

金元顺安价值增长混合型证券投资基金

2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：金元顺安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十六日

§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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金元顺安价值增长混合型证券投资基金
基金简称	金元顺安价值增长混合
基金主代码	620004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	24,676,280.45 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在 GARP（以合理的价格购买企业的增长）策略指导下，本基金投资于具有良好成长潜力和价值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	在 GARP 策略指导下，以“合理的价格购买中国企业的增长”是本基金构建股票投资组合的基本投资策略。本基金的股票资产投资于具有良好成长潜力和价值低估的上市公司股票，采取自下而上、四重过滤的方法构建股票组合。首先，采取模型识别法对所有股票的估值与成长前景进行数量化扫描，形成可投资股票集合，该股票集合构成本基金股票一级库；其次，对股票一级库中的所有股票进行流动性筛选，形成本基金股票二级库；再次，通过上市公司实地调研，利用“金元顺安上市公司成长前景评价体系”对股票二级库中的上市公司的成长前景进行翔实分析与评估，剔除“伪成长”的

	上市公司，甄别具有真正成长潜力的优质上市公司（“明星公司”），同时对甄别的明星公司进行公司治理评估，从而构成本基金股票三级库；最后，通过估值考量，选择价值被低估的上市公司，形成优化的股票组合。在股票组合的构建过程中，宏观经济预测和行业趋势分析辅助本基金股票组合的构建。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金系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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌有法	田青
	联系电话	021-68881801	010-67595096
	电子邮箱	service@jysa99.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0666	010-67595096
传真		021-68881875	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		任开宇	王洪章

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.jysa99.com
基金半年度报告备置地点	本基金管理人、基金托管人办公地址

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	-462,865.88
本期利润	-2,550,096.43
加权平均基金份额本期利润	-0.1020
本期加权平均净值利润率	-11.08%
本期基金份额净值增长率	-10.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017年6月30日）
期末可供分配利润	-3,450,379.90
期末可供分配基金份额利润	-0.1398
期末基金资产净值	21,225,900.55
期末基金份额净值	0.860
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017年6月30日）
基金份额累计净值增长率	-14.00%

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6月30日。

4、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。

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
过去一个月	2.26%	0.90%	4.13%	0.54%	-1.87%	0.36%
过去三个月	-8.41%	0.91%	4.69%	0.50%	-13.10%	0.41%
过去六个月	-10.70%	0.85%	8.24%	0.46%	-18.94%	0.39%
过去一年	-24.16%	1.05%	12.71%	0.54%	-36.87%	0.51%
过去三年	12.71%	2.07%	59.49%	1.40%	-46.78%	0.67%
自基金成立起至今	-14.00%	1.61%	23.39%	1.23%	-37.39%	0.38%

注：

1、本基金合同生效日为 2009 年 9 月 11 日，业绩基准累计增长率以 2009 年 9 月 10 日指数为基准；

2、本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，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%；

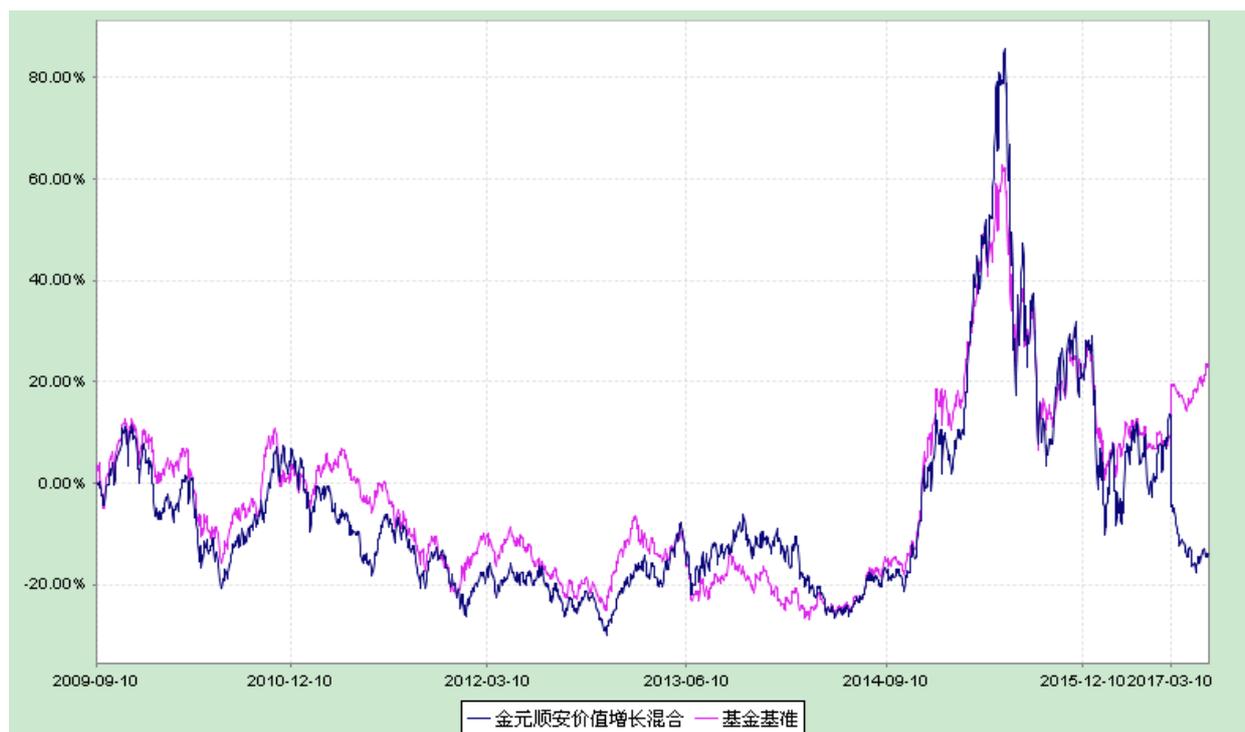
3、本基金业绩比较基准为“沪深 300 指数收益率×80%+中证国债指数收益率×20%”。

