

# 金元顺安核心动力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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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	金元顺安核心动力混合型证券投资基金
基金简称	金元顺安核心动力混合
基金主代码	620005
交易代码	620005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 2 月 11 日
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	121,700,353.06 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过运用“核心—卫星”股票投资策略，将大部分基金资产用于完全复制大型上市公司股票指数（中证 100 指数）的业绩表现，并将部分资产投资于中证 100 指数以外的具备良好成长潜力且价值被低估的上市公司股票，在控制组合风险的前提下，追求基金资产中长期的稳定增值。
投资策略	本基金的资产配置策略分为两个层次：第一层为大类资产配置策略，以确定基金资产在股票、债券和现金之间的比例；第二层以“核心—卫星”策略作为基金股票资产的配置策略。本基金的股票投资组合由“核心组合”和“卫星组合”两部分构成：核心组合采取被动投资方法，原则上对反映大市值股票走势的基准指数——中证 100 指数——采用完全复制法，按照成份股在该指数中的基准权重

	构建指数化投资组合。核心组合的市值介于股票资产的 60%-100%。卫星组合采取自下而上的方法精选中证 100 指数以外的具备良好成长潜力且价值被低估的上市公司股票，以期获得成长企业的估值溢价。卫星组合的市值介于股票资产的 0%-40%。本基金的债券投资组合以具票息优势的债券作为主要投资对象，并通过对债券的信用、久期和凸性等灵活配置，进行相对积极主动的操作，力争获取超越债券基准的收益。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌有法	郭明
	联系电话	021-68881801	010-66105799
	电子邮箱	service@jysa99.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-666-0666	95588
传真		021-68881875	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140

法定代表人	任开宇	易会满
-------	-----	-----

#### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金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	1,039,132.84
本期利润	9,846,505.67
加权平均基金份额本期利润	0.1175
本期加权平均净值利润率	11.12%
本期基金份额净值增长率	11.06%
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	15,258,536.87
期末可供分配基金份额利润	0.1254
期末基金资产净值	136,958,889.93
期末基金份额净值	1.125
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	12.50%

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	5.73%	0.64%	3.96%	0.61%	1.77%	0.03%
过去三个月	5.83%	0.63%	7.52%	0.53%	-1.69%	0.10%
过去六个月	11.06%	0.55%	11.41%	0.47%	-0.35%	0.08%
过去一年	8.91%	0.67%	16.37%	0.55%	-7.46%	0.12%
过去三年	67.66%	1.55%	64.71%	1.39%	2.95%	0.16%
自基金成立起至今	12.50%	1.31%	17.30%	1.22%	-4.80%	0.09%

注：

1、本基金合同生效日为 2010 年 2 月 11 日，业绩基准累计增长率以 2010 年 2 月 10 日指数为基准；

2、股票资产占基金资产的 60%-95%，其中，核心组合完全复制中证 100 指数，投资比例为股票资产的 60%-100%；卫星组合则以中证 100 指数以外的具备良好成长潜力且价值被低估的上市公司股票为标的，投资比例为股票资产的 0%-40%。债券资产、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；

