

金元顺安新经济主题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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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。

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.....	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§5 托管人报告.....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18

§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	21
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
6.4 报表附注.....	24
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	58
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	58
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	58
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	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息.....	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
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	67
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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	69

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	73
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
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.....	75
§12 备查文件目录.....	76
12.1 备查文件目录.....	76
12.2 存放地点.....	76
12.3 查阅方式.....	76

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金元顺安新经济主题混合型证券投资基金
基金简称	金元顺安新经济主题混合
基金主代码	620008
交易代码	620008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 7 月 31 日
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	111,286,852.02 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于新发展时期和发展环境下，所涌现的与新经济主题相关、基本面良好、且具有较强竞争力和持续成长能力的上市公司股票，力争实现基金资产的长期、持续、稳定增值。
投资策略	<p>本基金通过发掘经济发展及结构转型过程中所显现的新经济主题，并以该主题所孕育的投资机会作为主要的投资线索，力争获取持续稳健的投资超额收益。</p> <p>在资产配置方面，本基金根据国内外宏观经济、政策环境、市场运行趋势等因素确定基金的大类资产配置比例；在权益资产投资方面，采用“自上而下”的方式，选择与新经济主题相关性较高的行业中的个股进行配置。同时，结合“自下而上”的方式，精选与新经济</p>

	主题相关性较高的上市公司股票作为投资方向；在债券投资方面，选择具有票息优势的债券品种作为主要的债券投资标的；最后，在综合考量投资组合的风险收益特征基础上，本基金完成组合构建。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 ×80%+中国债券总指数收益率 ×20%
风险收益特征	本基金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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	凌有法	林葛
	联系电话	021-68881801	010-66060069
	电子邮箱	service@jysa99.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-666-0666	95599
传真		021-68881875	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		任开宇	周慕冰

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》、《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	1,036,536.91
本期利润	3,958,734.49
加权平均基金份额本期利润	0.0572
本期加权平均净值利润率	5.12%
本期基金份额净值增长率	8.68%
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	166,721.45
期末可供分配基金份额利润	0.0015
期末基金资产净值	129,671,642.38
期末基金份额净值	1.165
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	16.50%

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	3.93%	0.64%	4.15%	0.54%	-0.22%	0.10%
过去三个月	5.05%	0.75%	4.65%	0.50%	0.40%	0.25%
过去六个月	8.68%	0.71%	8.02%	0.46%	0.66%	0.25%
过去一年	6.78%	0.78%	12.03%	0.54%	-5.25%	0.24%
过去三年	16.85%	2.12%	56.23%	1.40%	-39.38%	0.72%
自基金成立起至今	16.50%	1.78%	47.08%	1.27%	-30.58%	0.51%

注：

1、本基金合同生效日为 2012 年 7 月 31 日，业绩基准累计增长率以 2012 年 7 月 30 日指数为基准；

2、本基金投资组合中股票的投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于新经济主题相关的上市公司股票的比例不低于本基金股票资产的 80%；债券、货币市场工具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占基金资产的 5%-40%，其中，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，权证不高于基金资产净值的 3%；

