

中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式 证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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	10
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	11
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内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	38

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	39
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	39
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	39
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.11 投资组合报告附注	39
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	40
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	41
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金	
基金简称	中金安益 30 天滚动持有短债发起	
基金主代码	013111	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 10 月 20 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,022,328,221.54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金安益 30 天滚动持有短债发起 A	中金安益 30 天滚动持有短债发起 C
下属分级基金的交易代码	013111	013112
报告期末下属分级基金的份额总额	39,620,756.02 份	982,707,465.52 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的基础上，重点投资于短期债券，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金将通过研究宏观经济运行状况、货币市场及资本市场资金供求关系，分析国债、金融债、公司债、企业债、短融和中期票据等不同债券板块之间的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例并根据市场变化进行调整。具体包括：1、债券类属配置策略；2、利率策略与久期管理策略；3、信用债投资策略；4、收益率曲线策略；5、资产支持证券投资策略；6、国债期货投资策略；7、信用衍生品投资策略。详见《中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中债-综合全价（一年以下）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。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	席晓峰
	联系电话	010-63211122
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com
客户服务电话	400-868-1166	95555
传真	010-66159121	0755-83195201
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号	深圳市深南大道 7088 号招商银

	国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100004	518040
法定代表人	胡长生	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)		
	中金安益 30 天滚动持有短债发起 A	中金安益 30 天滚动持有短债发起 C	
本期已实现收益	358,581.20	7,835,679.57	
本期利润	815,568.85	21,121,668.43	
加权平均基金份额 本期利润	0.0193	0.0185	
本期加权平均净 值利润率	1.85%	1.78%	
本期基金份额净 值增长率	1.87%	1.78%	
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)		
	期末可供分配利 润	1,728,778.64	39,704,412.87
	期末可供分配基 金份额利润	0.0436	0.0404
	期末基金资产净 值	41,802,219.20	1,033,617,784.41
	期末基金份额净	1.0551	1.0518

值		
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	5.51%	5.18%

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

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

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

4、本基金合同生效日为 2021 年 10 月 20 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金安益 30 天滚动持有短债发起 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	0.22%	0.01%	0.07%	0.01%	0.15%	0.00%
过去三个月	0.94%	0.01%	0.46%	0.01%	0.48%	0.00%
过去六个月	1.87%	0.01%	0.95%	0.01%	0.92%	0.00%
过去一年	2.41%	0.02%	1.39%	0.01%	1.02%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.51%	0.02%	2.75%	0.01%	2.76%	0.01%

