

金元顺安沅楹债券型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:金元顺安基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年08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2022年01月01日起至06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 | 9 |
| 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 | 11 |
| 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 | 15 |
| 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 | 15 |
| §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） | 15 |
| 6.1 资产负债表 | 15 |
| 6.2 利润表 | 17 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 19 |
| 6.4 报表附注 | 21 |
| §7 投资组合报告 | 45 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 45 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 45 |
| 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 | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 48 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 50 |
| 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 | 51 |
| 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 | 51 |
| 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 | 51 |
| 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 | 51 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 51 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 52 |
| §8 基金份额持有人信息 | 53 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 53 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 53 |

| | |
|--|----|
| 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 | 54 |
| §9 开放式基金份额变动 | 54 |
| §10 重大事件揭示 | 54 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 54 |
| 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 | 54 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 55 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 55 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 55 |
| 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 | 55 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 55 |
| 10.8 其他重大事件 | 57 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 58 |
| 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 | 59 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 59 |
| §12 备查文件目录 | 59 |
| 12.1 备查文件目录 | 59 |
| 12.2 存放地点 | 59 |
| 12.3 查阅方式 | 59 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 基金名称 | 金元顺安沅楹债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 金元顺安沅楹债券 |
| 基金主代码 | 003135 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年09月22日 |
| 基金管理人 | 金元顺安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,550,749,323.22份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资于债券资产，在控制基金资产净值波动的基础上，严格管理股票资产的投资比例，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金将密切关注债券、股票市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金系债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。 |

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 | 金元顺安基金管理有限公司 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 封涌 | 罗菲菲 |
| | 联系电话 | 021-68881801 | 010-58560666 |
| | 电子邮箱 | service@jysa99.com | tgxxpl@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话 | 400-666-0666 | 95568 | |
| 传真 | 021-68881875 | 010-58560798 | |
| 注册地址 | 中国（上海）自由贸易试验区 花园石桥路33号花旗集团大 厦3608室 | 北京市西城区复兴门内大街2 号 | |
| 办公地址 | 中国（上海）自由贸易试验区 花园石桥路33号花旗集团大 厦3608室 | 北京市西城区复兴门内大街2 号 | |
| 邮政编码 | 200120 | 100031 | |
| 法定代表人 | 任开宇 | 高迎欣 | |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|----------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.jysa99.com |
| 基金中期报告备置地点 | 中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 金元顺安基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室 |

§ 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 (2022年01月01日- 2022年06月30日) |
|---------------|-----------------------------------|
| 本期已实现收益 | -42,722,214.24 |
| 本期利润 | -72,536,439.63 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0435 |
| 本期加权平均净值利润率 | -3.45% |
| 本期基金份额净值增长率 | -2.85% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2022年06月30日) |
| 期末可供分配利润 | 429,140,219.81 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2767 |
| 期末基金资产净值 | 1,979,889,543.03 |
| 期末基金份额净值 | 1.2767 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 (2022年06月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 27.67% |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、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的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；
- 3、表中的“期末”均指报告期最后一日，即06月30日；
- 4、上述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

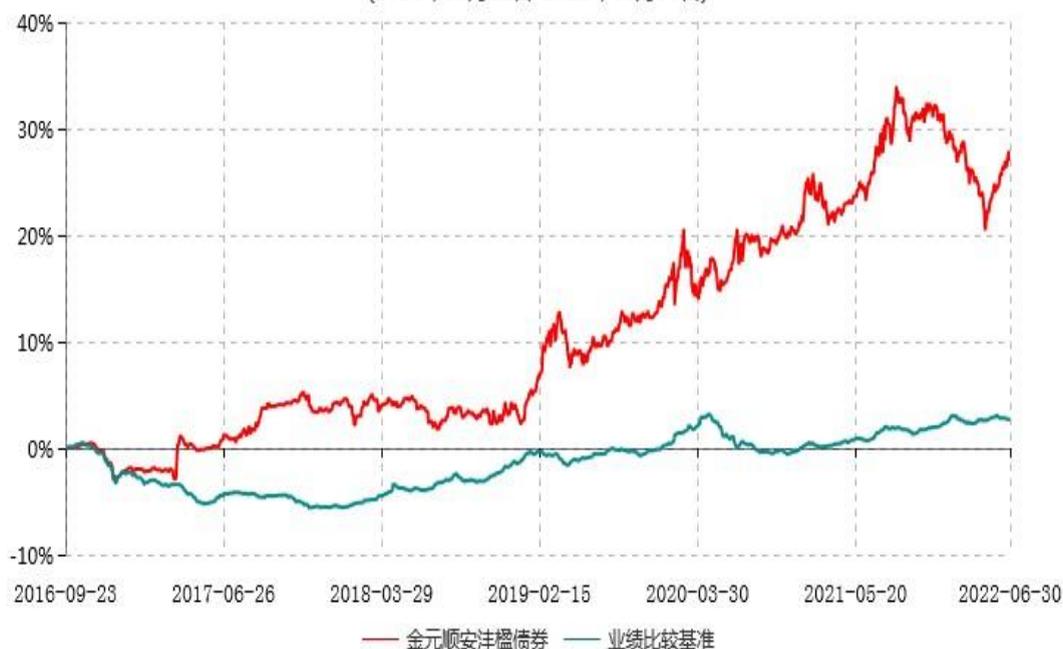
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 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 | 2.37% | 0.32% | -0.24% | 0.03% | 2.61% | 0.29% |
| 过去三个月 | 2.11% | 0.37% | 0.29% | 0.04% | 1.82% | 0.33% |
| 过去六个月 | -2.85% | 0.37% | 0.38% | 0.05% | -3.23% | 0.32% |
| 过去一年 | 1.36% | 0.42% | 1.83% | 0.05% | -0.47% | 0.37% |
| 过去三年 | 16.56% | 0.39% | 3.53% | 0.06% | 13.03% | 0.33% |
| 自基金合同生效起至今 | 27.67% | 0.34% | 0.07% | 24.93% | 0.27% | |

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

金元顺安沅楹债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年09月22日-2022年06月30日)



注：

- 1、本基金合同生效日为2016年09月22日，业绩基准累计增长率以2016年09月21日指数为基准；
- 2、本基金各类资产的投资比例为：本基金投资于债券资产不低于基金资产的80%；投资于股票资产不高于基金资产的20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- 3、本基金业绩比较基准为“中债综合指数收益率”。

