

# 金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 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:招商银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2024年08月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现 .....	7
§4 管理人报告 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	13
§5 托管人报告 .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表 .....	15
6.3 净资产变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	19
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 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 .....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	40
7.8 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贵金属投资明细 .....	41
7.9 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 .....	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	41
7.12 投资组合报告附注 .....	41
§8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	42
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
11.1 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 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
§12 备查文件目录.....	48
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	金元顺安沅泰定开债发起式
基金主代码	005818
交易代码	005818
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年05月09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
报告期末基金份额总额	1,010,001,353.88份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求持续、稳定的收益。
投资策略	<p>本基金采用的投资策略包括：</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>1、信用债投资策略；2、收益率曲线策略；3、资产支持证券投资策略；4、中小企业私募债投资策略；5、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>（二）开放期投资策略本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，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。
--	----

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金元顺安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	封涌	张姗
	联系电话	021-68881801	400-61-95555
	电子邮箱	service@jysa99.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-666-0666	400-61-95555
传真		021-68881875	0755-83195201
注册地址		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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		任开宇	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.jysa99.com
基金中期报告备置地点	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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)
本期已实现收益	13,739,011.69
本期利润	24,879,046.00
加权平均基金份额本期利润	0.0246
本期加权平均净值利润率	2.40%
本期基金份额净值增长率	2.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末可供分配利润	16,092,896.80
期末可供分配基金份额利润	0.0159
期末基金资产净值	1,036,253,027.05
期末基金份额净值	1.0260
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	28.54%

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、所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。

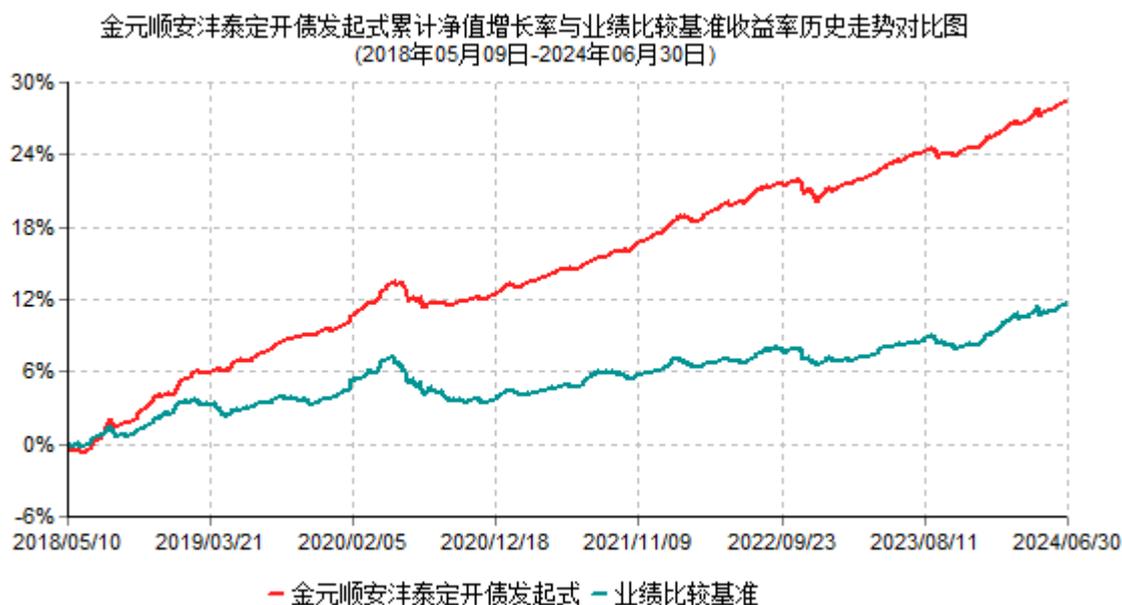
## 3.2 基金净值表现

## 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	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	0.53%	0.02%	0.65%	0.03%	-0.12%	-0.01%
过去三个月	1.34%	0.05%	1.06%	0.07%	0.28%	-0.02%
过去六个月	2.43%	0.05%	2.42%	0.07%	0.01%	-0.02%
过去一年	4.00%	0.05%	3.27%	0.06%	0.73%	-0.01%
过去三年	12.09%	0.04%	6.58%	0.05%	5.51%	-0.01%
自基金合同生效起至今	28.54%	0.05%	11.79%	0.06%	16.75%	-0.01%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



