

## 金元顺安消费主题混合型证券投资基金更新招募说明书摘要[2016年2号]

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

二〇一六年十月

### 重要提示

金元顺安消费主题混合型证券投资基金（原名：金元惠理消费主题股票型证券投资基金，以下简称“本基金”）根据2010年7月15日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准金元比联消费主题股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2010]963号）和2010年8月3日《关于金元比联消费主题股票型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2010]470号）的核准，进行募集。本基金基金合同于2010年9月15日生效。

金元比联基金管理有限公司于经上海市工商行政管理局名称变更预核准，于2012年3月20日更名为金元惠理基金管理有限公司，本基金基金名称于2012年3月20日相应变更为“金元惠理消费主题股票型证券投资基金”，上述变更事项依据《公开募集证券投资基金管理公司管理办法》等相关法律法规的规定向中国证监会完成备案手续。

金元惠理基金管理有限公司于经上海市工商行政管理局名称变更预核准，于2015年3月6日更名为金元顺安基金管理有限公司，本基金基金名称于2015年7月15日相应变更为“金元顺安消费主题混合型证券投资基金”，上述变更事项依据《公开募集证券投资基金管理公司管理办法》等相关法律法规的规定向中国证监会完成备案手续。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，基金管理人并不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险；个别证券特有的非系统性风险；由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2016年9月14日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年6月30日。

### 一、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：金元顺安基金管理有限公司

注册地址：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

办公地址：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

成立日期：2006年11月13日

法定代表人：任开宇

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2006]222号

经营范围：募集基金、管理基金和经中国证监会批准的其他业务（涉及行政许可的凭证经营）

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 2.45 亿元

存续期间：持续经营

联系人：孙筱君

联系电话：021-68882850

股权结构：金元证券股份有限公司占公司总股本的 51%，上海泉意金融信息服务有限公司占公司总股本的 49%。

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司的权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的执行机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由 8 名董事组成，其中 3 名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会履行《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由 4 名监事组成，其中包括 2 名职工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

公司日常经营管理由总经理负责。公司根据经营运作需要设置基金投资部、专户投资部、固定收益及量化部、研究部、产品开发部、市场营销部、机构理财部、北京分公司（筹）、华东营销中心、华南营销中心、信息技术部、基金事务部、交易部、财务部、人事行政部、监察稽核部、资产管理部、金融同业部和投资部等 19 个职能部门。此外，公司董事会下设风险控制与合规审核委员会、资格审查委员会和薪酬管理委员会，公司总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会。

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人董事会成员

任开宇先生，董事长，博士学位。曾任长春证券有限公司总裁助理，新华证券有限公司监事长，金元证券有限公司投行总监。2008 年至今，任金元证券股份有限公司副总裁；2010 年 7 月出任金元惠理基金管理有限公司董事，2010 年 9 月出任金元惠理基金管理有限公司董事长。

史克新先生，董事，学士学位。曾任珠海会计师事务所注册会计师、君安证券有限公司审计师、北大方正投资有限公司副总经理、兴安证券东莞营业部总经理和深圳丽晶生物技术有限公司董事长。2007 年至今，任金元证券股份有限公司经纪服务总部总经理、副监事长。

冷天晴先生，董事，学士学位，冷天晴先生长期在军区部队服役，主要从事军队内部的管理工作，后相继于多家大型企业担任总经理、执行董事等高级职务，曾于 2012 年 9 月至 2013 年 5 月担任云南建投集团动力配煤股份有限公司总经理，现担任云南九天投资控股集团有限公司总经理，主持公司的全面工作，此外兼任云南滇中供应链管理有限公司执行董事、深圳滇中商业保理有限公司执行董事。

栗旻先生，董事，硕士学位。栗旻先生长期在中国农业银行多个岗位担任管理职位，自 1996 年始至 2012 年在农业银行先后担任了分行营业部公司业务部/国际业务部担任副总经理、总经理，在农行云南省分行下属的支行担任副行长、行长等职务。自 2012 年始担任深圳滇中商业保理有限公司总经理至今。

李宪英先生，独立董事，硕士学位。曾任大庆市第一医院医师、大庆市中胜律师事务所律师，现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人。

张屹山先生，独立董事。曾任吉林大学数学系助教，吉林大学经济管理学院任副教授，日本关西学院大学客座教授，天治基金管理有限公司独立董事；1992 年 5 月，出任吉林大学商学院院长、博士生导师。