§ 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

金元比联基金管理有限公司（以下简称“金元比联”、“公司”或“本基金管理人”，系金元顺安基金管理有限公司前身）成立于2006年11月，由金元证券股份有限公司（以下简称“金元证券”）与比利时联合资产管理公司（以下简称“比联资管”）共同发起设立的中外合资基金管理有限公司。公司总部设在上海陆家嘴，旗下设立北京分公司及子公司—上海金元百利资产管理有限公司。

2012年03月，经中国证监会核准，比联资管将所持有的金元比联49%股权转让于惠理基金管理香港有限公司（以下简称“惠理香港”），公司更名为金元惠理基金管理有限公司（以下简称“金元惠理”）。

2012年10月，经中国证监会核准，公司双方股东按持股比例向公司增资人民币9,500万元，公司注册资本增加至24,500万元。

2016年03月，经中国证监会核准，惠理香港将所持有的金元惠理49%股权转让于上海泉意金融信息服务有限公司（以下简称“泉意金融”），公司更名为金元顺安基金管理有限公司（以下简称“金元顺安”）。

2017年11月，经中国证监会核准，公司双方股东按持股比例向公司增资人民币9,500万元，公司注册资本增加至34,000万元。

2020年04月，公司股东泉意金融更名为“上海前易信息咨询有限公司”。

金元顺安始终坚持以“取信于市场、取信于社会”作为行为准则，遵循“诚实信用，勤勉尽责，以专业经营方式管理和运作基金财产和客户资产，在合法、合规的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，从而使公司稳步、健康发展”的投资理念。遵守法律、行政法规和中国证券监督管理委员会的规定，遵守社会公德、商业道德，诚实守信，遵循基金份额持有人利益优先、公平对待其管理的不同基金财产和客户资产的原则，接受政府和社会公众的监督，承担社会责任。

截止至2022年06月30日，本基金管理人管理金元顺安宝石动力混合型证券投资基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安价值增长混合型证券投资基金、金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安金元宝货币市场基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金、金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安桉盛债券型证券投资基金、金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安沅顺定期开放债券型发起式证券投资基金、金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金、金元顺安沅泉债券型证券投资基金、金元顺安泓丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金、金元顺安医疗健康混合型证券投资基金和金元顺安行业精选混合型证券投资基金共18只开放式证券投资基金。

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 | | |
| 周博 洋 | 本基金基金经理 | 2018- 01-26 | - | 10 年 | 金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金、金元顺安沅顺定期开放债券型发起式证券投资基金和金元顺安沅泉债券型证券投资基金的基金经理，兰卡斯特大学理学硕士。曾任上海新世纪资信评估投资服务有限公司助理分析师，上海证券有限责任公司项目助理。2014年8月加入金元顺安基金管理有限公司。10年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。 |
| 贾丽 杰 | 本基金基金经理 | 2020- 01-22 | - | 12 年 | 金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金和金元顺安医疗健康混合型证券投资基金的基金经理，清华大学理学硕士。曾任 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 渤海证券股份有限公司研究员，中国长城资产管理公司投资经理，东兴证券投资有限公司投资经理，渤海人寿保险股份有限公司投资经理。2018年2月加入金元顺安基金管理有限公司，历任金元顺安价值增长混合型证券投资基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。12年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：

- 1、此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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》、《金元顺安沅楹债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》，建立了科学完善的制度和流程，从事前、事中、事后等各个业务环节严格控制不同基金之间可能存在的利益输送，覆盖了全部开放式基金及特定客户资产管理组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级

市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、考核、监察、惩戒等投资管理活动的各个环节。

在投资环节，本基金管理人建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。在交易环节，为确保交易的公平执行，本基金管理人交易管理实行集中交易，投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开，各投资组合的所有证券买卖活动须通过交易部集中统一完成。在报告分析环节，本基金管理人每季度和每年对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异、对连续四个季度期间内、不同时间窗内（日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差进行分析，根据收益率差异和交易价差的大小，说明是否符合公平交易的原则，由投资组合经理、分管风险管理副总经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

本基金管理人高度重视投资者利益保护。本报告期内，本基金管理人严格遵守公司投资交易业务流程及公平交易制度。公司投资交易行为监控体系由稽核监察部和交易室监督，确保公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，本基金管理人对旗下开放式基金与其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》及其他相关法律法规和公司内部规章制度，制定了《金元顺安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，涵盖了所有可投资证券的一级市场申购、二级市场交易所公开竞价交易、交易所大宗交易、银行间债券交易以及非公开发行股票申购、以公司名义进行的一级市场债券交易等可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本基金管理人采用定量分析和定性分析相结合的方式，建立并严格执行有效的异常交易日常监控制度，形成定期交易监控报告，按照报告路线实行及时报告的机制。本报告期内，未发现异常交易行为。

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

上半年的债券市场先是延续了去年底的宽松态势，但随着国内金融数据超预期和房地产相关政策的陆续放开，对信用扩张的担忧使得市场利率出现了一波调整。在此之后，对于货币政策预期的变化、全国疫情的再现、地产政策的持续放松，使得市场来回在货

币宽松和信用扩张的预期间反应，10年国债整体也是呈现了窄幅震荡的走势，短端利率受益于较为宽松的资金面，1年期国债上半年下行近30bp。转债市场开年一度相对权益表现的更有任性，但随着权益市场的大幅度杀跌，转债也是跟随进行了调整。4月27日政策底出现，权益市场一波估值修复行情，转债市场跟随表现良好，上半年中证转债指数先下后上，半年整体下跌4.07%

