

# 金元顺安消费主题混合型证券投资基金

## 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:中国工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。

基金托管人中国工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              | 11 |
| 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       | 12 |
| §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                                | 18 |
| §7 投资组合报告                               | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 42 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 42 |
| 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       | 43 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 45 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 48 |
| 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      | 48 |
| 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   | 48 |
| 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   | 48 |
| 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      | 48 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 49 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 49 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 49 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 51 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 51 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 52 |

|   |    |
|---|----|
| 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.....   | 52 |
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 52 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 52 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 52 |
| 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.....   | 52 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 53 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 53 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 53 |
| 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.....      | 53 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 53 |
| 10.8 其他重大事件.....                        | 55 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 57 |
| 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..... | 57 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 58 |
| §12 备查文件目录.....                         | 58 |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 58 |
| 12.2 存放地点.....                          | 58 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 58 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金名称       | 金元顺安消费主题混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 金元顺安消费主题混合        |
| 基金主代码      | 620006            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日    | 2010年09月15日       |
| 基金管理人      | 金元顺安基金管理有限公司      |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司      |
| 报告期末基金份额总额 | 107,613,876.70份   |
| 基金合同存续期    | 不定期               |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金在正确认识中国经济发展特点的基础上，重点投资于消费拉动经济增长过程中充分受益的消费主题行业及其中的优势企业，致力于分享中国经济增长及增长方式转变带来的投资机会，力争实现基金资产的中长期稳定增值。  |
| 投资策略   | <p>本基金是一只采用主题投资方法的混合型基金产品，其主要投资标的是消费拉动经济增长过程中充分受益的消费主题行业及其中的优势企业，分享中国经济增长及增长方式转变带来的投资机会。本基金将通过严格的股票选择，深入挖掘消费主题股票的获利机会，实现动态优化的投资布局。</p> <p>本基金采用的投资策略包括：1、消费主题行业范畴的界定；2、资产配置策略；3、大类资产配置策略；4、股票投资策略；5、债券投资策略；6、其他资产的投资策略；7、现金头寸管理</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%   |
| 风险收益特征 | 本基金系具有主题投资风格的混合型基金，其风险收益特征从长期平均及预期来看，低于股票型基金，   |

|  |  |
|--|--|
|  | 高于债券型基金与货币市场基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。 |
|--|--|

### 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                             | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 封涌                                       | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-68881801                             | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | service@jysa99.com                       | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 400-666-0666                             | 95588               |
| 传真          |      | 021-68881875                             | 010-66105798        |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>花园石桥路33号花旗集团大<br>厦3608室 | 北京市西城区复兴门内大街5<br>5号 |
| 办公地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>花园石桥路33号花旗集团大<br>厦3608室 | 北京市西城区复兴门内大街5<br>5号 |
| 邮政编码        |      | 200120                                   | 100140              |
| 法定代表人       |      | 任开宇                                      | 廖林                  |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                                  |
|---------------------|----------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》                          |
| 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<br>(2024年01月01日-2024年06月30日) |
|---------------|----------------------------------|
| 本期已实现收益       | 2,466,671.05                     |
| 本期利润          | 4,070,949.36                     |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0378                           |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.65%                            |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.67%                            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2024年06月30日)            |
| 期末可供分配利润      | 45,679,799.33                    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4245                           |
| 期末基金资产净值      | 153,293,676.03                   |
| 期末基金份额净值      | 1.4240                           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末<br>(2024年06月30日)            |
| 基金份额累计净值增长率   | 42.40%                           |

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      | -3.59%  | 0.45%   | -2.51%  | 0.38%     | -1.08% | 0.07% |
| 过去三个月      | 0.64%   | 0.67%   | -1.50%  | 0.60%     | 2.14%  | 0.07% |
| 过去六个月      | 2.67%   | 0.75%   | 1.24%   | 0.71%     | 1.43%  | 0.04% |
| 过去一年       | -1.39%  | 0.78%   | -7.31%  | 0.69%     | 5.92%  | 0.09% |
| 过去三年       | -21.54% | 1.06%   | -26.69% | 0.83%     | 5.15%  | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 42.40%  | 1.45%   | 22.05%  | 1.09%     | 20.35% | 0.36% |

### 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

金元顺安消费主题混合累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2010年09月15日-2024年06月30日)



注：

- 1、本基金合同生效日为2010年09月15日，业绩基准累计增长率以2010年09月14日指数为基准；
- 2、本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例为基金资产的60%-95%，其中，投资于消费主题行业的上市公司股票的比例不低于本基金股票资产的80%；债券、现金等金融工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%，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×80%+中国债券总指数收益率×20%。

## §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“上海前易信息咨询服务有限公司”。

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、金元顺安津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 |        |  |
| 闵杭 | 总经理助理、投资总监、本基金基金经理 | 2015-10-16      | -    | 30年    | 总经理助理、投资总监，金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安桉盛债券型证券投资基金、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的基金经理，上海交通大学工学学士。曾任湘财证券股份有限公司上海自营分公司总经理，申银万国证券股份有限公司证券投资总部投资总监。2015年8月加入金元顺安基金管理有限公司，历任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、金元顺安桉泰债券型证券投资基金、金元顺安新经济主题混合型证券投资基金和金元 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 顺安宝石动力混合型证券投资基金的基金经理。30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》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

2024年上半年，经济复苏一波三折，经济数据喜忧参半，A股呈现先抑后扬的震荡修复格局，大盘蓝筹股相对较强。上证综指下跌0.25%，深证成指下跌7.10%，创业板指

