

**金元顺安桉盛债券型证券投资基金
2019 年年度报告摘要**

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

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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@nbc.cn
客户服务电话		400-666-0666	0574-83895886
传真		021-68881875	0574-89103213

2.4 信息披露方式

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

§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

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

金元顺安桉盛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



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和金元顺安沅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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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。

4.6.2 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 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。

4.9 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

本报告期末基金 2019 年度财务报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师出具了标准无保留意见的审计报告（安永华明（2020）审字第 60657709_B12 号），投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§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	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	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	3,500,000.00
应收证券清算款	437,023.04	-
应收利息	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	-	-
资产总计	156,189,982.16	137,349,599.50
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2019 年 12 月 31 日	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	-	-
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	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	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	127,172,157.49	127,159,905.04
未分配利润	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	本期	上年度可比期间
	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	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	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	826,811.45	-

基金投资收益	-	-
债券投资收益	643,976.87	-754,554.41
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	84,148.17	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	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）	152.25	17,066.06
减：二、费用	1,286,654.39	1,790,929.96
1.管理人报酬	844,555.50	869,992.22
2.托管费	140,759.32	144,998.72
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	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	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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

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 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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%	-	-

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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 额的比例	成交金额	占当期债券总额成 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%
------------	---------------	---------	--------------	---------

7.4.8.1.4 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%

7.4.8.1.5 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	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：

$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$ ，

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	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：

$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$,

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。

7.4.8.2.3 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:

$H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$,

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。

7.4.8.3 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	-	-	-	-	-	-

7.4.8.4 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

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

7.4.8.5.2 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。

7.4.8.6 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

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）

7.4.8.7 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。

7.4.8.8 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。

7.4.9 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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	-
113554	仙鹤转债	2019-12-17	2020-01-10	新债未上市	100.00	100.00	150	15,000.00	15,000.00	-

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。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.9.4 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。

§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前十名股票投资明细

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

注：

投资者欲了解本报告期末本基金投资的所有股票明细，应阅读本基金的年度报告正文。

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。

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，《金元顺安沅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沅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%	-	-	-	-

§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。

金元顺安基金管理有限公司

二〇二〇年三月三十日