金元顺安桉盛债券型证券投资基金
2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：金元顺安基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

送出日期：2020 年 03 月 30 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。本年度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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 03 月 27 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。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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 6
2.1 基金基本情况 6
2.2 基金产品说明 6
2.3 基金管理人和基金托管人 7
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 9
3.1 主要会计数据和财务指标 9
3.2 基金净值表现 10
3.3 过去三年基金的利润分配情况 11
§4 管理人报告 12
4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 14
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 18
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 18
4.10 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 18
§5 托管人报告 19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 19
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 19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 19

§6 审计报告 20
6.1 审计报告基本信息 20
6.2 审计报告的基本内容 20
§7 年度财务报表 23
7.1 资产负债表 23
7.2 利润表 25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 27
7.4 报表附注 28
§8 投资组合报告 61
8.1 期末基金资产组合情况 61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 61
8.3 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 63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 67
8.6 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 68
8.7 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 68
8.8 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 68
8.9 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 69
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 69
8.12 投资组合报告附注 69
§9 基金份额持有人信息 73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 73
9.3 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 73
§10 开放式基金份额变动 74
§11 重大事件揭示 75
11.1 基金份额持有人大会决议 75
11.2 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 75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 76

11.4 基金投资策略的改变 76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 76
11.8 其他重大事件 77
§12 影响投资者决策的其他重要信息 83
12.1 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 83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 83
§13 备查文件目录 84
13.1 备查文件目录 84
13.2 存放地点 84
13.3 查阅方式 84

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金元顺安桉盛债券型证券投资基金
基金简称	金元顺安桉盛债券
基金主代码	004093
交易代码	004093
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 03 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	宁波银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	127,172,157.49 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将密切关注股票、债券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	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	封涌	朱广科
	联系电话	021-68881801	0574-87050338
	电子邮箱	service@jysa99.com	custody-audit@nbcb.cn
客户服务电话		400-666-0666	0574-83895886
传真		021-68881875	0574-89103213
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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码		200120	315100
法定代表人		任开宇	陆华裕

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.jysa99.com
基金年度报告备置地点	本基金管理人、基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

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、基金净值表现及利润分配情况

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	2019 年	2018 年	2017 年 03 月 30 日（基金合同生效日）-2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	5,628,953.16	4,581,879.89	4,921,034.77
本期利润	7,812,269.66	11,438,939.41	-417,130.26
加权平均基金份额本期利润	0.0614	0.0817	-0.0023
本期加权平均净值利润率	5.55%	7.91%	-0.23%
本期基金份额净值增长率	5.69%	8.21%	-0.29%
3.1.2 期末数据和指标	**2019 年末**	**2018 年末**	**2017 年末**
期末可供分配利润	13,206,559.08	7,578,396.84	-466,173.51
期末可供分配基金份额利润	0.1038	0.0596	-0.0029
期末基金资产净值	145,030,946.64	137,206,721.41	159,644,468.56
期末基金份额净值	1.1404	1.0790	0.9971
3.1.3 累计期末指标	**2019 年末**	**2018 年末**	**2017 年末**
基金份额累计净值增长率	14.04%	7.90%	-0.29%

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、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 12 月 31 日；

4、所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
过去三个月	1.67%	0.08%	0.61%	0.04%	1.06%	0.04%
过去六个月	3.21%	0.07%	1.07%	0.04%	2.14%	0.03%
过去一年	5.69%	0.06%	1.31%	0.05%	4.38%	0.01%
自基金合同生效起至今	14.04%	0.08%	3.86%	0.06%	10.18%	0.02%

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

注：

1、本基金合同生效日为 2017 年 03 月 30 日，业绩基准收益率以 2017 年 03 月 29 日为基准；

2、本基金各类资产的投资比例为本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票资产的比例不高于基金资产的 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”。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年内未进行利润分配。

§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。

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 2019 年 12 月 31 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、金元顺安沣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、金元顺安沣顺定期开放债券型发起式证券投资基金、金元顺安沣泰定期开放债券型发起式证券投资基金和金元顺安沣泉债券型证券投资基金共 15 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		
郭建新	本基金基金经理	2017-04-05	-	9 年	金元顺安金通宝货币市场基金和金元顺安桉盛债券型证券投资基金的基金经理，西南财经大学经济学硕士。曾任河北银行股份有限公司资金运营中心债券交易经理。2016 年 9 月加入金元顺安基金管理有限公司，历任金元顺安桉泰债券型证券投资基金的基金经理。9 年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。
缪玮彬	本基金基金经理	2017-08-03	2019-08-29	21 年	总经理助理，金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，复旦大学经济学硕士。曾任华泰资产管理有限公司固定收益部总经理，宝盈基金管理有限公司研究员，金元证券有限责任公司资产管理部总经理助理，联合证券有限责任公司高级投资经理，华宝信托投资有限责任公司投资经理。2016 年 10 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和金元顺安桉盛债券型证券投资基金的基金经理。21 年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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《金元顺安桉盛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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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风险管理部、监察稽核部和交易部监督，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。

