
金元顺安泓丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金

2024年第2季度报告

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:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月19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	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	9
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	10
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	10
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	10
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	10
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	11
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	11
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	11
5.11 投资组合报告附注	11
§6 开放式基金份额变动	12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	12
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	12
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	12
§8 影响投资者决策的其他重要信息	12
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	12
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	13
§9 备查文件目录	13
9.1 备查文件目录	13
9.2 存放地点	13
9.3 查阅方式	13

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024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2024年04月01日起至2024年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金元顺安泓丰纯债87个月定开债
基金主代码	008224
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月03日
报告期末基金份额总额	5,936,272,361.83份
投资目标	本基金严格采用持有到期策略，将基金资产配置于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的固定收益资产，力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期初，将视债券、银行存款、债券回购等大类资产的市场环境进行封闭期组合构建。在封闭期内，本基金严格采用持有到期策略构建投资组合，基本保持大类品种配置的比例稳定。所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。 基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违

	反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。 本基金采用的投资策略包括： （一）封闭期投资策略 1、资产配置策略；2、类属配置策略；3、信用债券投资策略；4、杠杆投资策略；5、现金管理；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、资产支持证券投资策略 （二）开放期投资策略 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。	
业绩比较基准	每个封闭期同期中国人民银行公布的三年期定期存款利率（税后）+1.25%	
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。	
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金元顺安泓丰纯债87个月定开债A	金元顺安泓丰纯债87个月定开债C
下属分级基金的交易代码	008224	008225
报告期末下属分级基金的份额总额	5,936,247,511.74份	24,850.09份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2024年04月01日 - 2024年06月30日)	
	金元顺安泓丰纯债87个月定开债A	金元顺安泓丰纯债87个月定开债C
1.本期已实现收益	66,411,418.79	263.30
2.本期利润	66,411,418.79	263.30

3.加权平均基金份额本期利润	0.0112	0.0106
4.期末基金资产净值	6,169,479,291.61	25,632.94
5.期末基金份额净值	1.0393	1.0315

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、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

金元顺安泓丰纯债87个月定开债A净值表现

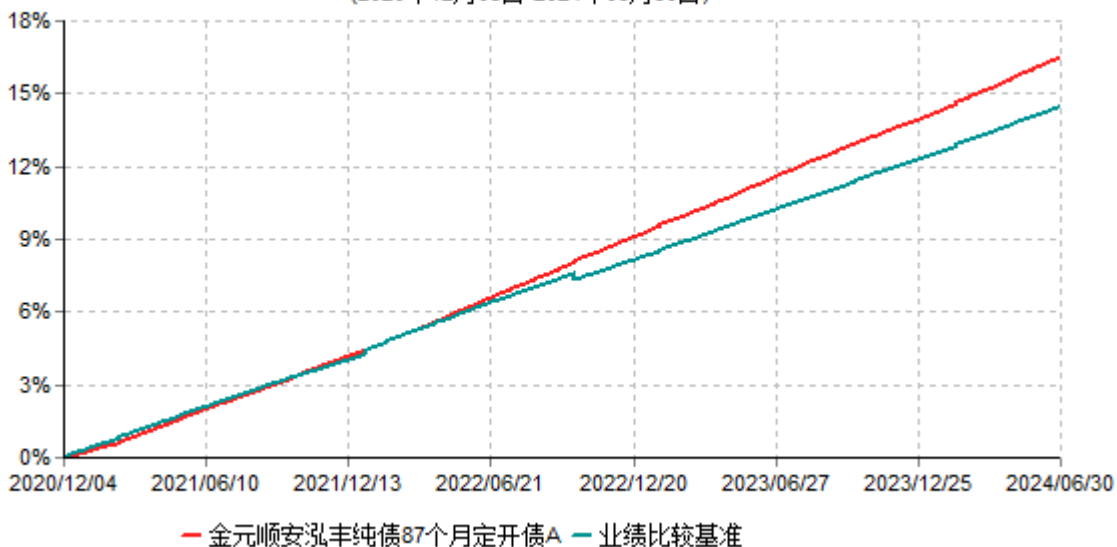
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.09%	0.01%	0.92%	0.01%	0.17%	0.00%
过去六个月	2.17%	0.02%	1.85%	0.01%	0.32%	0.01%
过去一年	4.34%	0.01%	3.78%	0.01%	0.56%	0.00%
过去三年	13.98%	0.01%	11.94%	0.01%	2.04%	0.00%
自基金合同生效起至今	16.50%	0.01%	14.46%	0.01%	2.04%	0.00%

