

金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金

2020 年第 4 季度报告

2020 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 01 月 22 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 | 11 |
| 4.1 | 基金经理（或基金经理小组）简介 | 11 |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 12 |
| 4.3 | 公平交易专项说明 | 12 |
| 4.4 | 报告期内基金的投资策略和运作分析 | 13 |
| 4.5 | 报告期内基金的业绩表现 | 13 |
| 4.6 | 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 | 13 |
| §5 | 投资组合报告 | 14 |
| 5.1 | 报告期末基金资产组合情况 | 14 |
| 5.2 | 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 14 |
| 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 | 15 |
| 5.4 | 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 | 16 |
| 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 | 17 |
| 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 | 17 |
| 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 | 17 |
| 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 | 17 |
| 5.9 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 17 |
| 5.10 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 17 |
| 5.11 | 投资组合报告附注 | 18 |
| §6 | 开放式基金份额变动 | 21 |
| §7 | 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 | 22 |
| 7.1 | 基金管理人持有本基金份额变动情况 | 22 |
| 7.2 | 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 | 22 |

| | | |
|-----|------------------------------------|----|
| §8 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 23 |
| 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..... | 23 |
| 8.2 | 影响投资者决策的其他重要信息..... | 23 |
| §9 | 备查文件目录 | 25 |
| 9.1 | 备查文件目录 | 25 |
| 9.2 | 存放地点 | 25 |
| 9.3 | 查阅方式 | 25 |

§1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 01 月 21 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 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 金元顺安优质精选灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 620007 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 10 月 10 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 118,417,818.67 份 |
| 投资目标 | 本基金在在正确认识中国经济发展特点的基础上，透过投资于优质股票和票息优势的固定收益证券，并结合严格风险管理，为投资者带来稳定的当期收益与长期的资本增值。 |
| 投资策略 | 本基金的大类资产配置策略的关键在于自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析的有机结合。股票投资采取行业配置指导下的个股精选方法；债券投资组合以具票息优势的债券作为主要投资对象，并通过对债券的信用、久期和凸性等的灵活配置，进行相对积极主动的操作，力争获取超越债券基准的收益；权证投资主要考虑运用的策略包括：限量投资、趋势投资、优化组合策略、价差策略、双向权证策略等；资产支持证券投资主要分析资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×55%+中国债券总指数收益率×45% |
| 风险收益特征 | 本基金系主动投资的混合型基金，其风险收益特征从长期平均及预期来看，低于股票型基金，高于货币市场基金，属于中低风险证券投资基金品种。 |
| 基金管理人 | 金元顺安基金管理有限公司 |

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 金元顺安优质精选灵活配置混合 A 类 | 金元顺安优质精选灵活配置混合 C 类 |
| 下属分级基金的交易代码 | 620007 | 001375 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,841,020.13份 | 113,576,798.54份 |

注：

1、“金元比联保本混合型证券投资基金”（系本基金前身，以下简称“本基金”）合同生效日为 2011 年 08 月 16 日。自 2017 年 10 月 10 日起，本基金转型为混合型证券投资基金。故本报告中，本基金基金合同生效日为 2017 年 10 月 10 日。

2、本基金自 2015 年 06 月 02 日起，新增 C 类份额。

§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10月01日-2020年12月31日） | |
|----------------|------------------------------|----------------------|
| | 金元顺安优质精选灵活配置混合 A类 | 金元顺安优质精选灵活配置混合 C类 |
| 1.本期已实现收益 | 253,501.93 | 5,811,338.77 |
| 2.本期利润 | 1,240,205.01 | 28,499,525.38 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2512 | 0.2509 |
| 4.期末基金资产净值 | 8,222,173.81 | 192,308,590.63 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.698 | 1.693 |

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金元顺安优质精选灵活配置混合 A 类净值表现

| 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 | 17.35% | 1.09% | 7.84% | 0.54% | 9.51% | 0.55% |
| 过去六个月 | 26.72% | 1.30% | 12.97% | 0.72% | 13.75% | 0.58% |
| 过去一年 | 49.08% | 1.38% | 14.85% | 0.77% | 34.23% | 0.61% |
| 过去三年 | 47.52% | 1.14% | 20.92% | 0.72% | 26.60% | 0.42% |
| 自基金转型起至今 | 46.51% | 1.10% | 22.72% | 0.71% | 23.79% | 0.39% |

金元顺安优质精选灵活配置混合 C 类净值表现

| 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 | 17.41% | 1.09% | 7.84% | 0.54% | 9.57% | 0.55% |
| 过去六个月 | 26.72% | 1.30% | 12.97% | 0.72% | 13.75% | 0.58% |
| 过去一年 | 49.16% | 1.37% | 14.85% | 0.77% | 34.31% | 0.60% |
| 过去三年 | 47.47% | 1.14% | 20.92% | 0.72% | 26.55% | 0.42% |
| 自基金转型起至今 | 46.20% | 1.10% | 22.72% | 0.71% | 23.48% | 0.39% |

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金元顺安优质精选灵活配置混合A类累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