下跌10.99%。本基金持仓相对稳定，维持偏高仓位，行业配置上以金融、食品饮料和家电、生物医药等蓝筹股为主。未来，本基金将继续坚持价值投资理念，精选个股，保持业绩相对稳定。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安消费主题混合基金份额净值为1.4240元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.67%，同期业绩比较基准收益率为1.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内经济继续呈现弱复苏态势，内需不足问题仍较突出，A股呈现先抑后扬的震荡修复格局，大盘蓝筹相关指数表现相对较强，而中小盘相关指数走势相对偏弱，特别中证2000以及微盘股受到退市新规影响跌幅较大，整体风格分化较为明显。展望下半年，预计管理层将继续实施积极的政策措施，以稳定经济增长，通过扩大内需和增强市场信心，进一步推动经济增长动能的恢复，货币政策方面，降准、降息仍有空间。当前A股估值处于底部区间，安全边际和投资性价比较高，但是趋势性机会仍需等待政策效果显现，预计市场短期将维持震荡走势，震荡磨底之后，市场有望进入盈利和估值双重提升的阶段。结构上来看，短期我们看好受益出口回暖的行业，如家电，以及资产荒背景下的高股息红利资产，如银行、高速公路、电力等。中长期看好新质生产力投资机会，如数字经济、低空经济、先进制造、新能源、生物医药等现代化产业体系重点方向。

#### 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

本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 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 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期内，本基金的管理人--金元顺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人依法对金元顺安基金管理有限公司编制和披露的本基金2024年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

2024年8月19日

## §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：金元顺安消费主题混合型证券投资基金

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<br>2024年06月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 货币资金       | 6.4.7.1 | 3,836,211.23       | 3,824,616.15        |
| 结算备付金      |         | 1,000,405.00       | 1,300,585.00        |
| 存出保证金      |         | 1,486.50           | 1,705.62            |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 136,717,966.71             | 135,987,646.03              |
| 其中：股票投资       |            | 128,593,046.16             | 127,945,783.02              |
| 基金投资          |            | -                          | -                           |
| 债券投资          |            | 8,124,920.55               | 8,041,863.01                |
| 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    | 12,000,000.00              | -976.43                     |
| 应收清算款         |            | 29,568.08                  | 9,003,905.75                |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 1,232.18                   | 101,485.78                  |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 153,586,869.70             | 150,218,967.90              |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>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   | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款         |            | 33,514.83                  | 1,447.99                    |
| 应付管理人报酬       |            | 153,503.44                 | 150,817.26                  |
| 应付托管费         |            | 25,583.94                  | 25,136.23                   |
| 应付销售服务费       |            | -                          | -                           |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | -                          | -                           |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |

|             |         |                |                |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 递延所得税负债     |         | -              | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 80,591.46      | 165,403.11     |
| 负债合计        |         | 293,193.67     | 342,804.59     |
| <b>净资产：</b> |         |                |                |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 107,613,876.70 | 108,075,755.46 |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 45,679,799.33  | 41,800,407.85  |
| 净资产合计       |         | 153,293,676.03 | 149,876,163.31 |
| 负债和净资产总计    |         | 153,586,869.70 | 150,218,967.90 |

注：

报告截止日2024年06月30日，基金份额净值1.424元，基金份额总额107,613,876.70份。

## 6.2 利润表

会计主体：金元顺安消费主题混合型证券投资基金

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<br>2024年01月01日至<br>2024年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至202<br>3年06月30日 |
|----------------------|----------|-----------------------------------|--|
| <b>一、营业总收入</b>       |          | 5,230,756.91                      | -5,788,819.10                          |
| 1.利息收入               |          | 108,914.64                        | 64,030.94                              |
| 其中：存款利息收入            | 6.4.7.9  | 15,750.92                         | 8,936.70                               |
| 债券利息收入               |          | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券利息<br>收入       |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产<br>收入       |          | 93,163.72                         | 55,094.24                              |
| 其他利息收入               |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”<br>填列） |          | 3,516,516.28                      | 4,706,287.45                           |
| 其中：股票投资收益            | 6.4.7.10 | 1,029,650.68                      | 1,891,012.84                           |
| 基金投资收益               |          | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益               | 6.4.7.11 | 65,457.54                         | 106,613.00                             |

|                                 |            |                     |                      |
|---------------------------------|------------|---------------------|----------------------|
| 资产支持证券投资<br>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   | 2,421,408.06        | 2,708,661.61         |
| 其他投资收益                          |            | -                   | -                    |
| 3.公允价值变动收益(损失<br>以“-”号填列)       | 6.4.7.16   | 1,604,278.31        | -10,560,562.62       |
| 4.汇兑收益(损失以“-”<br>号填列)           |            | -                   | -                    |
| 5.其他收入(损失以“-”<br>号填列)           | 6.4.7.17   | 1,047.68            | 1,425.13             |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | <b>1,159,807.55</b> | <b>1,511,815.41</b>  |
| 1.管理人报酬                         | 6.4.10.2.1 | 918,024.32          | 1,219,933.91         |
| 2.托管费                           | 6.4.10.2.2 | 153,004.11          | 203,322.34           |
| 3.销售服务费                         |            | -                   | -                    |
| 4.投资顾问费                         |            | -                   | -                    |
| 5.利息支出                          |            | -                   | -                    |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出               |            | -                   | -                    |
| 6.信用减值损失                        | 6.4.7.18   | -                   | -                    |
| 7.税金及附加                         |            | -                   | -                    |
| 8.其他费用                          | 6.4.7.19   | 88,779.12           | 88,559.16            |
| <b>三、利润总额(亏损总额<br/>以“-”号填列)</b> |            | <b>4,070,949.36</b> | <b>-7,300,634.51</b> |
| 减：所得税费用                         |            | -                   | -                    |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”<br/>号填列)</b>   |            | <b>4,070,949.36</b> | <b>-7,300,634.51</b> |
| 五、其他综合收益的税后<br>净额               |            | -                   | -                    |
| <b>六、综合收益总额</b>                 |            | <b>4,070,949.36</b> | <b>-7,300,634.51</b> |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：金元顺安消费主题混合型证券投资基金

