

金元顺安丰利债券型证券投资基金

2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年四月二十四日

§ 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 4 月 21 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 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 金元顺安丰利债券 |
| 基金主代码 | 620003 |
| 交易代码 | 620003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009 年 3 月 23 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,181,856,124.34 份 |
| 投资目标 | 在注重资产安全性和流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的稳健收益和总回报。 |
| 投资策略 | 基于“自上而下”的原则，本基金采用久期控制下的主动性投资策略，并本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。经过对历史数据的统计分析发现，债券市场收益率受到宏观经济形势和债券市场供需两方面不同程度的影响，因此本基金在债券投资过程中，将采用若干定量模型来对宏观和市场两方面数据进行分析，并运用适当的策略来构建债券组合。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金，其风险收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 金元顺安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |

§ 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（2017年1月1日-2017年3月31日） |
|----------------|---------------------------|
| 1.本期已实现收益 | -4,442,544.68 |
| 2.本期利润 | -10,447,226.41 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0047 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,248,956,622.93 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.031 |

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 | -0.48% | 0.14% | -1.24% | 0.07% | 0.76% | 0.07% |

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、本基金在 2015 年 11 月 27 日将业绩比较基准由“中信标普全债指数”变更为“中债综

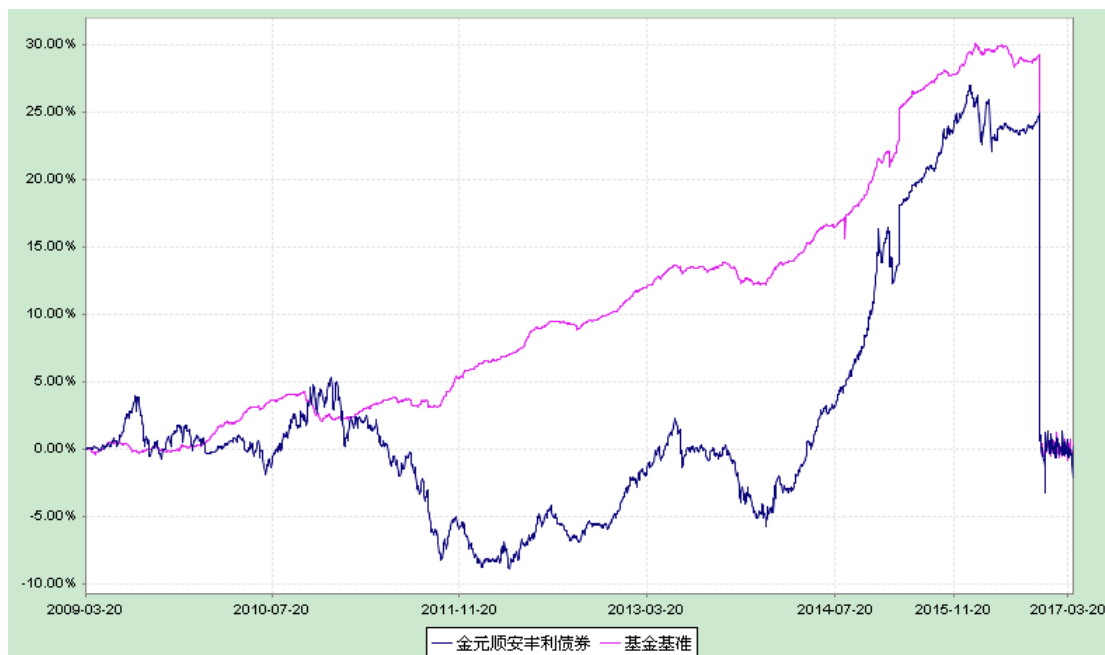
合指数”。

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

金元顺安丰利债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009 年 3 月 23 日至 2017 年 3 月 31 日)



注：

1、本基金合同生效日为 2009 年 3 月 23 日；

2、基金合同约定的投资比例为债券资产、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 60%-95%，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 2009 年 3 月 23 日至 2009 年 9 月 22 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。

§ 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 | | |
| 李杰 | 本基金基金经理 | 2012-6-14 | - | 10 | 金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金和金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 月加入金元顺安基金管理有限公司。10 年证券、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》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

