

金元顺安丰利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2017 年 1 号)

基金管理人：金元顺安基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇一七年五月

重要提示

金元顺安丰利债券型证券投资基金（原名：金元惠理丰利债券型证券投资基金以下简称“本基金”），经中国证监会 2009 年 2 月 5 日中国证券监督管理委员会下发的《关于同意金元比联丰利债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2009]101 号）的核准，进行募集。本基金基金合同于 2009 年 3 月 23 日生效。基金管理人和基金注册登记机构为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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“金元惠理丰利债券型证券投资基金”，上述变更事项依据《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“金元顺安丰利债券型证券投资基金”，上述变更事项依据《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。

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，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判

断市场，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、由于基金投资者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。

投资有风险，投资者认购或申购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2017 年 3 月 22 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 12 月 31 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，不得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、专户理财部、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、创新投资部、金融市场部、资本市场部和投资部等 22 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 月出任金元顺安基金管理有限公司董事，2010 年 9 月出任金元顺安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，副董事长，学士学位。曾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，于 2012 年 9 月至 2013 年 5 月任云南工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责任公司执行董事、深圳滇中商业保理有限公司执行董事。具有丰富的企业业务开拓、经营管理经验。

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。

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。

潘书鸿先生，独立董事，学士学位。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。

栗旻先生，董事，硕士学位。曾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。其长期在银行系统及非银金融领域工作，并在多个岗位担任管理职位。

2、基金管理人监事会成员

郭长洲先生，监事会主席，本科学位，金元证券股份有限公司财务总监、财务部总经理。曾任山东济南乾聚会计师事务所经理、BDO利安达会计师事务所业务经理、航港金控投资有限公司业务经理，历任首都机场集团公司业务经理、首都机场财务有限公司总经理助理、首都机场地产集团有限公司财务部总经理、财务总监。

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。曾于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，金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，金元证券电脑总部助理主管工程师。

洪婷女士，员工监事，专科学历，金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，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，金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，硕士学位。曾任海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，历任金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，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，金元证券有限责任公司上海宜山路证券营业部总经理，金元证券有限责任公司财务总部经理助理，历任金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

李杰先生，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的基金经理，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。

5、投资决策委员会成员

张嘉宾先生，总经理，简历同上。

李杰先生，基金经理，简历同上。

闵杭先生，投资总监，金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安新经济主题混合型证券投资基金、金元顺安宝石动力混合型证券投资基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金和金元顺安金通宝货币市场基金的基金经理，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。

23年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

侯斌女士，金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安宝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。15 年基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

缪玮彬先生，金元顺安价值增长混合型证券投资基金的基金经理，复旦大学经济学硕士。曾任华泰资产管理有限公司固定收益部总经理，宝盈基金管理有限公司研究员，金元证券有限责任公司资产管理部总经理助理，联合证券有限责任公司高级投资经理，华宝信托投资有限责任公司投资经理。2016 年 10 月加入金元顺安基金管理有限公司。19 年基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

郭建新先生，金元顺安金通宝货币市场基金的基金经理，西南财经大学经济学硕士。曾任河北银行股份有限公司资金运营中心债券交易经理。2016 年 9 月加入金元顺安基金管理有限公司。7 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）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：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

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中

国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2013年至2015年连续获得中国债券市场“优秀托管机构奖”，2015年被中国银行业协会授予“养老金业务最佳发展奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名，其中具有高级职称的专家30余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到2016年12月31日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共342只。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险

管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、相关服务机构

（一）直销机构

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

邮政编码：200120

联系电话：021-68882850

传真：021-68882865

联系人：孙筱君

客户服务专线：400-666-0666、021-68882850

公司网址：www.jysa99.com

（二）代销机构

1、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：张伟

联系电话：010-85109230

传真：010-68121816

客服电话：95599

公司网址：www.abchina.com

2、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：易会满

联系人：杨菲

联系电话：010-66107909

传真：010-66107914

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

3、中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院长安兴融中心 1 号楼 1115

法定代表人：王洪章

联系人：张静

联系电话：010-67596219

传真：010-66275654

客服电话：95533

公司网址：www.ccb.com

4、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

联系人：张作伟

联系电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服电话：95559

5、招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：于菲

联系电话：0755-83161095

传真：0755-83195050

客服电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

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：董金

联系电话：010-85238441

传真：010-85238419

客服电话：95577

公司网站：www.hxb.com.cn

7、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

联系电话：021-61614467

传真：021-63602540

客服电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

8、中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：穆婷

联系电话：010-57092619

传真：010-57092611

客服电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

9、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：李庆萍

联系人：王媛

联系电话：010-89937322

传真：010-65550827

客服电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

10、上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路168号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：金煜