注：

- 1、本基金合同生效日为2018年05月09日，业绩基准累计增长率以2018年05月08日指数为基准；
- 2、本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内现金或者到期日在一年以内的政府债券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。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制；

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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金元比联基金管理有限公司（以下简称“金元比联”、“公司”或“本基金管理人”，系金元顺安基金管理有限公司前身）成立于2006年11月，由金元证券股份有限公司（以下简称“金元证券”）与比利时联合资产管理公司（以下简称“比联资管”）共同发起设立的中外合资基金管理有限公司。公司总部设在上海陆家嘴，旗下设立北京分公司及子公司--上海金元百利资产管理有限公司。

2012年03月，经中国证监会核准，比联资管将所持有的金元比联49%股权转让于惠理基金管理香港有限公司（以下简称“惠理香港”），公司更名为金元惠理基金管理有限公司（以下简称“金元惠理”）。

2012年10月，经中国证监会核准，公司双方股东按持股比例向公司增资人民币9,500万元，公司注册资本增加至24,500万元。

2016年03月，经中国证监会核准，惠理香港将所持有的金元惠理49%股权转让于上海泉意金融信息服务有限公司（以下简称“泉意金融”），公司更名为金元顺安基金管理有限公司（以下简称“金元顺安”）。

2017年11月，经中国证监会核准，公司双方股东按持股比例向公司增资人民币9,500万元，公司注册资本增加至34,000万元。

2020年04月，公司股东泉意金融更名为“上海前易信息咨询有限公司”。

金元顺安始终坚持以“取信于市场、取信于社会”作为行为准则，遵循“诚实信用，勤勉尽责，以专业经营方式管理和运作基金财产和客户资产，在合法、合规的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，从而使公司稳步、健康发展”的投资理念。遵守法律、行政法规和中国证券监督管理委员会的规定，遵守社会公德、商业道德，诚实守信，遵循基金份额持有人利益优先、公平对待其管理的不同基金财产和客户资产的原则，接受政府和社会公众的监督，承担社会责任。

截止至2024年06月30日，本基金管理人管理金元顺安宝石动力混合型证券投资基金、金元顺安成长动力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、金元顺安价值增长混合型证券投资基金、金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安金元宝货币市场基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金、金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安桉盛债券型证券投资基金、金元顺安元启灵活配置混合型证券投资

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、金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金、金元顺安沅泉债券型证券投资基金、金元顺安泓丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金、金元顺安医疗健康混合型证券投资基金、金元顺安行业精选混合型证券投资基金和金元顺安产业臻选混合型证券投资基金共19只开放式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	2018-05-09	-	14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、金元顺安沅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。14年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

注：

- 1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期；非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
- 2、证券从业的含义遵从中国证监会和行业协会相关规定。

#### 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》及其他相关法律法规、中国证监会和基金合同的规定，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规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守法律法规和内部规章制度关于公平交易的相关规定，确保本基金管理人管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和内部规章制度执行投资交易。

本报告期内，本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

经济基本面：上半年经济增长缓慢，经济内生动能偏弱，有效需求不足，整体呈现“供强需弱”的格局。房地产调控政策持续优化，房地产投资对经济拖累较大。地方债发行缓慢，基建投资有所下行。外需延续强势，制造业投资对经济形成支撑。消费品“以旧换新”政策的推出，消费缓慢复苏。基数效应叠加海外库存周期启动，出口延续强劲。社会融资规模同比增速放缓，信贷结构有待优化，融资需求亟待改善。CPI微幅上行，PPI降幅收窄，通胀温和回升。

政策方面：上半年稳健的货币政策灵活适度、精准有效，强化逆周期调节，综合运用利率、准备金、再贷款等工具，切实服务实体经济，有效防控金融风险。贷款市场报价利率改革成效显著，存款利率市场化调整机制作用有效发挥，货币政策传导效率增强，社会融资成本继续下降。

流动性方面：上半年银行间流动性充裕，资金利率低位运行。政府债券发行缓慢，信贷需求偏弱，资金面宽松。央行在税期、季末等关键时点加大公开市场投放力度，呵护市场意愿较强，维稳资金面。