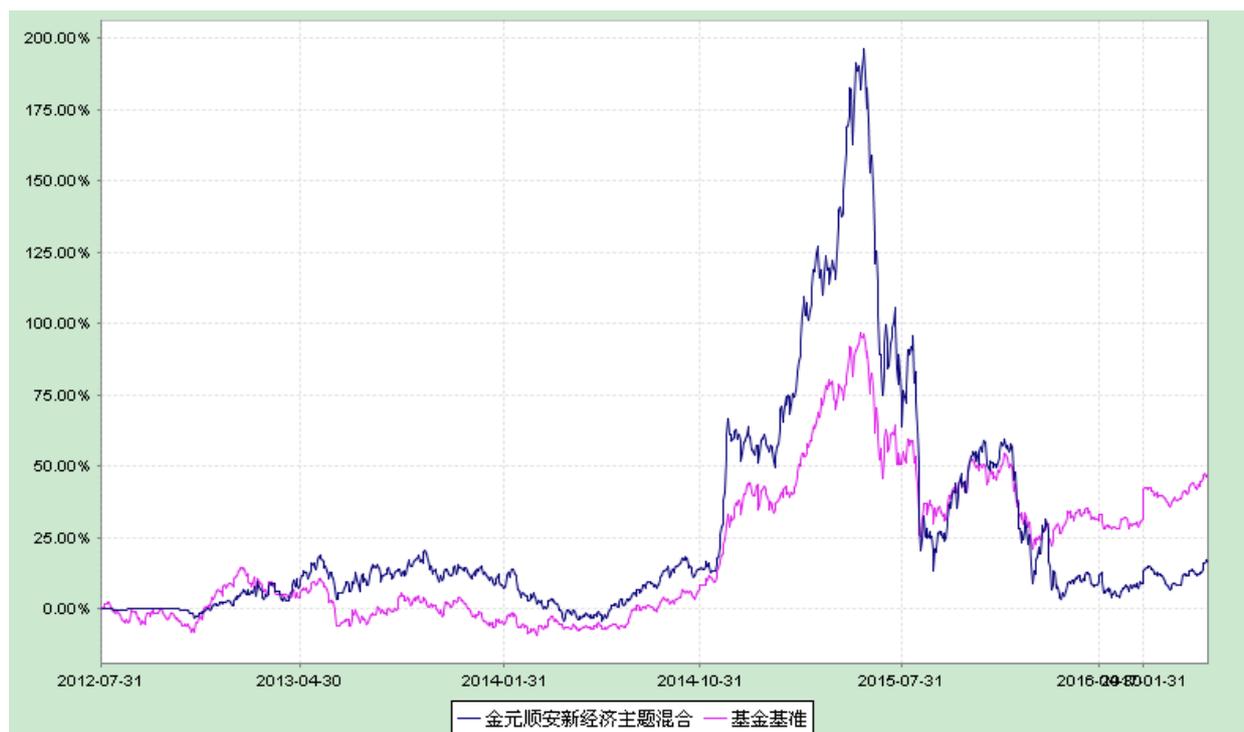
3、本基金业绩比较基准为“沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%”。

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

金元顺安新经济主题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

(2012 年 7 月 31 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：

- 1、本基金合同生效日为 2012 年 7 月 31 日，业绩基准累计增长率以 2012 年 7 月 30 日指数为基准；
- 2、本基金投资组合中股票的投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于新经济主题相关的上市公司股票的比例不低于本基金股票资产的 80%；债券、货币市场工具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占基金资产的 5%-40%，其中，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，权证不高于基金资产净值的 3%。

§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		
孔祥鹏	本基金基金经理	2017-06-28	-	5	金元顺安新经济主题混合型证券投资基金和金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，北京大学理学硕士。曾任上海市盟洋投资管理有限公司投资部研究员，中山证券有限责任公司研究所研究员，德邦证券有限责任公司研究所研究员。2015年5月加入金元顺安基金管理有限公司。5年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。
闵杭	本基金基金经理	2015-10-16	-	23	金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安新经济主题混合型证券投资基金、金元顺安宝石动力混合型证券投资基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安桉盛债券型证券投资基金和金元顺安桉泰债券型证券投资基金的基金经理，上海交通大学工学学士。曾任湘财证券股份有限公司上海自营分公司总经理，申银万国证券股份有限公司证券投资总部投资总监。2015年8月加入金元顺安基金管理有限公司。23年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

注：

1、此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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》、《金元顺安新经济主题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，基金重点投资于金融业和房地产业等。

