

**金元顺安桉盛债券型证券投资基金**  
**2020 年第 2 季度报告**

**2020 年 06 月 30 日**

基金管理人：金元顺安基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 07 月 21 日

## 目录

§1	重要提示 .....	4
§2	基金产品概况 .....	5
§3	主要财务指标和基金净值表现 .....	7
3.1	主要财务指标 .....	7
3.2	基金净值表现 .....	7
§4	管理人报告 .....	10
4.1	基金经理（或基金经理小组）简介 .....	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	10
4.3	公平交易专项说明 .....	11
4.4	报告期内基金的投资策略和运作分析 .....	11
4.5	报告期内基金的业绩表现 .....	11
4.6	报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 .....	12
§5	投资组合报告 .....	13
5.1	报告期末基金资产组合情况 .....	13
5.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	13
5.3	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 .....	14
5.4	报告期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	15
5.5	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	16
5.6	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细 .....	16
5.7	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	16
5.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	16
5.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	16
5.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	16
5.11	投资组合报告附注 .....	17
§6	开放式基金份额变动 .....	26
§7	基金管理人运用固有资金投资本基金情况 .....	27
7.1	基金管理人持有本基金份额变动情况 .....	27
7.2	基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 .....	27

§8	影响投资者决策的其他重要信息 .....	28
8.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	28
8.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	28
§9	备查文件目录 .....	30
9.1	备查文件目录 .....	30
9.2	存放地点 .....	30
9.3	查阅方式 .....	30

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 07 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	127,140,207.25 份	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	桉盛债券 A	桉盛债券 C
下属分级基金的交易代码	004093	007115

报告期末下属分级基金的份 额总额	127,138,329.08 份	1,878.17 份
---------------------	------------------	------------

注：

本基金自 2020 年 04 月 21 日起，C 类份额开始运作。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 04 月 01 日-2020 年 06 月 30 日）	
	桉盛债券 A	桉盛债券 C
1.本期已实现收益	1,719,101.59	4.22
2.本期利润	-843,985.09	-2.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0066	-0.0055
4.期末基金资产净值	143,810,128.47	2,117.75
5.期末基金份额净值	1.1311	1.1276

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 06 月 30 日；

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

###### 桉盛债券 A 净值表现

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.59%	0.27%	-1.04%	0.12%	0.45%	0.15%

过去六个月	-0.82%	0.34%	0.79%	0.11%	-1.61%	0.23%
过去一年	2.37%	0.24%	1.87%	0.08%	0.50%	0.16%
过去三年	12.37%	0.16%	5.61%	0.07%	6.76%	0.09%
自基金合同生效起至今	13.11%	0.15%	4.68%	0.07%	8.43%	0.08%

桉盛债券 C 净值表现

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
自基金运作起至今	-2.22%	0.21%	-1.76%	0.11%	-0.46%	0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