在报告期，本基金采取适中久期、低杠杆策略，配置高等级信用债以及利率债，获得良好的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安沅泰定开债发起式基金份额净值为1.0260元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.43%，同期业绩比较基准收益率为2.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面：当前外部环境复杂严峻，主要经济体经济增长和货币政策有所分化。我国经济运行延续回升向好态势，但面临有效需求不足、社会预期偏弱等问题。预计下半年房地产投资或将低位企稳，基建投资有所回升，制造业投资保持韧性。消费缓慢复苏。出口延续强劲。通胀温和回升。

政策方面：精准有效实施稳健的货币政策，更加注重做好逆周期调节，更好发挥货币政策工具的总量和结构双重功能。加大已出台货币政策实施力度。保持流动性合理充裕，引导信贷合理增长、均衡投放，保持社会融资规模、货币供应量同经济增长和价格水平预期目标相匹配。促进物价温和回升，保持物价在合理水平。

流动性方面：预计货币政策延续宽松态势，流动性保持合理充裕水平。同时面临着防止资金空转、银行净息差收窄、人民币汇率贬值等压力，资金利率难以明显下行。随着政府债券发行提速，资金面波动或将加大，资金利率中枢围绕政策利率运行。

本基金将坚持适中久期、低杠杆、高评级信用债策略，获取票息收益。同时关注利率债交易行情，积极把握交易机会。在控制风险的基础上获取最佳回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值工作小组。估值工作小组主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。公司估值工作小组由主管运营的公司领导负责，成员包括但不限于基金事务、投资研究、交易、风险管理、监察稽核等部门的负责人。估值工作小组成员均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值工作小组报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内利润分配情况如下：

经本基金管理人计算并由基金托管人招商银行股份有限公司复核，以2024年03月08日已实现的可分配收益为基准，本基金向基金份额持有人每10份基金份额派发红利0.30元。权益登记日及除息日：2024年03月20日,红利发放日：2023年03月21日

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			

货币资金	6.4.7.1	2,831,417.17	10,417,241.82
结算备付金		5,002,631.13	19,557,059.85
存出保证金		20,573.82	30,612.44
交易性金融资产	6.4.7.2	1,309,440,030.49	1,442,466,825.17
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,309,440,030.49	1,442,466,825.17
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,317,294,652.61	1,472,471,739.28
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款	6.4.12.3	280,572,635.63	430,088,040.74
应付清算款		-	122,431.55
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		254,125.11	264,035.38
应付托管费		84,708.36	88,011.79
应付销售服务费		-	-

应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,224.41	5,727.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	119,932.05	229,431.39
负债合计		281,041,625.56	430,797,678.60
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,010,001,353.88	1,010,001,390.80
未分配利润	6.4.7.8	26,251,673.17	31,672,669.88
净资产合计		1,036,253,027.05	1,041,674,060.68
负债和净资产总计		1,317,294,652.61	1,472,471,739.28

注：

报告截止日2024年06月30日，基金份额净值1.0260元，基金份额总额1,010,001,353.88份。

## 6.2 利润表

会计主体：金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		29,645,126.01	29,534,047.13
1.利息收入		199,968.40	192,132.26
其中：存款利息收入	6.4.7.9	199,968.40	186,128.23
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	6,004.03
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		18,305,123.30	27,250,708.57

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	18,305,123.30	27,250,708.57
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	11,140,034.31	2,091,206.30
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		4,766,080.01	6,300,005.07
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,546,572.16	1,631,143.56
2.托管费	6.4.10.2.2	515,524.08	543,714.51
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		2,572,871.30	3,985,960.04
其中：卖出回购金融资产 支出		2,572,871.30	3,985,960.04
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		6,207.98	11,812.80
8.其他费用	6.4.7.19	124,904.49	127,374.16
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		24,879,046.00	23,234,042.06
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		24,879,046.00	23,234,042.06

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		24,879,046.00	23,234,042.06