金元顺安优质精选灵活配置混合C类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、“金元比联保本混合型证券投资基金”（系本基金前身，以下简称“本基金”）合同生效日为 2011 年 08 月 16 日。自 2017 年 10 月 10 日起，本基金转型为混合型证券投资基金，业绩基准累计增长率以 2017 年 10 月 09 日指数为基准；

2、本基金投资组合中股票、权证的投资比例为基金资产的 30%—80%；债券、货币市场工具等占基金资产的 20%—70%，其中，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例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“沪深 300 指数收益率×55%+中国债券总指数收益率×45%”。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券 从业 年限 | 说明 |
|-----|-----------------|-------------|------|----------------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 周博洋 | 本基金 基金经 理 | 2018-01-26 | - | 8 年 | 金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金、金元顺安沅顺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的基金经理，兰卡斯特大学理学硕士。曾任上海新世纪资信评估投资服务有限公司助理分析师，上海证券有限责任公司项目经理。2014 年 8 月加入金元顺安基金管理有限公司。8 年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。 |
| 张博 | 本基金 基金经 理 | 2018-04-04 | - | 10 年 | 金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金和金元顺安沅泉债券型证券投资基金的基金经理，北京邮电大学工学博士。曾任普天信息技术研究院有限公司产业研究员，渤海证券股份有限公司高级研究员，天安财产保险股份有限公司投资经理助理，中信保诚人寿保险 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 有限公司投资经理。2018 年 3 月加入金元顺安基金管理有限公司。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》、《金元顺安优质精选灵活配置混合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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年四季度上证综指上涨 7.92%，深证成指上涨 12.11%，沪深 300 上涨 13.60%，中证 500 上涨 2.82%，创业板综指上涨 5.38%，新能源、汽车、食品饮料等板块表现较强。四季度我们保持行业的均衡配置，持仓的行业结构变动不大，在大部分时间都在耐心持股，仅针对少量持仓个股做了调整。我们在公司选择方面，依然专注在具有长期增长价值的优秀公司，尤其是那些处于高景气或边际改善行业中的优秀公司，将这一类别作为配置的重点，进行适度的分散化配置。四季度债券收益率震荡下行，10 年国开收益率下行幅度约 20bp，报告期内本基金债券配置偏向保守，仅在 11 月底央行超预期进行 MLF 续作后逐步提升组合久期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额净值为 1.698 元；

本报告期内，基金份额净值增长率为 17.35%，同期业绩比较基准收益率为 7.84%。

截至报告期末金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额净值为 1.693 元；

本报告期内，基金份额净值增长率为 17.41%，同期业绩比较基准收益率为 7.84%。

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 | 148,803,882.07 | 66.37 |
| | 其中：股票 | 148,803,882.07 | 66.37 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 64,259,422.12 | 28.66 |
| | 其中：债券 | 64,259,422.12 | 28.66 |
| | 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 | 4,244,882.29 | 1.89 |
| 8 | 其他资产 | 6,901,192.28 | 3.08 |
| 9 | 合计 | 224,209,378.76 | 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 | 5,439,888.00 | 2.71 |
| B | 采矿业 | - | - |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| C | 制造业 | 106,744,338.57 | 53.23 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 2,348,917.94 | 1.17 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 112,095.36 | 0.06 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 17,144,132.82 | 8.55 |
| J | 金融业 | 1,756,799.91 | 0.88 |
| K | 房地产业 | 8,756,865.25 | 4.37 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 8,938.80 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 228,817.98 | 0.11 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 6,164,064.00 | 3.07 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 99,023.44 | 0.05 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 148,803,882.07 | 74.21 |

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 | 600809 | 山西汾酒 | 29,688 | 11,141,609.52 | 5.56 |
| 2 | 600132 | 重庆啤酒 | 75,100 | 8,936,149.00 | 4.46 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 132,895 | 7,458,067.40 | 3.72 |
| 4 | 300496 | 中科创达 | 61,800 | 7,230,600.00 | 3.61 |
| 5 | 603486 | 科沃斯 | 78,300 | 6,928,767.00 | 3.46 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 23,400 | 6,829,290.00 | 3.41 |
| 7 | 002311 | 海大集团 | 104,200 | 6,825,100.00 | 3.40 |
| 8 | 601877 | 正泰电器 | 168,400 | 6,594,544.00 | 3.29 |
| 9 | 688169 | 石头科技 | 6,345 | 6,573,420.00 | 3.28 |
| 10 | 603043 | 广州酒家 | 154,500 | 5,983,785.00 | 2.98 |

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 | 16,980,200.00 | 8.47 |
| | 其中：政策性金融债 | 16,980,200.00 | 8.47 |
| 4 | 企业债券 | 30,017,000.00 | 14.97 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 17,262,222.12 | 8.61 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|---------------|-------|
| 10 | 合计 | 64,259,422.12 | 32.04 |
|----|----|---------------|-------|

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 | 143867 | 18 电投 08 | 100,000 | 10,078,000.00 | 5.03 |
| 2 | 136401 | 16 华润 01 | 100,000 | 10,021,000.00 | 5.00 |
| 3 | 200306 | 20 进出 06 | 100,000 | 9,983,000.00 | 4.98 |
| 4 | 163281 | 20CHNE03 | 100,000 | 9,918,000.00 | 4.95 |
| 5 | 018013 | 国开 2004 | 70,000 | 6,997,200.00 | 3.49 |

