

金元顺安宝石动力混合型证券投资基金  
2017 年半年度报告

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。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	10
§4 管理人报告.....	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§5 托管人报告.....	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
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.....	19

§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	20
6.1 资产负债表.....	20
6.2 利润表.....	22
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
6.4 报表附注.....	25
§7 投资组合报告.....	49
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
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 .....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
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 .....	55
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 .....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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 .....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61

10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
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.....	68
§12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金元顺安宝石动力混合型证券投资基金
基金简称	金元顺安宝石动力混合
基金主代码	620001
交易代码	620001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 10 月 1 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	107,160,646.03 份
基金合同存续期	不定期

注：

1、“金元比联宝石动力混合型证券投资基金”（系本基金前身）合同生效日为 2007 年 8 月 15 日，从 2010 年 10 月 1 日，本基金转型为混合型证券投资基金。故本基金本报告中基金合同生效日为 2010 年 10 月 1 日；

2、本基金第一个保本周期为 3 年，自 2007 年 8 月 15 日起至 2010 年 8 月 16 日。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资具有稳健基础的中国优质企业，追求本基金资产的稳定收益与长期资本增值。
投资策略	在不同的市场阶段，本基金将分别从宏观经济情景、各类资产收益风险预期等方面进行深入分析，在股票与债券资产之间进行策略性

	资产配置，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化基金资产组合。本基金股票投资策略由采用自上而下的资产配置计划与自下而上的选股计划组成。本基金的债券投资策略主要包括债券投资组合策略和个券选择策略。本公司将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。
业绩比较基准	标普中国 A 股 300 指数×50%+中证综合债指数×50%
风险收益特征	本基金系稳健增长型的混合型基金，其风险收益特征从长期平均及预期来看，低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场型基金，属于中等预期收益、中等预期风险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》、《证券日报》
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

**2.5 其他相关资料**

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	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

### §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	1,143,856.53
本期利润	6,887,585.95
加权平均基金份额本期利润	0.0629
本期加权平均净值利润率	6.27%
本期基金份额净值增长率	6.42%
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	5,574,026.49
期末可供分配基金份额利润	0.0520
期末基金资产净值	112,734,672.52
期末基金份额净值	1.0520
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	7.00%

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	2.99%	0.48%	3.23%	0.35%	-0.24%	0.13%
过去三个月	4.38%	0.48%	3.37%	0.33%	1.01%	0.15%
过去六个月	6.42%	0.43%	6.08%	0.29%	0.34%	0.14%
过去一年	3.20%	0.45%	9.57%	0.34%	-6.37%	0.11%
过去三年	29.83%	1.31%	38.51%	0.86%	-8.68%	0.45%
自基金成立起至今	7.00%	1.10%	29.30%	0.75%	-22.30%	0.35%

注：

1、“金元比联宝石动力混合型证券投资基金”（系本基金前身）合同生效日为 2007 年 8 月 15 日，从 2010 年 10 月 1 日，本基金转型为混合型证券投资基金；

2、本基金第一个保本周期为 3 年，自 2007 年 8 月 15 日起至 2010 年 8 月 16 日。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日，业绩基准累计增长率以 2010 年 9 月 30 日指数为基准；

3、本基金第一个保本周期为 3 年，自 2007 年 8 月 15 日起至 2010 年 8 月 16 日。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日；

4、本基金从 2010 年 10 月 1 日起正式转型为混合型证券投资基金，

5、本基金投资组合的资产配置范围为股票资产占基金资产的比例为 40%-60%，债券资产占基金资产的比例为 35%-55%，权证不超过基金资产净值的 3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围；

6、本基金在 2015 年 11 月 27 日变更了业绩比较基准，业绩比较基准由“中信标普 300 指数×50%+中信国债指数×50%”变更为“标普中国 A 股 300 指数×50%+中证综合债指数×50%”。

## 3.2.2 自基金转型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

金元顺安宝石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 10 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：

- 1、“金元比联宝石动力混合型证券投资基金”（系本基金前身）合同生效日为 2007 年 8 月 15 日，从 2010 年 10 月 1 日，本基金转型为混合型证券投资基金；
- 2、本基金第一个保本周期为 3 年，自 2007 年 8 月 15 日起至 2010 年 8 月 16 日。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日，业绩基准累计增长率以 2010 年 9 月 30 日指数为基准；
- 3、本基金第一个保本周期为 3 年，自 2007 年 8 月 15 日起至 2010 年 8 月 16 日。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日；
- 4、本基金从 2010 年 10 月 1 日起正式转型为混合型证券投资基金，
- 5、本基金投资组合的资产配置范围为股票资产占基金资产的比例为 40%-60%，债券资产占基金资产的比例为 35%-55%，权证不超过基金资产净值的 3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序