金元顺安泓丰纯债87个月定开债C净值表现

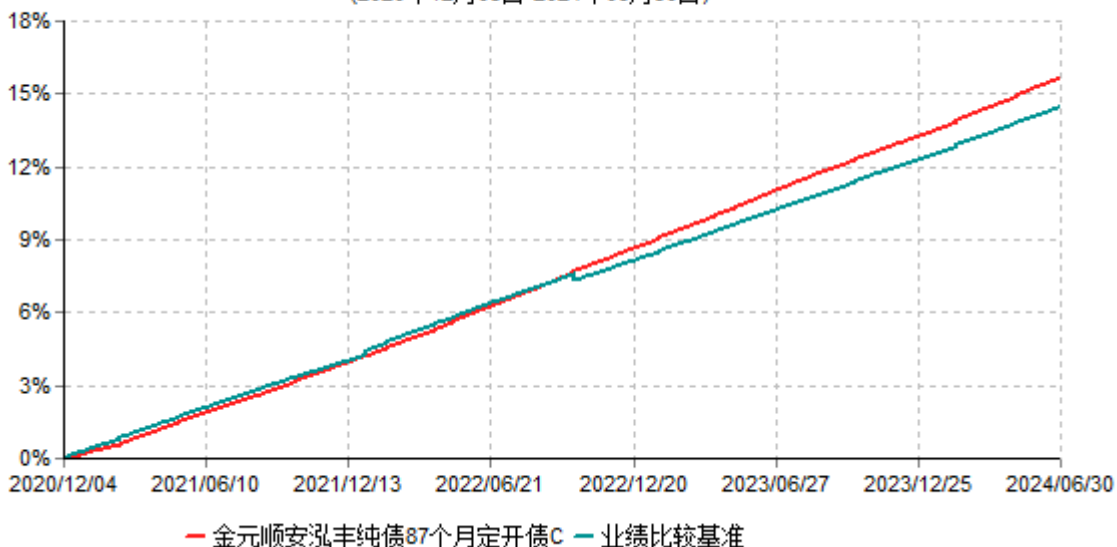
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.04%	0.01%	0.92%	0.01%	0.12%	0.00%
过去六个月	2.07%	0.01%	1.85%	0.01%	0.22%	0.00%
过去一年	4.13%	0.01%	3.78%	0.01%	0.35%	0.00%
过去三年	13.30%	0.01%	11.94%	0.01%	1.36%	0.00%
自基金合同生效起至今	15.68%	0.01%	14.46%	0.01%	1.22%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金元顺安泓丰纯债87个月定开债A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年12月03日-2024年06月30日)



金元顺安泓丰纯债87个月定开债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年12月03日-2024年06月30日)



注：

1、本基金合同生效日为2020年12月03日，业绩基准累计增长率以2020年12月02日指数为基准。

§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	说明

		任职日期	离任日期	年限	
苏利华	本基金基金经理	2020-12-03	-	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、金元顺安津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。
李玮	本基金基金经理	2022-12-07	-	9年	金元顺安泓丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金和金元顺安金元宝货币市场基金的基金经理，管理学学士，曾任富国基金管理有限公司研究助理、投研助理。2020年12月加入金元顺安基金管理有限公司。9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中国证监会和行业协会有关的规定。

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 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

经济基本面：二季度经济增长缓慢，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，房地产投资依旧低位徘徊。地方债发行缓慢，基建投资小幅下行。外需延续强势，制造业投资保持韧性。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：二季度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：二季度银行间流动性充裕，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，本基金采取长久期、高杠杆策略，全部配置政金债，获得良好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安泓丰纯债87个月定开债A基金份额净值为1.0393元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.09%，同期业绩比较基准收益率为0.92%；截至报告期末金元顺安泓丰纯债87个月定开债C基金份额净值为1.0315元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.04%，同期业绩比较基准收益率为0.92%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形。

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,573,191,348.79	99.90
	其中：债券	10,573,191,348.79	99.90
	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	10,438,899.96	0.10
8	其他资产	-	-
9	合计	10,583,630,248.75	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,573,191,348.79	171.38
	其中：政策性金融债	10,573,191,348.79	171.38
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	10,573,191,348.79	171.38

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	180205	18国开05	48,230,000	5,136,465,777.28	83.26
2	210204	21国开04	23,400,000	2,369,925,624.89	38.41
3	210307	21进出07	15,400,000	1,560,491,109.08	25.29
4	170210	17国开10	5,500,000	562,272,418.99	9.11
5	170215	17国开15	4,000,000	423,040,872.65	6.86

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

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未投资贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未投资权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

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

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票。

5.11.3 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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

	金元顺安泓丰纯债87个月定开债A	金元顺安泓丰纯债87个月定开债C
报告期期初基金份额总额	5,936,247,511.74	24,850.09
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	5,936,247,511.74	24,850.09

§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	2024年04月01日 - 2024年06月30日	2,799,999,000.00	-	-	2,799,999,000.00	47.17%
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

无

§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泓丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件;

2、《金元顺安泓丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

3、《金元顺安泓丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金基金招募说明书》;

4、《金元顺安泓丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》;

5、关于申请募集注册金元顺安泓丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金的法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照;

8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

金元顺安基金管理有限公司

中国(上海)自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

9.3 查阅方式

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

金元顺安基金管理有限公司

2024年07月19日