
金元顺安核心动力混合型证券投资基金
2015 年年度报告
2015 年 12 月 31 日

基金管理人：金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管
理有限公司”）

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
§ 2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1	主要会计数据和财务指标	5
3.2	基金净值表现	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9	基金持有人数或资产净值预警情形的说明	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6	审计报告	15
6.1	审计报告基本信息	15
6.2	审计报告的基本内容	15
§ 7	年度财务报表	16
7.1	资产负债表	16
7.2	利润表	18
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4	报表附注	20
§ 8	投资组合报告	43
8.1	期末基金资产组合情况	43
8.2	期末按行业分类的股票投资组合	43
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	47
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	49
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	49
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	49
8.8	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贵金属投资明细	49

8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	50
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
8.12	投资组合报告附注	50
§ 9	基金份额持有人信息	53
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§ 10	开放式基金份额变动	54
§ 11	重大事件揭示	54
11.1	基金份额持有人大会决议	54
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	54
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
11.4	基金投资策略的改变	54
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
11.8	其他重大事件	57
§ 12	备查文件目录	59
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	59
12.3	查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金元顺安核心动力混合型证券投资基金
基金简称	金元顺安核心动力混合
基金主代码	620005
交易代码	620005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月11日
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”）
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	29,686,267.36份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过运用“核心-卫星”股票投资策略，将大部分基金资产用于完全复制大型上市公司股票指数（中证100指数）的业绩表现，并将部分资产投资于中证100指数以外的具备良好成长潜力且价值被低估的上市公司股票，在控制组合风险的前提下，追求基金资产中长期的稳定增值。
投资策略	本基金的资产配置策略分为两个层次：第一层为大类资产配置策略，以确定基金资产在股票、债券和现金之间的比例；第二层以“核心-卫星”策略作为基金股票资产的配置策略。本基金的股票投资组合由“核心组合”和“卫星组合”两部分构成：核心组合采取被动投资方法，原则上对反映大市值股票走势的基准指数——中证100指数——采用完全复制法，按照成份股在该指数中的基准权重构建指数化投资组合。核心组合的市值介于股票资产的60%-100%。卫星组合采取自下而上的方法精选中证100指数以外的具备良好成长潜力且价值被低估的上市公司股票，以期获得成长企业的估值溢价。卫星组合的市值介于股票资产的0%-40%。本基金的债券投资组合以具票息优势的债券作为主要投资对象，并通过对债券的信用、久期和凸性等灵活配置，进行相对积极主动的操作，力争获取超越债券基准的收益。
业绩比较基准	中证100指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其风险收益特征从长期平均及预期来看，低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”）	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	凌有法	洪渊
	联系电话	021-68882815	010-66105799
	电子邮箱	service@jyvpfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68881801	95588
传真		021-68881875	010—66105798
注册地址		上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦3608	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦3608	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		任开宇	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.jyvpfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
注册登记机构	金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”）	上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	21,730,296.57	9,314,999.71	5,647,129.01
本期利润	8,387,796.29	27,583,791.79	293,278.18
加权平均基金份额本期利	0.2076	0.3375	0.0041

润			
本期加权平均净值利润率	17.13%	46.35%	0.56%
本期基金份额净值增长率	5.80%	53.77%	-0.55%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	5,517,539.18	3,108,830.40	-20,108,559.27
期末可供分配基金份额利润	0.1859	0.0414	-0.2712
期末基金资产净值	35,203,806.54	84,158,470.96	54,026,069.77
期末基金份额净值	1.186	1.121	0.729
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	18.60%	12.10%	-27.10%

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 12 月 31 日。

4：所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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	12.10%	1.43%	11.93%	1.27%	0.17%	0.16%
过去六个月	-13.68%	2.14%	-11.83%	2.07%	-1.85%	0.07%
过去一年	5.80%	2.15%	0.87%	1.97%	4.93%	0.18%
过去三年	61.80%	1.60%	32.52%	1.46%	29.28%	0.14%
过去五年	19.92%	1.40%	20.41%	1.30%	-0.49%	0.10%
自基金合同生效起至今	18.60%	1.37%	12.12%	1.29%	6.48%	0.08%

注：（1）本基金选择中证 100 指数作为股票投资部分的业绩基准，选择中国债券总指数作为债券投资部分的业绩基准，复合业绩比较基准为：中证 100 指数*80%+ 中国债券总指数收益率*20%；

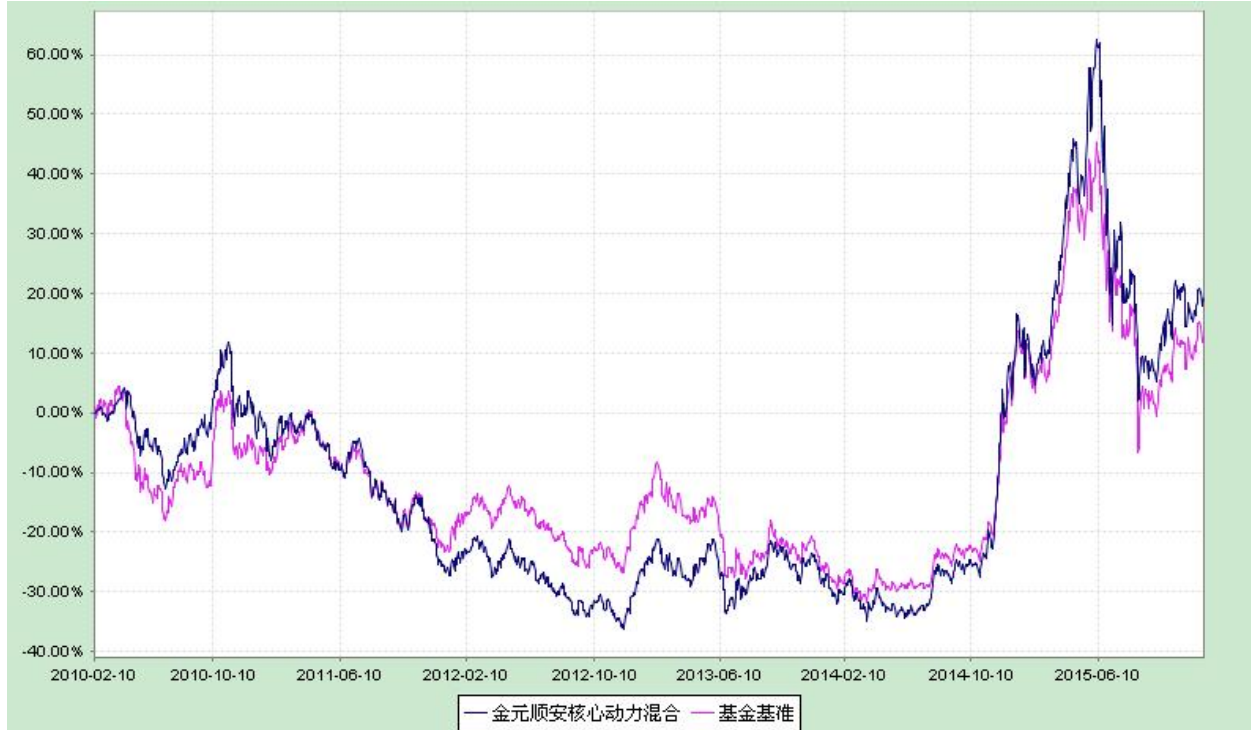
（2）本基金合同生效日为 2010 年 2 月 11 日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