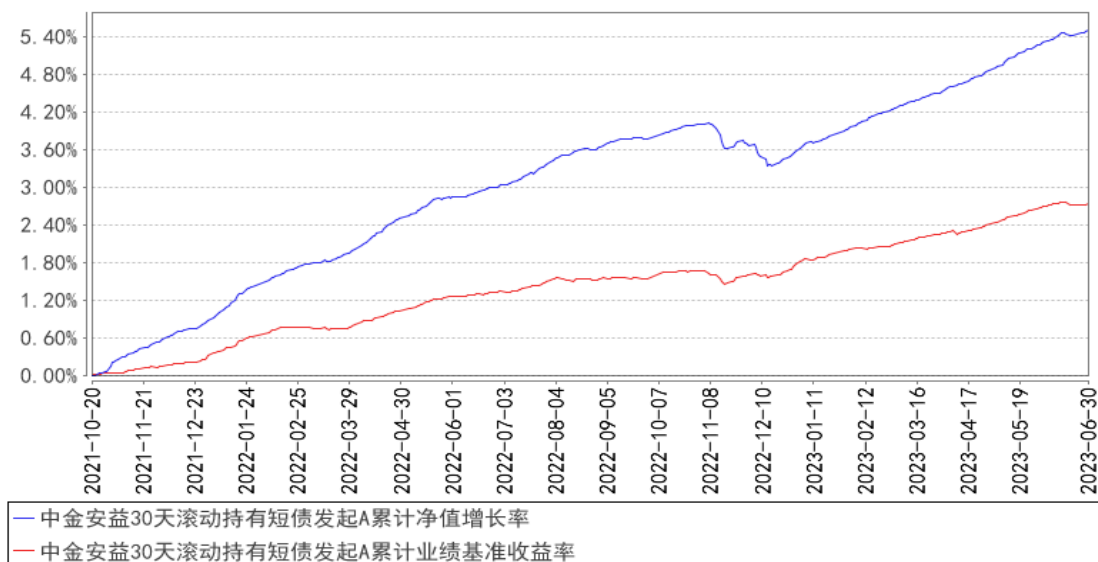
中金安益 30 天滚动持有短债发起 C

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	0.20%	0.01%	0.07%	0.01%	0.13%	0.00%
过去三个月	0.88%	0.01%	0.46%	0.01%	0.42%	0.00%
过去六个月	1.78%	0.01%	0.95%	0.01%	0.83%	0.00%
过去一年	2.23%	0.02%	1.39%	0.01%	0.84%	0.01%
自基金合同生效起	5.18%	0.02%	2.75%	0.01%	2.43%	0.01%

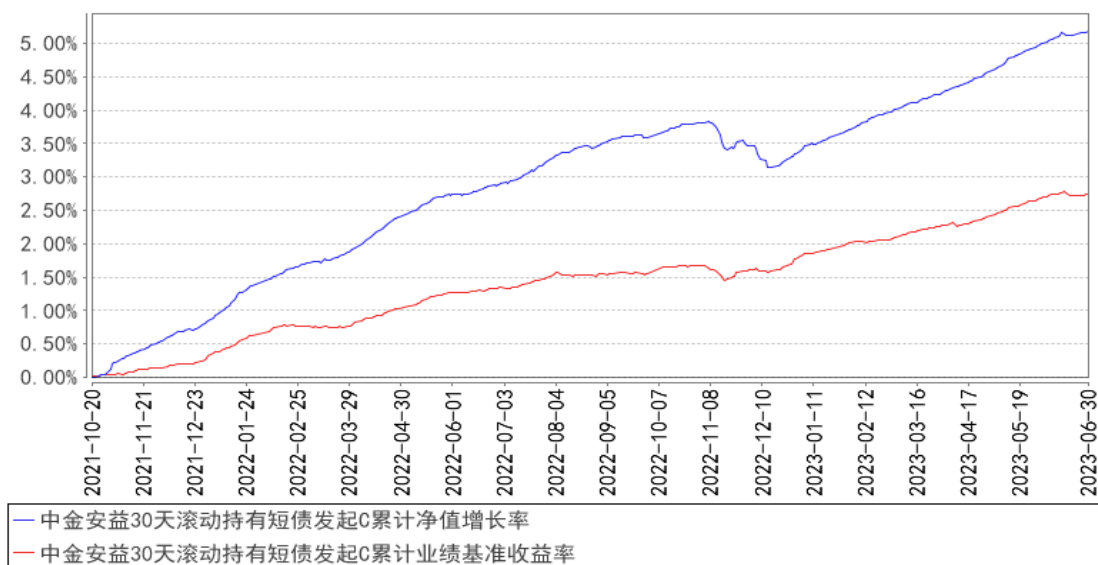
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