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<br>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                                | 108,075,755.46                     | 41,800,407.85 | 149,876,163.31 |
| 二、本期期初净资产                                | 108,075,755.46                     | 41,800,407.85 | 149,876,163.31 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -461,878.76                        | 3,879,391.48  | 3,417,512.72   |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 4,070,949.36  | 4,070,949.36   |
| （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）      | -461,878.76                        | -191,557.88   | -653,436.64    |
| 其中：1.基金申购款                               | 498,422.03                         | 208,411.21    | 706,833.24     |
| 2.基金赎回款                                  | -960,300.79                        | -399,969.09   | -1,360,269.88  |
| （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） | -                                  | -             | -              |
| 四、本期期末净资产                                | 107,613,876.70                     | 45,679,799.33 | 153,293,676.03 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 108,273,106.50 | 55,380,821.57 | 163,653,928.07 |
| 二、本期期初净资产                                | 108,273,106.50 | 55,380,821.57 | 163,653,928.07 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -331,699.61    | -7,484,254.61 | -7,815,954.22  |
| （一）、综合收益总额                               | -              | -7,300,634.51 | -7,300,634.51  |
| （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）      | -331,699.61    | -183,620.10   | -515,319.71    |
| 其中：1.基金申购款                               | 604,604.63     | 326,778.60    | 931,383.23     |
| 2.基金赎回款                                  | -936,304.24    | -510,398.70   | -1,446,702.94  |
| （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） | -              | -             | -              |
| 四、本期期末净资产                                | 107,941,406.89 | 47,896,566.96 | 155,837,973.85 |

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

金元顺安消费主题混合型证券投资基金（原名为：金元比联消费主题股票型证券投资基金，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[2010]963号文《关于核准金元比联消费主题股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人金元比联基金管理有限公司（系金元顺安基金管理有限公司的前身）向社会公开发行人募集，基金合同于2010年9月15日正式生效，首次设立募集规模为407,031,537.62份基金份额。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经金元比联第二届董事会第七次会议及第二届股东会第五次会议审议通过，并由中国证监会证监许可[2012]276号文核准，金元比联基金管理有限公司于2012年3月15日完成相关工商变更登记手续，并且变更公司名称为金元惠理基金管理有限公司。随后，报请中国证监会同意，将金元比联消费主题股票型证券投资基金更名为金元惠理消费主题股票型证券投资基金，并于2012年5月2日公告。

2015年2月5日，经金元惠理基金管理有限公司股东金元证券股份有限公司及惠理基金管理香港有限公司以书面表决的方式达成更名决议。金元惠理基金管理有限公司于2015年3月6日完成相关工商变更登记手续，并且变更公司名称为金元顺安基金管理有限公司，并于2015年3月10日进行公告。经本基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后，金元惠理消费主题股票型证券投资基金相应更名为金元顺安消费主题混合型证券投资基金，并于2015年7月15日进行公告。

本基金在正确认识中国经济发展特点的基础上，重点投资于消费拉动经济增长过程中充分受益的消费主题行业及其中的优势企业，致力于分享中国经济增长及增长方式转变带来的投资机会，力争实现基金资产的中长期稳定增值。

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股票、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

#### 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 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年04月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；根据财政部、税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年09月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 6.4.6.2 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05月01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。

#### 6.4.6.3 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、营业税的单位和个体，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。

#### 6.4.6.4 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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

#### 6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年01月01日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年09月08日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利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<br>2024年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 3,836,211.23       |
| 等于：本金        | 3,835,885.23       |
| 加：应计利息       | 326.00             |
| 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     | 3,836,211.23 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2024年06月30日 |              |                |                |           |
|---------------|--------------------|--------------|----------------|----------------|-----------|
|               | 成本                 | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动         |           |
| 股票            | 155,655,753.78     | -            | 128,593,046.16 | -27,062,707.62 |           |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                  | -            | -              | -              |           |
| 债券            | 交易所市场              | 7,970,400.00 | 123,320.55     | 8,124,920.55   | 31,200.00 |
|               | 银行间市场              | -            | -              | -              | -         |
|               | 合计                 | 7,970,400.00 | 123,320.55     | 8,124,920.55   | 31,200.00 |
| 资产支持证券        | -                  | -            | -              | -              |           |
| 基金            | -                  | -            | -              | -              |           |
| 其他            | -                  | -            | -              | -              |           |
| 合计            | 163,626,153.78     | 123,320.55   | 136,717,966.71 | -27,031,507.62 |           |

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2024年06月30日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 12,000,000.00      | -         |

|       |               |   |
|-------|---------------|---|
| 银行间市场 | -             | - |
| 合计    | 12,000,000.00 | - |

#### 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<br>2024年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 3.60               |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 应付交易费用      | 1,024.74           |
| 其中：交易所市场    | 1,024.74           |
| 银行间市场       | -                  |
| 应付利息        | -                  |
| 审计费用        | 19,890.78          |
| 信息披露费       | 59,672.34          |
| 合计          | 80,591.46          |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 108,075,755.46                | 108,075,755.46 |
| 本期申购          | 498,422.03                    | 498,422.03     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -960,300.79                   | -960,300.79    |

|     |                |                |
|-----|----------------|----------------|
| 本期末 | 107,613,876.70 | 107,613,876.70 |
|-----|----------------|----------------|

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           | 143,324,868.41 | -101,524,460.56 | 41,800,407.85 |
| 本期期初           | 143,324,868.41 | -101,524,460.56 | 41,800,407.85 |
| 本期利润           | 2,466,671.05   | 1,604,278.31    | 4,070,949.36  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -613,788.39    | 422,230.51      | -191,557.88   |
| 其中：基金申购款       | 661,124.96     | -452,713.75     | 208,411.21    |
| 基金赎回款          | -1,274,913.35  | 874,944.26      | -399,969.09   |
| 本期已分配利润        | -              | -               | -             |
| 本期末            | 145,177,751.07 | -99,497,951.74  | 45,679,799.33 |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 7,660.33                      |
| 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 | 8,070.70                      |
| 其他        | 19.89                         |
| 合计        | 15,750.92                     |

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|----|-------------------------------|
|----|-------------------------------|

|            |              |
|------------|--------------|
| 卖出股票成交总额   | 2,820,602.49 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,786,726.20 |
| 减：交易费用     | 4,225.61     |
| 买卖股票差价收入   | 1,029,650.68 |

#### 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                 | 65,457.54               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -                       |
| 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                           | 65,457.54               |

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 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

单位：人民币元

| 项目 | 本期                      |
|----|-------------------------|
|    | 2024年01月01日至2024年06月30日 |

|               |              |
|---------------|--------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 2,421,408.06 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -            |
| 基金投资产生的股利收益   | -            |
| 合计            | 2,421,408.06 |