2017 年一季度我国经济呈现开门红。GDP 同比增速 6.9%，创 5 个季度以来新高，工业生产稳重有升，固定资产投资、进出口金额都有所回升，消费保持稳定。这是 2016 年供给侧结构性改革和房地产销售火爆所带来持续影响。伴随经济复苏，信用也延续扩张态势。一季度新增信贷 4.5 万亿，非标融资扩张迅速，社会融资总量同比 12.5%，远远高于 GDP 增速。大宗商品价格继续上涨，PPI 保持在 7.6% 的高位；金融泡沫和金融风险上升。监管层采取了中性偏紧的货币政策，央行对公开市场操作和 MLF 进行了一系列加息措施，深入推进 MPA 宏观审慎政策。银监会等部门出台一系列文件加强对影子银行的监管，切实促进金融去杠杆。在多种措施的作用下，资金面偏紧，债市急剧波动。而股市在供给侧改革和经济复苏的背景，稳步上涨。一季度上证综合指数上涨 1.83%；中债总指数下跌 1.43%。

在报告期，本基金采取短久期债券策略，规避了债市下跌的风险；股票方面精选个股，灵活变化仓位，整体上获得了超越基准的表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金净值增长率为-0.48%，同期业绩比较基准增长率为-1.24%。本基金超

越基准 0.76%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前全球各经济体处于不同的周期，2017 年影响金融市场的因素比较复杂。具体看，美国就业市场和通胀水平接近政策目标，进入加息通道，但短期内“特朗普交易”有所减弱。日欧近期 PMI 有所反弹，显示经济有复苏迹象，但复苏动能非常微弱，显示经济仍在底部，其央行将继续采取宽松政策。中国在供给侧改革和居民房地产加杠杆的推动下，短期内信用扩张明显，通胀压力较大，金融体现风险隐现，对货币政策形成制约。因为一季度经济数据良好，政府对经济增长下滑的容忍度有所提高，监管层将保持中性货币政策，把金融防风险上升到主要位置。但随着房地产调控政策的深入，以及金融去杠杆的推进，预期下半年企业补库存周期结束，经济重回下行通道，有可能提升“稳增长”在政策中的比重。

在这样复杂的经济形势下，我们认为二季度流动性继续保持紧平衡，金融市场宽幅震荡，应该采取短久期防御策略，以获取票息收益为主要手段。同时积极参与波段性的交易机会。信用债方面，将坚持选择高评级信用债，防范信用风险。

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，本基金未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。

§ 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 | 440,760,507.92 | 16.54 |
| | 其中：股票 | 440,760,507.92 | 16.54 |
| 2 | 固定收益投资 | 2,098,308,378.00 | 78.74 |
| | 其中：债券 | 2,098,308,378.00 | 78.74 |
| | 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 | 30,000,245.00 | 1.13 |
| | 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 | 61,599,325.78 | 2.31 |
| 7 | 其他资产 | 34,257,880.24 | 1.29 |
| 8 | 合计 | 2,664,926,336.94 | 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 | - | - |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| C | 制造业 | 157,318,222.55 | 7.00 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 205,288,981.28 | 9.13 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 56,668,238.89 | 2.52 |
| K | 房地产业 | 21,485,065.20 | 0.96 |
| 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 | 440,760,507.92 | 19.60 |

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 | 600717 | 天津港 | 15,788,018 | 185,667,091.68 | 8.26 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 2 | 600160 | 巨化股份 | 4,004,575 | 44,891,285.75 | 2.00 |
| 3 | 300067 | 安诺其 | 4,121,628 | 33,920,998.44 | 1.51 |
| 4 | 601211 | 国泰君安 | 1,303,321 | 23,785,608.25 | 1.06 |
| 5 | 002531 | 天顺风能 | 3,150,044 | 23,058,322.08 | 1.03 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 833,900 | 22,865,538.00 | 1.02 |
| 7 | 300282 | 汇冠股份 | 861,098 | 21,630,781.76 | 0.96 |
| 8 | 600018 | 上港集团 | 3,325,744 | 19,621,889.60 | 0.87 |
| 9 | 300230 | 永利股份 | 547,094 | 17,824,322.52 | 0.79 |
| 10 | 000778 | 新兴铸管 | 2,939,800 | 15,992,512.00 | 0.71 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 55,147,200.00 | 2.45 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 180,804,000.00 | 8.04 |
| | 其中：政策性金融债 | 180,804,000.00 | 8.04 |
| 4 | 企业债券 | 410,944,200.00 | 18.27 |
| 5 | 企业短期融资券 | 587,913,000.00 | 26.14 |
| 6 | 中期票据 | 858,837,000.00 | 38.19 |
| 7 | 可转债 | 4,662,978.00 | 0.21 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 2,098,308,378.00 | 93.30 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 (张) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|-------------------|-----------|----------------|---------------|
| 1 | 120227 | 12 国开 27 | 1,000,000 | 100,660,000.00 | 4.48 |
| 2 | 101656027 | 16 武汉地产 MTN003 | 1,000,000 | 95,190,000.00 | 4.23 |
| 3 | 150406 | 15 农发 06 | 800,000 | 80,144,000.00 | 3.56 |
| 4 | 1180080 | 11 德清债 | 1,000,000 | 71,710,000.00 | 3.19 |
| 5 | 101452002 | 14 晋焦煤 MTN001 | 500,000 | 51,430,000.00 | 2.29 |