联系人：王笑

联系电话：021-68475732

传真：021-68476111

客服电话：021-962888

公司网址：www.bankofshanghai.com

11、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：谢永林

联系人：张莉

联系电话：021-38637673

传真：0755-82080400

客服电话：95511-3

公司网址：www.bank.pingan.com

12、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
联系电话：0755-83025022
传真：0755-83025625
客服电话：4008-888-228
公司网址：www.jyzq.cn、www.goldstate.com.cn

13、中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼
办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40-43 层
法定代表人：何亚刚
联系人：李微
联系电话：010-59355941
传真：010-66553791
客服电话：400-889-5618
公司网址：www.e5618.com

14、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
联系电话：010-85156398
传真：010-65182261
客服电话：400-8888-108
公司网址：www.csc108.com

15、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：李晓哲
联系电话：021-22169111
传真：021-22169134

客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

16、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

联系电话：021-33388211

传真：021-33388224

客服电话：95523、4008895523

网址：www.swhysc.com

17、海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：李笑鸣

联系电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服电话：95553

公司网址：www.htsec.com

18、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

联系人：柯延超

联系电话：0591-38507950

传真：021-38565955

客服电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

19、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 层地址：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

联系人：黄蝉君

联系电话：0755-82960167

传真：0755-82943636

客服电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

20、华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市江东中路 228 号

办公地址：江苏省南京市江东中路 228 号

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82493561

传真：0755-82492962

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

21、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 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

传真：010-66568990

客服电话：4008-888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

22、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

联系电话：020-87555888

传真：020-87553600

客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

23、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

联系电话：0551-62257012

传真：0551-62272100

客服电话：95578、400-888-8777

24、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：张佑君

联系人：侯艳红

联系电话：010-60838995

传真：010-60833739

客服电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

25、华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 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：王虹

联系电话：021-20655183

传真：0591-87383610

客服电话：96326

公司网址：www.gfhfzq.com.cn

26、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：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63081493

传真：010-63080978

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

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：尤习贵

联系人：奚博宇

联系电话：021-68751860

传真：027-85481900

客服电话：95579、4008-888-999

网址：www.95579.com

28、中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

基金业务联系人：孙秋月

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客服电话：95548

公司网址：www.zxwt.com.cn

29、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：韩志谦

联系人：王怀春

联系电话：0991-2307105

传真：010-88085195

客服电话：4008-000-562

公司网址：www.hysec.com

30、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

联系电话：010-66045152

传真：010-66045500

客服电话：010-66045678

网址：www.txsec.com

31、上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

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

联系电话：021-20211847

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

32、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

联系电话：021-38509680

传真：021-38509777

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

33、蚂蚁（杭州）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：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

电话：0571-26888888-37494

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn/

34、深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

联系人：童彩平

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn、www.jjmmw.com

35、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：刘洋

联系电话：021-20835787

传真：010-85650806

客服电话：010-85625158

公司网址：www.hexun.com

36、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：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：苗明

联系电话：021-20691926

传真：021-58787698

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

37、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：徐汇区宛平南路 88 号 26 楼

法定代表人：其实

联系人：朱玉

联系电话：021-54509998

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

38、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：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

联系人：曹怡晨

联系电话：021-60195148

客服电话：4000676266

公司网址：www.leadbank.com.cn

39、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

联系电话：010-59158281

客服电话：400-893-6885

公司网址：www.qianjing.com

40、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：周斌

联系人：祖杰

联系电话：010-57756159

客服电话：4008-980-618

公司网址：www.chtfund.com

41、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：何春燕

联系电话：021-80133828

客服电话：400-808-1016

公司网址：www.fundhaiyin.com

42、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：张彦

联系人：张燕

联系电话：010-58325388

客服电话：400-166-1188

公司网址：fund.jrj.com.cn

43、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：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟镇

联系电话：021-38676767

传真：021-38670666

服务电话：95521

公司网址：www.gtja.com

44、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

联系电话：021-52629999-218906

客服电话：95561

公司网址：www.cib.com.cn

45、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：刘晓倩

联系电话：0571-88911818

客服电话：4008-773-772

公司网址：fund.10jqka.com.cn

46、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：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼
法定代表人：金佶
联系人：陈云卉
联系电话：021-33323999
客服电话：400-820-2819
公司网址：www.chinapnr.com

47、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：鲍东华
联系人：宁博宇
联系电话：021-20665952
客服电话：4008-6666-18
公司网址：www.lu.com

48、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：北京建国门外大街国贸写字楼 2 座 28 层
法定代表人：丁学东
联系人：杨涵宇
联系电话：010-65051166-6493
客服电话：400-910-1166
公司网址：www.cicc.com

49、大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室
办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼
法定代表人：袁顾明
联系人：赵明
联系电话：021-20324155
客服电话：400-928-2266
公司网址：www.dtfunds.com

50、上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

联系电话：021-52822063-8102

客服电话：021-52822063

公司网址：www.91fund.com.cn

51、北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21 层

法定代表人：蒋煜

联系人：徐晓荣

联系电话：010-58170876

传真：010-58170800

客服电话：400-818-8866

公司网址：www.shengshiview.com

52、中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

联系电话：010-60833754

传真：010-57762999

客服电话：400-9908-826

公司网址：www.citicsf.com

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。

53、招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：于菲

联系电话：0755-83161095

客服电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

54、宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：于波涛

联系电话：0574-87050038

客服电话：96528

公司网址：www.nbc.com.cn

55、方正证券股份有限公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F

法定代表人：高利

联系人：高洋

联系电话：010-59355546

传真：010-56437013

客服电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

56、北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

联系电话：010-56282140

传真：010-62680827

客服电话：400-619-9059

公司网址：www.hcjijin.com

57、天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层

法定代表人：丁东华

联系人：许艳

联系电话：010-59287105

传真：010-59287825

客服电话：400-111-0889

公司网址：www.gomefund.com

58、泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人：林卓

联系人：姜焕洋

联系电话：0411-88891212

传真：0411-84396536

客户服务电话：400-6411-999

公司网址：www.haojiyoujijin.com

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。

（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

联系电话：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：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

（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：吴港平

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：汤骏

经办注册会计师：汤骏、印艳萍

四、基金的名称

金元顺安丰利债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法公开发行、上市的国债、央行票据、金融债、信用等级为BBB+及以上的企业（公司）债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券和债券回购等，以及股票等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%，其中对可转换债券（含分离交易可转债）的投资比例不高于基金资产的40%，对固定收益类以外的其他资产（包括股票、权证等）的投资比例不高于基金资产的20%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

此外，本基金在对新股的定价因素和预期因素进行综合考察的前提下，积极参与一级市场申购，获得较为安全的新股申购收益；本基金保留在股票市场系统性风险较低而且整体动态估值水平合理的前提下进行股票二级市场投资的选择权。

八、基金的投资策略

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。

1、债券投资主要定量模型

(1) 宏观经济多因素回归模型，通过回归分析建立宏观经济指标与债券收益率之间的数量关系。宏观经济指标主要包括消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、工业增加值、货币供应量、本外币信贷、进出口额和汇率等；

(2) 利率期限结构模型；

(3) 组合构建模型；

(4) 利差模型；

(5) 信用风险评估体系。

2、债券投资主要策略

在债券资产配置方面，本基金采用类属配置、久期管理、收益率曲线配置、相对价值配置等方法决定不同券种之间和不同期限券种之间的配置比例，制定债券资产配置方案。

(1) 类属配置就是通过对债券基准收益率的研究以及各类属债券之间利差的历史变化特征进行分析，寻找当前的市场投资机会。具体来说，在中国债券市场，根据发行人的不同，一般可以分为国债、金融债、央行票据和企业债。当金融债和国债之间的信用利差扩大到历史水平上限时，买入金融债，卖出国债；当金融债和国债之间的信用利差缩小到历史水平下限时，买入国债，卖出金融债。对于央票和企业债的策略也采取相同策略。本基金通过对上述两个变量的分析，来确定这四类券种在债券组合中最优的配置比例。