#### 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              | 1,604,278.31            |
| ——股票投资                 | 1,586,678.31            |
| ——债券投资                 | 17,600.00               |
| ——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                     | 1,604,278.31            |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 825.90                  |
| 转换费收入   | 221.78                  |
| 合计      | 1,047.68                |

#### 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<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 审计费用    | 19,890.78                     |
| 信息披露费   | 59,672.34                     |
| 证券出借违约金 | -                             |
| 汇划手续费   | 216.00                        |
| 账户维护费   | 9,000.00                      |
| 合计      | 88,779.12                     |

#### 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 |
| 中国工商银行股份有限公司   | 基金托管人、基金代销机构          |
| 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权证交易。

**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付关联方的佣金。

**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<br>2024年01月01日至20<br>24年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至20<br>23年06月30日 |
|------------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 918,024.32                        | 1,219,933.91                           |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 457,015.26                        | 606,763.68                             |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 461,009.06                        | 613,170.23                             |

注：

基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。

计算方法如下： $H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$ ，

H为每日应计提的基金管理费，

E为前一日的基金资产净值，

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发

送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2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 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024年01月01日至2024<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 153,004.11                        | 203,322.34                             |

注：

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。

计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ ，

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**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<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |          | 上年度可比期间<br>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   |
| 中国工商银行股份有限公司 | 3,836,211.23                  | 7,660.33 | 3,684,889.05                       | 5,225.88 |

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8,070.70元，2024年06月30日止结算备付金余额为人民币1,000,405.00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3,682.77元，2023年06月30日止结算备付金余额为人民币795,322.02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**

本基金本报告期末未进行利润分配。

**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**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |      |     |      |      |      |      |      |      |    |
|----------------------|------|------|-----|------|------|------|------|------|------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购 | 受限期 | 流通受限 | 认购价格 | 期末估值 | 数量（单 | 期末成本 | 期末估值 | 备注 |

|        |      | 日          |       | 类型     |       | 单价     | 位：股)   | 总额         | 总额        |   |
|--------|------|------------|-------|--------|-------|--------|--------|------------|-----------|---|
| 688717 | 艾罗能源 | 2023-12-26 | 6个月   | 新股流通受限 | 55.66 | 46.96  | 2,055  | 114,381.30 | 96,502.80 | - |
| 301589 | 诺瓦星云 | 2024-02-01 | 6个月   | 新股流通受限 | 70.42 | 188.33 | 355.00 | 24,997.33  | 66,857.15 | - |
| 603350 | 安乃达  | 2024-06-26 | 5个交易日 | 新股流通受限 | 20.56 | 20.56  | 750.00 | 15,420.00  | 15,420.00 | - |
| 603285 | 键邦股份 | 2024-06-28 | 5个交易日 | 新股流通受限 | 18.65 | 18.65  | 714.00 | 13,316.10  | 13,316.10 | - |
| 688692 | 达梦数据 | 2024-06-04 | 6个月   | 新股流通受限 | 86.96 | 209.54 | 60.00  | 5,217.60   | 12,572.40 | - |
| 301392 | 汇成真空 | 2024-05-28 | 6个月   | 新股流通受限 | 12.20 | 55.87  | 219.00 | 2,671.80   | 12,235.53 | - |
| 301538 | 骏鼎达  | 2024-03-13 | 6个月   | 新股流通受限 | 39.94 | 91.22  | 109.00 | 4,353.96   | 9,942.98  | - |
| 301536 | 星宸科技 | 2024-03-20 | 6个月   | 新股流通受限 | 16.16 | 32.26  | 283.00 | 4,573.28   | 9,129.58  | - |
| 301539 | 宏鑫科技 | 2024-04-03 | 6个月   | 新股流通受限 | 10.64 | 24.30  | 361.00 | 3,841.04   | 8,772.30  | - |
| 301565 | 中仑新材 | 2024-06-13 | 6个月   | 新股流通受限 | 11.88 | 23.32  | 368.00 | 4,371.84   | 8,581.76  | - |
| 688691 | 灿芯股份 | 2024-04-02 | 6个月   | 新股流通   | 19.86 | 49.38  | 173.00 | 3,435.78   | 8,542.74  | - |

|        |      |            |     |        |       |       |        |          |          |   |  |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|--------|----------|----------|---|--|
|        |      |            |     | 受限     |       |       |        |          |          |   |  |
| 301580 | 爱迪特  | 2024-06-19 | 6个月 | 新股流通受限 | 44.95 | 74.00 | 103.00 | 4,629.85 | 7,622.00 | - |  |
| 301591 | 肯特股份 | 2024-02-20 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.43 | 36.92 | 191.00 | 3,711.13 | 7,051.72 | - |  |
| 688530 | 欧莱新材 | 2024-04-29 | 6个月 | 新股流通受限 | 9.60  | 18.96 | 344.00 | 3,302.40 | 6,522.24 | - |  |
| 001389 | 广合科技 | 2024-03-26 | 6个月 | 新股流通受限 | 17.43 | 42.03 | 130.00 | 2,265.90 | 5,463.90 | - |  |
| 301588 | 美新科技 | 2024-03-06 | 6个月 | 新股流通受限 | 14.50 | 21.25 | 257.00 | 3,726.50 | 5,461.25 | - |  |
| 688695 | 中创股份 | 2024-03-06 | 6个月 | 新股流通受限 | 22.43 | 31.54 | 164.00 | 3,678.52 | 5,172.56 | - |  |
| 688709 | 成都华微 | 2024-01-31 | 6个月 | 新股流通受限 | 15.69 | 18.77 | 272.00 | 4,267.68 | 5,105.44 | - |  |
| 301587 | 中瑞股份 | 2024-03-27 | 6个月 | 新股流通受限 | 21.73 | 27.10 | 184.00 | 3,998.32 | 4,986.40 | - |  |
| 688584 | 上海合晶 | 2024-02-01 | 6个月 | 新股流通受限 | 22.66 | 15.87 | 225.00 | 5,098.50 | 3,570.75 | - |  |
| 601033 | 永兴股份 | 2024-01-11 | 6个月 | 新股流通受限 | 16.20 | 15.95 | 208.00 | 3,369.60 | 3,317.60 | - |  |
| 603341 | 龙旗科技 | 2024-02-23 | 6个月 | 新股流通   | 26.00 | 37.47 | 81.00  | 2,106.00 | 3,035.07 | - |  |