中金安益30天滚动持有短债发起A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



中金安益30天滚动持有短债发起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



§ 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 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 45 只公募基金，证券投资基金管理规模 1208.29 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		
石玉	本基金基金经理	2021 年 10 月 20 日	-	17 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。现任中金基金管理有限公司固定收益部基金经理。
杨力元	本基金基金经理	2023 年 4 月 12 日	-	6 年	杨力元女士，经济学硕士。曾任中金基金管理有限公司交易部债券交易员、固定收益部基金经理助理。现任中金基金管理有限公司固定收益部基金经理。
杨力元	本基金基金助理	2021 年 12 月 20 日	2023 年 4 月 12 日	6 年	杨力元女士，经济学硕士。曾任中金基金管理有限公司交易部债券交易员、固定收益部基金经理助理。现任中金基金管理有限公司固定收益部基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，海外部分银行爆发风险事件，美联储加息节奏有所放缓但通胀仍处于较高水平，美债收益率先上后下，10 年美债收益率从年初的 3.79% 回落至 4 月初的 3.30% 后，再度于 6 月末回升至 3.81%。人民币汇率出现一定程度的波动，美元兑人民币价格从年初的 6.91 上升至 6 月末的 7.26。国内方面，一季度，疫后需求集中释放，经济处于稳步复苏阶段，前三月 PMI 指数均在荣枯线以上；二季度，经济内生动能不强，地产投资持续回落，外需下滑，各项经济指标有所走弱，4-6 月份 PMI 指数低于荣枯线。金融数据方面，一季度表现亮眼，四五月份信贷投放节奏有所回落，6 月份再度回升。通胀方面，CPI 同比涨幅震荡回落且处于低位水平，PPI 总体下降，通胀压力整体可控。货币政策方面，央行实施稳健的货币政策，加强逆周期调节，保持流动性合理充裕，降低实体经济融资成本。3 月份全面降准 0.25 个百分点，6 月份下调公开市场操作 7 天逆回购利率 10BP。上半年资金面整体宽松，回购利率中枢有所下移，但仍围绕政策利率附近波动，其中一季度 DR007 均值 2.03%，二季度 DR007 均值 1.93%。

债市上半年呈现震荡偏牛的走势，收益率先上后下，期限利差有所走阔。一季度，受到经济修复、政策预期较高以及资金面扰动等因素影响，债市收益率震荡上行。二季度，受到经济内生动力不足、资金利率中枢整体下行、银行调降存款利率和机构配置需求较强等因素的影响，债市收益率整体下行。上半年，中债-总财富（总值）指数上涨 2.55%，中债-中期票据总财富（总值）指数上涨 2.97%。

操作上，报告期内主要配置短久期中高等级信用债，以票息持有策略为主。整体来看，组合

二季度的久期和杠杆水平略高于一季度。在做好组合流动性管理的同时，根据市场情况也适时参与波段操作，力争为投资者带来更高的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金安益 30 天滚动持有短债发起 A 基金份额净值为 1.0551 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.87%，同期业绩基准收益率为 0.95%；中金安益 30 天滚动持有短债发起 C 基金份额净值为 1.0518 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.78%，同期业绩基准收益率为 0.95%。

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，国内经济或将呈现稳步温和复苏态势。财政政策的投融资节奏或将加快，基建投资增速有望维持较高水平；消费仍存在持续修复空间；地产投资增速在低基数效应下以及优化政策支持下或边际小幅回升，但实质性改善难度较大；出口压力仍较大。从 7 月的政治局会议表述来看，整体政策定调较为积极，下半年逆周期调节力度或将强于上半年。同时，会议也提到发挥总量和结构性货币政策工具作用，预计后续货币政策仍有降准降息空间。

我们预计下半年的债市波动或将加大，但风险整体可控。随着一系列稳增长政策的陆续落地生效，包括地产政策优化、地方债供给放量以及市场风险偏好阶段性提升或对债市形成一定扰动，尤其是在债券收益率整体处于较低水平、银行间杠杆偏高的背景下，债券市场波动或将加大。但考虑到宏观政策大方向仍以高质量发展为核心目标，出台大规模刺激政策概率不高，债市发生大幅调整风险整体可控。同时，稳增长仍需稳健宽松的货币政策保驾护航，中短端品种仍具有一定配置价值。后续重点关注稳增长政策力度和效果、资金利率中枢变化以及机构行为。

本基金将坚持短债基金的定位，继续以短久期票息策略为主，维持适度杠杆，积极控制组合回撤，提高客户体验。同时根据经济基本面和货币政策的变化，及时调整组合久期和杠杆，力争为投资者提供相对稳健的回报。

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，本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，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 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,469,752.78	12,204,609.45
结算备付金		3,633,888.16	100,239,995.47
存出保证金		152,025.00	2,953.25

