

中金安盈 90 天持有期中短债债券型证券投资
基金
2024 年第 2 季度报告

2024 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

报告送出日期：2024 年 7 月 19 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|-------------|---|
| 基金简称 | 中金安盈 90 天持有中短债 |
| 基金主代码 | 016607 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 11 月 15 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 413,343,738.45 份 |
| 投资目标 | 在控制风险的基础上，重点投资于中短期债券，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、国债期货投资策略；6、信用衍生品投资策略。详见《中金安盈 90 天持有期中短债债券型证券投资基金基金合同》。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富(1 年以下)指数收益率*60%+中债综合财富(1-3 年)指数收益率*30%+一年期银行定期存款利率(税后)*10% |
| 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 | 招商银行股份有限公司 |
| 下属分级基金的基金简称 | 中金安盈 90 天持有中短债 A 中金安盈 90 天持有中短债 C |

| | | |
|-----------------|------------------|------------------|
| 下属分级基金的交易代码 | 016607 | 016608 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 140,839,813.24 份 | 272,503,925.21 份 |

§ 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|------------------|
| | 中金安盈 90 天持有中短债 A | 中金安盈 90 天持有中短债 C |
| 1. 本期已实现收益 | 870,675.42 | 1,809,313.82 |
| 2. 本期利润 | 915,342.87 | 1,915,486.63 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0079 | 0.0074 |
| 4. 期末基金资产净值 | 148,830,957.05 | 286,920,561.69 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0567 | 1.0529 |

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

中金安盈 90 天持有中短债 A

| 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 | 0.76% | 0.01% | 0.76% | 0.01% | 0.00% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.71% | 0.01% | 1.55% | 0.01% | 0.16% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.16% | 0.02% | 2.78% | 0.01% | 0.38% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.67% | 0.02% | 4.61% | 0.02% | 1.06% | 0.00% |

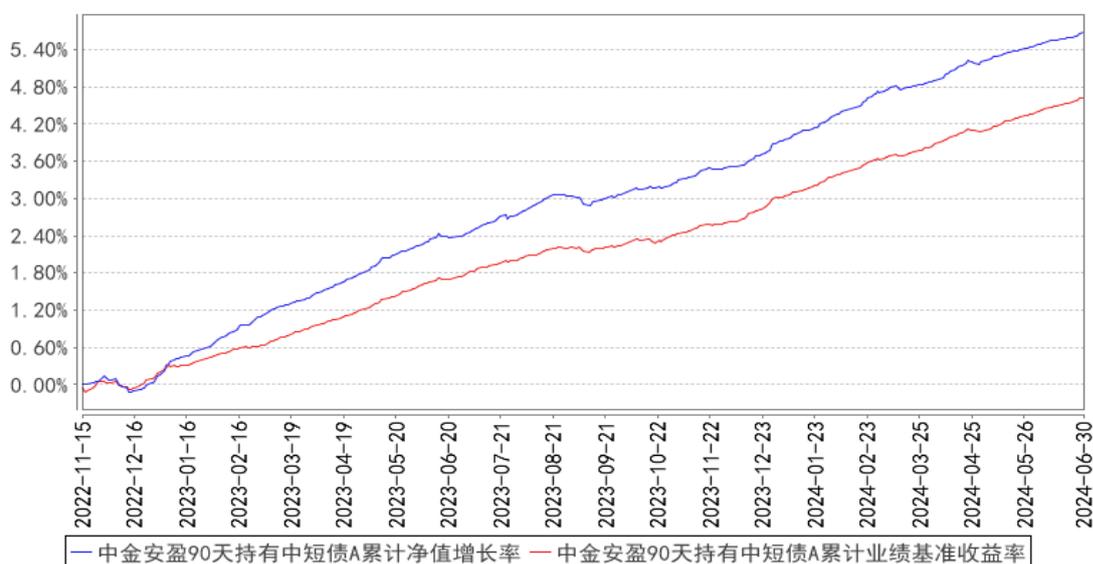
中金安盈 90 天持有中短债 C

| 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

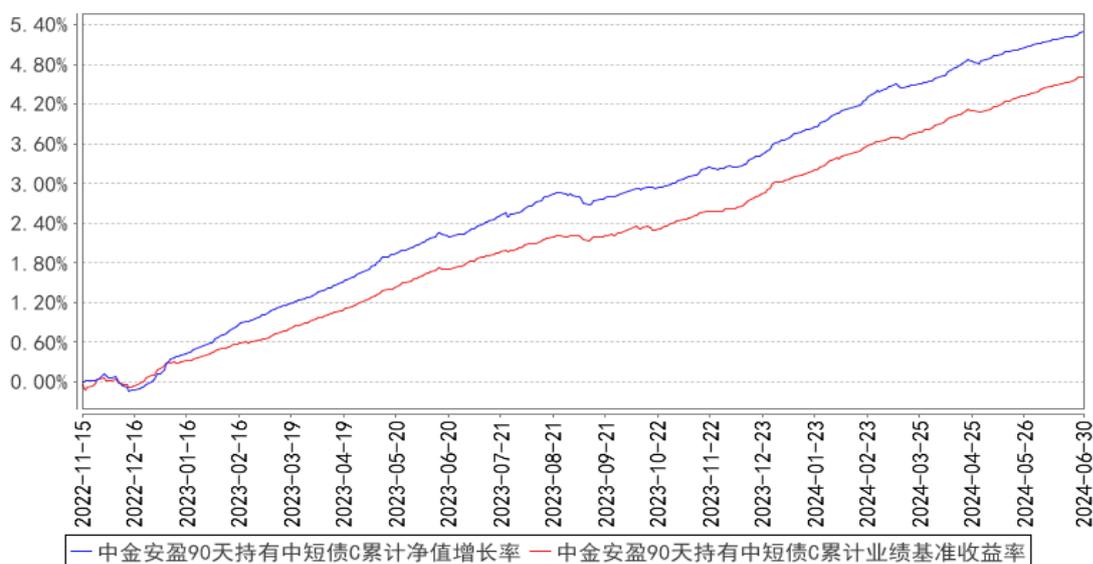
| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.72% | 0.01% | 0.76% | 0.01% | -0.04% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.62% | 0.01% | 1.55% | 0.01% | 0.07% | 0.00% |
| 过去一年 | 2.96% | 0.02% | 2.78% | 0.01% | 0.18% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.29% | 0.02% | 4.61% | 0.02% | 0.68% | 0.00% |