4.3.3 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

2019 年宏观经济整体增速整体放缓。GDP 增速 6.1%，较上年下降 0.6 个百分点。固定资产投资完成额增长 5.4%，主要是房地产投资保持坚挺，制造业有明显下降。受贸易摩擦以及全球经济放缓影响，外贸增速有较大下滑。在汽车消费大幅回落的情况下，消费增速逐步向下。受非洲猪瘟影响，食品价格大幅上涨，带动整体 CPI 增速有明显提高。货币政策保持稳健，M2 增长 8.7%。全年来看，资金面整体偏宽松，债券收益率震荡下行，信用利震荡收窄。股市经过一季度的快速上涨之后保持横盘震荡。

报告期内本基金主要配置等级信用债和长久期利率债，严控信用风险，适度参与利率债波段操作。小量参与股票和转债交易，年末逐步增加了权益的仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安桉盛债券型证券投资基金份额净值为 1.1404 元；

本报告期内，基金份额净值增长率为 5.69%，同期业绩比较基准收益率为 1.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济增速大概率继续保持小幅下行态势。年初为控制疫情的扩散，整个经济运转出现了短暂的停滞，目前复工复产在稳步推进，政府通过更积极的财政和货币政策来对冲负面影响。在降息的刺

激之下，地产需求不会大幅下滑。基建力度加大，最大程度上对冲其他行业的投资下行。消费需求在疫情结束之后应该会有明显的反弹。目前较大的不确定性在于海外疫情的控制，一方面会影响外贸需求，另一方面也会影响国内疫情控制的进度。货币政策方面，在疫情结束之前可能还会加大宽松力度，债券收益率可能先下后上。股市目前整体点位不高，可能随境外市场有一定调整，但易上难下。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人持续将规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益作为工作的基点，进一步完善内部控制制度和流程体系，推动各项法规、内控体系和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过定期检查、报表揭示、专项检查、人员询问等方法，独立地开展公司的监察稽核工作，并就在监察稽核过程中发现的问题，及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，公司重点开展的监察稽核工作包括：

1、依据相关法律、法规和公司实际运作情况，修订和完善公司各项内部管理制度，为保障基金份额持有人的利益，保障公司的规范运作提供制度保障。

2、开展对公司各项业务的日常监察稽核工作，查找各项业务中的风险漏洞，保证公司各项业务的合规运作，重点加强了对于各业务环节的专项稽核。

3、加强对公司投资、交易、研究、会计估值、注册登记、市场营销等各项业务过程中的法律、合规及投资风险的防范与控制，在合法合规的基础上，充分保障基金份额持有人的利益。

4、开展反洗钱、反商业贿赂等各项工作，并通过开展法规培训等形式，提高员工的合规意识和风险责任意识。

通过上述工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 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方法符合现行法律、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讯；

（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。

4.7.2 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。

4.8 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

4.10 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，本托管人在金元顺安桉盛债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2020）审字第 60657709_B12 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	金元顺安桉盛债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的金元顺安桉盛债券型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的金元顺安桉盛债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了金元顺安桉盛债券型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于金元顺安桉盛债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-

其他信息	金元顺安桉盛债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估金元顺安桉盛债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督金元顺安桉盛债券型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报

	风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对金元顺安桉盛债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致金元顺安桉盛债券型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	徐艳、张亚旎
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
审计报告日期	2020-03-27

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：金元顺安桉盛债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,037,751.34	429,452.00
结算备付金		54,946.24	33,181.82
存出保证金		9,001.52	143.06
交易性金融资产	7.4.7.2	151,240,657.36	130,393,100.00
其中：股票投资		19,328,599.76	-
基金投资		-	-
债券投资		131,912,057.60	130,393,100.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	3,500,000.00
应收证券清算款		437,023.04	-
应收利息	7.4.7.5	2,410,602.66	2,993,712.63
应收股利		-	-

应收申购款		-	9.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		156,189,982.16	137,349,599.50
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2019 年 12 月 31 日**	**上年度末 2018 年 12 月 31 日**
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		11,000,000.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	9.84
应付管理人报酬		73,208.57	69,682.00
应付托管费		12,201.46	11,613.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	17,199.48	2,251.90
应交税费		6,872.58	8,920.67
应付利息		-846.57	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	50,400.00	50,400.00
负债合计		11,159,035.52	142,878.09

所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	127,172,157.49	127,159,905.04
未分配利润	7.4.7.10	17,858,789.15	10,046,816.37
所有者权益合计		145,030,946.64	137,206,721.41
负债和所有者权益总计		156,189,982.16	137,349,599.50

注：

报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值为 1.1404 元，基金份额总额 127,172,157.49 份。

7.2 利润表

会计主体：金元顺安桉盛债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		9,098,924.05	13,229,869.37
1.利息收入		5,360,518.81	7,110,298.20
其中：存款利息收入	7.4.7.11	39,118.16	17,191.79
债券利息收入		5,153,531.97	7,059,776.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		167,868.68	33,329.54
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,554,936.49	-754,554.41
其中：股票投资收益	7.4.7.12	826,811.45	-

