

金元顺安核心动力混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 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：二〇一七年三月二十九日

§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 2017 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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§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
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	27,286,028.30 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌有法	郭明
	联系电话	021-68881801	010-66105799
	电子邮箱	service@jysa99.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-666-0666	95588
传真		021-68881875	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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	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	易会满

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.jysa99.com
基金年度报告备置地点	本基金管理人、基金托管人办公地址

§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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-3,145,296.78	21,730,296.57	9,314,999.71
本期利润	-5,056,238.40	8,387,796.29	27,583,791.79
加权平均基金份额本期利润	-0.1759	0.2076	0.3375
本期加权平均净值利润率	-16.85%	17.13%	46.35%
本期基金份额净值增长率	-14.59%	5.80%	53.77%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	349,298.18	5,517,539.18	3,108,830.40
期末可供分配基金份额利润	0.0128	0.1859	0.0414
期末基金资产净值	27,635,326.48	35,203,806.54	84,158,470.96
期末基金份额净值	1.013	1.186	1.121
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	1.30%	18.60%	12.10%

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	-1.75%	0.68%	1.90%	0.61%	-3.65%	0.07%
过去六个月	-1.94%	0.77%	4.46%	0.61%	-6.40%	0.16%
过去一年	-14.59%	1.15%	-6.10%	1.01%	-8.49%	0.14%
过去三年	38.96%	1.58%	40.21%	1.42%	-1.25%	0.16%
过去五年	36.71%	1.42%	35.27%	1.29%	1.44%	0.13%
自基金合同生效起至今	1.30%	1.34%	5.29%	1.25%	-3.99%	0.09%

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 2016 年 12 月 31 日)



