

# 金元顺安消费主题混合型证券投资基金

## 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年十月二十五日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 24 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 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	金元顺安消费主题混合
基金主代码	620006
交易代码	620006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月15日
报告期末基金份额总额	19,600,988.90份
投资目标	在正确认识中国经济发展特点的基础上，重点投资于消费拉动经济增长过程中充分受益的消费主题行业及其中的优势企业，致力于分享中国经济增长及增长方式转变带来的投资机会，力争实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金是一只采用主题投资方法的混合型基金产品，其主要投资标的是消费拉动经济增长过程中充分受

	益的消费主题行业及其中的优势企业,分享中国经济增长及增长方式转变带来的投资机会。本基金将通过严格的股票选择,深入挖掘消费主题股票的获利机会,实现动态优化的投资布局。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是一只具有主题投资风格的混合型基金,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,属于较高预期风险、较高预期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	中国工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(2016年7月1日-2016年9月30日)
1.本期已实现收益	216,612.23
2.本期利润	-599,966.86
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0299
4.期末基金资产净值	17,037,096.79
5.期末基金份额净值	0.869

注：(1)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；

(2)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。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期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	-3.44%	0.78%	2.79%	0.64%	-6.23%	0.14%

注：（1）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；

（2）本基金合同生效日为 2010 年 9 月 15 日；

（3）本基金选择沪深 300 指数作为股票投资部分的业绩基准，选择中债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：

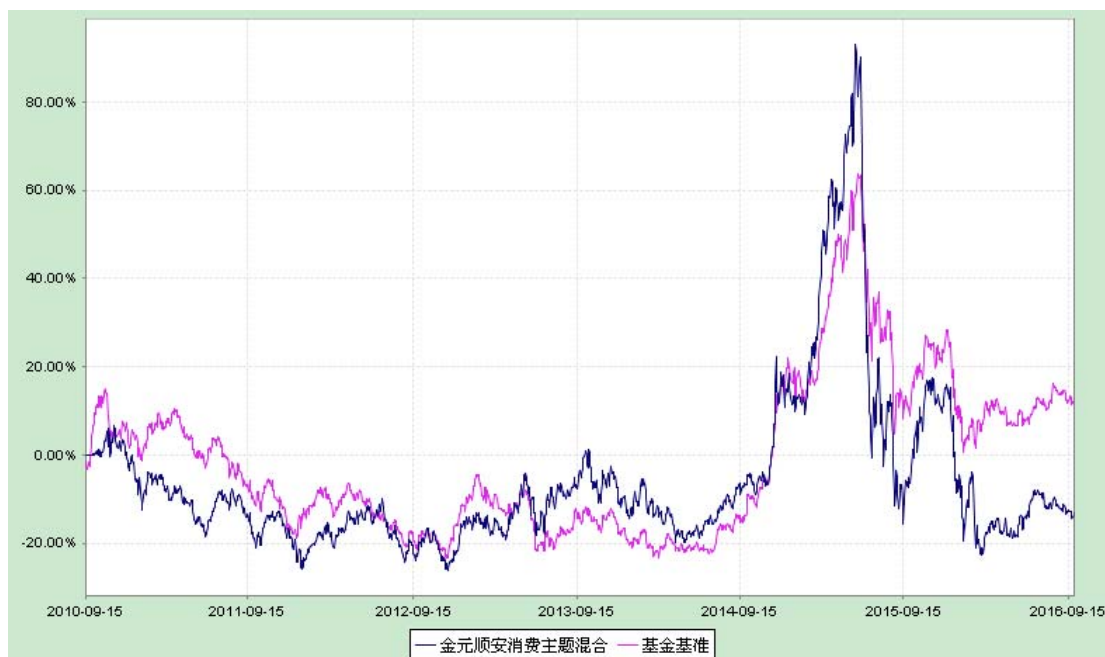
沪深 300 指数收益率\*80%+中国债券总指数收益率\*20%。

### 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

金元顺安消费主题混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2010 年 9 月 15 日至 2016 年 9 月 30 日）



注：（1）本基金合同生效日为 2010 年 9 月 15 日；

（2）本基金建仓期为 2010 年 9 月 15 日至 2011 年 3 月 14 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）基金合同约定的投资比例为股票资产占基金资产的 60%-95%，其中，投资于消费主题行业的上市公司股票的比例不低于本基金股票资产的 80%；债券、现金等金融工具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%。

## § 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		
闵杭	本基金基金经理	2015-10-16	-	22	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

					<p>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，上海交通大学工学学士。曾任湘财证券股份有限公司上海自营分公司总经理，申银万国证券股份有限公司证券投资总部投资总监。2015年8月加入金元顺安基金管理有限公司。22年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	--