潘书鸿先生，独立董事，学士学位。潘书鸿先生曾于 1995 年至 1999 年任上海功茂律师事务所行政主管，于 1999 年至 2006 年任上海崇林律师事务所（后更名为上海海之纯律师事务所）行政主管，此后自 2006 年至今在上海恒建律师事务所担任主任律师、首席合伙人。另外，潘书鸿先生自 2013 年至今在第十届上海律师协会担任副会长，自 2016 年至今在上海仲裁委员会担任仲裁员。

张嘉宾先生，董事，公司总经理，兼任子公司董事长，工商管理硕士。曾任深业美国公司（新泽西）副总裁，瑞银华宝（纽约）业务经理，富国基金管理有限公司总经理助理、市场总监，信诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官，中国光大资产管理有限公司（香港）首席运营官，民生加银基金管理有限公司总经理。

### 2、基金管理人监事会成员

吴毓锋先生，监事会主席，硕士学位，金元证券股份有限公司财务总监。曾任海南省国际信托投资公司证券营业部财务经理，历任金元证券股份有限公司财务部业务主管、助理总经理、副总经理和总经理。

李春光先生，监事，硕士学位，具有上海证交所颁发的董秘资格证书。李春光先生于 2005 年至 2015 年在云南凌云律师事务所担任律师，自 2015 年至今在上海泉意金融信息服务有限公司担任副总经理。

陈渝鹏先生，员工监事，兼任子公司监事会主席，硕士学位，天元顺安基金管理有限公司信息技术部总监。曾任银通证券信息部主管，天元证券电脑总部助理主管工程师。

洪婷女士，员工监事，大专学历，天元顺安基金管理有限公司财务部总监助理。曾任职于昆山组合服饰有限公司出纳及华尔街英语金茂培训中心财务会计。

### 3、管理层人员情况

任开宇先生，董事长，简历同上。

张嘉宾先生，总经理，简历同上。

凌有法先生，督察长，兼任子公司分管合规的副总经理，硕士学位。曾任华宝信托有限公司发展研究中心研究员、债券业务部高级经理，联合证券有限公司固定收益部业务董事，天元证券有限公司资产管理部首席研究员，首都机场集团公司资本运营部专家。

符刃先生，副总经理，兼任子公司分管运营的副总经理，硕士学位。曾任海南南国信资产管理公司总经理助理，香港海信投资有限公司总经理，历任天元证券有限公司基金筹备组负责人，公司督察长。

邝晓星先生，财务总监，兼任子公司财务总监，学士学位。曾任海南省国际信托投资公司上海宜山路证券营业部总经理，天元证券有限责任公司上海宜山路证券营业部总经理，天元证券有限责任公司财务总部经理助理，历任天元证券有限责任公司基金筹备组成员。

李锐先生，副总经理，硕士学位。曾任国金证券股份有限公司金融理财部总经理，中国民生银行石家庄分行历任金融市场部总经理助理（主持全面工作）、金融市场部副总经理（主持全面工作）。

### 4、本基金基金经理

#### (1) 现任基金经理

闵杭先生，投资总监，天元顺安消费主题混合型证券投资基金、天元顺安新经济主题混合型证券投资基金、天元顺安宝石动力混合型证券投资基金和天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月加入天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。

#### (2) 历任基金经理

黄奕女士，2010年9月至2013年4月；

冯志刚先生，2012年1月至2013年4月；

晏斌先生，2013年1月至2015年11月。

### 5、投资决策委员会成员的姓名和职务

张嘉宾先生，总经理，简历同上；

闵杭先生，基金经理，简历同上；

侯斌女士，天元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天元顺安宝石动力混合型证券投资基金、天元顺安核心动力混合型证券投资基金和天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月加入天元顺安基金管理有限公司，历任高级行业研究员，天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天元顺安核心动力混合型证券投资基金基金经理助理。14年基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

李杰先生，天元顺安丰利债券型证券投资基金、天元顺安丰祥债券型证券投资基金、天元顺安保本混合型证券投资基金和天元顺安金元宝货币市场基金基金经理，上海交通大学理学硕士。曾任国联安基金管理有限公司数量策略分析员、固定收益高级研究员。2012年4月加入天元顺安基金管理有限公司。9年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

### 6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一) 基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

## （二）主要人员情况

截至 2016 年 6 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 190 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

