
金元顺安产业臻选混合型证券投资基金

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:交通银行股份有限公司

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 | 4 |
| §4 管理人报告 | 6 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 | 6 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 8 |
| 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 | 10 |
| 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 | 11 |
| 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 | 12 |
| 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 | 12 |
| 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 | 14 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 | 14 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 | 14 |
| §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 | 14 |
| 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。

基金托管人交通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 | 金元顺安产业臻选混合 |
| 基金主代码 | 015291 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023年12月19日 |
| 报告期末基金份额总额 | 136,641,106.87份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，臻选具有核心竞争力的产业及其相关行业的上市公司，追求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金采用的投资策略包括：1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券资产投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、回购策略；7、股指期货投资策略；8、国债期货投资策略 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。 |
| 基金管理人 | 金元顺安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |

| | | |
|-----------------|----------------|-----------------|
| 下属分级基金的基金简称 | 金元顺安产业臻选混合A | 金元顺安产业臻选混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 015291 | 015292 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 32,035,855.65份 | 104,605,251.22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) | |
|----------------|--------------------------------|----------------|
| | 金元顺安产业臻选混合A | 金元顺安产业臻选混合C |
| 1.本期已实现收益 | -459,624.96 | -1,686,836.89 |
| 2.本期利润 | -3,491,220.00 | -10,439,416.27 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0967 | -0.0906 |
| 4.期末基金资产净值 | 20,078,321.96 | 65,456,475.76 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.6267 | 0.6257 |