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	643,976.87	-754,554.41
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	84,148.17	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,183,316.50	6,857,059.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	152.25	17,066.06
减：二、费用		1,286,654.39	1,790,929.96
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	844,555.50	869,992.22
2.托管费	7.4.10.2.2	140,759.32	144,998.72
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	7.4.7.19	53,578.68	4,486.70
5.利息支出		28,900.96	570,509.79
其中：卖出回购金融资产支出		28,900.96	570,509.79
6.税金及附加		11,659.93	13,742.53
7.其他费用	7.4.7.20	207,200.00	187,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,812,269.66	11,438,939.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,812,269.66	11,438,939.41

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安桉盛债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	127,159,905.04	10,046,816.37	137,206,721.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,812,269.66	7,812,269.66
三、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）	12,252.45	-296.88	11,955.57
其中：1.基金申购款	194,189.38	17,761.49	211,950.87
2.基金赎回款	-181,936.93	-18,058.37	-199,995.30
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	127,172,157.49	17,858,789.15	145,030,946.64
项目	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	160,110,642.07	-466,173.51	159,644,468.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,438,939.41	11,438,939.41
三、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）	-32,950,737.03	-925,949.53	-33,876,686.56

其中：1.基金申购款	179,126.95	5,924.99	185,051.94
2.基金赎回款	-33,129,863.98	-931,874.52	-34,061,738.50
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	127,159,905.04	10,046,816.37	137,206,721.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金元顺安桉盛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]2923 号文《关于准予金元顺安桉盛债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人金元顺安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2017 年 03 月 30 日正式生效，首次设立募集规模为 200,133,079.03 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均为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

2019 年 03 月 16 日，经本基金管理人与托管行协商一致，并报中国证监会备案后，根据申购费用、销售服务费用收取方式的不同，对本基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，投资者在申购该类基金份额时收取申购费用；另外增设 C 类份额，投资者在申购时不收取申购费。

本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

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）、同业存单、货币市场工具、股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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本基金投资其他品种，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为：中债综合指数收益率。

7.4.2 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。

7.4.3 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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票投资、债券投资等；

2、金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或收取该金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

1、股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

2、债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

3、权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

4、股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

5、分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述 2、3 中相关原则进行计算；

6、回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

2、不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

3、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

4、如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）

占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

3、资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

4、买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

5、股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

6、债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

7、资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

8、股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

9、权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

10、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

11、公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

12、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日（即基金可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 20%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.6.5 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	2,037,751.34	429,452.00
定期存款	-	-
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	-	-
合计	2,037,751.34	429,452.00

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		18,679,998.09	19,328,599.76	648,601.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	48,042,684.35	49,885,057.60	1,842,373.25
	银行间市场	80,815,763.93	82,027,000.00	1,211,236.07
	合计	128,858,448.28	131,912,057.60	3,053,609.32
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		147,538,446.37	151,240,657.36	3,702,210.99
项目		上年度末 2018 年 12 月 31 日		
		成本	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	28,789,303.72	28,875,100.00	85,796.28
	银行间市场	100,084,901.79	101,518,000.00	1,433,098.21
	合计	128,874,205.51	130,393,100.00	1,518,894.49

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	128,874,205.51	130,393,100.00	1,518,894.49

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,500,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	521.32	126.13
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	24.70	14.90
应收债券利息	2,410,052.64	2,990,042.74
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	3,528.76
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	4.00	0.10
合计	2,410,602.66	2,993,712.63

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	17,199.48	-
银行间市场应付交易费用	-	2,251.90
合计	17,199.48	2,251.90

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 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	-	-
预提费用	50,000.00	50,000.00
其他应付	400.00	400.00
合计	50,400.00	50,400.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	127,159,905.04	127,159,905.04
本期申购	194,189.38	194,189.38
本期赎回（以“-”号填列）	-181,936.93	-181,936.93
本期末	127,172,157.49	127,172,157.49

注：

1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金本报告期无认/申购及赎回下属 C 类基金份额。

7.4.7.10 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
上年度末	7,578,396.84	2,468,419.53	10,046,816.37
本期利润	5,628,953.16	2,183,316.50	7,812,269.66
本期基金份额交易产生的变动数	-790.92	494.04	-296.88
其中：基金申购款	13,342.86	4,418.63	17,761.49
基金赎回款	-14,133.78	-3,924.59	-18,058.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,206,559.08	4,652,230.07	17,858,789.15

注：

本基金本报告期无认/申购及赎回下属 C 类基金份额，因此下属 C 类基金本报告期亦无未分配利润金额变动。

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	28,454.66	17,130.72
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	10,599.36	40.28
其他	64.14	20.79
合计	39,118.16	17,191.79

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	11,022,358.00	-
减：卖出股票成本总额	10,195,546.55	-
买卖股票差价收入	826,811.45	-

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	643,976.87	-754,554.41
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	643,976.87	-754,554.41