## （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 587 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 51 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 三、相关服务机构

### （一）直销机构

金元顺安基金管理有限公司

住所：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

办公地址：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

法定代表人：任开宇

邮政编码：200120

电话：021-68882850

传真：021-68882865

联系人：孙筱君

客户服务专线：400-666-0666，021-68882815

公司网址：www.jysa99.com

### （二）代销机构

#### 1、中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：杨菲

电话：（010）66107909

传真：（010）66107914

客户服务电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

#### 2、中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

联系人：刘一宁

电话：010-85108227

传真：010-68121816

客户服务电话：95599

公司网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

### 3、交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

联系人：张作伟

客户服务电话：95559

### 4、中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：常振明

联系人：王媛

电话：(010) 89937322

传真：(010) 65550827

客户服务电话：95558

公司网址：<http://bank.ecitic.com>

### 5、上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：姚磊

电话：(021) 61614467

传真：021-63602540

客户服务电话：95528

公司网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

### 6、华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：刘军祥

电话：(010) 85238820

传真：(010) 85238419

客户服务电话：95577

公司网站：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

### 7、平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

电话：（0755）22168073

传真：（0755）82080400

客户服务电话：95511-3

公司网址：[www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

#### 8、天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

电话：（010）66045152

传真：（010）66045500

客户服务电话：（010）66045678

网址：<http://www.txsec.com>，<http://jjjn.txsec.com>

#### 9、和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

法定代表人：王莉

联系人：刘英

电话：021-20835787

传真：010-85650806

客户服务电话：010-85625158

公司网址：[www.hexun.com](http://www.hexun.com)

#### 10、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼

法定代表人：汪静波

联系人：张裕

电话：（021）38602377

传真：（021）38509777

客户服务电话：400-821-5399

公司网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

#### 11、深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

联系人：童彩平

客户服务电话：4006-788-887

公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

#### 12、上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：徐汇区龙田路（近田东路）195号3C楼7楼

法定代表人：其实

联系人：朱玉

电话：021-54509998

客服电话：400-1818-188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

### 13、上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：陆敏

电话：(021) 2061 3638

传真：(021) 68596916

客户服务电话：400-700-9665

公司网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

### 14、杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：郭轶凡

电话：0571-60897840

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

网址：<http://www.fund123.cn/>

### 15、上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：唐诗洋

联系电话：021-20691942

客服电话：400-089-1289

传真：021-58787698

网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

### 16、北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：李悦

联系人：张晔

电话：010-56810330

客服热线：400-786-8868-5

公司网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

### 17、海银基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号陆家嘴金融服务广场 16F

法定代表人：刘惠

联系人：徐烨琳

电话：021-80133828

客服热线：400-808-1016

公司网址：[www.fundhaiyin.com](http://www.fundhaiyin.com)

18、国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：杨德红

联系人：朱雅威

电话：(021) 38676767

传真：(021) 38670666

客户服务电话：400-8888-666

公司网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

19、中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

电话：010-85156398

传真：(010) 65182261

客户服务电话：400-8888-108

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

20、招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755) 82960167

联系人：黄蝉君

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943636

客户服务电话：95565 或 400-8888-111

公司网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

21、广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广州市天河北路大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：(020) 87558888