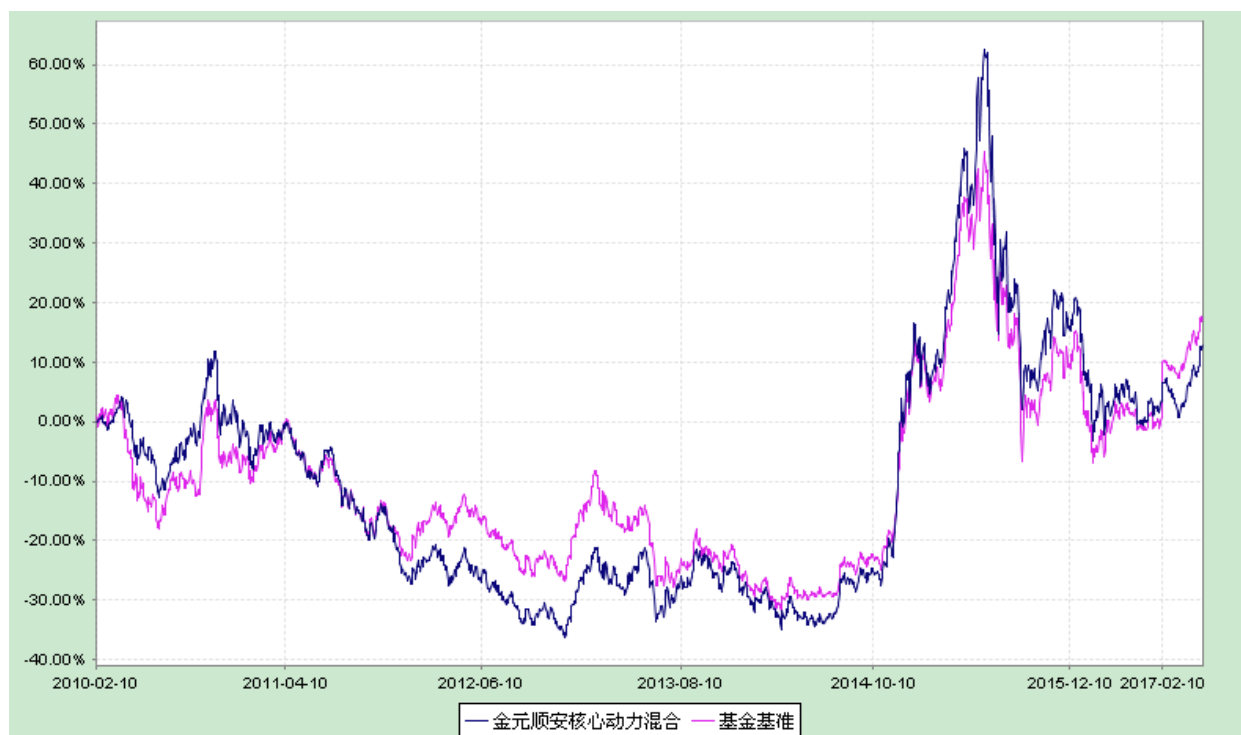
3、本基金业绩比较基准为“中证 100 指数×80%+中国债券总指数收益率×20%”。

#### 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

金元顺安核心动力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

(2010 年 2 月 11 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：

1、本基金合同生效日为 2010 年 2 月 11 日，业绩基准累计增长率以 2010 年 2 月 10 日指数为基准；

2、股票资产占基金资产的 60%-95%，其中，核心组合完全复制中证 100 指数，投资比例为股票资产的 60%-100%；卫星组合则以中证 100 指数以外的具备良好成长潜力且价值被低估的上市公司股票为标的，投资比例为股票资产的 0%-40%。债券资产、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。



## §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		
侯斌	本基金基金经理	2015-07-03	-	15	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。

注：

- 1、此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》、《金元顺安核心动力混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

基金一直按照基金合约要求，采取稳健的投资策略，争取为基金投资者取得较好收益。我们对主动管理部分采取精选个股方法，选取业绩稳定，具有长期投资价值的公司进行投资，追求绝对收益。主要投资于消费行业、周期性行业龙头等行业和低估值龙头白马。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期份额净值增长率为 11.06%，同期业绩比较基准增长率为 11.41%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们判断整体经济仍然处于较好的水平。从宏观政策层面来看，货币和投资仍然处于有效控制范围之内，相机抉择，从上半年情况来看，特别是复杂的 6 月份，美国加息，国内

MPA 考核，流动性表现出较其他月份略宽松的情况。所以从下半年来看，中性货币政策下，虽然面临美国进一步加息和缩表，我们判断大概率国内能成功平稳过渡。但重点需要关注的是下半年利率中枢是否继续上行已经上行趋势斜率问题，如果在央行引导下利率出现长期趋势性中枢上移，可能对整体经济活动、投融资需求以及房地产市场都将出现重大影响。

从国际市场来看，下半年主要关注美国加息和缩表同时进行对全球金融市场的影响，我们判断全球主要经济体已经储备了大量的应对措施，出现黑天鹅的情况概率上比较低。

展望下半年的资本市场，我们先回顾上半年，主要是上证 50 和龙头白马公司出现明显上涨，部分行业估值水平已经上涨到历史较高水平，由于市场整体风险偏好较低，中小企业融资较难和部分企业出现实际控制人风险和轻仓式减持，所以龙头白马出现明显的估值溢价，我们需要重点关注行业盈利趋势的变化和风格偏好的变化，虽然短期可能不会出现趋势的风格切换，但我们认为仍然需要关注企业盈利端在大中型企业之间的变迁。

#### **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询；

(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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §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

本报告期内，本基金托管人在对金元顺安核心动力混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，金元顺安核心动力混合型证券投资基金的管理人——金元顺安基金管理有限公司在金元顺安核心动力混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，金元顺安核心动力混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本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

本托管人依法对金元顺安基金管理有限公司编制和披露的金元顺安核心动力混合型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