后，可以将其纳入投资范围。

## §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、金元顺安核盛债券型证券投资基金和金元顺安核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	2011-12-22	-	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。
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。

#### **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》、《金元顺安宝石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

报告期内，基金重点投资于银行、保险和生物医药等。

##### 4.4.2 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 6.42%，业绩比较基准收益率为 6.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度 GDP 同比增长 6.9%，与一季度持平，超出市场预期。二季度经济能够超预期保持 6.9% 的高增速，主要得益于二季度房地产投资的高增速和基建的持续发力。然而，受到一线城市房地产调控影响和市场利率维持高位背景下，房地产投资仍可能承压，基建也会受到财政赤字约束。经济虽然保持韧性，但是仍有回落压力。

全国金融工作会议和政治局的下半年经济工作部署会议都强调下半年工作总基调是稳中求进，两场会议都强调了深化供给侧改革的经济工作主线，“去杠杆”工作的重心从金融业转向国企“去杠杆”和防范地方政府债务风险。下半年继续保持货币政策稳健中性是大概率事，货币市场利率将维持高位震荡。

欧美经济的复苏态势总体平稳，尽管通胀低位使得货币正常化的推进仍然审慎，但是美联储表达的坚定的缩表意愿，欧央行也表示将于秋季考虑 QE 削减的问题。外部流动性收紧的方向是确定的。

一方面受益于经济韧性，企业盈利改善，另一方面，又受制于经济下行压力和中性货币政策，市场仍将维持震荡市和结构市的特征。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。

#### 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宝石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，金元顺安宝石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宝石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，金元顺安宝石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宝石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：金元顺安宝石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	21,733,938.32	1,336,783.81
结算备付金		145,669.55	275,996.15
存出保证金		26,758.08	26,820.35
交易性金融资产	6.4.7.2	91,150,467.71	108,097,731.04
其中：股票投资	6.4.7.2	50,253,779.91	59,514,608.94
基金投资	6.4.7.2	-	-
债券投资	6.4.7.2	40,896,687.80	48,583,122.10
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		34,062.88	-
应收利息	6.4.7.5	673,820.40	1,636,085.63
应收股利		-	-
应收申购款		1,103.00	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		113,765,819.94	111,373,416.98
<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		-	-
应付赎回款		76,851.83	32,465.92
应付管理人报酬		136,678.00	141,618.02
应付托管费		22,779.67	23,603.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	633,642.36	514,394.68
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	161,195.56	70,000.74
负债合计		1,031,147.42	782,082.38
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	107,160,646.03	111,875,874.22
未分配利润	6.4.7.10	5,574,026.49	-1,284,539.62

所有者权益合计		112,734,672.52	110,591,334.60
负债和所有者权益总计		113,765,819.94	111,373,416.98

注：

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0520 元，基金份额总额 107,160,646.03 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金元顺安宝石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		8,223,868.42	-22,972,189.34
1.利息收入		1,364,043.99	1,571,080.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	53,846.16	41,769.15
债券利息收入		1,310,197.83	1,529,311.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,115,472.19	-24,213,070.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	378,843.48	-24,603,995.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	77,638.63	267,948.42
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	658,990.08	122,976.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,743,729.42	-336,513.13
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	622.82	6,313.91
<b>减：二、费用</b>		<b>1,336,282.47</b>	<b>1,931,187.49</b>
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	817,199.07	918,289.43
2.托管费	6.4.10.2.2	136,199.91	153,048.10
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	202,907.47	649,214.97
5.利息支出		-	7,497.49
其中：卖出回购金融资产支出		-	7,497.49
6.其他费用	6.4.7.21	179,976.02	203,137.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>6,887,585.95</b>	<b>-24,903,376.83</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>6,887,585.95</b>	<b>-24,903,376.83</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安宝石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）	111,875,874.22	-1,284,539.62	110,591,334.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,887,585.95	6,887,585.95
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）	-4,715,228.19	-29,019.84	-4,744,248.03
其中：1.基金申购款	442,721.50	4,935.03	447,656.53
2.基金赎回款	-5,157,949.69	-33,954.87	-5,191,904.56
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）	107,160,646.03	5,574,026.49	112,734,672.52
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）	123,893,659.61	27,285,366.71	151,179,026.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-24,903,376.83	-24,903,376.83
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）	-4,936,656.83	-73,454.95	-5,010,111.78
其中：1.基金申购款	1,231,954.95	-4,221.08	1,227,733.87
2.基金赎回款	-6,168,611.78	-69,233.87	-6,237,845.65
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）	118,957,002.78	2,308,534.93	121,265,537.71
-----------------	----------------	--------------	----------------

