金元顺安金通宝货币市场基金
2023 年第 1 季度报告

2023 年 03 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

报告送出日期：2023 年 04 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 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 10
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 10
4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明 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 12
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 报告期债券回购融资情况 13
5.3 基金投资组合平均剩余期限 13
5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 14
5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 14
5.6 报告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 15
5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 16
5.8 报告期末按摊余成本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 16
5.9 投资组合报告附注 16
§6 开放式基金份额变动 18
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 19
§8 影响投资者决策的其他重要信息 21

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 21

8.2 影响投资者决策的其他重要信息 22

§9 备查文件目录 23

9.1 备查文件目录 23

9.2 存放地点 23

9.3 查阅方式 23

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 04 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金元顺安金通宝货币	
基金主代码	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	
报告期末基金份额总额	65,962,464.18 份	
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。	
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	
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	122,214.58份	65,840,249.60份

§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（2022 年 10 月 01 日 - 2022 年 12 月 31 日）	
	金通宝货币 A 类	金通宝货币 B 类
1.本期已实现收益	403.76	355,589.07
2.本期利润	403.76	355,589.07
3.期末基金资产净值	122,214.58	65,840,249.60

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）扣除相关费用及信用减值损失后的余额，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 03 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 类净值表现

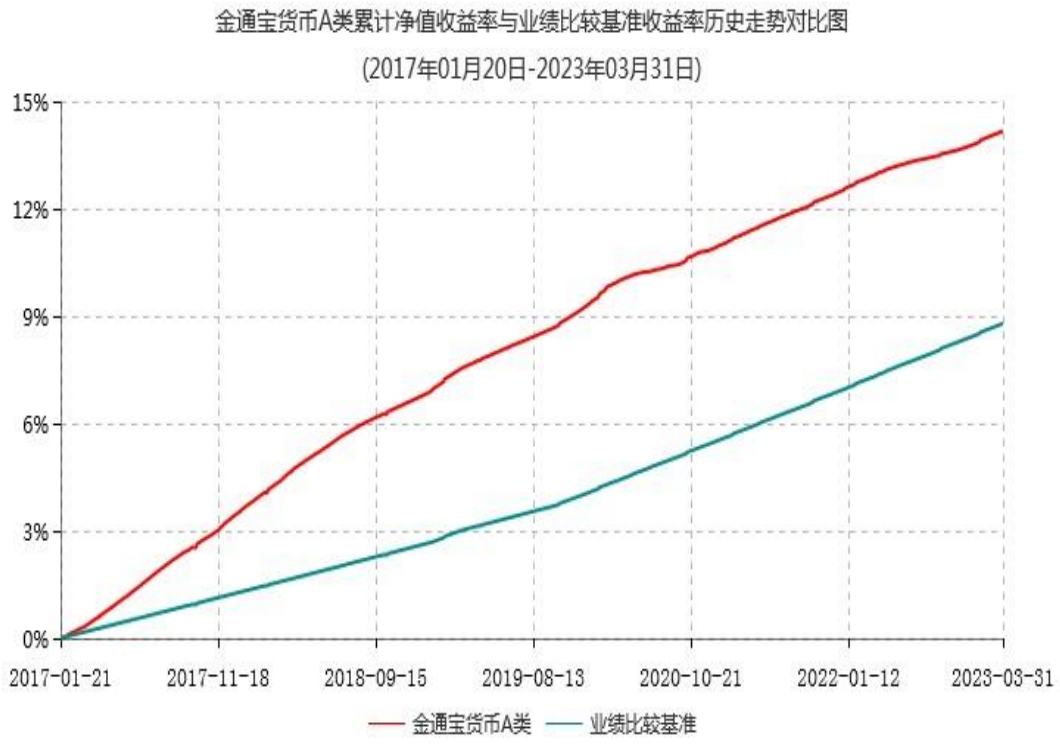
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3450%	0.0006%	0.3334%	0.0000%	0.0116%	0.0006%
过去六个月	0.5967%	0.0008%	0.6753%	0.0000%	-0.0786%	0.0008%
过去一年	1.0847%	0.0008%	1.3590%	0.0000%	-0.2743%	0.0008%