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 8.68%，业绩比较基准收益率为 8.02%。

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资产净值低于五千万元或基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——金元顺安基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，金元顺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，金元顺安基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：金元顺安新经济主题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	8,882,423.97	3,379,903.39
结算备付金		-	395,373.22
存出保证金		71,190.12	73,281.63
交易性金融资产	6.4.7.2	129,062,376.39	19,580,033.45
其中：股票投资	6.4.7.2	129,062,376.39	19,580,033.45
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		155,572.84	998,513.71
应收利息	6.4.7.5	1,777.52	1,447.70
应收股利		-	-
应收申购款		10,011,424.23	26,104.95
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		148,184,765.07	24,454,658.05
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		-	688,958.06
应付赎回款		17,301,602.99	80,303.24
应付管理人报酬		174,951.41	29,764.58
应付托管费		29,158.57	4,960.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	872,795.67	792,780.76
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	134,614.05	70,053.66
负债合计		18,513,122.69	1,666,821.04
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	111,286,852.02	21,256,657.59
未分配利润	6.4.7.10	18,384,790.36	1,531,179.42

所有者权益合计		129,671,642.38	22,787,837.01
负债和所有者权益总计		148,184,765.07	24,454,658.05

注：

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.165 元，基金份额总额 111,286,852.02 份。

6.2 利润表

会计主体：金元顺安新经济主题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	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
一、收入		5,207,034.53	-8,215,109.24
1.利息收入		31,662.64	34,086.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	31,662.64	34,086.10
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,214,380.21	-7,684,625.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	315,950.70	-7,749,692.55
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	1,898,429.51	65,067.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,922,197.58	-603,293.34
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	38,794.10	38,723.07
减：二、费用		1,248,300.04	772,137.45
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	559,712.27	217,607.39
2.托管费	6.4.10.2.2	93,285.30	36,267.91
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	505,987.28	424,108.06
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	89,315.19	94,154.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,958,734.49	-8,987,246.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,958,734.49	-8,987,246.69

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安新经济主题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）	21,256,657.59	1,531,179.42	22,787,837.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,958,734.49	3,958,734.49
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）	90,030,194.43	12,894,876.45	102,925,070.88
其中：1.基金申购款	117,570,466.70	17,233,887.18	134,804,353.88
2.基金赎回款	-27,540,272.27	-4,339,010.73	-31,879,283.00
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）	111,286,852.02	18,384,790.36	129,671,642.38
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）	19,213,378.82	10,888,772.98	30,102,151.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,987,246.69	-8,987,246.69
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）	7,830,645.65	566,380.19	8,397,025.84
其中：1.基金申购款	36,380,896.92	3,428,000.16	39,808,897.08
2.基金赎回款	-28,550,251.27	-2,861,619.97	-31,411,871.24
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）	27,044,024.47	2,467,906.48	29,511,930.95
-----------------	---------------	--------------	---------------

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

金元顺安新经济主题混合型证券投资基金（原名为：金元惠理新经济主题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[2012]505号文《关于核准金元惠理新经济主题股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人金元惠理基金管理有限公司（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 2012 年 7 月 31 日正式生效，首次设立募集规模为 728,816,319.81 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均为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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“金元顺安新经济主题混合型证券投资基金”。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证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（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金贯彻“以基本面为基础，以研究为驱动”的理念，充分把握我国经济发展及结构转型过程中所带来的新经济主题型投资机会，重点投资于从新经济主题中受益，具有高成长性的上市公司。

本基金业绩比较基准为沪深 300 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 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	8,882,423.97

定期存款	-
其他存款	-
合计	8,882,423.97

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		127,209,266.70	129,062,376.39	1,853,109.69
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		127,209,266.70	129,062,376.39	1,853,109.69

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	1,748.63
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	-
应收债券利息	-
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	28.89
合计	1,777.52

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	872,795.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	872,795.67

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	65,189.69
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	39,671.58
合计	134,614.05

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	21,256,657.59	21,256,657.59
本期申购	117,570,466.70	117,570,466.70
本期赎回（以“-”号填列）	-27,540,272.27	-27,540,272.27
本期末	111,286,852.02	111,286,852.02

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	-830,333.30	2,361,512.72	1,531,179.42
本期利润	1,036,536.91	2,922,197.58	3,958,734.49
本期基金份额交易产生的变动数	-39,482.16	12,934,358.61	12,894,876.45
其中：基金申购款	-131,841.83	17,365,729.01	17,233,887.18
基金赎回款	92,359.67	-4,431,370.40	-4,339,010.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	166,721.45	18,218,068.91	18,384,790.36