金元顺安核心动力混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年2月11日至2015年12月31日)



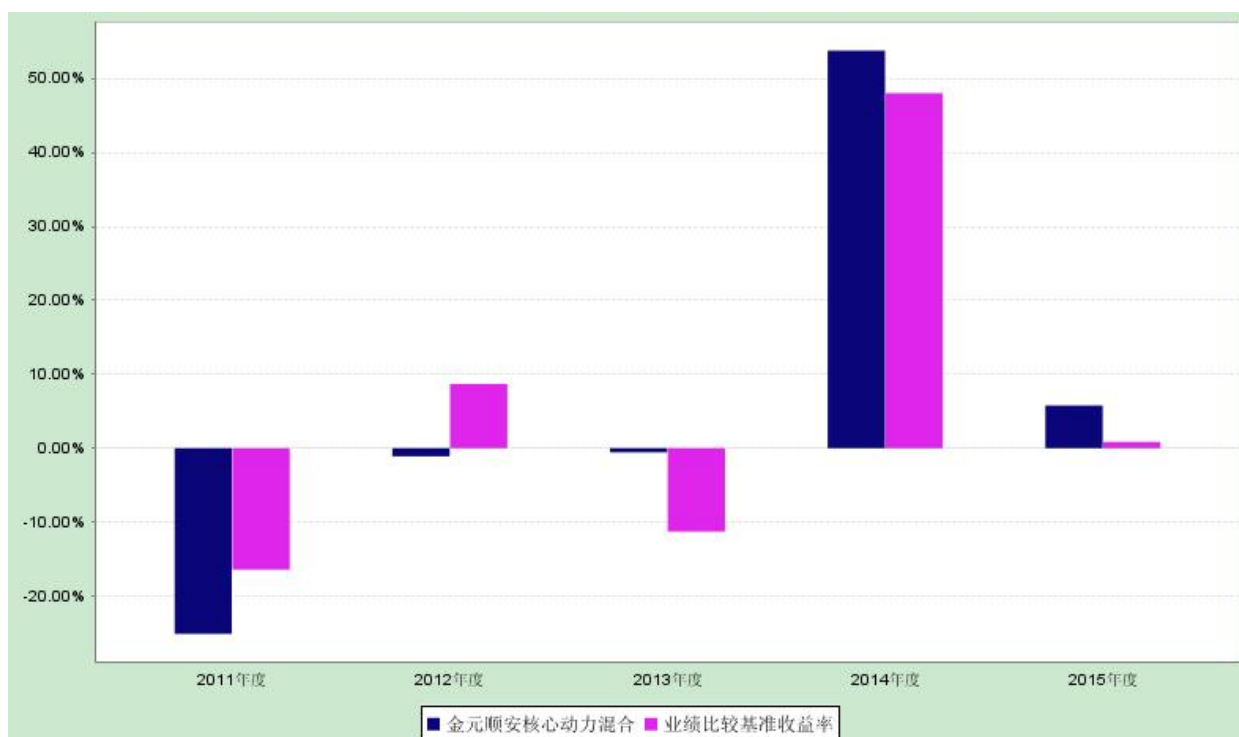
注：(1) 本基金合同生效日为2010年2月11日；

(2) 股票资产占基金资产的60%–95%，其中，核心组合完全复制中证100指数，投资比例为股票资产的60%–100%；卫星组合则以中证100指数以外的具备良好成长潜力且价值被低估的上市公司股票为标的，投资比例为股票资产的0%–40%。债券资产、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%–40%，其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%；本基金建仓期为2010年2月11日至2010年8月10日，在建仓期末和本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金元顺安核心动力混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：（1）本基金选择中证 100 指数作为股票投资部分的业绩基准，选择中国债券总指数作为债券投资部分的业绩基准，复合业绩比较基准为：中证 100 指数*80% + 中国债券总指数收益率*20%；

（2）本基金合同生效日为 2010 年 2 月 11 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年内未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”）成立于 2006 年 11 月，由金元证券有限公司（以下简称“金元证券”）与比利时联合资产管理公司（以下简称“KBC”）共同发起设立的中外合资基金管理公司。公司注册地为上海，注册资本 1.5 亿人民币，其中金元证券持有 51% 的股份，KBC 持有 49% 的股份。2012 年 3 月，经中国证监会核准，KBC 将所持有的 49% 股权转让惠理基金管理香港有限公司（以下简称“惠理香港”），公司更名为金元惠理基金管理有限公司，成为国内首家港资入股的合资基金公司，股权结构变更为：金元证券持有 51% 股权，惠理香港持有 49% 股权。2012 年 10 月，经中国证监会核准，公司双方股东按持股比例向公司增资人民币 9,500 万元，公司注册资本金

增至 24,500 万元。

截至 2015 年 12 月 31 日本基金管理人管理金元顺安宝石动力混合型证券投资基金、金元顺安成长动力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、金元顺安价值增长混合型投资基金、金元顺安核心动力混合型投资基金、金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金、金元顺安新经济主题混合型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金和金元顺安金元宝货币市场基金金共十只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
晏斌	本基金基金经理	2013-01-18	2015-05-08	12	金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安新经济主题混合型证券投资基金、金元顺安宝石动力混合型证券投资基金和金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，香港中文大学工商管理硕士。曾任招商基金管理有限公司行业研究员，上海惠理投资管理咨询有限公司副基金经理等。2012 年 12 月加入本公司任投资副总监，历任金元顺安核心动力股票型证券投资基金和金元顺安价值增长股票型证券投资基金基金经理。12 年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。
林材	本基金基金经理	2015-05-08	2015-07-10	9	金元顺安核心动力混合型证券投资基金和金元顺安价值增长混合型证券投资基金基金经理，中科院、贵州大学理学硕士。曾任民生加银基金管理有限公司基金经理助理，德邦证券医药行业核心分析师，上海医药工业研究院行业研究员等。2011 年 10 月加入本公司，历任高级行业研究员。9 年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。
侯斌	本基金基金经理	2015-07-03	-	13	金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安宝

