金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金

2023年第2季度报告

2023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:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2023年07月20日

目录

§1 重要提示 3
§2 基金产品概况 3
§3 主要财务指标和基金净值表现 4
3.1 主要财务指标 4
3.2 基金净值表现 5
§4 管理人报告 7
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 7
4.3 公平交易专项说明 8
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 8
4.5 报告期内基金的业绩表现 8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 9
§5 投资组合报告 9
5.1 报告期末基金资产组合情况 9
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 9
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 10
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 11
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 11
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细 11
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 11
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 12
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 12
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 12
5.11 投资组合报告附注 12
§6 开放式基金份额变动 13
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 13
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 13
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 13
§8 影响投资者决策的其他重要信息 14
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 **20%**的情况 14
8.2 影响投资者决策的其他重要信息 14
§9 备查文件目录 14
9.1 备查文件目录 14
9.2 存放地点 15
9.3 查阅方式 15

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年07月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年04月01日起至2023年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金元顺安优质精选灵活配置混合
基金主代码	620007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年10月10日
报告期末基金份额总额	51,705,542.83份
投资目标	本基金在在正确认识中国经济发展特点的基础上，透过投资于优质股票和票息优势的固定收益证券，并结合严格风险管理，为投资者带来稳定的当期收益与长期的资本增值。
投资策略	本基金的大类资产配置策略的关键在于自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析的有机结合。股票投资采取行业配置指导下的个股精选方法；债券投资组合以具票息优势的债券作为主要投资对象，并通过对债券的信用、久期和凸性等的灵活配置，进行相对积极主动的操作，力争获取超越债券基准的收益；权证投资主要考虑运用的策略包括：限量投资、趋势投资、优化组合策略、价差策略、双向权证策略等；资产支持证券投资主要分析资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。

	本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+中国债券总指数收益率×45%	
风险收益特征	本基金系混合型基金，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，属于中等风险、中等收益的证券投资基金品种。	
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	金元顺安优质精选灵活配置混合C类
下属分级基金的交易代码	620007	001375
报告期末下属分级基金的份额总额	38,278,392.56份	13,427,150.27份

注：

1、“金元比联保本混合型证券投资基金”（系本基金前身，以下简称“本基金”）合同生效日为2011年08月16日。自2017年10月10日起，本基金转型为混合型证券投资基金。故本报告中，本基金基金合同生效日为2017年10月10日。

2、本基金自2015年06月02日起，新增C类份额。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2023年04月01日 - 2023年06月30日)	
	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	金元顺安优质精选灵活配置混合C类
1.本期已实现收益	260,157.41	-260,728.49
2.本期利润	2,439,775.04	420,158.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.1434	0.0363
4.期末基金资产净值	62,683,384.90	21,979,929.27
5.期末基金份额净值	1.6376	1.6370

注：

1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允

价值变动收益；

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

3、表中的"期末"均指报告期最后一日，即06月30日；

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金元顺安优质精选灵活配置混合A类净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.63%	0.84%	-2.36%	0.45%	7.99%	0.39%
过去六个月	18.09%	0.80%	0.08%	0.46%	18.01%	0.34%
过去一年	8.11%	0.91%	-7.31%	0.54%	15.42%	0.37%
过去三年	22.21%	1.06%	-2.02%	0.65%	24.23%	0.41%
过去五年	59.14%	1.09%	11.41%	0.69%	47.73%	0.40%
自基金合同生效起至今	41.29%	1.06%	6.43%	0.68%	34.86%	0.38%

金元顺安优质精选灵活配置混合C类净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.61%	0.84%	-2.36%	0.45%	7.97%	0.39%
过去六个月	18.56%	0.80%	0.08%	0.46%	18.48%	0.34%
过去一年	8.49%	0.91%	-7.31%	0.54%	15.80%	0.37%
过去三年	22.53%	1.06%	-2.02%	0.65%	24.55%	0.41%
过去五年	59.40%	1.09%	11.41%	0.69%	47.99%	0.40%
自基金合同生效起至今	41.36%	1.06%	6.43%	0.68%	34.93%	0.38%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：

1、“金元比联保本混合型证券投资基金”（系本基金前身，以下简称“本基金”）合同生效日为 2011 年 08 月 16 日。自 2017 年 10 月 10 日起，本基金转型为混合型证券投资基金，业绩基准累计增长率以 2017 年 10 月 09 日指数为基准；

2、本基金投资组合中股票、存托凭证、权证的投资比例为基金资产的 30%－80%；债券、

货币市场工具等占基金资产的 20%－70%，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×55%+中国债券总指数收益率×45%”。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周博洋	本基金基金经理	2018-01-26	-	11年	金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安沣楹债券型证券投资基金、金元顺安沣顺定期开放债券型发起式证券投资基金和金元顺安沣泉债券型证券投资基金的基金经理，兰卡斯特大学理学硕士。曾任上海新世纪资信评估投资服务有限公司助理分析师，上海证券有限责任有限公司项目经理。2014年8月加入金元顺安基金管理有限公司。11年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