注：

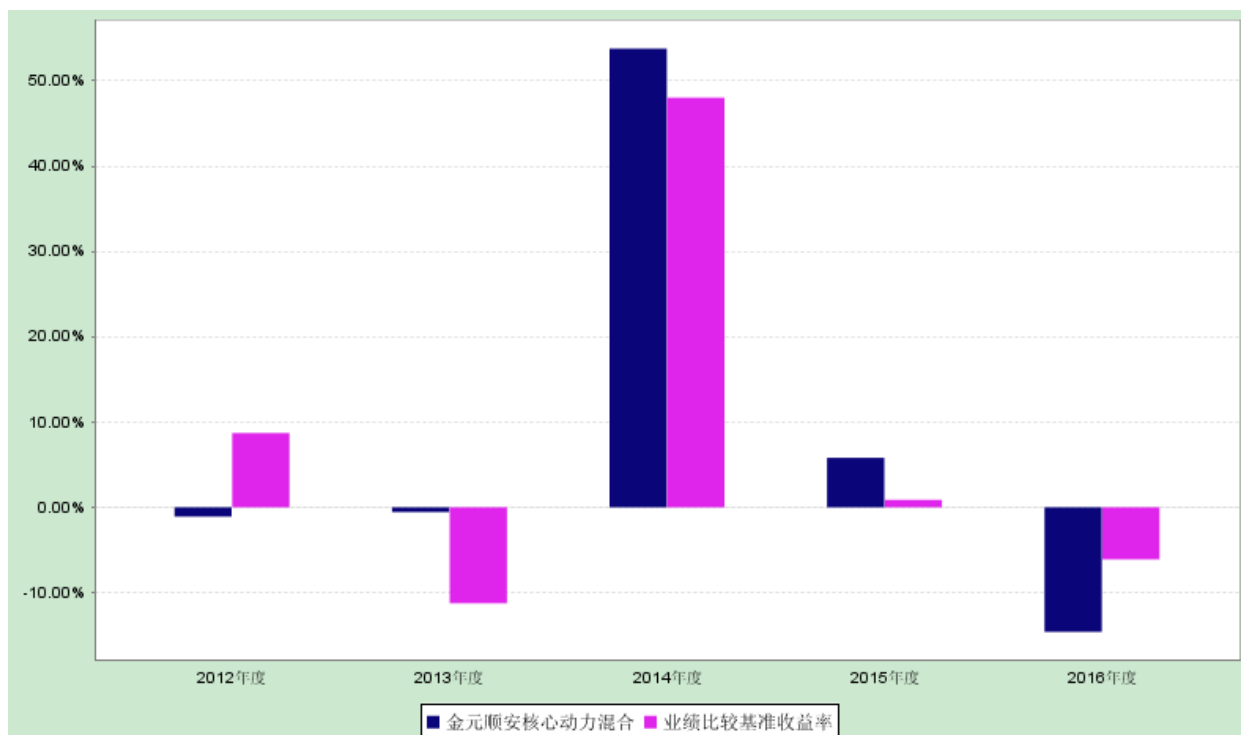
1、本基金合同生效日为2010年2月11日；

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（以下简称“金元顺安”）成立于2006年11月，由金元证券股份有限公司（以下简称“金元证券”）与比利时联合资产管理公司（以下简称“比联资管”）共同发起设立的中外合资基金管理有限公司。公司总部设在上海陆家嘴，旗下设立了北京分公司，以及一个子公司——金元百利资产管理有限公司。2012年3月，经中国证监会核准，比联资管将所持有的49%股权转让于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。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，公司注册资本增加至24,500万元。2016年3月，经中国证监会核准，惠理香港将所持有的49%股权转让于上海泉意金融信息服务有限公司（以下简称“泉意金融”）。

金元顺安始终坚持以“取信于市场、取信于社会为行为准则，诚实信用，勤勉尽责，以专业经营方式管理和运作基金财产和客户资产，在合法、合规的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，从而使公司稳步、健康发展”的投资理念，遵守法律、行政法规和中国证监会的规定，遵守社会公德、商业道德，诚实守信，遵循基金份额持有人利益优先、公平对待其管理的不同基金财产和客户资产的原则，接受政府和社会公众的监督，承担社会责任。

截止至2016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证券投资基金、金元顺安核心动力混合型证券投资基金、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、金元顺安金元宝货币市场基金和金元顺安沅楹债券型证券投资基金共11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		
侯斌	本基金基	2015-07-03	-	14	金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资

	金经理			基金、金元顺安宝石动力混合型证券投资基金和金元顺安核心动力混合型证券投资基金的基金经理，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月加入金元顺安基金管理有限公司，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，金元顺安核心动力混合型证券投资基金基金经理助理，金元顺安价值增长混合型证券投资基金基金经理。14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》、《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》、《金元顺安核心动力混合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

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》，建立了科学完善的制度和流程，从事前、事中、事后等各个业务环节严格控制不同基金之间可能存在的利益输送，覆盖了全部开放式基金及特定客户资产管理组合；涵盖了境内上市股票、债

券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节。

在投资环节，本基金管理人建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。在交易环节，为确保交易的公平执行，本基金管理人交易管理实行集中交易，投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开，各投资组合的所有证券买卖活动须通过交易部集中统一完成。在报告分析环节，本基金管理人每季度和每年对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异、对连续四个季度期间内、不同时间窗内（日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差进行分析，根据收益率差异和交易价差的大小，说明是否符合公平交易的原则，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。本报告期内，本基金管理人严格遵守公司投资交易业务流程及公平交易制度。公司投资交易行为监控体系由稽核监察部和交易室监督，确保公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，本基金管理人对旗下开放式基金与其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》及其他相关法律法规和公司内部规章制度，制定了《金元顺安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，涵盖了所有可投资证券的一级市场申购、二级市场交易所公开竞价交易、交易所大宗交易、银行间债券交易以及非公开发行股票申购、以公司名义进行的一级市场债券交易等可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本基金管理人采用定量分析和定性分析相结合的方式，建立并严格执行有效的异常交易日常监控制度，形成定期交易监控报告，按照报告路线实行及时报告的机制。本报告期内，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，由于年底出现成长股普跌，导致基金出现一定幅度的回撤。

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-14.59%，业绩比较基准收益率为-6.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从国家宏观层面来看，2017 年的货币政策较 2016 年略紧，要求防范风险。从国内经济来看，经济仍然处于增速重心下移、经济结构调整阶段，但是外部环境更复杂，特朗普上台可能加剧中美贸易摩擦，美元升值可能导致新兴市场资金流入美国，人民币汇率和外汇储备变化需重点关注。市场风险偏好不高，压制整体估值水平。