	理				石动力混合型证券投资基金、金元顺安核心动力混合型证券投资基金和金元顺安价值增长混合型证券投资基金基金经理,上海财经大学经济学学士。曾任光大保德信基金管理有限公司行业研究员。2010年6月加入本公司,历任高级行业研究员,金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理和金元顺安核心动力股票型证券投资基金基金经理助理等职位。13年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合规守信情况的说明

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》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》、《金元惠理核心动力股票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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起了《金元惠理基金管理有限公司公平交易管理制度》,涵盖了各投资组合、投资市场、投资标的的公平交易制度规范,贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程,并通过分析报告、监控、稽核的方式保证制度流程的有效执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期,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》,通过科学完善的

制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、股票备选库管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等，重视交易执行环节的公平交易措施，启用投资交易系统内的公平交易模块，以确保公平对待各投资组合。在报告期内，本管理人对不同投资组合的交易价差、收益率进行分析，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《异常交易监控与报告制度》的规定，对交易进行了监控，未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金一直按照基金合约要求，采取稳健的投资策略，争取为基金投资者取得较好收益。由于合约规定有大部分资产必需完全拟合中证 100 成分股，但我们还是采取“自下而上”的精选个股方法，在剩余资产中配置一些优质个股，使基金业绩跑赢基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期，本基金份额净值增长率为 5.80%，业绩比较基准收益率为 0.87%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年中国经济，我们判断 2016 年的经济环境会更加复杂，国内面临供给过剩、需求不足，旧经济模式较过去更为困顿，中国经济转型仍在进行中，新旧经济之间的转换由于体量上的不匹配，使得整体经济仍然处于重心下移阶段。中长期来看，中国经济必然也必须转型成功，但短期阵痛无法避免，而在 2016 年将尤为突出。从国外经济来看，美国进入加息周期，这对全球新兴市场都将产生深远影响，全球货币可能回流美国，但从整体全球经济来看，整体需求不足，经济下滑，也对中国外需带来负面影响。再看国内流动性的因素，国内货币继续大幅宽松的空间不大，而美元升值，资金流出，将加剧国内流动性紧张，年内应该有一次以上降准，但我们判断流动性较 2015 年紧张。

重点优选超跌个股、业绩超预期和消费类稳定增长类公司进行投资。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2015 年度，本基金管理人仍把规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益作为工作的基点，进一步完善内部控制制度和流程体系，推动各项法规、内控体系和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、定期检查、报表揭示、专项

检查、人员询问等方法，独立地开展公司的监察稽核工作，并就在监察稽核过程中发现的问题，及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。本期内，重点开展的监察稽核工作包括：

1、依据相关法律、法规和公司实际运作情况，修订和完善公司各项内部管理制度，特别是对公司各部门的业务操作流程进行了梳理和修订，为保障基金份额持有人的利益，保障公司的规范运作提供制度保障。

2、开展对公司各项业务的日常监察稽核工作，查找公司各项业务中的风险漏洞，保证公司各项业务的合规运作，重点加强了对于各业务环节的专项稽核。

3、加强对公司营销、投研等各项业务过程中的法律、合规及投资风险的防范与控制，在合法合规的基础上，充分保障基金份额持有人的利益。

4、开展反洗钱、反商业贿赂等各项工作，并通过开展法规培训等形式，提高员工的合规意识和风险责任意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

4.7.1.1 估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由主管运营的副总经理、基金事务部、投资部、交易部、监察稽核部部门总监组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 对异常情况做出决策。

主管运营的副总经理是估值工作小组的组长，主管运营的副总经理在基金事务部总监或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

4.7.1.2 基金事务部的职责分工

基金事务部负责日常证券资产估值。该部门和公司投资部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金事务部定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金事务部职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金事务部总监认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

4.7.1.3 投资部的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
- ③ 评价并确认基金事务部提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4.7.1.4 交易部的职责分工

- ① 对基金事务部的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 通知基金事务部关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- ③ 评价并确认基金事务部提供的估值报告。

4.7.1.5 监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；

-
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价值的风险；
 - ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
 - ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7.2 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 基金持有人数或资产净值预警情形的说明

在本报告期内，该基金曾出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形：

截止到 2015 年 12 月 31 日，该基金连续一百三十六个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对金元顺安核心动力混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，金元顺安核心动力混合型证券投资基金的管理人——金元顺安基金管理有限公司在金元顺安核心动力混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，金元顺安核心动力混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对金元顺安基金管理有限公司编制和披露的金元顺安核心动力混合型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

2016年3月24日

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2016）审字第60657709_B05号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	金元顺安核心动力混合型证券投资基金（原“金元惠理核心动力股票型证券投资基金”）全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的金元顺安核心动力混合型证券投资基金财务报表，包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人金元顺安基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审

	<p>计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了金元顺安核心动力混合型证券投资基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	汤 骏 印艳萍
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
审计报告日期	2016-03-25

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：金元顺安核心动力混合型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	11,281,482.14	7,016,784.47
结算备付金		44,990.98	129,629.87
存出保证金		22,290.88	33,235.73
交易性金融资产	7.4.7.2	23,278,625.72	79,525,924.64
其中：股票投资	7.4.7.2	23,278,625.72	79,525,924.64
基金投资		-	-

债券投资	7.4.7.2	-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		754,024.23	-
应收利息	7.4.7.5	2,068.04	1,727.76
应收股利		-	-
应收申购款		498.36	511,767.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		35,383,980.35	87,219,070.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		107.92	2,728,727.15
应付管理人报酬		44,780.32	95,776.55
应付托管费		7,463.38	15,962.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	67,821.78	150,204.21
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	60,000.41	69,928.67
负债合计		180,173.81	3,060,599.33
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	29,686,267.36	75,053,189.85
未分配利润	7.4.7.	5,517,539.18	9,105,281.11

	10		
所有者权益合计		35,203,806.54	84,158,470.96
负债和所有者权益总计		35,383,980.35	87,219,070.29

注：报告期截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.186 元，基金份额总额 29,686,267.36 份。

7.2 利润表

会计主体：金元顺安核心动力混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		10,025,662.51	29,408,723.80
1. 利息收入		58,339.39	131,786.66
其中：存款利息收入	7.4.7.11	56,625.77	56,912.02
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,713.62	74,874.64
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		23,244,707.41	10,952,509.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	22,713,049.26	9,265,725.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	531,658.15	1,686,783.19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-13,342,500.28	18,268,792.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	65,115.99	55,636.06
减：二、费用		1,637,866.22	1,824,932.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2	741,000.48	893,024.22
2. 托管费	7.4.10.2	123,500.03	148,837.39
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	564,905.71	549,297.90
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	7. 4. 7. 21	208,460.00	233,772.50
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		8,387,796.29	27,583,791.79
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		8,387,796.29	27,583,791.79