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	27,718.07
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	3,289.10
其他	655.47
合计	31,662.64

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	131,511,413.58

减：卖出股票成本总额	131,195,462.88
买卖股票差价收入	315,950.70

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

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	1,898,429.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,898,429.51

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	2,922,197.58
——股票投资	2,922,197.58

——债券投资	-
——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	2,922,197.58

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	38,759.98
配股手续费	-
新股手续费返还	-
印花税返还	-
转换费收入	34.12
其他	-
合计	38,794.10

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	505,987.28
银行间市场交易费用	-
合计	505,987.28

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	29,752.78
信息披露费	39,671.58
银行汇划费用	1,110.83
上市费	-
持有人大会费	-
账户维护费	18,180.00
其他费用	600.00
合计	89,315.19

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
中国农业银行股份有限公司	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无应支付的关联方佣金。

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	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月

	30 日	30 日
当期发生的基金应支付的管理费	559,712.27	217,607.39
其中：支付销售机构的客户维护费	88,859.33	112,051.51

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。

6.4.10.2.2 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	93,285.30	36,267.91

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的情况。

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
中国农业银行股份有限公司	8,882,423.97	27,718.07	6,947,144.48	31,274.74

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人民币3,289.10元，2016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人民币1,779.94元，2015年6月30日止结算备付金余额为人民币346,841.49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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	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	新股未上市	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股未上市	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股未上市	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股未上市	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股未上市	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
300670	大烨智能	2017-07-26	2017-07-03	新股未上市	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股未上市	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股未上市	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股未上市	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

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。

6.4.13.3 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和交易保证金等。

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	8,882,423.97	-	-	-	8,882,423.97
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	71,190.12	-	-	-	71,190.12
交易性金融资产	-	-	-	129,062,376.39	129,062,376.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	155,572.84	155,572.84
应收利息	-	-	-	1,777.52	1,777.52
应收申购款	-	-	-	10,011,424.23	10,011,424.23

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,953,614.09	-	-	139,231,150.98	148,184,765.07
负债					
应付赎回费	-	-	-	65,189.69	65,189.69
应付管理人报酬	-	-	-	174,951.41	174,951.41
应付托管费	-	-	-	29,158.57	29,158.57
应付交易费用	-	-	-	872,795.67	872,795.67
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	-	-	-	69,424.36	69,424.36
应付赎回款	-	-	-	17,301,602.99	17,301,602.99
负债总计	-	-	-	18,513,122.69	18,513,122.69
利率敏感度缺口	8,953,614.09	-	-	120,718,028.29	129,671,642.38
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,379,903.39	-	-	-	3,379,903.39
结算备付金	395,373.22	-	-	-	395,373.22
存出保证金	73,281.63	-	-	-	73,281.63
交易性金融资产	-	-	-	19,580,033.45	19,580,033.45

衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	998,513.71	998,513.71
应收利息	-	-	-	1,447.70	1,447.70
应收申购款	-	-	-	26,104.95	26,104.95
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,848,558.24	-	-	20,606,099.81	24,454,658.05
负债					
应付赎回费	-	-	-	53.66	53.66
应付管理人报酬	-	-	-	29,764.58	29,764.58
应付托管费	-	-	-	4,960.74	4,960.74
应付交易费用	-	-	-	792,780.76	792,780.76
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	-	-	-	688,958.06	688,958.06
其他负债	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	-	-
预提费用	-	-	-	70,000.00	70,000.00
应付赎回款	-	-	-	80,303.24	80,303.24
负债总计	-	-	-	1,666,821.04	1,666,821.04
利率敏感度缺口	3,848,558.24	-	-	18,939,278.77	22,787,837.01

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

本基金本期末计息资产仅包括少量现金类资产，现金类资产包括银行存款和交易保证金，假定利率变动仅影响现金类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；因而在本基金本期末未持有其他付息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

