

国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划

2023年第3季度报告

2023年09月30日

基金管理人:国元证券股份有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2023年10月25日

§1 重要提示

集合计划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。

集合计划托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2023年10月25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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年7月1日起至2023年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国元元赢六个月定开债
基金主代码	970124
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年02月17日
报告期末基金份额总额	944,234,820.26份
投资目标	在追求资产安全性的基础上，力争为集合计划份额持有人实现长期稳定的投资收益。
投资策略	本集合计划的投资策略包括类属资产配置策略、久期策略、收益率曲线策略、杠杆策略、个券选择策略、可转债投资策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。本集合计划投资于可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券的比例不超过集合计划资产的20%。
业绩比较基准	中债-信用债总全价(总值)指数(CBA02703.CS)收益率。
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划，高于货币市场基金、货币型集合计划。
基金管理人	国元证券股份有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§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（2023年07月01日 - 2023年09月30日）
1.本期已实现收益	9,074,632.05
2.本期利润	11,650,782.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0124
4.期末基金资产净值	968,712,850.67
5.期末基金份额净值	1.0259

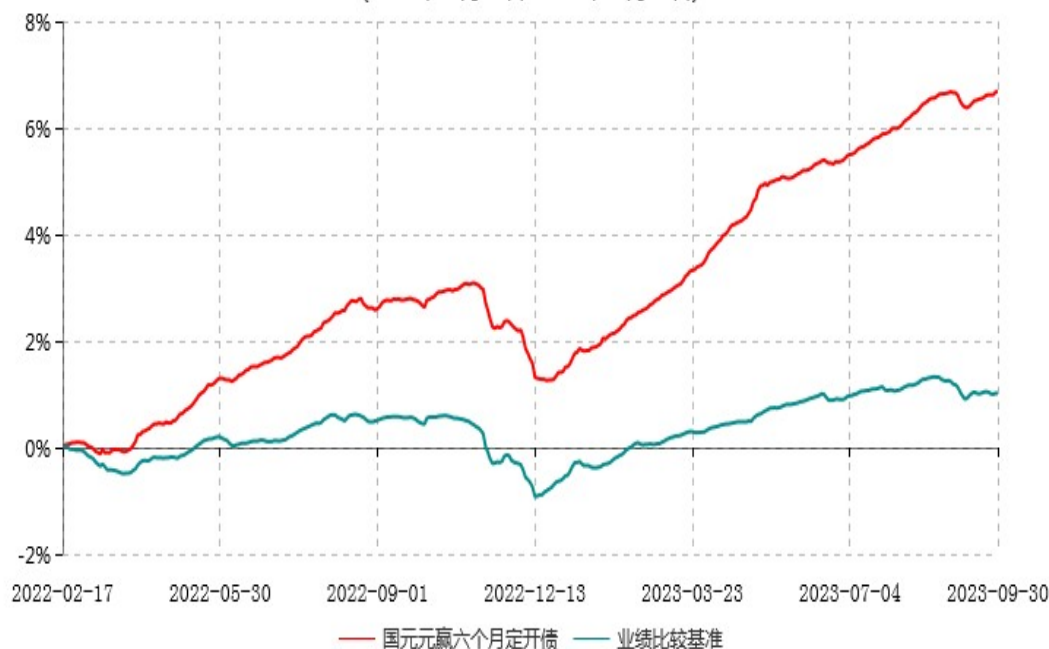
3.2 基金净值表现

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

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	1.19%	0.03%	0.10%	0.03%	1.09%	0.00%
过去六个月	3.02%	0.03%	0.70%	0.02%	2.32%	0.01%
过去一年	3.95%	0.05%	0.59%	0.04%	3.36%	0.01%
自基金合同生效起至今	6.69%	0.04%	1.02%	0.03%	5.67%	0.01%

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

国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年02月17日-2023年09月30日)