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 金元顺安核心动力混合型证券投资基金

本报告期: 2015年1月1日至2015年12月31日

单位: 人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	75,053,189.85	9,105,281.11	84,158,470.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,387,796.29	8,387,796.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-45,366,922.49	-11,975,538.22	-57,342,460.71
其中: 1. 基金申购款	28,100,945.10	5,585,931.41	33,686,876.51
2. 基金赎回款	-73,467,867.59	-17,561,469.63	-91,029,337.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	29,686,267.36	5,517,539.18	35,203,806.54
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	74,134,629.04	-20,108,559.27	54,026,069.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,583,791.79	27,583,791.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	918,560.81	1,630,048.59	2,548,609.40
其中: 1. 基金申购款	81,270,339.81	-14,225,060.38	67,045,279.43
2. 基金赎回款	-80,351,779.00	15,855,108.97	-64,496,670.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	75,053,189.85	9,105,281.11	84,158,470.96

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张嘉宾，主管会计工作负责人：符刃，会计机构负责人：季泽

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金元顺安核心动力混合型证券投资基金（原名为金元比联核心动力股票型证券投资基金，以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]1424 号文《关于核准金元比联核心动力股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人金元比联基金管理有限公司(系金元顺安基金管理有限公司的前身)向社会公开发行募集，基金合同于 2010 年 2 月 11 日正式生效，首次设立募集规模为 436,884,917.98 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构为金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经金元比联第二届董事会第七次会议及第二届股东会第五次会议审议通过，并由中国证监会证监许可[2012]276 号文核准，金元比联基金管理有限公司已于 2012 年 3 月 15 日完成相关工商变更登记手续，并且变更公司名称为“金元惠理基金管理有限公司”。随后，报请中国证监会同意，将金元比联核心动力股票型证券投资基金更名为金元惠理核心动力股票型证券投资基金，并于 2012 年 5 月 2 日公告。

2015 年 2 月 5 日，经金元惠理基金管理有限公司股东金元证券股份有限公司及惠理基金管理香港有限公司以书面表决的方式达成更名决议。金元惠理基金管理有限公司于 2015 年 3 月 6 日完成相关工商变更登记手续，并且变更公司名称为“金元顺安基金管理有限公司”，并于 2015 年 3 月 10 日进行公告。根据中国证券监督管理委员会于 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，自 2015 年 7 月 15 日起将本基金变更为金元顺安核心动力混合型证券投资基金，并相应修改本基金的《基金合同》。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金通过运用“核心-卫星”股票投资策略，将大部分基金资产用于完全复制大型上市公司股票指数（中证 100 指数）的业绩表现，并将部分资产投资于中证 100 指数以外的具备良好成长潜力且价值被低估的上市公司股票，在控制组合风险的前提下，追求基金资产中长期的稳定增值。本基金的业绩比较基准为：中证 100 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票投资；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(2)债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3)权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1)存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(2)不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣

代缴的个人所得税后的净额入账；

(10)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3)卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
活期存款	11,281,482.14	7,016,784.47
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	11,281,482.14	7,016,784.47

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	20,464,141.35	23,278,625.72	2,814,484.37
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	20,464,141.35	23,278,625.72	2,814,484.37
项目	上年度末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	63,368,939.99	79,525,924.64	16,156,984.65
贵金属投资-金交所黄	-	-	-

金合约			
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	63,368,939.99	79,525,924.64	16,156,984.65

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度可比会计期末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	2,037.84	1,654.46
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	20.20	58.30
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	10.00	15.00
合计	2,068.04	1,727.76

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	67,821.78	150,204.21
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	67,821.78	150,204.21
----	-----------	------------

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.41	4,928.67
预提审计费	60,000.00	65,000.00
预提信息披露费	-	-
合计	60,000.41	69,928.67

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	75,053,189.85	75,053,189.85
本期申购	28,100,945.10	28,100,945.10
本期赎回（以“-”号填列）	-73,467,867.59	-73,467,867.59
本期末	29,686,267.36	29,686,267.36

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,108,830.40	5,996,450.71	9,105,281.11
本期利润	21,730,296.57	-13,342,500.28	8,387,796.29
本期基金份额交易产生的变动数	-9,589,680.12	-2,385,858.10	-11,975,538.22
其中：基金申购款	5,567,247.56	18,683.85	5,585,931.41
基金赎回款	-15,156,927.68	-2,404,541.95	-17,561,469.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,249,446.85	-9,731,907.67	5,517,539.18

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	53,144.11	52,697.86
定期存款利息收入	-	-

其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,540.05	3,628.42
其他	941.61	585.74
合计	56,625.77	56,912.02

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	209,573,900.84	177,939,876.83
减：卖出股票成本总额	186,860,851.58	168,674,151.02
买卖股票差价收入	22,713,049.26	9,265,725.81

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	531,658.15	1,686,783.19
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	531,658.15	1,686,783.19

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	-13,342,500.28	18,268,792.08

——股票投资	-13,342,500.28	18,268,792.08
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-13,342,500.28	18,268,792.08

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
基金赎回费收入	60,737.21	55,321.33
印花税返还	547.02	-
转换费收入	3,831.76	314.73
其他	-	-
合计	65,115.99	55,636.06

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	564,905.71	549,297.90
银行间市场交易费用	-	-
合计	564,905.71	549,297.90

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
审计费用	60,000.00	65,000.00
信息披露费	130,000.00	150,000.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费用	460.00	772.50
其他费用	-	-
合计	208,460.00	233,772.50

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

经中国证监会核准，本公司原外方股东惠理基金管理香港有限公司将其持有本公司 49%的股权转给上海泉意金融信息服务有限公司。该项股权变更的工商登记手续已于 2016 年 3 月 8 日完成。股权变更后，本公司的股权结构为：金元证券股份有限公司持有 51%的股权，上海泉意金融信息服务有限公司持有 49%的股权。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
惠理基金管理香港有限公司	基金管理人的股东
上海金元百利资产管理有限公司（原“上海金元惠理资产管理有限公司”）	基金管理人的子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
金元证券股份有限公司	10,257,968.60	2.92%	10,321,979.59	2.85%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
金元证券股份有限	9,338.86	2.93%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
金元证券股份有限	9,397.14	2.86%	9,397.14	6.26%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31 日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	741,000.48	893,024.22
其中：支付销售机构的客户维护费	158,914.28	309,709.36