从证券市场来看，大盘股在 16 年年底出现一波调整后，整体估值有所回落到不太高的水平，市场在没有黑天鹅出现的情况下，下跌空间有限。从现在的情况来看，地产销售仍然较好，也会带来产业链相关行业的景气延续。我们认为从全年角度来看，仍然可以通过精选个股获取绝对收益。

本基金将重点优选超跌个股、业绩超预期和消费类稳定增长类公司进行投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

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。估值工作小组由分管运营的副总经理、基金事务部、投资研究部、交易部、监察稽核部等部门总监组成。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。

分管运营的副总经理担任估值工作小组的组长, 分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。

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时, 可以提议召开估值工作小组会议。

3、投资研究部的职责分工

(1) 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问询;

(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、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。

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。

4.6.2 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。

4.7 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。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

§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2016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

2017年3月17日

§6 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对金元顺安基金管理有限公司金元顺安核心动力混合型证券投资基金证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告（安永华明（2017）审字第 60657709_B05 号）。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

6.1 管理层对财务报表的责任

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导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

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，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

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。

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。

6.3 审计意见

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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

注册会计师：汤骏、朱昀

§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：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,770,787.07	11,281,482.14
结算备付金		20,030.28	44,990.98
存出保证金		5,482.95	22,290.88
交易性金融资产	7.4.7.2	24,472,259.44	23,278,625.72
其中：股票投资	7.4.7.2	24,472,259.44	23,278,625.72
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		1,100,096.25	754,024.23
应收利息	7.4.7.5	554.96	2,068.04
应收股利		-	-
应收申购款		9.99	498.36

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		28,369,220.94	35,383,980.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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		551,754.83	-
应付赎回款		17.48	107.92
应付管理人报酬		36,612.20	44,780.32
应付托管费		6,102.05	7,463.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	79,407.83	67,821.78
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	60,000.07	60,000.41
负债合计		733,894.46	180,173.81
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	27,286,028.30	29,686,267.36
未分配利润	7.4.7.10	349,298.18	5,517,539.18
所有者权益合计		27,635,326.48	35,203,806.54
负债和所有者权益总计		28,369,220.94	35,383,980.35

注：报告期截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.013 元，基金份额总额 27,286,028.30 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
一、收入		-4,229,640.03	10,025,662.51
1.利息收入		34,842.50	58,339.39
其中：存款利息收入	7.4.7.11	29,485.75	56,625.77
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		5,356.75	1,713.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,355,006.66	23,244,707.41
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-2,888,324.98	22,713,049.26
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	533,318.32	531,658.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-1,910,941.62	-13,342,500.28
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	1,465.75	65,115.99
减：二、费用		826,598.37	1,637,866.22
1. 管理人报酬	7.4.10.2	450,235.28	741,000.48
2. 托管费	7.4.10.2	75,039.18	123,500.03
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	133,007.91	564,905.71
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	168,316.00	208,460.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,056,238.40	8,387,796.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,056,238.40	8,387,796.29

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：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	29,686,267.36	5,517,539.18	35,203,806.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,056,238.40	-5,056,238.40
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）	-2,400,239.06	-112,002.60	-2,512,241.66
其中：1.基金申购款	698,276.00	38,301.40	736,577.40
2.基金赎回款	-3,098,515.06	-150,304.00	-3,248,819.06
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）	27,286,028.30	349,298.18	27,635,326.48
项目	上年度可比期间 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

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，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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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

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

卖出股票于成交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成交日结转；

2、债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交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；

卖出债券于成交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

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

卖出权证于成交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成交日结转；

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 分部报告

本基金本报告期以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 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要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要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、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的

规定，2017年7月1日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

4、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]132号《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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

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	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
活期存款	2,770,787.07	11,281,482.14
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	2,770,787.07	11,281,482.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,568,716.69	24,472,259.44	903,542.75
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	23,568,716.69	24,472,259.44	903,542.75

项目	上年度末 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

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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日

应收活期存款利息	543.46	2,037.84
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	9.00	20.20
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	2.50	10.00
合计	554.96	2,068.04

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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	79,407.83	67,821.78
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	79,407.83	67,821.78

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016年12月31日	2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.07	0.41
预提审计费	60,000.00	60,000.00
预提信息披露费	-	-
合计	60,000.07	60,000.41

