

金元顺安丰祥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:中国农业银行股份有限公司

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	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	7
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	8
5.1 报告期末基金资产组合情况	8
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	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	9
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	9
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	10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	10
5.11 投资组合报告附注	10
§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	13
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	13
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	14

§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	金元顺安丰祥债券	
基金主代码	620009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年01月14日	
报告期末基金份额总额	2,458,082,577.07份	
投资目标	本基金在强调基金资产安全性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金采用的投资策略包括：1、资产配置策略；2、债券投资主要策略；3、债券选择；4、现金管理	
业绩比较基准	中债综合指数	
风险收益特征	本基金是一只债券型基金，属于基金中的较低预期风险较低预期收益的品种，其预期风险收益水平高于货币市场基金，低于股票型基金及混合型基金。	
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金元顺安丰祥债券A	金元顺安丰祥债券C
下属分级基金的交易代码	620009	018296
报告期末下属分级基金的份额总额	1,657,408,647.34份	800,673,929.73份

注：

“金元惠理惠利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2013年02月05日。自2015年01月14日起，本基金转型为债券型证券投资基金。故本报告中，本基金基金合同生效日为2015年01月14日。

§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)	
	金元顺安丰祥债券A	金元顺安丰祥债券C
1.本期已实现收益	-1,196,980.54	-146,242.95
2.本期利润	836,239.34	2,256,212.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0004	0.0032
4.期末基金资产净值	1,813,078,193.33	874,586,789.35
5.期末基金份额净值	1.0939	1.0923

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

金元顺安丰祥债券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	0.18%	0.09%	0.26%	0.10%	-0.08%	-0.01%
过去六个月	0.80%	0.08%	1.32%	0.09%	-0.52%	-0.01%
过去一年	2.13%	0.08%	3.53%	0.07%	-1.40%	0.01%
过去三年	10.16%	0.06%	5.97%	0.06%	4.19%	0.00%
过去五年	22.58%	0.22%	8.14%	0.06%	14.44%	0.16%
自基金合同	42.28%	0.20%	12.59%	0.07%	29.69%	0.13%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

金元顺安丰祥债券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	0.16%	0.09%	0.26%	0.10%	-0.10%	-0.01%
过去六个月	0.75%	0.08%	1.32%	0.09%	-0.57%	-0.01%
过去一年	2.03%	0.08%	3.53%	0.07%	-1.50%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.37%	0.07%	4.14%	0.07%	-0.77%	0.00%

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

金元顺安丰祥债券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
(2015年01月14日-2024年09月30日)



金元顺安丰祥债券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05月04日-2024年09月30日)



注：

- 1、“金元惠理惠利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2013年2月5日。自2015年1月14日起，本基金转型为金元顺安丰祥债券型证券投资基金，业绩基准累计增长率以2015年1月13日指数为基准；
- 2、本基金于2023年5月4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	2018-01-26	-	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

					<p>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副经理。2014年8月加入金元顺安基金管理有限公司，历任金元顺安沣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。</p>
--	--	--	--	--	--

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

季度内债市收益率整体震荡下行，季末收益率出现一波快速调整。分月来看，7月，在国内稳增长压力上升和外汇压力减弱下，国内在时间点和幅度上超预期降息，随后央行对利率下行未进行干预，对资金面更多呵护，收益率大幅下行；8月，在央行指导大行卖债和监管处罚市场交易主体等措施后，债券市场流动性明显降低，收益率出现一波快速调整，月末基金预防性赎回负反馈初见端倪，信用利差扩大；9月，月初公布的一系列经济金融数据较差，市场开始交易降准降息，收益率大幅下行。市场在月末最后一周出现转折，随着降准降息落地，央行推出两项支持权益市场举措，形成股强债弱的跷跷板走势。转债方面，季度内转债市场基本随权益市场涨跌，在连续下跌后，季度末迎来大幅反弹，而7月由于退市风波转债跌幅较大，落后同期权益市场表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安丰祥债券A基金份额净值为1.0939元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.18%，同期业绩比较基准收益率为0.26%；截至报告期末金元顺安丰祥债券C基金份额净值为1.0923元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.16%，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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,314,691,136.13	96.06
	其中：债券	3,314,691,136.13	96.06
	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	121,023,745.85	3.51
	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	13,697,969.75	0.40
8	其他资产	1,200,566.83	0.03
9	合计	3,450,613,418.56	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	132,082,897.17	4.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,696,111,407.30	63.11
	其中：政策性金融债	111,230,136.61	4.14
4	企业债券	10,202,582.47	0.38
5	企业短期融资券	223,481,764.81	8.32
6	中期票据	957,242,463.09	35.62
7	可转债（可交换债）	295,570,021.29	11.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,314,691,136.13	123.33