注：a.基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。

计算方法如下： $H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$ ，

H为每日应支付的基金管理费，

E为前一日的基金资产净值，

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

b.根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	123,500.03	148,837.39

注：a.基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。

计算方法如下： $H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$,

H为每日应支付的基金托管费,

E为前一日的基金资产净值,

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
报告期初持有的基金份额	13,548,780.49	-
报告期间申购/买入总份额	-	13,548,780.49
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	13,548,780.49	13,548,780.49
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	45.64%	18.05%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的	持有的基金份额	持有的	持有的基金份额

	基金份额	额占基金总份 额的比例	基金份额	额占基金总份 额的比例
上海金元百利 资产管理有限公司	4,061,363.93	13.68%	-	-

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份 有限公司	11,281,482.14	53,144.11	7,016,784.47	52,697.86

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015年度获得的利息收入为人民币2,540.05元（2014年度获得的利息收入为人民币3,628.42元），2015年末结算备付金余额为人民币44,990.98元（2014年末结算备付金余额为人民币129,629.87元）。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600690	青岛海尔	2015-10-19	重大 重组 停牌	9.92	2016-02-01	8.93	10,678	110,372.40	105,925.76	-
601018	宁波港	2015-08-04	重大 重组 停牌	8.16	2016-02-22	7.34	11,806	33,278.46	96,336.96	-
000002	万科A	2015-12-18	重大 重组 停牌	23.98	-	-	34,512	414,459.43	827,597.76	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入公司各个业务层面的全面控制过程之中，并建立了三道防线：以各岗位职责为基础，形成第一道防线；通过相关岗位之间、相关部门之间相互监督制衡，形成第二道防线；由督察长、风险控制委员会、监察稽核部对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务进行监督、检查、评价，形成的第三道防线。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以降低信用风险。

本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额

持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持有的证券均在证券交易所上市，因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易债券投资的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,281,48 2.14	-	-	-	11,281,48 2.14
结算备付 金	44,990.98	-	-	-	44,990.98
存出保证 金	22,290.88	-	-	-	22,290.88
交易性金 融资产	-	-	-	23,278,62 5.72	23,278,62 5.72
衍生金融 资产	-	-	-	-	-
应收证券 清算款	-	-	-	754,024.2 3	754,024.2 3
应收利息	-	-	-	2,068.04	2,068.04

应收申购款	-	-	-	498.36	498.36
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,348,76 4.00	-	-	24,035,21 6.35	35,383,98 0.35
负债					
应付赎回费	-	-	-	0.41	0.41
应付管理人报酬	-	-	-	44,780.32	44,780.32
应付托管费	-	-	-	7,463.38	7,463.38
应付交易费用	-	-	-	67,821.78	67,821.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	-	-
预提费用	-	-	-	60,000.00	60,000.00
应付赎回款	-	-	-	107.92	107.92
负债总计	-	-	-	180,173.8 1	180,173.8 1
利率敏感度缺口	11,348,76 4.00	-	-	23,855,04 2.54	35,203,80 6.54
上年度末 2014年12	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

月31日					
资产					
银行存款	7,016,784 .47	-	-	-	7,016,784 .47
结算备付 金	129,629.8 7	-	-	-	129,629.8 7
存出保证 金	33,235.73	-	-	-	33,235.73
交易性金 融资产	-	-	-	79,525.92 4.64	79,525.92 4.64
衍生金融 资产	-	-	-	-	-
应收证券 清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,727.76	1,727.76
应收申购 款	11,000.00	-	-	500,767.8 2	511,767.8 2
买入返售 金融资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,190,650 .07	-	-	80,028.42 0.22	87,219.07 0.29
负债					
应付赎回 费	-	-	-	4,928.67	4,928.67
应付管理 人报酬	-	-	-	95,776.55	95,776.55
应付托管 费	-	-	-	15,962.75	15,962.75
应付交易 费用	-	-	-	150,204.2 1	150,204.2 1
应付销售 服务费	-	-	-	-	-
卖出回购 金融资产	-	-	-	-	-

款					
应付利息	-	-	-	-	-
应付证券 清算款	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	-	-
预提费用	-	-	-	65,000.00	65,000.00
应付赎回 款	-	-	-	2,728,727 .15	2,728,727 .15
负债总计	-	-	-	3,060,599 .33	3,060,599 .33
利率敏感 度缺口	7,190,650 .07	-	-	76,967,82 0.89	84,158,47 0.96

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2014 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	23,278,625.72	66.13	79,525,924.64	94.50
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	23,278,625.72	66.13	79,525,924.64	94.50

注：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，核心组合完全复制中证 100 指数，投资比例为股票资产的 60%-100%；卫星组合则以中证 100 指数以外的具备良好成长潜力且价值被低估的上市公司股票为标的，投资比例为股票资产的 0%-40%。债券资产、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合中股票投资的贝塔系数紧密相关。		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	中证 100 指数上涨 5%	减少 112.06 万元	增加 420.67 万元
	中证 100 指数下跌 5%	增加 112.06 万元	减少 420.67 万元

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。若干比较数字已进行重述，以符合本期之列报要求。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

风险价值（VaR）含义是指：在市场正常波动下，某一金融资产或证券组合的最大可能损失。更为确切的是指，在一定概率水平（置信度）下，某一金融资产或证券组合价值在未来特定时期内的最大可能损失。用公式表示为： $\text{Prob}(\Delta P > \text{VaR}) = 1 - \alpha$ 或： $\text{Prob}(\Delta P < \text{VaR}) = \alpha$ 其中 Prob 表示：资产价值损失小于可能损失上限的概率。 ΔP 表示：某一金融资产在一定持有期 Δt 的价值损失额。 VAR 表示：给定置信水平 α 下的在险价值，即可能的损失上限。 α 为：给定的置信水平。

假设	在 99% 的置信水平下采用风险价值模型来管理风险；
	以资产负债表日前 125 个交易日为观察期；
	预测期间本基金的资产组合的结构保持不变；

	本基金的基金净值日对数收益率服从正态分布。		
分析	风险价值	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
	合计	增加134.95万元	增加263.87万元
	-	-	-

注：上述分析衡量了在 99%的置信水平下，所持有的资产组合在资产负债表日后一个交易日内由于市场价格风险所导致的最大潜在损失。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 22,248,765.24 元，属于第二层次的余额为人民币 1,029,860.48 元，无属于第三层次的余额。（于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 79,149,310.64 元，属于第二层次的余额为人民币 376,614.00 元，无属于第三层次的余额。）