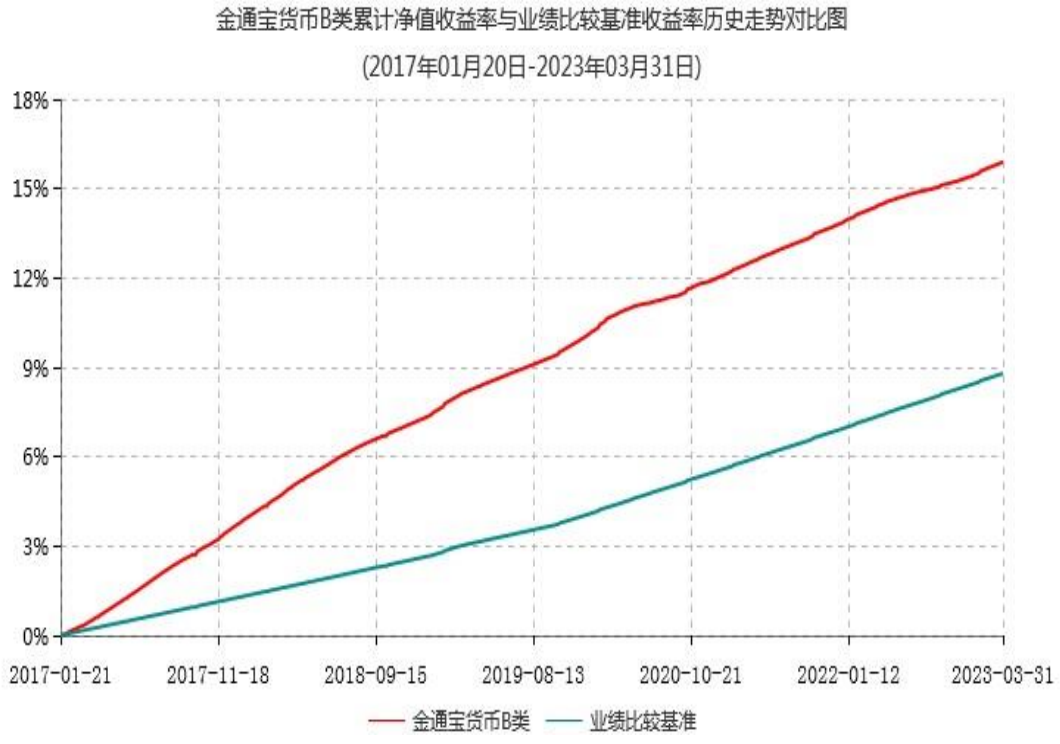
过去三年	3.7800%	0.0011%	4.1326%	0.0000%	-0.3526%	0.0011%
过去五年	9.1521%	0.0025%	6.9860%	0.0000%	2.1661%	0.0025%
自基金成立起至今	14.1718%	0.0034%	8.7251%	0.0000%	5.4467%	0.0034%

金通宝货币 B 类净值表现

阶段	净值收益率①	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	0.4042%	0.0006%	0.3334%	0.0000%	0.0708%	0.0006%
过去六个月	0.7169%	0.0008%	0.6753%	0.0000%	0.0416%	0.0008%
过去一年	1.3275%	0.0008%	1.3590%	0.0000%	-0.0315%	0.0008%
过去三年	4.5292%	0.0011%	4.1326%	0.0000%	0.3966%	0.0011%
过去五年	10.4704%	0.0025%	6.9860%	0.0000%	3.4844%	0.0025%
自基金成立起至今	15.8843%	0.0034%	8.7251%	0.0000%	7.1592%	0.0034%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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