|        |      |            |     |        |       |       |        |          |          |   |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|--------|----------|----------|---|
|        |      |            |     | 受限     |       |       |        |          |          |   |
| 001359 | 平安电工 | 2024-03-19 | 6个月 | 新股流通受限 | 17.39 | 20.61 | 109.00 | 1,895.51 | 2,246.49 | - |
| 603344 | 星德胜  | 2024-03-13 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.18 | 22.66 | 92.00  | 1,764.56 | 2,084.72 | - |
| 603082 | 北自科技 | 2024-01-23 | 6个月 | 新股流通受限 | 21.28 | 29.48 | 66.00  | 1,404.48 | 1,945.68 | - |
| 603381 | 永臻股份 | 2024-06-19 | 6个月 | 新股流通受限 | 23.35 | 26.59 | 67.00  | 1,564.45 | 1,781.53 | - |
| 603350 | 安乃达  | 2024-06-26 | 6个月 | 新股流通受限 | 20.56 | 20.56 | 84.00  | 1,727.04 | 1,727.04 | - |
| 603375 | 盛景微  | 2024-01-17 | 6个月 | 新股流通受限 | 38.18 | 38.88 | 41.00  | 1,565.38 | 1,594.08 | - |
| 603285 | 键邦股份 | 2024-06-28 | 6个月 | 新股流通受限 | 18.65 | 18.65 | 80.00  | 1,492.00 | 1,492.00 | - |

注：

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的债券、权证。

#### 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

截至本报告期末2024年06月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### 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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 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的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债券投资

单位：人民币元

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

|       |              |              |
|-------|--------------|--------------|
| A-1以下 | -            | -            |
| 未评级   | 8,124,920.55 | 8,041,863.01 |
| 合计    | 8,124,920.55 | 8,041,863.01 |

### 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随时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、存出保证金、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024年0<br>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                   | 3,836,211.23  | -    | -    | -              | 3,836,211.23   |
| 结算备付金                  | 1,000,405.00  | -    | -    | -              | 1,000,405.00   |
| 存出保证金                  | 1,486.50      | -    | -    | -              | 1,486.50       |
| 交易性金融资产                | 8,124,920.55  | -    | -    | 128,593,046.16 | 136,717,966.71 |
| 买入返售金融资产               | 12,000,000.00 | -    | -    | -              | 12,000,000.00  |
| 应收清算款                  | -             | -    | -    | 29,568.08      | 29,568.08      |
| 应收申购款                  | -             | -    | -    | 1,232.18       | 1,232.18       |
| 资产总计                   | 24,963,023.28 | -    | -    | 128,623,846.42 | 153,586,869.70 |
| 负债                     |               |      |      |                |                |
| 应付赎回款                  | -             | -    | -    | 33,514.83      | 33,514.83      |
| 应付管理人报酬                | -             | -    | -    | 153,503.44     | 153,503.44     |
| 应付托管费                  | -             | -    | -    | 25,583.94      | 25,583.94      |
| 其他负债                   | -             | -    | -    | 80,591.46      | 80,591.46      |
| 负债总计                   | -             | -    | -    | 293,193.67     | 293,193.67     |
| 利率敏                    | 24,963,023.28 | -    | -    | 128,330,652.75 | 153,293,676.03 |

| 感度缺口                |               |      |      |                |                |
|---------------------|---------------|------|------|----------------|----------------|
| 上年度末<br>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                | 3,824,616.15  | -    | -    | -              | 3,824,616.15   |
| 结算备付金               | 1,300,585.00  | -    | -    | -              | 1,300,585.00   |
| 存出保证金               | 1,705.62      | -    | -    | -              | 1,705.62       |
| 交易性金融资产             | 8,041,863.01  | -    | -    | 127,945,783.02 | 135,987,646.03 |
| 买入返售金融资产            | -976.43       | -    | -    | -              | -976.43        |
| 应收清算款               | -             | -    | -    | 9,003,905.75   | 9,003,905.75   |
| 应收申购款               | -             | -    | -    | 101,485.78     | 101,485.78     |
| 资产总计                | 13,167,793.35 | -    | -    | 137,051,174.55 | 150,218,967.90 |
| 负债                  |               |      |      |                |                |
| 应付赎回款               | -             | -    | -    | 1,447.99       | 1,447.99       |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -    | 150,817.26     | 150,817.26     |
| 应付托管费               | -             | -    | -    | 25,136.23      | 25,136.23      |
| 其他负债                | -             | -    | -    | 165,403.11     | 165,403.11     |
| 负债总计                | -             | -    | -    | 342,804.59     | 342,804.59     |

|         |               |   |   |                |                |
|---------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 计       |               |   |   |                |                |
| 利率敏感度缺口 | 13,167,793.35 | - | - | 136,708,369.96 | 149,876,163.31 |

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<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2024年06月30日              | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|    | 基准利率增加一个基点         | -59.31                          | -449.36             |
|    | 基准利率减少一个基点         | 59.31                           | 449.40              |

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 | 上年度末 |
|----|-----|------|
|----|-----|------|

|               | 2024年06月30日    |               | 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  | 128,593,046.16 | 83.89         | 127,945,783.02 | 85.37         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -              | -             | -              | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 8,124,920.55   | 5.30          | 8,041,863.01   | 5.37          |
| 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            | 136,717,966.71 | 89.19         | 135,987,646.03 | 90.73         |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |  |                             |                     |
|----|--|-----------------------------|---------------------|
| 假设 | 1、本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合中股票投资的贝塔系数紧密相关； |                             |                     |
|    | 2、以下分析中，除市场指标发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变；             |                             |                     |
| 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<br>2024年06月30日          | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|    | 沪深300指数上涨5%  | 5,177,449.06                | 6,493,039.54        |
|    | 沪深300指数下跌5%  | -5,177,449.06               | -6,493,039.54       |

注：

本基金管理人运用资本--资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为

市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

## 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<br>2024年06月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 128,260,992.35     | 127,111,796.19      |
| 第二层次          | 8,156,875.69       | 8,205,225.11        |
| 第三层次          | 300,098.67         | 670,624.73          |
| 合计            | 136,717,966.71     | 135,987,646.03      |