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安沅楹债券型证券投资基金份额净值为1.2767元；

本报告期内，基金份额净值增长率为-2.85%，同期业绩比较基准收益率为0.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市我们的落脚点还是在房地产，房地产投资的平稳对维护基本面的稳定起到至关重要的作用。尽管当前部分城市的地产销售已有明显起色，但大部分地区还是呈现出刺激过后需求仍然不足的状态，地产整体销售的可持续性以及对投资的带动作用后续仍然需要观察。当然从中期来看，我们相信稳增长的能力和决心，伴随需求恢复、物价上行等因素，资金面可能也会存在一定的边际收紧，利率届时可能也会打破当前的震荡走势。转债方面，美债的阶段性见顶使得我们不用太担心外部的流动性环境对国内权益市场估值的冲击，但经历了一轮估值修复之后，如果后续央行采取边际收紧的态度，国内市场可能根据业绩差异而呈现分化，叠加转债当前估值水平本已较高，我们倾向于控制住仓位，选择有盈利支撑的双低个券进行配置。股票部分通过行业比较筛选相关的细分行业，重点看好（1）大消费边际回暖预期受益板块如食品饮料、家电家居、医药健康等；（2）持续受益产业结构升级的科技制造板块，如数字经济、新能源（风光、储能、汽车电动化及智能化等）、半导体产业链、工业智能化及军工产业链等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

1、估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由分管运营的副总经理、基金事务部、投资研究部、交易部、风险管理部、监察稽核部等部门总监组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- （1）制定估值制度并在必要时修改；
- （2）确保估值方法符合现行法规；
- （3）批准证券估值的步骤和方法；
- （4）对异常情况做出决策。

分管运营的副总经理担任估值工作小组的组长，分管运营的副总经理在基金事务部总监或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组2/3或以上多数票通过。

2、基金事务部的职责分工

基金事务部负责日常证券资产估值。该部门和公司投资部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金事务部定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金事务部职责：

- (1) 获得独立、完整的证券价格信息；
- (2) 每日证券估值；
- (3) 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- (4) 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- (5) 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- (6) 对估值调整和人工估值进行记录；
- (7) 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金事务部总监认为必要时，可以提议召开估值工作小组会议。

3、投资研究部的职责分工

- (1) 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问询；
- (2) 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
- (3) 评价并确认基金事务部提供的估值报告；
- (4) 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4、交易部的职责分工

- (1) 对基金事务部的证券价格信息需求做出即时回应；
- (2) 通知基金事务部关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- (3) 评价并确认基金事务部提供的估值报告。

5、风险管理部、监察稽核部的职责分工

- (1) 监督证券的整个估值过程；
- (2) 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- (3) 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- (4) 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价值的风险；
- (5) 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问询；
- (6) 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.6.2 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 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：金元顺安沅楹债券型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 8,936,964.05 | 5,701,079.03 |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 结算备付金 | | 5,670,326.70 | 8,081,964.59 |
| 存出保证金 | | 205,860.33 | 461,716.50 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,484,603,029.78 | 2,807,411,724.60 |
| 其中：股票投资 | | 364,334,347.65 | 450,764,792.21 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 2,120,268,682.13 | 2,356,646,932.39 |
| 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 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | 19,739,059.26 | 11,758,606.72 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 893.73 | 509.69 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | 41,922,808.09 |
| 资产总计 | | 2,519,156,133.85 | 2,875,338,409.22 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021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 | 6.4.12.3 | 519,304,972.17 | 473,949,206.37 |
| 应付清算款 | | 18,002,444.43 | 10,604,363.86 |
| 应付赎回款 | | 100,416.93 | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,131,823.28 | 1,323,855.58 |
| 应付托管费 | | 161,689.06 | 189,122.25 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 146,035.99 | 196,525.99 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 419,208.96 | 886,192.23 |
| 负债合计 | | 539,266,590.82 | 487,149,266.28 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 1,550,749,323.22 | 1,817,270,824.12 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 429,140,219.81 | 570,918,318.82 |
| 净资产合计 | | 1,979,889,543.03 | 2,388,189,142.94 |
| 负债和净资产总计 | | 2,519,156,133.85 | 2,875,338,409.22 |

注：

报告截止日2022年06月30日，基金份额净值1.2767元，基金份额总额1,550,749,323.22份。

6.2 利润表

会计主体：金元顺安沅楹债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022年01月01日至 2022年06月30日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日 |
|-----------|---------|-----------------------------------|--|
| 一、营业总收入 | | -57,758,459.23 | 66,748,248.02 |
| 1. 利息收入 | | 103,591.86 | 42,399,185.30 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 99,338.43 | 114,252.76 |

| | | | |
|------------------------|------------|----------------|---------------|
| 债券利息收入 | | - | 42,179,652.23 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 4,253.43 | 105,280.31 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -28,299,777.01 | 17,390,815.87 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -69,114,421.05 | 16,904,945.27 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 39,253,567.06 | -567,291.79 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.12 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 1,561,076.98 | 1,053,162.39 |
| 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） | 6.4.7.16 | -29,814,225.39 | 6,958,193.58 |
| 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 | 251,951.31 | 53.27 |
| 减：二、营业总支出 | | 14,777,980.40 | 15,632,373.86 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 7,318,218.16 | 6,581,357.03 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,045,459.79 | 940,193.83 |

| | | | |
|---------------------|----------|----------------|---------------|
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 6,162,792.19 | 5,238,839.43 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 6,162,792.19 | 5,238,839.43 |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 122,659.90 | 138,778.99 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.18 | 128,850.36 | 2,733,204.58 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -72,536,439.63 | 51,115,874.16 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -72,536,439.63 | 51,115,874.16 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -72,536,439.63 | 51,115,874.16 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安沅楹债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06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） | 1,817,270,824.12 | - | 570,918,318.82 | 2,388,189,142.94 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 1,817,270,824.12 | - | 570,918,318.82 | 2,388,189,142.94 |

| | | | | |
|--|------------------------------------|--------|---------------------|----------------------|
| (基金净值) | 4.12 | | 82 | 2.94 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | -266,521,50 0.90 | - | -141,778,09 9.01 | -408,299,59 9.91 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -72,536,439. 63 | -72,536,439. 63 |
| (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) | -266,521,50 0.90 | - | -69,241,659. 38 | -335,763,16 0.28 |
| 其中:1.基金申购款 | 152,879.08 | - | 40,418.63 | 193,297.71 |
| 2.基金赎回款 | -266,674,37 9.98 | - | -69,282,078. 01 | -335,956,45 7.99 |
| (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) | 1,550,749,32 3.22 | - | 429,140,219. 81 | 1,979,889,54 3.03 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06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) | 1,535,617,13 1.50 | - | 347,564,419. 16 | 1,883,181,55 0.66 |
| 加:会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 1,535,617,13 | - | 347,564,419. | 1,883,181,55 |

| | | | | |
|--|------------------|---|----------------|------------------|
| (基金净值) | 1.50 | | 16 | 0.66 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | 44,273.31 | - | 51,127,906.62 | 51,172,179.93 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 51,115,874.16 | 51,115,874.16 |
| (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) | 44,273.31 | - | 12,032.46 | 56,305.77 |
| 其中:1.基金申购款 | 106,436.74 | - | 26,512.67 | 132,949.41 |
| 2.基金赎回款 | -62,163.43 | - | -14,480.21 | -76,643.64 |
| (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) | 1,535,661,404.81 | - | 398,692,325.78 | 1,934,353,730.59 |