2017 年 8 月 18 日

## §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：金元顺安核心动力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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,080,188.19	2,770,787.07
结算备付金		-	20,030.28
存出保证金		45,506.33	5,482.95
交易性金融资产	6.4.7.2	128,807,807.54	24,472,259.44
其中：股票投资	6.4.7.2	128,807,807.54	24,472,259.44
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	-	-
应收证券清算款		-	1,100,096.25
应收利息	6.4.7.5	2,191.78	554.96
应收股利		-	-
应收申购款		44,999,217.02	9.99
递延所得税资产		-	-



其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		184,934,910.86	28,369,220.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	551,754.83
应付赎回款		47,190,802.27	17.48
应付管理人报酬		183,606.94	36,612.20
应付托管费		30,601.15	6,102.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	321,445.95	79,407.83
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	249,564.62	60,000.07
负债合计		47,976,020.93	733,894.46
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	121,700,353.06	27,286,028.30
未分配利润	6.4.7.10	15,258,536.87	349,298.18

所有者权益合计		136,958,889.93	27,635,326.48
负债和所有者权益总计		184,934,910.86	28,369,220.94

注：

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.125 元，基金份额总额 121,700,353.06 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金元顺安核心动力混合型证券投资基金

本报告期：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		11,045,234.05	-4,110,048.14
1.利息收入		33,484.12	23,649.98
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,144.50	20,453.43
债券利息收入		4.03	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,335.59	3,196.55
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,121,664.32	-1,012,681.06
其中：股票投资收益	6.4.7.12	614,269.25	-1,242,570.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,366.77	-
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	1,506,028.30	229,889.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	8,807,372.83	-3,121,459.99
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	82,712.78	442.93
<b>减：二、费用</b>		<b>1,198,728.38</b>	<b>419,095.63</b>
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	657,951.96	227,017.41
2.托管费	6.4.10.2.2	109,658.63	37,836.17
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	350,067.54	70,483.17
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	81,050.25	83,758.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>9,846,505.67</b>	<b>-4,529,143.77</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>9,846,505.67</b>	<b>-4,529,143.77</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安核心动力混合型证券投资基金

本报告期：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）	27,286,028.30	349,298.18	27,635,326.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,846,505.67	9,846,505.67
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）	94,414,324.76	5,062,733.02	99,477,057.78
其中：1.基金申购款	154,428,987.68	12,205,188.87	166,634,176.55
2.基金赎回款	-60,014,662.92	-7,142,455.85	-67,157,118.77
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）	121,700,353.06	15,258,536.87	136,958,889.93
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）	29,686,267.36	5,517,539.18	35,203,806.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,529,143.77	-4,529,143.77
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）	-674,250.86	-29,018.04	-703,268.90
其中：1.基金申购款	322,587.17	12,449.54	335,036.71
2.基金赎回款	-996,838.03	-41,467.58	-1,038,305.61
四、本期向基金份额持有人分配	-	-	-

利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	29,012,016.50	959,377.37	29,971,393.87

报告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

金元顺安核心动力混合型证券投资基金（原名为：金元比联核心动力股票型证券投资基金，以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]1424 号文《关于核准金元比联核心动力股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人金元比联基金管理有限公司（系金元顺安基金管理有限公司的前身）向社会公开发行募集，基金合同于 2010 年 2 月 11 日正式生效，首次设立募集规模为 436,884,917.98 份基金份额。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经金元比联第二届董事会第七次会议及第二届股东会第五次会议审议通过，并由中国证监会证监许可[2012]276 号文核准，金元比联基金管理有限公司已于 2012 年 3 月 15 日完成相关工商变更登记手续，并且变更公司名称为“金元惠理基金管理有限公司”。随后，报请中国证监会同意，将“金元比联核心动力股票型证券投资基金”更名为“金元惠理核心动力股票型证券投资基金”，并于 2012 年 5 月 2 日公告。

2015 年 2 月 5 日，经金元惠理基金管理有限公司股东金元证券股份有限公司及惠理基金管理香港有限公司以书面表决的方式达成更名决议。金元惠理基金管理有限公司于 2015 年 3 月 6 日完成相关工商变更登记手续，并且变更公司名称为“金元顺安基金管理有限公司”，并于 2015 年 3 月 10 日进行公告。根据中国证券监督管理委员会于 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，自 2015 年 7 月 15 日起将本基金变更

为“金元顺安核心动力混合型证券投资基金”，并相应修改本基金的《基金合同》。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金通过运用“核心—卫星”股票投资策略，将大部分基金资产用于完全复制大型上市公司股票指数（中证 100 指数）的业绩表现，并将部分资产投资于中证 100 指数以外的具备良好成长潜力且价值被低估的上市公司股票，在控制组合风险的前提下，追求基金资产中长期的稳定增值。