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,686,267.36	29,686,267.36
本期申购	698,276.00	698,276.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,098,515.06	-3,098,515.06
本期末	27,286,028.30	27,286,028.30

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	15,249,446.85	-9,731,907.67	5,517,539.18
本期利润	-3,145,296.78	-1,910,941.62	-5,056,238.40
本期基金份额交易产生的变动数	-1,142,463.28	1,030,460.68	-112,002.60
其中：基金申购款	338,511.97	-300,210.57	38,301.40

基金赎回款	-1,480,975.25	1,330,671.25	-150,304.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,961,686.79	-10,612,388.61	349,298.18

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日 至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年12月31日
活期存款利息收入	28,117.58	53,144.11
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	934.62	2,540.05
其他	433.55	941.61
合计	29,485.75	56,625.77

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日 至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年12月31日
卖出股票成交总额	41,912,688.97	209,573,900.84
减：卖出股票成本总额	44,801,013.95	186,860,851.58
买卖股票差价收入	-2,888,324.98	22,713,049.26

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 2016年1月1日 至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	533,318.32	531,658.15
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	533,318.32	531,658.15

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日 至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-1,910,941.62	-13,342,500.28
——股票投资	-1,910,941.62	-13,342,500.28
——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	-1,910,941.62	-13,342,500.28

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日 至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年12月31日
基金赎回费收入	1,465.75	60,737.21
其他	-	-
印花税返还	-	547.02
转换费收入	-	3,831.76
合计	1,465.75	65,115.99

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日	上年度可比期间 2015年1月1日

	至 2016 年 12 月 31 日	至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	133,007.91	564,905.71
银行间市场交易费用	-	-
合计	133,007.91	564,905.71

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	90,000.00	130,000.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费用	316.00	460.00
其他费用	-	-
合计	168,316.00	208,460.00

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

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

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	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、基金代销机构
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海泉意金融信息服务有限公司	基金管理人的股东
上海金元百利资产管理有限公司	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 2016年1月1日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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%

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 2016年1月1日至2016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
金元证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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
金元证券股份有限公司	9,338.86	2.93%	-	-

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 2016年1月1日 至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	450,235.28	741,000.48
其中：支付销售机构的客户维护费	58,031.51	158,914.28

注：

1、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。

2、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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	75,039.18	123,500.03

注：

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 2016 年 1 月 1 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日
----	----------------------	---------------------------

	至 2016 年 12 月 31 日	至 2015 年 12 月 31 日
报告期初持有的基金份额	13,548,780.49	13,548,780.49
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	49.65%	45.64%

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 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 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	14.88%	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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	2,770,787.07	28,117.58	11,281,482.14	53,144.11

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，2016年度获得的利息收入为人民币934.62元（2015年度获得的利息收入为人民币2,540.05元），2016年末结算备付金余额为人民币20,030.28元（2015年末结算备付金余额为人民币44,990.98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

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016-12-21	2017-01-03	新股未上市	4.00	4.00	1,000	4,000.00	4,000.00	-

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
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项停牌	14.60	-	-	5,300	122,695.00	77,380.00	-
603986	兆易创新	2016-09-19	重大资产重组	177.97	2017-03-13	195.77	90	2,093.40	16,017.30	-
000166	申万宏源	2016-12-21	重大事项停牌	6.25	2017-01-26	6.29	20,620	194,894.58	128,875.00	-
300104	乐视	2016-	重大资	35.80	2017-	36.88	4,600	235,062.00	164,680.00	-

	网	12-07	产重组		01-16					
601727	上海 电气	2016- 08-31	重大事 项停牌	8.42	-	-	10,900	123,977.42	91,778.00	-

