

金元顺安新经济主题混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告

2017-06-30

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：2017-07-20

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

重要提示

基金产品概况

基金基本情况

主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标

基金净值表现

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

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

其他指标

管理人报告

基金经理（或基金经理小组）简介

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

异常交易行为的专项说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内基金的业绩表现

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

报告期末按行业分类的股票投资组合

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

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告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

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

报告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

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本期国债期货投资评价

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

其他资产构成

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

影响投资者决策的其他重要信息

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

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

备查文件目录

存放地点

查阅方式

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 7 月 19 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金简称

金元顺安新经济主题混合

场内简称

基金主代码

620008

前端交易主代码

620008

基金运作方式

契约型开放式
基金合同生效日

2012-07-31

报告期末基金份额总额

111,286,852.02

投资目标

中国经济进入新的历史发展阶段、产业结构调整以及发展方式转变将带来新的挑战和发展契机，一批新经济将成为投资主题。本基金主要投资于新发展时期和发展环境下，所涌现的与新经济主题相关、基本面良好、且具有较强竞争力和持续成长能力的上市公司股票，力争实现基金资产的长期、持续、稳定增值。

投资策略

本基金通过发掘经济发展及结构转型过程中所显现的新经济主题，并以该主题所孕育的投资机会作为主要的投资线索，力争获取持续稳健的投资超额收益。在资产配置方面，本基金根据国内外宏观经济、政策环境、市场运行趋势等因素确定基金的大类资产配置比例；在权益资产投资方面，采用“自上而下”的方式，选择与新经济主题相关性较高的行业中的个股进行配置。同时，结合“自下而上”的方式，精选与新经济主题相关性较高的上市公司股票作为投资方向；在债券投资方面，选择具有票息优势的债券品种作为主要的债券投资标的；最后，在综合考量投资组合的风险收益特征基础上，本基金完成组合构建。

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%。

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，其预期的风险和收益特征低于股票型基金、高于债券型基金与货币市场基金，属于较高风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

基金管理人

金元顺安基金管理有限公司

基金托管人

中国农业银行股份有限公司

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标

报告期（2017-04-01 至 2017-06-30）

本期已实现收益

383,804.14

本期利润

3,144,248.72

加权平均基金份额本期利润

0.0269

期末基金资产净值

129,671,642.38

期末基金份额净值

1.165

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。

□

基金净值表现

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

5.05 %

0.75 %

4.65 %

0.50 %

0.40 %

0.25 %

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本基金合同生效日为 2012 年 7 月 31 日；

3、本基金选择沪深 300 指数作为股票投资部分的业绩基准，选择中债总指数作为债券投资部分的业绩基准，复合业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%；

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

注：1、本基金合同生效日为 2012 年 7 月 31 日；

2、股票资产占基金资产的 60%-95%，债券资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 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%，权证不高于基金资产净值的 3%。本基金建仓期为 2012 年 7 月 31 日至 2013 年 1 月 30 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。

其他指标

单位：人民币元

其他指标

报告期（2017-04-01 至 2017-06-30）

其他指标

报告期（2017-06-30）

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

孔祥鹏

本基金基金经理

2017-06-28

-

5

金元顺安新经济主题混合型证券投资基金和金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，北京大学理学硕士。曾任上海市盟洋投资管理有限公司投资部研究员，中山证券有限责任公司研究所研究员，德邦证券有限责任公司研究所研究员。2015年5月加入金元顺安基金管理有限公司。5年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

闵杭

本基金基金经理

2015-10-16

-

23

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、金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安桉盛债券型证券投资基金和金元顺安桉泰债券型证券投资基金的基金经理，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。

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。

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。

公平交易专项说明

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。

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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，基金重点投资于金融业和房地产业等。

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 5.05%，业绩比较基准收益率为 4.65%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

制造业短期加库存接近尾声，基建投资面临资金来源压力，经济增速总体承压但整体可控，6 月制造业 PMI 反弹至 51.7，连续 11 个月位于荣枯线上方，表明国内经济韧性十足，有助于国内金融监管坚定不移的推进，预计三季度银监会会出台相关业务的监管细则，证监会和保监会则继续保持从严监管的高压态势。