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。

关于国泰君安（代码：601211）的处罚说明

（1）中国证券监督管理委员会广东监管局行政处罚决定书（2016）2号（宋海龙）

当事人：宋海龙，男，1983年11月出生，住深圳市南山区。

依据《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）的有关规定，我局对宋海龙违法买卖股票行为进行了立案调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利，当事人未提出陈述、申辩意见，也未要求听证。本案现已审理终结。

经查明，宋海龙存在以下违法事实：

宋海龙系在国泰君安证券股份有限公司任职的证券从业人员，从业期间为2011年7月25日至调查日（2015年9月10日）。宋海龙从业期间利用其本人名下账户交易股票金额达2,617,803.10元，其中买入成交金额1,250,718.00元，卖出成交金额1,367,085.10元，本人名下账户亏损9,615.78元；宋海龙从业期间利用其配偶名下账户交易股票金额1,384,523.82元，其中买入成交金额854,693.82元，卖出成交金额529,830.00元，宋海龙操作其配偶名下账户有关交易的盈利为33,033.18元。宋海龙利用本人名下和其配偶名下的账户交易股票的总盈利为23,417.40元。

上述违法事实，有劳动合同、社保记录、相关证券账户资料、证券交易记录、银行账户流水、电脑查勘笔录，以及相关人员询问笔录、情况说明等证据证明，足以认定。

我局认为，宋海龙的上述行为违反了《证券法》第四十三条有关“证券交易所、证券公司和证券登记结算机构的从业人员、证券监督管理机构的工作人员以及法律、行政法规禁止参与股票交易的其他人员，在任期或者法定限期内，不得直接或者以化名、借他人名义持有、买卖股票，也不得收受他人赠送的股票。任何人在成为前款所列人员时，其原已持有的股票，必须依法转让”的规定，构成《证券法》第一百九十九条规定的违法行为。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》第一百九十九条的规定，我局决定：没收宋海龙违法所得 23,417.40 元，并处以 5 万元罚款，罚没款共计 73,417.40 元。

当事人应自收到本处罚决定书之日起 15 日内，将罚没款汇交中国证券监督管理委员会（开户银行：中信银行总行营业部，账号 7111010189800000162，由该行直接上缴国库），并将注有当事人名称的付款凭证复印件送我局备案。当事人如果对本处罚决定不服，可在收到本处罚决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会申请行政复议，也可在收到本处罚决定书之日起 6 个月内直接向有管辖权的人民法院提起行政诉讼。复议和诉讼期间，上述决定不停止执行。

广东证监局

2016 年 4 月 12 日

(2) 担任参仙源重大资产重组财务顾问期间，所出具独立财务顾问核查意见、重大资产重组相关信息披露程序及备案程序等存在违规行为。

出具警示函。

(3) 国泰君安证券股份有限公司关于期货子公司收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

2016 年 6 月 16 日，国泰君安期货有限公司收到中国证券监督管理委员会（下称“中

国证监会”）《调查通知书》（稽查总队调查通字 Q160027 号）。原文如下：

“因你公司未能有效履行资产管理人职责，根据《期货交易管理条例》的有关规定，我会决定对你公司立案调查，请予以配合。”

国泰君安证券股份有限公司及国泰君安期货有限公司将全面配合中国证监会的相关调查工作，同时严格按照有关规定履行信息披露义务。

特此公告。

国泰君安证券股份有限公司董事会

2016 年 6 月 17 日

中国证券监督管理委员会北京监管局行政监管措施决定书（国泰君安证券）

（4）关于对国泰君安证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定

国泰君安证券股份有限公司：

根据中国证监会公司债券监管部的统一要求，我局近期对你公司作为北京利尔高温材料股份有限公司（以下简称北京利尔）2015 年公司债券（第一期）（以下简称本期债券）受托管理人的履职情况进行了核查，核查发现：