交易性金融资产	6.4.7.2	1,255,161,304.10	1,510,041,162.19
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,255,161,304.10	1,510,041,162.19
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,613,465.90	1,273,496.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,263,030,435.94	1,623,762,217.17
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		183,435,574.03	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,526,476.53	25,589,803.24
应付管理人报酬		180,064.33	366,970.35
应付托管费		45,016.09	91,742.60
应付销售服务费		155,821.48	323,081.33
应付投资顾问费		-	-
应交税费		109,377.60	237,256.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	158,102.27	240,707.65
负债合计		187,610,432.33	26,849,561.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,022,328,221.54	1,545,140,664.11
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	53,091,782.07	51,771,991.28
净资产合计		1,075,420,003.61	1,596,912,655.39

负债和净资产总计		1, 263, 030, 435. 94	1, 623, 762, 217. 17
----------	--	----------------------	----------------------

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，中金安益 30 天滚动持有短债发起 A 的基金份额净值为 1. 0551 元，期末份额总额为 39, 620, 756. 02 份；中金安益 30 天滚动持有短债发起 C 的基金份额净值为 1. 0518 元，期末份额总额为 982, 707, 465. 52 份。基金份额总额 1, 022, 328, 221. 54 份。

6.2 利润表

会计主体：中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		26, 381, 868. 83	10, 542, 477. 30
1. 利息收入		231, 694. 08	1, 066, 669. 99
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	178, 657. 07	64, 780. 77
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		53, 037. 01	1, 001, 889. 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）		12, 407, 198. 24	9, 765, 730. 58
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	12, 354, 196. 74	9, 765, 730. 58
资产支持证券投资	6. 4. 7. 16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	53, 001. 50	-
股利收益	6. 4. 7. 19	-	-
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	13, 742, 976. 51	-289, 923. 27
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	-	-

减：二、营业总支出		4,444,631.55	1,809,608.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,229,803.60	464,093.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	307,450.86	116,023.40
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,067,447.27	340,118.66
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,628,675.08	840,434.65
其中：卖出回购金融资产支出		1,628,675.08	840,434.65
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		76,085.67	31,402.70
8. 其他费用	6.4.7.23	135,169.07	17,535.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,937,237.28	8,732,868.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,937,237.28	8,732,868.58
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		21,937,237.28	8,732,868.58

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,545,140,664.11	-	51,771,991.28	1,596,912,655.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,545,140,664.11	-	51,771,991.28	1,596,912,655.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-522,812,442.57	-	1,319,790.79	-521,492,651.78
（一）、综合收益总额	-	-	21,937,237.28	21,937,237.28

(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-522,812,442.57		-20,617,446.49	-543,429,889.06
其中: 1. 基金申购款	330,590,233.76		13,966,358.23	344,556,591.99
2. 基金赎回款	-853,402,676.33		-34,583,804.72	-887,986,481.05
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-		-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-		-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,022,328,221.54		53,091,782.07	1,075,420,003.61
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	364,750,969.92	-	3,110,513.10	367,861,483.02
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	364,750,969.92	-	3,110,513.10	367,861,483.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	754,186,178.73	-	29,390,742.77	783,576,921.50
(一)、综合收益总额	-	-	8,732,868.58	8,732,868.58
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	754,186,178.73	-	20,657,874.19	774,844,052.92

其中：1. 基金申购款	1,256,044,735.62	-	31,200,260.03	1,287,244,995.65
2. 基金赎回款	-501,858,556.89	-	-10,542,385.84	-512,400,942.73
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,118,937,148.65	-	32,501,255.87	1,151,438,404.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2021 年 7 月 1 日证监许可(2021)2301 号文注册,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金招募说明书》和《中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式债券型证券投资基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金,托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、招商银行、中国中金财富证券有限公司(以下简称“中金财富证券”)、上海证券责任有限公司共同销售,募集期为自 2021 年 10 月 18 日起至 2021 年 10 月 18 日止期间。经向中国证监会备案,《中金安益 30 天滚动持有短债债券

型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2021 年 10 月 20 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 320,682,459.28 份(含利息转份额 0.00 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。

根据经中国证监会备案的基金合同和《中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金招募说明书》的相关内容,本基金根据认购费、申购费、赎回费、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,但从本类别基金资产中不计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;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,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 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基金份额净值并分别公告,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《中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式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国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、证券公司短期公司债券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、国债期货、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本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》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和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 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率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)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。