(2) 久期管理就是债券分析员通过对 GDP 增长速度、财政政策和货币政策的变化、通货膨胀的变动趋势分析，运用数量模型判断未来利率走势，提出债券投资组合的久期的建议。当预测未来市场利率将上升时，降低组合久期；当预测未来利率下降时，增加组合久期。久期管理的主要目的是通过久期的主动管理来增加债券部分的投资收益率。

(3) 收益率曲线配置是指通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率和货币供应量等多种因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化，从而通过子弹形、哑铃形和梯形等配置方法，在短、中、长期债券间确定比例。收益率曲线反映了债券的期限与收益率之间的关系，它随着时间的变化而改变。本基金通过预测收益率曲线形状的变化，调整整个债券投资组合中长短期品种的比例以获得投资收益。当收益率曲线发生陡峭化变形的时候，减少长期债券比重，增加短期债券比重；当收益率曲线发生平坦化变

形的时候，则增加短期债券，减少长期债券。

(4) 相对价值配置是指市场中寻找其他各个指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券，并进行投资。在此策略中，本基金主要衡量这样几方面的指标：流动性、信用度、收益率等。举例来说，当某一组债券具有相同流动性和收益率时，则选取其中信用度更高的债券；当某一组债券具有相同信用度和收益率时，则选取其中流动性更好的债券。或者，衡量债券与市场公允收益率之间的差距。当某组债券偏离市场公允价值时，则抛出其中高估的，买入其中低估的债券；

(5) 在企业债券投资方面，本基金注重单个债券品种信用风险的控制，并且结合流动性选择优质债券。鉴于公司基本面分析是企业债（包括可转债）的投资决策的重要决定因素，本基金将对发行债券公司的财务经营状况、运营能力、管理层信用度、所处行业竞争状况等因素进行综合分析，准确评价债券的信用程度。

3、债券选择

本基金的债券选择通过如下三个环节：数量小组初步筛选、债券分析员研究和集体讨论。

本基金在选择单个企业债券时，将注重信用风险的分析。信用风险是发行人对其发行的债券到期时不予兑付的风险。债券都存在一定的信用风险。根据不同的信用风险，债券有不同的风险溢价。一般来看，国债的信用风险最低，金融债和市政债券的信用风险略高。企业债的信用风险由债券信用评级机构评定，而国内目前的债券信用评级体系尚待完善。目前，在AA级以上的企业债券中，信用风险也参差不齐。因此在个券选择时，仍需要对发行人的基本面进行系统的调研与分析，重点是企业现金流与资产负债比率等指标。即使是今后有了完善的信用评级体系，采取独立的内部信用分析，仍能更准确地对相同信用等级的债券加以细分。

4、现金管理

在现金管理上，本基金通过对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。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为中债综合指数。

本基金选择中债综合指数的原因如下：

中债综合指数由中央国债登记结算公司编制，该指数涵盖了在沪深证券交易所及银行间市场上市的国债、金融债、企业债、央行票据及企业短期融资券。基于本基金的债券投资比例和债券投资市场，选用该业绩比较基准能够真实、客观地反映本基金的风险收益特征。

本基金业绩评价基准自基金成立后由基金管理人每半年审核一次，如所用基准不再符合本基金的投资策略和投资目标，将对其进行调整，新基准将在更新的招募说明书中列示。

在更具代表性的新债券市场指数推出、债券市场发生重大变动等情况下，本基金管理人可根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致。基金管理人最迟应于新的业绩比较基准实施前 2 日在至少一种指定媒体上进行公告并报中国证监会备案。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2017 年 4 月 20 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 12 月 31 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	93,784,632.66	3.47
---	------	---------------	------

其中：股票	93,784,632.66	3.47
-------	---------------	------

2	固定收益投资	2,423,557,275.80	89.57
---	--------	------------------	-------

其中：债券	2,423,557,275.80	89.57
-------	------------------	-------

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	142,803,245.15	5.28
---	--------------	----------------	------