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

金元顺安宝石动力混合型证券投资基金（原名为：金元比联宝石动力混合型证券投资基金，以下简称“本基金”），由金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金转型而成。金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金于 2010 年 8 月 16 日保本到期，由于不符合保本基金存续条件，按照《金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金基金合同》约定，该基金由保本混合型基金转型为非保本混合型基金，相应调整基金投资目标、投资策略、业绩比较基准和费率等，同时修订基金合同，并更名为“金元比联宝石动力混合型证券投资基金”。本基金于 2010 年 10 月 1 日起始运作。

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，并由中国证券监督管理委员会（以下简称“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，将金元比联宝石动力混合型证券投资基金更名为金元惠理宝石动力混合型证券投资基金，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于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。经本基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后，“金元惠理宝石动力混合型证券投资基金”相应更名为“金元顺安宝石动力混合型证券投资基金”，并于 2015 年 7 月 15 日进行公告。

本基金主要投资具有稳健基础的中国优质企业，追求本基金资产的稳定收益与长期资本增值。本基金投资范围限于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。

本基金采用行业配置指导下的个股精选策略。

本基金业绩比较基准为标普中国 A 股 300 指数×50%+中证综合债指数×50%。

#### 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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	活期存款	21,733,938.32
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	21,733,938.32	

## 6.4.7.2 交易性金融资产

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	42,585,232.91	50,253,779.91	7,668,547.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	37,326,037.26	36,495,687.80
	银行间市场	4,830,722.74	4,401,000.00
	合计	42,156,760.00	40,896,687.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	84,741,992.91	91,150,467.71	6,408,474.80

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	3,872.56
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	59.04
应收债券利息	669,878.00
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	10.80
合计	673,820.40

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

金额单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	633,342.36
银行间市场应付交易费用	300.00
合计	633,642.36

#### 6.4.7.8 其他负债

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	29.54
预提审计费	32,232.48
预提信息披露费	128,933.54
合计	161,195.56

#### 6.4.7.9 实收基金

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	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	111,875,874.22	111,875,874.22
本期申购	442,721.50	442,721.50
本期赎回（以“-”号填列）	-5,157,949.69	-5,157,949.69
本期末	107,160,646.03	107,160,646.03

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,518,158.98	-18,802,698.60	-1,284,539.62
本期利润	1,143,856.53	5,743,729.42	6,887,585.95
本期基金份额交易产生的变动数	-750,803.91	721,784.07	-29,019.84
其中：基金申购款	70,229.98	-65,294.95	4,935.03
基金赎回款	-821,033.89	787,079.02	-33,954.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,911,211.60	-12,337,185.11	5,574,026.49

#### 6.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	52,658.39
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	938.42
其他	249.35
合计	53,846.16

#### 6.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	72,275,100.22
减：卖出股票成本总额	71,896,256.74
买卖股票差价收入	378,843.48

**6.4.7.13 债券投资收益**

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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,324,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,422,361.37
减：应收利息总额	824,000.00
债券投资收益	77,638.63

**6.4.7.14 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**6.4.7.17 股利收益**

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
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	658,990.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	658,990.08

## 6.4.7.18 公允价值变动收益

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
1.交易性金融资产	5,743,729.42
——股票投资	6,497,352.35
——债券投资	-753,622.93
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	5,743,729.42

## 6.4.7.19 其他收入

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
基金赎回费收入	611.79

配股手续费	-
新股手续费返还	-
印花税返还	-
转换费收入	11.03
其他	-
合计	622.82

#### 6.4.7.20 交易费用

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
交易所市场交易费用	202,907.47
银行间市场交易费用	-
合计	202,907.47

#### 6.4.7.21 其他费用

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
审计费用	32,232.48
信息披露费	128,933.54
银行汇划费用	210.00
上市费	-
持有人大会费	-
账户维护费	18,000.00

转托管费	-
其他费用	600.00
合计	179,976.02

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 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。

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

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管理费	817,199.07	918,289.43
其中：支付销售机构的客户维护费	48,569.15	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。