7 月份 28 天逆回购和 MLF 将集中到期，其中逆回购有 5600 亿，MLF 有 3575 亿，当前金融去杠杆方向未发生变化，预计 7 月份资金仍将维持紧平衡的状态。

美国一季度 GDP 增长年率被上修至 1.4%，全球三大央行释放鹰派信号，美联储 6 月 FOMC 会议宣布加息 25 个基点，维持 2017 年再加息一次的预测，且预计 2017 年将开始缩表。虽然受到特朗普推行一揽子计划受挫，近期美元走弱，外围压力减轻，但是由于全球进入加息周期，仍将对我们的货币政策构成制约。

6 月份市场上涨，我们认为更多来自于市场预期差的博弈，市场反转的基础并不存在，中长期仍将受制于经济下行和流动性偏紧的约束，维持震荡市，结构市特征。监管趋严及监管层多次强调价值投资，因此我们仍看好低估值蓝筹股的配置价值，尤其银行、保险、房地产等，将会沿着以下两条思路选择个股，1，选择基本面改善幅度大且估值仍较低的个股，2，监管强调内生增长，业绩依赖于主营业务，选择本板块龙头公司。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

在本报告期内，该基金未曾出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元或基金份额持有人数量不满二百人的情形。

投资组合报告

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

权益类投资

129,062,376.39

87.10

其中：股票

129,062,376.39

87.10

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	
	8,882,423.97	
	5.99	
7		
	其他资产	
	10,239,964.71	
	6.91	
8		
	合计	
	148,184,765.07	
	100.00	
	报告期末按行业分类的股票投资组合	
	报告期末按行业分类的境内股票投资组合	
	序号	
	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

26,120,497.75

20.14

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

-

E

建筑业

6,446,880.00

4.97

F

批发和零售业

-

-

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

7,639.62

0.01

J

金融业

45,113,721.50

34.79

K

房地产业

51,373,637.52

39.62

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

129,062,376.39

99.53

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

000002

万科A

295,102

7,368,696.94

5.68

2

000666

经纬纺机

313,800
7,135,812.00
5.50
3
600015
华夏银行
739,800
6,820,956.00
5.26
4
600048
保利地产
673,388
6,713,678.36
5.18
5
000036
华联控股
711,127
6,471,255.70
4.99
6
601818
光大银行
1,594,850
6,459,142.50
4.98
7
601668
中国建筑
666,000
6,446,880.00
4.97
8
600823
世茂股份
1,314,120
6,439,188.00
4.97
9
002142
宁波银行
333,279
6,432,284.70

4.96

10

600016

民生银行

781,915

6,427,341.30

4.96

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

-

-

2

央行票据

-

-

3

金融债券

-

-

其中：政策性金融债

-

-

4

企业债券

-

-

5

企业短期融资券

-

-

6

中期票据

-

-

7

可转债（可交换债）

-

-

8

同业存单

-

-

9

其他

-

-

10

合计

-

-

注：本基金本报告期末未持有债券。

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（%）

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未投资资产支持证券。

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
序号

贵金属代码

贵金属名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未投资贵金属。

报告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

注：本基金本报告期末未投资权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险说明

公允价值变动总额合计(元)

-

股指期货投资本期收益(元)

-

股指期货投资本期公允价值变动(元)

-

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

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。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险指标说明

公允价值变动总额合计(元)

-

国债期货投资本期收益（元）

-

国债期货投资本期公允价值变动(元)

-

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、关于世茂股份（代码：600823）的处罚说明

A.2016年12月23日，中国证券监督管理委员会上海监管局对孟洁做出行政处罚决定书（沪[2016]8号）

当事人：孟洁，身份证号：2202XXXXXXXXXX004X，女，1968年2月出生，时任上海世茂股份有限公司（以下简称世茂股份）副总裁，住址：北京市大兴区。

依据《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）的有关规定，我局对孟洁短线交易“世茂股份”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。当事人未提出陈述和申辩意见。本案现已审理终结。