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 2016 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 2016 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、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	2,770,787.07	-	-	-	2,770,787.07
结算备付金	20,030.28	-	-	-	20,030.28
存出保证金	5,482.95	-	-	-	5,482.95
交易性金融资产	-	-	-	24,472,259.44	24,472,259.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	1,100,096.25	1,100,096.25
应收利息	-	-	-	554.96	554.96
应收申购款	-	-	-	9.99	9.99
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,796,300.30	-	-	25,572,920.64	28,369,220.94
负债					
应付赎回费	-	-	-	0.07	0.07
应付管理人报酬	-	-	-	36,612.20	36,612.20
应付托管费	-	-	-	6,102.05	6,102.05
应付交易费用	-	-	-	79,407.83	79,407.83
应付销售服务费	-	-	-	-	0.00
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	0.00
应付利息	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	551,754.83	551,754.83
其他负债	-	-	-	-	0.00
应交税金	-	-	-	-	0.00
预提费用	-	-	-	60,000.00	60,000.00
应付赎回款	-	-	-	17.48	17.48
负债总计	-	-	-	733,894.46	733,894.46
利率敏感度缺口	2,796,300.30	-	-	24,839,026.18	27,635,326.48
上年度末 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	11,281,482.14	-	-	-	11,281,482.14
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	-	-	-	23,278,625.72	23,278,625.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	754,024.23	754,024.23
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	11,348,764.00	-	-	24,035,216.35	35,383,980.35
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	-	-	-	180,173.81	180,173.81
利率敏感度缺口	11,348,764.00	-	-	23,855,042.54	35,203,806.54

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，并按照合约规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2016年12月31日，本基金未持有交易性债券投资（2015年12月31日：同），银行存款、结算备付金及存出保证金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（2015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 2016年12月31日		上年度末 2015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	24,472,259.44	88.55	23,278,625.72	66.13
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	24,472,259.44	88.55	23,278,625.72	66.13

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	中证 100 指数上涨 5%	减少 136.39 万元	减少 112.06 万元
	中证 100 指数下跌 5%	增加 136.39 万元	增加 112.06 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。

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	合计	增加 43.57 万元	增加 134.95 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、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 2016 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 23,989,529.14 元，属于第二层次的余额为人民币 482,730.30 元，无属于第三层次的余额。（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。）

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 27,635,326.48 元，已连续超过 380 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《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，向中国证监会说明原因和报送解决方案。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。

除此以外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	24,472,259.44	86.26
	其中：股票	24,472,259.44	86.26
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	2,790,817.35	9.84
7	其他各项资产	1,106,144.15	3.90
8	合计	28,369,220.94	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	1,243,497.08	4.50

C	制造业	7,454,394.79	26.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	776,638.79	2.81
E	建筑业	1,252,187.60	4.53
F	批发和零售业	161,994.60	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	452,925.24	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	720,681.27	2.61
J	金融业	11,044,312.62	39.96
K	房地产业	1,148,459.50	4.16
L	租赁和商务服务业	32,821.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	87,020.95	0.31
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	97,326.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	24,472,259.44	88.55

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	41,513	1,470,805.59	5.32

2	600016	民生银行	110,482	1,003,176.56	3.63
3	601166	兴业银行	51,221	826,706.94	2.99
4	600036	招商银行	39,497	695,147.20	2.52
5	600519	贵州茅台	1,856	620,182.40	2.24
6	601328	交通银行	104,960	605,619.20	2.19
7	002508	老板电器	15,300	563,040.00	2.04
8	603611	诺力股份	14,700	561,246.00	2.03
9	000921	海信科龙	53,900	550,319.00	1.99
10	000937	冀中能源	81,100	546,614.00	1.98
11	600000	浦发银行	33,018	535,221.78	1.94
12	000002	万科 A	25,954	533,354.70	1.93
13	601668	中国建筑	57,195	506,747.70	1.83
14	600837	海通证券	30,893	486,564.75	1.76
15	000333	美的集团	17,180	483,960.60	1.75
16	600030	中信证券	30,098	483,373.88	1.75
17	601288	农业银行	147,055	455,870.50	1.65
18	601169	北京银行	46,480	453,644.80	1.64
19	000651	格力电器	18,400	453,008.00	1.64
20	600887	伊利股份	23,178	407,932.80	1.48
21	601766	中国中车	35,241	344,304.57	1.25
22	601601	中国太保	11,952	331,907.04	1.20
23	601211	国泰君安	17,500	325,325.00	1.18
24	600900	长江电力	25,253	319,702.98	1.16
25	000001	平安银行	32,878	299,189.80	1.08
26	600104	上汽集团	12,671	297,134.95	1.08
27	601988	中国银行	80,995	278,622.80	1.01
28	000725	京东方 A	91,100	260,546.00	0.94

