

## 金元顺安金通宝货币市场基金

### 2018年第四季度报告

1. 本基金合同生效日为2017年01月20日, 业绩比较收益率为2017年01月19日为基准。

2. 本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具, 包括现金, 期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单, 剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券, 以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具;

3. 本基金业绩比较基准为“同期7天通知存款利率(税后)”,

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	3.30
其中: 买断式回购融资	-	-	-
2	报告期内债券正回购融资余额	104,749,522.07	0.44
其中: 买断式回购融资	-	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值20%。

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期内投资组合平均剩余期限	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	68
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	32

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

序号	平均剩余期限	报告期内资产基金资产净值比例(%)	报告期内负债基金资产净值比例(%)
1	30天以内	40.56	0.44
2	其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率	-	-
3	30天(含)-60天	41.33	-
其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率	-	-	-
3	60天(含)-90天	12.89	-
其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率	-	-	-
4	90天(含)-120天	2.69	-
其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率	-	-	-
5	120天(含)-397天(含)	7.80	-
其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率	-	-	-
合计	106.17	0.44	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	240,561,811.56	12.48
其中: 政策性金融债	-	240,561,811.56	12.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,303,909,161.27	67.67
8	其他	-	-
9	合计	1,544,470,962.82	80.16
10	其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1119516	18民生银行CD596	2,000,000	109,115,562.00	10.33
2	1119803	18中管银行CD399	2,000,000	138,596,561.21	10.32
3	1119163	18上海银行CD370	1,000,000	98,946,666.86	5.19
4	1119133	18恒丰银行CD313	1,000,000	99,798,983.73	5.18
5	1119194	18恒丰银行CD340	1,000,000	99,744,609.65	5.18
6	1119213	18渤海银行CD340	1,000,000	99,727,715.70	5.18
7	1119166	18兴业银行CD663	1,000,000	99,512,626.11	5.17
8	1119182	18民生银行CD303	1,000,000	99,453,403.79	5.16
9	1119182	18华夏银行CD235	1,000,000	99,453,403.79	5.16
10	1119106	18民生银行CD616	1,000,000	99,222,258.43	5.15

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0.0007%
报告期内偏离度的最高值	-0.0367%
报告期内偏离度的最低值	0.0319%

报告期内偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内无偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内无偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”, 即估值对象以买入成本列示, 按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价, 在剩余存续期内平均摊销, 每日计提损益。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,998,841.78
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	5,998,841.78

5.9.4 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。

5.9 开放式基金份额变动

项目	金通宝货币A类	金通宝货币B类
报告期期初基金份额总额	1,463,670.21	2,486,767,623.86
报告期内基金总申购份额	142,002.44	2,401,494,262.89
减: 报告期内基金总赎回份额	312,327.29	3,061,676,560.00
报告期期末基金份额总额	1,293,345.32	1,926,585,344.75

5.9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	交易方式	交易日期(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2018-10-08	6,140.69	6,140.69
2	赎回证券清算款	2018-10-09	610.72	610.72
3	红利再投	2018-10-10	596.02	596.02
4	红利再投	2018-10-11	573.26	573.26
5	红利再投	2018-10-12	574.06	574.06
6	红利再投	2018-10-15	1,712.96	1,712.96
7	红利再投	2018-10-16	561.97	561.97
8	红利再投	2018-10-17	561.81	561.81
9	红利再投	2018-10-18	563.71	563.71
10	红利再投	2018-10-19	567.86	567.86
11	红利再投	2018-10-22	1,672.20	1,672.20
12	红利再投	2018-10-23	565.50	565.50
13	红利再投	2018-10-24	547.50	547.50
14	红利再投	2018-10-25	554.31	554.31
15	红利再投	2018-10-26	566.31	566.31
16	红利再投	2018-10-29	1,597.28	1,597.28
17	红利再投	2018-10-30	527.16	527.16
18	红利再投	2018-10-31	542.33	542.33
19	红利再投	2018-11-01	546.56	546.56
20	红利再投	2018-11-02	550.99	550.99
21	红利再投	2018-11-05	1,677.24	1,677.24
22	红利再投	2018-11-06	559.34	559.34
23	红利再投	2018-11-07	547.14	547.14
24	红利再投	2018-11-08	550.83	550.83
25	红利再投	2018-11-09	636.74	636.74
26	红利再投	2018-11-12	1,925.36	1,925.36
27	红利再投	2018-11-13	556.61	556.61
28	赎回	2018-11-14	5,000,000.00	5,000,341.91
29	红利再投	2018-11-14	212.56	212.56
30	红利再投	2018-11-15	213.15	213.15
31	红利再投	2018-11-16	213.28	213.28
32	红利再投	2018-11-19	642.27	642.27
33	红利再投	2018-11-20	212.39	212.39
34	红利再投	2018-11-21	208.72	208.72
35	红利再投	2018-11-22	216.84	216.84
36	红利再投	2018-11-23	219.10	219.10
37	红利再投	2018-11-26	670.49	670.49