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上期末均不以第三层次公允价值计量。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金的资产净值为人民币 35,203,806.54 元，已连续超过 136 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元。本基金资产管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，在本基金 2015 年 4 季度报告中进行了披露。本基金资产管理人将积极采取开展持续营销、加大宣传力度、提高投研能力等措施，尽快扭转这一状况。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	23,278,625.72	65.79
	其中：股票	23,278,625.72	65.79
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	买入返售金融资产	-	-
5	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,326,473.12	32.01
7	其他各项资产	778,881.51	2.20
8	合计	35,383,980.35	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	836,176.85	2.38
C	制造业	7,050,148.88	20.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	712,088.72	2.02
E	建筑业	1,065,026.30	3.03
F	批发和零售业	219,880.60	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	431,975.32	1.23

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	542,382.98	1.54
J	金融业	11,097,757.11	31.52
K	房地产业	1,204,204.16	3.42
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	118,984.80	0.34
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,278,625.72	66.13

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	39,684	1,428,624.00	4.06
2	600036	招商银行	60,997	1,097,336.03	3.12
3	600016	民生银行	108,782	1,048,658.48	2.98
4	000002	万科A	34,512	827,597.76	2.35
5	300007	汉威电子	22,600	772,920.00	2.20
6	600000	浦发银行	40,807	745,543.89	2.12
7	601166	兴业银行	42,221	720,712.47	2.05
8	600030	中信证券	28,498	551,436.30	1.57
9	601988	中国银行	137,195	550,151.95	1.56
10	601328	交通银行	72,460	466,642.40	1.33
11	600837	海通证券	29,393	464,997.26	1.32
12	601766	中国中车	33,841	434,856.85	1.24
13	601939	建设银行	71,057	410,709.46	1.17
14	600519	贵州茅台	1,856	404,960.64	1.15
15	000651	格力电器	17,548	392,197.80	1.11
16	601169	北京银行	37,133	391,010.49	1.11
17	600887	伊利股份	22,578	370,956.54	1.05
18	300135	宝利国际	41,675	368,407.00	1.05
19	601668	中国建筑	55,895	354,374.30	1.01
20	601601	中国太保	11,452	330,504.72	0.94
21	601989	中国重工	34,200	321,480.00	0.91

22	601288	农业银行	98,055	316,717.65	0.90
23	601818	光大银行	73,699	312,483.76	0.89
24	600048	保利地产	24,760	263,446.40	0.75
25	600104	上汽集团	12,371	262,512.62	0.75
26	000001	平安银行	21,098	252,965.02	0.72
27	600900	长江电力	18,653	252,934.68	0.72
28	000333	美的集团	7,553	247,889.46	0.70
29	600015	华夏银行	19,699	239,145.86	0.68
30	601688	华泰证券	11,817	233,031.24	0.66
31	601390	中国中铁	20,733	226,404.36	0.64
32	002024	苏宁云商	16,348	219,880.60	0.62
33	600276	恒瑞医药	4,292	210,823.04	0.60
34	000776	广发证券	10,800	210,060.00	0.60
35	600050	中国联通	31,397	194,033.46	0.55
36	000858	五粮液	7,091	193,442.48	0.55
37	600028	中国石化	38,900	192,944.00	0.55
38	601006	大秦铁路	22,366	192,794.92	0.55
39	600637	东方明珠	4,800	181,872.00	0.52
40	600999	招商证券	8,316	180,457.20	0.51
41	600518	康美药业	10,246	173,669.70	0.49
42	000166	申万宏源	16,167	173,148.57	0.49
43	601628	中国人寿	6,066	171,728.46	0.49
44	601186	中国铁建	12,692	171,088.16	0.49
45	000063	中兴通讯	8,675	161,615.25	0.46
46	002415	海康威视	4,568	157,093.52	0.45
47	601336	新华保险	3,008	157,047.68	0.45
48	601857	中国石油	17,881	149,306.35	0.42
49	600705	中航资本	9,400	146,452.00	0.42
50	601901	方正证券	14,955	143,568.00	0.41
51	600795	国电电力	36,445	143,228.85	0.41
52	000625	长安汽车	8,382	142,242.54	0.40
53	600011	华能国际	15,547	135,725.31	0.39
54	000538	云南白药	1,863	135,291.06	0.38
55	600010	包钢股份	36,479	131,689.19	0.37
56	601727	上海电气	11,400	131,556.00	0.37
57	600703	三安光电	5,300	128,684.00	0.37
58	600585	海螺水泥	7,324	125,240.40	0.36
59	601899	紫金矿业	35,381	124,541.12	0.35
60	601669	中国电建	15,292	122,794.76	0.35
61	000069	华侨城 A	13,521	118,984.80	0.34
62	601618	中国中冶	19,210	115,644.20	0.33

63	600383	金地集团	8,200	113,160.00	0.32
64	600111	北方稀土	8,053	112,903.06	0.32
65	002304	洋河股份	1,641	112,474.14	0.32
66	002594	比亚迪	1,730	111,412.00	0.32
67	000725	京东方 A	37,200	110,484.00	0.31
68	601088	中国神华	7,258	108,652.26	0.31
69	600690	青岛海尔	10,678	105,925.76	0.30
70	600886	国投电力	12,600	105,210.00	0.30
71	600019	宝钢股份	18,229	101,717.82	0.29
72	600893	中航动力	2,200	99,066.00	0.28
73	600196	复星医药	4,200	98,658.00	0.28
74	601788	光大证券	4,200	96,348.00	0.27
75	601018	宁波港	11,806	96,336.96	0.27
76	600535	天士力	2,312	94,607.04	0.27
77	600031	三一重工	14,149	93,100.42	0.26
78	002241	歌尔声学	2,678	92,658.80	0.26
79	600150	中国船舶	2,562	89,234.46	0.25
80	600406	国电南瑞	5,314	88,637.52	0.25
81	002736	国信证券	4,400	86,900.00	0.25
82	600958	东方证券	3,700	86,173.00	0.24
83	601998	中信银行	11,801	85,203.22	0.24
84	601111	中国国航	9,568	82,093.44	0.23
85	601600	中国铝业	16,500	82,005.00	0.23
86	002252	上海莱士	2,000	79,540.00	0.23
87	603508	思维列控	1,000	77,840.00	0.22
88	600256	广汇能源	11,570	77,171.90	0.22
89	600023	浙能电力	10,012	74,989.88	0.21
90	601800	中国交建	5,572	74,720.52	0.21
91	000895	双汇发展	3,616	73,802.56	0.21
92	600583	海油工程	8,200	73,390.00	0.21
93	600398	海澜之家	5,000	69,800.00	0.20
94	600309	万华化学	3,874	69,150.90	0.20
95	600018	上港集团	9,375	60,750.00	0.17
96	601633	长城汽车	4,541	54,673.64	0.16
97	600372	中航电子	1,913	47,117.19	0.13
98	601898	中煤能源	6,728	40,704.40	0.12
99	002779	中坚科技	500	39,100.00	0.11
100	601225	陕西煤业	7,399	35,959.14	0.10
101	601808	中海油服	2,159	33,507.68	0.10
102	603288	海天味业	900	31,815.00	0.09
103	600485	信威集团	500	13,375.00	0.04