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

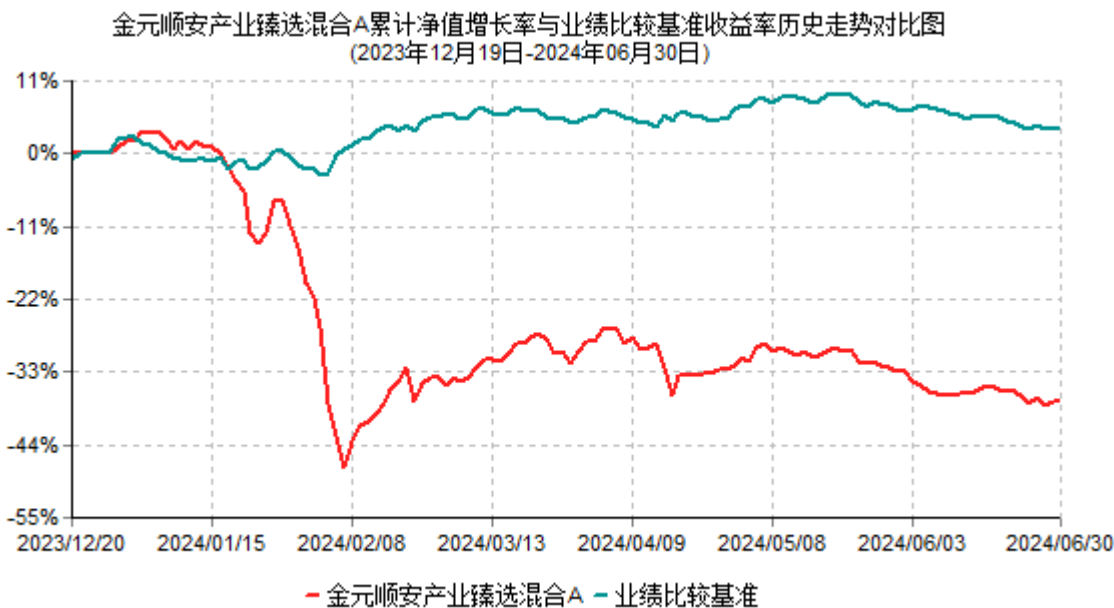
金元顺安产业臻选混合A净值表现

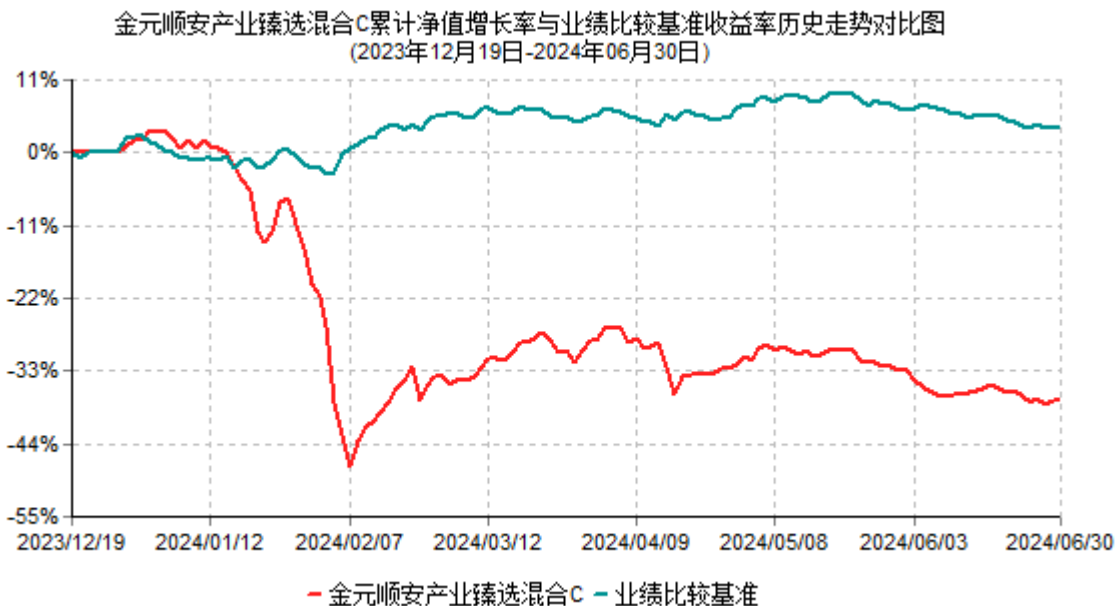
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -12.53% | 1.65% | -1.48% | 0.60% | -11.05% | 1.05% |
| 过去六个月 | -38.59% | 2.87% | 1.28% | 0.72% | -39.87% | 2.15% |
| 自基金合同生效起至今 | -37.33% | 2.76% | 3.86% | 0.72% | -41.19% | 2.04% |

金元顺安产业臻选混合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 | -12.60% | 1.65% | -1.48% | 0.60% | -11.12% | 1.05% |
| 过去六个月 | -38.67% | 2.87% | 1.28% | 0.72% | -39.95% | 2.15% |
| 自基金合同生效起至今 | -37.43% | 2.76% | 3.86% | 0.72% | -41.29% | 2.04% |

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





注：

- 1、本基金合同生效日为2023年12月19日，业绩基准累计增长率以2023年12月19日指数为基准；
- 2、本基金自合同生效日至本报告期末不满一年，建仓期6个月，从2023年12月19日起至2024年6月18日，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

§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 | | |
| 闵杭 | 本基金基金经理 | 2023-12-19 | - | 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、金元顺安核盛债券型证券投资基金、金元顺安核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。 |
| 周博洋 | 本基金基金经理 | 2023-12-21 | - | 12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、金元顺安沅楹债券型证券投资基金、金元顺安沅泉债券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，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，上海证券有限责任公司项目总经理。2014年8月加入金元顺安基金管理有限公司，历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。12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的相关规定。

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 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

二季度市场整体呈现先涨后跌格局的同时出现明显的大小市值分化。具体来看，4月进入年报及一季报业绩密集披露期叠加政策因素影响，中小盘个股承压；5月经济基本面数据有所向好资金风险偏好略有上升，而后随着各项经济金融数据不及预期，市场风险偏好持续下行。从指数涨跌幅来看，二季度全A下跌5.32%，沪深300下跌2.14%，创业板指下跌7.41%，中证500下跌6.5%，中证1000下跌10.02%。展望后市，政策方面，新“国九条”、“科八条”等政策出台了一系列有利于提高市场长期投资回报的举措，