本基金的业绩比较基准为：中证 100 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

#### 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海泉意金融信息服务有限公司	基金管理人的股东
上海金元百利资产管理有限公司	基金管理人的子公司

#### 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未有应支付关联方的佣金。

##### 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	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年
----	------------------------------	-----------------------------------

	6 月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	657,951.96	227,017.41
其中：支付销售机构的客户维护费	23,838.44	30,336.25

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	109,658.63	37,836.17

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	-	13,548,780.49
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	-	13,548,780.49
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	11.13%

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
上海金元百利资产	4,061,363.93	3.34%	4,061,363.93	14.88%

管理有限公司				
--------	--	--	--	--

#### 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
中国工商银行股份有限公司	11,080,188.19	27,362.09	3,105,647.17	19,356.46

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 2,623.04 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 735.25 元，2016 年 6 月 30 日止结算备付金余额为人民币 0 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

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下新股	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下新股	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-

603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	网下新股	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	网下新股	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	网下新股	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下新股	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下新股	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下新股	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下新股	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-

## 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
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	14.59	-	-	5,300	122,695.00	77,327.00	-
600050	中国联通	2017-04-05	重要事项未公告	7.47	-	-	32,197	212,962.89	240,511.59	-
600795	国电电力	2017-06-05	重大资产重组	3.60	-	-	170,245	564,696.12	612,882.00	-
601088	中国神华	2017-06-05	重要事项未公告	22.29	-	-	28,858	541,483.84	643,244.82	-
601727	上海	2017-	重要公	7.57	2017-	7.54	55,900	432,154.42	423,163.00	-

	电气	06-22	告		07-03					
601989	中国重工	2017-05-31	重大资产重组	6.21	-	-	121,500	932,055.42	754,515.00	-
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项	20.24	-	-	14,440	305,018.58	292,265.60	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组	30.68	-	-	17,300	661,563.00	530,764.00	-

### 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，因其剩余期限不长，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 125,109,451.43 元，属于第二层次的余额为人民币 3,698,356.11 元，无属于第三层次的余额。（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 25,999,004.74 元，属于第二层次的余额为人民币 1,061,011.19 元，无属于第三层次的余额。）

###### 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	128,807,807.54	69.65
	其中：股票	128,807,807.54	69.65
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	11,080,188.19	5.99
7	其他各项资产	45,046,915.13	24.36
8	合计	184,934,910.86	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	-	-
B	采矿业	2,551,017.47	1.86



C	制造业	40,404,478.84	29.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,616,543.66	1.91
E	建筑业	4,449,921.53	3.25
F	批发和零售业	537,165.00	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	1,801,938.14	1.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,648,404.97	1.20
J	金融业	44,598,137.92	32.56
K	房地产业	29,371,383.75	21.45
L	租赁和商务服务业	122,464.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	405,629.26	0.30
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	300,723.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	128,807,807.54	94.05

### 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	000002	万科 A	332,073	8,291,862.81	6.05
2	601318	中国平安	137,313	6,812,097.93	4.97
3	002146	荣盛发展	480,100	4,738,587.00	3.46
4	002142	宁波银行	243,423	4,698,063.90	3.43
5	000036	华联控股	466,596	4,246,023.60	3.10
6	000936	华西股份	600,370	4,214,597.40	3.08
7	002133	广宇集团	737,555	4,086,054.70	2.98
8	000059	华锦股份	379,600	3,799,796.00	2.77
9	000666	经纬纺机	165,738	3,768,882.12	2.75
10	000031	中粮地产	467,035	3,516,773.55	2.57
11	600016	民生银行	380,482	3,127,562.04	2.28
12	000625	长安汽车	215,822	3,112,153.24	2.27
13	600036	招商银行	129,697	3,101,055.27	2.26
14	600519	贵州茅台	6,556	3,093,448.60	2.26
15	600048	保利地产	290,397	2,895,258.09	2.11
16	601166	兴业银行	156,121	2,632,200.06	1.92
17	000651	格力电器	62,000	2,552,540.00	1.86
18	000333	美的集团	58,980	2,538,499.20	1.85
19	601328	交通银行	343,560	2,116,329.60	1.55
20	601668	中国建筑	189,095	1,830,439.60	1.34
21	600000	浦发银行	141,483	1,789,759.95	1.31
22	601288	农业银行	480,755	1,692,257.60	1.24
23	600030	中信证券	98,998	1,684,945.96	1.23