因此本基金本报告期内无需进行利率风险的敏感性分析。

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	129,062,376.39	99.53	19,580,033.45	85.92
交易性金融资产—— 债券投资	-	-	-	-
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	129,062,376.39	99.53	19,580,033.45	85.92
----	----------------	-------	---------------	-------

注：

以上资产，除债券投资外，同时在利率风险敞口表中列入不计息资产类下。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%；于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

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
	沪深 300 指数下跌 5%	减少 611.27 万元	减少 118.77 万元
	沪深 300 指数上涨 5%	增加 611.27 万元	增加 118.77 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。 ΔP 表示：某一金融资产在一定持有期 Δt

的价值损失额。VAR 表示：给定置信水平 α 下的在险价值，即可能的损失上限。 α 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 223.97 万元	增加 48.88 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工具中属于第一层次的余额为人民币 128,938,693.29 元，属于第二层次的余额为人民币 123,683.10 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 132,336,116.81 元，属于第二层次的余额为人民币 0 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。

6.4.14.1.2.3 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	129,062,376.39	87.10
	其中：股票	129,062,376.39	87.10
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,882,423.97	5.99
7	其他各项资产	10,239,964.71	6.91
8	合计	148,184,765.07	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	-	-

C	制造业	26,120,497.75	20.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,446,880.00	4.97
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.01
J	金融业	45,113,721.50	34.79
K	房地产业	51,373,637.52	39.62
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	129,062,376.39	99.53

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	295,102	7,368,696.94	5.68
2	000666	经纬纺机	313,800	7,135,812.00	5.50
3	600015	华夏银行	739,800	6,820,956.00	5.26
4	600048	保利地产	673,388	6,713,678.36	5.18
5	000036	华联控股	711,127	6,471,255.70	4.99
6	601818	光大银行	1,594,850	6,459,142.50	4.98
7	601668	中国建筑	666,000	6,446,880.00	4.97
8	600823	世茂股份	1,314,120	6,439,188.00	4.97
9	002142	宁波银行	333,279	6,432,284.70	4.96
10	600016	民生银行	781,915	6,427,341.30	4.96
11	000936	华西股份	909,062	6,381,615.24	4.92
12	601398	工商银行	1,213,646	6,371,641.50	4.91
13	600000	浦发银行	498,180	6,301,977.00	4.86
14	601988	中国银行	1,702,805	6,300,378.50	4.86
15	000031	中粮地产	829,435	6,245,645.55	4.82
16	000059	华锦股份	622,038	6,226,600.38	4.80
17	600383	金地集团	538,051	6,171,444.97	4.76
18	002133	广宇集团	1,112,300	6,162,142.00	4.75
19	000625	长安汽车	416,580	6,007,083.60	4.63
20	002146	荣盛发展	587,800	5,801,586.00	4.47
21	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.04
22	603043	广州酒家	1,755	44,348.85	0.03
23	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03

24	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.02
25	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.02
26	002881	美格智能	989	22,608.54	0.02
27	603679	华体科技	809	21,438.50	0.02
28	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.02
29	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
30	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
31	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
32	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
33	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
34	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
35	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
36	603331	百达精工	999	9,620.37	0.01
37	300671	富满电子	942	7,639.62	0.01
38	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	000031	中粮地产	8,198,682.00	35.98
2	000059	华锦股份	7,499,788.89	32.91
3	600823	世茂股份	7,499,180.00	32.91
4	000625	长安汽车	7,498,793.00	32.91