2015 年 8 月 28 日，北京利尔将本期债券发行募集资金从专户转入公司基本户后，将其中的 2 亿元资金出借给伊川财源实业投资有限责任公司，该笔借款期限为 1 年，利率为 11%，双方约定按月付息，由伊川县人民政府、伊川县建设投资有限公司进行担保。上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》第十五条的规定。

你公司作为受托管理人，未能及时发现和制止上述转借事项，违反了《公司债券发行与交易管理办法》第七条和第五十条第二款的规定。根据《公司债券发行与交易管理办法》第五十八条的有关规定，决定对你公司采取出具警示函的行政监管措施。

如果对本监督管理措施不服，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 6 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。

中国证监会北京监管局

2016 年 6 月 15 日

(5) 国泰君安证券股份有限公司在保荐金徽酒股份有限公司首次公开发行股票并上市项目过程中，向我会提交的会后重大事项承诺函中未如实说明发行人 2015 年利润分配情况；发行人分红实施完毕后，亦未履行主动告知义务。上述行为违反了《证券发行上市保荐业务管理办法》（证监会令第 63 号）第四条规定。按照《证券发行上市保荐业务管理办法》第六十六条规定，我会决定对国泰君安证券股份有限公司采取出具警示函的行政监管措施。

(6) 一是在推荐河北润农节水科技股份有限公司（简称润农节水）进入全国中小企业股份转让系统挂牌过程中，对润农节水关键业务流程、存货情况的核查不充分；内核机构履职的独立性存在缺陷。二是在持续督导参仙源参业股份有限公司（简称参仙源）过程中，参仙源被立案稽查后，未在规定时间内完成并报送《持续督导现场检查工作报告》。三是在推荐新疆瑞兆源生态农业股份有限公司（简称瑞兆源）进入全国中小企业股份转让系统挂牌过程中，对瑞兆源关键业务流程、购销情况的核查不充分。公司在开展推荐业务过程中存在多项违规行为，反映出内部控制制度存在一定缺陷。上述缺陷及行为违反了《非上市公众公司监督管理办法》第六条规定和《证券公司内部控制指引》的相关规定。按照《证券公司监督管理条例》第七十条、《非上市公众公司监督管理办法》第六十二条的规定，我会决定对国泰君安证券采取责令改正、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告的措施。请国泰君安证券在本决定书作出之日起 1 个月内完成整改。

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。该处罚事件对公司生产经营产生影响，目前公司生产经营一切正常。我们判断此次事件对公司的生产经营活动没有影响，我们认为不会对整体的业绩造成影响。

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 | 356,285.60 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 33,901,564.66 |
| 5 | 应收申购款 | 29.98 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 34,257,880.24 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1 | 128013 | 洪涛转债 | 181,622.00 | 0.01 |

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 | 2,272,415,295.36 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 56,373.21 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 90,615,544.23 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 2,181,856,124.34 |

§ 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

单位：份

| | |
|------------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 17,500,400.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 17,500,400.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 0.80% |

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|--------------------------------|----------------|------|------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2017 年 1 月 1 日-2017 年 3 月 31 日 | 882,426,835.72 | - | - | 882,426,835.72 | 40.44% |
| | 2 | 2017 年 1 月 1 日-2017 年 3 月 31 日 | 479,952,901.18 | - | - | 479,952,901.18 | 22.00% |

产品特有风险

1、持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。

2、基金净值大幅波动的风险

高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。

3、基金规模较小导致的风险

高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2017 年 1 月 19 日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安丰利债券型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告；

2、2017 年 2 月 23 日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金关于参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告；

3、2017 年 3 月 25 日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金管理有限公司关于将同业存单列为金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金投资范围的公告；

4、2017 年 3 月 29 日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安丰利债券型证券投资基金 2016 年年度报告（正文）；

5、2017 年 3 月 29 日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安丰利债券型证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）；

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金元顺安丰利债券型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《金元顺安丰利债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《金元顺安丰利债券型证券投资基金基金招募说明书》
- 4、《金元顺安丰利债券型证券投资基金托管协议》
- 5、关于申请募集注册金元顺安丰利债券型证券投资基金的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 8、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

金元顺安基金管理有限公司

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

投资者可于本基金管理人办公时间至办公地点进行查询，或登录本基金管理人网站 www.jysa99.com 查阅。投资者对本报告书存有疑问，可咨询本基金管理人金元顺安基金管理有限公司，本公司客服电话 400-666-0666、021-68881898。

金元顺安基金管理有限公司

二〇一七年四月二十四日