注：
1、此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。本报告期内，本基金管理人严格遵守公司投资交易业务流程及公平交易制度。公司投资交易行为监控体系由风险管理部、监察稽核部和交易部监督，确保公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，本基金管理人对旗下开放式基金与其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》及其他相关法律法规和公司内部规章制度，制定了《金元顺安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，涵盖了所有可投资证券的一级市场申购、二级市场交易所公开竞价交易、交易所大宗交易、银行间债券交易以及非公开发行股票申购、以公司名义进行的一级市场债券交易等可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本基金管理人采用定量分析和定性分析相结合的方式，建立并严格执行有效的异常交易日常监控制度，形成定期交易监控报告，按照报告路线实行及时报告的机制。本报告期内，未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度以来，宏观数据开始逐步出现走弱迹象，市场也开始对此前的乐观预期作出修正；海外方面，在强经济及通胀数据的支撑下，美联储关于货币政策的表态继续鹰派。二季度整体来看，2年期美债收益率上行约80bp，10年期美债收益率上行近40bp，在中美两国货币政策差异背景下人民币汇率有所走贬，对国内权益资产表现也产生了一定影响，二季度上证指数下跌2.16%，深圳成指下跌5.97%，创业板下跌7.69%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安优质精选灵活配置混合A类基金份额净值为1.6376元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.63%，同期业绩比较基准收益率为-2.36%；截至

报告期末金元顺安优质精选灵活配置混合C类基金份额净值为1.6370元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.61%，同期业绩比较基准收益率为-2.36%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金自2023年2月8日起至2023年6月5日（连续八十个工作日）出现基金资产净值低于五千万元的情形。

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	67,685,259.43	68.09
	其中：股票	67,685,259.43	68.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,664,813.16	18.78
	其中：债券	18,664,813.16	18.78
	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	11,794,819.54	11.86
8	其他资产	1,264,461.07	1.27
9	合计	99,409,353.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,065,772.00	1.26

C	制造业	53,391,880.31	63.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,342,054.00	1.59
E	建筑业	512,160.00	0.60
F	批发和零售业	1,852,442.00	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	1,815,174.00	2.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,247,657.32	3.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	592,354.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	2,438,729.00	2.88
N	水利、环境和公共设施管理业	1,427,036.80	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	67,685,259.43	79.95

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	003004	声迅股份	23,600	681,332.00	0.80
2	002205	国统股份	64,300	680,937.00	0.80
3	300817	双飞股份	45,455	679,552.25	0.80
4	300675	建科院	42,500	677,025.00	0.80
5	300554	三超新材	32,400	674,892.00	0.80

6	603488	展鹏科技	83,700	672,111.00	0.79
7	603320	迪贝电气	46,200	671,748.00	0.79
8	688597	煜邦电力	66,498	671,629.80	0.79
9	688038	中科通达	44,786	669,998.56	0.79
10	300462	华铭智能	56,900	668,006.00	0.79

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	10,010,806.77	11.82
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）	8,654,006.39	10.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,664,813.16	22.05

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019688	22国债23	99,000	10,010,806.77	11.82
2	110059	浦发转债	37,740	4,079,402.42	4.82
3	113042	上银转债	13,780	1,491,218.75	1.76
4	128034	江银转债	8,112	882,792.07	1.04
5	110043	无锡转债	7,740	845,669.86	1.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未投资贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未投资权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	46,147.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,218,313.53
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	1,264,461.07

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	4,079,402.42	4.82
2	113042	上银转债	1,491,218.75	1.76
3	128034	江银转债	882,792.07	1.04
4	110043	无锡转债	845,669.86	1.00
5	127078	优彩转债	679,239.83	0.80
6	123153	英力转债	675,683.46	0.80

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	金元顺安优质精选灵活配置混合C类
报告期期初基金份额总额	11,855,497.05	16,350,070.11
报告期期间基金总申购份额	31,591,769.66	3,832,261.75
减：报告期期间基金总赎回份额	5,168,874.15	6,755,181.59
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	38,278,392.56	13,427,150.27

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未进行本基金的申购、赎回及红利再投资等交易。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023年06月20日－2023年06月26日	-	9,439,561.62	-	9,439,561.62	18.26%
产品特有风险							
持有份额比例较高的投资者（"高比例投资者"）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。 基金净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2023年04月22日，在《证券时报》和www.jysa99.com上公布金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2023年第一季度报告；

2、2023年06月06日，在《证券时报》和www.jysa99.com上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加德邦证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

3、2023年06月29日，在《证券时报》和www.jysa99.com上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加麦高证券有限责任公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

4、2023年06月30日，在《证券时报》和www.jysa99.com上公布金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金C类份额恢复转换转入、转换转出、定期定额投资公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；

2、《金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金基金招募说明书》；

4、《金元顺安优质精选灵活配置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优质精选灵活配置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。

9.2 存放地点

金元顺安基金管理有限公司

中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间至办公地点进行查询，或登录本基金管理人网站www.jysa99.com查阅。投资者对本报告书存有疑问，可咨询本基金管理人金元顺安基金管理有限公司，本公司客服电话400-666-0666、021-68881898。

金元顺安基金管理有限公司

2023年07月20日