5	000666	经纬纺机	7,497,437.00	32.90
6	600383	金地集团	7,199,778.00	31.59
7	601398	工商银行	7,199,764.00	31.59
8	002244	滨江集团	7,199,744.00	31.59
9	000069	华侨城 A	7,199,710.00	31.59
10	601988	中国银行	7,199,708.00	31.59
11	601818	光大银行	7,199,582.00	31.59
12	000001	平安银行	7,199,581.00	31.59
13	000966	长源电力	7,199,561.90	31.59
14	000002	万科 A	7,199,460.00	31.59
15	601939	建设银行	7,199,347.00	31.59
16	600000	浦发银行	7,199,314.00	31.59
17	600048	保利地产	7,199,054.00	31.59
18	601166	兴业银行	7,199,041.00	31.59
19	002142	宁波银行	7,198,742.00	31.59
20	600015	华夏银行	7,198,145.00	31.59
21	601668	中国建筑	6,699,597.00	29.40
22	000936	华西股份	6,699,557.40	29.40
23	000543	皖能电力	6,699,552.00	29.40
24	002133	广宇集团	6,699,474.80	29.40
25	000036	华联控股	6,699,324.82	29.40
26	000926	福星股份	6,698,926.00	29.40
27	002146	荣盛发展	6,698,200.00	29.39
28	600016	民生银行	6,498,802.30	28.52

29	002174	游族网络	1,619,383.00	7.11
30	601688	华泰证券	1,607,248.00	7.05
31	601699	潞安环能	1,395,375.47	6.12
32	002185	华天科技	1,395,015.00	6.12
33	002562	兄弟科技	1,362,829.00	5.98
34	300070	碧水源	1,356,485.00	5.95
35	002669	康达新材	1,178,911.00	5.17
36	600428	中远海特	1,115,732.00	4.90
37	300203	聚光科技	1,033,060.90	4.53
38	000651	格力电器	956,446.00	4.20
39	600068	葛洲坝	934,645.00	4.10
40	002236	大华股份	934,490.00	4.10
41	000630	铜陵有色	929,936.00	4.08
42	600297	广汇汽车	929,693.00	4.08
43	000878	云南铜业	927,560.00	4.07
44	002719	麦趣尔	915,105.00	4.02
45	300511	雪榕生物	913,257.00	4.01
46	002191	劲嘉股份	905,859.00	3.98
47	601377	兴业证券	904,510.00	3.97
48	600409	三友化工	877,002.00	3.85
49	000789	万年青	702,250.00	3.08
50	300284	苏交科	702,196.00	3.08
51	000521	美菱电器	701,863.72	3.08
52	601899	紫金矿业	700,035.00	3.07

53	600612	老凤祥	699,638.00	3.07
54	300342	天银机电	698,759.00	3.07
55	600169	太原重工	695,844.00	3.05
56	002172	澳洋科技	695,639.16	3.05
57	000709	河钢股份	695,556.00	3.05
58	002241	歌尔股份	695,467.00	3.05
59	002179	中航光电	695,220.00	3.05
60	300237	美晨科技	694,450.00	3.05
61	600258	首旅酒店	693,747.00	3.04
62	002468	申通快递	692,735.00	3.04
63	600500	中化国际	688,779.00	3.02
64	601611	中国核建	688,356.00	3.02
65	600502	安徽水利	686,832.00	3.01
66	600141	兴发集团	686,456.00	3.01
67	002104	恒宝股份	683,760.00	3.00
68	600990	四创电子	682,485.75	2.99
69	000826	启迪桑德	679,517.00	2.98
70	300156	神雾环保	677,629.24	2.97

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	000069	华侨城 A	7,888,412.06	34.62
2	601166	兴业银行	7,323,511.14	32.14
3	000001	平安银行	7,273,828.45	31.92
4	601939	建设银行	7,248,239.00	31.81
5	000926	福星股份	6,861,487.84	30.11
6	002244	滨江集团	6,827,683.24	29.96
7	000966	长源电力	6,160,911.00	27.04
8	000543	皖能电力	6,019,423.20	26.42
9	601688	华泰证券	2,534,743.91	11.12
10	002174	游族网络	1,739,963.00	7.64
11	002236	大华股份	1,733,767.00	7.61
12	002142	宁波银行	1,648,895.98	7.24
13	600409	三友化工	1,642,337.00	7.21
14	300070	碧水源	1,597,114.42	7.01
15	601611	中国核建	1,596,588.00	7.01
16	600258	首旅酒店	1,526,275.00	6.70
17	002185	华天科技	1,499,970.00	6.58
18	002241	歌尔股份	1,473,483.19	6.47
19	601398	工商银行	1,449,498.28	6.36
20	601699	潞安环能	1,440,748.93	6.32
21	600500	中化国际	1,428,219.00	6.27
22	002562	兄弟科技	1,388,699.00	6.09
23	600428	中远海特	1,345,164.76	5.90
24	000002	万科 A	1,247,806.82	5.48