传真：(020) 87553600

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

公司网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

22、中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明



客户服务电话：95548

传真：010-60833739

联系人：侯艳红

联系电话：010-60838995

公司网址：<http://www.cs.ecitic.com/>

23、中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客户服务电话：4008-888-888

传真：（010）66568990

联系人：邓颜

电话：（010）66568292

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

24、海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

电话：（021）23219000

传真：（021）23219100

客户服务电话：95553

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

25、申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：（021）33388211

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

国际互联网网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

26、兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

客服电话：95562

联系人：柯延超

电话：0591-38507950

传真：021-38565955

客户服务电话：95562

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

27、长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法人代表人：胡运钊

客服电话：95579 或 4008-888-999

联系人：奚博宇

电话：021-68751860

传真：027-85481900

网址：www.95579.com

#### 28、申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：李季

联系人：李巍

电话：010-88085201

传真：010-88085195

客服热线：4008-000-562

公司网址：<http://www.hysec.com/>

#### 29、国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市梅山路 18 号

办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号

法定代表人：蔡咏

联系人：陈琳琳

电话：（0551）62257012

传真：（0551）62272100

客户服务电话：95578 或 400-888-8777

#### 30、华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：盛宗龄

电话：（0755）82493561

传真：0755-82492962

客户服务电话：95597

公司网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

#### 31、公司名称：中信证券（山东）有限责任公司

法定代表人：杨宝林

注册和办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层（266061）

基金业务联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

公司网址：[www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

#### 32、信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

联系人：尹旭航

电话：（010）63081493

传真：（010）63080978

客户服务电话：400-800-8899

### 33、光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：黄素青

电话：（021）22169081

传真：（021）22169134

客户服务电话：10108998、4008888788、95525

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

### 34、金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

电话：（0755）83025022

传真：（0755）83025625

客户服务电话：4008-888-228

公司网址：[www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

### 35、中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人：赵大建

联系人：李微

电话：（010）59355941

传真：（010）66553791

客户服务电话：400-889-5618

公司网址：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

### 36、华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张宗锐

电话：（0591）87823053

传真：（0591）87383610

客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）

公司网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

### 37、上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 989 号中达大厦 2 楼

法定代表人：盛大

联系人：尹旭航

电话：（010）63081493

客服热线：400-893-6885

公司网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

38、北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：高静

电话：010-59158281

客服热线：400-893-6885

公司网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

39、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层

法定代表人：杨懿

联系人：张燕

电话：010-58325388

客服热线：400-166-1188

公司网址：<http://www.jrj.com.cn>

40、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层

法定代表人：杨懿

联系人：张燕

电话：010-58325388

客服热线：400-166-1188

公司网址：<http://www.jrj.com.cn>

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

41、兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路154号中山大厦

办公地址：福州市湖东路154号中山大厦

法定代表人：高建平

联系人：曾鸣

电话：（8621）52629999-218906

客服热线：95561

公司网址：<http://www.cib.com.cn>

42、浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路1号903室

办公地址：杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室

法定代表人：凌顺平

联系人：汪林林

电话：0571-88911818-8653

客服热线：4008-773-772

公司网址: <http://fund.10jqka.com.cn/>

43、上海汇付金融服务有限公司

注册地址: 上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址: 徐汇区虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 层

法定代表人: 冯修敏

联系人: 李栋

电话: 8621-33323999-8048

客服热线: 400-820-2819

公司网址: <http://www.chinapnr.com/>

44、上海陆金所资产管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人: 郭坚

联系人: 何雪

电话: 021-20662010

客服热线: 4008 6666 18

公司网址: <https://www.lu.com/>

45、中国国际金融股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址:

法定代表人: 丁学东

联系人: 杨涵宇

电话: 010-65051166-6493

客服热线: (+86-10) 6505 7590

公司网址: [http://www.cicc.com/index\\_cn.xhtml](http://www.cicc.com/index_cn.xhtml)

(三) 注册登记机构

名称: 金元顺安基金管理有限公司

注册地址: 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

办公地址: 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

法定代表人: 任开宇

电话: 021-68881801

传真: 021-68881875

(四) 律师事务所

名称: 上海通力律师事务所

注册地址: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人: 韩炯

电话: (021) 31358666

传真: (021) 31356000

联系人: 秦悦民

经办律师: 秦悦民、王利民

(五) 会计师事务所

名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址: 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

办公地址: 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

法人代表：葛明

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：汤骏

经办注册会计师：徐艳、汤骏

？

#### 四、基金的名称

金元顺安消费主题混合型证券投资基金

#### 五、基金的类型

混合型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

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。

#### 七、基金的投资范围

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。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的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%。

#### 八、基金的投资策略

本基金的股票投资采取行业配置指导下的个股精选方法，即：首先进行消费主题行业的投资价值评估，确定拟投资的优势行业；其次进行行业内个股的精选，从品质、增长和估值三个维度精选优质消费主题股票构建股票组合。

##### 1、消费主题行业范畴的界定

本基金采用的行业分类基准是摩根斯坦利和标准普尔联合发布的“全球行业分类标准（Global Industry Classification Standard，GICS）”。目前，GICS的行业划分包括10个行业板块（Sectors）、24个行业组（Industry groups）、68个行业（Industries）和154个子行业（Sub-industries）。

考虑到主题投资的特点，本基金将消费主题的行业范畴做如下界定：非日常生活消费品、日常消费品、医疗保健、金融、信息技术、电信服务、公用事业以及工业中的运输。本基金拟投资的消费主题行业总共包括8个一级行业和20个二级行业。详见下表。