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600837	海通证券	7,133,717.00	8.48
2	601318	中国平安	5,991,649.00	7.12
3	600422	昆药集团	5,441,456.16	6.47
4	601628	中国人寿	5,440,751.00	6.46
5	002465	海格通信	4,900,189.38	5.82
6	600030	中信证券	4,378,926.00	5.20
7	600547	山东黄金	3,250,000.00	3.86
8	000911	南宁糖业	3,152,509.72	3.75
9	600050	中国联通	3,078,272.00	3.66
10	002493	荣盛石化	2,983,682.00	3.55
11	600373	中文传媒	2,944,889.68	3.50
12	000800	一汽轿车	2,663,639.00	3.17
13	600010	包钢股份	2,634,026.00	3.13
14	000069	华侨城 A	2,595,048.00	3.08
15	600340	华夏幸福	2,573,297.00	3.06
16	002373	千方科技	2,559,595.44	3.04
17	600066	宇通客车	2,510,885.14	2.98
18	300273	和佳股份	2,506,000.00	2.98
19	600111	北方稀土	2,500,336.00	2.97
20	000089	深圳机场	2,489,120.00	2.96
21	600495	晋西车轴	2,379,000.00	2.83
22	601169	北京银行	2,326,663.00	2.76
23	600312	平高电气	2,229,495.00	2.65
24	600535	天士力	2,177,047.02	2.59
25	000651	格力电器	2,100,495.00	2.50
26	600809	山西汾酒	2,069,611.00	2.46
27	603555	贵人鸟	2,046,312.00	2.43
28	601377	兴业证券	2,040,000.00	2.42
29	002142	宁波银行	1,915,004.03	2.28
30	300020	银江股份	1,820,872.24	2.16
31	600031	三一重工	1,741,757.00	2.07
32	000630	铜陵有色	1,719,575.00	2.04
33	600395	盘江股份	1,694,988.64	2.01

注：本项的“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600837	海通证券	8,536,948.49	10.14
2	601318	中国平安	6,355,867.96	7.55
3	600030	中信证券	5,918,672.83	7.03
4	601628	中国人寿	5,886,077.55	6.99
5	600422	昆药集团	5,781,173.00	6.87
6	002465	海格通信	5,602,053.56	6.66
7	000002	万科A	5,133,470.55	6.10
8	000651	格力电器	4,719,874.66	5.61
9	600395	盘江股份	4,520,645.58	5.37
10	600875	东方电气	4,274,471.55	5.08
11	000911	南宁糖业	3,876,779.46	4.61
12	600547	山东黄金	3,506,038.44	4.17
13	600000	浦发银行	3,502,696.78	4.16
14	600426	华鲁恒升	3,370,040.24	4.00
15	600373	中文传媒	3,316,969.60	3.94
16	600010	包钢股份	3,303,834.90	3.93
17	002493	荣盛石化	3,266,791.35	3.88
18	600050	中国联通	3,141,781.00	3.73
19	300273	和佳股份	3,039,550.52	3.61
20	600111	北方稀土	2,757,387.89	3.28
21	000089	深圳机场	2,698,200.00	3.21
22	000786	北新建材	2,639,020.00	3.14
23	000069	华侨城A	2,584,024.00	3.07
24	000401	冀东水泥	2,574,549.00	3.06
25	601169	北京银行	2,569,382.15	3.05
26	600535	天士力	2,558,349.25	3.04
27	002373	千方科技	2,526,506.00	3.00
28	000800	一汽轿车	2,503,512.40	2.97
29	600066	宇通客车	2,462,362.40	2.93
30	603555	贵人鸟	2,458,605.00	2.92
31	600495	晋西车轴	2,403,093.24	2.86
32	600016	民生银行	2,401,348.61	2.85
33	600340	华夏幸福	2,400,309.00	2.85
34	600309	万华化学	2,329,467.50	2.77
35	601106	中国一重	2,275,434.30	2.70
36	002142	宁波银行	2,253,979.03	2.68

37	000630	铜陵有色	2,184,600.00	2.60
38	601377	兴业证券	2,182,500.00	2.59
39	000063	中兴通讯	2,175,360.88	2.58
40	600809	山西汾酒	2,163,076.00	2.57
41	600312	平高电气	2,119,233.00	2.52
42	600383	金地集团	2,099,445.00	2.49
43	300020	银江股份	2,028,780.60	2.41
44	600031	三一重工	1,799,986.50	2.14
45	600036	招商银行	1,717,434.84	2.04

注：本项的“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	186,860,851.58
卖出股票的收入（成交）总额	209,573,900.84

注：本项的“买入股票的成本”、“卖出股票的收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未投资贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未投资权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.10.2 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。

8.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

1、关于汉威电子（代码：300007）的处罚说明

公司日前收到孙公司合肥嘉园水处理投资有限公司董事高某某、陈某某的书面告知函，两人因合肥嘉园水处理投资有限公司在承接项目过程中涉嫌单位行贿，被安徽省有关检察机关立案侦查并取保候审，案件正在侦查过程中。

现作出说明如下：

A.投资决策程序：基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案，综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配，同时在研究部的支持下，对准备重

点投资的公司进行深入的基本面分析，最终构建投资组合。

B.基金经理遵循价值投资理念，看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。我们判断此次事件主要是公司旗下孙公司个别员工涉及的可能存在的违法违规事项，对公司影响有限，公司经营活动一切正常，我们认为不会对整体的业绩造成影响。

2、关于兴业银行（代码：601166）的处罚说明

2015年5月中旬，公司南宁分行下辖二级分行北海分行接到北海市公安局通报，该分行前员工苏瑜涉嫌个人非法集资已被立案，目前案件在调查阶段。公司南宁以及北海两级分行成立专项调查小组，就其涉及业务进行了全面内部排查，未发现银行资金卷入其中。目前，公司北海分行经营、财务状况与对外服务均正常。涉案人苏瑜于2010年7月进入公司北海分行筹建组工作，先后任北海分行企业金融客户经理、业务三部负责人，并非网传高管，其于2015年3月27日主动向分行递交离职申请，分行批准与其解除劳动合同。

现作出说明如下：

A.投资决策程序：基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案，综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配，同时在研究部的支持下，对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析，最终构建投资组合。