经查明，孟洁存在以下违法事实：

孟洁于2012年4月26日至2016年3月9日担任世茂股份副总裁。孟洁在担任世茂股份副总裁期间，于2015年6月16日以股权激励股票期权行权方式买入“世茂股份”股票450,000股，买入金额2,830,500元。2015年6月29日，孟洁的个人证券账户累计卖出所持“世茂股份”股票110,000股，卖出金额1,448,084.82元。经交易所测算，卖出部分盈利288,539.13元。

上述违法事实，有世茂股份的公告、涉案证券账户交易记录、相关当事人的询问笔录和情

况说明等证据证明，足以认定。

孟洁的上述行为属于《证券法》第四十七条第一款规定的“上市公司董事、监事、高级管理人员、持有上市公司股份百分之五以上的股东，将其持有的该公司的股票在买入后六个月内卖出，或者在卖出后六个月内又买入”的行为，构成了《证券法》第一百九十五条所述的违法行为。

我局在调查中发现，孟洁的证券账户由孟洁实际控制，账户资金为孟洁的自有资金，账户利益归属于孟洁，账户盈亏由孟洁承担，但本次卖出“世茂股份”股票的决策由孟洁的朋友康某作出，交易由康某具体操作。案发后孟洁已主动将相关收益 293,700 元（其自己测算）上缴了世茂股份。同时，调查过程中，孟洁能够积极配合调查，及时提供相关资料。考虑到上述事实，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》第一百九十五条、《中华人民共和国行政处罚法》第二十七条第一款之规定，我局决定：对孟洁给予警告。

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。

B.2017 年 6 月 12 日，上海证券交易所对上海世茂股份有限公司和实际控制人许荣茂及有关责任人予以监管关注

当事人：

上海世茂股份有限公司，A 股证券简称：世茂股份，A 股证券代码：600823；许荣茂，上海世茂股份有限公司实际控制人，时任上海世茂股份有限公司董事长；俞峰，时任上海世茂股份有限公司董事会秘书。

经查明，上海世茂股份有限公司（以下简称世茂股份或公司）实际控制人许荣茂在规范运作、公司在信息披露义务等方面存在以下违规行为。

一、实际控制人违反避免同业竞争承诺

2009 年，公司实施重大资产重组，向实际控制人许荣茂控制的公司发行股份购买资产，将许荣茂旗下的中国境内商业地产业务整合进入公司。当时，许荣茂及其控制的世茂房地产控股有限公司（以下简称世茂房地产）承诺：许荣茂、世茂房地产及其控制的其他所属公司将在中国境内主要专业从事住宅和酒店的投资、开发和经营业务，不再从事商业地产的投资、开发和经营。

2013 年-2014 年，世贸房地产相继控股了深圳前海世茂金融中心项目、杭州世茂智慧之门项目、南昌市贸新城项目三个非酒店商业地产项目，世贸房地产为上市公司的关联方，上述行为违背了实际控制人做出的避免同业竞争承诺。

二、公司未如实披露实际控制人违背承诺的事项

世贸房地产于 2013 年-2014 年相继控股了深圳前海世茂金融中心项目、杭州世茂智慧之门项目、南昌市贸新城项目三个非酒店商业地产项目，相关行为已违背了实际控制人做出的避免同业竞争承诺，但上市公司在相关年度报告中仍披露称实际控制人“及时严格履行承诺”，未如实披露上述违背承诺情形。

综上，公司未和相关年度报告中如实披露实际控制人违背承诺情形，相关行为违反了《上市公司监管指引第 4 号——上市公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及上市公司承诺及履行》第八条、《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 2 号——年度报告的内容与格式准则》第三十条的规定、《股票上市规则》第 1.4 条、第 2.1 条、第 2.5 条。公司实际控制人兼时任董事长许荣茂作为承诺方，违反其做出的承诺，相关行为违反了《股票上市规则》第 2.22 条；同时作为公司主要负责人和信息披露第一责任人，未勤勉尽责，对公司的违规行为负有责任，违反了《股票上市规则》第 2.2 条、第 3.1.4 条、第

3.1.5 条的规定，以及在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。时任董事会秘书俞峰作为公司直接负责人，未勤勉尽责，对公司的违规行为负有责任，违反了《股票上市规则》第 2.2 条、第 3.1.4 条、第 3.2.2 条的规定，以及在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。