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

金元顺安价值增长混合型证券投资基金

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 9 月 11 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：

1、本基金合同生效日为 2009 年 9 月 11 日，业绩基准累计增长率以 2009 年 9 月 10 日指数为基准；

2、本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，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%。

§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——上海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”），公司更名为金元顺安基金管理有限公司（以下简称“金元顺安”）。

金元顺安始终坚持以“取信于市场、取信于社会”作为行为准则，遵循“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、行政法规和中国证券监督管理委员会的规定，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 2017 年 6 月 30 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、金元顺安沅楹债券型证券投资基金、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共 14 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		
缪玮彬	本基金基金经理	2016-12-16	-	19	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。

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》、《金元顺安价值增长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。

4.3.2 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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金重点投资于成长性较好、前期跌幅较大的小市值股票，行业分布较为分散，仓位保持在 70%-80% 区间。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-10.70%，业绩比较基准收益率为 8.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，经过一轮房地产和基建主导的复苏之后，中国经济增速可能将呈现前高后低的局面，GDP 增长率将基本维持在 6.7%-6.9% 的区间内。下半年虽然房地产和基建主导的投资动能有向下的压力，但制造业可能提供更多支撑。最新公布的 6 月 PMI 指数为 51.7，仍然保持稳中向好的扩张态势。从全球来看，美国与欧元区经济复苏势头强劲，各主要经济体的政策动向较为明确，各大央行有望在年底开始收缩资产负债表。

上半年 A 股市场在金融监管与去杠杆带来的流动性收缩下呈现了明显的结构性行情，机构抱团蓝筹白马，价值与成长风格出现明显对立。目前，部分价值蓝筹股的估值已经过高，在下半年中可能很难再走出持续上涨的行情。在证金公司持续加仓创业板的背景下，小市值股票在经历了大半年的下跌行情后有望走出由盈利驱动的反弹行情。行业方面，以有色和钢铁为代表的周期性行业在下半年有望持续走强，采掘、化工等低估值行业也有望出现投资机会。

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

本报告期内本基金未进行利润分配。

4.8 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

本基金本报告期出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形：截止到 2017 年 06 月 30 日，该基金连续四百九十四个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金元顺安价值增长混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

金额单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,326,983.20	4,554,299.97
结算备付金		-	32,218.21
存出保证金		4,510.68	5,923.37
交易性金融资产	6.4.7.2	15,236,383.04	19,827,210.68
其中：股票投资	6.4.7.2	15,236,383.04	19,827,210.68
基金投资	6.4.7.2	-	-
债券投资	6.4.7.2	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.2	-	-
贵金属投资	6.4.7.2	-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	2,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,030.14	682.63
应收股利		-	-
应收申购款		686.99	3,246.65
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		21,569,594.05	26,423,581.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,000,000.00
应付赎回款		12,225.79	3,230.73
应付管理人报酬		26,098.85	31,295.20
应付托管费		4,349.78	5,215.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	229,098.97	223,679.32
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	71,920.11	60,010.59
负债合计		343,693.50	2,323,431.72
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	24,676,280.45	25,036,115.08
未分配利润	6.4.7.10	-3,450,379.90	-935,965.29

所有者权益合计		21,225,900.55	24,100,149.79
负债和所有者权益总计		21,569,594.05	26,423,581.51

注：

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.860 元，基金份额总额 24,676,280.45 份。