**6.4.10.2 基金托管费**

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托管费	136,199.91	153,048.10

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。

**6.4.10.3 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。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 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	21,733,938.32	52,658.39	14,113,452.81	36,015.24

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 938.42 元，2017 年 6 月 30 日止结算备付金余额为人民币 145,669.55 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 4,492.27 元，2016 年 6 月 30 日止结算备付金余额为人民币 148,109.22 元。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 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。

###### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入公司各个业务层面的全面控制过程之中，并建立了三道防线：以各岗位职责为基础，形成第一道防线；通过相关岗位之间、相关部门之间相互监督制衡，形成第二道防线；由督察长、风险控制委员会、监察稽核部对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务进行监督、检查、评价，形成的第三道防线。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以降低信用风险。

本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

金额单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年末 2016 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	9,987,000.00
合计	-	9,987,000.00

注：

未评级债券为国债。

#### 6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

金额单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年末 2016 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	14,780,037.80	17,437,072.10
未评级	26,116,650.00	21,159,050.00
合计	40,896,687.80	38,596,122.10

注：

未评级债券为国债和政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所和银行间同业市场交易；因此，本年末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产

主要为银行存款、清算备付金、存出保证金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,733,938.32	-	-	-	21,733,938.32
结算备付金	145,669.55	-	-	-	145,669.55
存出保证金	26,758.08	-	-	-	26,758.08
交易性金融资产	7,694,450.00	23,346,237.80	9,856,000.00	50,253,779.91	91,150,467.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	34,062.88	34,062.88
应收利息	-	-	-	673,820.40	673,820.40
应收申购款	-	-	-	1,103.00	1,103.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
资产总计	29,600,815.95	23,346,237.80	9,856,000.00	50,962,766.19	113,765,819.94
负债					
应付赎回费	-	-	-	29.54	29.54
应付管理人报酬	-	-	-	136,678.00	136,678.00
应付托管费	-	-	-	22,779.67	22,779.67
应付交易费用	-	-	-	633,642.36	633,642.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	-	-
预提费用	-	-	-	161,166.02	161,166.02
应付赎回款	-	-	-	76,851.83	76,851.83
负债总计	-	-	-	1,031,147.42	1,031,147.42
利率敏感度缺口	29,600,815.95	23,346,237.80	9,856,000.00	49,931,618.77	112,734,672.52
<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	1,336,783.81	-	-	-	1,336,783.81
结算备付金	275,996.15	-	-	-	275,996.15
存出保证金	26,820.35	-	-	-	26,820.35
交易性金融资产	22,947,405.43	15,460,716.67	10,175,000.00	59,514,608.94	108,097,731.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,636,085.63	1,636,085.63
应收申购款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,587,005.74	15,460,716.67	10,175,000.00	61,150,694.57	111,373,416.98
负债					
应付赎回费	-	-	-	0.74	0.74
应付管理人报酬	-	-	-	141,618.02	141,618.02
应付托管费	-	-	-	23,603.02	23,603.02

应付交易费用	-	-	-	514,394.68	514,394.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	-	-
预提费用	-	-	-	70,000.00	70,000.00
应付赎回款	-	-	-	32,465.92	32,465.92
负债总计	-	-	-	782,082.38	782,082.38
利率敏感度缺口	24,587,005.74	15,460,716.67	10,175,000.00	60,368,612.19	110,591,334.60

注：

表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	以中央国债登记结算有限责任公司公布的 2017 年 6 月 30 日和 2016 年 12 月 31 日各债券的基点价值（BP 价值）为主要计算依据		
	债券持仓结构保持不变		
	银行存款、清算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	基准利率下降 1 个基点	增加 0.92 万元	增加 1.08 万元

	基准利率上升 1 个基点	减少 0.92 万元	减少 1.07 万元
--	--------------	------------	------------

注：

上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—— 股票投资	50,253,779.91	44.58	59,514,608.94	53.81
交易性金融资产—— 债券投资	40,896,687.80	36.28	48,583,122.10	43.93
交易性金融资产—— 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产——权 证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	91,150,467.71	80.85	108,097,731.04	97.75
----	---------------	-------	----------------	-------

注：

本基金投资组合的资产配置范围为：股票资产占基金资产的比例为 40%-60%，债券资产占基金资产的比例为 35%-55%，权证不超过基金资产净值的 3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合中股票投资的贝塔系数紧密相关。		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	标普中国 300 指数上涨 5%	增加 127.67 万元	增加 351.83 万元
	标普中国 300 指数下跌 5%	减少 127.67 万元	减少 351.83 万元