另经核实，深圳前海世茂金融中心项目、杭州世茂智慧之门项目、南昌市贸新城项目三个商业地产项目均要求受让方为外商投资企业，世茂股份受客观条件限制在当时无法取得三个项目。且实际控制人为落实三个商业地产项目的后续承诺，已于 2016 年 12 月将三个项目的控制权转让至世茂股份，相关事项于 2016 年 12 月 31 日公告。因此，对世茂股份和上述有关责任人可酌情减轻处理。

鉴于上述事实 and 情节，根据《股票上市规则》第 17.1 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》的有关规定，我部做出如下监管措施决定：对上海世茂股份有限公司、实际控制人兼时任上海世茂股份有限公司董事长许荣茂、时任上海世茂股份有限公司董事会秘书俞峰予以监管关注。

公司应当引以为戒，严格按照法律、法规和《股票上市规则》的规定，规范运作，认真履行信息披露义务；实际控制人在从事证券交易等活动时，应当严格遵守法律法规和本所业务规则及其承诺，并认真履行信息披露义务，积极配合上市公司做好信息披露工作；董事、监事、高级管理人员应当履行忠实勤勉义务，促使公司规范运作，并保证公司及时、公平、真实、准确和完整地披露所有重大信息。

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。此次事件涉及上市公司副总裁短线交易公司股票、大股东同业竞争问题，我们判断此次事件对公司负面影响有限，公司生产经营活动一切正常，我们认为不会对整体的业绩造成影响，因此买入并持有公司股票。

2、关于民生银行（代码：600016）的处罚说明

A. 2017 年 5 月 8 日，江苏证监局对中国民生银行南京分行做出责令改正措施的决定，具体内容如下：

中国民生银行南京分行：

2017 年 3 月 17 日，我局对你行实施了现场检查。经查，你行销售私募基金“民生加银资管慧选 6 号之紫鑫专项资产管理计划”存在以下问题：

一、你行未由投资者书面承诺符合合格投资者条件，违反了《私募投资基金监督管理暂行办法》（中国证监会令 105 号）第十六条关于私募基金销售机构应当由投资者书面承诺符合合格投资者条件的规定。

二、你行提供给个别投资者的内部培训材料部分表述不严谨，有误导投资者之嫌，违反了《私募投资基金监督管理暂行办法》第四条关于从事私募基金销售业务的机构应当恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务的规定。

以上事实有现场检查中收集的证据证明。

依据《私募投资基金监督管理暂行办法》第三十三条的规定，我局决定对你行采取责令改正的行政监管措施，请你行高度重视，严格遵守法律法规，对存在的问题切实整改，并在 2017 年 5 月 31 前向我局提交书面报告。

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 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。

B.2017年5月19日，上海证券交易所上市公司监管一部对中国民生银行股份有限公司和时任董事会秘书万青元做出予以监管关注的决定，具体内容如下：

当事人：

中国民生银行股份有限公司，A股证券简称：民生银行，A股证券代码：600016；

万青元，时任中国民生银行股份有限公司董事会秘书。经查明，中国民生银行股份有限公司（以下简称公司）在信息披露、规范运作等方面存在以下违规行为。

一、公司未按规定聘任独立董事

中国证监会《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》（以下简称《独立董事指导意见》）第一条规定，上市公司董事会成员中应当至少包括三分之一独立董事。同时公司章程规定，董事会由18名董事组成。据此，公司应当至少聘请6名独立董事。但是，根据公司披露的独立董事2015年度述职报告，有三名独立董事已分别于2014年3月6日、2014年4月30日、2014年7月22日申请辞去独立董事及董事会相关专门委员会委员的职务；其中，两名独立董事分别自2015年1月31日、2015年5月9日起不再继续履职；另一名独立董事自2016年1月15日起未再继续履职。截至2016年10月28日，公司仅有3名独立董事尚在履职，不符合《独立董事指导意见》有关独立董事人数不得低于董事会成员三分之一的法定最低比例要求，但公司长期未能补充选任独立董事。