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑	135,594,998.97	262,120,284.94

付）成交总额		
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	131,841,587.52	258,802,569.66
减：应收利息总额	3,109,434.58	4,072,269.69
买卖债券差价收入	643,976.87	-754,554.41

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	84,148.17	-
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	84,148.17	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 01 月 01 日至	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至

	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	2,183,316.50	6,857,059.52
——股票投资	648,601.67	-
——债券投资	1,534,714.83	6,857,059.52
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——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	2,183,316.50	6,857,059.52

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	152.25	17,066.06
合计	152.25	17,066.06

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	51,303.68	61.70
银行间市场交易费用	2,275.00	4,425.00
合计	53,578.68	4,486.70

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	100,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他费用	1,200.00	1,200.00
合计	207,200.00	187,200.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
宁波银行股份有限公司	基金托管人
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东
上海泉意金融信息服务有限公司	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
金元证券股份有限公司	39,897,902.64	100.00%	-	-

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期债券总额成

		额的比例		交的比例
金元证券股份有限公司	74,818,922.10	100.00%	1,542,617.00	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 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
金元证券股份有限公司	1,556,900,000.00	100.00%	47,900,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
金元证券股份有限公司	36,358.84	100.00%	17,199.48	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
金元证券股份有限公司	-	-	-	-

注：

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	844,555.50	869,992.22
其中：支付销售机构的客户维护费	471.83	278.66

注：

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.60%÷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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	140,759.32	144,998.72

注：

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.10%÷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。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的销售服务费。

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.30%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年销售服务费率÷当年天数，

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费，

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值，

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给销售机构等。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。

7.4.10.3 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 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 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

宁波银行股份有限公司	-	10,523,515.21	-	-	-	-
上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 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**
宁波银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日**		**上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日**	
	期末余额	**当期利息收入**	**期末余额**	**当期利息收入**
宁波银行股份有限公司	2,037,751.34	28,454.66	429,452.00	17,130.72

注：

除上表列示的金额外，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，2019 年度获得的利息收入为人民币 10,599.36 元（2018 年度：人民币 40.28 元），

2019 年末结算备付金余额为人民币 54,946.24 元（2018 年末：人民币 33,181.82 元）

7.4.10.7 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在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	**证券名称**	**成功认购日**	**可流通日**	**流通受限类型**	**认购价格**	**期末估值单价**	**数量（单位：张）**	**期末成本总额**	**期末估值总额**	**备注**
113029	明阳转债	2019-12-17	2020-01-07	新债未上市	100.00	100.00	660	66,000.00	66,000.00	-
128085	鸿达转债	2019-12-17	2020-01-08	新债未上市	100.00	100.00	420	42,000.00	42,000.00	-
128084	木森转债	2019-12-17	2020-01-10	新债未上市	100.00	100.00	340	34,000.00	34,000.00	-
128086	国轩转债	2019-12-18	2020-01-10	新债未上市	100.00	100.00	260	26,000.00	26,000.00	-
110065	淮矿转债	2019-12-24	2020-01-13	新债未上市	100.00	100.00	240	24,000.00	24,000.00	-
113030	东风转债	2019-12-25	2020-01-20	新债未上市	100.00	100.00	150	15,000.00	15,000.00	-
11355	仙鹤	2019-12-	2020-0	新债未	100.00	100.00	150	15,000.00	15,000.00	-

4	转债	17	1-10	上市						

注：

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股票、权证。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额人民币 11,000,000.00 元，于 2020 年 01 月 02 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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发行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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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债券投资。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	9,659,000.00
合计	-	9,659,000.00

7.4.13.2.4 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	69,281,859.70	77,939,100.00
AAA 以下	20,902,697.90	12,132,000.00
未评级	41,727,500.00	30,663,000.00

合计	131,912,057.60	120,734,100.00

注：

未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

本基金所持有的大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	2,037,751.34	-	-	-	2,037,751.34
结算备付金	54,946.24	-	-	-	54,946.24
存出保证金	9,001.52	-	-	-	9,001.52
交易性金融资产	44,690,157.60	56,638,900.00	30,583,000.00	19,328,599.76	151,240,657.36
应收证券清算款	-	-	-	437,023.04	437,023.04
应收利息	-	-	-	2,410,602.66	2,410,602.66
资产总计	**46,791,856.70**	**56,638,900.00**	**30,583,000.00**	**22,176,225.46**	**156,189,982.16**
负债					
卖出回购金融资产款	11,000,000.00	-	-	-	11,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	73,208.57	73,208.57
应付托管费	-	-	-	12,201.46	12,201.46