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	240401	24农发01	1,100,000	111,230,136.61	4.14
2	2228050	22光大银行	1,000,000	102,753,420.77	3.82

3	2228020	22兴业银行02	1,000,000	102,054,021.92	3.80
4	2028033	20建设银行二级	1,000,000	102,046,493.15	3.80
5	2228015	22浦发银行03	1,000,000	101,913,934.25	3.79

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末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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	57,742.06
2	应收证券清算款	1,130,910.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,914.69
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,200,566.83

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	118034	晶能转债	15,242,514.81	0.57
2	123133	佩蒂转债	13,437,783.84	0.50
3	127042	嘉美转债	13,092,434.70	0.49
4	110081	闻泰转债	12,534,410.88	0.47
5	128130	景兴转债	11,985,701.35	0.45
6	118028	会通转债	10,841,079.98	0.40
7	111016	神通转债	10,354,651.28	0.39
8	127053	豪美转债	10,216,936.62	0.38
9	127059	永东转2	9,656,676.19	0.36
10	113056	重银转债	9,037,495.57	0.34
11	110067	华安转债	8,961,570.99	0.33
12	110073	国投转债	8,726,524.17	0.32
13	113679	芯能转债	8,490,730.77	0.32
14	110085	通22转债	8,122,904.64	0.30
15	127067	恒逸转2	7,852,034.39	0.29
16	113656	嘉诚转债	7,691,569.38	0.29
17	113053	隆22转债	7,407,235.77	0.28
18	113549	白电转债	7,026,702.11	0.26
19	127049	希望转2	6,833,084.27	0.25
20	123208	孩王转债	6,729,085.86	0.25

21	113632	鹤21转债	6,349,679.19	0.24
22	127032	苏行转债	6,191,872.65	0.23
23	113043	财通转债	5,528,417.76	0.21
24	111002	特纸转债	5,163,459.73	0.19
25	128141	旺能转债	5,138,930.84	0.19
26	113637	华翔转债	4,924,222.79	0.18
27	111005	富春转债	4,736,756.12	0.18
28	127078	优彩转债	4,602,851.24	0.17
29	127070	大中转债	4,348,359.46	0.16
30	113644	艾迪转债	4,261,771.66	0.16
31	110093	神马转债	4,233,157.01	0.16
32	110089	兴发转债	4,208,294.41	0.16
33	113663	新化转债	3,331,020.81	0.12
34	118038	金宏转债	3,231,670.85	0.12
35	123169	正海转债	3,167,168.75	0.12
36	110079	杭银转债	3,098,602.56	0.12
37	127017	万青转债	2,290,425.20	0.09
38	110082	宏发转债	2,088,450.78	0.08
39	123108	乐普转2	2,038,573.52	0.08
40	113050	南银转债	1,828,994.00	0.07
41	123229	艾录转债	1,678,401.89	0.06
42	123212	立中转债	1,663,612.16	0.06
43	123182	广联转债	1,639,682.98	0.06
44	123120	隆华转债	1,626,211.28	0.06
45	123218	宏昌转债	1,611,046.06	0.06
46	128109	楚江转债	1,600,209.90	0.06
47	123213	天源转债	1,595,635.23	0.06
48	123124	晶瑞转2	1,583,025.67	0.06
49	113662	豪能转债	1,573,741.05	0.06
50	127039	北港转债	1,539,168.81	0.06
51	118036	力合转债	1,535,875.20	0.06
52	113065	齐鲁转债	1,503,985.22	0.06
53	113060	浙22转债	814,715.25	0.03

54	128129	青农转债	600,903.69	0.02
----	--------	------	------------	------

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

	金元顺安丰祥债券A	金元顺安丰祥债券C
报告期期初基金份额总额	2,354,968,170.33	715,820,403.32
报告期期间基金总申购份额	1,281,037.83	138,592,896.73
减：报告期期间基金总赎回份额	698,840,560.82	53,739,370.32
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	1,657,408,647.34	800,673,929.73

§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	718,981,037.66	-	-	718,981,037.66	29.25%
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丰祥债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安丰祥债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安丰祥债券型证券投资基金基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安丰祥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丰祥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