后续配套系列文件的出台有望提振市场信心。基本面方面，楼市新政后6月百强房企销售额数据出现环比增长，若地产销售能够企稳对于经济基本面的预期将起到较好的支撑作用，提升市场情绪。海外方面，近期美国核心通胀数据持续回落提振降息预期，或将有利于外资流入位置相对较低的A股市场。行业方面，新质生产力相关支持政策密集发布，高阶自动驾驶、商业航天等细分领域有望经历快速成长阶段；作为新质生产力的硬件基础，半导体行业也可能将有较好表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安产业臻选混合A基金份额净值为0.6267元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.53%，同期业绩比较基准收益率为-1.48%；截至报告期末金元顺安产业臻选混合C基金份额净值为0.6257元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.60%，同期业绩比较基准收益率为-1.48%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 79,019,026.98 | 88.42 |
| | 其中：股票 | 79,019,026.98 | 88.42 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 5,549,137.74 | 6.21 |
| | 其中：债券 | 5,549,137.74 | 6.21 |
| | 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 | 4,606,867.03 | 5.16 |

| | | | |
|---|------|---------------|--------|
| 8 | 其他资产 | 190,085.87 | 0.21 |
| 9 | 合计 | 89,365,117.62 | 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 | 851,967.00 | 1.00 |
| C | 制造业 | 65,798,367.93 | 76.93 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 937,575.00 | 1.10 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,701,908.00 | 1.99 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 9,729,209.05 | 11.37 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 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 | 79,019,026.98 | 92.38 |

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 | 002241 | 歌尔股份 | 51,900 | 1,012,569.00 | 1.18 |
| 2 | 600150 | 中国船舶 | 24,200 | 985,182.00 | 1.15 |
| 3 | 601766 | 中国中车 | 127,300 | 956,023.00 | 1.12 |
| 4 | 600406 | 国电南瑞 | 38,300 | 955,968.00 | 1.12 |
| 5 | 600660 | 福耀玻璃 | 19,800 | 948,420.00 | 1.11 |
| 6 | 600760 | 中航沈飞 | 23,620 | 947,162.00 | 1.11 |
| 7 | 300054 | 鼎龙股份 | 41,700 | 945,756.00 | 1.11 |
| 8 | 300762 | 上海瀚讯 | 52,800 | 945,648.00 | 1.11 |
| 9 | 000063 | 中兴通讯 | 33,700 | 942,589.00 | 1.10 |
| 10 | 003816 | 中国广核 | 202,500 | 937,575.00 | 1.10 |

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 | 5,549,137.74 | 6.49 |
| 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 | 5,549,137.74 | 6.49 |

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 | 019727 | 23国债24 | 54,500 | 5,549,137.74 | 6.49 |
| 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 3 | - | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - | - |

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

1、上海瀚讯（300762.SZ）

2024年01月03日，上海证监局决定对高博文采取出具警示函的行政监管措施。经查，高博文作为立信会计师事务所（特殊普通合伙，以下简称立信）审计高级项目经理、上海瀚讯信息技术股份有限公司2021年年度财务报告审计项目组成员，于2022年3月21日

至2022年3月24日期间买卖上海瀚讯股票。其中，2022年3月21日买入1100股，2022年3月24日卖出1100股。

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，认为公司经营业务均为国家产业支持的细分子行业，盈利能力逐步修复，整体符合预期，后续公司业务仍具有发展潜力；

(2) 因2021年年度财务报告审计项目组成员于2022年3月21日至2022年3月24日期间买卖上海瀚讯股票，上海证监局于2024年1月3日对高博文采取出具警示函的行政监管措施，经过分析，我们认为该事项对公司影响可控，与公司的经营发展无关，因此继续持有该公司股票。

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 | 160,016.43 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 30,069.44 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 190,085.87 |

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

| | | |
|--|------------|------------|
| | 金元顺安产业臻选混合 | 金元顺安产业臻选混合 |
|--|------------|------------|

| | A | C |
|-------------------------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 46,693,268.15 | 126,222,169.08 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,836,750.07 | 28,822,312.63 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 17,494,162.57 | 50,439,230.49 |
| 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 | 32,035,855.65 | 104,605,251.22 |

§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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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产业臻选混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安产业臻选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安产业臻选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安产业臻选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产业臻选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

2024年07月19日