应付交易费用	-	-	-	17,199.48	17,199.48
应交税费	-	-	-	6,872.58	6,872.58
应付利息	-	-	-	-846.57	-846.57
其他负债	-	-	-	50,400.00	50,400.00
负债总计	**11,000,000.00**	**0.00**	**0.00**	**159,035.52**	**11,159,035.52**
利率敏感度缺口	**35,791,856.70**	**56,638,900.00**	**30,583,000.00**	**22,017,189.94**	**145,030,946.64**
上年度末 2018 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	429,452.00	-	-	-	429,452.00
结算备付金	33,181.82	-	-	-	33,181.82
存出保证金	143.06	-	-	-	143.06
交易性金融资产	39,880,000.00	63,754,700.00	26,758,400.00	-	130,393,100.00
买入返售金融资产	3,500,000.00	-	-	-	3,500,000.00
应收利息	-	-	-	2,993,712.63	2,993,712.63
应收申购款	-	-	-	9.99	9.99
资产总计	43,842,776.88	63,754,700.00	26,758,400.00	2,993,722.62	137,349,599.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	9.84	9.84
应付管理人报酬	-	-	-	69,682.00	69,682.00
应付托管费	-	-	-	11,613.68	11,613.68

应付交易费用	-	-	-	2,251.90	2,251.90
应交税费	-	-	-	8,920.67	8,920.67
其他负债	-	-	-	50,400.00	50,400.00
负债总计	**-**	**-**	**-**	**142,878.09**	**142,878.09**
利率敏感度缺口	**43,842,776.88**	**63,754,700.00**	**26,758,400.00**	**2,850,844.53**	**137,206,721.41**

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。

7.4.13.4.1.2 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 2019 年 12 月 31 日和 2018 年 12 月 31 日各债券的基点价值（BP 价值）为主要计算依据；		
	2、债券持仓结构保持不变；		
	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；买入返售金融资产利息收益/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；		
	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 2019 年 12 月 31 日	**上年度末 2018 年 12 月 31 日**
	基准利率增加一个基点	-34,195.44	-32,356.04
	基准利率减少一个基点	34,218.15	32,375.85

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。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 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股票和债券，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产——股票投资	19,328,599.76	13.33	-	-
交易性金融资产——基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产——债券投资	131,912,057.60	90.95	130,393,100.00	95.03
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	151,240,657.36	104.28	130,393,100.00	95.03

注：

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票资产的比例不高于基金资产的 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。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

7.4.13.4.3.2 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	900,240.92	-
	沪深 300 指数下跌 5%	-900,240.92	-

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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 47,464,157.36 元，属于第二层次的余额为人民币 103,776,500.00 元，无属于第三层次的余额。（于 2018 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 8,753,100.00 元，属于第二层次的余额为人民币 121,640,000.00 元，无属于第三层次的余额。）

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本

基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2020 年 03 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	19,328,599.76	12.38
	其中：股票	19,328,599.76	12.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	131,912,057.60	84.46
	其中：债券	131,912,057.60	84.46
	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	2,092,697.58	1.34
8	其他各项资产	2,856,627.22	1.83
9	合计	156,189,982.16	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	2,923,439.20	2.02
C	制造业	3,257,320.76	2.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	917,782.00	0.63
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	409,440.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	117,800.00	0.08
J	金融业	10,212,188.80	7.04
K	房地产业	838,124.00	0.58
L	租赁和商务服务业	560,385.00	0.39
M	科学研究和技术服务业	92,120.00	0.06
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	19,328,599.76	13.33

8.2.2 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。

8.3 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	600547	山东黄金	63,660	2,076,589.20	1.43
2	600737	中粮糖业	163,206	1,380,722.76	0.95
3	600036	招商银行	29,000	1,089,820.00	0.75
4	600000	浦发银行	80,000	989,600.00	0.68
5	601628	中国人寿	25,000	871,750.00	0.60
6	600048	保利地产	51,800	838,124.00	0.58
7	601211	国泰君安	40,900	756,241.00	0.52
8	601688	华泰证券	34,800	706,788.00	0.49
9	600030	中信证券	27,400	693,220.00	0.48
10	601888	中国国旅	6,300	560,385.00	0.39
11	601319	中国人保	71,500	542,685.00	0.37
12	600016	民生银行	72,100	454,951.00	0.31
13	603993	洛阳钼业	100,000	436,000.00	0.30
14	601601	中国太保	11,400	431,376.00	0.30
15	601818	光大银行	95,000	418,950.00	0.29
16	601066	中信建投	13,500	410,400.00	0.28
17	601288	农业银行	107,800	397,782.00	0.27
18	600837	海通证券	25,000	386,500.00	0.27
19	601398	工商银行	65,000	382,200.00	0.26
20	601668	中国建筑	66,500	373,730.00	0.26