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）”。

§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		
苏利华	本基金基金经理	2021-01-12	-	13 年	金元顺安金元宝货币市场基金、金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安沣泰定期开放债券型发起式证券投资基金和金元顺安泓丰纯债 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理，上海交通大学应用统计学硕士。曾任内蒙古自治区农村信用社联合社债券交易员。2016 年 8 月加入金元顺安基金管理有限公司。13 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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 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

一季度我国经济延续修复，但修复动能有逐月放缓的趋势。固定资产投资稳中有升，基建投资维持高位，制造业投资小幅回落，房地产投资降幅收窄。社零同比增速改善明显。外需回落，出口延续下行趋势。工业生产持续改善，服务业景气度较高。一季度我国 CPI 持续回落，核心 CPI 低位运行，PPI 降幅加大，整体物价压力不大。

中央经济工作会议对经济“稳中求进”定调，要求稳健的货币政策要精准有力。要搞好跨周期调节，着力支持扩大内需，为实体经济提供有力支持。积极的财政政策要加力提效，更直接更有效的发挥积极财政政策。

一季度流动性合理充裕。央行在 3 月份全面降准以及增量续作 MLF，在季末、税期关键时点加大公开市场投放，维稳资金面，资金利率中枢围绕政策利率波动。

在报告期，本基金采取中短久期策略，资产配置以高评级存单以及回购为主，获得良好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金通宝货币 A 类基金份额净值为 1.000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为 0.3450%，同期业绩比较基准收益率为 0.3334%；截至报告期末金通宝货币 B 类基金份额净值为 1.000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为 0.4042%，同期业绩比较基准收益率为 0.3334%。

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的情形。

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	固定收益投资	44,978,086.56	68.08
	其中：债券	44,978,086.56	68.08
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	15,004,047.00	22.71
	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	1,077,100.17	1.63
4	其他资产	5,005,764.18	7.58
5	合计	66,064,997.91	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	32
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	42
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

5.3.2 报告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	62.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	15.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	15.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		92.56	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,091,883.86	7.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	39,886,202.70	60.47
8	其他	-	-
9	合计	44,978,086.56	68.19
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112211091	22平安银行CD091	100,000	9,982,407.21	15.13
2	112205064	22建设银行CD064	100,000	9,982,366.77	15.13
3	112206135	22交通银行CD135	100,000	9,969,009.78	15.11
4	112303029	23农业银行CD029	100,000	9,952,418.94	15.09
5	019674	22国债09	50,000	5,091,883.86	7.72
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-

10	-	-	-	-	-

5.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0158%
报告期内偏离度的最低值	-0.0203%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0094%

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负偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告期末按摊余成本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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	764.18
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	5,005,000.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	5,005,764.18

5.9.4 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。

§6 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
报告期期初基金份额总额	123,251.32	60,595,015.12
报告期期间基金总申购份额	9,305.76	55,355,589.07
报告期期间基金总赎回份额	10,342.50	50,110,354.59
报告期期末基金份额总额	122,214.58	65,840,249.60

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利发放	2023-01-03	702.45	702.45	0.0000
2	红利发放	2023-01-04	175.69	175.69	0.0000
3	红利发放	2023-01-05	175.68	175.68	0.0000
4	红利发放	2023-01-06	135.49	135.49	0.0000
5	红利发放	2023-01-09	242.75	242.75	0.0000
6	红利发放	2023-01-10	148.80	148.80	0.0000
7	红利发放	2023-01-11	155.31	155.31	0.0000
8	红利发放	2023-01-12	155.31	155.31	0.0000
9	红利发放	2023-01-13	158.23	158.23	0.0000
10	红利发放	2023-01-16	480.04	480.04	0.0000
11	红利发放	2023-01-17	156.70	156.70	0.0000
12	红利发放	2023-01-18	173.13	173.13	0.0000
13	红利发放	2023-01-19	173.14	173.14	0.0000
14	红利发放	2023-01-20	174.95	174.95	0.0000
15	红利发放	2023-01-30	1,858.03	1,858.03	0.0000
16	红利发放	2023-01-31	165.55	165.55	0.0000
17	红利发放	2023-02-01	172.05	172.05	0.0000
18	红利发放	2023-02-02	172.06	172.06	0.0000
19	红利发放	2023-02-03	154.49	154.49	0.0000
20	红利发放	2023-02-06	483.02	483.02	0.0000
21	红利发放	2023-02-07	163.06	163.06	0.0000
22	红利发放	2023-02-08	163.39	163.39	0.0000