29	601998	中信银行	39,901	255,765.41	0.93
30	601390	中国中铁	28,333	251,030.38	0.91
31	601989	中国重工	35,100	248,859.00	0.90
32	600048	保利地产	27,160	247,970.80	0.90
33	000858	五粮液	7,191	247,945.68	0.90
34	600276	恒瑞医药	5,350	243,425.00	0.88
35	601818	光大银行	61,099	238,897.09	0.86
36	600050	中国联通	32,197	235,360.07	0.85
37	600015	华夏银行	20,399	221,329.15	0.80
38	601688	华泰证券	12,317	219,981.62	0.80
39	600028	中国石化	40,400	218,564.00	0.79
40	601186	中国铁建	17,292	206,812.32	0.75
41	600518	康美药业	11,346	202,526.10	0.73
42	000776	广发证券	11,200	188,832.00	0.68
43	600958	东方证券	11,900	184,807.00	0.67
44	300104	乐视网	4,600	164,680.00	0.60
45	002415	海康威视	6,852	163,146.12	0.59
46	002024	苏宁云商	14,148	161,994.60	0.59
47	601006	大秦铁路	22,766	161,183.28	0.58
48	002304	洋河股份	2,241	158,214.60	0.57
49	601628	中国人寿	6,366	153,356.94	0.55
50	601857	中国石油	18,681	148,513.95	0.54
51	001979	招商蛇口	9,000	147,510.00	0.53
52	002736	国信证券	9,351	145,408.05	0.53
53	000063	中兴通讯	9,075	144,746.25	0.52
54	600795	国电电力	45,145	143,109.65	0.52
55	600999	招商证券	8,716	142,332.28	0.52

56	601899	紫金矿业	42,481	141,886.54	0.51
57	300059	东方财富	8,140	137,810.20	0.50
58	601377	兴业证券	17,900	136,935.00	0.50
59	601336	新华保险	3,108	136,068.24	0.49
60	600585	海螺水泥	7,624	129,303.04	0.47
61	000166	申万宏源	20,620	128,875.00	0.47
62	601985	中国核电	17,800	125,668.00	0.45
63	601088	中国神华	7,558	122,288.44	0.44
64	601901	方正证券	15,755	119,738.00	0.43
65	600019	宝钢股份	18,829	119,564.15	0.43
66	000538	云南白药	1,563	119,022.45	0.43
67	601788	光大证券	7,400	118,326.00	0.43
68	600637	东方明珠	5,000	116,500.00	0.42
69	600690	青岛海尔	11,578	114,390.64	0.41
70	601669	中国电建	15,592	113,197.92	0.41
71	000625	长安汽车	7,482	111,781.08	0.40
72	002673	西部证券	5,300	110,081.00	0.40
73	601600	中国铝业	25,100	105,922.00	0.38
74	600705	中航资本	17,200	105,264.00	0.38
75	600010	包钢股份	37,279	104,008.41	0.38
76	600886	国投电力	15,500	103,385.00	0.37
77	600111	北方稀土	8,253	101,264.31	0.37
78	002594	比亚迪	2,030	100,850.40	0.36
79	600893	中航动力	3,000	98,220.00	0.36
80	002739	万达院线	1,800	97,326.00	0.35
81	601727	上海电气	10,900	91,778.00	0.33
82	601800	中国交建	5,772	87,676.68	0.32

83	000069	华侨城 A	12,521	87,020.95	0.31
84	601618	中国中冶	18,610	86,722.60	0.31
85	002252	上海莱士	3,740	86,356.60	0.31
86	601198	东兴证券	4,300	86,258.00	0.31
87	600023	浙能电力	15,612	84,773.16	0.31
88	600606	绿地控股	9,300	81,003.00	0.29
89	600115	东方航空	11,400	80,598.00	0.29
90	600340	华夏幸福	3,300	78,870.00	0.29
91	000895	双汇发展	3,716	77,775.88	0.28
92	600485	信威集团	5,300	77,380.00	0.28
93	601018	宁波港	15,206	76,942.36	0.28
94	601111	中国国航	9,768	70,329.60	0.25
95	600959	江苏有线	5,870	66,331.00	0.24
96	600061	国投安信	4,200	65,562.00	0.24
97	600018	上港集团	12,475	63,872.00	0.23
98	600663	陆家嘴	2,700	59,751.00	0.22
99	601633	长城汽车	4,541	50,223.46	0.18
100	601225	陕西煤业	7,699	37,340.15	0.14
101	002027	分众传媒	2,300	32,821.00	0.12
102	002797	第一创业	900	31,320.00	0.11
103	600871	石化油服	6,900	28,290.00	0.10
104	603986	兆易创新	90	16,017.30	0.06
105	601375	中原证券	1,000	4,000.00	0.01