21	601328	交通银行	55,400	311,902.00	0.22
22	601336	新华保险	5,900	289,985.00	0.20
23	601800	中国交建	29,000	265,640.00	0.18
24	601111	中国国航	26,000	251,940.00	0.17
25	601988	中国银行	67,200	247,968.00	0.17
26	600703	三安光电	13,000	238,680.00	0.16
27	601088	中国神华	13,000	237,250.00	0.16
28	600690	海尔智家	12,000	234,000.00	0.16
29	600309	万华化学	4,000	224,680.00	0.15
30	601166	兴业银行	11,000	217,800.00	0.15
31	601939	建设银行	30,000	216,900.00	0.15
32	600887	伊利股份	6,700	207,298.00	0.14
33	601229	上海银行	20,920	198,530.80	0.14
34	600104	上汽集团	8,000	190,800.00	0.13
35	601390	中国中铁	29,800	177,012.00	0.12
36	600276	恒瑞医药	2,000	175,040.00	0.12
37	600009	上海机场	2,000	157,500.00	0.11
38	600019	宝钢股份	24,800	142,352.00	0.10
39	601989	中国重工	25,000	131,000.00	0.09
40	600050	中国联通	20,000	117,800.00	0.08
41	601318	中国平安	1,200	102,552.00	0.07
42	601186	中国铁建	10,000	101,400.00	0.07
43	601169	北京银行	16,600	94,288.00	0.07

44	603259	药明康德	1,000	92,120.00	0.06
45	600028	中国石化	18,000	91,980.00	0.06
46	601138	工业富联	5,000	91,350.00	0.06
47	601766	中国中车	12,200	87,108.00	0.06
48	601857	中国石油	14,000	81,620.00	0.06
49	600196	复星医药	3,000	79,800.00	0.06
50	601012	隆基股份	3,000	74,490.00	0.05

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600737	中粮糖业	3,653,901.64	2.66
2	600547	山东黄金	3,553,580.00	2.59
3	601888	中国国旅	1,616,847.00	1.18
4	600036	招商银行	1,236,524.00	0.90
5	600000	浦发银行	1,071,686.00	0.78
6	601628	中国人寿	959,959.00	0.70
7	600048	保利地产	826,238.00	0.60
8	600030	中信证券	782,971.00	0.57
9	601688	华泰证券	757,256.00	0.55
10	601211	国泰君安	728,230.00	0.53
11	601818	光大银行	688,512.00	0.50
12	603993	洛阳钼业	659,418.00	0.48

13	600340	华夏幸福	609,900.00	0.44
14	601319	中国人保	588,130.00	0.43
15	600703	三安光电	535,954.00	0.39
16	601398	工商银行	478,400.00	0.35
17	601800	中国交建	471,895.00	0.34
18	600016	民生银行	450,293.00	0.33
19	600837	海通证券	424,420.00	0.31
20	601601	中国太保	412,410.00	0.30

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，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	600737	中粮糖业	2,301,500.00	1.68
2	600547	山东黄金	2,159,560.00	1.57
3	601888	中国国旅	1,119,670.00	0.82
4	600340	华夏幸福	625,883.00	0.46
5	603993	洛阳钼业	311,055.00	0.23
6	600703	三安光电	298,468.00	0.22
7	601818	光大银行	293,850.00	0.21
8	601800	中国交建	200,242.00	0.15
9	600519	贵州茅台	183,401.00	0.13
10	600029	南方航空	170,408.00	0.12

11	601166	兴业银行	162,045.00	0.12
12	600585	海螺水泥	160,127.00	0.12
13	600309	万华化学	157,526.00	0.11
14	600050	中国联通	157,214.00	0.11
15	600690	海尔智家	156,105.00	0.11
16	600036	招商银行	155,402.00	0.11
17	601088	中国神华	155,308.00	0.11
18	600030	中信证券	153,783.00	0.11
19	601360	三六零	152,184.00	0.11
20	600104	上汽集团	148,562.00	0.11

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，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	28,875,544.64
卖出股票收入（成交）总额	11,022,358.00

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。

8.5 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	41,727,500.00	28.77
	其中：政策性金融债	41,727,500.00	28.77
4	企业债券	41,347,000.00	28.51
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,480,000.00	14.12
7	可转债（可交换债）	28,357,557.60	19.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	131,912,057.60	90.95

8.6 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	1780057	17 邳州润城债	100,000	10,427,000.00	7.19
2	1780061	17 宿迁开发债	100,000	10,418,000.00	7.18
3	170215	17 国开 15	100,000	10,409,000.00	7.18
4	101474010	14 北控集 MTN003	100,000	10,400,000.00	7.17
5	143065	17 海资 01	100,000	10,279,000.00	7.09

8.7 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投资资产支持证券。

8.8 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投资贵金属。

8.9 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投资权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

招商银行（600036）

2019 年 07 月 02 日，平安银行和招商银行在银行间债券回购市场达成 DR001 为 0.09%的异常利率交易。经两家银行自查，为交易员操作失误所致。

全国银行间同业拆借中心现对平安银行和招商银行进行通报批评，要求两家机构加强风险控制和内部管理，并依据《银行间本币市场交易员管理办法（试行）》（中汇交发[2014]196 号），暂停平安银行和招商银行相关交易员的银行间本币市场交易员资格 1 年。

本基金管理人作出说明如下：

1、投资决策程序：招商银行为全国性股份制银行，在整个银行系统中规模排名靠前，资产质量较好，经营相对稳健，未来业务能保持平稳发展。

2、该行 2019 年 07 月由于一笔银行间回购操作失误被全国银行间同业拆借中心通报批评。该处罚对公司经营影响不大，不会对公司的对公和个人业务产生负面影响，因此继续持有该公司股票。