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:

邝晓星

符刃

季泽

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

金元顺安沅楹债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1650号文《关于准予金元顺安沅楹债券型证券投资基金注册的批复》的批准,由金元顺安基金管理有限公司作为基金管理人

向社会公开募集，基金合同于2016年09月22日正式生效，首次设立募集规模为200,971,336.64份基金份额。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金主要投资于债券资产，在控制基金资产净值波动的基础上，严格管理股票资产的投资比例，力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含可分离型可转换债券）、可交换债券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款以及其他银行存款）、非金融企业债务融资工具、同业存单、货币市场工具、股票（含中小板、创业板及其他依法上市的股票）、存托凭证、权证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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准：中债综合指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年06月30日的财务状况以及2022年01月01日至06月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

除下文6.4.5.1会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

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

新金融工具准则

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润【或其他综合收益】。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

2021年12月31日，本基金根据原金融工具准则计量的减值准备金额为人民币0.00元。首次执行日（2022年1月1日），本基金根据新金融工具准则预期信用损失模型重新计量的减值准备金额为人民币0.00元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年04月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3%调整为1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年09月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年05月01日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年01月01日起，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，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01月01日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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年01月01日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月09日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年01月01日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年09月08日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2022年06月30日 |
|------|--------------------|
| 活期存款 | 8,936,964.05 |

| | |
|--------------|--------------|
| 等于：本金 | 8,935,912.29 |
| 加：应计利息 | 1,051.76 |
| 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 | 8,936,964.05 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 | | | | |
|---------------|--------------------|------------------|----------------|------------------|---------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 392,794,054.33 | - | 364,334,347.65 | -28,459,706.68 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 426,444,605.96 | 5,757,710.36 | 435,114,374.18 | 2,912,057.86 |
| | 银行间市场 | 1,647,396,009.27 | 28,736,307.95 | 1,685,154,307.95 | 9,021,990.73 |
| | 合计 | 2,073,840,615.23 | 34,494,018.31 | 2,120,268,682.13 | 11,934,048.59 |

| | | | | |
|--------|----------------------|---------------|----------------------|--------------------|
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 2,466,634,66 9.56 | 34,494,018.31 | 2,484,603,02 9.78 | -16,525,658.0 9 |

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 226.32 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 324,763.09 |
| 其中：交易所市场 | 290,014.13 |
| 银行间市场 | 34,748.96 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 94,219.55 |
| 合计 | 419,208.96 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | |
|---------------|-------------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,817,270,824.12 | 1,817,270,824.12 |
| 本期申购 | 152,879.08 | 152,879.08 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -266,674,379.98 | -266,674,379.98 |
| 本期末 | 1,550,749,323.22 | 1,550,749,323.22 |

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期期初 | 559,868,946.62 | 11,049,372.20 | 570,918,318.82 |
| 本期利润 | -42,722,214.24 | -29,814,225.39 | -72,536,439.63 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -80,567,116.59 | 11,325,457.21 | -69,241,659.38 |
| 其中：基金申购款 | 46,259.68 | -5,841.05 | 40,418.63 |
| 基金赎回款 | -80,613,376.27 | 11,331,298.26 | -69,282,078.01 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 436,579,615.79 | -7,439,395.98 | 429,140,219.81 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|----------|-------------------------------|
| | 活期存款利息收入 |
| 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 | 65,036.19 |
| 其他 | 2,819.13 |
| 合计 | 99,338.43 |

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 498,123,385.96 |
| 减：卖出股票成本总额 | 565,912,374.77 |
| 减：交易费用 | 1,325,432.24 |
| 买卖股票差价收入 | -69,114,421.05 |

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 42,517,640.78 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -3,264,073.72 |
| 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 | 39,253,567.06 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,623,541,028.56 |

| | |
|------------------------|------------------|
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,596,152,160.57 |
| 减：应计利息总额 | 30,632,891.54 |
| 减：交易费用 | 20,050.17 |
| 买卖债券差价收入 | -3,264,073.72 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 1,561,076.98 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,561,076.98 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | -29,814,225.39 |
| ——股票投资 | -30,753,721.27 |
| ——债券投资 | 939,495.88 |
| ——资产支持证券投资 | - |

| | |
|------------------------|----------------|
| ——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 | -29,814,225.39 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 251,951.12 |
| 转换费收入 | 0.19 |
| 合计 | 251,951.31 |

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 审计费用 | 34,712.18 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 16,030.81 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 其他费用 | 600.00 |
| 合计 | 128,850.36 |

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露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

本基金本报告期不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。

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 |
|----------------|-----------------------|
| 金元顺安基金管理有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 金元证券股份有限公司 | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 上海前易信息咨询服务有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 上海金元百利资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |

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均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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未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 2022年01月01日至2022年06月30日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 7,318,218.16 | 6,581,357.03 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 53,456.77 | 256.88 |

注：

基金管理费按前一日的基金资产净值的0.70%的年费率计提。

计算方法如下： $H=E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$ ，

H为每日应计提的基金管理费，

E为前一日的基金资产净值，

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,045,459.79 | 940,193.83 |

注：

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。

计算方法如下： $H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ ，

H为每日应计提的基金托管费，

E为前一日的基金资产净值，

基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节

假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

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 2022年01月01日至2022年06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 |
| 中国民生银行 股份有限公司 | - | - | - | - | 303,900,0 00.00 | 164,91 4.72 |
| 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06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 |
| 中国民生银行 股份有限公司 | - | - | - | - | 94,500,00 0.00 | 74,64 2.57 |