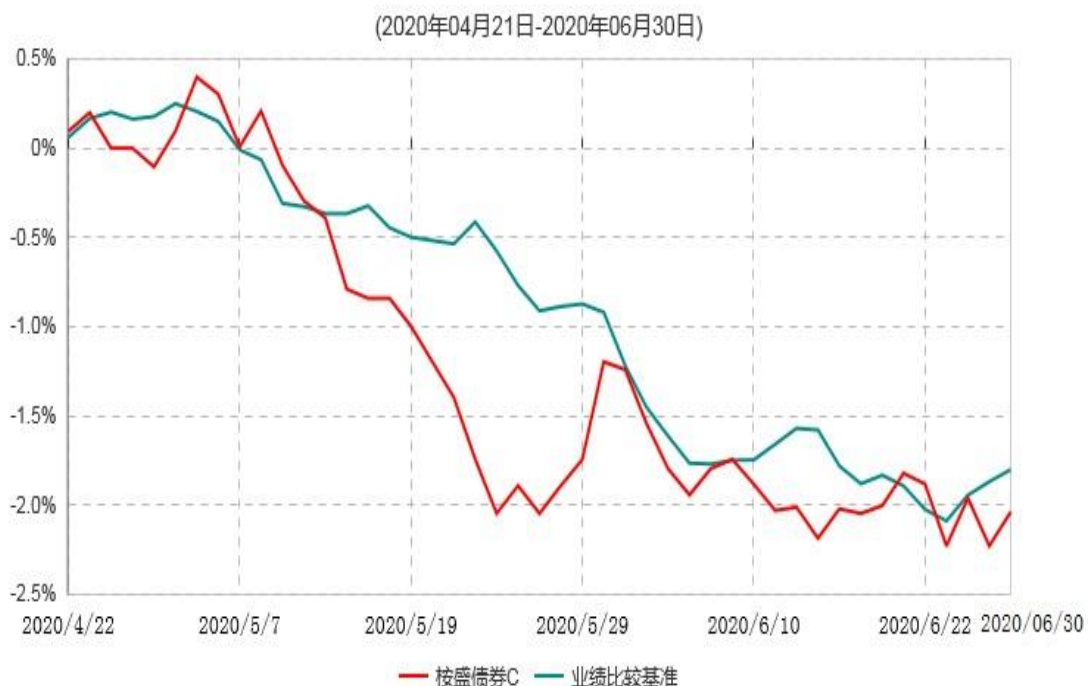
桉盛债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年04月21日-2020年06月30日)





桉盛债券C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”。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郭建新	本基金基金经理	2017-04-05	-	10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。10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 公平交易专项说明

#### 4.3.1 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。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人《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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年二季度国内疫情得到有效控制，海外疫情持续扩散。国内经济逐步从疫情的负面影响中走出，在常态化的疫情防护措施保障下，多数生产和消费活动正逐步恢复到疫情之前的状态。固定资产投资在基建和房地产的带动下增速开始转正，消费恢复的相对缓慢，出口在防疫物资的带动下明显好于预期。PPI 环比增速转正，社融和 M2 继续保持高速增长。在经济整体企稳的情况下，央行边际收紧流动性，债券收益率在 4 月份触底之后迅速反弹。股票市场震荡向上。

报告期内本基金债券配置以高等级信用债和长久期利率债为主，规避信用风险，小量参与波段操作。股票保持较高仓位，以大盘股为主。小幅增加了转债持仓。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末桉盛债券 A 基金份额净值为 1.1311 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 -0.59%，同期业绩比较基准收益率为 -1.04%；

截至报告期末桉盛债券 C 基金份额净值为 1.1276 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为

-2.22%，同期业绩比较基准收益率为-1.76%。

#### **4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明**

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形。

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	26,781,121.88	15.25
	其中：股票	26,781,121.88	15.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	143,226,684.25	81.55
	其中：债券	143,226,684.25	81.55
	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	3,521,198.95	2.00
8	其他资产	2,105,239.30	1.20
9	合计	175,634,244.38	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,922,537.20	4.12

C	制造业	5,256,795.68	3.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	841,801.00	0.59
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,061,010.00	0.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,800.00	0.07
J	金融业	12,625,025.00	8.78
K	房地产业	930,944.00	0.65
L	租赁和商务服务业	46,209.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	26,781,121.88	18.62

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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

1	600547	山东黄金	131,060	4,799,417.20	3.34
2	600737	中粮糖业	363,206	2,825,742.68	1.96
3	600030	中信证券	62,400	1,504,464.00	1.05
4	601688	华泰证券	69,800	1,312,240.00	0.91
5	601211	国泰君安	65,900	1,137,434.00	0.79
6	601601	中国太保	31,400	855,650.00	0.59
7	601066	中信建投	21,500	846,670.00	0.59
8	600000	浦发银行	80,000	846,400.00	0.59
9	600048	保利地产	56,800	839,504.00	0.58
10	600036	招商银行	24,000	809,280.00	0.56