B.基金经理遵循价值投资理念，看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。兴业银行为中证100成分股，核心组合被动投资。我们判断此次事件对公司影响有限，公司经营活动一切正常，我们认为不会对整体的业绩造成影响。

3、关于中信证券（代码：600030）的处罚说明

2015.1.16

检查发现，部分公司存在违规为到期融资融券合约展期、向不符合条件的客户融资融券、未按规定及时处分客户担保物、违规为客户与客户之间融资提供便利等问题。此外，个别证券公司还存在整改不到位、受过处理仍未改正甚至出现新的违规等问题。其中，中信证券、海通证券和国泰君安3家公司存在违规为到期融资融券合约展期问题，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多，对这3家公司采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

2015.1.19

日前，因存在为到期融资融券合约展期的问题（根据相关规定，融资融券合约期限最长为6个月），公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

2015年1月26日，中国证监会出具了《关于对中信证券股份有限公司采取监管谈话措施的决定》（证监会[2015]14号），就我公司从事投行项目中的有关问题，要求有关负责人到中国证监会非上市公众公司监管部接受监管谈话。

2015.9.16

公司总经理程博明、经纪业务发展与管理委员会运营管理部负责人于新利、信息技术中心汪锦岭等人涉嫌内幕交易、泄露内幕信息。

2015年11月26日，中信证券股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）调查通知书（稽查总队调查通字153121号），其中提及：因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。

现作出说明如下：

A.投资决策程序：基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案，综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配，同时在研究部的支持下，对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析，最终构建投资组合。

B.基金经理遵循价值投资理念，看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。中信证券为中证100成分股，核心组合被动投资。我们判断此次事件对公司影响有限，公司经营活动一切正常，我们认为不会对整体的业绩造成影响。

8.11.2 报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	22,290.88

2	应收证券清算款	754,024.23
3	应收股利	-
4	应收利息	2,068.04
5	应收申购款	498.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	778,881.51

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科 A	827,597.76	2.35	重大资产重组

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
949	31,281.63	17,659,551.53	59.49%	12,026,715.83	40.51%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末本公司所有从业人员未持有本基金。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

报告期末本公司所有从业人员未持有本基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年2月11日)基金份额总额	436,884,917.98
本报告期期初基金份额总额	75,053,189.85
本报告期基金总申购份额	28,100,945.10
减：本报告期基金总赎回份额	73,467,867.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	29,686,267.36

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人董事会审议通过，批准晏斌先生辞去本公司基金经理职务，聘用闵杭先生为本公司基金经理兼总经理助理、投资总监。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，未发生改聘会计师事务所的情况。本报告期内，应向安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）支付报酬人民币 60,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券股份有限公司	2	106,145,667.00	30.23%	96,650.62	30.30%	-
兴业证券股份有限公司	1	76,766,911.67	21.87%	70,152.50	21.99%	-
上海华信证券有限责任公司	2	67,142,212.75	19.12%	60,242.94	18.89%	-
中信证券股份有限公司	2	25,714,301.94	7.32%	23,410.38	7.34%	-
国泰君安证券股份有限公司	2	18,232,203.16	5.19%	16,598.51	5.20%	-
光大证券股份有限公司	1	17,528,148.82	4.99%	16,076.72	5.04%	-
国金证券股份有限公司	1	16,948,616.50	4.83%	14,997.81	4.70%	-
金元证券股份有限公司	1	10,257,968.60	2.92%	9,338.86	2.93%	-
中国国际金融有限公司	2	9,735,027.48	2.77%	9,066.21	2.84%	-
华创证券有限责任公司	1	2,610,828.00	0.74%	2,431.48	0.76%	-
民生证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1：专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序：

A.选择标准。

a.公司具有较强的研究实力，能够出具高质量的各种研究报告。研究及投资建议质量较高、报告出具及时、能及时地交流和对需求做出反应，有较广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

b.公司资信状况较好，无重大不良记录。

c.公司经营规范，能满足基金运作的合法、合规需求。

d.能够对持有人提供较高质量的服务。能够向持有人提供咨询、查询等服务；可以向投资人提供及时、主动的信息以及其它增值服务，无被持有人投诉的记录。

B.选择流程。

公司投研和市场部门定期对券商服务质量根据选择标准进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元。

2：截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金退租华泰证券股份有限公司 1 个上海交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 回购成 交总额 的比例	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例
平安证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

兴业证券股份 有限公司	-	-	700,000.00	3.78%	-	-
上海华信证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
金元证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	-	-	17,800,000.00	96.22%	-	-
民生证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金元惠理核心动力股票型证券投资基金 2014年第4季度报告	《中国证券报》、《上海 证券报》、《证券 时报》和 www.jyvpfund.com	2015-01-23
2	金元惠理核心动力股票型证券投资基金更 新招募说明书[2015年1号]	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券 时报》和	2015-03-28

		www. jyvpfund. com	
3	金元惠理核心动力股票型证券投资基金更新招募说明书摘要[2015年1号]	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-03-28
4	金元惠理核心动力股票型证券投资基金2014年年度报告（正文）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-03-31
5	金元惠理核心动力股票型证券投资基金2014年年度报告（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-03-31
6	金元惠理核心动力股票型证券投资基金2015年第1季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-04-21
7	金元惠理核心动力股票型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-05-09
8	金元惠理核心动力股票型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-07-04
9	金元惠理核心动力股票型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-07-11
10	金元惠理核心动力股票型证券投资基金2015年第2季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-07-17
11	金元惠理核心动力股票型证券投资基金2015年半年度报告（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-08-29
12	金元惠理核心动力股票型证券投资基金2015年半年度报告（正文）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-08-29
13	金元顺安核心动力混合型证券投资基金更新招募说明书摘要[2015年2号]	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和	2015-09-24

		www. jyvpfund. com	
14	金元顺安核心动力混合型证券投资基金更新招募说明书[2015年2号]	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-09-24
15	金元顺安基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-10-08
16	金元顺安基金管理有限公司增加兴业银行为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-10-09
17	金元顺安核心动力混合型证券投资基金2015年第3季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-10-27
18	金元顺安核心动力混合型证券投资基金（原金元惠理核心动力股票型证券投资基金）年度最后一个市场交易日（或自然日）净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-12-31
19	金元顺安基金管理有限公司关于实施指数熔断调整旗下基金开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www. jyvpfund. com	2015-12-31

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《金元顺安核心动力混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《金元顺安核心动力混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、《金元顺安核心动力混合型证券投资基金招募说明书》。

12.2 存放地点

上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦36层3608室。

12.3 查阅方式

<http://www.jyvpfund.com>。

金元顺安基金管理有限公司（原
“金元惠理基金管理有限公司”）

二〇一六年三月二十九日