注：

本基金管理人运用资本——资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

风险价值（VaR）含义是指：在市场正常波动下，某一金融资产或证券组合的最大可能损失。更为确切的是指，在一定概率水平（置信度）下，某一金融资产或证券组合价值在未来特定时期内的最大可能损失。用公式表示为： $\text{Prob}(\Delta P > \text{VaR}) = 1 - \alpha$  或  $\text{Prob}(\Delta P < \text{VaR}) = \alpha$ ，

其中 Prob 表示：资产价值损失小于可能损失上限的概率。 $\Delta P$  表示：某一金融资产在一定持有期  $\Delta t$

的价值损失额。VAR 表示：给定置信水平  $\alpha$  下的在险价值，即可能的损失上限。 $\alpha$  为：给定的置信水平。

置信区间	在 99% 的置信水平下采用风险价值模型来管理风险		
观察期	以资产负债表日前 120 个交易日为观察期		
假设	本基金的基金净值日对数收益率服从正态分布		
	预测期间本基金的资产组合的结构保持不变		
分析	风险价值	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	合计	增加 91.77 万元	增加 148.23 万元

注：

上述分析衡量了在 99% 的置信水平下，所持有的权益类资产组合在资产负债表日后一个交易日内由于市场价格风险所导致的最大潜在损失。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

###### 6.4.14.1.1 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、卖出回购金融资产款以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.1.2.1 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资产中属于第一层次的余额为人民币 50,253,799.91 元，属于第二层次的余额为人民币 40,896,687.80 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资产中属于第一层次的余额为人民币 96,589,176.09 元，属于第二层次的余额为人民币 10,561,150.68 元，无属于第三层次的余额。）

###### 6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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股票和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，确定相关股票和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次从第一层次转入第二层次。

#### **6.4.14.1.2.3 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。

#### **6.4.14.2 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。

#### **6.4.14.3 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	50,253,779.91	44.17
	其中：股票	50,253,779.91	44.17
2	固定收益投资	40,896,687.80	35.95
	其中：债券	40,896,687.80	35.95
	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	21,879,607.87	19.23
7	其他各项资产	735,744.36	0.65
8	合计	113,765,819.94	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	1,721,335.00	1.53

C	制造业	17,446,175.52	15.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	31,086,269.39	27.57
K	房地产业	-	-
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	50,253,779.91	44.58

### 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	601318	中国平安	223,057	11,065,857.77	9.82
2	600036	招商银行	438,646	10,488,025.86	9.30
3	600276	恒瑞医药	181,728	9,193,619.52	8.16
4	601939	建设银行	897,100	5,517,165.00	4.89
5	600521	华海药业	200,600	4,220,624.00	3.74
6	601601	中国太保	118,548	4,015,220.76	3.56
7	600056	中国医药	133,600	3,466,920.00	3.08
8	600547	山东黄金	59,500	1,721,335.00	1.53
9	000063	中兴通讯	23,800	565,012.00	0.50

#### 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	601318	中国平安	8,490,979.14	7.68
2	601939	建设银行	5,351,258.00	4.84
3	600036	招商银行	4,822,639.52	4.36
4	600521	华海药业	4,346,758.00	3.93
5	600582	天地科技	3,295,645.00	2.98
6	601601	中国太保	3,285,249.60	2.97
7	601377	兴业证券	3,273,263.00	2.96
8	600276	恒瑞医药	3,270,887.65	2.96
9	600056	中国医药	3,265,323.00	2.95

10	600362	江西铜业	2,848,313.00	2.58
11	600547	山东黄金	2,223,041.00	2.01
12	600596	新安股份	2,211,137.00	2.00
13	600141	兴发集团	2,210,534.00	2.00
14	000925	众合科技	2,199,917.00	1.99
15	600409	三友化工	2,198,575.00	1.99
16	601618	中国中冶	2,198,449.00	1.99
17	000063	中兴通讯	498,134.00	0.45
18	603096	新经典	21,550.00	0.02
19	603178	圣龙股份	19,412.34	0.02
20	601878	浙商证券	16,900.00	0.02

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	600519	贵州茅台	7,132,123.91	6.45
2	600491	龙元建设	4,938,304.74	4.47
3	600502	安徽水利	4,861,404.38	4.40
4	300284	苏交科	4,656,418.42	4.21
5	601618	中国中冶	4,477,492.84	4.05
6	600068	葛洲坝	4,380,628.50	3.96
7	002299	圣农发展	3,571,050.50	3.23