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	002245	澳洋顺昌	1,966,445.00	5.59
2	300336	新文化	1,850,936.00	5.26
3	002407	多氟多	1,673,787.00	4.75
4	603609	禾丰牧业	1,344,413.50	3.82
5	300407	凯发电气	1,261,273.00	3.58
6	300064	豫金刚石	1,245,110.00	3.54
7	002152	广电运通	1,237,310.00	3.51
8	600963	岳阳林纸	1,223,620.00	3.48
9	300303	聚飞光电	1,223,552.00	3.48
10	000690	宝新能源	1,217,274.00	3.46
11	002609	捷顺科技	1,204,458.75	3.42
12	002470	金正大	1,195,176.02	3.40
13	600818	中路股份	1,191,412.00	3.38
14	000988	华工科技	1,163,134.00	3.30
15	300135	宝利国际	1,122,586.90	3.19
16	601318	中国平安	1,122,060.00	3.19
17	300252	金信诺	966,900.00	2.75
18	600800	天津磁卡	966,656.00	2.75
19	002690	美亚光电	963,825.00	2.74
20	601600	中国铝业	936,682.00	2.66
21	300047	天源迪科	922,320.00	2.62
22	600978	宜华生活	920,354.00	2.61
23	002481	双塔食品	868,956.00	2.47

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	002245	澳洋顺昌	1,566,281.00	4.45
2	300303	聚飞光电	1,362,187.40	3.87
3	300407	凯发电气	1,307,428.00	3.71
4	600963	岳阳林纸	1,297,026.00	3.68
5	002470	金正大	1,269,990.70	3.61
6	300064	豫金刚石	1,258,992.20	3.58
7	300336	新文化	1,237,270.08	3.51
8	000690	宝新能源	1,212,680.00	3.44
9	002407	多氟多	1,202,958.00	3.42
10	002609	捷顺科技	1,128,527.90	3.21
11	603609	禾丰牧业	1,091,618.47	3.10
12	300135	宝利国际	1,067,709.00	3.03
13	601318	中国平安	1,059,140.84	3.01
14	600818	中路股份	1,042,994.00	2.96
15	600978	宜华生活	1,004,427.00	2.85
16	002690	美亚光电	969,759.00	2.75
17	002152	广电运通	968,454.00	2.75
18	300047	天源迪科	957,414.00	2.72
19	000988	华工科技	885,791.00	2.52
20	300007	汉威电子	855,533.00	2.43
21	002481	双塔食品	847,299.00	2.41
22	601600	中国铝业	817,138.00	2.32
23	600800	天津磁卡	808,649.00	2.30
24	300088	长信科技	710,175.00	2.02

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	47,905,589.29
卖出股票的收入（成交）总额	41,912,688.97

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 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

关于招商银行（代码：600036）的处罚说明

2016年1月6日吉林证监局对对招商银行股份有限公司长春分行采取责令改正措施的决定，具体内容如下：

我局于2015年12月3日至12月7日对你行进行了基金销售业务专项检查，经查，发现你行存

在以下问题：

一、你行未及时在网站更新基金销售人员资格情况，不符合中国证监会公告（2008）31号第二部分第四条“各基金销售机构应当在2009年1月底前，将全部基金销售网点及销售人员资格情况在公司网站上披露，同时抄报中国证券业协会。今后每年的1月和7月基金销售机构应当对以上信息进行更新并报送中国证券业协会”的规定。

