

# 金元顺安金通宝货币市场基金 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	金元顺安金通宝货币	
基金主代码	004072	
交易代码	004072	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 01 月 20 日	
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	665,926,460.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金通宝货币 A 类	金通宝货币 B 类
下属分级基金的交易代码	004072	004073
报告期末下属分级基金的份额总额	1,565,920.70 份	664,360,539.94 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在在严格控制基金资产风险、保持基金资产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金结合自上而下和自下而上的分析，在保证资产的安全性和流动性的前提下，进行积极的投资组合管理，追求基金的长期、稳定增值。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金系货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金元顺安基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	封涌	罗菲菲
	联系电话	021-68881801	010-58560666
	电子邮箱	service@jysa99.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-666-0666	95568
传真		021-68881875	010-58560798

## 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 01 月 20 日（基金合 同生效日）-2017 年 12 月 31 日	
	金通宝货币 A 类	金通宝货币 B 类	金通宝货币 A 类	金通宝货币 B 类	金通宝货币 A 类	金通宝货币 B 类
本期已实 现收益	40,542.74	54,626,625.14	86,588.62	79,767,250.83	75,263.04	55,329,052.54
本期利润	40,542.74	54,626,625.14	86,588.62	79,767,250.83	75,263.04	55,329,052.54
本期净值 收益率	2.2906%	2.5366%	3.2513%	3.5008%	3.5626%	3.7994%
3.1.2 期末 数据和指 标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
期末基金 资产净值	1,565,920.70	664,360,539.94	1,293,345.52	1,925,583,344.7 5	7,174,485.7 4	999,321,516.64
期末基金 份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、上述基金财务指标不包括持有人认购和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、本基金利润分配按日结转份额。

4、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日；

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 金通宝货币 A 类

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.5905%	0.0008%	0.3408%	0.0000%	0.2497%	0.0008%
过去六个月	1.1272%	0.0007%	0.6828%	0.0000%	0.4444%	0.0007%
过去一年	2.2906%	0.0007%	1.3590%	0.0000%	0.9316%	0.0007%
自基金合同生效起至今	9.3790%	0.0029%	4.0594%	0.0000%	5.3196%	0.0029%

##### 金通宝货币 B 类

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.6516%	0.0008%	0.3408%	0.0000%	0.3108%	0.0008%
过去六个月	1.2499%	0.0007%	0.6828%	0.0000%	0.5671%	0.0007%
过去一年	2.5366%	0.0007%	1.3590%	0.0000%	1.1776%	0.0007%
自基金合同生效起至今	10.1584%	0.0029%	4.0594%	0.0000%	6.0990%	0.0029%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金通宝货币A类累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年01月20日-2019年12月31日)



金通宝货币B类累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年01月20日-2019年12月31日)