(b)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。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，资管产品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。

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。

(c)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。

(d)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。

(e)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。

(f)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。

(g)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
	2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,469,752.78
等于：本金	2,469,477.64
加：应计利息	275.14
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	2,469,752.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	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	-	-	-	
	银行间市场	1,236,573,594.61	19,384,304.10	1,255,161,304.10	-796,594.61
	合计	1,236,573,594.61	19,384,304.10	1,255,161,304.10	-796,594.61
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,236,573,594.61	19,384,304.10	1,255,161,304.10	-796,594.61	

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

单位：人民币元

项目	本期末			备注
	合同/名义金额	2023 年 6 月 30 日		
		公允价值		
	资产	负债		

利率衍生工具	30,383,625.00	-	-	-
其中：国债期货投资	30,383,625.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	30,383,625.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
TS2309	2 年期国债 2309	15.00	30,405,000.00	21,375.00
合计				21,375.00
减：可抵销期货暂收款				21,375.00
净额				-

注：1、衍生金融资产项下的利率衍生工具为国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间抵销后的净额为 0。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	52,403.02
其中：交易所市场	-
银行间市场	52,403.02
应付利息	-
预提费用	105,699.25
合计	158,102.27

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金安益 30 天滚动持有短债发起 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,126,964.43	44,126,964.43
本期申购	10,030,720.77	10,030,720.77
本期赎回（以“-”号填列）	-14,536,929.18	-14,536,929.18
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	39,620,756.02	39,620,756.02

中金安益 30 天滚动持有短债发起 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,501,013,699.68	1,501,013,699.68
本期申购	320,559,512.99	320,559,512.99
本期赎回（以“-”号填列）	-838,865,747.15	-838,865,747.15
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	982,707,465.52	982,707,465.52

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中金安益 30 天滚动持有短债发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,545,088.43	30,870.04	1,575,958.47
本期利润	358,581.20	456,987.65	815,568.85
本期基金份额交易产生的变动数	-174,890.99	-35,173.15	-210,064.14
其中：基金申购款	365,189.77	82,468.59	447,658.36
基金赎回款	-540,080.76	-117,641.74	-657,722.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,728,778.64	452,684.54	2,181,463.18

中金安益 30 天滚动持有短债发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	49,140,909.16	1,055,123.65	50,196,032.81
本期利润	7,835,679.57	13,285,988.86	21,121,668.43
本期基金份额交易产生	-17,272,175.86	-3,135,206.49	-20,407,382.35

的变动数			
其中：基金申购款	10,913,369.61	2,605,330.26	13,518,699.87
基金赎回款	-28,185,545.47	-5,740,536.75	-33,926,082.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,704,412.87	11,205,906.02	50,910,318.89

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
活期存款利息收入	8,746.22	
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	169,906.48	
其他	4.37	
合计	178,657.07	

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

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票买卖差价收入。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
债券投资收益——利息收入	22,088,024.27	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-9,733,827.53	
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	12,354,196.74	

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	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总	2,408,268,773.23	

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,379,670,445.37
减：应计利息总额	38,295,780.39
减：交易费用	36,375.00
买卖债券差价收入	-9,733,827.53

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	53,001.50

6.4.7.19 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	13,722,298.79
股票投资	-
债券投资	13,722,298.79
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	21,300.29
权证投资	-
期货投资	21,300.29
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	622.57
合计	13,742,976.51

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	37,191.88
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
上清所查询费	600.00
划款手续费	19,869.82
合计	135,169.07

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
招商银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东
中国中金财富证券有限公司（以下简称“中金财富证券”）	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

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债券交易。

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
中金公司	-	-	739,524,445.00	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均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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,229,803.60	464,093.57
其中：支付销售机构的客户维护费	525,239.57	133,700.60

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 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	307,450.86	116,023.40

注：支付基金托管人招商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。其计算公式为：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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金安益 30 天滚动持有短债发起 A	中金安益 30 天滚动持有短债发起 C	合计
中金基金		0.57	0.57
招商银行		34,685.63	34,685.63
中金财富证券		320,340.82	320,340.82
合计	-	355,027.02	355,027.02
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金安益 30 天滚动持有短债发起 A	中金安益 30 天滚动持有短债发起 C	合计
中金基金	-	-	-
招商银行	-	120,475.79	120,475.79