### 6.3 净资产变动表

会计主体：金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,010,001,390.80	31,672,669.88	1,041,674,060.68
二、本期期初净资产	1,010,001,390.80	31,672,669.88	1,041,674,060.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-36.92	-5,420,996.71	-5,421,033.63
（一）、综合收益总额	-	24,879,046.00	24,879,046.00
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-36.92	-1.28	-38.20
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-36.92	-1.28	-38.20
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-30,300,041.43	-30,300,041.43

四、本期期末净资产	1,010,001,353.88	26,251,673.17	1,036,253,027.05
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,010,001,436.95	97,257,107.26	1,107,258,544.21
二、本期期初净资产	1,010,001,436.95	97,257,107.26	1,107,258,544.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18.46	-16,156,015.28	-16,156,033.74
（一）、综合收益总额	-	23,234,042.06	23,234,042.06
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-18.46	-1.26	-19.72
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-18.46	-1.26	-19.72
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-39,390,056.08	-39,390,056.08
四、本期期末净资产	1,010,001,418.49	81,101,091.98	1,091,102,510.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

邝晓星

任笑菲

季泽

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]511号文《关于准予金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由金元顺安基金管理有限公司作为发起人向社会公开募集，基金合同于2018年05月09日生效，首次设立募集规模为1,009,999,000.00份基金份额。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。本基金的基金管理人与注册登记机构均为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金在严格控制风险的前提下，追求持续、稳定的收益。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、政策性金融债、公开发行的次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括但不限于协议存款、定期存款及其他银行存款等）、同业存单、货币市场工具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）。本基金不投资股票、权证等资产。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人可在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

本基金业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2024年06月30日的财务状况以及2024年01月01日至06月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 6.4.6.2城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和個人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.3企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年01月01日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月09日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	2,831,417.17
等于：本金	2,829,985.74
加：应计利息	1,431.43
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,831,417.17

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	392,973,491.24	4,956,370.41	401,323,370.41	3,393,508.76
	银行间市场	891,426,572.43	11,713,660.08	908,116,660.08	4,976,427.57
	合计	1,284,400,063.67	16,670,030.49	1,309,440,030.49	8,369,936.33
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,284,400,063.67	16,670,030.49	1,309,440,030.49	8,369,936.33	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	25,450.39
其中：交易所市场	-
银行间市场	25,450.39
应付利息	-
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
合计	119,932.05

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,010,001,390.80	1,010,001,390.80
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-36.92	-36.92
本期末	1,010,001,353.88	1,010,001,353.88

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,653,927.80	-981,257.92	31,672,669.88
本期期初	32,653,927.80	-981,257.92	31,672,669.88
本期利润	13,739,011.69	11,140,034.31	24,879,046.00
本期基金份额交易产生的变动数	-1.26	-0.02	-1.28
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1.26	-0.02	-1.28
本期已分配利润	-30,300,041.43	-	-30,300,041.43
本期末	16,092,896.80	10,158,776.37	26,251,673.17

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	64,991.79
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	134,812.84
其他	163.77
合计	199,968.40

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

**6.4.7.11 债券投资收益****6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	18,523,263.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-218,140.08
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	18,305,123.30

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,673,590,388.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,657,785,051.48
减：应计利息总额	16,000,527.47
减：交易费用	22,950.00
买卖债券差价收入	-218,140.08

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	11,140,034.31
——股票投资	-
——债券投资	11,140,034.31
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	11,140,034.31

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日

审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	11,822.83
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	124,904.49

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
金元顺安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海前易信息咨询服务有限公司	基金管理人的股东
上海金元百利资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付的关联方佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,546,572.16	1,631,143.56
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	1,546,572.16	1,631,143.56

注：

本基金管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年01月01日至2024年06月30日	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	515,524.08	543,714.51

注：

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年06月30日	2023年01月01日至2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00

减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.99%	0.99%

注：

期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	2,831,417.17	64,991.79	7,831,518.75	65,544.45

注：

本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2024年01月01日至2024年06月30日止期间获得的利息收入为134,812.84元，2024年06月30日止结算备付金余额为人民币5,002,631.13元。2023年01月01日至2023年06月30日止期间获得的利息收入为人民币120,480.08元，2023年06月30日止结算备付金余额为人民币16,214,156.66元。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