24	600887	伊利股份	75,182	1,623,179.38	1.19
25	600837	海通证券	101,593	1,508,656.05	1.10
26	601169	北京银行	153,180	1,404,660.60	1.03
27	000858	五粮液	24,591	1,368,735.06	1.00
28	600104	上汽集团	44,071	1,368,404.55	1.00
29	601601	中国太保	39,752	1,346,400.24	0.98
30	600900	长江电力	82,253	1,265,051.14	0.92
31	601766	中国中车	121,941	1,234,042.92	0.90
32	000725	京东方 A	295,700	1,230,112.00	0.90
33	002415	海康威视	36,078	1,165,319.40	0.85
34	601211	国泰君安	56,700	1,162,917.00	0.85
35	600276	恒瑞医药	21,271	1,076,099.89	0.79
36	000001	平安银行	107,578	1,010,157.42	0.74
37	601988	中国银行	263,495	974,931.50	0.71
38	601998	中信银行	149,101	937,845.29	0.68
39	601390	中国中铁	93,533	810,931.11	0.59
40	600518	康美药业	37,146	807,554.04	0.59
41	601818	光大银行	198,199	802,705.95	0.59
42	600028	中国石化	132,600	786,318.00	0.57
43	601989	中国重工	121,500	754,515.00	0.55
44	600019	宝钢股份	111,529	748,359.59	0.55
45	600015	华夏银行	80,639	743,491.58	0.54
46	601688	华泰证券	41,117	735,994.30	0.54
47	000063	中兴通讯	29,875	709,232.50	0.52

48	601186	中国铁建	57,692	694,034.76	0.51
49	002304	洋河股份	7,641	663,315.21	0.48
50	000776	广发证券	37,300	643,425.00	0.47
51	601088	中国神华	28,858	643,244.82	0.47
52	001979	招商蛇口	29,800	636,528.00	0.46
53	000538	云南白药	6,763	634,707.55	0.46
54	601006	大秦铁路	74,466	624,769.74	0.46
55	600795	国电电力	170,245	612,882.00	0.45
56	600690	青岛海尔	39,578	595,648.90	0.43
57	601628	中国人寿	21,266	573,756.68	0.42
58	600585	海螺水泥	25,124	571,068.52	0.42
59	601336	新华保险	10,708	550,391.20	0.40
60	600958	东方证券	39,200	545,272.00	0.40
61	002024	苏宁云商	47,748	537,165.00	0.39
62	300104	乐视网	17,300	530,764.00	0.39
63	601009	南京银行	45,600	511,176.00	0.37
64	601901	方正证券	51,255	508,962.15	0.37
65	600999	招商证券	28,816	496,211.52	0.36
66	601857	中国石油	60,881	468,174.89	0.34
67	600340	华夏幸福	13,900	466,762.00	0.34
68	601985	中国核电	58,700	458,447.00	0.33
69	601899	紫金矿业	130,481	447,549.83	0.33
70	601669	中国电建	54,592	432,368.64	0.32
71	601727	上海电气	55,900	423,163.00	0.31

72	000166	申万宏源	75,520	422,912.00	0.31
73	002736	国信证券	31,051	411,425.75	0.30
74	000069	华侨城 A	40,321	405,629.26	0.30
75	600010	包钢股份	171,970	376,614.30	0.27
76	300059	东方财富	31,028	372,956.56	0.27
77	601788	光大证券	24,700	368,771.00	0.27
78	600637	东方明珠	16,600	359,722.00	0.26
79	002594	比亚迪	6,830	341,158.50	0.25
80	601618	中国中冶	67,610	338,726.10	0.25
81	601800	中国交建	19,172	304,643.08	0.22
82	002739	万达电影	5,900	300,723.00	0.22
83	000895	双汇发展	12,616	299,630.00	0.22
84	002252	上海莱士	14,440	292,265.60	0.21
85	600893	航发动力	10,300	281,190.00	0.21
86	600023	浙能电力	51,312	280,163.52	0.20
87	600606	绿地控股	35,300	276,046.00	0.20
88	601018	宁波港	48,806	275,753.90	0.20
89	600018	上港集团	40,675	257,879.50	0.19
90	600115	东方航空	37,300	253,640.00	0.19
91	601111	中国国航	25,268	246,363.00	0.18
92	600050	中国联通	32,197	240,511.59	0.18
93	601198	东兴证券	13,900	239,636.00	0.17
94	600061	国投安信	14,000	217,700.00	0.16
95	600663	陆家嘴	9,200	217,488.00	0.16