6.2 利润表

会计主体：金元顺安价值增长混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

金额单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-2,237,925.98	-3,200,680.54
1.利息收入		43,765.77	15,168.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,543.13	12,708.21
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		28,222.64	2,459.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-196,118.78	-2,195,163.87
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-282,682.15	-2,264,142.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-

衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	86,563.37	68,979.06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-2,087,230.55	-1,024,065.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,657.58	3,380.78
减：二、费用		312,170.45	465,482.46
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	171,248.19	197,688.95
2.托管费	6.4.10.2.2	28,541.36	32,948.17
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	31,227.99	150,117.27
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.21	81,152.91	84,728.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,550,096.43	-3,666,163.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,550,096.43	-3,666,163.00

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安价值增长混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	25,036,115.08	-935,965.29	24,100,149.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,550,096.43	-2,550,096.43
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）	-359,834.63	35,681.82	-324,152.81
其中：1.基金申购款	1,912,597.81	-148,377.78	1,764,220.03
2.基金赎回款	-2,272,432.44	184,059.60	-2,088,372.84
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）	24,676,280.45	-3,450,379.90	21,225,900.55
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	25,117,581.30	7,074,110.07	32,191,691.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,666,163.00	-3,666,163.00
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）	232,125.49	-14,398.41	217,727.08
其中：1.基金申购款	3,141,841.30	139,809.78	3,281,651.08
2.基金赎回款	-2,909,715.81	-154,208.19	-3,063,924.00
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）	25,349,706.79	3,393,548.66	28,743,255.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

金元顺安价值增长混合型证券投资基金（原名为：金元比联价值增长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]535 号文《关于核准金元比联价值增长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 2009 年 9 月 11 日正式生效，首次设立募集规模为 412,063,932.20 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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“金元比联价值增长股票型证券投资基金”更名为“金元惠理价值增长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“金元顺安价值增长混合型证券投资基金”。

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。在以合理的价格购买企业的增长（GARP）策略指导下，本基金投资于具有良好成长潜力和价值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：沪深 300 指数收益率×80%+中证国债指数收益率×20%。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 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
中国建设银行股份有限公司	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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.8.1.1 股票交易**

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股票交易。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 债券回购交易

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回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付的关联方佣金。

6.4.8.2 关联方报酬**6.4.8.2.1 基金管理费**

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的管理费	171,248.19	197,688.95
其中：支付销售机构的客户维护费	24,621.09	28,136.49

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。

2、基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，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两个工作日内从基金资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。

3、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。

6.4.8.2.2 基金托管费

金额单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	28,541.36	32,948.17

注：

1、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。

2、基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，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两个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.8.3 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度可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 6月30日
期初持有的基金份额	-	9,999,200.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	9,999,200.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	40.52%

6.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末均未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国建设银行股份有限公司	6,326,983.20	13,706.73	1,770,218.09	11,144.89
--------------	--------------	-----------	--------------	-----------

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，2017年1月1日至2017年6月30日止期间获得的利息收入为1,798.31元，2017年6月30日止结算备付金余额为人民币0元。

2016年1月1日至2016年6月30日止期间获得的利息收入为1,222.84，2016年6月30日止结算备付金余额为人民币27,123.26元。

6.4.8.6 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有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限的证券。

6.4.9.2 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
002504	*ST弘高	2017-05-02	重大资产重组	8.10	-	-	15,600	123,552.00	126,360.00	-
002426	胜利精密	2017-01-16	拟披露重大事项	7.68	-	-	17,700	150,243.00	135,936.00	-
002076	雪莱特	2017-03-20	重大资产重组	7.07	-	-	22,400	148,885.00	158,368.00	-
002006	精功科技	2017-05-22	重大资产	7.91	-	-	12,400	123,256.00	98,084.00	-

			重组							
603861	白云 电器	2017- 06-15	重大 资产 重组	24.27	-	-	4,000	121,420.00	97,080.00	-
600734	实达 集团	2016- 11-22	重大 事项	12.75	2017- 07-12	12.00	9,000	123,210.00	114,750.00	-
300098	高新 新兴	2017- 06-22	拟披 露重 大事 项	12.90	2017- 07-03	13.15	10,100	126,856.00	130,290.00	-
300089	文化 长城	2017- 04-19	重大 资产 重组	14.93	-	-	7,500	128,250.00	111,975.00	-
300109	新开 源	2017- 03-27	重大 资产 重组	46.46	-	-	2,600	122,279.64	120,796.00	-
300100	双林 股份	2017- 04-05	重大 资产 重组	25.96	-	-	4,500	125,100.00	116,820.00	-
002619	巨龙 管业	2017- 05-24	重大 资产 重组	6.37	-	-	14,400	126,800.00	91,728.00	-
300163	先锋 新材	2017- 04-26	重大 资产 重组	7.60	-	-	12,700	149,365.00	96,520.00	-
300252	金信 诺	2017- 04-27	重大 事项	21.65	2017- 07-27	19.49	4,900	148,864.00	106,085.00	-
002669	康达 新材	2017- 04-21	重大 事项	28.27	-	-	4,200	125,495.00	118,734.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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