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,889,800.00	36.08
	其中：政策性金融债	51,889,800.00	36.08
4	企业债券	35,192,000.00	24.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,566,000.00	14.30
7	可转债（可交换债）	35,578,884.25	24.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	143,226,684.25	99.59
----	----	----------------	-------

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170215	17 国开 15	100,000	10,565,000.00	7.35
2	101474010	14 北控集 MTN003	100,000	10,419,000.00	7.24
3	190310	19 进出 10	100,000	10,347,000.00	7.19
4	143065	17 海资 01	100,000	10,306,000.00	7.17
5	190401	19 农发 01	100,000	10,260,000.00	7.13

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未投资贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未投资权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策



本基金本报告期末未投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 1、中信证券（600030）

1、2019 年 11 月 14 日公告,中信证券营业部在 2019 年 07 月 29 日至 2019 年 10 月 24 日期间,由王穗宏代为履行营业部负责人职责,营业部未按规定及时向深圳证监局报告,违反了《证券公司分支机构监管规定》第十七条、《证券公司监督管理条例》第二十七条的规定。

深圳证监局对营业部采取责令改正的行政监管措施。

2、2020 年 04 月 01 日公告,中信证券股份有限公司上海分公司的员工,向客户推荐非中信证券股份有限公司发行或代销的金融产品,且参与了部分产品的销售过程。

上海证监局对相关员工采取出具警示函的行政监管措施,并记入证券期货市场诚信档案。

3、2020 年 04 月 16 日公告,营业部存在以下违规行为:

(1) 存在多名客户开户资料重要信息填写缺失、未对高龄客户职业信息填写异常进行核实、同一客户同日填写的两份信息登记材料内容不一致、测评打分加总错误导致评级结果出现偏差等问题,违反了《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第(一)项、第(二)项及《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第六条第(一)项、第(二)项的规定。

(2) 未按规定向我局报告营业部负责人孙丽丽任职情况,违反了《证券公司董事、监事和高级管理人员任职资格监管办法》第三十四条的规定。

(3) 无法提供营业场所计算机设备及对应媒介访问控制地址(MAC 地址)的登记记录变更及历史登记数据,违反了《证券公司内部控制指引》第七条第(一)项的规定。

北京证监局责令营业部限期改正,应当对存在的问题予以整改,完善内部控制机制,做好开户审核、人员任免备案、客户适当性管理工作,切实加强异常交易监控,防止营销人员在执业过程中从事违法违规或者超越代理权限、损害客户合法利益的行为。

4、2020 年 05 月 15 日公告,中信证券股份有限公司作为债务融资工具主承销商,在部分债务融资

工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本。

依据相关自律规定，经 2020 年第 5 次自律处分会议审议，中国银行间市场交易商协会对中信证券予以警告，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

#### **本基金管理人作出说明如下：**

(1) 投资决策程序：中信证券是国内规模最大的证券公司，若干业务领域保持或取得领先地位。公司依托第一大股东与中信银行、中信信托、信诚人寿保险等公司共同组成中信控股之综合经营模式，并与中信国际金融控股共同为客户提供境内外全面金融服务。公司内控体系相对健全，经营稳健。

(2) 该公司由于个别营业部员工违规销售非自营或代销金融产品，被上海证监局出具警示函；由于营业部负责人履职情况未及时报备监管，被深圳证监局责令整改；由于客户开户资料信息缺失等原因，被北京证监局限期改正；由于承销费率过低被交易商协会予以警告。以上处罚对公司影响可控，因此继续持有该公司股票。

#### **2、华泰证券（601688）**

1、2019 年 08 月 23 日公告，华泰证券在代销“聚潮资产-中科招商新三板 I 期 A、B 专项资管计划”过程中，存在使用未经报备的宣传推介材料的情形。该行为违反《证券公司代销金融产品管理规定》第十条的规定，反映出公司内部控制不完善。