#### 6.4.14.2.2 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，本基金无需要披露的其他重要事项。

**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              | 128,593,046.16 | 83.73        |
|    | 其中：股票             | 128,593,046.16 | 83.73        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 8,124,920.55   | 5.29         |
|    | 其中：债券             | 8,124,920.55   | 5.29         |
|    | 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          | 12,000,000.00  | 7.81         |
|    | 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      | 4,836,616.23   | 3.15         |
| 8  | 其他各项资产            | 32,286.76      | 0.02         |
| 9  | 合计                | 153,586,869.70 | 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**

| 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         | -              | -     |
| B | 采矿业              | -              | -     |
| C | 制造业              | 55,617,242.57  | 36.28 |
| 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           | -              | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -     |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 26,287.70      | 0.02  |
| J | 金融业              | 68,816,681.29  | 44.89 |
| K | 房地产业             | 82,467.00      | 0.05  |
| L | 租赁和商务服务业         | 804,768.00     | 0.52  |
| M | 科学研究和技术服务业       | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 3,317.60       | 0.00  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -     |
| P | 教育               | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | 3,242,282.00   | 2.12  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -              | -     |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 128,593,046.16 | 83.89 |

### 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

金额单位：人民币元

| 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  | 600519 | 贵州茅台 | 7,600   | 11,152,164.00 | 7.28         |
| 2  | 000001 | 平安银行 | 937,800 | 9,518,670.00  | 6.21         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 3  | 002001 | 新和成  | 490,320 | 9,414,144.00 | 6.14 |
| 4  | 002142 | 宁波银行 | 388,420 | 8,568,545.20 | 5.59 |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 430,722 | 7,589,321.64 | 4.95 |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 111,000 | 7,159,500.00 | 4.67 |
| 7  | 600030 | 中信证券 | 356,615 | 6,501,091.45 | 4.24 |
| 8  | 601628 | 中国人寿 | 187,300 | 5,815,665.00 | 3.79 |
| 9  | 600036 | 招商银行 | 158,700 | 5,425,953.00 | 3.54 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 203,400 | 5,255,856.00 | 3.43 |
| 11 | 000651 | 格力电器 | 111,835 | 4,386,168.70 | 2.86 |
| 12 | 600000 | 浦发银行 | 531,700 | 4,375,891.00 | 2.85 |
| 13 | 000858 | 五粮液  | 33,100  | 4,238,124.00 | 2.76 |
| 14 | 601318 | 中国平安 | 94,100  | 3,891,976.00 | 2.54 |
| 15 | 601658 | 邮储银行 | 750,000 | 3,802,500.00 | 2.48 |
| 16 | 600276 | 恒瑞医药 | 95,760  | 3,682,929.60 | 2.40 |
| 17 | 002966 | 苏州银行 | 430,900 | 3,231,750.00 | 2.11 |
| 18 | 601009 | 南京银行 | 309,000 | 3,210,510.00 | 2.09 |
| 19 | 300059 | 东方财富 | 288,000 | 3,041,280.00 | 1.98 |
| 20 | 300015 | 爱尔眼科 | 293,225 | 3,026,082.00 | 1.97 |
| 21 | 000538 | 云南白药 | 51,660  | 2,642,409.00 | 1.72 |
| 22 | 000513 | 丽珠集团 | 58,100  | 2,161,901.00 | 1.41 |
| 23 | 601601 | 中国太保 | 72,300  | 2,014,278.00 | 1.31 |
| 24 | 601211 | 国泰君安 | 135,000 | 1,829,250.00 | 1.19 |
| 25 | 300122 | 智飞生物 | 33,700  | 944,611.00   | 0.62 |
| 26 | 688506 | 百利天恒 | 5,021   | 910,809.40   | 0.59 |
| 27 | 002027 | 分众传媒 | 132,800 | 804,768.00   | 0.52 |
| 28 | 000596 | 古井贡酒 | 3,800   | 802,066.00   | 0.52 |
| 29 | 002304 | 洋河股份 | 9,564   | 772,197.36   | 0.50 |
| 30 | 002415 | 海康威视 | 23,600  | 729,476.00   | 0.48 |
| 31 | 000786 | 北新建材 | 22,400  | 664,384.00   | 0.43 |
| 32 | 002271 | 东方雨虹 | 27,000  | 333,180.00   | 0.22 |
| 33 | 600763 | 通策医疗 | 4,000   | 216,200.00   | 0.14 |

|    |        |      |        |           |      |
|----|--------|------|--------|-----------|------|
| 34 | 688717 | 艾罗能源 | 2,055  | 96,502.80 | 0.06 |
| 35 | 000002 | 万科A  | 11,900 | 82,467.00 | 0.05 |
| 36 | 301589 | 诺瓦星云 | 355    | 66,857.15 | 0.04 |
| 37 | 002798 | 帝欧家居 | 19,900 | 64,874.00 | 0.04 |
| 38 | 603350 | 安乃达  | 834    | 17,147.04 | 0.01 |
| 39 | 603285 | 键邦股份 | 794    | 14,808.10 | 0.01 |
| 40 | 688692 | 达梦数据 | 60     | 12,572.40 | 0.01 |
| 41 | 301392 | 汇成真空 | 219    | 12,235.53 | 0.01 |
| 42 | 301538 | 骏鼎达  | 109    | 9,942.98  | 0.01 |
| 43 | 301536 | 星宸科技 | 283    | 9,129.58  | 0.01 |
| 44 | 301539 | 宏鑫科技 | 361    | 8,772.30  | 0.01 |
| 45 | 301565 | 中仑新材 | 368    | 8,581.76  | 0.01 |
| 46 | 688691 | 灿芯股份 | 173    | 8,542.74  | 0.01 |
| 47 | 301580 | 爱迪特  | 103    | 7,622.00  | 0.00 |
| 48 | 301591 | 肯特股份 | 191    | 7,051.72  | 0.00 |
| 49 | 688530 | 欧莱新材 | 344    | 6,522.24  | 0.00 |
| 50 | 001389 | 广合科技 | 130    | 5,463.90  | 0.00 |
| 51 | 301588 | 美新科技 | 257    | 5,461.25  | 0.00 |
| 52 | 688695 | 中创股份 | 164    | 5,172.56  | 0.00 |
| 53 | 688709 | 成都华微 | 272    | 5,105.44  | 0.00 |
| 54 | 301587 | 中瑞股份 | 184    | 4,986.40  | 0.00 |
| 55 | 688584 | 上海合晶 | 225    | 3,570.75  | 0.00 |
| 56 | 601033 | 永兴股份 | 208    | 3,317.60  | 0.00 |
| 57 | 603341 | 龙旗科技 | 81     | 3,035.07  | 0.00 |
| 58 | 001359 | 平安电工 | 109    | 2,246.49  | 0.00 |
| 59 | 603344 | 星德胜  | 92     | 2,084.72  | 0.00 |
| 60 | 603082 | 北自科技 | 66     | 1,945.68  | 0.00 |
| 61 | 603381 | 永臻股份 | 67     | 1,781.53  | 0.00 |
| 62 | 603375 | 盛景微  | 41     | 1,594.08  | 0.00 |

#### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额  | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|----------------|
| 1  | 688692 | 达梦数据 | 51,567.28 | 0.03           |
| 2  | 688584 | 上海合晶 | 50,826.38 | 0.03           |
| 3  | 301589 | 诺瓦星云 | 49,994.66 | 0.03           |
| 4  | 301580 | 爱迪特  | 46,073.75 | 0.03           |
| 5  | 301536 | 星宸科技 | 45,652.00 | 0.03           |
| 6  | 301565 | 中仑新材 | 43,659.00 | 0.03           |
| 7  | 301538 | 骏鼎达  | 43,260.50 | 0.03           |
| 8  | 688709 | 成都华微 | 42,614.04 | 0.03           |
| 9  | 301587 | 中瑞股份 | 39,852.82 | 0.03           |
| 10 | 301539 | 宏鑫科技 | 38,378.48 | 0.03           |
| 11 | 301588 | 美新科技 | 37,236.00 | 0.02           |
| 12 | 301591 | 肯特股份 | 36,975.29 | 0.02           |
| 13 | 688695 | 中创股份 | 36,785.20 | 0.02           |
| 14 | 688691 | 灿芯股份 | 34,218.78 | 0.02           |
| 15 | 601033 | 永兴股份 | 33,696.00 | 0.02           |
| 16 | 688530 | 欧莱新材 | 32,995.20 | 0.02           |
| 17 | 301392 | 汇成真空 | 26,705.80 | 0.02           |
| 18 | 001389 | 广合科技 | 22,606.71 | 0.02           |
| 19 | 603341 | 龙旗科技 | 20,930.00 | 0.01           |
| 20 | 001359 | 平安电工 | 18,885.54 | 0.01           |

注：

本项的"买入金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比 |
|----|------|------|----------|------------|
|----|------|------|----------|------------|

|    |        |      |            | 例(%) |
|----|--------|------|------------|------|
| 1  | 301565 | 中仑新材 | 165,350.00 | 0.11 |
| 2  | 688692 | 达梦数据 | 165,230.00 | 0.11 |
| 3  | 301591 | 肯特股份 | 137,331.28 | 0.09 |
| 4  | 301539 | 宏鑫科技 | 129,840.00 | 0.09 |
| 5  | 688347 | 华虹公司 | 128,723.08 | 0.09 |
| 6  | 301392 | 汇成真空 | 128,247.00 | 0.09 |
| 7  | 301536 | 星宸科技 | 122,270.20 | 0.08 |
| 8  | 301580 | 爱迪特  | 92,190.78  | 0.06 |
| 9  | 301589 | 诺瓦星云 | 87,884.67  | 0.06 |
| 10 | 301588 | 美新科技 | 87,818.00  | 0.06 |
| 11 | 688717 | 艾罗能源 | 86,240.00  | 0.06 |
| 12 | 688691 | 灿芯股份 | 84,475.00  | 0.06 |
| 13 | 688530 | 欧莱新材 | 81,995.43  | 0.05 |
| 14 | 688695 | 中创股份 | 81,180.00  | 0.05 |
| 15 | 301538 | 骏鼎达  | 68,306.00  | 0.05 |
| 16 | 301587 | 中瑞股份 | 66,231.00  | 0.04 |
| 17 | 688709 | 成都华微 | 64,745.92  | 0.04 |
| 18 | 001389 | 广合科技 | 58,350.00  | 0.04 |
| 19 | 688584 | 上海合晶 | 43,945.48  | 0.03 |
| 20 | 603341 | 龙旗科技 | 43,432.76  | 0.03 |

注：

本项的"卖出金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |              |
|--------------|--------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 847,311.03   |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,820,602.49 |

注：

本项的"买入股票的成本"、"卖出股票的收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 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      | 8,124,920.55 | 5.30         |
| 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  | 可转债(可交换债) | -            | -            |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 8,124,920.55 | 5.30         |

## 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  | 019709 | 23国债16 | 80,000 | 8,124,920.55 | 5.30         |
| 2  | -      | -      | -      | -            | -            |
| 3  | -      | -      | -      | -            | -            |
| 4  | -      | -      | -      | -            | -            |
| 5  | -      | -      | -      | -            | -            |

## 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

#### 1、中信证券（600030.SH）

（1）中国证监会2023年07月13日公布《深圳证监局关于对中信证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（行政监管措施决定书〔2023〕102号）和《深圳证监局关于对方兴、侯敏、何涛采取出具警示函措施的决定》（行政监管措施决定书〔2023〕101号）。

经查，深圳证监局发现中信证券在2023年6月19日的网络安全事件中，存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题。上述行为违反了《证券期货业网络和信息安全管理办法》（证监会令第218号，以下简称《网络和信息安全管理办法》）第十三条相关规定。

方兴作为中信证券首席信息官兼信息技术中心行政负责人，全面负责公司信息技术工作，侯敏作为信息技术中心分管运维负责人，何涛作为信息技术中心机房与网络负责人，对相关问题负有责任。