另外，根据《独立董事指导意见》第四条及《上海证券交易所上市公司独立董事备案及培训工作指引》（以下简称《独立董事备案工作指引》）第十五条的相关规定，独立董事在上市公司连任时间不得超过六年。经核实，公司上述3名尚在履职的独立董事中，有两名自2009年9月9日至2017年2月20日连续担任独立董事超过六年，违反了有关独立董事最长连任期限的规定。

另经核实，公司于2015年12月31日、2016年5月17日、2016年8月15日多次召开董事会非决策会议及提名委员会会议，讨论独立董事补选及换届事宜。2016年10月28日，公司2016年第二次临时股东大会选举产生三名新任独立董事，独立董事人数达到董事会成员的三分之一。2017年2月20日，公司2017年第一次临时股东大会另选举产生两名新任独立董事，原两名超期任职的独立董事不再任职。

二、公司未及时披露关联交易协议生效的先决条件，交易进展披露不完整，风险提示不充分

2015年8月28日，公司披露称，公司全资子公司民生商银国际控股有限公司（以下简称民银国际）与6家关联法人及5家非关联公司作为共同收购方，认购华富国际控股有限公司（以下简称华富国际）拟对外发行的股份，各方共同签订股份认购协议（以下简称认购协议）。经核实，前述认购协议中含有须获得香港证监会与香港联交所的批准等八项协议生效的先决条件，但公司未在相关公告中披露上述协议生效关键条款，也未充分提示协议失效可能导致关联交易不能实施的风险。

2016年3月3日，公司披露进展公告称，由于若干先决条件尚未达成，认购协议失效，民银国际与华富国际正就后续安排持续磋商。但该公告中公司仍未披露协议生效先决条件的具体内容、先决条件未达成的原因，也未披露双方磋商的具体事项。经监管问询，公司随后披露称双方尚需就新股认购价格与最终完成日进行磋商。2016年5月13日，公司再次披露公告称，由于民银国际及华富国际于公告日期仍未就拟议的认购事项条款达成一致，民银国际将终止该认购事项。

综上，公司未按证监会及本所相关规定聘任独立董事，导致独立董事成员比例及独立董事任职时间均不符合相关规则的要求；公司未及时披露关联交易关键生效条款并充分揭示风险，关联交易后续进展披露不完整。公司上述行为违反了《独立董事指导意见》第一条、

第四条,《上海证券交易所股票上市规则》(以下简称《股票上市规则》)第1.4条、第2.1条、第2.7条、第10.2.9条以及《独立董事备案工作指引》第十五条等有关规定;时任董事会秘书万青元作为公司信息披露事务的具体负责人,未勤勉尽责,对公司的违规行为负有责任,其行为违反了《股票上市规则》第2.2条、第3.1.4条、第3.2.2条的规定,以及在《董事(监事、高级管理人员)声明及承诺书》中做出的承诺。

同时,考虑到公司及董事会秘书积极推进增补独立董事及董事会换届事宜,并已完成独立董事补选工作,目前公司独立董事履职情况符合相关规定,可以酌情给予减轻处理。

鉴于上述事实 and 情节,根据《股票上市规则》第17.1条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》有关规定,我部作出如下监管措施决定:对中国民生银行股份有限公司和时任董事会秘书万青元予以监管关注。

公司应当引以为戒,严格按照法律、法规和《股票上市规则》的规定,规范运作,认真履行信息披露义务;董事、监事和高级管理人员应当履行忠实勤勉义务,促使公司规范运作,并保证公司及时、公平、真实、准确和完整地履行信息披露义务。

现做出说明如下:

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。此次事件涉及下属分支机构销售产品信息披露不全、上市公司治理结构不够完善等问题,我们判断此次事件对公司负面影响有限,公司已经整改,生产经营活动一切正常,我们认为不会对整体的业绩造成影响,因此买入并持有公司股票。

3、关于兔宝宝(代码:002043)的处罚决定

2017年5月15日,中小板公司管理部对德华兔宝宝装饰新材股份有限公司监事丁观芬出具监管函,具体内容如下:

德华兔宝宝装饰新材股份有限公司监事丁观芬:

你作为德华兔宝宝装饰新材股份有限公司(以下简称“公司”)监事,自2016年11月14日至12月12日买入公司股票6,000股,成交金额77,170元,2017年4月28日,你卖出公司股票6,000股,成交金额99,840元。你的上述股票买卖行为构成《证券法》第四十七条所界定的短线交易。你的上述行为违反了本所《股票上市规则(2014年修订)》第1.4条、第3.1.8条和《中小企业板上市公司规范运作指引(2015年修订)》第3.8.1条的规定。请你充分重视上述问题,吸取教训,及时整改,杜绝上述问题的再次发生。同时,我部提醒你:上市公司董事、监事、高级管理人员买卖股票应当按照国家法律、法规、本所《股票上市规则》和《中小企业板上市公司规范运作指引》等规定,不得违规交易股票。

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。此次事件是公司高管短线交易公司股票,我们判断此次事件对公司负面影响有限,公司生产经营活动一切正常,我们认为不会对整体的业绩造成影响,因此买入并持有公司股票。

4、关于万科A(代码:000002)的处罚说明

中国证券监督管理委员会深圳监管局在2016年7月21日对万科企业股份有限公司出具了监管关注函,具体内容如下:

万科企业股份有限公司：

2016年7月19日，我局收到你公司现场提交的《关于提请查处钜盛华及其控制的相关资管计划违法违规行为的报

告》，就你公司举报事项，我局已依法开展核查。

在对相关事项的核查过程中，我局同时也关注到，你公司举报事项的信息发布和决策程序不规范。一是未按规定健全对外发布信息的申请、审核机制，导致相关信息被部分非指定信息披露媒体提前公布。二是以公司名义向监管部门提交对公司重要股东的举报事项，有关决策程序不审慎。

我局对此高度关注，对你公司提出以下监管要求：一、你公司主要负责人应于2016年7月22日下午3:00到我局接受诫勉谈话。

二、你公司应对信息披露事务管理方面存在的问题进行全面梳理，完善信息披露内部管理制度，切实发挥信息披露委员会在公司治理和信息披露方面的监督和指导作用。

三、你公司应本着对广大投资者利益高度负责的态度，以促进公司长远发展为宗旨，尽最大努力与各方股东积极磋商，妥善解决争议。

我局将对相关事项保持密切关注，依法履行监管职责，发现存在违法违规行为，我局将坚决查处。

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。且该公司为中证100权重股。该处罚主要是针对二级市场违规投资行为，并不影响公司的经营和公司价值，因此继续持有该公司股票。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中没有超出基金合同规定的备选股票库。

其他资产构成

单位：人民币元

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

71,190.12

2

应收证券清算款

155,572.84

3

应收股利

-

4

应收利息

1,777.52

5

应收申购款
10,011,424.23

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

10,239,964.71

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

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。

开放式基金份额变动

单位：份

项目

数值

报告期期初基金份额总额

19,705,636.66

报告期期间基金总申购份额

116,796,620.13

减：报告期期间基金总赎回份额

25,215,404.77

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）

报告期期末基金份额总额

111,286,852.02

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目

基金份额

报告期期初管理人持有的本基金份额

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

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)

-

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号

交易方式

交易日期

交易份额（份）

交易金额（元）

适用费率

合计

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-%

-%

基金管理人高级管理人员

-%

-%

基金经理等人员

-%

-%

基金管理人股东

-%

-%

其他

-%

-%

合计

-%

-%

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

-
-
-
-
-
-
-

个人

-
-
-
-
-
-
-

产品特有风险

-

影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2017年04月10日，在《中国证券报》、《证券日报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金关于参加广发证券网上、手机委托系统基金申购费率优惠活动的公告；
- 2、2017年04月22日，在《中国证券报》、《证券日报》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04月24日，在《中国证券报》、《证券日报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安新经济主题混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告；
- 4、2017年05月17日，在《中国证券报》、《证券日报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下开放式基金参加钱景基金费率优惠活动的公告；
- 5、2017年06月29日，在《中国证券报》、《证券日报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安新经济主题混合型证券投资基金基金经理变更公告。

备查文件目录

- 1、中国证监会准予金元顺安新经济混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《金元顺安新经济主题混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《金元顺安新经济主题混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《金元顺安新经济主题混合型证券投资基金托管协议》
- 5、关于申请募集注册金元顺安新经济主题混合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

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

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。