##### 消费主题行业范畴的界定

一级行业（行业板块） 二级行业（行业组）

非日常生活消费品 汽车与汽车零部件

耐用消费品与服装

消费者服务

媒体

零售业

日常消费品 食品与主要用品零售

食品、饮料

家庭与个人用品

医疗保健 医疗保健设备与服务

制药、生物技术和生命科学

金融 银行

综合金融

保险

房地产

信息技术 软件与服务

技术硬件与设备

半导体产品与设备

电信服务 电信服务

公用事业 公用事业

工业 运输

## 2、资产配置策略

本基金的资产配置策略分为两个层次：第一层为基于“自上而下”的大类资产配置策略，以确定基金资产在股票、债券和现金之间的比例；第二层采取主动投资方法构建本基金的股票组合。

## 3、大类资产配置策略

本基金将遵循定量与定性分析相结合原则、及时性原则、动态调整原则三大原则，通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析的有机结合进行大类资产配置。

一方面，本基金将分析和预测众多的宏观经济变量和关注经济结构调整过程中政策、法规的相关变化，另一方面，本基金会对股票市场整体估值水平、债券市场整体收益率曲线变化进行定量分析，从而得出对可投资市场走势和波动特征的判断。基于上述研究结果，本基金将决定股票、债券和现金等大类资产在给定区间内的动态配置。

## 4、股票投资策略

本基金的股票投资采取行业配置指导下的个股精选方法，即：首先进行消费主题行业的投资价值评估，确定拟投资的优势行业；其次进行行业内个股的精选，从品质、增长和估值三个维度精选优质消费主题股票构建股票组合。

### （1）消费主题行业的选择与配置

#### 1) 行业投资价值评估方法

本基金以“全球行业分类标准（GICS）”作为行业划分依据。在此基础上，本基金管理人建立了系统完善的行业投资价值评估体系——“行业配置综合评分模型”。该模型将影响消费主题行业投资价值的若干因素归结为定性因素和定量因素的判断和预测问题，通过因素主观赋权和打分排序的方法来判断行业的超额收益潜力。

在消费主题行业的选择与配置过程中，本基金管理人以五分制为基础，将行业的投资价值从六个主因素进行评估：产业结构、国家政策、景气度、盈利状况、市场表现以及相对价值。本基金管理人的投资团队结合各证券研究机构的行业研究成果与个人的分析判断，给出行业评分和行业评述，从而得到该行业各因素的得分，然后将各因素得分加总，从而得到行业的综合评分。

#### 2) 行业配置比例与调整

本基金股票组合根据消费主题行业综合得分对行业进行排序，取排名在前的行业作为拟投资行业。具体方法如下：对于投资价值评估得分高的若干行业，给予“增持”的评级，即在该行业市场权重的基础上增加一定比例的投资；对于评分居中的行业，本基金给予“中性”的评级，即在资产配置时维持该行业的市场权重；对于投资价值评估得分低的若干行业，本基金给予“减持”的评级，即在该行业市场权重的基础上减少一定比例的投资。

本基金管理人每季度对全部行业的投资价值进行综合评分和排序，并由此决定不同行业的投资权重。

### （2）消费主题股票精选方法

本基金股票组合在行业配置指导下从品质、增长和估值三个维度精选优质消费主题股票构建股票组合。本基金股票组合采取因素主观赋权和打分排序的方法进行股票精选。

#### 1) 品质精选的具体方法

下表展示了股票组合进行质地精选的指标框架。该框架将股票品质比较的实现问题归结为三类指标：利润率、速度和稳健。三类指标又分别包括几个基本指标。

#### 股票组合品质精选的指标框架

指标类别 基本指标

利润率 净利润率

净资产收益率

主营业务利润率

速度 存货周转率

应收账款周转率

稳健 速动比率

流动比率

净负债率

## 2) 增长精选的具体方法

下表展示了股票组合进行增长精选的指标框架。该框架主要从增长的表现和质量 2 个角度进行股票的遴选。

### 股票组合增长精选指标框架

指标类别 基本指标

增长表现 每股收益增长率

主营业务收入增长率

增长质量 净利润率的变化

主营业务利润率的变化

## 3) 估值考量的具体方法

本基金估值分析方法主要采用专业的估值模型，结合行业的不同特征，合理使用估值指标。具体采用的方法包括股利折现模型、自由现金流折现模型、市盈率法、市净率法、EV/EBITDA 等方法。

