

# **国元元赢四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:招商银行股份有限公司**

**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。

集合计划托管人招商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，但不保证基金一定盈利。

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	国元元赢四个月定开债
基金主代码	970070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年10月28日
报告期末基金份额总额	906,603,217.77份
投资目标	在追求资产安全性的基础上，力争满足客户对于短期固定周期的资金配置和保值增值的需求。
投资策略	一、本集合计划债券资产的投资比例不低于集合计划资产的80%，但在开放期开始前10个工作日、开放期以及开放期结束后的10个工作日内，本集合计划债券资产的投资比例不受上述比例限制。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%。开放期内，本集合计划持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资

	比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。 二、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、个券选择策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。
业绩比较基准	中债新综合财富(1-3年)指数（代码：CBA00121.CS）收益率*85%+一年期定期存款利率*15%。
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	招商银行股份有限公司

### §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	7,808,853.59
2.本期利润	9,539,064.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0113
4.期末基金资产净值	978,282,833.02
5.期末基金份额净值	1.0791

#### 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	1.08%	0.02%	0.52%	0.02%	0.56%	0.00%
过去六个月	2.35%	0.02%	1.60%	0.02%	0.75%	0.00%
过去一年	3.50%	0.04%	2.43%	0.03%	1.07%	0.01%

自基金合同生效起至今	8.42%	0.04%	5.80%	0.03%	2.62%	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

国元元赢四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

(2021年10月28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		
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，现任国元元赢六个月定开债、国元元赢四个月定开债基金经理。
李雅婷	大集合产品投资经理	2019-11-08	-	13	南开大学金融学硕士。曾任职于中国工商银行安徽省

					分行营业部，2012年8月加入国元证券资管总部，历任投资助理，现任国元元赢30天持有期债、国元元赢四个月定开债、国元元增利货币基金经理。
--	--	--	--	--	--

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

管理人声明：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》等有关法律法规及集合计划合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、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，本公司严格执行了《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》的规定。

### 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

**债市回顾：**3季度，债券市场先扬后抑。2季度，国内GDP同比增长6.3%，上半年同比增长5.5%。7月政治局会议对下半年经济增长表态积极，特别是对地产政策较之前删除“房住不炒”，宽信用预期重启。8月央行下调OMO、MLF等政策利率，9月下旬存款准备金率，但收益率并未选择下行，而是在活跃资本市场、认房不认贷、存量房贷利率下调、加快专项债发行使用等一系列宽信用政策的扰动下一路走高。十年国债收益率3季度上行11.76BP至2.6751%。

**转债市场回顾：**3季度受经济恢复不及预期和人民币汇率波动等因素影响，股票市场震荡下行，万得全A3季度下跌4.33%，中证转债3季度微跌0.52%，转债市场抗跌性凸显。

**组合操作：**3季度我们继续严格遵照产品合同的相关约定，优化资产配置结构，提高组合收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国元元赢四个月定开债基金份额净值为1.0791元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.08%，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

报告期末持有人数为4318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	975,927,300.68	98.56
	其中：债券	975,927,300.68	98.56
	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	9,247,250.74	0.93
8	其他资产	5,011,438.50	0.51
9	合计	990,185,989.92	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

本集合计划本报告期末未持有股票资产。

##### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有股票资产。

#### 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资产。

#### 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	30,958,360.66	3.16
	其中：政策性金融债	30,958,360.66	3.16
4	企业债券	603,639,931.05	61.70
5	企业短期融资券	125,866,681.85	12.87
6	中期票据	152,233,727.82	15.56
7	可转债（可交换债）	33,799,625.94	3.45
8	同业存单	29,428,973.36	3.01
9	其他	-	-
10	合计	975,927,300.68	99.76

#### 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	152629	20吉凤01	530,000	56,063,385.48	5.73
2	184097	21六安债	400,000	42,913,632.88	4.39
3	102100914	21临汾投资MTN002	400,000	41,313,092.90	4.22
4	102100365	21扬州化工MTN002	400,000	41,301,136.61	4.22
5	042200025	22通泰CP001	300,000	31,852,479.45	3.26

#### 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

本集合计划不参与股指期货投资。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本集合计划不参与国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

**5.11.1** 根据管理人现有舆情系统监控，未发现本集合计划投资的其他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。

**5.11.2** 本集合计划本报告期末未持有股票资产。

## 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,438.50
2	应收证券清算款	5,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,011,438.50

## 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	132026	G三峡EB2	7,875,949.75	0.81
2	113052	XD兴业转	5,359,930.51	0.55
3	110088	XD淮22转	5,275,049.25	0.54
4	113044	大秦转债	5,262,855.53	0.54
5	127006	敖东转债	1,646,909.52	0.17
6	113066	N平煤转	1,332,649.93	0.14
7	110059	浦发转债	1,305,775.89	0.13
8	110075	南航转债	1,262,969.86	0.13

9	113059	福莱转债	1,089,972.21	0.11
10	113050	XD南银转	824,449.14	0.08
11	127025	冀东转债	769,747.94	0.08
12	113037	N紫银转	582,203.63	0.06
13	113042	上银转债	490,784.79	0.05
14	113057	中银转债	266,998.63	0.03
15	127017	万青转债	225,946.30	0.02
16	123101	拓斯转债	116,901.64	0.01
17	113033	利群转债	110,531.42	0.01

### 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资产。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	811,848,487.24
报告期期间基金总申购份额	199,657,739.33
减：报告期期间基金总赎回份额	104,903,008.80
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	906,603,217.77

## §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集合计划的情况。

## §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
机构	1	20230701-20230930	190,185,749.05	0.00	0.00	190,185,749.05

## §9 备查文件目录

## 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、国元元赢四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四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。

## 9.2 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

## 9.3 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。

客户服务电话：95578

网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

国元证券股份有限公司

2023年10月25日