

金元顺安沅泉债券型证券投资基金
2021 年第 4 季度报告

2021 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 01 月 24 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	6
3.1	主要财务指标	6
3.2	基金净值表现	6
§4	管理人报告	8
4.1	基金经理（或基金经理小组）简介	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.3	公平交易专项说明	9
4.4	报告期内基金的投资策略和运作分析	9
4.5	报告期内基金的业绩表现	10
4.6	报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	10
§5	投资组合报告	11
5.1	报告期末基金资产组合情况	11
5.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	11
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	12
5.4	报告期末按债券品种分类的债券投资组合	12
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	12
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	13
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	13
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	13
5.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	13
5.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	13
5.11	投资组合报告附注	13
§6	开放式基金份额变动	17
§7	基金管理人运用固有资金投资本基金情况	18
7.1	基金管理人持有本基金份额变动情况	18
7.2	基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	18

§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	19
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.....	19
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	19
§9 备查文件目录	21
9.1 备查文件目录	21
9.2 存放地点	21
9.3 查阅方式	21

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2021 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金元顺安沅泉债券
基金主代码	005843
交易代码	005843
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 06 月 10 日
报告期末基金份额总额	99,256,462.09 份
投资目标	本基金在控制基金资产净值波动的基础上，严格管理股票资产的投资比例，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将密切关注债券、股票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，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于中低风险的证券投资基金品种。
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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（2021 年 10 月 01 日-2021 年 12 月 31 日）
1.本期已实现收益	2,677,206.63
2.本期利润	5,108,314.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0514
4.期末基金资产净值	115,852,383.80
5.期末基金份额净值	1.1672

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

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	4.61%	0.17%	0.60%	0.05%	4.01%	0.12%
过去六个月	8.92%	0.23%	1.44%	0.05%	7.48%	0.18%
过去一年	9.87%	0.24%	2.10%	0.05%	7.77%	0.19%

自基金合同生效起至今	16.72%	0.17%	3.23%	0.07%	13.49%	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

金元顺安沅泉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
(2019年06月10日-2021年12月31日)



注：

- 1、本基金合同生效日为 2019 年 06 月 10 日，业绩基准收益率以 2019 年 06 月 07 日为基准；
- 2、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、公开发行的次级债、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的纯债部分）、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、创业板及其他依法上市的股票）、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。

- 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		
周博洋	本基金 基金经 理	2019-06-10	-	9 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。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》、《金元顺安沅泉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

国庆长假后，受二次“降准”预期落空和通胀预期升温的影响，利率出现明显调整，十年国债收益率在 10 月中旬触及 3.04%，之后央行连续开展大额逆回购操作呵护流动性，市场收益率震荡下行。12 月初，年内第二次降准落地，1 年期 LPR 降息，对基本面的悲观预期促使政策利率调降预期升温，市场利率加速下行，十年国债收益率向下突破 2.8%。整个四季度十年国债收益率在 2.77%-3.04% 区间内波动，市场利率整体呈震荡下行走势。转债方面，持续宽松的流动性支撑高估值，中证转债指数四季度涨幅达 7.05%。报告期内，本基金保持组合中等久期，并适当进行转债配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安沅泉债券型证券投资基金份额净值为 1.1672 元；

本报告期内，基金份额净值增长率为 4.61%，同期业绩比较基准收益率为 0.60%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	121,770,114.97	93.02
	其中：债券	121,770,114.97	93.02
	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	3,000,000.00	2.29
	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	4,319,064.86	3.30
8	其他资产	1,821,331.81	1.39
9	合计	130,910,511.64	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	20,151,000.00	17.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,614,000.00	17.79
	其中：政策性金融债	20,614,000.00	17.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,043,000.00	8.67
6	中期票据	20,236,000.00	17.47
7	可转债（可交换债）	50,726,114.97	43.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	121,770,114.97	105.11

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	210205	21国开05	100,000	10,404,000.00	8.98
2	210403	21农发03	100,000	10,210,000.00	8.81
3	210009	21付息国债09	100,000	10,166,000.00	8.77