购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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证券款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1 公允价值

6.4.10.1.1 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、买入返售金融资产、应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 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 13,731,591.04 元，属于第二层次的余额为人民币 1,504,792.00 元，无第三层次余额。（于 2016 年 6 月 30 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 25,046,750.03 元，属于第二层次的余额为人民币 2,287,003.90 元，无第三层次余额。）

6.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的债券，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债券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，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

根据中国证券投资基金业协会中基协发（2014）24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自 2015 年 4 月 10 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层级从第一层次转入第二层次。

6.4.10.1.2.3 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。

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 其他事项

截至本财务报表批准日，本基金无需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	15,236,383.04	70.64
	其中：股票	15,236,383.04	70.64
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	6,326,983.20	29.33
7	其他各项资产	6,227.81	0.03
8	合计	21,569,594.05	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	451,495.00	2.13
B	采矿业	249,962.00	1.18

C	制造业	9,414,075.50	44.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	567,949.00	2.68
E	建筑业	305,603.00	1.44
F	批发和零售业	354,842.00	1.67
G	交通运输、仓储和邮政业	201,148.60	0.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,752,870.96	8.26
J	金融业	11,860.00	0.06
K	房地产业	382,402.12	1.80
L	租赁和商务服务业	324,420.78	1.53
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	186,024.00	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	94,468.00	0.45
Q	卫生和社会工作	209,739.00	0.99
R	文化、体育和娱乐业	729,523.08	3.44
S	综合	-	-
	合计	15,236,383.04	71.78

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

7.3 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	002076	雪莱特	22,400	158,368.00	0.75
2	300288	朗玛信息	5,300	147,605.00	0.70
3	600338	西藏珠峰	3,800	144,362.00	0.68
4	000958	东方能源	17,400	140,592.00	0.66
5	300467	迅游科技	3,400	140,522.00	0.66
6	002658	雪迪龙	7,900	140,225.00	0.66
7	000915	山大华特	3,770	138,999.90	0.65
8	002773	康弘药业	2,600	135,980.00	0.64
9	300357	我武生物	3,300	135,960.00	0.64
10	002426	胜利精密	17,700	135,936.00	0.64
11	300208	恒顺众昇	8,400	134,148.00	0.63
12	603989	艾华集团	3,400	133,416.00	0.63
13	300219	鸿利智汇	9,900	131,274.00	0.62
14	002602	世纪华通	3,600	130,536.00	0.61
15	300098	高新兴	10,100	130,290.00	0.61
16	002690	美亚光电	6,700	128,506.00	0.61
17	002504	*ST 弘高	15,600	126,360.00	0.60
18	000810	创维数字	10,300	124,939.00	0.59
19	600273	嘉化能源	13,300	124,754.00	0.59
20	300206	理邦仪器	14,400	124,272.00	0.59
21	300341	麦迪电气	14,200	122,830.00	0.58
22	300109	新开源	2,600	120,796.00	0.57
23	600856	中天能源	10,700	120,482.00	0.57

24	300373	扬杰科技	5,900	118,885.00	0.56
25	002669	康达新材	4,200	118,734.00	0.56
26	000796	凯撒旅游	9,794	118,703.28	0.56
27	002680	长生生物	7,700	117,733.00	0.55
28	000902	新洋丰	13,000	117,000.00	0.55
29	300100	双林股份	4,500	116,820.00	0.55
30	300311	任子行	7,600	116,660.00	0.55
31	300025	华星创业	14,800	116,476.00	0.55
32	300477	合纵科技	6,200	116,312.00	0.55
33	300371	汇中股份	4,300	116,272.00	0.55
34	002130	沃尔核材	18,000	115,740.00	0.55
35	002609	捷顺科技	7,700	115,269.00	0.54
36	600734	实达集团	9,000	114,750.00	0.54
37	300336	新文化	7,400	114,404.00	0.54
38	300366	创意信息	6,800	113,968.00	0.54
39	002343	慈文传媒	3,000	113,580.00	0.54
40	300302	同有科技	6,300	113,463.00	0.53
41	002147	新光圆成	7,300	113,442.00	0.53
42	300365	恒华科技	3,177	113,418.90	0.53
43	300090	盛运环保	11,900	112,693.00	0.53
44	002831	裕同科技	1,500	112,500.00	0.53
45	600483	福能股份	10,800	111,996.00	0.53
46	300089	文化长城	7,500	111,975.00	0.53
47	300071	华谊嘉信	13,800	111,780.00	0.53