依据《网络和信息安全管理办法》第六十二条第二款，以及《证券期货业网络安全事件报告与调查处理办法》（证监会公告〔2021〕12号）第二十八条的规定，深圳证监局决定对中信证券采取出具警示函的行政监管措施；对方兴、侯敏、何涛采取出具警示函的行政监管措施。

（2）根据《证券发行上市保荐业务管理办法》，中国证监会于2024年01月12日对中信证券股份有限公司采取出具警示函措施，经查，公司保荐的恒逸石化股份有限公司（发行人）可转债项目，发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑50%以上。

(3) 中国证监会于2024年04月20日对中信证券出具《行政处罚事先告知书》。因2022年7月至8月，中信中证向中核钛白实际控制人王泽龙推荐定增多空方案。根据方案，客户通过场外衍生品交易台直接实现定增多空套利，提前结算收益，无需等待六个月的锁定期，中国证监会对王泽龙、洪浩炜、中信中证资本管理有限公司、中信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、韩雨辰违反限制性规定转让股票的违法行为，责令改正，给予警告，没收违法所得77,531,959.84元。

(4) 中信证券股份有限公司作为广东泉为科技股份有限公司（原广东国立科技股份有限公司）首次公开发行股票持续督导机构，在持续督导履职过程中存在以下违规行为：一是对二甲苯贸易业务客户和供应商之间的关联关系核查不充分。二是对二甲苯贸易业务真实性核查不充分。三是对二甲苯业务单据审核中未关注到运输合同与船舱计量报告对应的船运公司存在明显差异。四是对二甲苯业务单据审核中未关注到销售合同和租船合同约定的装货港存在明显异常。广东证监局于2024年05月10日对中信证券股份有限公司、凌鹏、浦瑞航采取出具警示函措施的决定。

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) 因存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题，相关责任人被深圳证监局出具警示函，因公司保荐的恒逸石化股份有限公司（发行人）可转债项目，发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑50%以上，中国证监会于2024年01月12日对中信证券股份有限公司采取出具警示函措施。因向中核钛白实际控制人王泽龙推荐定增多空方案，中国证监会于2024年04月20日对中信证券出具《行政处罚事先告知书》。作为广东泉为科技股份有限公司首次公开发行股票持续督导机构，在持续督导履职过程中存在违规行为，广东证监局于2024年05月10日对中信证券股份有限公司、凌鹏、浦瑞航采取出具警示函措施的决定。经过分析，我们认为相关事项对公司影响可控，因此继续持有该公司股票。

## 2、平安银行（000001.SZ）

2024年06月28日，因公司存在利用赠送基金份额形式开展基金销售业务的情况，深圳证监局决定对你公司采取出具警示函行政监管措施。

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) 因公司存在利用赠送基金份额形式开展基金销售业务的情况，深圳证监局于2024年5月10日对公司采取出具警示函行政监管措施。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。

**7.12.2 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。****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 | 1,486.50  |
| 2  | 应收清算款 | 29,568.08 |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 1,232.18  |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 32,286.76 |

**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**

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

**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  |
| 1,174    | 91,664.29 | 0.00  | 0.00%  | 107,613,876.70 | 100.00% |

**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 | 284,258.63 | 0.26%    |

**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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 10~50             |

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2010年09月15日)基金份额总额 | 407,031,537.62 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 108,075,755.46 |
| 本报告期基金总申购份额                | 498,422.03     |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 960,300.79     |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 107,613,876.70 |

**§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顺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洋顺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洋顺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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 东兴证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|        |   |              |        |          |        |   |
|--------|---|--------------|--------|----------|--------|---|
| 方正证券   | 1 | 1,589,198.30 | 56.34% | 1,487.37 | 56.46% | - |
| 金元证券   | 1 | -            | -      | -        | -      | - |
| 平安证券   | 1 | -            | -      | -        | -      | - |
| 申银万国证券 | 1 | -            | -      | -        | -      | - |
| 海通证券   | 1 | -            | -      | -        | -      | - |
| 首创证券   | 1 | -            | -      | -        | -      | - |
| 兴业证券   | 1 | 1,231,404.19 | 43.66% | 1,147.18 | 43.54% | - |
| 中信证券   | 1 | -            | -      | -        | -      | - |
| 浙商证券   | 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，本基金无新租交易单元，退租海通证券股份有限公司1个上海交易单元。

### 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 |
| 东兴证券   | -    | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 方正证券   | -    | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 金元证券   | -    | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 平安证券   | -    | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 申银万国证券 | -    | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 海通证券   | -    | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 首创证券   | -    | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 兴业证券   | -    | -            | 1,132,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券   | -    | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 浙商证券   | -    | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |

### 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 |

|    |   |        |            |
|----|---|--------|------------|
| 4  | 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 |
| 5  | 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 |
| 6  | 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 |
| 7  | 金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加宜信普泽（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 | 规定披露媒介 | 2024-03-08 |
| 8  | 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 |
| 9  | 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 |
| 10 | 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 |
| 11 | 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 |
| 12 | 金元顺安基金管理有限公司  | 规定披露媒介 | 2024-06-14 |

|    |  |        |            |
|----|--|--------|------------|
|    | 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                  |        |            |
| 13 | 金元顺安基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金份额净值小数点保留位数并修订基金合同、托管协议的公告 | 规定披露媒介 | 2024-06-28 |
| 14 | 金元顺安消费主题混合型证券投资基金基金合同                              | 规定披露媒介 | 2024-06-28 |
| 15 | 金元顺安消费主题混合型证券投资基金托管协议                              | 规定披露媒介 | 2024-06-28 |
| 16 | 金元顺安消费主题混合型证券投资基金基金产品资料概要更新[2024年06月28日更新]         | 规定披露媒介 | 2024-06-29 |

## §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   |
| 个人  | 1              | 2024年01月01日<br>- 2024年06月30日 | 50,393,592.51 | -    | -          | 50,393,592.51 | 46.83% |
|   | 2              | 2024年01月01日<br>- 2024年06月30日 | 51,246,107.43 | -    | -          | 51,246,107.43 | 47.62% |
| 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</p> <p>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</p> |                |                              |               |      |            |               |        |

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。

## 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消费主题混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安消费主题混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安消费主题混合型证券投资基金基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安消费主题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消费主题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。

### 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