

金元顺安沅泉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:招商银行股份有限公司

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	16
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	16
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	16
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	16
§8 影响投资者决策的其他重要信息	16
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	16
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	17
§9 备查文件目录	17
9.1 备查文件目录	17
9.2 存放地点	17
9.3 查阅方式	17

§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。

基金托管人招商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	金元顺安沅泉债券	
基金主代码	005843	
交易代码	005843	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年06月10日	
报告期末基金份额总额	220,959,501.15份	
投资目标	本基金在控制基金资产净值波动的基础上，严格管理股票资产的投资比例，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
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、存托凭证投资策略；5、权证投资策略；6、可转换债券投资策略；7、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	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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金元顺安沅泉债券A	金元顺安沅泉债券C

下属分级基金的交易代码	005843	019486
报告期末下属分级基金的份额总额	220,271,866.22份	687,634.93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07月01日 - 2024年09月30日)	
	金元顺安沅泉债券A	金元顺安沅泉债券C
1.本期已实现收益	-3,394,848.34	678.86
2.本期利润	4,260,105.29	36,353.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0193	0.5772
4.期末基金资产净值	219,987,967.40	679,870.16
5.期末基金份额净值	0.9987	0.9887

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

金元顺安沅泉债券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	1.97%	0.93%	0.26%	0.10%	1.71%	0.83%
过去六个月	0.50%	0.78%	1.32%	0.09%	-0.82%	0.69%
过去一年	-2.79%	0.74%	3.53%	0.07%	-6.32%	0.67%
过去三年	4.15%	0.48%	5.97%	0.06%	-1.82%	0.42%
过去五年	14.42%	0.39%	8.14%	0.06%	6.28%	0.33%
自基金合同	16.21%	0.38%	8.74%	0.06%	7.47%	0.32%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

金元顺安沅泉债券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	1.93%	0.94%	0.26%	0.10%	1.67%	0.84%
过去六个月	0.38%	0.78%	1.32%	0.09%	-0.94%	0.69%
过去一年	-3.77%	0.73%	3.53%	0.07%	-7.30%	0.66%
自基金合同生效起至今	-3.69%	0.72%	3.34%	0.07%	-7.03%	0.65%

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

金元顺安沅泉债券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
(2019年06月10日-2024年09月30日)



金元顺安沅泉债券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
(2023年09月14日-2024年09月30日)



注：

- 1、本基金合同生效日为2019年06月10日，业绩基准累计增长率以2019年06月09日指数为基准。
- 2、本基金于2023年9月14日新增C类份额，新增份额自有实有资产之日起披露业绩数据。

§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		
周博洋	本基金基金经理	2019-06-10	-	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

					司助理分析师，上海证券有限责任公司项目经理。2014年8月加入金元顺安基金管理有限公司，历任金元顺安沅泉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。
苏利华	本基金基金经理	2024-09-05	-	14年	金元顺安金元宝货币市场基金、金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金、金元顺安泓丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金、金元顺安泓泽债券型证券投资基金和金元顺安沅泉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。

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

三季度我国经济增长动能偏弱，国内有效需求不足，经济下行压力较大。固定资产投资增速放缓，基建投资保持稳定，制造业投资延续韧性，房地产投资低位徘徊。社零同比增速有所回落。出口景气度延续。工业生产放缓，工业企业利润回落。三季度我国CPI小幅增长，PPI降幅加大，核心CPI放缓，物价水平处于低位。

面对当前经济形势，国新办出台一揽子刺激政策，包括降低存款准备金率以及政策利率，引导银行降低存量房贷利率以及统一降低首付比例，创设新的货币政策工具支持资本市场稳定发展。加大财政货币政策逆周期调节力度，保证必要的财政支出，努力完成全年经济社会发展目标任务。

三季度经济下行的趋势仍在延续，权益市场持续下跌，转债市场跟随权益市场表现疲软，特别是弱资质个券一度跌破债底。9月下旬，国新办刺激政策出台，央行创设新的货币政策工具为资本市场提供流动性，权益市场迎来大幅反弹，转债市场亦表现亮眼。

在报告期，本基金采取中短久期，低杠杆策略，资产配置以高等级信用，以及资质良好的双低转债为主，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沔泉债券A基金份额净值为0.9987元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.97%，同期业绩比较基准收益率为0.26%；截至报告期末金元顺安沔泉债券C基金份额净值为0.9887元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.93%，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	32,876,802.94	13.40
	其中：股票	32,876,802.94	13.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	203,815,481.39	83.08
	其中：债券	203,815,481.39	83.08
	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	4,144,213.59	1.69
8	其他资产	4,498,824.47	1.83
9	合计	245,335,322.39	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	676,126.00	0.31
B	采矿业	1,958,702.00	0.89
C	制造业	14,149,063.94	6.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	676,350.00	0.31
E	建筑业	717,498.00	0.33
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政	738,692.00	0.33