48	002446	盛路通信	9,180	111,720.60	0.53
49	300272	开能环保	11,040	111,172.80	0.52
50	002196	方正电机	9,690	110,756.70	0.52
51	300396	迪瑞医疗	3,200	110,496.00	0.52
52	603328	依顿电子	7,800	110,370.00	0.52
53	002324	普利特	4,100	110,208.00	0.52
54	000546	金圆股份	10,100	110,090.00	0.52
55	300292	吴通控股	16,200	109,674.00	0.52
56	002782	可立克	5,200	108,940.00	0.51
57	000813	德展健康	12,450	107,443.50	0.51
58	603023	威帝股份	8,500	107,100.00	0.50
59	300121	阳谷华泰	7,700	106,260.00	0.50
60	000989	九芝堂	5,600	106,176.00	0.50
61	300252	金信诺	4,900	106,085.00	0.50
62	002631	德尔未来	7,200	106,056.00	0.50
63	300350	华鹏飞	10,260	105,780.60	0.50
64	300221	银禧科技	7,600	105,640.00	0.50
65	600714	金瑞矿业	8,800	105,600.00	0.50
66	600763	通策医疗	4,200	105,378.00	0.50
67	300061	康耐特	5,700	104,994.00	0.49
68	000150	宜华健康	4,300	104,361.00	0.49
69	300196	长海股份	3,500	104,125.00	0.49
70	600891	秋林集团	13,200	102,828.00	0.48
71	002099	海翔药业	15,400	102,564.00	0.48

72	600644	乐山电力	13,500	102,465.00	0.48
73	300202	聚龙股份	6,200	102,424.00	0.48
74	300253	卫宁健康	13,110	102,389.10	0.48
75	300360	炬华科技	6,800	102,340.00	0.48
76	600229	城市传媒	10,900	102,133.00	0.48
77	300018	中元股份	11,600	101,964.00	0.48
78	002587	奥拓电子	13,500	101,790.00	0.48
79	600053	九鼎投资	2,900	101,384.00	0.48
80	002299	圣农发展	6,800	101,116.00	0.48
81	000802	北京文化	6,900	100,464.00	0.47
82	000908	景峰医药	11,900	100,436.00	0.47
83	600965	福成股份	8,700	99,093.00	0.47
84	002718	友邦吊顶	1,700	99,025.00	0.47
85	300286	安科瑞	4,800	99,024.00	0.47
86	002107	沃华医药	7,900	98,750.00	0.47
87	600530	交大昂立	17,400	98,310.00	0.46
88	603099	长白山	6,400	98,112.00	0.46
89	002006	精功科技	12,400	98,084.00	0.46
90	603168	莎普爱思	4,200	98,028.00	0.46
91	300019	硅宝科技	9,600	97,728.00	0.46
92	000892	欢瑞世纪	9,736	97,652.08	0.46
93	300017	网宿科技	8,088	97,622.16	0.46
94	300445	康斯特	4,400	97,460.00	0.46
95	300213	佳讯飞鸿	10,800	97,092.00	0.46

96	603861	白云电器	4,000	97,080.00	0.46
97	002502	骅威文化	10,300	96,717.00	0.46
98	603777	来伊份	2,600	96,538.00	0.45
99	300163	先锋新材	12,700	96,520.00	0.45
100	000017	深中华 A	11,000	96,360.00	0.45
101	300567	精测电子	1,200	95,916.00	0.45
102	300363	博腾股份	6,300	95,508.00	0.45
103	300248	新开普	5,900	95,403.00	0.45
104	002357	富临运业	9,100	95,368.00	0.45
105	600980	北矿科技	5,500	95,315.00	0.45
106	000565	渝三峡 A	9,200	94,760.00	0.45
107	600661	新南洋	4,400	94,468.00	0.45
108	002224	三力士	8,500	94,350.00	0.44
109	300063	天龙集团	11,250	93,937.50	0.44
110	002713	东易日盛	4,600	93,702.00	0.44
111	002124	天邦股份	10,800	93,528.00	0.44
112	002792	通宇通讯	2,700	93,501.00	0.44
113	600381	青海春天	7,400	93,092.00	0.44
114	000607	华媒控股	12,300	92,988.00	0.44
115	600975	新五丰	14,500	92,800.00	0.44
116	600917	重庆燃气	9,800	92,414.00	0.44
117	300231	银信科技	7,000	92,400.00	0.44
118	000936	华西股份	13,100	91,962.00	0.43
119	600838	上海九百	7,600	91,884.00	0.43

