

金元顺安沅楹债券型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09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

报告送出日期:2024年10月25日

目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	3
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	6
4.3 公平交易专项说明	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	7
4.5 报告期内基金的业绩表现	7
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	8
§5 投资组合报告	8
5.1 报告期末基金资产组合情况	8
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	8
5.3 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	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	10
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	10
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	10
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	10
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	11
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	11
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	11
5.11 投资组合报告附注	11
§6 开放式基金份额变动	12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	12
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	12
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	12
§8 影响投资者决策的其他重要信息	12
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	12
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	13
§9 备查文件目录	13
9.1 备查文件目录	13
9.2 存放地点	13
9.3 查阅方式	13

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2024年10月24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07月01日起至2024年09月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	719,717,588.45份
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	本基金采用的投资策略包括：1、大类资产配置策略；2、债券资产投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、权证投资策略
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，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。
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

§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07月01日 - 2024年09月30日）
1.本期已实现收益	-12,542,381.71
2.本期利润	6,218,038.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0086
4.期末基金资产净值	775,317,797.47
5.期末基金份额净值	1.0773

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、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	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	0.81%	0.25%	0.26%	0.10%	0.55%	0.15%
过去六个月	-0.03%	0.21%	1.32%	0.09%	-1.35%	0.12%
过去一年	0.10%	0.20%	3.53%	0.07%	-3.43%	0.13%
过去三年	-4.40%	0.26%	5.97%	0.06%	-10.37%	0.20%
过去五年	11.70%	0.33%	8.14%	0.06%	3.56%	0.27%
自基金合同生效起至今	24.42%	0.31%	7.80%	0.07%	16.62%	0.24%

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

金元顺安沅楹债券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-2024年09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。

§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		
周博洋	本基金基金经理	2018-01-26	-	12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、金元顺安沅泉债券型证券投资基金和金元顺安产业臻选混合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

					限责任有限公司项目经理。2014年8月加入金元顺安基金管理有限公司，历任金元顺安沅楹定期开放债券型发起式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。
韩辰尧	本基金基金经理	2023-03-21	-	16年	金元顺安沅楹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和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，香港中文大学工商管理硕士。曾任都邦财产保险股份有限公司交易员、行业研究员和基金投资经理，昆仑健康保险股份有限公司股票投资部门负责人，太平资产管理股份有限公司事业部负责人，合众资产管理股份有限公司权益投资部门负责人。2022年05月加入金元顺安基金管理有限公司。16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中国证监会和行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》及其他相关法律法规、中国证监会和基金合同的规定，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规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守法律法规和内部规章制度关于公平交易的相关规定，确保本基金管理人管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和内部规章制度执行投资交易。

本报告期内，本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人未发生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超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度股票市场整体呈现先跌后涨格局，且主要涨幅集中于9月24日一系列政策出台之后，从指数涨跌幅看，全A上涨17.68%，沪深300上涨16.07%，创业板指上涨29.21%，中证500上涨16.19%，中证1000上涨16.6%。回顾三季度，5月楼市新政出台后，地产销售数据仍未得到明显好转，叠加7-8月进入业绩披露期，二季度市场整体业绩较一季度出现下滑，市场预期转弱，流动性进一步收缩，市场在7月到9月中旬整体呈现持续下行格局。9月24日，包括降准降息、提振楼市、对资本市场进行流动性支持等一系列金融政策发布超出市场预期，市场流动性迅速回暖，风险偏好大幅提升，短期实现较大涨幅。债券方面，季度内债市收益率整体震荡下行，季末收益率出现一波快速调整。分月来看，7月，在国内稳增长压力上升和外汇压力减弱下，国内在时间点和幅度上超预期降息，随后央行对利率下行未进行干预，对资金面更多呵护，收益率大幅下行；8月，在央行指导大行卖债和监管处罚市场交易主体等措施后，债券市场流动性明显降低，收益率出现一波快速调整，月末基金预防性赎回负反馈初见端倪，信用利差扩大；9月，月初公布的一系列经济金融数据较差，市场开始交易降准降息，收益率大幅下行。市场在月末最后一周出现转折，随着降准降息落地，央行推出两项支持权益市场举措，形成股强债弱的跷跷板走势。转债方面，季度内转债市场基本随权益市场涨跌，在连续下跌后，季度末迎来大幅反弹，而7月由于退市风波转债跌幅较大，落后同期权益市场表现。

4.5 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基金份额净值为1.0773元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.81%，同期业绩比较基准收益率为0.26%。

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资产净值低于五千万元情形。

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	109,712,275.87	12.92
	其中：股票	109,712,275.87	12.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	724,079,202.55	85.28
	其中：债券	724,079,202.55	85.28
	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	11,225,551.69	1.32
8	其他资产	4,067,803.26	0.48
9	合计	849,084,833.37	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

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	4,752,994.00	0.61
C	制造业	104,959,281.87	13.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
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	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	109,712,275.87	14.15

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投资的股票。

5.3 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

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	002837	英维克	232,100	6,039,242.00	0.78
2	002849	威星智能	435,400	5,790,820.00	0.75
3	601138	工业富联	210,600	5,305,014.00	0.68
4	002922	伊戈尔	240,700	5,259,295.00	0.68
5	002463	沪电股份	128,400	5,156,544.00	0.67
6	600522	中天科技	330,000	5,111,700.00	0.66
7	300274	阳光电源	48,900	4,869,462.00	0.63

8	300115	长盈精密	351,167	4,828,546.25	0.62
9	000975	山金国际	255,400	4,752,994.00	0.61
10	600372	中航机载	362,924	4,703,495.04	0.61

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	30,394,597.26	3.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	429,191,984.84	55.36
	其中：政策性金融债	20,283,128.77	2.62
4	企业债券	213,688,404.39	27.56
5	企业短期融资券	30,002,876.17	3.87
6	中期票据	20,801,339.89	2.68
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	724,079,202.55	93.39

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	2028033	20建设银行二级	500,000	51,023,246.58	6.58
2	185469	22沪电02	400,000	40,689,354.52	5.25
3	2228026	22华夏银行02	400,000	40,681,937.53	5.25
4	185423	22大唐01	400,000	40,660,800.00	5.24
5	2028049	20工商银行二级02	300,000	31,725,819.67	4.09

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投资资产支持证券。

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投资贵金属。

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投资权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	67,803.26
2	应收证券清算款	4,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	4,067,803.26
---	----	--------------

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	719,747,903.16
报告期期间基金总申购份额	3,569.93
减：报告期期间基金总赎回份额	33,884.64
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	719,717,588.45

§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，本基金管理人未进行本基金的申购、赎回及红利再投资等交易。

§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

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	2024年07月01日 - 2024年09月30日	280,444,070.68	-	-	280,444,070.68	38.97%

产品特有风险

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。

基金净值大幅波动的风险

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。

基金规模较小导致的风险

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 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

9.3 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

2024年10月25日