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均未发生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均未发生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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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 2022年01月01日至2022年06月30日 | | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 | |
|--------------|-------------------------------|-----------|------------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 8,936,964.05 | 31,483.11 | 13,912,240.13 | 21,251.73 |

注：

本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2022年01月01日至2021年06月30日止期间获得的利息收入为65,036.19元，2022年06月30日止结算备付金余额为人民币5,670,326.7元。2021年01月01日至2021年06月30日止期间获得的利息收入为88,494.28元，2021年06月30日止结算备付金余额为人民币7,424,344.23元。

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均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06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

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 |
|-----------|--------------|------------|--------|-----------|----------------|
| 101900157 | 19兴创投资MTN001 | 2022-07-04 | 105.39 | 200,000 | 21,077,151.78 |
| 102001646 | 20成华旧城MTN001 | 2022-07-04 | 104.84 | 200,000 | 20,968,004.38 |
| 102002361 | 20汉江国资MTN006 | 2022-07-04 | 103.78 | 350,000 | 36,323,960.82 |
| 102102178 | 21上虞国投MTN002 | 2022-07-04 | 103.73 | 300,000 | 31,118,778.08 |
| 190406 | 19农发06 | 2022-07-01 | 107.76 | 1,100,000 | 118,533,016.44 |
| 220201 | 22国开01 | 2022-07-07 | 101.06 | 400,000 | 40,423,079.45 |
| 220304 | 22进出04 | 2022-07-07 | 100.28 | 500,000 | 50,140,205.48 |
| 合计 | | | | 3,050,000 | 318,584,196.43 |

注：

截至本报告期末2022年06月30日止，基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币289,304,972.17元，其中，人民币104,521,472.60元于2022年07月01日到期，人民币99,777,725.49元于2022年07月04日到期，人民币85,005,774.08元于2022年07月07日到期。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30日止，本基金因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为230,000,000.00元，于2022年07月07日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2022年06月30日止，本基金无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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入公司各个业务层面的全面控制过程之中，并建立了三道防线：以各岗位职责为基础，形成第一道防线；通过相关岗位之间、相关部门之间相互监督制衡，形成第二道防线；由督察长、分管风险管理副总经理、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务进行监督、检查、评价，形成的第三道防线。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金投资于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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | - | 20,098,000.00 |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | 172,105,695.89 | 199,968,000.00 |
| 合计 | 172,105,695.89 | 220,066,000.00 |

注：

未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债及超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

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 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | 1,010,531,439.40 | 918,411,820.29 |
| AAA以下 | 509,455,815.86 | 788,332,112.10 |
| 未评级 | 428,175,730.98 | 429,837,000.00 |
| 合计 | 1,948,162,986.24 | 2,136,580,932.39 |

注：

未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用

现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注6.4.12中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、存出保证金、结算备付金、债券投资等。生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022年0 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 | 8,936,964.05 | - | - | - | 8,936,964.05 |
| 结算备付金 | 5,670,326.70 | - | - | - | 5,670,326.70 |
| 存出保证金 | 205,860.33 | - | - | - | 205,860.33 |
| 交易性金融资产 | 632,830,970.89 | 1,338,612,901.04 | 148,824,810.20 | 364,334,347.65 | 2,484,603,029.78 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---------------------|----------------|------------------|----------------|----------------|------------------|
| 应收证券清算款 | - | - | - | 19,739,059.26 | 19,739,059.26 |
| 应收申购款 | - | - | - | 893.73 | 893.73 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 647,644,121.97 | 1,338,612,901.04 | 148,824,810.20 | 384,074,300.64 | 2,519,156,133.85 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 100,416.93 | 100,416.93 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,131,823.28 | 1,131,823.28 |
| 应付托管费 | - | - | - | 161,689.06 | 161,689.06 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 519,304,972.17 | - | - | - | 519,304,972.17 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 18,002,444.43 | 18,002,444.43 |
| 应交税费 | - | - | - | 146,035.99 | 146,035.99 |
| 其他负债 | - | - | - | 419,208.96 | 419,208.96 |
| 负债总计 | 519,304,972.17 | - | - | 19,961,618.65 | 539,266,590.82 |
| 利率敏感度缺口 | 128,339,149.80 | 1,338,612,901.04 | 148,824,810.20 | 364,112,681.99 | 1,979,889,543.03 |
| 上年度末 2021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 | 5,701,079.03 | - | - | - | 5,701,079.03 |

| | | | | | |
|-----------|----------------|------------------|----------------|----------------|------------------|
| 款 | | | | | |
| 结算备付金 | 8,081,964.59 | - | - | - | 8,081,964.59 |
| 存出保证金 | 461,716.50 | - | - | - | 461,716.50 |
| 交易性金融资产 | 779,008,532.39 | 1,329,928,400.00 | 247,710,000.00 | 450,764,792.21 | 2,807,411,724.60 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 11,758,606.72 | 11,758,606.72 |
| 其他资产 | - | - | - | 41,922,808.09 | 41,922,808.09 |
| 应收申购款 | - | - | - | 509.69 | 509.69 |
| 资产总计 | 793,253,292.51 | 1,329,928,400.00 | 247,710,000.00 | 504,446,716.71 | 2,875,338,409.22 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 473,949,206.37 | - | - | - | 473,949,206.37 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 10,604,363.86 | 10,604,363.86 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,323,855.58 | 1,323,855.58 |
| 应付托管费 | - | - | - | 189,122.25 | 189,122.25 |
| 应交税费 | - | - | - | 196,525.99 | 196,525.99 |
| 其他负债 | - | - | - | 886,192.23 | 886,192.23 |
| 负债总计 | 473,949,206.37 | - | - | 13,200,059.91 | 487,149,266.28 |
| 利率敏感度缺口 | 319,304,086.14 | 1,329,928,400.00 | 247,710,000.00 | 491,246,656.80 | 2,388,189,142.94 |

注：

表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | |
|----|---|
| 假设 | 1、以中央国债登记结算有限责任公司公布的2022年06月30日和2021年12月3 |
|----|---|

| | | | |
|----|---|---------------------------------|---------------------|
| | 1日各债券的基点价值（BP价值）为主要计算依据； | | |
| 假设 | 2、债券持仓结构保持不变； | | |
| 假设 | 3、银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； | | |
| 假设 | 4、该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。 | | |
| 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 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| | 基准利率增加一个基点 | -412,835.91 | -451,448.31 |
| | 基准利率减少一个基点 | 413,004.86 | 451,672.45 |