序	权益	除息日	每10份基	现金形式	再投资形	本期利润	备
---	----	-----	-------	------	------	------	---

号	登记日		金 份额分红 数	发放总额	式发放总 额	分配合计	注
1	2024-03- 20	2024-03- 20	0.300	30,300,04 1.43	-	30,300,04 1.43	-
合计			0.300	30,300,04 1.43	-	30,300,04 1.43	-

#### 6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估 值单价	数量（张）	期末估值总额
1920046	19宁波银行二 级	2024-07-01	104.35	600,000	62,612,524.59
1920059	19江苏银行二 级	2024-07-01	103.69	700,000	72,582,984.70
2028034	20浦发银行二 级03	2024-07-01	106.01	600,000	63,604,800.00
合计				1,900,000	198,800,309.29

注：

截至本报告期末2024年06月30日止，基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币180,541,539.73元于2024年07月01日到期。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年06月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额人民币100,031,095.90元，于2024年07月02日到期。该类交易要求

本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2024年06月30日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入公司各个业务层面的全面控制过程之中，并建立了三道防线：以各岗位职责为基础，形成第一道防线；通过相关岗位之间、相关部门之间相互监督制衡，形成第二道防线；由督察长、分管风险管理副总经理、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务进行监督、检查、评价，形成的第三道防线。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-

未评级	49,066,350.68	0.00
合计	49,066,350.68	0.00

#### 6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	1,073,844,656.22	1,277,309,429.99
AAA以下	0.00	0.00
未评级	186,529,023.59	165,157,395.18
合计	1,260,373,679.81	1,442,466,825.17

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求并设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,831,417.17	-	-	-	2,831,417.17
结算备付金	5,002,631.13	-	-	-	5,002,631.13
存出保证金	20,573.82	-	-	-	20,573.82
交易性金融资产	110,130,023.28	473,186,688.53	726,123,318.68	-	1,309,440,030.49
资产总计	117,984,645.40	473,186,688.53	726,123,318.68	-	1,317,294,652.61
负债					
卖出回购金融资产款	280,572,635.63	-	-	-	280,572,635.63
应付管理人报酬	-	-	-	254,125.11	254,125.11
应付托管费	-	-	-	84,708.36	84,708.36
应交税	-	-	-	10,224.41	10,224.41

费					
其他负债	-	-	-	119,932.05	119,932.05
负债总计	280,572,635.63	-	-	468,989.93	281,041,625.56
利率敏感度缺口	-162,587,990.23	473,186,688.53	726,123,318.68	-468,989.93	1,036,253,027.05
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,417,241.82	-	-	-	10,417,241.82
结算备付金	19,557,059.85	-	-	-	19,557,059.85
存出保证金	30,612.44	-	-	-	30,612.44
交易性金融资产	343,287,914.96	500,507,569.55	598,671,340.66	-	1,442,466,825.17
资产总计	373,292,829.07	500,507,569.55	598,671,340.66	-	1,472,471,739.28
负债					
卖出回购金融资产款	430,088,040.74	-	-	-	430,088,040.74
应付清算款	-	-	-	122,431.55	122,431.55
应付管理人报酬	-	-	-	264,035.38	264,035.38
应付托管费	-	-	-	88,011.79	88,011.79
应交税	-	-	-	5,727.75	5,727.75

费					
其他负债	-	-	-	229,431.39	229,431.39
负债总计	430,088,040.74	-	-	709,637.86	430,797,678.60
利率敏感度缺口	-56,795,211.67	500,507,569.55	598,671,340.66	-709,637.86	1,041,674,060.68

注：

表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	基准利率增加一个基点	-360,858.60	-232,735.85
	基准利率减少一个基点	361,138.38	232,800.12

注：

上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,309,440,030.49	126.36	1,442,466,825.17	138.48
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,309,440,030.49	126.36	1,442,466,825.17	138.48

## 6.4.14 公允价值

## 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末
---------------	-----	------

	2024年06月30日	2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	1,309,440,030.49	1,442,466,825.17
第三层次	-	-
合计	1,309,440,030.49	1,442,466,825.17

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

##### 6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2024年8月30日经本基金的基金管理人批准。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	1,309,440,030.49	99.40
	其中：债券	1,309,440,030.49	99.40
	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	7,834,048.30	0.59
8	其他各项资产	20,573.82	0.00
9	合计	1,317,294,652.61	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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境内投资的股票。