根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，江苏证监局决定对公司采取责令改正的监督管理措施。公司应采取切实有效措施，完善内部控制，并于收到本决定之日起 30 日内向江苏证监局提交书面整改报告。

2、2020 年 03 月 17 日公告，深圳证监局发现华泰证券营业部存在以下问题：

(1) 在 2018 年 05 月至 2019 年 03 月期间，营业部监测发现客户邓某某有 14 个交易日出现交易异常预警，但仅通过电话询问和发送提示短信即排除可疑；

(2) 邓某某在电话回访中已表示将账户交他人操作，但营业部未充分了解实际操作人、实际受益人、账户资金来源归属等重要信息并防范风险；

(3) 未审慎核查交易异常预警的关联客户，未及时上报重大异常行为。

对此深圳证监局决定对营业部采取出具警示函的行政监管措施。

#### **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) 该公司由于宣传材料使用不规范，被江苏证监局责令整改；由于对客户的交易异常行为处理不审慎，被深圳证监局出具警示函。以上仅为个案，公司内控体系相对健全，监管处罚对公司正常经营影响不大，因此继续持有该公司股票。

### 3、国泰君安（601211）

1、2019 年 09 月 20 日公告，国泰君安四平中央西路证券营业部员工王珏存在替客户办理证券交易操作、与客户约定分享投资收益的行为。营业部未能有效防范员工违法违规风险，存在异常交易监控不到位、部分重要空白合同文本管理不到位的问题，反映出营业部内部控制不完善。

吉林证监局决定对营业部采取责令改正的行政监管措施。

2、2020 年 01 月 17 日公告，公司分支机构员工存在替客户办理证券交易操作、为客户的融资活动提供便利等违规行为，公司未能有效动态监控客户交易活动，未及时报告、处置重大异常行为，在分支机构管理、异常交易和操作监控等方面存在不足。

上海证监局决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

3、2020 年 03 月 17 日公告，国泰君安证券股份有限公司深圳红荔西路证券营业部存在副总经理实际履行分支机构负责人职责 4 个月未向深圳证监局报备的情形。

深圳证监局决定对营业部采取出具警示函的行政监管措施。

4、2020 年 05 月 06 日公告，国泰君安证券股份有限公司作为富贵鸟股份有限公司公开发行 2014 年公司债券的承销机构和受托管理人，在尽职调查和受托管理过程中未严格遵守执业规范，未能勤勉尽责地履行相关责任，违反了中国证监会《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 113 号，以下简称《管理办法》）第七条和第四十九条的规定。

福建证监局决定对公司采取出具警示函的监督管理措施。

#### 本基金管理人作出说明如下：

(1) 投资决策程序：国泰君安是中国证券行业长期、持续、全面领先的综合金融服务商，跨越了中国资本市场发展的全部历程和多个周期，逐渐形成了风控为本、追求卓越的企业文化，成为中国资本市场全方位的领导者以及中国证券行业科技和创新的引领者。公司未来仍有增长空间。

(2) 该公司因营业部员工违规操作被吉林证监局责令改正；因未能有效监控客户交易被上海证监局出具警示函；因机构负责人履职未及时报备被深圳证监局出具警示函；由于债券承销中未严格遵守职业规范，被福建证监局出具警示函。经过分析，我们认为以上事项对公司影响可控，因此继续持有该公司股票。