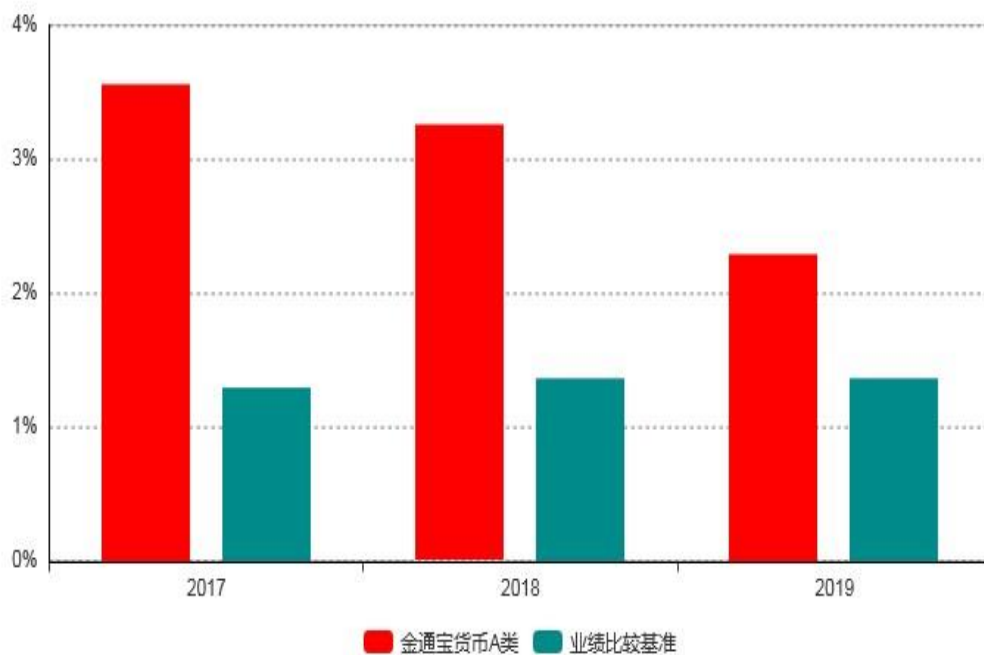
注：

- 1、本基金合同生效日为 2017 年 01 月 20 日，业绩基准收益率以 2017 年 01 月 19 日为基准；
- 2、本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非

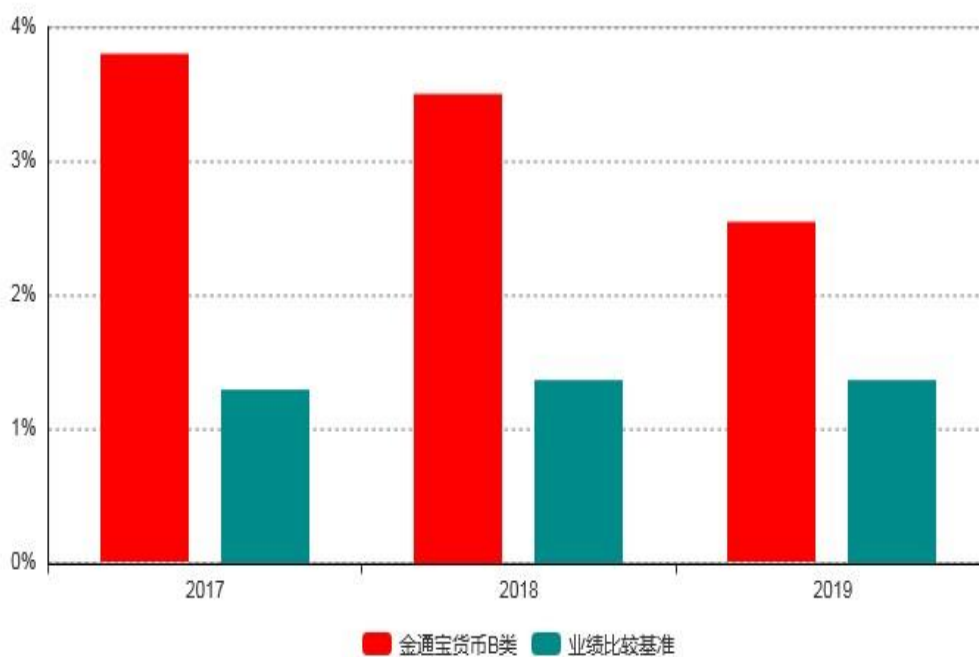
金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具；

3、本基金业绩比较基准为“同期七天通知存款利率（税后）”。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益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

#### 金通宝货币 A 类

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2019年	40,542.74	-	-	40,542.74	-
2018年	86,588.62	-	-	86,588.62	-
2017年	75,263.04	-	-	75,263.04	-
合计	202,394.40	-	-	202,394.40	-

#### 金通宝货币 B 类

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注

2019年	54,626,625.14	-	-	54,626,625.14	-
2018年	79,767,250.83	-	-	79,767,250.83	-
2017年	55,329,052.54	-	-	55,329,052.54	-
合计	189,722,928.51	-	-	189,722,928.51	-

## §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	2017-01-24	-	9 年	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和金元顺安桉泰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。9 年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

注：

1、此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《金元顺安金通宝货币市场基金基金合同》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。

报告期内本基金维持较短久期，资产流动性良好。资产配置以高等级存单和逆回购为主，规避信用风险。有效控制偏离度，整体运行平稳。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安金通宝 A 类基金份额净值为 1.000 元；

本报告期内，A 类基金份额净值增长率为 2.2906%，同期业绩比较基准收益率为 1.3590%；

截至报告期末金元顺安金元宝 B 类基金份额净值为 1.000 元；

本报告期内，B 类基金份额净值增长率为 2.5366%，同期业绩比较基准收益率为 1.3590%；

#### 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

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

##### 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、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

根据本基金基金合同“基金的收益与分配”之“收益分配原则”和相关法律法规的规定，本基金收益分配方式为红利再投资，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并全部分配，每月集中支付。