96	601229	上海银行	8,200	209,428.00	0.15
97	601225	陕西煤业	29,099	205,729.93	0.15
98	002673	西部证券	14,200	201,924.00	0.15
99	601633	长城汽车	15,141	201,223.89	0.15
100	600919	江苏银行	15,900	147,711.00	0.11
101	002352	顺丰控股	2,700	143,532.00	0.10
102	002558	巨人网络	2,960	136,811.20	0.10
103	601878	浙商证券	7,398	125,839.98	0.09
104	002027	分众传媒	8,900	122,464.00	0.09
105	601881	中国银河	8,100	96,066.00	0.07
106	600485	信威集团	5,300	77,327.00	0.06
107	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.06
108	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.03
109	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.03
110	002797	第一创业	4,940	45,497.40	0.03
111	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03
112	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.03
113	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.03
114	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.02
115	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.02
116	002881	美格智能	989	22,608.54	0.02
117	603679	华体科技	809	21,438.50	0.02
118	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.02
119	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01

120	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
121	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
122	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
123	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
124	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
125	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
126	603331	百达精工	999	9,620.37	0.01
127	300671	富满电子	942	7,639.62	0.01
128	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.01

#### 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	000625	长安汽车	10,327,965.00	37.37
2	000002	万科 A	8,991,131.00	32.53
3	000001	平安银行	5,860,122.00	21.21
4	002142	宁波银行	5,606,730.45	20.29
5	000069	华侨城 A	5,263,204.00	19.05
6	002133	广宇集团	4,999,584.82	18.09
7	000966	长源电力	4,999,514.75	18.09
8	000031	中粮地产	4,999,308.55	18.09
9	000936	华西股份	4,999,208.14	18.09
10	000059	华锦股份	4,999,040.00	18.09

11	000402	金融街	4,998,991.00	18.09
12	002244	滨江集团	4,998,917.60	18.09
13	000036	华联控股	4,998,789.00	18.09
14	000926	福星股份	4,998,631.00	18.09
15	000666	经纬纺机	4,998,330.16	18.09
16	002146	荣盛发展	4,997,337.00	18.08
17	000539	粤电力 A	4,961,782.30	17.95
18	601318	中国平安	4,279,228.03	15.48
19	600048	保利地产	3,733,138.00	13.51
20	600016	民生银行	2,732,449.00	9.89
21	601166	兴业银行	2,319,406.00	8.39
22	600519	贵州茅台	2,263,464.00	8.19
23	600036	招商银行	1,971,609.00	7.13
24	601328	交通银行	1,822,089.00	6.59
25	000651	格力电器	1,602,355.00	5.80
26	000333	美的集团	1,590,960.00	5.76
27	600887	伊利股份	1,540,249.00	5.57
28	601766	中国中车	1,519,868.00	5.50
29	600000	浦发银行	1,437,468.00	5.20
30	601288	农业银行	1,370,139.00	4.96
31	601668	中国建筑	1,322,190.00	4.78
32	600030	中信证券	1,303,963.00	4.72
33	601169	北京银行	1,286,660.92	4.66
34	000921	海信科龙	1,284,622.00	4.65



35	600837	海通证券	1,278,250.00	4.63
36	600104	上汽集团	1,114,040.00	4.03
37	603377	东方时尚	1,094,168.00	3.96
38	600900	长江电力	934,183.00	3.38
39	601601	中国太保	922,564.00	3.34
40	000725	京东方 A	903,078.00	3.27
41	000858	五粮液	869,918.00	3.15
42	600019	宝钢股份	856,992.00	3.10
43	601211	国泰君安	840,258.00	3.04
44	600276	恒瑞医药	805,666.26	2.92
45	601998	中信银行	782,740.00	2.83
46	601009	南京银行	761,630.00	2.76
47	600585	海螺水泥	741,380.00	2.68
48	601988	中国银行	735,201.00	2.66
49	601390	中国中铁	729,482.00	2.64
50	300444	双杰电气	680,235.00	2.46
51	601186	中国铁建	661,782.00	2.39
52	601989	中国重工	656,322.00	2.37
53	600028	中国石化	656,294.00	2.37
54	600015	华夏银行	648,952.00	2.35
55	601818	光大银行	617,156.00	2.23
56	600518	康美药业	589,150.00	2.13
57	601628	中国人寿	570,866.00	2.07
58	300503	昊志机电	565,656.00	2.05