§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		
柯贤发	大集合产品 投资经理	2023-08-30	-	12	先后任职于南方基金管理有限公司、平安基金管理有限公司，2017年加入国元证券客户资产管理总部，历任项目经理、投资经理助理，现任国元元赢六个月定开债、国元元赢30天持有期债、国元元增利货币投资经理。
夏真辉	大集合产品 投资经理	2013-05-29	-	15	中国科学技术大学金融学硕士。2008年2月加入国元证券客户资产管理总部，历任研究员、投资助理，现任国元元赢四个月定开债、国元元赢六个月定开债投资经理。

2023年8月30日，本集合计划投资经理由陈帅、夏真辉共同担任变更为柯贤发、夏真辉共同担任。

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，本管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在控制风险的基础上，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害集合计划份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本集合计划管

理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国元证券客户资产管理业务公平交易管理暂行办法》等内部相关公平交易制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本集合计划于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内管理人管理的所有大集合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%的交易次数为0次。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

在企业 and 居民投资消费信心低迷的情况下，政府在货币政策和财政政策上不断发力，从宽货币、松地产，到地方政府发债化债等，显示了政府稳增长的决心，但政策的效果不显著或存在滞后，下半年很有可能还有新的刺激政策出台。

经济的复苏力度不足和政府的稳增长政策，为债券市场提供了强力支撑。银行存款利率的下调和超长期限国债的收益率跌到3%以下，反映整个市场利率中枢下移已成趋势，债券市场将迎来较长时间的慢牛行情。

三季度，本集合计划延续封闭期杠杆策略，控制持仓久期，以短久期高评级信用债为主要投资标的，季度末杠杆降至较低水平，来应对国庆后产品开放。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国元元赢六个月定开债基金份额净值为1.0259元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.19%，同期业绩比较基准收益率为0.10%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内集合计划持有人数为4464户。

§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	837,712,674.44	86.41
	其中：债券	837,712,674.44	86.41
	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	105,065,289.93	10.84
	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	24,494,001.26	2.53
8	其他资产	2,187,070.28	0.23
9	合计	969,459,035.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有股票。

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

本集合计划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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	515,012,540.45	53.16
5	企业短期融资券	175,511,156.10	18.12
6	中期票据	118,672,406.54	12.25
7	可转债（可交换债）	28,516,571.35	2.94
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	837,712,674.44	86.48

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	102282399	22蚌埠投资MTN001	500,000	53,117,671.23	5.48

2	152935	21寿城01	500,000	51,441,027.40	5.31
3	184080	21城乡债	500,000	51,116,780.82	5.28
4	102281828	22蚌埠经开MT N001	500,000	49,981,612.02	5.16
5	042280452	22磁湖高新CPO 04	400,000	41,697,095.89	4.30

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
本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

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
本集合计划本报告期末未持有贵金属。

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
本集合计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本集合计划本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本集合计划本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期没有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 本集合计划在本报告期内未投资股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	37,070.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,150,000.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	2,187,070.28
---	----	--------------

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	110073	国投转债	7,551,132.58	0.78
2	113043	财通转债	6,767,695.89	0.70
3	127005	长证转债	3,271,839.86	0.34
4	113623	凤21转债	2,355,643.84	0.24
5	128129	青农转债	2,040,732.88	0.21
6	127040	国泰转债	1,139,513.70	0.12
7	127049	希望转2	1,093,019.32	0.11
8	118022	锂科转债	1,043,217.81	0.11
9	113052	XD兴业转	1,031,946.58	0.11
10	110047	山鹰转债	640,697.08	0.07
11	123149	通裕转债	613,930.48	0.06
12	128136	立讯转债	556,009.38	0.06
13	123158	宙邦转债	411,191.95	0.04

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	940,382,528.21
报告期期间基金总申购份额	3,852,292.05
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	944,234,820.26

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本集合计划本报告期无集合计划管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划托管协议；
- 4、国元证券股份有限公司国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划招募说明书
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内披露的各项公告。

8.2 存放地点

安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座

8.3 查阅方式

上述文件可在国元证券网站上查阅，或者在营业时间内到国元证券查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人国元证券股份有限公司。

客户服务中心电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

国元证券股份有限公司

2023年10月25日