120	002619	巨龙管业	14,400	91,728.00	0.43
121	300389	艾比森	6,300	91,602.00	0.43
122	600892	大晟文化	7,600	91,048.00	0.43
123	002157	正邦科技	20,000	91,000.00	0.43
124	300403	地尔汉宇	5,000	90,900.00	0.43
125	002137	麦达数字	10,000	90,700.00	0.43
126	603609	禾丰牧业	9,400	89,864.00	0.42
127	300295	三六五网	4,800	89,808.00	0.42
128	002815	崇达技术	2,700	89,208.00	0.42
129	600593	大连圣亚	3,300	87,912.00	0.41
130	600083	博信股份	6,600	87,120.00	0.41
131	300546	雄帝科技	2,750	86,350.00	0.41
132	000018	神州长城	11,300	85,541.00	0.40
133	300387	富邦股份	4,300	85,140.00	0.40
134	600730	中国高科	10,300	84,357.00	0.40
135	600826	兰生股份	4,600	83,260.00	0.39
136	000502	绿景控股	6,889	83,219.12	0.39
137	600647	同达创业	3,600	83,160.00	0.39
138	600385	山东金泰	6,000	83,040.00	0.39
139	603006	黎明股份	3,700	82,658.00	0.39
140	000004	国农科技	3,100	79,515.00	0.37
141	300532	今天国际	3,240	76,528.80	0.36
142	002746	仙坛股份	2,500	72,825.00	0.34
143	603228	景旺电子	1,000	48,250.00	0.23

144	002458	益生股份	2,100	43,365.00	0.20
145	002234	民和股份	3,400	42,296.00	0.20
146	300623	捷捷微电	500	33,600.00	0.16
147	601881	中国银河	1,000	11,860.00	0.06
148	300592	华凯创意	500	11,585.00	0.05

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300089	文化长城	128,250.00	0.53
2	300018	中元股份	128,131.00	0.53
3	300208	恒顺众昇	128,100.00	0.53
4	002609	捷顺科技	128,051.00	0.53
5	300121	阳谷华泰	128,039.21	0.53
6	300292	吴通控股	127,656.00	0.53
7	300231	银信科技	127,529.00	0.53
8	300445	康斯特	127,499.00	0.53
9	300063	天龙集团	127,479.00	0.53
10	300221	银禧科技	127,300.00	0.53
11	300371	汇中股份	127,252.00	0.53
12	300071	华谊嘉信	127,236.00	0.53
13	300090	盛运环保	127,211.00	0.53
14	300336	新文化	127,132.00	0.53

15	300219	鸿利智汇	127,116.00	0.53
16	002658	雪迪龙	127,111.00	0.53
17	300311	任子行	127,109.50	0.53
18	002690	美亚光电	127,034.00	0.53
19	300196	长海股份	127,022.00	0.53
20	300286	安科瑞	127,008.00	0.53

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，不考虑相关费用。

7.4.2 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	002664	信质电机	1,266,266.00	5.25
2	600303	曙光股份	1,243,000.00	5.16
3	600552	凯盛科技	1,011,499.00	4.20
4	000921	海信科龙	213,484.00	0.89
5	002236	大华股份	190,034.00	0.79
6	002192	融捷股份	187,102.00	0.78
7	002032	苏泊尔	180,091.61	0.75
8	600007	中国国贸	179,547.00	0.75
9	300408	三环集团	178,966.94	0.74
10	600750	江中药业	176,538.00	0.73
11	300127	银河磁体	175,747.00	0.73
12	000055	方大集团	172,794.00	0.72

13	300346	南大光电	170,364.59	0.71
14	600491	龙元建设	170,061.00	0.71
15	002577	雷柏科技	170,035.00	0.71
16	002273	水晶光电	168,795.00	0.70
17	002081	金螳螂	166,748.00	0.69
18	002431	棕榈股份	165,167.00	0.69
19	300215	电科院	163,915.00	0.68
20	600172	黄河旋风	163,570.00	0.68

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，不考虑相关费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	16,291,894.27
卖出股票的收入（成交）总额	18,512,809.21

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。

7.5 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投资债券。

7.6 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

本基金本报告期末未投资债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未投资贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、关于西藏珠峰（代码：600338）的处罚说明