23	红利发放	2023-02-09	163.43	163.43	0.0000
24	红利发放	2023-02-10	169.09	169.09	0.0000
25	红利发放	2023-02-13	507.32	507.32	0.0000
26	红利发放	2023-02-14	162.08	162.08	0.0000
27	红利发放	2023-02-15	165.40	165.40	0.0000
28	红利发放	2023-02-16	166.23	166.23	0.0000
29	红利发放	2023-02-17	169.56	169.56	0.0000
30	红利发放	2023-02-20	508.75	508.75	0.0000
31	红利发放	2023-02-21	175.02	175.02	0.0000
32	红利发放	2023-02-22	175.67	175.67	0.0000
33	红利发放	2023-02-23	135.73	135.73	0.0000
34	红利发放	2023-02-24	92.53	92.53	0.0000
35	红利发放	2023-02-27	470.06	470.06	0.0000
36	红利发放	2023-02-28	165.10	165.10	0.0000
37	红利发放	2023-03-01	165.11	165.11	0.0000
38	红利发放	2023-03-02	165.12	165.12	0.0000
39	红利发放	2023-03-03	155.96	155.96	0.0000
40	红利发放	2023-03-06	467.94	467.94	0.0000
41	红利发放	2023-03-07	155.99	155.99	0.0000
42	红利发放	2023-03-08	156.00	156.00	0.0000
43	红利发放	2023-03-09	155.94	155.94	0.0000
44	红利发放	2023-03-10	152.52	152.52	0.0000
45	红利发放	2023-03-13	457.62	457.62	0.0000
46	红利发放	2023-03-14	152.55	152.55	0.0000
47	红利发放	2023-03-15	152.56	152.56	0.0000

48	红利发放	2023-03-16	152.57	152.57	0.0000
49	红利发放	2023-03-17	160.59	160.59	0.0000
50	红利发放	2023-03-20	481.82	481.82	0.0000
51	红利发放	2023-03-21	160.62	160.62	0.0000
52	红利发放	2023-03-22	160.63	160.63	0.0000
53	红利发放	2023-03-23	160.64	160.64	0.0000
54	红利发放	2023-03-24	145.08	145.08	0.0000
55	红利发放	2023-03-27	470.85	470.85	0.0000
56	红利发放	2023-03-28	148.19	148.19	0.0000
57	红利发放	2023-03-29	159.99	159.99	0.0000
58	红利发放	2023-03-30	160.00	160.00	0.0000
59	红利发放	2023-03-31	216.59	216.59	0.0000
合计			14,680.17	14,680.17	

§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	2023 年 01 月 01 日-2023 年 03 月 31 日	47,175,006.27	192,549.55	0.00	47,367,555.82	71.81%

	2	2023 年 01 月 06 日-2023 年 02 月 23 日	0.00	50,109,068.65	50,109,068.65	0.00	0.00%

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、2023 年 01 月 20 日，在《中国证券报》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 2022 年第四季度报告；

2、2023 年 02 月 10 日，在《中国证券报》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新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

3、2023 年 02 月 20 日，在《中国证券报》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增加广发证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

4、2023 年 03 月 14 日，在《中国证券报》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增加中泰证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

5、2023 年 03 月 31 日，在《中国证券报》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 2022 年度报告。

§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金通宝货币市场基金募集注册的文件；

2、《金元顺安金通宝货币市场基金基金合同》；

3、《金元顺安金通宝货币市场基金基金招募说明书》；

4、《金元顺安金通宝货币市场基金托管协议》；

5、关于申请募集注册金元顺安金通宝货币市场基金的法律意见书；

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

2023 年 04 月 22 日