华泰证券（601688）

经查，四川证监局发现营业部存在以下行为：一、营业部营销人员执业行为管理不到位。营业部前员工王登科任营业部客户经理期间，涉嫌私下接受客户委托买卖证券。王登科个人手机号码 181XXXX9333 在其 2014 年劳动合同及公司人力资源系统中均有记录，其名下 3 名客户的开户资料均留下 181XXXX9333 作为联系方式、9 名客户存在以 181XXXX9333 为委托电话的股票交易记录。营业部未能结合企业风险管理平台营销人员风险监控模块预警信息进行跟踪排查。二、营业部未对企业风险管理平台营销人员风险监控模块预警信息进行核查。2016 年 12 月至 2017 年 03 月，营业部客户黄某在风险监控模块中集中出现内容为“多客户相同 MAC\电话地址委托”、“多客户相同 IP 地址委托且客户买卖相同证券”、“多客户相同 IP 地址委托且客户年累计亏损过高”的 8 次预警，营业部未能提供以上预警信息回访记录。营业部于 2017 年 01 月 23 日曾因深交所风险提示对黄某进行过回访，但回访内容不涉及系统预警内容。此外，黄某在该次回访中表示账户由他人操作，营业部未引起重视并进行跟进核查。三、营业部未对客户回访中发现的违规线索进行核查处理。2017 年 05 月，营业部对客户张某某进行两融业务回访的过程中，张某某反映王登科代客理财致其亏损严重；2017 年 06 月，王登科离职，营业部在针对其名下客户进行的员工离职回访中，2 名客户反映王登科存在代客理财行为。营业部未对相关线索进行核查处理。

四川证监局责令营业部对上述问题限期改正，并在 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日期间，每季度开展一次内部合规检查，并在每次检查后 10 个工作日内，向我局报送合规检查报告。同时，1、对王登科私下接受客户委托买卖证券行为，责令改正，给予警告，并处罚款 10 万元。2、对王登科违法持有及买卖股票行为，责令依法处理非法持有的股票，没收违法所得 1,230,162.12 元，并处罚款 30 万元。

本基金管理人作出说明如下：

1、投资决策程序：华泰证券为市值排名前列的大型券商，具有庞大的客户基础、领先的互联网平台和敏捷协同的全业务链体系，是证监会首批批准的综合类券商，全国最早获得创新试点资格券商，业务经营相对稳健。

2、该公司由于员工私下接受客户委托买卖证券等原因被四川证监局责令整改，给予警告，并处罚款 10 万元。该案仅为个案，公司内控体系相对健全，该处罚对公司正常经营影响不大，因此继续持有该公司股票。

8.12.2 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。

8.12.3 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	9,001.52
2	应收证券清算款	437,023.04
3	应收股利	-
4	应收利息	2,410,602.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,856,627.22

8.12.4 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	132007	16 凤凰 EB	4,024,000.00	2.77
2	110053	苏银转债	3,134,313.00	2.16
3	132004	15 国盛 EB	2,982,300.00	2.06
4	113021	中信转债	1,985,607.00	1.37
5	110043	无锡转债	1,246,800.10	0.86
6	113516	苏农转债	1,201,000.50	0.83
7	110057	现代转债	1,166,513.40	0.80
8	113026	核能转债	1,095,863.40	0.76

9	110052	贵广转债	1,053,990.00	0.73
10	127013	创维转债	883,476.90	0.61
11	110055	伊力转债	797,160.00	0.55
12	113530	大丰转债	790,580.00	0.55
13	113534	鼎胜转债	634,291.20	0.44
14	128064	司尔转债	617,324.40	0.43
15	123023	迪森转债	606,300.00	0.42
16	110058	永鼎转债	520,700.00	0.36
17	110051	中天转债	389,305.00	0.27
18	127012	招路转债	343,770.00	0.24
19	113024	核建转债	319,140.00	0.22
20	113022	浙商转债	238,440.00	0.16
21	113025	明泰转债	235,013.10	0.16

8.12.5 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不存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
205	620,351.99	126,997,000.00	99.86%	175,157.49	0.14%

9.2 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	45,134.52	0.04%

9.3 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	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 03 月 30 日）基金份额总额	200,133,079.03
本报告期期初基金份额总额	127,159,905.04
本报告期基金总申购份额	194,189.38
减：本报告期基金总赎回份额	181,936.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	127,172,157.49

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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 2019 年 01 月 08 日公告，增聘孙权先生担任金元顺安丰利债券证券投资基金的基金经理；

（2）本基金管理人于 2019 年 01 月 08 日公告，增聘孙权先生担任金元顺安丰祥债券证券投资基金的基金经理；

（3）本基金管理人于 2019 年 01 月 08 日公告，金元顺安新经济主题混合型证券投资基金基金合同终止，并于 2019 年 01 月 08 日进入基金财产清算程序；