近日，证监会依法对 3 宗案件作出行政处罚。

一是北京东方国信科技股份有限公司（简称东方国信）董事长管某平为东方国信拟进行重大资产重组事项这一内幕信息的知情人。在内幕信息敏感期内，秦宏伟与管某平联系频繁，并控制使用“秦宏伟”“虞某悦”2 个账户买入“东方国信”202,200 股，获利约 199.9 万元。秦宏伟的上述行为违反了《证券法》第 73 条、第 76 条规定，依据《证券法》第 202 条规定，北京证监局决定没收秦宏伟违法所得约 199.9 万元，并处以约 199.9 万元罚款。

二是东方国信董事长管某平为东方国信拟进行重大资产重组事项这一内幕信息的知情人。在内幕信息敏感期内，秦某伟与管某平存在联络接触，之后秦某伟即开始与姜艳杰频繁通讯联系，并指示其公司出纳向“姜艳杰”证券账户的三方存管银行账户内转入 100 万元。姜艳杰控制使用“姜艳杰”账户买入“东方国信”54,595 股，获利约 59.3 万元。姜艳杰的上述行为违反了《证券法》第 73 条、第 76 条规定，依据《证券法》第 202 条规定，北京证监局决定没收姜艳杰违法所得约 59.3 万元，并处以约 59.3 万元罚款。

三是韦承宏是西藏珠峰工业股份有限公司（简称西藏珠峰）拟向湖南智昊投资管理有限公司出售所持青海珠峰锌业有限公司和青海西部铝业有限责任公司股权这一内幕信息的知情人。在内幕信息敏感期内，韦承宏使用其本人证券账户买入“西藏珠峰”4000 股，没有违法所得。韦承宏的上述行为违反了《证券法》第 73 条、第 76 条规定，依据《证券法》第 202 条规定，西藏证监局决定对韦承宏处以 3 万元罚款。

上述行为违反了证券法律法规，破坏了市场秩序，必须坚决予以打击。我会将持续保持执法高压态势，严厉惩处各类违法违规行，维护公开、公平、公正的市场秩序，促进资本市场健康发展。

现作出说明如下：

处罚涉及某个人利用该公司内幕消息进行交易，交易数量仅为 4000 股，对该股股价无任何实质性影响。

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，经过深入的基本面和技术面分析，并综合考虑行业配置比例最终构建投资组合。

B. 基金经理遵循成长股投资逻辑，该公司去年盈利增长较快，一季度仍保持较高增速，因此买入并坚定持有该公司股票。

2、关于胜利精密（代码：002426）的处罚说明

A.2017 年 4 月 21 日中小板公司管理部对苏州胜利精密制造科技股份有限公司出具了监管函，具体内容如下：

苏州胜利精密制造科技股份有限公司董事会：

2016 年 1 月 18 日，你公司董事会审议通过了《关于与苏州中晟精密制造有限公司日常关联交易预计的公告》。2016 年 2 月 4 日，你公司股东大会审议通过上述议案。2017 年 4 月 20 日，公司披露《关于追认 2016 年度日常关联交易超额部分的公告》，2016 年度公司实际发生的关联交易额超出上述审议通过的额度，超出金额为 4,380.41 万元，占你公司最近一期经审计的净资产比例为 0.82%，你对新增关联交易未及时履行审批程序及信息披露义务。你公司的上述行为违反了本所《股票上市规则（2014 年修订）》第 2.1 条、第 2.7 条、第 10.2.4 条及第 10.2.11 条的规定。请你公司董事会充分重视上述问题，吸取教训，及时整改，杜绝上述问题的再次发生。

同时，提醒你公司：上市公司应当按照国家法律、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，诚实守信，规范运作，认真和及时地履行信息披露义务。上市公司全体董事、监事、高级管理人员应当保证信息披露内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并就其保证承担个别和连带的责任。