注：

上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 | | 上年度末 2021年12月31日 | |
|----|--------------------|-----|---------------------|-----|
| | 公允价值 | 占基金 | 公允价值 | 占基金 |
| | | | | |

| | | 资产净 值比例 (%) | | 资产净 值比例 (%) |
|---------------|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| 交易性金融资产—股票投资 | 364,334,347.65 | 18.40 | 450,764,792.21 | 18.87 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 364,334,347.65 | 18.40 | 450,764,792.21 | 18.87 |

注：

本基金投资于债券资产不低于基金资产的80%；投资于股票和存托凭证资产不高于基金资产的20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

于2022年06月30日，本基金面临的整体其他价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--|-----------------------------|---------------------|
| 假设 | 1、本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合中股票投资的贝塔系数紧密相关； | | |
| | 2、以下分析中，除市场指标发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变； | | |
| 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 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| | 沪深300指数上涨5% | 21,899,097.36 | 18,869,772.52 |
| | 沪深300指数下跌5% | -21,899,097.36 | -18,869,772.52 |

注：

本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：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

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次 | 419,620,208.39 | 523,351,724.60 |
| 第二层次 | 2,064,982,821.39 | 2,284,060,000.00 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 2,484,603,029.78 | 2,807,411,724.60 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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均未持有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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2022年8月30日经本基金的基金管理人批准。

§ 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 | 364,334,347.65 | 14.46 |
| | 其中：股票 | 364,334,347.65 | 14.46 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,120,268,682.13 | 84.17 |
| | 其中：债券 | 2,120,268,682.13 | 84.17 |
| | 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 | 14,607,290.75 | 0.58 |
| 8 | 其他各项资产 | 19,945,813.32 | 0.79 |
| 9 | 合计 | 2,519,156,133.85 | 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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 25,652,195.00 | 1.30 |
| C | 制造业 | 315,293,419.65 | 15.92 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,463,020.00 | 0.17 |
| E | 建筑业 | 5,937,128.00 | 0.30 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 6,270,237.00 | 0.32 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 7,718,348.00 | 0.39 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 364,334,347.65 | 18.40 |

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的股票。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|
|----|------|------|-------|---------|-----------|

| | | | | | (%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 1 | 300769 | 德方纳米 | 38,340 | 15,668,791.20 | 0.79 |
| 2 | 300054 | 鼎龙股份 | 652,501 | 13,813,446.17 | 0.70 |
| 3 | 002487 | 大金重工 | 323,700 | 13,508,001.00 | 0.68 |
| 4 | 603659 | 璞泰来 | 143,100 | 12,077,640.00 | 0.61 |
| 5 | 601012 | 隆基绿能 | 171,080 | 11,399,060.40 | 0.58 |
| 6 | 300351 | 永贵电器 | 656,700 | 10,966,890.00 | 0.55 |
| 7 | 002738 | 中矿资源 | 114,800 | 10,631,628.00 | 0.54 |
| 8 | 300438 | 鹏辉能源 | 171,000 | 10,507,950.00 | 0.53 |
| 9 | 600745 | 闻泰科技 | 122,700 | 10,442,997.00 | 0.53 |
| 10 | 002756 | 永兴材料 | 66,600 | 10,137,186.00 | 0.51 |
| 11 | 002840 | 华统股份 | 563,400 | 9,944,010.00 | 0.50 |
| 12 | 603456 | 九洲药业 | 191,500 | 9,900,550.00 | 0.50 |
| 13 | 688598 | 金博股份 | 33,507 | 9,874,512.90 | 0.50 |
| 14 | 600096 | 云天化 | 313,100 | 9,856,388.00 | 0.50 |
| 15 | 603363 | 傲农生物 | 514,600 | 9,525,246.00 | 0.48 |
| 16 | 603260 | 合盛硅业 | 80,700 | 9,519,372.00 | 0.48 |
| 17 | 600460 | 士兰微 | 164,400 | 8,548,800.00 | 0.43 |
| 18 | 601001 | 晋控煤业 | 450,100 | 7,989,275.00 | 0.40 |
| 19 | 603650 | 彤程新材 | 239,600 | 7,806,168.00 | 0.39 |
| 20 | 603688 | 石英股份 | 58,500 | 7,757,685.00 | 0.39 |
| 21 | 300015 | 爱尔眼科 | 172,400 | 7,718,348.00 | 0.39 |
| 22 | 601225 | 陕西煤业 | 335,600 | 7,108,008.00 | 0.36 |
| 23 | 002345 | 潮宏基 | 1,462,000 | 6,710,580.00 | 0.34 |
| 24 | 688050 | 爱博医疗 | 29,636 | 6,644,391.20 | 0.34 |
| 25 | 000739 | 普洛药业 | 314,065 | 6,482,301.60 | 0.33 |
| 26 | 300179 | 四方达 | 403,400 | 6,325,312.00 | 0.32 |
| 27 | 603501 | 韦尔股份 | 36,500 | 6,315,595.00 | 0.32 |
| 28 | 601088 | 中国神华 | 188,400 | 6,273,720.00 | 0.32 |
| 29 | 300759 | 康龙化成 | 65,850 | 6,270,237.00 | 0.32 |
| 30 | 688116 | 天奈科技 | 36,978 | 6,267,031.44 | 0.32 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 31 | 605388 | 均瑶健康 | 360,900 | 6,196,653.00 | 0.31 |
| 32 | 300751 | 迈为股份 | 12,240 | 6,008,616.00 | 0.30 |
| 33 | 601669 | 中国电建 | 754,400 | 5,937,128.00 | 0.30 |
| 34 | 002897 | 意华股份 | 130,800 | 5,768,280.00 | 0.29 |
| 35 | 600399 | 抚顺特钢 | 300,600 | 5,380,740.00 | 0.27 |
| 36 | 300850 | 新强联 | 57,700 | 5,137,031.00 | 0.26 |
| 37 | 000400 | 许继电气 | 250,500 | 4,809,600.00 | 0.24 |
| 38 | 002782 | 可立克 | 281,800 | 4,801,872.00 | 0.24 |
| 39 | 605358 | 立昂微 | 68,968 | 4,647,063.84 | 0.23 |
| 40 | 600711 | 盛屯矿业 | 551,700 | 4,281,192.00 | 0.22 |
| 41 | 300655 | 晶瑞电材 | 218,569 | 4,218,381.70 | 0.21 |
| 42 | 003026 | 中晶科技 | 72,500 | 4,210,075.00 | 0.21 |
| 43 | 300896 | 爱美客 | 6,800 | 4,080,068.00 | 0.21 |
| 44 | 000049 | 德赛电池 | 86,600 | 3,905,660.00 | 0.20 |
| 45 | 603612 | 索通发展 | 102,100 | 3,762,385.00 | 0.19 |
| 46 | 601778 | 晶科科技 | 641,300 | 3,463,020.00 | 0.17 |
| 47 | 000933 | 神火股份 | 249,400 | 3,262,152.00 | 0.16 |
| 48 | 300286 | 安科瑞 | 114,500 | 3,108,675.00 | 0.16 |
| 49 | 002179 | 中航光电 | 46,860 | 2,967,175.20 | 0.15 |
| 50 | 601126 | 四方股份 | 147,900 | 2,397,459.00 | 0.12 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 002756 | 永兴材料 | 14,944,752.00 | 0.63 |
| 2 | 600096 | 云天化 | 13,879,442.00 | 0.58 |
| 3 | 002487 | 大金重工 | 13,246,953.00 | 0.55 |
| 4 | 601001 | 晋控煤业 | 12,946,920.00 | 0.54 |
| 5 | 300769 | 德方纳米 | 11,925,032.00 | 0.50 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 6 | 603659 | 璞泰来 | 11,762,088.80 | 0.49 |
| 7 | 601636 | 旗滨集团 | 11,709,117.36 | 0.49 |
| 8 | 603260 | 合盛硅业 | 11,611,510.00 | 0.49 |
| 9 | 688556 | 高测股份 | 11,545,251.93 | 0.48 |
| 10 | 601668 | 中国建筑 | 11,532,615.00 | 0.48 |
| 11 | 601012 | 隆基绿能 | 9,994,725.35 | 0.42 |
| 12 | 603456 | 九洲药业 | 9,990,852.00 | 0.42 |
| 13 | 600460 | 士兰微 | 9,990,023.00 | 0.42 |
| 14 | 000739 | 普洛药业 | 9,985,814.00 | 0.42 |
| 15 | 300438 | 鹏辉能源 | 9,782,834.00 | 0.41 |
| 16 | 603363 | 傲农生物 | 9,782,216.00 | 0.41 |
| 17 | 002840 | 华统股份 | 9,780,125.00 | 0.41 |
| 18 | 300351 | 永贵电器 | 9,773,047.00 | 0.41 |
| 19 | 300179 | 四方达 | 9,743,234.00 | 0.41 |
| 20 | 603882 | 金域医学 | 9,674,730.00 | 0.41 |