	业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	708,352.00	0.32
J	金融业	13,252,019.00	6.01
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	32,876,802.94	14.90

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	600030	中信证券	46,800	1,272,960.00	0.58
2	300059	东方财富	62,300	1,264,690.00	0.57
3	688981	中芯国际	18,566	1,113,774.34	0.50
4	601633	长城汽车	33,500	1,015,385.00	0.46
5	601319	中国人保	124,400	925,536.00	0.42
6	601628	中国人寿	20,700	910,800.00	0.41
7	300750	宁德时代	3,600	906,804.00	0.41
8	601601	中国太保	22,600	883,660.00	0.40
9	601318	中国平安	15,400	879,186.00	0.40
10	603288	海天味业	18,180	875,730.60	0.40

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	15,331,315.07	6.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,787,183.56	23.02
	其中：政策性金融债	20,368,575.34	9.23
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）	137,696,982.76	62.40
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	203,815,481.39	92.36

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	240210	24国开10	200,000	20,368,575.34	9.23
2	019727	23国债24	150,000	15,331,315.07	6.95
3	2228041	22农业银行二级01	100,000	10,392,128.77	4.71
4	312400001	24工行TLAC非资本债01A	100,000	10,076,561.64	4.57
5	312410003	24建行TLAC非资本债01A	100,000	9,949,917.81	4.51

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农业银行二级01（2228041.IB）

2023年11月16日，国家金融监督管理总局对中国农业银行股份有限公司作出行政处罚，没收违法所得并处罚款合计2710.9738万元。其中，总行570.9738万元，分支机构2140万元。主要由于：一、流动资金贷款被用于固定资产投资；二、贷款受托支付问题整改不到位；三、贷款风险分类不准确；四、个别精准扶贫贷款被挪用；五、不良资产转让流程问题整改不到位；六、小微企业划型不准确；七、贷款资金转存银承汇票保证金问题整改不到位等违法违规事实。

本基金管理人做出说明如下：

投资决策程序：通过对公司的基本面进行分析，认为公司经营业务良好，盈利能力较强，现金流充裕，债务压力较小，资质符合投资要求；

因报贷款风险分类不准确、不良资产转让流程问题整改不到位等问题，国家金融监督管理总局决定对农业银行作出行政处罚，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债券。

2、24建行TLAC非资本债01（312410003.IB）

1) 2023年11月22日，国家金融监督管理总局对中国建设银行股份有限公司作出行政处罚，没收违法所得并处罚款合计3791.879382万元。其中，总行2041.879382万元，

分支机构1750万元。主要由于：一、单个网点在同一会计年度内与超过3家保险公司开展保险业务合作；二、违规通过储蓄柜台销售投资连结型保险产品；三、代销利益不确定的保险产品未按规定提供完整合同材料；四、未将超过规定年龄客户的保单材料转至保险公司核保并出单，且销售的部分保险产品属于保单利益不确定型；五、向客户销售高于其风险承受能力的保险产品；六、代销公募基金产品违规采用低风险评级等违法违规事实。

2) 2023年12月27日，国家金融监督管理总局对中国建设银行股份有限公司作出行政处罚，罚款170万元。主要由于：一、并表管理内部审计存在不足；二、母行对境外机构案件管理不到位；三、未及时报告境外子行高级管理人员任职情况；四、监管检查发现问题整改不力违法违规事实。

本基金管理人做出说明如下：

投资决策程序：通过对公司的基本面进行分析，认为公司经营业务良好，盈利能力较强，现金流充裕，债务压力较小，资质符合投资要求；

因报并表管理内部审计存在不足、向客户销售高于风险承受能力的产品等等问题，国家金融监督总局决定对建设银行作出行政处罚，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债券。