59	002304	洋河股份	563,732.00	2.04
60	600358	国旅联合	563,176.00	2.04
61	600737	中粮糖业	561,550.00	2.03
62	600889	南京化纤	561,326.00	2.03
63	600498	烽火通信	561,116.00	2.03
64	000528	柳工	561,024.00	2.03
65	000877	天山股份	560,683.00	2.03
66	600567	山鹰纸业	560,000.00	2.03
67	002426	胜利精密	559,106.00	2.02
68	000718	苏宁环球	558,800.00	2.02
69	002443	金洲管道	553,421.00	2.00

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	000625	长安汽车	6,366,584.79	23.04
2	000069	华侨城 A	5,492,765.96	19.88
3	000001	平安银行	5,178,821.04	18.74
4	000402	金融街	5,174,689.80	18.72
5	000926	福星股份	5,122,465.48	18.54
6	002244	滨江集团	4,746,190.64	17.17
7	000539	粤电力 A	4,704,358.45	17.02

8	000966	长源电力	4,197,230.70	15.19
9	000002	万科 A	2,598,517.71	9.40
10	000921	海信科龙	1,983,124.00	7.18
11	002142	宁波银行	1,185,007.00	4.29
12	600048	保利地产	1,149,212.29	4.16
13	603377	东方时尚	1,119,026.40	4.05
14	000666	经纬纺机	999,840.00	3.62
15	000059	华锦股份	999,775.00	3.62
16	002133	广宇集团	999,640.00	3.62
17	000936	华西股份	999,475.00	3.62
18	000031	中粮地产	999,417.00	3.62
19	000036	华联控股	999,273.84	3.62
20	601318	中国平安	995,836.00	3.60
21	000877	天山股份	715,957.64	2.59
22	300444	双杰电气	694,307.00	2.51
23	601166	兴业银行	614,904.00	2.23
24	000528	柳工	603,956.58	2.19
25	601766	中国中车	601,169.00	2.18
26	600887	伊利股份	599,999.52	2.17
27	000718	苏宁环球	581,981.00	2.11
28	600737	中粮糖业	580,770.00	2.10
29	002508	老板电器	579,920.00	2.10
30	002443	金洲管道	572,697.00	2.07
31	600567	山鹰纸业	571,200.00	2.07

32	603611	诺力股份	558,804.00	2.02
33	600498	烽火通信	555,253.00	2.01
34	600596	新安股份	554,566.00	2.01

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	179,575,767.21
卖出股票的收入（成交）总额	84,661,861.19

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、关于中国平安（代码：601318）的处罚说明

2017 年 2 月 22 日中国证券监督管理委员会深圳监管局行政处罚决定书（2017）2 号，具体内容如下：

当事人：敖翔，男，1982 年 10 月出生，住址：上海市闵行区。

依据《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）有关规定，我局对敖翔涉嫌违法买卖股票案进行了调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据以及当事人依法享有的权利。当事人敖翔提交了陈述、申辩意见，未要求举行听证，本案现已审理终结。

经查明，敖翔存在以下违法事实：

敖翔于 2008 年 4 月至 2011 年 11 月在平安证券有限责任公司投资银行部门任职，2011 年 11 月至 2015 年 3 月在齐鲁证券有限公司（现更名为中泰证券股份有限公司）投资银行部门任职；2015 年 4 月至调查日（2016 年 5 月 6 日）在华泰联合证券有限责任公司投资银行部门任职。

“徐某珍”账户于 2010 年 9 月 20 日开立于世纪证券有限责任公司樟树富通街证券营业部，资金账号 19\*\*\*\*33，下挂上海股东账户 A31\*\*\*\*\*38 和深圳股东账户 01\*\*\*\*\*89；2014 年 12 月 10 日开通融资融券业务，信用资金账户为 90\*\*\*\*44，下挂深 A 信用证券账户 06\*\*\*\*\*56 和沪 A 信用证券账户 E02\*\*\*\*\*18。

敖翔在上述证券公司任职期间，利用“徐某珍”账户通过网上委托、手机委托等方式交易“中国平安”、“欣旺达”、“金城股份”等多只股票。经查，“徐某珍”账户累计转入资金 6,056,900 元，转出资金 5,916,054.8 元，累计买入金额 25,916,482.17 元，卖出金额 25,775,796.68 元，合计亏损 140,685.49 元。截至调查日，“徐某珍”账户无期末持股，资金余额 159.71 元。在案件调查过程中，敖翔能积极配合调查。

上述违法事实，有任职情况说明、相关证券账户资料、证券交易记录、银行账户流水和询问笔录等证据在案证明。

敖翔的上述行为违反了《证券法》第四十三条“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”的规定，构成了《证券法》第一百九十九条所述违法行为。