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、山西汾酒（600809）

2020 年 12 月 31 日公告,上海证券交易所上市公司监管一部经查明,2020 年 12 月 26 日,山西杏花村汾酒厂股份有限公司的控股股东山西杏花村汾酒集团有限责任公司(以下简称汾酒集团)召开 2020 全球经销商会议。公司董事长李秋喜在会议上表示,2020 年汾酒集团收入预计增长 17%,利润总额预计同比增长 60%,全年营收预计排名行业前列,利润同比增速继续保持行业第一。根据公司 2019 年年报及相关公告,公司 2019 年的营业收入、净利润占控股股东营业收入、净利润的比例分别为 98%、113%,公司是控股股东的主要收入和利润来源,经营业绩与控股股东高度关联。董事长发布的汾酒集团相关信息,直接涉及公司尚未披露的 2020 年度经营业绩,属于对公司股票交易价格和投资者决策可能产生较大影响的信息。李秋喜作为公司时任董事长,通过非法定信息披露渠道自行对外发布涉及公司经营的重要信息,上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》(以下简称《股票上市规则》)第 2.2 条、第 2.4 条、第 2.6 条、第 2.14 条、第 2.15 条、第 3.1.4 条、第 3.1.5 条等有关规定,以及在《董事(监事、高级管理人员)声明及承诺书》中做出的承诺。

上海证券交易所上市公司监管一部对山西杏花村汾酒厂股份有限公司时任董事长李秋喜予以监管关注。

本基金管理人做出说明如下:

(1) 投资决策程序:通过对公司的基本面进行分析,认为基本面发展势头良好,业绩表现符合预期,后续业务持续发展尚有一定的潜力;

(2) 因 2020 年 12 月 26 日,山西杏花村汾酒厂股份有限公司的控股股东汾酒集团召开 2020 全球经销商会议,公司董事长李秋喜在会议上发布的汾酒集团相关信息,直接涉及公司尚未披露的 2020 年度经营业绩,属于对公司股票交易价格和投资者决策可能产生较大影响的信息,因此上海证券交易所上市公司监管一部对山西杏花村汾酒厂股份有限公司时任董事长李秋喜予以监管关注。经过分析,我

们认为该事项对公司影响可控，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 | 42,319.73 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,150,523.83 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 704,875.69 |
| 5 | 应收申购款 | 3,473.03 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 6,901,192.28 |

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 | 110053 | 苏银转债 | 2,143,548.00 | 1.07 |
| 2 | 128028 | 赣锋转债 | 1,925,113.32 | 0.96 |
| 3 | 113011 | 光大转债 | 1,787,588.40 | 0.89 |
| 4 | 110059 | 浦发转债 | 1,783,536.00 | 0.89 |
| 5 | 113021 | 中信转债 | 1,776,996.90 | 0.89 |
| 6 | 113516 | 苏农转债 | 1,723,123.40 | 0.86 |
| 7 | 127005 | 长证转债 | 1,449,725.00 | 0.72 |
| 8 | 127012 | 招路转债 | 1,001,291.90 | 0.50 |
| 9 | 110067 | 华安转债 | 874,528.20 | 0.44 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 10 | 113013 | 国君转债 | 855,476.80 | 0.43 |
|----|--------|------|------------|------|

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

| | 金元顺安优质精选灵 活配置混合 A 类 | 金元顺安优质精选灵 活配置混合 C 类 |
|---------------------------|------------------------|------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 5,023,221.80 | 113,576,798.54 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 32,536.79 | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 214,738.46 | - |
| 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 | 4,841,020.13 | 113,576,798.54 |

§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 10 月 01 日-2020 年 12 月 31 日 | 67,661,305.58 | - | - | 67,661,305.58 | 57.14% |
| | 2 | 2020 年 10 月 01 日-2020 年 12 月 31 日 | 45,915,492.96 | - | - | 45,915,492.96 | 38.77% |

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 10 月 28 日，在《证券时报》和 www.jysa99.com 公布金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金 2020 年第三季度的报告；

2、2020 年 11 月 05 日，在《证券时报》和 www.jysa99.com 公布金元顺安基金管理有限公司关于

修改旗下部分证券投资基金基金合同及托管协议的公告；

3、2020 年 11 月 05 日，在《证券时报》和 www.jysa99.com 公布金元顺安基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书更新公告；

4、2020 年 11 月 05 日，在《证券时报》和 www.jysa99.com 公布金元顺安基金管理有限公司关于旗下证券投资基金产品资料概要更新；

§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优质精选灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

金元顺安基金管理有限公司

中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间至办公地点进行查询，或登录本基金管理人网站 www.jysa99.com 查阅。投资者对本报告书存有疑问，可咨询本基金管理人金元顺安基金管理有限公司，本公司客服电话 400-666-0666、021-68881898。

金元顺安基金管理有限公司

2021 年 01 月 22 日