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

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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\_B11 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：金元顺安金通宝货币市场基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	13,092,881.94	2,620,941.95
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	660,121,006.81	1,544,470,962.82
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	660,121,006.81	1,544,470,962.82
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	108,600,602.90	479,376,879.07
应收证券清算款	-	-
应收利息	4,416,021.43	5,998,841.78
应收股利	-	-
应收申购款	-	-

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	786,230,513.08	2,032,467,625.62
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2019 年 12 月 31 日</b>	<b>2018 年 12 月 31 日</b>
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	119,939,620.09	104,749,522.87
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	198,694.41	510,620.59
应付托管费	39,738.91	102,124.14
应付销售服务费	8,265.89	20,705.04
应付交易费用	36,613.47	48,216.52
应交税费	-	-
应付利息	11,719.67	100,346.19
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	69,400.00	59,400.00
负债合计	120,304,052.44	105,590,935.35
<b>所有者权益：</b>		

实收基金	665,926,460.64	1,926,876,690.27
未分配利润	-	-
所有者权益合计	665,926,460.64	1,926,876,690.27
负债和所有者权益总计	786,230,513.08	2,032,467,625.62

注：

报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 665,926,460.64 份，其中 A 类基金份额参考净值 1.0000 元，份额总额 1,565,920.70 份；B 类基金份额参考净值 1.0000 元，份额总额 664,360,539.94 份；

## 7.2 利润表

会计主体：金元顺安金通宝货币市场基金

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	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入	<b>62,724,743.28</b>	<b>92,299,195.29</b>
1.利息收入	62,611,618.10	92,219,482.62
其中：存款利息收入	38,056.19	39,635.91
债券利息收入	44,738,279.31	77,755,068.37
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	17,835,282.60	14,424,778.34
证券出借利息收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	113,125.18	79,712.67

其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	113,125.18	79,712.67
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
<b>减：二、费用</b>	<b>8,057,575.40</b>	<b>12,445,355.84</b>
1.管理人报酬	5,479,232.55	5,931,800.54
2.托管费	1,095,846.44	1,186,360.15
3.销售服务费	223,518.28	243,326.65
4.交易费用	612.50	-
5.利息支出	1,008,725.59	4,857,539.37
其中：卖出回购金融资产支出	1,008,725.59	4,857,539.37
6.税金及附加	-	3,556.66
7.其他费用	249,640.04	222,772.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>54,667,167.88</b>	<b>79,853,839.45</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>54,667,167.88</b>	<b>79,853,839.45</b>

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安金通宝货币市场基金

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）	1,926,876,690.27	-	1,926,876,690.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	54,667,167.88	54,667,167.88
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）	-1,260,950,229.63	-	-1,260,950,229.63
其中：1.基金申购款	6,637,929,665.09	-	6,637,929,665.09
2.基金赎回款	-7,898,879,894.72	-	-7,898,879,894.72
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）	-	-54,667,167.88	-54,667,167.88
五、期末所有者权益（基金净值）	665,926,460.64	-	665,926,460.64
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）	1,006,496,002.38	-	1,006,496,002.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	79,853,839.45	79,853,839.45

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）	920,380,687.89	-	920,380,687.89
其中：1.基金申购款	15,065,354,147.14	-	15,065,354,147.14
2.基金赎回款	-14,144,973,459.25	-	-14,144,973,459.25
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）	-	-79,853,839.45	-79,853,839.45
五、期末所有者权益（基金净值）	1,926,876,690.27	-	1,926,876,690.27

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：

邱晓星

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

金元顺安金通宝货币市场基金（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]2835 号文《关于准予金元顺安金通宝货币市场基金募集的批复》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募集，基金合同于 2017 年 01 月 20 日正式生效，首次设立募集规模为 267,583,834.80 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金根据投资者认（申）购本基金的金额，对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成不同的基金份额类别。本基金目前分设两类基金份额：A 类基金份额和 B 类基金份额。其中，A 类基金份额和 B 类基金份额以 300 万份为界限划分，单一持有人持有 300 万份基金份额以下的为 A 类份额，达到或超过 300 万份的为 B 类份额。若 A 类基金份额持有人在单个基金账户



保留的基金份额达到或超过 300 万份时，本基金的登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额。若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 300 万份时，本基金的登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。

本基金在严格控制基金资产风险、保持基金资产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的稳定增值。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，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：同期七天通知存款利率（税后）。