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

中金安盈90天持有中短债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



中金安盈90天持有中短债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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---------|------------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 石玉 | 本基金基金经理 | 2022 年 11 月 15 日 | - | 18 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。 |

注：上述基金经理任职日期为本基金基金合同生效日。

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

二季度，海外主要经济体通胀出现高位回落趋势但仍具粘性，不同国家的经济增长和货币政策有所分化，10 年期美债收益率从 3 月末的 4.20% 上行至 6 月末的 4.36%，美元兑人民币中间价从 3 月末的 7.10 上行至 6 月末的 7.13。国内基本面方面，5 月和 6 月 PMI 均为 49.5%，连续两个月低于荣枯线。地产投资和商品房销售持续低景气，出口有一定支撑。金融数据方面，4 月新增社融为负，5 月新增贷款同比少增，一方面与信贷“挤水分”的因素有关，另一方面也说明当下实体经济融资需求仍然不足。通胀方面，价格指数整体平稳，5 月 CPI 环比季节性略降，同比涨幅与上月相同，PPI 环比由降转涨，同比降幅收窄。货币政策方面，央行二季度虽未开展降准降息操作，但市场流动性仍保持合理充裕，尤其是在税期、月末等关键时点积极投放公开市场操作维稳资金面。资金利率方面，二季度 DR007 加权均值 1.87%，持平于一季度，R007 加权均值 1.94%，较一季度下行 19bp，流动性分层缓解，跨季平稳。

二季度，债券市场收益率继续下行，收益率曲线有所走陡。中短端债券资产受益于资金面整体宽松、禁止手工补息后理财配置需求较多、市场对降准降息的预期等。长端和超长端波动较大，在地产限购政策放松以及特别国债发行计划落地后，长债走出了利空出尽的行情，但同时央行也多次提示关注长期国债收益率的久期风险。整体来看，中债 30 年期国债收益率下行 3bps 至 2.43%，10 年期国债收益率下行 8bps 至 2.21%，1 年期国债收益率下行 18bps 至 1.54%。二季度中债-总财富（总值）指数上涨 1.58%。

操作上，组合精选中短久期中高等级信用债，以票息持有策略为主。同时，根据市场情况灵活调节久期和杠杆，择机参与波段交易，力争为投资者带来更高的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金安盈 90 天持有中短债 A 基金份额净值为 1.0567 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.76%；截至本报告期末中金安盈 90 天持有中短债 C 基金份额净值为 1.0529 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.72%；同期业绩比较基准收益率为 0.76%。

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 | 591,411,023.15 | 99.53 |
| | 其中：债券 | 591,411,023.15 | 99.53 |
| | 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 | 1,800,273.67 | 0.30 |
| 8 | 其他资产 | 985,783.79 | 0.17 |
| 9 | 合计 | 594,197,080.61 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

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。

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 | 40,795,749.29 | 9.36 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,759,510.93 | 7.06 |
| 4 | 企业债券 | 10,373,800.00 | 2.38 |
| 5 | 企业短期融资券 | 160,901,651.30 | 36.93 |
| 6 | 中期票据 | 349,713,561.26 | 80.26 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 29,626,261.30 | 6.80 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 591,411,023.15 | 135.72 |

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 | 112404024 | 24 中国银行 CD024 | 300,000 | 29,626,261.30 | 6.80 |
| 2 | 102001337 | 20 河钢集 MTN006 | 200,000 | 21,324,872.13 | 4.89 |
| 3 | 102281630 | 22 安徽港航 MTN002 | 200,000 | 20,675,593.44 | 4.74 |
| 4 | 150305 | 15 进出 05 | 200,000 | 20,593,786.89 | 4.73 |
| 5 | 102200110 | 22 淮安国投 MTN001 | 200,000 | 20,458,942.08 | 4.70 |

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

本基金为中短期纯债型基金，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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险指标说明 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|-----------|
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | - |
| 国债期货投资本期收益（元） | | | | | 53,339.77 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | - |

注：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。

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，中国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

本基金未投资股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 985,783.79 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 985,783.79 |

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

由于四舍五入的原因，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

| 项目 | 中金安盈 90 天持有中短债 A | 中金安盈 90 天持有中短债 C |
|--------------|---------------------|---------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 100,953,111.57 | 222,380,367.26 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 54,773,205.17 | 92,274,439.43 |

| | | |
|-------------------------------|-------------------|-------------------|
| 减: 报告期期间基金总赎回份额 | 14, 886, 503. 50 | 42, 150, 881. 48 |
| 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 | 140, 839, 813. 24 | 272, 503, 925. 21 |

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金安盈 90 天持有期中短债债券型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金安盈 90 天持有期中短债债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金安盈 90 天持有期中短债债券型证券投资基金托管协议》
- 4、《中金安盈 90 天持有期中短债债券型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金安盈 90 天持有期中短债债券型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、报告期内中金安盈 90 天持有期中短债债券型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

9.2 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。

9.3 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

2024 年 7 月 19 日