（4）本基金管理人于 2019 年 05 月 18 日公告，邝晓星先生担任公司总经理，不再担任公司副总经理、代理总经理；

（5）本基金管理人于 2019 年 06 月 11 日公告，《金元顺安沣泉债券型证券投资基金基金合同》正式生效，周博洋先生担任该基金的基金经理；

（6）本基金管理人于 2019 年 06 月 19 日公告，增聘孙权先生担任金元顺安沣泉债券证券投资基金的基金经理；

（7）本基金管理人于 2019 年 08 月 30 日公告，缪玮彬先生不再担任金元顺安桉盛债券型证券投资基金的基金经理；

2、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动

（1）2019 年 04 月 10 日，聘任朱广科为总行资产托管部常务副总经理，聘任滕翠霞为总行资产托管部副总经理；

（2）2019 年 09 月 20 日，聘任朱广科为总行资产托管部副总经理（主持工作），免去朱广科的总行资产托管部常务副总经理职务；

（3）2019 年 09 月 20 日，免去陈辰的总行资产托管部总经理职务。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。

11.6 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，本基金的基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
国金证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	39,897,902.64	100.00%	36,358.84	100.00%	-

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 2019 年 12 月 31 日止，本基金无新租或退租交易单元。

11.7.2 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
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	74,818,922.10	100.00%	1,556,900,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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关于旗下基金 2018 年年度资产净值的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-01-01
2	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加凯石财富为销售机构并	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-01-07

	参与费率优惠的公告		
3	关于金元顺安基金管理有限公司关于开展直销柜台基金认、申购费 1 折的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-01-09
4	关于金元顺安基金管理有限公司关于开展直销柜台基金转换费率的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-01-09
5	金元顺安基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金调整信息披露媒体的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-01-21
6	金元顺安基金管理有限公司旗下基金 2018 年四季度报告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-01-21
7	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加阳光人寿保险股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-01-25
8	金元顺安基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长春高新股票估值调整情况的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-03-01
9	金元顺安基金管理有限公司 2018 年旗下证券投资基金年度报告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-03-26
10	金元顺安基金管理有限公司 2018 年旗下证券投资基金年度报告摘要	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-03-26
11	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加中信证券股份有限公司	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-04-19

	为销售机构并参与费率优惠的公告		
12	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 第一季度报告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-04-20
13	金元顺安基金管理有限公司关于手工披露旗下基金 04 月 26 日行情的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-04-27
14	金元顺安桉盛债券型证券投资基金更新招募说明书[2019 年 1 号]	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-05-14
15	金元顺安桉盛债券型证券投资基金更新招募说明书摘要[2019 年 1 号]	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-05-14
16	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金参加北京恒天明泽基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-05-18
17	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加华瑞保险为销售机构的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-06-21
18	金元顺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-06-25
19	金元顺安基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年半年度资产净值的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-07-01
20	金元顺安基金管理有限公司旗下	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-07-11

	基金增加北京汇成基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告		
21	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年第二季度报告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-07-17
22	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加上海联泰基金销售有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-07-31
23	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加西藏东方财富证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-08-05
24	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加联储证券有限责任公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-08-16
25	金元顺安基金管理有限公司旗下基金 2019 年半年度报告（摘要）	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-08-22
26	金元顺安基金管理有限公司旗下基金 2019 年半年度报告（正文）	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-08-22
27	金元顺安桉盛债券型证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-08-30
28	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加中信证券（山东）为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-09-06

29	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加大连网金基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-09-19
30	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加安信证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-09-20
31	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加中信期货为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-09-27
32	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金新增中证金牛为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-09-30
33	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加上海挖财基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-10-14
34	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加海通证券为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-10-16
35	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增珠海盈米基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-10-18
36	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年第三季度报	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-10-22

	告		
37	金元顺安基金管理有限公司旗下基金新增交通银行为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-10-25
38	金元顺安基金管理有限公司关于修改旗下 15 只基金的基金合同及托管协议的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-10-31
39	关于金元顺安基金管理有限公司直销柜台更改认申购最低限额的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-11-02
40	金元顺安桉盛债券型证券投资基金更新招募说明书[2019 年 2 号]	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-11-05
41	金元顺安桉盛债券型证券投资基金更新招募说明书摘要[2019 年 2 号]	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-11-05
42	金元顺安基金管理有限公司旗下基金新增国泰君安证券为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-11-15
43	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加中信建投证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-12-09
44	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加北京百度百盈基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《上海证券报》和 www.jysa99.com	2019-12-11

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2019 年 01 月 01 日-2019 年 12 月 31 日	99,999,000.00	0.00	0.00	99,999,000.00	78.63%
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。							

12.2 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。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会准予金元顺安桉盛债券型证券投资基金募集注册的文件；

2、《金元顺安桉盛债券型证券投资基金基金合同》；

3、《金元顺安桉盛债券型证券投资基金基金招募说明书》；

4、《金元顺安桉盛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桉盛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。

13.2 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

13.3 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

二〇二〇年三月三十日