B.2017 年 6 月 5 日，中小板公司管理部对苏州胜利精密制造科技股份有限公司及高玉根、徐永红、曹海峰出具了监管函，具体内容如下：

苏州胜利精密制造科技股份有限公司及高玉根、徐永红、曹海峰：2016 年 10 月 27 日，苏州胜利精密制造科技股份有限公司（以下简称“公司”）披露 2016 年第三季度报告，预计 2016 年度归属于上市公司股东的净利润（以下简称“净利润”）为 7.5 亿元至 8.5 亿元。2017 年 1 月 26 日，公司披露 2016 年度业绩预告修正公告，预计 2016 年度净利润为 6 亿元至 6.5 亿元。2017 年 2 月 28 日，公司披露 2016 年度业绩快报，预计 2016 年度净利润为 5.45 亿元。2017 年 4 月 18 日，公司披露 2016 年度业绩快报修正公告，修正预计净利润为 4.29 亿元。2017 年 4 月 20 日，公司披露 2016 年年度报告，2016 年度净利润为 4.29 亿元。你公司在 2016 年度业绩预告修正公告及业绩快报中披露的预计业绩与实际数据差异较大，且未按规定及时予以修正，直至 2017 年 4 月 18 日才披露业绩快报修正公告予以修正，公司未及时、准确地履行相关信息披露义务。你公司的上述行为违反了本所《股票上市规则（2014 年修订）》第 2.1 条、第 2.5 条、第 2.7 条、第 11.3.3 条及《中小企业板上市公司规范运作指引》（2015 年修订）第 5.3.4 条的规定。公司董事长高玉根、总经理曹海峰、财务总监徐永红未能恪尽职守、履行诚信勤勉 2 义务，违反了本所《股票上市规则（2014 年修订）》第 2.2 条和第 3.1.5 条的规定，对公司上述违规行为负有重要责任。请你们充分重视上述问题，吸取教训，及时整改，杜绝

上述问题的再次发生。同时，提醒你公司：上市公司应当按照国家法律、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，诚实守信，规范运作，认真和及时地履行信息披露义务。上市公司全体董事、监事、高级管理人员应当保证信息披露内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并就其保证承担个别和连带的责任。

现作出说明如下：

新闻涉及该公司因信息披露不及时而收到监管函，性质较轻，预计对股价不会造成重大负面影响。

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，经过深入的基本面和技术面分析，并综合考虑行业配置比例最终构建投资组合。

B.基金经理遵循价值投资理念，该公司之前股价有较大的下跌，其内在价值已经凸显。我们预计监管函对公司负面影响十分有限，因此买入并持有该公司股票。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,510.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,030.14
5	应收申购款	686.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,227.81

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002076	雪莱特	158,368.00	0.75	重大资产重组
2	002426	胜利精密	135,936.00	0.64	发行股份购买资产

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
2,622	9,411.24	10,127,692.30	41.04%	14,548,588.15	58.96%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	380,352.27	1.54%

8.3 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

项目	持有份额总数（份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

份额单位：份

基金合同生效日（2009 年 9 月 11 日）基金份额总额	412,063,932.20
本报告期期初基金份额总额	25,036,115.08
本报告期基金总申购份额	1,912,597.81
减：本报告期基金总赎回份额	2,272,432.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	24,676,280.45

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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 2017 年 1 月 23 日公告，《金元顺安金通宝货币市场基金基金合同》正式生效，闵杭先生担任该基金的基金经理；

2、本基金管理人于 2017 年 1 月 26 日公告，增聘郭建新先生担任金元顺安金通宝货币市场基金的基金经理；

3、本基金管理人于 2017 年 3 月 25 日公告，聘任陈嘉楠女士担任公司副总经理。

4、本基金管理人于 2017 年 3 月 31 日公告，《金元顺安桉盛债券型证券投资基金基金合同》正式生效，闵杭先生担任该基金的基金经理；

5、本基金管理人于 2017 年 4 月 6 日公告，增聘郭建新先生担任金元顺安桉盛债券型证券投资基金的基金经理；

6、本基金管理人于 2017 年 6 月 10 日公告，《金元顺安桉泰债券型证券投资基金基金合同》正式生效，闵杭先生担任该基金的基金经理；

7、本基金管理人于 2017 年 6 月 20 日公告，增聘郭建新先生担任金元顺安桉泰债券型证券投资基金的基金经理；

8、本基金管理人于 2017 年 6 月 29 日公告，增聘孔祥鹏先生担任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；

9、本基金管理人于 2017 年 6 月 29 日公告，增聘孔祥鹏先生担任金元顺安新经济主题混合型证券投资基金的基金经理。

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 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，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 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	
海通证券股份有限公司	2	32,518,614.48	93.49%	7,521.61	78.11%	-
国信证券股份有限公司	1	2,262,859.00	6.51%	2,107.39	21.89%	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	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：

(1) 选择标准

1) 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。

2) 公司资信状况较好，无重大不良记录。

3) 公司经营规范，能满足基金运作的合法、合规需求。

4) 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。

(2) 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 2017 年 6 月 30 日止，本基金新租用海通证券股份有限公司 1 个上海交易单元、1 个深圳交易单元。

10.7.2 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
海通证券股份有限公司	-	-	53,000,000.00	28.09%	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	135,700,000.00	71.91%	-	-
华泰证券股	-	-	-	-	-	-

份有限公司						
金元证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融有限公司	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

份额单位：份

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 6 月 30 日	9,999,200.00	-	-	9,999,200.00	40.52%
产品特有风险							
<ul style="list-style-type: none"> 持有份额比例较高的投资者（“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。 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。 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。 							

金元顺安基金管理有限公司

二〇一七年八月二十六日