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》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则、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。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《异常交易监控与报告制度》。本报告期，根据制度的规定，对交易进行了监控，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

报告期内，基金重点投资于食品饮料、TMT、军工等行业。

#### 4.5 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-3.44%，业绩比较基准收益率为 2.79%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度 GDP 增速有望保持平稳。房地产在今年初起到了对经济的支撑作用，但房价上涨过快，政府开始对楼市进行调控，预计将会导致当地产销量和投资的下滑，未来有望通过财政发力基建投资平滑房地产对经济的影响。货币政策一方面受制于房地产调控政策和汇率贬值压力难以继续宽松，但是在经济下行周期中，货币政策收紧概率很小，预计将会维持稳健的货币政策。海外方面，四季度风险事件较多，11 月美国的大选，12 月意大利宪改公投，以及美联储议息会议等。

证券市场上，由于当前个人投资者、机构仓位较低，市场下行空间有限，但是，考虑到国内货币政策空间受限，海外风险事件较多，风险偏好难以提升。四季度市场大概率维持弱势震荡。在市场风险偏好难提升的背景下，预计低估值高股息率的蓝筹股会继续受到市场青睐，同时，受益于财政发力的基建以及 PPP 概念股也有望继续获得市场的关注。

#### 4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 2016 年 09 月 30 日，该基金连续二百一十三个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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	12,965,126.19	74.41
	其中：股票	12,965,126.19	74.41
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	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	4,434,801.91	25.45
7	其他资产	23,704.41	0.14
8	合计	17,423,632.51	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	982,583.99	5.77
C	制造业	10,266,636.20	60.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	434,934.00	2.55



F	批发和零售业	391,668.00	2.30
G	交通运输、仓储和邮政业	447,300.00	2.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和技术服务业	432,004.00	2.54
J	金融业	10,000.00	0.06
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	12,965,126.19	76.10

### 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	600519	贵州茅台	3,679	1,096,010.89	6.43
2	300444	双杰电气	24,800	711,264.00	4.17
3	002179	中航光电	17,501	706,340.36	4.15

4	002013	中航机电	42,700	696,864.00	4.09
5	002635	安洁科技	22,611	691,444.38	4.06
6	603328	依顿电子	22,000	620,620.00	3.64
7	002236	大华股份	37,300	578,523.00	3.40
8	002583	海能达	44,563	547,679.27	3.21
9	000858	五 粮 液	15,700	523,752.00	3.07
10	600060	海信电器	29,900	497,536.00	2.92

#### 5.4 报告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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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。

### 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。

## 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、关于海能达（代码：002583）的处罚说明

2016年3月21日深圳证券交易所对海能达通信股份有限公司董事兼副总经理武美给予通报批评处分的决定，具体内容如下：

当事人：

武美，海能达通信股份有限公司董事兼副总经理。

经查明，武美存在以下违规行为：

武美于2015年12月17日通过二级市场减持公司股份37,760股，减持金额为491,257.60元。

武美的减持行为违反了中国证券监督管理委员会公告(2015)18号中有关“从即日起6个月内，上市公司控股股东和持股5%以上股东及董事、监事、高级管理人员不得通过二级市场减持本公司股份”的规定以及本所《股票上市规则（2014年修订）》第1.4条和第3.1.8条的规定和《中小板上市公司规范运作指引（2015年修订）》1.3条、第3.8.1条的规定。

鉴于武美的上述违规事实和情节，根据本所《股票上市规则（2014年修订）》第17.3条的规定，经本所纪律处分委员会审议通过，本所作出如下处分决定：对武美给予通报批评的处分。

对于武美的上述违规行为和本所给予的上述处分，本所将记入上市公司诚信档案，并向社会公布。

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。此次事件属于管理人员的个人行为，公司日常经营活动一切正常，我们判断短期负面影响有限，因此买入并持有公司股票。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	18,885.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	944.20
5	应收申购款	3,874.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,704.41

#### 5.11.4 报告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。

#### 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

报告期期初基金份额总额	20,550,222.97
报告期期间基金总申购份额	2,595,379.31
减：报告期期间基金总赎回份额	3,544,613.38
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	19,600,988.90

**§ 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**

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**§ 8 影响投资者决策的其他重要信息**

1、2016 年 7 月 21 日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安消费主题混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告；

2、2016 年 8 月 27 日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》和 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 上公布金元顺安消费主题混合型证券投资基金 2016 年半年度报告及摘要。

**§ 9 备查文件目录**

## 9.1 备查文件目录

- 1、《金元顺安消费主题混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《金元顺安消费主题混合型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《金元顺安消费主题混合型证券投资基金托管协议》。

## 9.2 存放地点

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

<http://www.jysa99.com>

金元顺安基金管理有限公司

二〇一六年十月二十五日