

金元顺安桉盛债券型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09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:宁波银行股份有限公司

报告送出日期:2024年10月25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	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	8
§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	11
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	14
§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	15
§9 备查文件目录	15
9.1 备查文件目录	15
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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月24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07月01日起至2024年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金元顺安桉盛债券	
基金主代码	004093	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年03月30日	
报告期末基金份额总额	1,165,977,173.17份	
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取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、债券资产投资策略；3、股票投资策略；4、权证投资策略；5、资产支持证券投资策略	
业绩比较基准	中债综合指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。	
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金元顺安桉盛债券A	金元顺安桉盛债券C
下属分级基金的交易代码	004093	007115

报告期末下属分级基金的份额总额	1,165,404,803.03份	572,370.14份
-----------------	-------------------	-------------

注：

本基金自2020年04月21日起，C类份额开始运作。

§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07月01日 - 2024年09月30日)	
	金元顺安桉盛债券A	金元顺安桉盛债券C
1.本期已实现收益	4,889,281.55	2,197.89
2.本期利润	29,269,030.66	14,934.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0251	0.0258
4.期末基金资产净值	1,130,533,910.10	603,699.08
5.期末基金份额净值	0.9701	1.0547

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

金元顺安桉盛债券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	2.66%	0.44%	0.26%	0.10%	2.40%	0.34%
过去六个月	1.16%	0.38%	1.32%	0.09%	-0.16%	0.29%
过去一年	-0.04%	0.39%	3.53%	0.07%	-3.57%	0.32%
过去三年	-6.13%	0.30%	5.97%	0.06%	-12.10%	0.24%
过去五年	-1.82%	0.30%	8.14%	0.06%	-9.96%	0.24%

自基金合同生效起至今	10.13%	0.25%	11.63%	0.06%	-1.50%	0.19%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

金元顺安桉盛债券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	2.58%	0.44%	0.26%	0.10%	2.32%	0.34%
过去六个月	1.00%	0.38%	1.32%	0.09%	-0.32%	0.29%
过去一年	0.96%	0.41%	3.53%	0.07%	-2.57%	0.34%
过去三年	2.87%	0.46%	5.97%	0.06%	-3.10%	0.40%
自基金合同生效起至今	3.93%	0.41%	4.75%	0.06%	-0.82%	0.35%

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

金元顺安桉盛债券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
(2017年03月30日-2024年09月30日)

金元顺安桉盛债券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04月21日-2024年09月30日)



注：

- 1、本基金合同生效日为2017年03月30日，业绩基准收益率以2017年03月29日为基准。
- 2、本基金于2019年3月16日新增C类份额，新增份额至有实有资产之日起披露数据。

§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	总经理助理、投资总监、本基金基金经理	2021-07-21	-	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、金元顺安产业臻选混合型证券投资基金和金元顺安鼎泰债券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和金元顺安新经济主题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。
郭建新	本基金基金经理	2017-04-05	-	14年	金元顺安桉盛债券型证券投资基金和金元顺安鼎泰债券型证券投资基金的基金经理，西南财经大学经济学硕士。曾任河北银行股份有限公司资金运营中心债券交易经理。2016年9月加入金元顺安基金管理有限公司，历任金元顺安桉泰债券型证券投资基金和金元顺安金通宝货币市场基金的基金经理。14年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

注：

- 1、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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024年三季度国内经济整体保持放缓态势。地产投资和销售仍然没有出现改善，通胀增速在零附近徘徊，货币增速较低。在此背景下，债券收益率稳步下行，长端利率突破此前低位。季末出台的地产和股市相关支持政策力度较强，市场预期出现调整，股市和债券收益率大幅波动。

本基金三季度纯债部分继续维持较短久期，配置高等级信用债，降低了杠杆水平，股票和转债基本维持此前持仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安桉盛债券A基金份额净值为0.9701元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.66%，同期业绩比较基准收益率为0.26%；截至报告期末金元顺安桉盛债券C基金份额净值为1.0547元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.58%，同期业绩比较基准收益率为0.26%。

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	156,551,287.78	11.99
	其中：股票	156,551,287.78	11.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,138,683,168.90	87.23
	其中：债券	1,138,683,168.90	87.23
	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	8,848,631.84	0.68
8	其他资产	1,284,766.59	0.10
9	合计	1,305,367,855.11	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	-	-
C	制造业	96,378,017.56	8.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,564,790.00	0.49
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政	7,380,117.00	0.65