注：

本项的“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|--------------------|
| 1 | 300316 | 晶盛机电 | 18,797,112.30 | 0.79 |
| 2 | 688599 | 天合光能 | 18,410,899.27 | 0.77 |
| 3 | 600111 | 北方稀土 | 15,974,424.00 | 0.67 |
| 4 | 000733 | 振华科技 | 15,659,123.00 | 0.66 |
| 5 | 300450 | 先导智能 | 14,255,715.00 | 0.60 |
| 6 | 002459 | 晶澳科技 | 13,932,610.06 | 0.58 |
| 7 | 688556 | 高测股份 | 12,938,637.63 | 0.54 |
| 8 | 300026 | 红日药业 | 11,905,024.00 | 0.50 |
| 9 | 002837 | 英维克 | 11,150,647.86 | 0.47 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 10 | 300031 | 宝通科技 | 10,645,541.45 | 0.45 |
| 11 | 601668 | 中国建筑 | 10,384,248.00 | 0.43 |
| 12 | 600933 | 爱柯迪 | 10,100,620.00 | 0.42 |
| 13 | 600096 | 云天化 | 9,646,370.00 | 0.40 |
| 14 | 600378 | 昊华科技 | 9,612,009.00 | 0.40 |
| 15 | 300373 | 扬杰科技 | 9,311,870.00 | 0.39 |
| 16 | 601636 | 旗滨集团 | 9,014,354.00 | 0.38 |
| 17 | 688518 | 联赢激光 | 9,007,505.71 | 0.38 |
| 18 | 300035 | 中科电气 | 8,827,774.59 | 0.37 |
| 19 | 300590 | 移为通信 | 8,793,712.00 | 0.37 |
| 20 | 003031 | 中瓷电子 | 7,925,235.00 | 0.33 |

注：

本项的“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 510,235,651.48 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 498,123,385.96 |

注：

本项的“买入股票的成本”、“卖出股票的收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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 | 606,183,850.42 | 30.62 |
| | 其中：政策性金融债 | 353,218,991.79 | 17.84 |
| 4 | 企业债券 | 379,828,513.44 | 19.18 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 1,078,970,457.53 | 54.50 |

| | | | |
|----|-----------|------------------|--------|
| 7 | 可转债(可交换债) | 55,285,860.74 | 2.79 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,120,268,682.13 | 107.09 |

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 | 190406 | 19农发06 | 1,100,000 | 118,533,016.44 | 5.99 |
| 2 | 2028013 | 20农业银行二级01 | 900,000 | 90,666,443.84 | 4.58 |
| 3 | 2228017 | 22邮储银行二级01 | 600,000 | 60,961,364.38 | 3.08 |
| 4 | 102101356 | 21徐州经开MTN002 | 500,000 | 52,225,652.05 | 2.64 |
| 5 | 102001899 | 20即墨旅投MTN001 | 500,000 | 52,189,534.25 | 2.64 |