#### **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编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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 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。

#### 7.4.6.2 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。

#### 7.4.6.3 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[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。

#### 7.4.6.4 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。

#### 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
中国民生银行股份有限公司	基金托管人
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东
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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 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**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

**7.4.8.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

**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	5,479,232.55	5,931,800.54
其中：支付销售机构的客户维护费	45,395.15	2,193.58

注：

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

管理费的计算方法如下： $H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ ，

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。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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，基金托管人复核后于次月前 2 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、公休日等，支付日期顺延。

**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	1,095,846.44	1,186,360.15
----------------	--------------	--------------

注：

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下： $H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ ，

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。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金通宝货币 A 类	金通宝货币 B 类	合计
金元顺安基金管理有限公司	3,641.15	215,195.91	218,837.06
合计	3,641.15	215,195.91	218,837.06
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金通宝货币 A 类	金通宝货币 B 类	合计
金元顺安基金管理有限公司	1,009.69	236,983.72	237,993.41
合计	1,009.69	236,983.72	237,993.41

注：

本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，

年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

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

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费，

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值。

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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
中国民生银行 股份有限公司	199,625,741.86	29,918,894.84	-	-	-	-
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
中国民生银行 股份有限公司	198,956,222.46	-	528,660,000.00	33,431.63	209,000,000.00	13,987.94

**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固有资金投资本基金的情况****金通宝货币 A 类**

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

**金通宝货币 B 类**

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	-	25,154,540.32

报告期间申购/买入总份额	-	15,468,913.81
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	40,623,454.13
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：

期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

#### 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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	13,092,881.94	38,056.19	2,620,941.95	39,635.91

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0.00元（2018年度：人民币0.00元），2019年末结算备付金余额为人民币0.00元（2018年末：人民币0.00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

金额单位：元

<p>本期</p> <p>2019年01月01日至2019年12月31日</p>
--



关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
中国民生银行股份有限公司	111915159	19民生银行CD159	网下发行	1,000,000	99,251,500.00
中国民生银行股份有限公司	111915363	19民生银行CD363	网下发行	500,000	49,662,950.00
中国民生银行股份有限公司	111915430	19民生银行CD430	网下发行	500,000	49,662,900.00
中国民生银行股份有限公司	111915446	19民生银行CD446	网下发行	1,000,000	99,333,200.00
中国民生银行股份有限公司	111915567	19民生银行CD567	网下发行	500,000	49,601,000.00
<b>上年度可比期间</b> <b>2018年01月01日至2018年12月31日</b>					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
中国民生银行股份有限公司	111815012	18民生银行CD012	网下发行	500,000	49,427,200.00
中国民生银行股份有限公司	111815082	18民生银行CD082	网下发行	500,000	49,404,750.00
中国民生银行股份有限公司	111815108	18民生银行CD108	网下发行	1,000,000	99,602,400.00
中国民生银行股份有限公司	111815190	18民生银行CD190	网下发行	500,000	49,492,300.00
中国民生银行股份有限公司	111815635	18民生银行CD635	网下发行	500,000	49,596,450.00

有限公司			行		
------	--	--	---	--	--

#### 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

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限的证券。

##### 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的股票。

##### 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

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
111909018	19浦发银行CD018	2020-01-07	99.82	266,000	26,552,907.96
111910475	19兴业银行CD475	2020-01-07	99.64	1,000,000	99,637,865.98
合计	-	-	-	1,266,000	126,190,773.94

注：

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 119,939,620.09 元，于 2020 年 01 月 07 日到期。

###### 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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

###### 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	固定收益投资	660,121,006.81	83.96
	其中：债券	660,121,006.81	83.96
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	108,600,602.90	13.81
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	13,092,881.94	1.67
4	其他各项资产	4,416,021.43	0.56
5	合计	786,230,513.08	100.00

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额		2.42
	其中：买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	119,939,620.09	18.01
	其中：买断式回购融资	-	-

## 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期
1	2019-12-17	29.26	赎回	2天
2	2019-12-18	29.13	赎回	1天

注：

本基金本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

## 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

## 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期及上年度可比期间不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

## 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	45.42	18.01
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	58.41	-
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
3	60 天（含）—90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天 的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	6.03	-
	其中：剩余存续期超过397天 的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	7.55	-
	其中：剩余存续期超过397天 的浮动利率债	-	-
合计		117.40	18.01