### 4、中信建投（601066）

1、2019 年 06 月 17 日公告，肖洪彬于 2014 年 06 月 25 日至 2017 年 12 月 19 日期间，在中信建投

证券股份有限公司任职，担任交易部投资经理，为证券从业人员。“易某媛”普通资金账户于 2014 年 06 月 19 日开立于新时代证券北京羊坊店路证券营业部，开户预留电话为肖洪彬配偶赵某手机号码。“易某媛”信用资金账户于 2015 年 01 月 05 日开立于新时代证券北京羊坊店路证券营业部。“易某媛”证券账户及建设银行三方存管银行账户均由肖洪彬实际控制并使用。肖洪彬向“易某媛”证券账户内转入家庭自有资金，并由其本人负责交易决策并使用手机下单交易，当其不方便下单时，会让其配偶赵某代为下单交易股票。2014 年 06 月 25 日至 2017 年 12 月 19 日期间，肖洪彬控制并使用“易某媛”证券账户交易金额合计 3,094.58 万元，盈利 48,735.11 元。以上事实，有相关证券账户资料、银行账户资料、相关人员询问笔录、相关单位提供资料等证据证明，足以认定。肖洪彬的上述行为违反了《证券法》第四十三条第一款的规定，构成《证券法》第一百九十九条所述“法律、行政法规规定禁止参与股票交易的人员，直接或者以化名、借他人名义持有、买卖股票”的违法行为。听证时，肖洪彬提出以下申辩意见：其一，其积极主动配合调查，对所有问题都如实交代；其二，其投入交易的金额不大，盈利不到 5 万元，且 2015 年至 2016 年的交易频率很低，情节相对较轻；其三，本案从投入金额、交易金额、盈利金额来看都不属于特别大的金额，类似案例并未采取市场禁入措施，希望能参照其他案件适当量罚；其四，其主观上已认识到自己的行为违法，希望能给一个改正的机会，且家庭负担较重，恳请从轻或减轻处罚。综上，肖洪彬请求不对其采取市场禁入措施，从轻或减轻处罚。

经复核，中国证监会认为，本案违法所得较少，综合考虑当事人违法行为的情节和社会危害程度，对肖洪彬提出对其不予市场禁入措施的陈述申辩意见依法予以采纳。根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》第一百九十九条规定，中国证监会决定：责令肖洪彬依法处理非法持有的股票，对肖洪彬没收违法所得 48,735.11 元，并处以 146,205.33 元罚款。

## 2、2019 年 07 月 17 日公告：

(1) 主承销前海结算发行的 18 五矿地产 ABN002、19 五矿地产 ABN001、19 五矿地产 ABN002、19 五矿地产 ABN003 等 4 期资产支持票据均未向协会备案即进行了发行，对上述 4 期资产支持票据发行备案工作尽职履责不到位。

(2) 针对 19 五矿地产 ABN003 发行文件中前海结算 2019 年一季度财务报表信息披露不准确事项，未能及时关注到相关财务报表差异。

依据相关自律规定，经 2019 年第 8 次自律处分会议审议，中国银行间市场交易商协会给予中信建投通报批评处分，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

## 3、2019 年 07 月 18 日公告，中信建投证券存在以下问题：

(1) 中信建投证券私募子公司中信建投资本管理有限公司（以下简称建投资本）在完成组织架构规范整改公示前实际开展业务，违反《证券公司私募投资基金子公司管理规范》第三十七条的规定。

(2) 中信建投证券开展国债期货等部分品种自营交易的投资决策和交易执行未分离, 违反了《证券公司内部控制指引》第五十条的规定。

北京证监局决定责令中信建投证券在决定书作出之日起 3 个月内改正, 完善内部控制流程, 加强对子公司的合规管理, 并在 2019 年 06 月 30 日至 2020 年 06 月 30 日期间, 每 6 个月开展一次内部合规检查, 在每次检查后 10 个工作日内, 向北京证监局报送合规检查报告, 北京证监局将在日常监管中持续关注中信建投证券的整改情况。