	业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,014,044.40	3.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,214,318.82	0.28
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	156,551,287.78	13.84

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	600435	北方导航	1,187,600	12,956,716.00	1.15
2	688122	西部超导	271,705	12,612,546.10	1.12
3	603255	鼎际得	298,500	9,250,515.00	0.82
4	002384	东山精密	388,955	9,156,000.70	0.81
5	688579	山大地纬	876,345	8,316,514.05	0.74
6	603565	中谷物流	820,013	7,380,117.00	0.65
7	002777	久远银海	419,700	7,206,249.00	0.64
8	300366	创意信息	705,000	7,205,100.00	0.64
9	688270	臻镭科技	209,114	5,779,910.96	0.51
10	002230	科大讯飞	126,900	5,639,436.00	0.50

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	80,380,328.77	7.11
	其中：政策性金融债	80,380,328.77	7.11
4	企业债券	227,389,635.14	20.10
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	592,651,074.36	52.39
7	可转债（可交换债）	238,262,130.63	21.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,138,683,168.90	100.67

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	102102027	21苏国信MTN010	500,000	51,611,721.31	4.56
2	102102120	21广州国资MTN002	500,000	51,578,442.62	4.56
3	148128	23穗交01	500,000	51,473,449.32	4.55
4	102103096	21华能MTN002 (可持续挂钩)	500,000	51,373,464.48	4.54
5	102280270	22中化股MTN001A	500,000	50,955,245.90	4.50

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、22桂投资MTN003（102282078.IB）

2023年12月14日，广西证监局对广西投资集团有限公司及相关责任人员采取出具警示函措施的决定，广投集团存在以下问题：公司债券“19桂纾01”存在未按约定用途使用募集资金的情形，违反了《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第113号）第十五条第一款规定。

本基金管理人做出说明如下：

（1）投资决策程序：广西投资集团有限公司为广西省级大型地方国企，实控人为广西壮族自治区人民政府。公司主要投资和经营电力、铝业、金融等产业。主体信用评级AAA，信用资质较高，违约概率较低。

（2）该公司由于一期债券的募集资金未按照约定用途使用而被广西证监局出具警示函。以上处罚不影响公司的正常运营，对公司的偿债能力没有明显负面影响，因此继续持有该债券。

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	27,892.40
2	应收证券清算款	1,256,514.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	360.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,284,766.59

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	113666	爱玛转债	39,395,761.64	3.48
2	127020	中金转债	33,544,932.19	2.97
3	110089	兴发转债	27,729,931.51	2.45
4	113641	华友转债	26,552,640.00	2.35
5	113043	财通转债	23,657,030.78	2.09
6	110067	华安转债	17,249,989.47	1.53
7	127028	英特转债	12,047,934.87	1.07
8	127086	恒邦转债	9,547,785.21	0.84
9	113634	珀莱转债	8,060,457.53	0.71
10	110090	爱迪转债	8,052,627.40	0.71
11	110073	国投转债	6,913,010.96	0.61
12	127066	科利转债	6,435,415.09	0.57
13	127073	天赐转债	6,245,041.64	0.55
14	127056	中特转债	5,363,286.83	0.47
15	113061	拓普转债	2,440,677.81	0.22
16	113661	福22转债	2,137,116.16	0.19
17	128133	奇正转债	1,230,455.07	0.11
18	123119	康泰转2	1,156,964.38	0.10
19	127032	苏行转债	488,911.17	0.04
20	110079	杭银转债	12,160.92	0.00

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

	金元顺安桉盛债券A	金元顺安桉盛债券C
报告期期初基金份额总额	1,165,405,527.13	590,245.95
报告期期间基金总申购份额	689.52	6,021.80
减：报告期期间基金总赎回份额	1,413.62	23,897.61
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	1,165,404,803.03	572,370.14

§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07月01日 - 2024年09月30日	621,476,372.61	-	-	621,476,372.61	53.30%
	2	2024年07月01日 - 2024年09月30日	543,791,704.65	-	-	543,791,704.65	46.64%
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桉盛债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安桉盛债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安桉盛债券型证券投资基金基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安桉盛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桉盛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10月25日