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 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	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	160,503,876.61	24.10
	其中：政策性金融债	160,503,876.61	24.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	同业存单	499,617,130.20	75.03
8	其他	-	-
9	合计	660,121,006.81	99.13
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111910475	19兴业银行CD475	1,000,000	99,637,865.98	14.96
2	111990113	19杭州银行CD001	510,000	50,963,066.33	7.65
3	170307	17进出07	500,000	50,269,604.51	7.55
4	130402	13农发02	500,000	50,105,824.95	7.52
5	111976513	19杭州银行CD138	500,000	49,935,576.70	7.50
6	111909018	19浦发银行CD018	500,000	49,911,481.12	7.50
7	111909399	19浦发银行CD399	500,000	49,848,587.32	7.49
8	111972352	19宁波银行CD232	500,000	49,844,158.75	7.48
9	111915567	19民生银行CD567	500,000	49,787,091.26	7.48
10	150410	15农发10	400,000	40,150,596.04	6.03

#### 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）—0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0946%
报告期内偏离度的最低值	-0.0142%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0189%
------------------------	---------

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

**报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明**

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

**8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

**8.9 投资组合报告附注****8.9.1 基金计价方法说明**

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

**8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体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。**

**8.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	4,416,021.43
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-

8	合计	4,416,021.43
---	----	--------------

#### 8.9.4 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

份额级别	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
金通宝货币 A 类	1,037	1,510.05	1,377,487.75	87.97%	188,432.95	12.03%
金通宝货币 B 类	6	110,726,756.66	664,360,539.94	100.00%	0.00	0.00%
合计	1,043	638,472.16	665,738,027.69	99.97%	188,432.95	0.03%

### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	机构	500,522,480.52	75.16%
2	机构	53,045,993.98	7.97%
3	机构	40,016,642.69	6.01%
4	机构	37,207,357.63	5.59%
5	机构	21,791,075.90	3.27%
6	机构	11,702,590.68	1.76%
7	机构	1,209,827.77	0.18%
8	机构	122,462.67	0.02%
9	个人	54,695.18	0.01%

10	个人	43,803.21	0.01%
----	----	-----------	-------

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	金通宝货币 A 类	91,938.17	5.87%
	金通宝货币 B 类	-	0.00%
	合计	91,938.17	0.01%

### 9.4 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	份额级别	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	金通宝货币 A 类	0~10
	金通宝货币 B 类	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	金通宝货币 A 类	0~10
	金通宝货币 B 类	-
	合计	0~10

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	金通宝货币 A 类	金通宝货币 B 类
基金合同生效日（2017 年 01 月 20 日）基金份额总额	581,694.80	267,002,140.00
本报告期期初基金份额总额	1,293,345.52	1,925,583,344.75
本报告期基金总申购份额	1,993,039.95	6,635,936,625.14
减：本报告期基金总赎回份额	1,720,464.77	7,897,159,429.95
本报告期期末基金份额总额	1,565,920.70	664,360,539.94

## §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

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 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，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

**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	
万和证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

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
万和证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.5% 的情况。

## §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 02 月 12 日、 2019 年 02 月 14 日 -2019 年 02 月 14 日、 2019 年 02 月 25 日 -2019 年 03 月 12 日	739,526,735.32	7,129,707.69	746,656,443.01	0.00	0.00%
	2	2019 年 01 月 08 日 -2019 年 02 月 12 日、 2019 年 02 月 14 日 -2019 年 02 月 14 日、 2019 年 02 月 18 日 -2019 年 02 月 24 日、 2019 年 03 月 26 日 -2019 年 03 月 26 日	0.00	803,698,258.31	803,698,258.31	0.00	0.00%
	3	2019 年 03 月 13 日 -2019 年 12 月 31 日	220,913,454.71	379,609,025.81	100,000,000.00	500,522,480.52	75.16%
	4	2019 年 03 月 26 日 -2019 年 05 月 26 日、 2019 年 06 月 12 日 -2019 年 07 月 11 日、	165,549,998.98	334,797,392.20	500,347,391.18	0.00	0.00%

		2019年07月23日 -2019年12月03日					
5		2019年06月05日 -2019年06月11日	0.00	500,495,431.37	500,495,431.37	0.00	0.00%
6		2019年12月04日 -2019年12月16日	79,043,204.68	157,659,386.00	225,000,000.00	11,702,590.68	1.76%

**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