## 4) 个股确定方法

依据行业投资价值排序结果及上述股票精选框架，本基金在行业内将相关个股按各个指标由高到低进行排序，选取每个行业内综合分值排在前十名的股票作为股票组合的拟投资标的。其次结合估值考量，选择被低估的股票，形成优化的股票组合。

## 5) 股票组合的调整

本基金将根据股票品质、增长和估值状况的发展变化定期调整股票组合。

## 5、债券组合的构建与管理

本基金在满足流动性及风险监控要求下，通过宏观经济方面自上而下的分析及债券市场方面自下而上的判断，把握市场利率水平的运行态势，根据债券市场收益率曲线的整体运动方向进行债券投资。具体的投资策略主要有：

### (1) 票息策略

票息策略是指投资于较高票息的债券，通常来说，高票息债券一般为中长期国债或信用等级低于国债的企业债券、次级债以及基金所允许投资的其它固定收益类产品。在利率水平及信用水平维持稳定的情况下，通过投资高票息债券，可以获取较高的利息收入，在提高债券组合的整体收益率水平的同时也获取较高的投资回报。

### (2) 息差策略

息差策略是指利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券的策略。息差策略实际上就是杠杆放大策略。在进行放大策略操作时，必须考虑回购资金成本与债券收益率之间的关系。只有当债券收益率高于回购资金成本（即回购利率）时，息差策略才能取得正的收益。

### (3) 利差策略

利差策略是指对两个期限相近的债券的利差进行分析，从而对利差水平的未来走势做出判断，进而进行相应的债券置换。影响两个期限相近的债券的利差水平的因素主要有息票因素、流动性因素及信用评级因素等。当预期利差水平缩小时，可以买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两个债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，可以买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券，通过两个债券利差的扩大获得投资收益。利差策略实际上是某种形式上的债券互换，也是相对价值投资的一种常见策略。随着信用市场的发展，本基金将密切关注企业债以及其它固定收益类产品的信用状况的变化，从中分析信用利差的走势，积极进行信用利差投资策略。

## 6、其他资产投资策略

### (1) 权证投资策略

本基金将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型计算权证价值。本基金权证操作将根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性



等特性结合本基金的需要进行该产品的投资。主要考虑运用的策略包括：限量投资、趋势投资、优化组合策略、价差策略、双向权证策略等。

#### (2) 资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### 7、现金头寸管理

为了尽可能避免基金操作过程中出现的现金过度和现金不足现象对基金运作的拖累，在现金头寸管理上，本基金通过对内生性与外生性未来现金流的预测进行现金预算管理，及时满足本基金运作中的流动性需求。

#### (五) 投资决策依据

- 1、国家有关法律法规、基金合同和本基金管理人内部相关制度的有关规定；
- 2、宏观经济、产业状况、上市公司基本面及相关政策等可能的影响因素；
- 3、可投资品种的预期风险、预期收益水平。

#### (六)、投资管理流程

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中责任明确、密切合作，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的投资管理程序如下：

- 1、研究部通过自身研究及借助外部研究形成有关公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析以及数据模拟的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。
- 2、投资决策委员会定期召开会议，并依据上述报告为基金的投资方向、资产配置比例等提出指导性意见；如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议作出决策。
- 3、基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身对证券市场和上市公司的分析判断，形成基金投资计划，包括资产配置、行业配置、股票和债券选择，以及买卖时机。
- 4、交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行投资组合计划，进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。
- 5、风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施，监察部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制，基金经理依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险。

#### (七)、投资限制

##### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

##### 2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- (2) 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%；
- (3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

(5) 本基金股票投资比例为基金资产的 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%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(9) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(10) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

(11) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

在本基金成立起不超过 6 个月，应达到上述比例限制。由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动或基金托管人对基金管理人投资监督等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个工作日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

基金托管人对基金的投资的监督和检查自本基金合同生效之日起开始。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准为中国债券总指数。本基金的整体业绩基准为：

沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%

本基金选择上述业绩比较基准的理由如下：

沪深 300 指数由专业指数提供商“中证指数有限公司”编制和发布，由从上海和深圳证券交易所中选取的 300 只 A 股作为样本股编制而成。该指数以成份股的自由流通股数进行加权，指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性和市场影响力。