3	101556023	15闽高速MTN001	100,000	10,166,000.00	8.77
5	101900820	19汇金MTN011	100,000	10,070,000.00	8.69

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

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	15,271.05
2	应收证券清算款	415,155.73
3	应收股利	-
4	应收利息	1,390,875.04
5	应收申购款	29.99
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,821,331.81

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	113044	大秦转债	2,452,550.40	2.12
2	128129	青农转债	2,325,272.40	2.01
3	128034	江银转债	2,254,788.90	1.95
4	110053	苏银转债	2,216,882.80	1.91
5	110043	无锡转债	2,197,779.50	1.90
6	127006	敖东转债	1,822,086.90	1.57
7	110073	国投转债	1,660,273.80	1.43
8	123096	思创转债	1,539,053.55	1.33
9	113530	大丰转债	1,507,905.60	1.30
10	113608	威派转债	1,470,813.30	1.27

11	123049	维尔转债	1,349,312.00	1.16
12	123082	北陆转债	1,239,861.00	1.07
13	113606	荣泰转债	1,234,717.50	1.07
14	123076	强力转债	1,193,899.20	1.03
15	123077	汉得转债	1,180,713.90	1.02
16	128107	交科转债	1,159,004.16	1.00
17	123059	银信转债	1,150,718.27	0.99
18	113037	紫银转债	1,149,968.10	0.99
19	127012	招路转债	1,149,703.74	0.99
20	110067	华安转债	1,147,540.80	0.99
21	128048	张行转债	1,133,252.25	0.98
22	123023	迪森转债	1,131,891.60	0.98
23	113050	南银转债	1,118,124.00	0.97
24	123105	拓尔转债	873,032.50	0.75
25	110062	烽火转债	812,316.50	0.70
26	110060	天路转债	634,304.00	0.55
27	127013	创维转债	621,991.40	0.54
28	113563	柳药转债	619,813.80	0.54
29	113524	奇精转债	617,197.00	0.53
30	113535	大业转债	615,959.40	0.53
31	128083	新北转债	605,176.50	0.52
32	113033	利群转债	598,562.40	0.52
33	128049	华源转债	596,985.60	0.52

34	123106	正丹转债	594,163.80	0.51
35	128039	三力转债	580,902.10	0.50
36	113601	塞力转债	578,642.40	0.50
37	113532	海环转债	578,604.00	0.50
38	110068	龙净转债	573,790.50	0.50
39	128116	瑞达转债	570,110.40	0.49
40	113597	佳力转债	562,908.00	0.49
41	110080	东湖转债	552,687.20	0.48
42	128120	联诚转债	550,525.44	0.48
43	128042	凯中转债	528,030.00	0.46
44	128071	合兴转债	400,334.00	0.35
45	127034	绿茵转债	344,375.50	0.30
46	113046	金田转债	331,956.80	0.29
47	113036	宁建转债	318,696.00	0.28
48	110064	建工转债	316,525.00	0.27

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

报告期期初基金份额总额	99,499,006.96
报告期期间基金总申购份额	198,344.53
减：报告期期间基金总赎回份额	440,889.40
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	99,256,462.09

§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	2021年10月1日 - 2021年12月31日	96,144,710.03	0.00	0.00	96,144,710.03	96.86%

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、2021年10月12日，在《上海证券报》和 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海银基金销售有限公司费率优惠活动的公告；

2、2021年10月27日，在《上海证券报》和 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 2021 年第三季度报告；

3、2021 年 11 月 11 日，在《上海证券报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安沅泉债券型证券投资基金基金产品资料概要更新；

4、2021 年 11 月 11 日，在《上海证券报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安沅泉债券型证券投资基金更新招募说明书；

5、2021 年 11 月 18 日，在《上海证券报》和 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西部证券股份有限公司费率优惠活动的公告。

§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沔泉债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安沔泉债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安沔泉债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安沔泉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沔泉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 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

2022 年 01 月 24 日