富（总值）指数上涨 1.00%。

本基金以利率债、商业银行债和城投债等为主要投资标的。报告期本基金适当调整杠杆和久期，争取通过积极操作，为投资者带来稳健和较好的投资回报。

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 1.0056 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.79%，业绩比较基准收益率为 0.95%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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 | 1,545,647,710.91 | 99.95 |
| | 其中：债券 | 1,545,647,710.91 | 99.95 |
| | 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 | 807,607.51 | 0.05 |
| 8 | 其他资产 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,546,455,318.42 | 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资产。

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资产。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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资产。

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 | 1,262,874,068.56 | 85.51 |
| | 其中：政策性金融债 | 371,139,201.24 | 25.13 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 148,177,246.58 | 10.03 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 49,238,587.55 | 3.33 |
| 9 | 其他 | 85,357,808.22 | 5.78 |
| 10 | 合计 | 1,545,647,710.91 | 104.66 |

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 | 2120027 | 21 三峡银行小微债 01 | 1,400,000 | 146,521,736.99 | 9.92 |
| 2 | 2128018 | 21 渤海银行 02 | 1,300,000 | 135,258,631.78 | 9.16 |
| 3 | 2128037 | 21 民生银行 01 | 1,300,000 | 131,945,690.41 | 8.93 |
| 4 | 140205 | 14 国开 05 | 1,000,000 | 103,887,671.23 | 7.03 |
| 5 | 2120094 | 21 贵阳银行小微债 01 | 1,000,000 | 101,631,035.62 | 6.88 |

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，渤海银行股份有限公司、中国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。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

本基金本报告期末无其他资产。

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

| | |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,468,578,538.21 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1.10 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,468,578,539.31 |

§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

本基金已成立满三年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

§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 | 2023 年 01 月 01 日 - 2023 年 03 月 31 日 | 1,468,575,374.96 | 0.00 | 0.00 | 1,468,575,374.96 | 99.9998 |

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。

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浙金 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金浙金 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金浙金 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》

- 4、《中金浙金 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金浙金 6 个月定期开放债券型发起式证券投资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和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、报告期内中金浙金 6 个月定期开放债券型发起式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

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

2023 年 4 月 21 日