4、2019 年 10 月 31 日公告, 中国证监会发现中信建投在保荐恒安嘉新(北京)股份公司(以下简称发行人)科创板首次公开发行股票申请过程中, 招股说明书申报稿显示发行人于 2018 年 12 月 28 日、12 月 29 日签订, 并于当年签署验收报告的 4 个重大合同(合计金额 15,859.76 万元), 2018 年底均未回款且未开具发票, 发行人将上述 4 个合同收入确认在 2018 年。在上交所审核过程中, 发行人以谨慎性为由, 对上述 4 个合同收入确认时点进行调整, 调整为满足合同约定并且主要经济利益已经流入公司后再予以确认收入。据此, 发行人相应调减 2018 年主营收入 13,682.84 万元, 调减净利润 7,827.17 万元, 扣非后归属于母公司所有者的净利润由调整前的 8,732.99 万元变为调整后的 905.82 万元, 调减金额占扣非前归属于母公司所有者的净利润的 89.63%。发行人对上述 4 个重大合同相关收入确认的信息披露前后不一致且有实质性差异。

上述情形, 反映了公司未能勤勉尽责地履行保荐义务, 按照《科创板首次公开发行股票注册管理办法(试行)》第七十四条的规定, 中国证监会决定对公司采取出具警示函的行政监督管理措施。

5、2019 年 12 月 06 日公告, (郭丽萍, 身份证号: 4203XXXXXXXXXX2049) 在中信建投证券股份有限公司十堰北京北路证券营业部从业期间, 存在为客户之间的融资提供便利的行为。

上述行为违反了中国证监会《证券经纪人管理暂行规定》(证监会公告[2009]2 号, 以下简称《暂行规定》)第十三条第(六)项的规定, 根据《暂行规定》第二十五条第一款、第二十七条第一款的规定, 湖北证监局决定采取出具警示函的行政监管措施。

6、2020 年 03 月 05 日公告, 浙江证监局发现夏孝臣在担任中信建投证券股份有限公司义乌县前街证券营业部负责人期间, 存在私下提供虚假或者误导客户的信息的行为。

浙江证监局决定依法采取出具警示函的监督管理措施, 并记入证券期货市场诚信档案。

7、2020 年 04 月 21 日公告, 中信建投管理的 8 只私募资管计划, 投资于同一资产的资金均超过该资产管理计划资产净值的 25%。

北京证监局决定对公司采取出具警示函的行政监督管理措施。

#### **本基金管理人作出说明如下:**

(1) 投资决策程序: 是经中国证监会批准设立的全国性大型综合证券公司, 自成立以来各项业务

快速发展，在企业融资、收购兼并、证券经纪、证券金融、固定收益、资产管理、股票及衍生品交易等领域形成了自身特色和核心业务优势，并搭建了研究咨询、信息技术、运营管理、风险管理、合规管理等专业高效的业务支持体系。公司业务经营相对稳健。

(2) 该公司由于员工非法买卖股票被证监会处罚；由于作为债券主承对发行稳健备案不合规被交易商协会通宝批评；由于子公司内部管理不规范被北京证监局责令整改；由于新股发行中未能勤勉尽责被证监会出具警示函；由于员工向客户提供融资便利被湖北证监局出具警示函；由于营业部负责人私下误导客户被浙江证监局出具警示函；由于资管计划投资底层资产比例超标被北京证监局出具警示函。虽然公司被监管处罚事项较多，但以上事项未对公司经营产生重大负面影响，因此决定继续持有该股票。

## 5、浦发银行（600000）

1、2020 年 01 月 13 日公告，浦发银行在开展基金销售业务中存在以下问题：

(1) 负责基金销售业务的部门管理人员未取得基金从业资格，不符合《证券投资基金销售管理办法》第十条第四项的规定。

(2) 投资者适当性执行不到位，客户投资风险评估工作存在漏洞，不符合《证券期货投资者适当性管理办法》第二十四条的规定。

根据《证券投资基金销售管理办法》第八十七条和《证券期货投资者适当性管理办法》第三十七条的规定，湖南证监局决定采取责令改正的行政监管措施。

### 本基金管理人作出说明如下：

(1) 投资决策程序：公司是一家全国性股份制银行，各项业务开展处于行业前列。上市以来连续多年被评为“中国上市公司 100 强”。2020 年 2 月英国《银行家》杂志发布“全球银行品牌 500 强”排名，浦发银行位列第 17 位，居上榜中资银行第 7 位。公司经营稳健，内控体系较完备。