中金财富证券	-	161,480.26	161,480.26
合计	-	281,956.05	281,956.05

注：本基金仅针对 C 类基金份额收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日该类基金资产净值 0.18% 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 类基金日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.18%/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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	-	-	-	-	40,420,000.00	1,469.09
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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。

6.4.10.4.2 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自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中金安益 30 天滚动持有短债发起 A

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)
中金公司	10,000,000.00	25.24	10,000,000.00	22.66

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
招商银行	2,469,752.78	8,746.22	1,125,630.54	26,282.13

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2023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 2023 年 06 月 30 日止，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 183,435,574.03 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
012284128	22 首创生态 SCP001	2023 年 7 月 3 日	101.40	500,000	50,702,221.92
012380431	23 山东金融 SCP001	2023 年 7 月 3 日	101.09	200,000	20,217,646.03
102001833	20 南部新城 MTN002	2023 年 7 月 3 日	104.06	300,000	31,218,900.82
102002361	20 汉江国资 MTN006	2023 年 7 月 3 日	102.62	100,000	10,262,274.52
102100322	21 首旅 MTN004	2023 年 7 月 3 日	102.11	200,000	20,422,393.44
102100464	21 首旅	2023 年 7 月 3 日	101.99	48,000	4,895,540.99

	MTN006	日			
170404	17 农发 04	2023 年 7 月 4 日	102.70	590,000	60,591,108.76
合计				1,938,000	198,310,086.48

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	61,701,287.67	-
A-1 以下	-	-
未评级	477,545,338.27	596,040,471.24
合计	539,246,625.94	596,040,471.24

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等。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	401,671,302.33	521,625,863.56
AAA 以下	170,875,611.09	229,794,099.72
未评级	61,221,414.06	60,559,440.00
合计	633,768,327.48	811,979,403.28

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性压力测试、流动性风险预警、指标超标及危机的处理、流动性风险管理工具、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司投资风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性指标进行监控。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可在其持有的基金份额的每个

运作期到期日要求赎回，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	2,469,477.64	-	-	275.14	2,469,752.78
结算备付金	3,631,768.58	-	-	2,119.58	3,633,888.16
存出保证金	-	-	-	152,025.00	152,025.00
交易性金融资产	1,073,208,000.00	162,569,000.00	-	19,384,304.10	1,255,161,304.10
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,613,465.90	1,613,465.90
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,079,309,246.22	162,569,000.00	-	21,152,189.72	1,263,030,435.94

负债					
卖出回购金融资产款	183,409,404.88	-	-	26,169.15	183,435,574.03
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,526,476.53	3,526,476.53
应付销售服务费	-	-	-	155,821.48	155,821.48
应付管理人报酬	-	-	-	180,064.33	180,064.33
应付托管费	-	-	-	45,016.09	45,016.09
应交税费	-	-	-	109,377.60	109,377.60
其他负债	-	-	-	158,102.27	158,102.27
负债总计	183,409,404.88	-	-	4,201,027.45	187,610,432.33
利率敏感度缺口	895,899,841.34	162,569,000.00	-	16,951,162.27	1,075,420,003.61
上年度末 2022 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	12,201,851.77	-	-	2,757.68	12,204,609.45
结算备付金	100,206,468.33	-	-	33,527.14	100,239,995.47
存出保证金	2,951.82	-	-	1.43	2,953.25
交易性金融资产	1,320,231,000.00	169,104,000.00	-	20,706,162.19	1,510,041,162.19
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,273,496.81	1,273,496.81
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,432,642,271.92	169,104,000.00	-	22,015,945.25	1,623,762,217.17
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	25,589,803.24	25,589,803.24
应付销售服务费	-	-	-	323,081.33	323,081.33
应付管理人报酬	-	-	-	366,970.35	366,970.35
应付托管费	-	-	-	91,742.60	91,742.60
应交税费	-	-	-	237,256.61	237,256.61
其他负债	-	-	-	240,707.65	240,707.65
负债总计	-	-	-	26,849,561.78	26,849,561.78
利率敏感度缺口	1,432,642,271.92	169,104,000.00	-	-4,833,616.53	1,596,912,655.39