二、你行部分从事基金销售业务的人员未取得基金销售业务资格，不符合《证券投资基金销售管理办法》第五十七条第二款“宣传推介基金的人员、基金销售信息管理平台系统运营维护人员等从事基金销售业务的人员应当取得基金销售业务资格”的规定。

三、你行《投资人权益须知》的内容未包括投资者投诉方式和程序，不符合《证券投资基金销售机构内部控制指导意见》第二十七条“基金销售机构制定《投资人权益须知》，内容至少应当包括：……（五）向基金销售机构、自律组织以及监管机构的投诉方式和程序”的规定。

四、你行在基金宣传推介材料中登载有个人的推荐性文字，不符合《证券投资基金销售管理办法》第三十五条“基金宣传推介材料必须真实、准确，与基金合同、基金招募说明书相符，不得有下列情形：……（六）登载单位或者个人的推荐性文字”的规定。

现要求你行对上述行为进行整改，并于2016年1月31日前向我局提交整改情况的书面报告，我局将组织检查验收。

如果对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定书之日起60日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起3个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

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。我们判断此次事件对公司短期负面影响有限，再者公司经营多元化，涉及多个领域，受到处罚不会对整体的业绩造成持续的影响，因此买入并持有公司股票。

8.9.2 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。

8.9.3 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	5,482.95
2	应收证券清算款	1,100,096.25
3	应收股利	-
4	应收利息	554.96
5	应收申购款	9.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,106,144.15

8.9.4 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。

8.9.5 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。

8.9.6 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
824	33,114.11	17,659,551.53	64.72%	9,626,476.77	35.28%

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

本报告期末本公司高管及投研部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§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	29,686,267.36
本报告期基金总申购份额	698,276
减：本报告期基金总赎回份额	3,098,515.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	27,286,028.30

§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，本基金未举行基金份额持有人大会。

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

1、本基金管理人于 2016 年 4 月 14 日公告，张津伟先生、王炎东先生不再担任公司董事，梁宝吉先生不再担任公司独立董事。同时选举冷天晴先生、栗旻先生为公司董事、潘书鸿先生为公司独立董事。

2、本基金管理人于 2016 年 8 月 27 日公告，聘任李锐先生担任公司副总经理。

3、《金元顺安沅楹债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 23 日正式生效，李杰先生担任该基金的基金经理。

4、本基金管理人于 2016 年 12 月 16 日公告，增聘缪纬彬先生担任金元顺安价值增长混合型证券投资基金的基金经理。同时，侯斌女士不再担任该基金的基金经理。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，未发生涉及本基金管理人、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，本基金的基金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。

本报告期末，应向安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）支付审计费用 60,000 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，针对中国证券业协会公告的《首次公开发行股票配售对象黑名单》（2016年第3号），本基金管理人高度重视，认真落实，加强内部管理、业务操作流程，强化流程管理，进一步提升本基金管理人内部控制和风险管理的能力。

本报告期内，中国证券监督管理委员会（下称“中国证监会”）上海监管局于2016年1月13日对本基金管理人下发《关于对金元顺安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》（沪证监决[2016]4号）。本基金管理人已根据法律法规、行政法规和中国证监会的要求落实整改。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
平安证券有限责任公司	1	24,496,424.31	27.30%	22,813.75	27.44%	-
国金证券股份有限公司	1	20,790,055.00	23.17%	18,946.01	22.79%	-
申银万国证券股份有限公司	1	10,287,076.51	11.47%	9,580.44	11.52%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	8,912,488.66	9.93%	8,300.14	9.98%	-
华创证券有限责任公司	1	8,704,239.47	9.70%	8,106.31	9.75%	-

公司						
海通证券股份有限公司	1	8,478,073.92	9.45%	7,895.56	9.50%	-
兴业证券股份有限公司	1	8,048,230.98	8.97%	7,495.53	9.02%	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
爱建证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

金元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国民族 证券有限 责任公司	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》（证监基金字<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 2016 年 12 月 31 日止，本基金新租用中国民族证券股份有限公司 1 个上海交易单元，方正证券股份有限公司 1 个深圳交易单元。

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
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	55,100,000.00	93.71%	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	3,700,000.00	6.29%	-	-

方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中国民族证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
----------------------	---	---	---	---	---	---

金元顺安基金管理有限公司

二〇一七年三月二十九日