敖翔在陈述和申辩材料中提出，“徐某珍”账户由其父亲敖某生 2010 年开立并独立控制，资金主要来源于父亲的积蓄，自己也将部分闲置资金借给父亲，但对父亲开立并使用“徐某珍”账户炒股并不知情。直至 2014 年初，才知晓父亲使用“徐某珍”账户炒股的事实，并协助父亲进行了少量股票操作。愿对自己的行为承担责任，请求考虑上述情况酌情处理。

我局认为，根据在案证据，敖翔与其父亲 2010 年开始在上海共同居住生活，“徐某珍”账户开立后，即通过敖翔多个银行账户转入多笔资金，资金主要来源于敖翔及其夫妻共同财产；资金转出主要去向为敖翔夫妻、其他个人和企业，用于敖翔家庭日常生活消费以及敖翔对外投资、借给朋友和支付离婚协议费用等。“徐某珍”账户网上委托交易使用多个 MAC 地址，对应的 IP 地址分布在北京、上海、杭州、无锡、南通、南昌和丽江等地，同时还有多笔敖翔通过手机下单的交易记录。敖翔所称其父亲在上海家中使用单一 MAC 地址下单交易、自己在 2014 年初之后才知道“徐某珍”账户并仅协

助进行少量股票操作的说法与上述事实明显不符。敖翔在接受调查时承认利用“徐某珍”账户进行股票交易，并称融资融券账户都由其操作。综合本案情况，虽然不排除敖某生可能使用“徐某珍”账户进行了股票交易，但在案证据足以认定敖翔主要控制和利用“徐某珍”账户进行股票交易的违法事实。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度，依据《证券法》第一百九十九条的规定，我局决定：对敖翔处以 10 万元罚款。

当事人应自收到本处罚决定书之日起 15 日内，将罚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：711101018980000162，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中国证券监督管理委员会稽查局和深圳证监局备案。当事人如对本处罚决定不服，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。

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，根据基金契约被动持有。该处罚主要是针对二级市场违规投资个人行为，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。

## 2、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。

### 3、关于中粮地产（代码：000031）的处罚说明

深圳证券交易所 2017 年 3 月 21 日对中粮地产（集团）股份有限公司出具关注函，具体内容如下：

中粮地产（集团）股份有限公司：

近日，我部关注到你公司在信息披露方面存在以下不规范事项：

一、你公司部分信息披露不准确。你公司在 2015 年年报和 2016 年半年报中关于“08 中粮债”募集资金存储与划转账户的相关信息披露内容与实际情况不相符。

二、你公司部分信息披露不完整。你公司在定期报告中未按照规定披露公司债券募集资金使用履行的程序。

你公司上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》第四条及《深圳证券交易所公司债券上市规则（2015 年修订）》第 4.1.1 条等相关规定，我部予以监管关注。请你公司高度重视信息披露义务，就上述事项说明后续整改计划及整改情况，于 2017 年 3 月 28 日前向我部提交书面说明。

同时，我部提醒你公司严格遵守《公司债券发行与交易管理办法》、《深圳证券交易所公司债券



上市规则（2015 年修订）》等相关法律法规规定，及时、真实、准确、完整地履行信息披露义务，维护债券持有人合法权益。

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。主要是针对公司的信息披露完整性进行关注，并不影响公司的经营和公司价值。

#### 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	45,506.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,191.78
5	应收申购款	44,999,217.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,046,915.13

#### 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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

#### 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
771	157,847.41	112,911,039.09	92.78%	8,789,313.97	7.22%

## 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	393,187.85	0.323%

## 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	10~50
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（2010年2月11日）基金份额总额	436,884,917.98
本报告期期初基金份额总额	27,286,028.30
本报告期基金总申购份额	154,428,987.68
减：本报告期基金总赎回份额	60,014,662.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	121,700,353.06

## §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	
国金证券股份有限公司	1	164,784,402.66	62.55%	150,167.87	62.04%	-
华创证券有限责任公司	1	82,036,701.32	31.14%	76,400.54	31.57%	-
平安证券有限责任公司	2	16,610,882.57	6.31%	15,469.71	6.39%	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
爱建证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：

## 1、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<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，本基金无新租或退租的交易单元。

## 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
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	47,370.80	100.00%	20,600,000.00	100.00%	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-



申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

长江证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国民族证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-

## §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 6 月 30 日-2017 年 6 月 30 日	-	39,892,730.50	-	39,892,730.50	32.78%
机构	2	2017 年 3 月 31 日-2017 年 6 月 30 日	-	42,371,939.74	33,000,000.00	9,371,939.74	7.70%

**产品特有风险**

- 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