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-1,699,833.85	-1,916,417.81
	市场利率下降 25 个基点	1,699,833.85	1,916,417.81

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 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

第一层次	-	-
第二层次	1,255,161,304.10	1,510,041,162.19
第三层次	-	-
合计	1,255,161,304.10	1,510,041,162.19

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应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,255,161,304.10	99.38
	其中：债券	1,255,161,304.10	99.38
	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	6,103,640.94	0.48
8	其他各项资产	1,765,490.90	0.14
9	合计	1,263,030,435.94	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

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

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	122,528,234.83	11.39
	其中：政策性金融债	82,146,350.68	7.64
4	企业债券	31,203,320.55	2.90
5	企业短期融资券	539,246,625.94	50.14
6	中期票据	562,183,122.78	52.28
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,255,161,304.10	116.71

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	170404	17 农发 04	600,000	61,618,076.71	5.73

2	012284128	22 首创生态 SCP001	500,000	50,702,221.92	4.71
3	2120050	21 南京银行绿 色金融债 01	400,000	40,381,884.15	3.75
4	012381526	23 华银电力 SCP001	400,000	40,219,449.18	3.74
5	101901099	19 陕煤化 MTN003	300,000	31,464,279.45	2.93

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 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

本基金为短期纯债型基金，投资国债期货以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约进行交易，以管理组合利率风险敞口，降低组合整体波动。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金参与国债期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对可控。

7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 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	152,025.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	1,613,465.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,765,490.90

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 (%)
中金安益 30 天滚动持有短债发起 A	433	91,502.90	10,000,000.00	25.24	29,620,756.02	74.76
中金安益 30 天滚动持有短债发起 C	47,503	20,687.27	-	0.00	982,707,465.52	100.00
合计	47,936	21,326.94	10,000,000.00	0.98	1,012,328,221.54	99.02

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	中金安益 30 天滚动持有短债发起 A	1,241,594.10	3.1337
	中金安益 30 天滚动持有短债发起 C	1,192,640.25	0.1214
	合计	2,434,234.35	0.2381

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	中金安益 30 天滚动持有短债发起 A	0
	中金安益 30 天滚动持有短债发起 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中金安益 30 天滚动持有短债发起 A	0
	中金安益 30 天滚动持有短债发起 C	0
	合计	0

8.4 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	0.98	10,000,000.00	0.98	自基金合同生效之日起不少于三年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.98	10,000,000.00	0.98	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金安益 30 天滚动持有短债发起 A	中金安益 30 天滚动持有短债发起 C
基金合同生效日 (2021 年 10 月 20 日) 基金份额总额	26,038,897.21	294,643,562.07
本报告期期初基金份额总额	44,126,964.43	1,501,013,699.68
本报告期基金总申购份额	10,030,720.77	320,559,512.99
减：本报告期基金总赎回份额	14,536,929.18	838,865,747.15

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	39,620,756.02	982,707,465.52

注：报告期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。

§ 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

2023 年 1 月 20 日，本基金管理人发布公告，赵璧先生自 2023 年 1 月 18 日起担任公司总经理、董事，同日起不再担任公司副总经理；孙菁女士自 2023 年 1 月 18 日起不再担任公司总经理、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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中金公司	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；能根据基金所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中金公司	-	-	-	-	-	-

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高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
2	中金基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
3	中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
4	中金基金管理有限公司关于不法分子假冒“中金基金”名义、虚构“中金基金静态战略投资项目”进行诈骗活	中国证监会规定媒介	2023-03-09

	动的风险提示		
5	中金基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
6	中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
7	中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2023-04-12
8	中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金更新招募说明书 (2023 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2023-04-12
9	中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新 (2023 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2023-04-12
10	中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-04-21
11	中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-21

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有份额比例达到或超过总份额 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金安益 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金安益 30 天滚动持有短债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、报告期内中金安益 30 天滚动持有短债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

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

2023 年 8 月 31 日