金元顺安丰利债券型证券投资基金

2026年第3季度报告

2026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:2026年10月27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 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 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 10
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 10
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 11
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 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 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 14
§9 备查文件目录 14
9.1 备查文件目录 14
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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月26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2026年07月01日起至2026年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金元顺安丰利债券
基金主代码	620003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年03月23日
报告期末基金份额总额	466,160,548.12份
投资目标	在注重资产安全性和流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的稳健收益和总回报。
投资策略	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，将采用若干定量模型来对宏观和市场两方面数据进行分析，并运用适当的策略来构建债券组合。本基金采用的投资策略包括：1、债券投资主要定量模型；2、债券投资主要策略；3、债券选择；4、存托凭证投资策略；5、现金管理
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金属于债券型基金，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。	
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	金元顺安丰利债券A	金元顺安丰利债券C
下属分级基金的交易代码	620003	020499
报告期末下属分级基金的份额总额	175,744,996.95份	290,415,551.17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(2026年07月01日 - 2026年09月30日)	
	金元顺安丰利债券A	金元顺安丰利债券C
1.本期已实现收益	-4,909,662.72	-8,181,963.54
2.本期利润	-2,838,530.38	-4,790,166.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0161	-0.0165
4.期末基金资产净值	180,082,976.38	294,431,609.11
5.期末基金份额净值	1.0247	1.0138

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

金元顺安丰利债券A净值表现

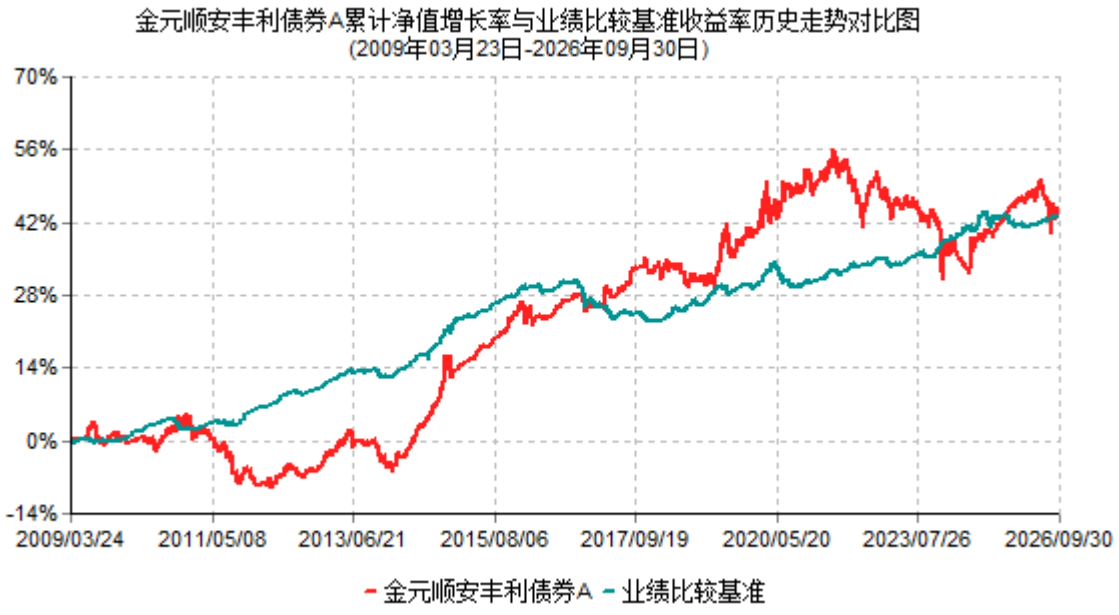
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.55%	0.49%	0.52%	0.03%	-2.07%	0.46%
过去六个月	-2.65%	0.38%	1.15%	0.03%	-3.80%	0.35%