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。

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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 | 205,860.33 |
| 2 | 应收清算款 | 19,739,059.26 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 893.73 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 19,945,813.32 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|---------------|
| 1 | 128129 | 青农转债 | 7,971,840.20 | 0.40 |
| 2 | 110053 | 苏银转债 | 6,967,925.01 | 0.35 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 3 | 113052 | 兴业转债 | 4,895,680.06 | 0.25 |
| 4 | 113516 | 苏农转债 | 4,424,067.49 | 0.22 |
| 5 | 110079 | 杭银转债 | 4,034,093.63 | 0.20 |
| 6 | 110043 | 无锡转债 | 3,966,596.55 | 0.20 |
| 7 | 110073 | 国投转债 | 3,924,753.97 | 0.20 |
| 8 | 128034 | 江银转债 | 3,397,784.62 | 0.17 |
| 9 | 113044 | 大秦转债 | 3,367,713.58 | 0.17 |
| 10 | 113050 | 南银转债 | 3,081,822.77 | 0.16 |
| 11 | 127012 | 招路转债 | 2,396,598.70 | 0.12 |
| 12 | 123125 | 元力转债 | 2,012,764.08 | 0.10 |
| 13 | 111001 | 山玻转债 | 1,714,561.03 | 0.09 |
| 14 | 123076 | 强力转债 | 1,130,240.60 | 0.06 |
| 15 | 123059 | 银信转债 | 1,004,165.97 | 0.05 |

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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

| 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 |
| 356 | 4,356,037.42 | 1,550,458,795.92 | 99.98% | 290,527.30 | 0.02% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 2,089.00 | 0.00% |
|------------------|----------|-------|

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 | 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2016年09月22日)基金份额总额 | 200,971,336.64 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,817,270,824.12 |
| 本报告期基金总申购份额 | 152,879.08 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 266,674,379.98 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,550,749,323.22 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未举行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

(1) 本基金管理人于2022年01月15日公告，张博先生不再担任金元顺安丰利债券型证券投资基金的基金经理；

(2) 本基金管理人于2022年01月15日公告，张博先生不再担任金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；

(3) 本基金管理人于2022年04月15日公告，贾丽杰女士不再担任金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，增聘孔祥鹏先生担任该基金的基金经理；

(4) 本基金管理人于2022年04月15日公告，贾丽杰女士不再担任金元顺安价值增长混合型证券投资基金的基金经理，增聘孔祥鹏先生担任该基金的基金经理；

(5) 本基金管理人于2022年05月10日公告,《金元顺安行业精选混合型证券投资基金基金合同》正式生效, 闵杭先生担任该基金的基金经理。

2、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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, 未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内, 本基金的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

本报告期内, 未发生改聘会计师事务所的情况。

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

本报告期内, 管理人无受稽查或处罚等情况。

本报告期内, 托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

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 | |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 东吴证券 | 2 | 738,942,372.37 | 73.28% | 526,261.05 | 71.01% | - |
| 国信证券 | 2 | 93,724,671.20 | 9.29% | 86,348.67 | 11.65% | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 2 | 175,691,993.87 | 17.42% | 128,483.90 | 17.34% | - |
| 万和证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 五矿证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：

1、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序：

（1）选择标准

- 1) 公司具有较强的研究实力，能够出具高质量的各种研究报告。研究及投资建议质量较高、报告出具及时、能及时地交流和对需求做出反应，有较广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。
- 2) 公司资信状况较好，无重大不良记录。
- 3) 公司经营规范，能满足基金运作的合法、合规需求。
- 4) 能够对持有人提供较高质量的服务。能够向持有人提供咨询、查询等服务；可以向投资人提供及时、主动的信息以及其它增值服务，无被持有人投诉的记录。

(2) 选择流程

公司投研和市场部门定期对券商服务质量根据选择标准进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元。

2、截至本报告期末2022年6月30日止，本基金新租用民生证券股份有限公司1个上海交易单元1个深圳交易单元、国盛证券股份有限公司1个上海交易单元、西部证券股份有限公司1个深圳交易单元，无退租交易单元。

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 | | 基金交易 | |
|--------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 118,541,839.53 | 50.52% | 4,834,000,000.00 | 68.31% | - | - | - | - |
| 国信证券 | 4,122,011.85 | 1.76% | 40,000,000.00 | 0.57% | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | 91,297,635.62 | 38.91% | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 20,695,902.70 | 8.82% | 2,203,000,000.00 | 31.13% | - | - | - | - |
| 万和证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 五矿证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

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 | 金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加交通银行股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告 | 《证券时报》和www.jysa99.com | 2022-04-29 |
| 2 | 金元顺安基金管理有限公司 | 《证券时报》和www.jysa99.com | 2022-04-22 |

| | | | |
|---|---|-----------------------|------------|
| | 旗下证券投资基金2022年第一季度报告 | com | |
| 3 | 金元顺安基金管理有限公司关于暂停深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告 | 《证券时报》和www.jysa99.com | 2022-04-22 |
| 4 | 金元顺安基金管理有限公司旗下基金新增中国银河证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告 | 《证券时报》和www.jysa99.com | 2022-04-21 |
| 5 | 金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2021年度报告 | 《证券时报》和www.jysa99.com | 2022-03-31 |
| 6 | 金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司为销售机构并参与费率优惠的公告 | 《证券时报》和www.jysa99.com | 2022-03-25 |
| 7 | 金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为销售机构并参与费率优惠的公告 | 《证券时报》和www.jysa99.com | 2022-03-08 |
| 8 | 金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加广发证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告 | 《证券时报》和www.jysa99.com | 2022-02-23 |
| 9 | 金元顺安基金管理有限公司关于旗下基金增加恒泰证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告 | 《证券时报》和www.jysa99.com | 2022-02-08 |

§ 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 | 2022年01月01日 - 2022年06月30日 | 460,208,478.33 | - | - | 460,208,478.33 | 29.68% |
| | 2 | 2022年03月09日 - 2022年06月30日 | 360,436,440.50 | - | - | 360,436,440.50 | 23.24% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。</p> <p>基金净值大幅波动的风险</p> <p>高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>基金规模较小导致的风险</p> <p>高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无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、中国证监会准予金元顺安沅楹债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安沅楹债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安沅楹债券型证券投资基金基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安沅楹债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册金元顺安沅楹债券型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

金元顺安基金管理有限公司

中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间至办公地点进行查询，或登录本基金管理人网站 www.jysa99.com 查阅。投资者对本报告书存有疑问，可咨询本基金管理人金元顺安基金管理有限公司，本公司客服电话400-666-0666、021-68881898。

金元顺安基金管理有限公司
二〇二二年八月三十一日