

金元顺安沅泉债券型证券投资基金

2023年第3季度报告

2023年09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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2023年10月25日

目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	6
4.3 公平交易专项说明	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	7
4.5 报告期内基金的业绩表现	7
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	7
§5 投资组合报告	8
5.1 报告期末基金资产组合情况	8
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	8
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	8
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	8
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	9
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	9
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	9
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	9
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	9
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	10
5.11 投资组合报告附注	10
§6 开放式基金份额变动	11
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	11
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	11
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	11
§8 影响投资者决策的其他重要信息	11
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	11
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	12
§9 备查文件目录	13
9.1 备查文件目录	13
9.2 存放地点	14
9.3 查阅方式	14

§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2023年10月24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07月01日起至2023年09月30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
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	423,881,589.70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，其风险收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于中低风险中低收益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	
下属分级基金的基金简称	金元顺安沅泉债券A	金元顺安沅泉债券C
下属分级基金的交易代码	005843	019486
报告期末下属分级基金的份额总额	423,881,589.70份	0.00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(2023年07月01日 - 2023年09月30日)	
	沅泉债券A	沅泉债券C
1.本期已实现收益	3,251,558.10	-
2.本期利润	2,290,098.10	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0037	-
4.期末基金资产净值	435,507,678.99	-
5.期末基金份额净值	1.0274	1.0274

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）扣除相关费用和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09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 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

沅泉债券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	0.35%	0.02%	0.01%	0.05%	0.34%	-0.03%

过去六个月	1.67%	0.25%	0.95%	0.04%	0.72%	0.21%
过去一年	1.30%	0.27%	0.62%	0.05%	0.68%	0.22%
过去三年	15.69%	0.26%	4.54%	0.05%	11.15%	0.21%
自基金合同生效起至今	19.55%	0.22%	5.03%	0.06%	14.52%	0.16%

沅泉债券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
自基金合同生效起至今	0.08%	0.02%	-0.18%	0.04%	0.26%	-0.02%

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

(2019年06月10日-2023年09月30日)



金元顺安沅泉债券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
(2023年09月14日-2023年09月30日)



§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	周博洋	-	2019-06-10	-	11年

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

进入三季度，债券市场继续反应对基本面的悲观预期，至8月15日央行降息，市场收益率到达底部，后续伴随一系列地产政策的出台，市场对基本面的预期发生改变，叠加持续收紧的资金面，市场收益率开始持续上行。整个三季度市场利率呈先下后上的走势，具体来看，1年期AAA存单收益率由2.31%上行至2.44%，10年国债收益率由2.64%上行至2.68%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末沅泉债券A基金份额净值为1.0274元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.35%，同期业绩比较基准收益率为0.01%；截至报告期末沅泉债券C基金份额净值为1.0274元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.08%，同期业绩比较基准收益率为-0.18%。

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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	421,440,178.73	96.70
	其中：债券	421,440,178.73	96.70
	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	14,395,915.49	3.30
8	其他资产	3,531.91	0.00
9	合计	435,839,626.13	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	6,397,032.08	1.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	395,317,074.63	90.77
	其中：政策性金融债	395,317,074.63	90.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	19,726,072.02	4.53
9	其他	-	-
10	合计	421,440,178.73	96.77

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	220312	22进出12	1,200,000	121,126,229.51	27.81
2	230304	23进出04	1,000,000	100,428,688.52	23.06
3	190203	19国开03	600,000	61,528,767.12	14.13
4	230203	23国开03	500,000	51,328,547.95	11.79
5	220302	22进出02	500,000	50,765,382.51	11.66

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

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 本基金本报告期末未持有股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,327.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	204.87
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,531.91

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

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

	沅泉债券A	沅泉债券C
报告期期初基金份额总额	397,932,352.72	-
报告期期间基金总申购份额	357,474,557.09	-
减：报告期期间基金总赎回份额	331,525,320.11	-
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	423,881,589.70	-

§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	2023年07月01日 - 2023年07月25日	125,988,745.69	0.00	125,988,745.69	0.00	0.00%
	2	2023年09月13日 - 2023年09月25日	0.00	109,032,122.79	109,032,122.79	0.00	0.00%
	3	2023年07月01日 - 2023年09月30日	167,967,582.09	0.00	0.00	167,967,582.09	39.63%
	4	2023年09月13日 - 2023年09月30日	0.00	125,774,777.80	0.00	125,774,777.80	29.67%
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07月07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基金增加招商银行股份有限公司（招赢通平台）为销售机构并参与费率优惠的公告；

2、2023年07月10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增加福克斯（北京）基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

3、2023年07月20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暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）公告；

4、2023年07月20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2023年第二季度报告；

5、2023年07月21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增加博时财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

6、2023年07月28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增加江海证券有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

7、2023年08月15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分红公告；

8、2023年08月21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增加东方证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

9、2023年08月31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2023年中期报告；

10、2023年09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托管协议（增设C类份额）；

11、2023年09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合同（增设C类份额）；

12、2023年09月11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关于金元顺安沅泉债券型证券投资基金增设C类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告；

13、2023年09月13日，在《上海证券报》和www.jysa99.com上公布金元顺安沔泉债券型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新[2023年09月13日更新]；

14、2023年09月13日，在《上海证券报》和www.jysa99.com上公布金元顺安沔泉债券型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新[2023年09月13日更新]；

15、2023年09月13日，在《上海证券报》和www.jysa99.com上公布金元顺安沔泉债券型证券投资基金更新招募说明书（增设C类份额）[2023年09月13日更新].；

16、2023年09月13日，在《上海证券报》和www.jysa99.com上公布金元顺安沔泉债券型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额申购）公告；

17、2023年09月19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增加东方证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

18、2023年09月19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增加珠海盈米基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

19、2023年09月19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增加上海天天基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

20、2023年09月19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增加济安财富（北京）基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

21、2023年09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部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

22、2023年09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部分基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

23、2023年09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部分基金增加北京汇成基金销售有限公司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

2023年10月25日