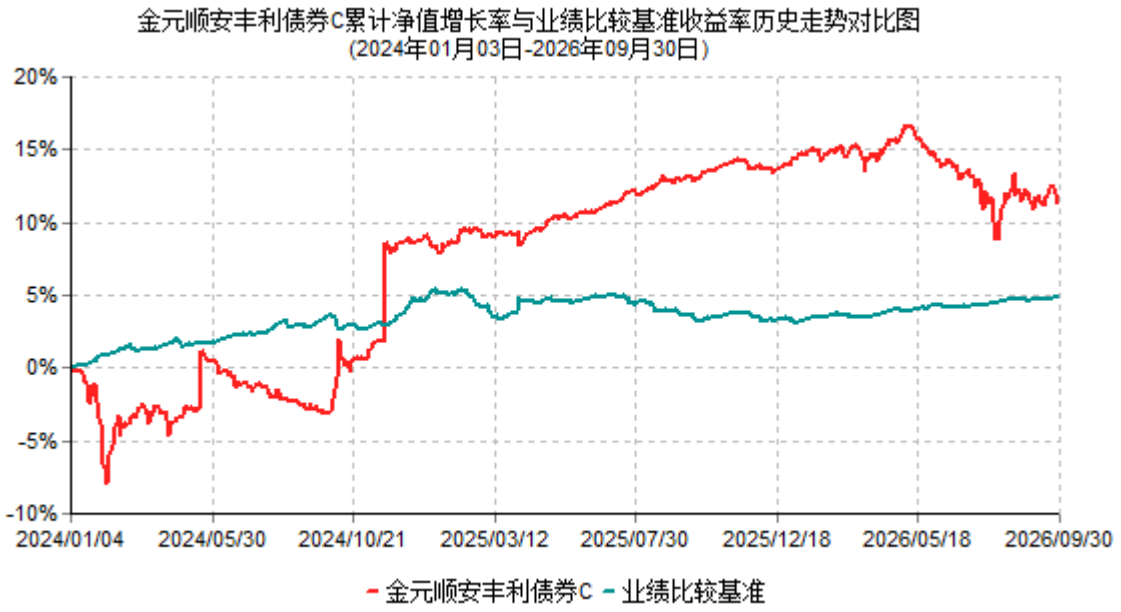
过去一年	-1.45%	0.30%	1.48%	0.04%	-2.93%	0.26%
过去三年	0.29%	0.30%	5.66%	0.07%	-5.37%	0.23%
过去五年	-5.70%	0.29%	8.15%	0.07%	-13.85%	0.22%
过去七年	2.91%	0.31%	10.36%	0.07%	-7.45%	0.24%
过去十年	12.66%	0.30%	9.90%	0.07%	2.76%	0.23%
自基金合同生效起至今	43.40%	0.29%	43.29%	0.07%	0.11%	0.22%

金元顺安丰利债券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	-1.60%	0.50%	0.52%	0.03%	-2.12%	0.47%
过去六个月	-2.75%	0.39%	1.15%	0.03%	-3.90%	0.36%
过去一年	-1.65%	0.30%	1.48%	0.04%	-3.13%	0.26%
自基金合同生效起至今	11.13%	0.42%	4.81%	0.08%	6.32%	0.34%

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





注：
1、本基金合同生效日为 2009 年 03 月 23 日，业绩基准累计增长率以 2009 年 03 月 22 日指数为基准。
2、本基金于 2024 年 1 月 3 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	-	14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、金元顺安沣楹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助理分析师，上海证券有限责任

					有限公司项目经理。2014年8月加入金元顺安基金管理有限公司，历任金元顺安沣顺定期开放债券型发起式证券投资基金和金元顺安沣泉债券型证券投资基金的基金经理。14年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。
庄江林	本基金基金经理	2025-12-12	-	10年	金元顺安丰祥债券型证券投资基金和金元顺安丰利债券型证券投资基金的基金经理，上海财经大学金融硕士。曾任厦门国际银行股份有限公司固定收益交易员、历任我司混合投资部基金经理助理、交易部交易高级专员，2017年12月加入金元顺安基金管理有限公司。10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

三季度国内经济延续供强需弱，外需强内需弱的分化表现。政策端以落实存量政策为主。央行增加隔夜回购操作频率，资金面波动较小。债券供给持续低于预期，本季度债市震荡走强，超长端表现强势，9月中下旬以来市场对公积金降息预期增强。海外地缘冲突不断，油价冲高，美国通胀压力大，美联储进行三年以来首次加息，全球债券收益率不断冲高。权益方面，科技股三季度出现大幅调整，红利和小市值板块表现占优。

报告期内，基金重点配置了中高等级信用债，合理控制权益仓位，结构上均衡配置为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安丰利债券A基金份额净值为1.0247元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.55%，同期业绩比较基准收益率为0.52%；截至报告期末金元顺安丰利债券C基金份额净值为1.0138元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.60%，同期业绩比较基准收益率为0.52%。