7	其他资产	45,485,130.08	1.68
---	------	---------------	------

8	合计	2,705,630,283.69	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	--	
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	7,739,193.22	0.33
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	--	
J	金融业	16,725,720.00	0.71
K	房地产业	69,319,719.44	2.95
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	93,784,632.66	3.99

3. 期末按市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	000671	阳光城	12,445,192	69,319,719.44	2.95
2	600036	招商银行	950,325	16,725,720.00	0.71
3	600998	九州通	373,153	7,739,193.22	0.33
4	--	--	--	--	--
5	--	--	--	--	--
6	--	--	--	--	--
7	--	--	--	--	--

8 - - - - -

9 - - - - -

10 - - - - -

4. 期末按券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 93,284,895.80 3.96

2 央行票据 - -

3 金融债券 386,571,530.00 16.43

其中：政策性金融债 386,571,530.00 16.43

4 企业债券 464,773,700.00 19.75

5 企业短期融资券 481,655,000.00 20.47

6 中期票据 996,562,000.00 42.35

7 可转债 710,150.00 0.03

8 其他 - -

9 合计 2,423,557,275.80 102.98

5. 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

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 101664059 16 南昌城投 MTN002 1,300,000 124,085,000.00 5.27

2 011699579 16 魏桥铝电 SCP006 1,000,000 100,560,000.00 4.27

3 041654030 16 河钢 CP003 1,000,000 100,220,000.00 4.26

4 101552037 15 中油股 MTN002 1,000,000 100,020,000.00 4.25

5 120227 12 国开 27 1,000,000 98,790,000.00 4.20

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. 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

11.1 本基金本期投资的前十名证券中有未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。

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。

11.2 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。

11.3 期末其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 609,142.99

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 44,875,987.09

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 45,485,130.08

11.4 本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。

11.5 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中不存在流通受限情况。

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。

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 12 月 31 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

2009-3-23 至 2009-12-31 0.97% 0.25% 0.20% 0.05% 0.77% 0.20%

2010-1-1 至 2010-12-31 3.19% 0.29% 2.00% 0.07% 1.19% 0.22%

2011-1-1 至 2011-12-31 -11.57% 0.32% 3.79% 0.06% -15.36% 0.26%

2012-1-1 至 2012-12-31 3.55% 0.21% 4.03% 0.04% -0.48% 0.17%

2013-1-1 至 2013-12-31 -0.54% 0.28% 1.78% 0.05% -2.32% 0.23%

2014-1-1 至 2014-12-31 19.81% 0.38% 9.41% 0.16% 10.40% 0.22%

2015-1-1 至 2015-12-31 11.68% 0.14% 5.36% 0.07% 6.32% 0.07%

2016-1-1 至 2016-12-31 -0.93% 0.26% -1.63% 0.09% 0.70% 0.17%

自基金合同生效日至今 25.80% 0.28% 27.36% 0.09% -1.56% 0.19%

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) 本基金在 2015 年 11 月 27 日将基金业绩比较基准由“中信标普全债指数”更改为“中债综合指数”；

(3) 业绩比较基准日期为 2009 年 3 月 22 日，即以基金合同生效日前一日收盘价格为计算基数；

(4) 数据截止日期为 2016 年 12 月 31 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：

报告期末，投资组合中各项资产的投资比例均符合各项法规约定。

十三、基金的费用概览

（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、基金合同生效后的信息披露费用；
- 4、基金份额持有人大会费用；
- 5、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金财产拨划支付的银行费用；
- 8、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.7\% / \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 0.7%，其中，H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值。

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.2%，其中，H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值。

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、上述（一）中 4 到 7 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规

定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

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费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。降低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告并报中国证监会备案。

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

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》、《公开募集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”部分对代销机构进行了更新；
- 5、“基金的投资”部分对基金投资组合报告和基金的业绩进行了更新；
- 6、“对基金份额持有人的服务”部分对电子版资料发送服务进行了更新；
- 7、“其它应披露事项”部分进行了更新；

金元顺安基金管理有限公司

二〇一七年五月六日