

金元顺安丰祥债券型证券投资基金
2023 年第 1 季度报告

2023 年 03 月 31 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：2023 年 04 月 22 日

目录

§1	重要提示	4
§2	基金产品概况	5
§3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要财务指标	6
3.2	基金净值表现	6
§4	管理人报告	9
4.1	基金经理（或基金经理小组）简介	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3	公平交易专项说明	10
4.4	报告期内基金的投资策略和运作分析	10
4.5	报告期内基金的业绩表现	11
4.6	报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	11
§5	投资组合报告	12
5.1	报告期末基金资产组合情况	12
5.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	12
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	13
5.4	报告期末按债券品种分类的债券投资组合	13
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	13
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	14
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	14
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	14
5.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	14
5.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	14
5.11	投资组合报告附注	14
§6	开放式基金份额变动	19

§7	基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	20
7.1	基金管理人持有本基金份额变动情况.....	20
7.2	基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	20
§8	影响投资者决策的其他重要信息.....	21
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.....	21
8.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	21
§9	备查文件目录	22
9.1	备查文件目录	22
9.2	存放地点	22
9.3	查阅方式	22

§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 2023 年 04 月 21 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 03 月 31 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	1,034,519,123.27 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	本基金基于“自上而下”的原则，本基金采用久期控制下的主动性投资策略，并本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。经过对历史数据的统计分析发现，债券市场收益率受到宏观经济形势和债券市场供需两方面不同程度的影响，因此本基金在债券投资过程中，将在分析和判断宏观经济指标与债券收益率之间的数量关系、市场利率变化和期限结构、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上，动态调整组合久期和债券的结构，构建和调整固定收益投资组合，获取稳健收益。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金系债券型基金，其风险收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于中低风险中低收益的证券投资基金品种。
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

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
	(2023 年 01 月 01 日 - 2023 年 03 月 31 日)
1.本期已实现收益	4,505,292.53
2.本期利润	17,778,589.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0177
4.期末基金资产净值	1,251,580,089.07
5.期末基金份额净值	1.2098

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）扣除相关费用及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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

3、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 03 月 31 日；

4、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

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	1.50%	0.04%	0.28%	0.03%	1.22%	0.01%

过去六个月	0.52%	0.07%	-0.32%	0.06%	0.84%	0.01%
过去一年	3.23%	0.06%	0.70%	0.05%	2.53%	0.01%
过去三年	13.27%	0.13%	0.98%	0.06%	12.29%	0.07%
过去五年	25.08%	0.26%	7.95%	0.06%	17.13%	0.20%
自基金合同 生效起至今	36.73%	0.22%	7.73%	0.07%	29.00%	0.15%

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

金元顺安丰祥债券型证券投资基金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-2023年03月31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 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，业绩基准累计增长率以 2015 年 01 月 13 日指数为基准；

2、本基金投资于债券类金融工具的比例不低于基金资产的 80%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购或增发新股，持有的因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证和因投资分离交易可转债所形成的

权证应在其可交易之日起的 30 个交易日内卖出。

此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围；

3、本基金业绩比较基准为“中债综合指数”。

§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	-	11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、金元顺安沆楹债券型证券投资基金、金元顺安沆顺定期开放债券型发起式证券投资基金和金元顺安沆泉债券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经理。2014年8月加入金元顺安基金管理有限公司。11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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《金元顺安丰祥债券型证券投资基金基金合同》和其他

有关法律法规的规定，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律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

受疫情管控放开及银行信贷支持影响，一季度宏观经济数据整体向好，PMI 连续站在 50 上方，但市场对经济复苏的斜率及持续性仍有分歧，10 年国债呈窄幅震荡走势，收益率大致持平去年年末。受去年年底理财踩踏的冲击，信用利差隐含一轮加息周期价格，一季度债券市场的主线是信用利差的修复，符合我们年初的判断。以 3 年 AA+ 城投曲线为例，信用利差由去年年末的 115bp 下行至季末的 58bp。

转债方面，市场流动性整体维持宽松状态，高溢价得以延续，市场整体风格偏向 TMT 主线，传统双低表现较为一般。一季度中证转债指数上涨 3.53%。

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基金份额净值为 1.2098 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 1.50%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%。

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	1,509,821,504.82	95.80
	其中：债券	1,509,821,504.82	95.80
	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	1,000,388.16	0.06
	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	15,047,071.09	0.95
8	其他资产	50,161,113.33	3.18
9	合计	1,576,030,077.40	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	75,936,883.56	6.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	469,808,142.79	37.54
	其中：政策性金融债	90,639,501.37	7.24
4	企业债券	30,412,397.26	2.43
5	企业短期融资券	172,193,690.41	13.76
6	中期票据	654,621,866.75	52.30
7	可转债（可交换债）	106,848,524.05	8.54
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,509,821,504.82	120.63