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	83,413,677.56	14.16
	其中：股票	83,413,677.56	14.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	499,973,684.28	84.86
	其中：债券	499,973,684.28	84.86
	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	5,354,622.37	0.91
8	其他资产	429,721.38	0.07
9	合计	589,171,705.59	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	1,910,194.00	0.40
B	采矿业	-	-
C	制造业	59,859,984.17	12.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	971,836.00	0.20
E	建筑业	2,449,292.00	0.52
F	批发和零售业	5,195,039.00	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	969,296.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,810,768.39	1.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,495,690.00	0.32
L	租赁和商务服务业	954,890.00	0.20

M	科学研究和技术服务业	2,412,894.00	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	1,420,704.00	0.30
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	963,090.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	83,413,677.56	17.58

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	300308	中际旭创	2,400	1,940,256.00	0.41
2	603031	安孚科技	52,100	1,910,507.00	0.40
3	002463	沪电股份	16,000	1,854,880.00	0.39
4	002008	大族激光	20,200	1,616,606.00	0.34
5	600498	烽火通信	45,100	1,610,070.00	0.34
6	002475	立讯精密	32,000	1,581,760.00	0.33
7	688627	精智达	3,649	1,542,797.20	0.33
8	002821	凯莱英	8,100	1,527,822.00	0.32
9	688766	普冉股份	4,176	1,489,328.64	0.31
10	603986	兆易创新	4,100	1,450,990.00	0.31

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	50,602,508.50	10.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	287,374,168.76	60.56

	其中：政策性金融债	50,637,167.12	10.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	153,076,882.74	32.26
7	可转债（可交换债）	8,920,124.28	1.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	499,973,684.28	105.37

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	092280108	22中行二级资本债02A	300,000	31,326,156.16	6.60
2	232380021	23浙商银行二级资本债01	300,000	31,296,205.48	6.60
3	092280021	22上海农商行二级资本债02	300,000	30,644,261.92	6.46
4	092280080	22光大银行二级资本债01A	300,000	30,514,265.75	6.43
5	019827	26国债01	300,000	30,259,709.59	6.38

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、宁波银行（002142.SZ）

2025年11月14日，因宁波银行股份有限公司违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定。中国人民银行对宁波银行股份有限公司处罚款 98.8 万元。

本基金管理人做出说明如下：

（1）投资决策程序:通过对公司的基本面进行分析，认为公司发展经营良好，公司盈利能力稳定，偿债能力足够;

（2）宁波银行因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定受到罚款处罚。事项对公司整体影响较小，且公司为城商大行，基本面良好，因此继续持有该公司债券。

2、22中行二级资本债02A（092280108.IB）

2025年10月31日，因相关公司治理、贷款、同业、票据、资产质量、不良资产处置等业务管理不审慎，金融监管总局对中国银行股份有限公司罚款9790万元。

本基金管理人做出说明如下：

（1）投资决策程序:通过对公司的基本面进行分析，认为公司发展经营良好，公司盈利能力稳定，偿债能力足够;

（2）中国银行因相关公司治理、贷款、同业、票据、资产质量、不良资产处置等业务管理不审慎事项受到罚款处罚。事项对公司整体影响较小，且公司为国有大行，基本面良好，因此继续持有该公司债券。

5.11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)

1	存出保证金	64,318.03
2	应收证券清算款	364,413.38
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	989.97
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	429,721.38

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	113052	兴业转债	6,134,433.22	1.29
2	127045	牧原转债	948,057.73	0.20
3	118034	晶能转债	925,513.42	0.20
4	127049	希望转2	912,119.91	0.19

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

	金元顺安丰利债券A	金元顺安丰利债券C
报告期期初基金份额总额	176,059,565.22	290,894,888.02
报告期期间基金总申购份额	22,356.72	117,812.52
减：报告期期间基金总赎回份额	336,924.99	597,149.37
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	175,744,996.95	290,415,551.17

§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	2026年07月01日 - 2026年09月30日	289,379,762.71	-	-	289,379,762.71	62.08%
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利债券型证券投资基金募集注册的文件；

2、《金元顺安丰利债券型证券投资基金基金合同》；

3、《金元顺安丰利债券型证券投资基金基金招募说明书》；

4、《金元顺安丰利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利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）自由贸易试验区滨江大道1655弄7号9层908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、021-68882865。

金元顺安基金管理有限公司

2026年10月27日