(2) 公司由于基金销售人员未取得从业资格以及投资者适当性执行不到位，被湖南证监局责令改正。经过分析，该处罚不影响公司主要业务的开展，对经营无重大负面影响，因此决定继续持有该股票。

## 6、招商银行（600036）

1、2019 年 07 月 08 日公告，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 7 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。

#### 5.11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	18,138.63
2	应收证券清算款	104,295.13
3	应收股利	-
4	应收利息	1,982,805.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,105,239.30

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	132007	16 凤凰 EB	4,080,000.00	2.84
2	110053	苏银转债	3,039,904.00	2.11
3	113021	中信转债	2,256,069.50	1.57
4	128081	海亮转债	2,135,567.20	1.48
5	132018	G 三峡 EB1	1,918,498.40	1.33
6	113026	核能转债	1,711,972.20	1.19

7	110052	贵广转债	1,553,253.30	1.08
8	110065	淮矿转债	1,488,181.70	1.03
9	128085	鸿达转债	1,295,778.60	0.90
10	110059	浦发转债	1,295,532.00	0.90
11	110058	永鼎转债	1,204,641.40	0.84
12	110057	现代转债	1,168,201.50	0.81
13	110043	无锡转债	1,157,767.10	0.81
14	128064	司尔转债	1,108,240.65	0.77
15	113516	苏农转债	1,086,513.00	0.76
16	127006	敖东转债	1,036,377.24	0.72
17	132004	15 国盛 EB	1,000,800.00	0.70
18	123023	迪森转债	967,672.86	0.67
19	113530	大丰转债	912,780.00	0.63
20	110060	天路转债	889,461.00	0.62
21	113022	浙商转债	665,340.00	0.46
22	113554	仙鹤转债	647,337.60	0.45
23	113030	东风转债	539,451.00	0.38
24	127013	创维转债	529,784.40	0.37
25	113025	明泰转债	524,132.70	0.36
26	113534	鼎胜转债	464,723.40	0.32
27	113024	核建转债	304,152.00	0.21
28	127012	招路转债	302,190.00	0.21
29	113029	明阳转债	190,020.20	0.13



30	128048	张行转债	104,541.30	0.07
----	--------	------	------------	------

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

	桉盛债券 A	桉盛债券 C
报告期期初基金份额总额	127,138,922.23	-
报告期期间基金总申购份额	1,073.89	1,878.17
减：报告期期间基金总赎回份额	1,667.04	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	127,138,329.08	1,878.17

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未进行本基金的申购、赎回及红利再投资等交易。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020 年 04 月 01 日 -2020 年 06 月 30 日	99,999,000.00	0.00	0.00	99,999,000.00	78.65%

#### 产品特有风险

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

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2020 年 04 月 17 日，在《上海证券报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

2、2020 年 04 月 22 日，在《上海证券报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安基金管理有限公司关于旗下基金在泰诚财富基金销售（大连）有限公司暂停办理相关销售业务的公告；

3、2020 年 04 月 22 日，在《上海证券报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安基金管理有限公司

旗下证券投资基金 2020 年第一季度的报告；

4、2020 年 05 月 06 日，在《上海证券报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加中信证券华南股份有限公司为销售机构的公告；

5、2020 年 05 月 06 日，在《上海证券报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金新增北京肯特瑞基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

6、2020 年 05 月 27 日，在《上海证券报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安基金管理有限公司关于暂停扬州国信嘉利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告；

7、2020 年 06 月 01 日，在《上海证券报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告；

8、2020 年 06 月 11 日，在《上海证券报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加沈阳麟龙投资顾问有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金元顺安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。

### 9.2 存放地点

金元顺安基金管理有限公司

中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室

### 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间至办公地点进行查询，或登录本基金管理人网站 [www.jysa99.com](http://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

2020 年 07 月 21 日