### 7.2.2 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。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	42,341,105.75	4.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,094,115,151.21	105.58
	其中：政策性金融债	112,282,265.67	10.84
4	企业债券	40,977,467.40	3.95
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	51,034,303.28	4.92
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	49,066,350.68	4.73
9	其他	31,905,652.17	3.08
10	合计	1,309,440,030.49	126.36

### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1920059	19江苏银行二级	900,000	93,320,980.33	9.01
2	1920066	19上海银行二级	800,000	82,743,755.19	7.98
3	240410	24农发10	800,000	81,431,232.88	7.86
4	312410002	24中行TLAC非资本债01B	700,000	70,599,430.14	6.81
5	2028034	20浦发银行二级03	600,000	63,604,800.00	6.14

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未投资贵金属。

### 7.9 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。

### 7.10 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 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。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 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。

#### 7.12.2 本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	20,573.82
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,573.82

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.12.6 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。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
257	3,929,966.36	1,010,001,353.88	100.00%	0.00	0.00%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.99%	10,000,000.00	0.99%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,000.00	0.99%	10,000,000.00	0.99%	不少于3年

#### §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年05月09日)基金份额总额	1,009,999,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,010,001,390.80
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	36.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,010,001,353.88

#### §10 重大事件揭示

##### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未举行基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

### 1、基金管理人的重大人事变动

(1) 本基金管理人于2024年01月11日公告，增聘孙嘉女士担任金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；

(2) 本基金管理人于2024年01月11日公告，贾丽杰女士不再担任金元顺安丰利债券型证券投资基金的基金经理；

(3) 本基金管理人于2024年01月25日公告，周博洋先生不再担任金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；

(4) 本基金管理人于2024年02月20日公告，增聘李海瑞女士担任金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；

### 2、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，未发生改聘会计师事务所的情况。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成	佣金	占当期佣金总	

	元数量		交总额的 比例		量的比 例	
东吴证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

注：

### 1、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序：

#### （1）选择标准：

1）公司具有较强的研究实力，能够出具高质量的各种研究报告。研究及投资建议质量较高、报告出具及时、能及时地交流和对需求做出反应，有较广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

2）公司资信状况较好，无重大不良记录。

3）公司经营规范，能满足基金运作的合法、合规需求。

4）能够对持有人提供较高质量的服务。能够向持有人提供咨询、查询等服务；可以向投资人提供及时、主动的信息以及其它增值服务，无被持有人投诉的记录。

#### （2）选择流程：

公司投研和市场部门定期对券商服务质量根据选择标准进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元。

2、截至本报告期末2024年06月30日止，基金租用东吴证券股份有限公司1个上海交易单元、1个深圳交易单元，无退租交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证	544,664,729.	100.00%	14,790,000,00	100.00%	-	-	-	-

券	03		0.00				
---	----	--	------	--	--	--	--

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加物产中大期货有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2024-01-11
2	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2023年第四季度报告	规定披露媒介	2024-01-22
3	金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回及转换业务公告	规定披露媒介	2024-01-22
4	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加华鑫证券有限责任公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2024-01-23
5	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加上海攀赢基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2024-01-24
6	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	规定披露媒介	2024-01-26
7	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加玄元保险代理有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2024-02-07
8	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加宜信普泽	规定披露媒介	2024-03-08

	（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		
9	金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	规定披露媒介	2024-03-18
10	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加乾道基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2024-03-25
11	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2023年度报告	规定披露媒介	2024-03-30
12	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2024年第一季度报告	规定披露媒介	2024-04-22
13	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2024-04-23
14	金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回及转换业务公告	规定披露媒介	2024-04-30
15	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加北京雪球基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2024-05-22
16	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加招商银行股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2024-06-14
17	金元顺安沅泰定期开放债券	规定披露媒介	2024-06-29

	型发起式证券投资基金基金 产品资料概要[2024年06月2 8日更新]		
--	---	--	--

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	2024年01月01日 - 2024年06月30日	999,999,000.00	-	-	999,999,000.00	99.01%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册金元顺安沅泰定期开放债券型发起式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。

## 12.2 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

## 12.3 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  
二〇二四年八月三十一日