8	600582	天地科技	3,243,000.00	2.93
9	600115	东方航空	3,222,427.00	2.91
10	601169	北京银行	3,185,880.00	2.88
11	601377	兴业证券	3,185,607.28	2.88
12	000151	中成股份	2,911,708.00	2.63
13	600362	江西铜业	2,548,200.97	2.30
14	002051	中工国际	2,448,810.00	2.21
15	600409	三友化工	2,432,867.49	2.20
16	000568	泸州老窖	2,241,728.00	2.03
17	600141	兴发集团	2,182,693.00	1.97
18	000925	众合科技	2,096,596.00	1.90
19	002234	民和股份	2,036,770.00	1.84
20	600596	新安股份	1,999,808.00	1.81

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	56,138,075.36
卖出股票的收入（成交）总额	72,275,100.22

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	15,349,950.00	13.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,766,700.00	9.55
	其中：政策性金融债	10,766,700.00	9.55
4	企业债券	14,780,037.80	13.11
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	40,896,687.80	36.28

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018002	国开 1302	105,000	10,766,700.00	9.55
2	122652	12 杨农债	100,010	10,379,037.80	9.21
3	010303	03 国债（3）	100,000	9,856,000.00	8.74
4	019546	16 国债 18	55,000	5,493,950.00	4.87
5	1380055	13 万正债	100,000	4,401,000.00	3.90

## 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。**

##### **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。

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 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：7111010189800000162，由该行直接上缴国库），并将注有当事人名称的付款凭证复印件送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。此次事件是公司下属子公司平安证券一名部门员工利用个人账户参与股票市场交易而违规，是该员工的个人行为。我们判断此次事件对公司无任何影响，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。

#### 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	26,758.08
2	应收证券清算款	34,062.88
3	应收股利	-
4	应收利息	673,820.40
5	应收申购款	1,103.00

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	735,744.36

#### 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
8,041	13,326.78	1,586,291.64	1.48%	105,574,354.39	98.52%

### 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	125,753.52	0.117%

### 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

本报告期末本公司高管及投研部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

## §9 开放式基金份额变动

份额单位：份

基金合同生效日（2010 年 10 月 1 日）基金份额总额	765,571,227.19
本报告期期初基金份额总额	111,875,874.22
本报告期基金总申购份额	442,721.50
减：本报告期基金总赎回份额	5,157,949.69
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	107,160,646.03

注：

“金元比联宝石动力混合型证券投资基金”（系本基金前身）合同生效日为 2007 年 8 月 15 日，从 2010 年 10 月 1 日，本基金转型为混合型证券投资基金。故本基金本报告中基金合同生效日为 2010 年 10 月 1 日。

## §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	
华创证券有限责任公司	1	103,964,038.20	81.05%	96,821.35	81.19%	-
平安证券有限责任公司	2	14,036,276.43	10.94%	13,071.97	10.96%	-
国金证券股份有限公司	1	10,264,888.50	8.00%	9,354.36	7.84%	-
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	-	-	-	-	-
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
华创证券有限责任公司	5,489,550.00	100.00%	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金元顺安宝石动力混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-01-19
2	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-02-23
3	金元顺安基金管理有限公司旗下开放式基金参加北京肯特瑞财富费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-03-22
4	金元顺安宝石动力混合型证券投资基金 2016 年年度报告（正文）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-03-29
5	金元顺安宝石动力混合型证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-03-29
6	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加万得投顾为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-03-29
7	金元顺安宝石动力混合型证券投资基金更新招募说明书摘要[2017 年 1 号]	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-04-06
8	金元顺安宝石动力混合型证券投资基金更新招募说明书[2017 年 1 号]	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-04-06
9	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投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-04-10
10	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-04-22
11	金元顺安宝石动力混合型证券投资	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时	2017-04-24

	资基金 2017 年第 1 季度报告	报》、《证券日报》和 <a href="http://www.jysa99.com">www.jysa99.com</a>	
12	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和 <a href="http://www.jysa99.com">www.jysa99.com</a>	2017-05-17

## §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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金元顺安宝石动力混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安宝石动力混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安宝石动力混合型证券投资基金基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安宝石动力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宝石动力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。

### 12.2 存放地点

金元顺安基金管理有限公司

中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室

### 12.3 查阅方式

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

金元顺安基金管理有限公司

二〇一七年八月二十六日