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	019679	22国债14	750,000	75,936,883.56	6.07
2	230203	23国开03	600,000	60,141,534.25	4.81
3	1928028	19中国银行二级01	400,000	41,399,480.55	3.31
4	2128023	21中信银行小微债	400,000	41,261,030.14	3.30

5	2028018	20交通银行二级	400,000	41,246,772.60	3.30
---	---------	----------	---------	---------------	------

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	24,073.99
2	应收证券清算款	50,082,907.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	54,131.81
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	50,161,113.33

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	113516	苏农转债	4,918,521.43	0.39
2	128048	张行转债	4,815,258.55	0.38
3	110043	无锡转债	4,806,866.86	0.38
4	113054	绿动转债	4,664,102.94	0.37
5	127032	苏行转债	4,575,697.36	0.37
6	110079	杭银转债	4,550,233.54	0.36
7	128034	江银转债	4,543,345.16	0.36
8	113631	皖天转债	3,192,635.16	0.26

9	127006	敖东转债	2,997,132.86	0.24
10	113062	常银转债	2,933,183.67	0.23
11	110053	苏银转债	2,835,268.46	0.23
12	110067	华安转债	2,625,507.75	0.21
13	113057	中银转债	2,535,629.78	0.20
14	113505	杭电转债	2,445,806.93	0.20
15	128023	亚太转债	2,399,755.55	0.19
16	113549	白电转债	2,087,013.22	0.17
17	113060	浙22转债	2,004,933.79	0.16
18	128119	龙大转债	1,974,399.17	0.16
19	113640	苏利转债	1,968,919.38	0.16
20	110086	精工转债	1,934,670.10	0.15
21	128109	楚江转债	1,929,928.41	0.15
22	127045	牧原转债	1,893,941.94	0.15
23	113024	核建转债	1,892,070.95	0.15
24	127049	希望转2	1,876,211.33	0.15
25	127035	濮耐转债	1,865,559.28	0.15
26	110080	东湖转债	1,748,884.22	0.14
27	113532	海环转债	1,651,929.47	0.13
28	123149	通裕转债	1,606,359.78	0.13
29	123146	中环转2	1,537,370.51	0.12
30	118016	京源转债	1,526,829.84	0.12
31	127016	鲁泰转债	1,526,480.01	0.12
32	123063	大禹转债	1,455,283.94	0.12

33	110073	国投转债	1,387,466.60	0.11
34	113048	晶科转债	1,380,625.64	0.11
35	113044	大秦转债	1,357,258.88	0.11
36	128042	凯中转债	1,323,787.90	0.11
37	127040	国泰转债	1,317,636.04	0.11
38	113017	吉视转债	1,301,898.25	0.10
39	127039	北港转债	1,281,519.53	0.10
40	113058	友发转债	938,403.40	0.07
41	127060	湘佳转债	898,431.48	0.07
42	113565	宏辉转债	852,442.49	0.07
43	127034	绿茵转债	720,122.54	0.06
44	113535	大业转债	648,149.34	0.05
45	123076	强力转债	642,914.53	0.05
46	113524	奇精转债	640,779.08	0.05
47	110060	天路转债	636,088.97	0.05
48	127061	美锦转债	624,551.83	0.05
49	113618	美诺转债	622,296.75	0.05
50	113628	晨丰转债	398,700.00	0.03
51	127033	中装转2	385,961.62	0.03
52	110057	现代转债	373,146.80	0.03
53	113604	多伦转债	280,167.15	0.02
54	127046	百润转债	256,683.40	0.02
55	127067	恒逸转2	256,300.52	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

报告期期初基金份额总额	856,072,992.63
报告期期间基金总申购份额	339,130,553.81
减：报告期期间基金总赎回份额	160,684,423.17
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	1,034,519,123.27

§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

1、2023 年 01 月 20 日，在《上海证券报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金 2022 年第四季度报告；

2、2023 年 02 月 10 日，在《上海证券报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

3、2023 年 02 月 22 日，在《上海证券报》和 www.jysa99.com 上公布关于金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金在部分代销机构开展赎回费率优惠活动的公告；

4、2023 年 03 月 14 日，在《上海证券报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加中泰证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

5、2023 年 03 月 15 日，在《上海证券报》和 www.jysa99.com 上公布关于金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金在部分代销机构开展赎回费率优惠活动的公告；

6、2023 年 03 月 20 日，在《上海证券报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加国融证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

7、2023 年 03 月 21 日，在《上海证券报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安丰祥债券型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）公告；

8、2023 年 03 月 25 日，在《上海证券报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安丰祥债券型证券投资基金分红公告；

9、2023 年 03 月 30 日，在《上海证券报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安丰祥债券型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）公告；

10、2023 年 03 月 31 日，在《上海证券报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金 2022 年度报告。

§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

2023 年 04 月 22 日