38	红利再投	2018-11-27	220.78	220.78	-
39	红利再投	2018-11-28	219.42	219.42	-
40	红利再投	2018-11-29	224.27	224.27	-
41	红利再投	2018-11-30	221.22	221.22	-
42	红利再投	2018-12-03	666.34	666.34	-
43	红利再投	2018-12-04	223.66	223.66	-
44	红利再投	2018-12-06	222.34	222.34	-
45	红利再投	2018-12-06	220.44	220.44	-
46	红利再投	2018-12-07	216.33	216.33	-
47	红利再投	2018-12-10	653.67	653.67	-
48	红利再投	2018-12-11	218.17	218.17	-
49	红利再投	2018-12-12	218.22	218.22	-
50	红利再投	2018-12-13	217.36	217.36	-
51	红利再投	2018-12-14	219.70	219.70	-
52	红利再投	2018-12-17	663.24	663.24	-
53	红利再投	2018-12-18	221.63	221.63	-
54	红利再投	2018-12-19	226.38	226.38	-
55	红利再投	2018-12-20	238.06	238.06	-
56	红利再投	2018-12-21	167.07	167.07	-
57	红利再投	2018-12-24	726.00	726.00	-
58	红利再投	2018-12-25	190.59	190.59	-
59	赎回	2018-12-26	3,117,562.20	3,117,860.84	-
合计	-	-	8,153,312.60	8,153,953.06	-

8.1 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	持有基金份额比例达到或超过20%的期间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构投资者1	2018年10月01日至2018年12月20日	742,680,312.32	254,657,423.00	258,000,000.00	739,538,736.32	38.38%

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

8.2 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

序号	交易方式	交易日期(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2018-10-08	6,140.69	6,140.69
2	赎回证券清算款	2018-10-09	610.72	610.72
3	红利再投	2018-10-10	596.02	596.02
4	红利再投	2018-10-11	573.26	573.26
5	红利再投	2018-10-12	574.06	574.06
6	红利再投	2018-10-15	1,712.96	1,712.96
7	红利再投	2018-10-16	561.97	561.97
8	红利再投	2018-10-17	561.81	561.81
9	红利再投	2018-10-18	563.71	563.71
10	红利再投	2018-10-19	567.86	567.86
11	红利再投	2018-10-22	1,672.20	1,672.20
12	红利再投	2018-10-23	565.50	565.50
13	红利再投	2018-10-24	547.50	547.50
14	红利再投	2018-10-25	554.31	554.31
15	红利再投	2018-10-26	566.31	566.31
16	红利再投	2018-10-29	1,597.28	1,597.28
17	红利再投	2018-10-30	527.16	527.16
18	红利再投	2018-10-31	542.33	542.33
19	红利再投	2018-11-01	546.56	546.56
20	红利再投	2018-11-02	550.99	550.99
21	红利再投	2018-11-05	1,677.24	1,677.24
22	红利再投	2018-11-06	559.34	559.34
23	红利再投	2018-11-07	547.14	547.14
24	红利再投	2018-11-08	550.83	550.83
25	红利再投	2018-11-09	636.74	636.74
26	红利再投	2018-11-12	1,925.36	1,925.36
27	红利再投	2018-11-13	556.61	556.61
28	赎回	2018-11-14	5,000,000.00	5,000,341.91
29	红利再投	2018-11-14	212.56	212.56
30	红利再投	2018-11-15	213.15	213.15
31	红利再投	2018-11-16	213.28	213.28
32	红利再投	2018-11-19	642.27	642.27
33	红利再投	2018-11-20	212.39	212.39
34	红利再投	2018-11-21	208.72	208.72
35	红利再投	2018-11-22	216.84	216.84
36	红利再投	2018-11-23	219.10	219.10
37	红利再投	2018-11-26	670.49	670.49

8.3 影响投资者决策的其他重要信息

8.3 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

序号	交易方式	交易日期(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2018-10-08	6,140.69	6,140.69
2	赎回证券清算款	2018-10-09	610.72	610.72
3	红利再投	2018-10-10	596.02	596.02
4	红利再投	2018-10-11	573.26	573.26
5	红利再投	2018-10-12	574.06	574.06
6	红利再投	2018-10-15	1,712.96	1,712.96
7	红利再投	2018-10-16	561.97	561.97
8	红利再投	2018-10-17	561.81	561.81
9	红利再投	2018-10-18	563.71	563.71
10	红利再投	2018-10-19	567.86	567.86
11	红利再投	2018-10-22	1,672.20	1,672.20
12	红利再投	2018-10-23	565.50	565.50
13	红利再投	2018-10-24	547.50	547.50
14	红利再投	2018-10-25	554.31	554.31
15	红利再投	2018-10-26	566.31	566.31
16	红利再投	2018-10-29	1,597.28	1,597.28
17	红利再投	2018-10-30	527.16	527.16
18	红利再投	2018-10-31	542.33	542.33
19	红利再投	2018-11-01	546.56	546.56