3、豪美转债（127053.SZ）

2024年1月11日，深圳证券交易所出具对广东豪美新材股份有限公司的纪律处分决定书。豪美新材于2023年10月30日披露的投资者关系活动记录表显示，汽车轻量化业务方面，上半年已累计取得280个车型定点项目，客户覆盖了华为问界等国产品牌及宝马等合资车型。豪美新材于2023年11月3日披露的投资者关系活动记录表显示，豪美新材回复投资者提问“公司为华为问界的供应商，目前订单情况如何”时称，“问界M7量产后为公司带了一定的订单增量”。2023年11月7日至14日期间，豪美新材股票及可转债价格持续大幅上涨，股票交易三次触及异常波动，可转债交易出现两次异常波动，豪美新材在11月9日、13日披露的《股票交易异常波动公告》中称，豪美新材前期披露的汽车轻量化业务相关信息不存在需要更正、补充之处，也不存在应披露而未披露、对公司股票交易价格产生重大影响的信息。直至本所于11月14日发出关注函，要求豪美新材核实说明相关事项后，豪美新材才在11月16日披露的《关于汽车轻量化业务相关披露事项的更正公告》中表示，公司的定位是整车厂的二级或三级供应商，直接客户主要为凌云股份等汽车零部件企业，相关产品终端应用涵盖了华为问界等国产品牌以及宝马等合资车型，2023年前三季度向零部件企业出货应用于问界车型相关产品的收入约479万元（含税），占公司前三季度销售收入约0.11%，对公司目前收入、利润影响较小。11月15日至11月17日，豪美新材股价连续下跌，再次触及异常波动。

本基金管理人做出说明如下：

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重点支持领域，盈利能力良好，公司业务具备发展潜力，整体符合预期。

因存在信息应披露未披露对公司股价产生重大影响的信息，深圳证券交易所对广东豪美新材股份有限公司出具纪律处分决定书，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可转债。

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	43,640.17
2	应收证券清算款	4,349,736.81
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	105,447.49
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,498,824.47

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	127042	嘉美转债	6,111,204.76	2.77
2	113549	白电转债	5,744,448.27	2.60
3	127053	豪美转债	5,177,680.57	2.35
4	127059	永东转2	5,173,060.38	2.34
5	123133	佩蒂转债	4,966,596.06	2.25
6	113632	鹤21转债	4,939,564.90	2.24
7	110067	华安转债	4,742,499.40	2.15
8	127049	希望转2	4,475,944.46	2.03
9	128141	旺能转债	4,445,507.64	2.01
10	118028	会通转债	4,428,189.29	2.01
11	113675	新23转债	4,326,775.58	1.96
12	111005	富春转债	4,317,544.95	1.96
13	111002	特纸转债	4,307,453.25	1.95
14	113056	重银转债	4,257,937.04	1.93

15	127082	亚科转债	4,220,701.77	1.91
16	127078	优彩转债	4,105,449.65	1.86
17	113623	凤21转债	3,976,213.62	1.80
18	127070	大中转债	3,489,066.00	1.58
19	113024	核建转债	3,319,047.27	1.50
20	111016	神通转债	3,306,690.01	1.50
21	128130	景兴转债	3,276,940.59	1.49
22	113045	环旭转债	3,161,267.99	1.43
23	110093	神马转债	3,136,775.07	1.42
24	118034	晶能转债	2,832,278.31	1.28
25	113062	常银转债	2,639,413.15	1.20
26	113679	芯能转债	2,539,988.68	1.15
27	123035	利德转债	2,366,747.85	1.07
28	113051	节能转债	2,313,590.94	1.05
29	110084	贵燃转债	2,192,160.21	0.99
30	113662	豪能转债	2,139,149.59	0.97
31	110081	闻泰转债	2,128,216.81	0.96
32	127045	牧原转债	2,047,376.46	0.93
33	113044	大秦转债	2,037,888.22	0.92
34	111008	沿浦转债	1,833,161.27	0.83
35	123182	广联转债	1,234,217.90	0.56
36	123120	隆华转债	1,151,949.81	0.52
37	118038	金宏转债	1,142,556.48	0.52
38	123169	正海转债	1,132,280.52	0.51
39	113644	艾迪转债	1,116,983.41	0.51
40	118036	力合转债	1,100,296.24	0.50
41	123124	晶瑞转2	1,093,837.32	0.50
42	118041	星球转债	1,053,200.60	0.48
43	110090	爱迪转债	1,045,691.19	0.47
44	123212	立中转债	1,042,167.40	0.47
45	113676	荣23转债	1,006,799.26	0.46
46	113656	嘉诚转债	991,901.52	0.45
47	127020	中金转债	108,571.10	0.05

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

	金元顺安沅泉债券A	金元顺安沅泉债券C
报告期期初基金份额总额	220,255,952.69	30,492.11
报告期期间基金总申购份额	194,946.17	735,497.68
减：报告期期间基金总赎回份额	179,032.64	78,354.86
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	220,271,866.22	687,634.93

§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	99,284,154.09	-	-	99,284,154.09	44.93%
	2	2024年07月01日 -2024年09月30日	69,170,530.68	-	-	69,170,530.68	31.30%

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沅泉债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安沅泉债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安沅泉债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安沅泉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沅泉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