中国债券总指数是中央国债登记结算有限责任公司编制的，采用市值加权计算的债券指数，其中涵盖了可流通的记账式国债和金融债，基本上可以反映中国债券市场的趋势特征。由于该债券指数较好地反映了我国债券市场价格总水平的波动幅度和变动趋势，涵盖的投资范围较宽，作为本基金固定收益证券投资的投资基准较为适当。

随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金，或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者出现更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 2 个工作日在至少一种指定媒体上予以公告。

## 十、基金的风险收益特征

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，高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种。

### (十) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

### (十一) 基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

## 十一、基金的投资组合报告

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基金合同规定，于 2016 年 9 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。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 6 月 30 日。

### 1. 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 13,466,096.22 70.59

其中：股票 13,466,096.22 70.59

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 5,520,524.68 28.94

7 其他各项资产 90,574.40 0.47

8 合计 19,077,195.30 100.00

## 2. 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 --

C 制造业 9,161,898.89 49.56

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 379,746.00 2.05

F 批发和零售业 498,649.20 2.70

G 交通运输、仓储和邮政业 --

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 1,808,517.00 9.78

J 金融业 --

K 房地产业 --

L 租赁和商务服务业 293,461.13 1.59

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 1,323,824.00 7.16

S 综合 --

合计 13,466,096.22 72.85

## 3. 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 1,073,973.68 5.81

2 300339 润和软件 26,000 931,840.00 5.04

3 002343 慈文传媒 18,900 916,650.00 4.96

4 002100 天康生物 100,500 903,495.00 4.89

5 603328 依顿电子 25,500 753,270.00 4.07

6 002583 海能达 60,700 730,828.00 3.95

7 002649 博彦科技 17,700 700,389.00 3.79  
8 002123 荣信股份 31,600 656,964.00 3.55  
9 002179 中航光电 13,301 576,199.32 3.12  
10 002013 中航机电 42,700 575,596.00 3.11

#### 4. 期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5. 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明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 6. 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。

#### 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。

#### 8. 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投资。

#### 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 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。

##### 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。

#### 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 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。

##### 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。

##### 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。

#### 11. 投资组合报告附注

(1) 本基金本期投资的前十名证券中有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

##### 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。

(2) 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 期末其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 28,898.42

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 960.53

5 应收申购款 60,715.45

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 90,574.40

(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。

(5) 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。

(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。

## 十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2016 年 6 月 30 日。

?

### 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 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

2010-9-15 至 2010-12-31 -0.60% 1.25% 3.90% 1.37% -4.50% -0.12%

2011-1-1 至 2011-12-31 -18.71% 1.11% -19.90% 1.04% 1.19% 0.07%

2012-1-1 至 2012-12-31 4.46% 1.17% 6.20% 1.02% -1.74% 0.15%

2013-1-1 至 2013-12-31 7.11% 1.53% -6.83% 1.12% 13.94% 0.41%

2014-1-1 至 2014-12-31 27.99% 1.37% 41.98% 0.97% -13.99% 0.40%

2015-1-1 至 2015-12-31 -4.67% 2.75% 6.67% 1.99% -11.34% 0.76%

2016-1-1 至 2016-6-30 -18.40% 2.36% -12.36% 1.48% -6.04% 0.88%

自基金合同生效起至今 -10.00% 1.74% 9.29% 1.31% -19.29 0.43%

### 重要提示:

(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) 业绩比较基准: 80%\*沪深 300 股票指数+20%\*中国债券总指数;

(3) 本基金合同生效日为 2010 年 9 月 15 日;

(4) 数据截止日期为 2016 年 6 月 30 日。

2、自基金合同生效以来基金累计份额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：

重要提示：

投资组合中各项资产的投资比例均符合各项法规和基金合同约定。

？

### 十三、费用概览

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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。

##### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

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。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—8 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

？

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、“重要提示”部分对招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期进行了更新；
- 2、“基金管理人”部分对基金管理人概况和主要人员情况进行了更新；
- 3、“基金托管人”部分对基金托管人情况进行了更新；
- 4、“相关服务机构”部分更新了直销机构和代销机构；
- 5、“基金的投资”部分对投资组合报告内容更新；
- 6、“基金的业绩”部分对基金业绩更新至 2016 年 6 月 30 日。

金元顺安基金管理有限公司

二〇一六年十月二十九日