25	601111	中国国航	1,157,813.32	5.08
26	002669	康达新材	1,151,912.24	5.05
27	000031	中粮地产	1,149,685.50	5.05
28	600489	中金黄金	1,149,453.84	5.04
29	600000	浦发银行	1,148,846.90	5.04
30	000059	华锦股份	1,118,561.74	4.91
31	600362	江西铜业	1,110,491.19	4.87
32	600383	金地集团	1,049,850.42	4.61
33	601988	中国银行	1,049,664.36	4.61
34	000651	格力电器	1,039,824.80	4.56
35	300203	聚光科技	1,039,724.00	4.56
36	000960	锡业股份	1,029,294.00	4.52
37	600057	象屿股份	1,014,199.20	4.45
38	600068	葛洲坝	999,666.00	4.39
39	600029	南方航空	995,371.61	4.37
40	600219	南山铝业	981,492.00	4.31
41	600995	文山电力	969,910.00	4.26
42	600297	广汇汽车	966,005.00	4.24
43	600115	东方航空	957,521.00	4.20
44	601377	兴业证券	953,544.00	4.18
45	600967	内蒙一机	926,404.00	4.07
46	000807	云铝股份	907,725.00	3.98
47	002191	劲嘉股份	897,417.00	3.94
48	000878	云南铜业	862,770.00	3.79

49	600547	山东黄金	862,108.00	3.78
50	000625	长安汽车	849,469.80	3.73
51	000630	铜陵有色	842,112.00	3.70
52	300237	美晨科技	829,540.00	3.64
53	002719	麦趣尔	811,922.00	3.56
54	300511	雪榕生物	806,218.00	3.54
55	000789	万年青	786,762.00	3.45
56	002468	申通快递	753,423.00	3.31
57	601818	光大银行	749,997.50	3.29
58	300342	天银机电	741,001.37	3.25
59	601899	紫金矿业	739,270.00	3.24
60	000709	河钢股份	728,992.00	3.20
61	600612	老凤祥	727,371.00	3.19
62	002172	澳洋科技	720,920.18	3.16
63	300156	神雾环保	713,937.40	3.13
64	000521	美菱电器	711,758.03	3.12
65	002239	奥特佳	710,725.83	3.12
66	002179	中航光电	709,344.00	3.11
67	601333	广深铁路	701,576.00	3.08
68	000826	启迪桑德	696,314.00	3.06
69	600169	太原重工	674,620.00	2.96
70	002091	江苏国泰	674,508.00	2.96
71	600141	兴发集团	673,503.00	2.96
72	600990	四创电子	670,677.68	2.94

73	600502	安徽水利	666,590.00	2.93
74	600048	保利地产	649,457.88	2.85
75	300284	苏交科	640,818.00	2.81
76	002104	恒宝股份	623,961.00	2.74
77	002133	广宇集团	549,697.00	2.41
78	002146	荣盛发展	549,640.00	2.41
79	000036	华联控股	549,626.00	2.41
80	000936	华西股份	549,339.00	2.41
81	000666	经纬纺机	548,328.00	2.41
82	600153	建发股份	537,007.15	2.36

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	237,755,608.24
卖出股票的收入（成交）总额	131,511,413.58

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、关于世茂股份（代码：600823）的处罚说明

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

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

依据《中华人民共和国证券法》(以下简称《证券法》)的有关规定,我局对孟洁短线交易“世茂股份”股票行为进行了立案调查、审理,并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。当事人未提出陈述和申辩意见。本案现已审理终结。

经查明,孟洁存在以下违法事实:

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

上述违法事实,有世茂股份的公告、涉案证券账户交易记录、相关当事人的询问笔录和情况说明等证据证明,足以认定。

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

我局在调查中发现,孟洁的证券账户由孟洁实际控制,账户资金为孟洁的自有资金,账户利益归属于孟洁,账户盈亏由孟洁承担,但本次卖出“世茂股份”股票的决策由孟洁的朋友康某作出,交易由康某具体操作。案发后孟洁已主动将相关收益 293,700 元(其自己测算)上缴了世茂股份。同时,调查过程中,孟洁能够积极配合调查,及时提供相关资料。

考虑到上述事实,根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度,依据《证券法》第一百九十五条、《中华人民共和国行政处罚法》第二十七条第一款之规定,我局决定:对孟洁给予警告。

当事人如果对本处罚决定不服,可在收到本处罚决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会

申请行政复议，也可在收到本处罚决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起行政诉讼。复议和诉讼期间，上述决定不停止执行。

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

当事人：

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

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

一、实际控制人违反避免同业竞争承诺

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

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

二、公司未如实披露实际控制人违背承诺的事项

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

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

息披露第一责任人，未勤勉尽责，对公司的违规行为负有责任，违反了《股票上市规则》第 2.2 条、第 3.1.4 条、第 3.1.5 条的规定，以及在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。时任董事会秘书俞峰作为公司直接负责人，未勤勉尽责，对公司的违规行为负有责任，违反了《股票上市规则》第 2.2 条、第 3.1.4 条、第 3.2.2 条的规定，以及在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。

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

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

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

现作出说明如下：

A.投资决策程序：基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案，综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配，同时在研究部的支持下，对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析，最终构建投资组合。

B.基金经理遵循价值投资理念，看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。此次事件涉及上市公司副总裁短线交易公司股票、大股东同业竞争问题，我们判断此次事件对公司负面影响有限，公司生产经营活动一切正常，我们认为不会对整体的业绩造成影响，因此买入并持有公司股票。

2、关于民生银行（代码：600016）的处罚说明

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

中国民生银行南京分行：

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

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

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

以上事实有现场检查中收集的证据证明。

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

如果对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

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

当事人：

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

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

一、公司未按规定聘任独立董事

中国证监会《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》（以下简称《独立董事指导意见》）第一条规定，上市公司董事会成员中应当至少包括三分之一独立董事。同时公司章程规定，董事会由 18 名董事组成。据此，公司应当至少聘请 6 名独立董事。但是，根据公司披露的独立董事 2015 年度述职报告，有三名独立董事已分别于 2014 年 3 月 6 日、2014 年 4 月 30 日、2014 年 7 月 22 日申请辞去独立董事及董事会相关专门委员会委员的职务；其中，两名独立董事分别自 2015 年 1 月 31 日、2015 年 5 月 9 日起不再继续履职；另一名独立董事自 2016 年 1 月 15 日起未再继续履职。截至 2016 年 10

月 28 日，公司仅有 3 名独立董事尚在履职，不符合《独立董事指导意见》有关独立董事人数不得低于董事会成员三分之一的法定最低比例要求，但公司长期未能补充选任独立董事。

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

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

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

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

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

综上，公司未按证监会及本所相关规定聘任独立董事，导致独立董事成员比例及独立董事任职时间均不符合相关规则的要求；公司未及时披露关联交易关键生效条款并充分揭示风险，关联交易后续进展披露不完整。公司上述行为违反了《独立董事指导意见》第一条、第四条，《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称《股票上市规则》）第 1.4 条、第 2.1 条、第 2.7 条、第 10.2.9 条以及《独立董事备案工作指引》第十五条等有关规定；时任董事会秘书万青元作为公司信息披露事务的具体负责人，未勤勉尽责，对公司的违规行为负有责任，其行为违反了《股票上市规则》第 2.2 条、第 3.1.4 条、第 3.2.2 条的规定，以及在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。

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

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

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

现做出说明如下：

A.投资决策程序：基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案，综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配，同时在研究部的支持下，对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析，最终构建投资组合。

B.基金经理遵循价值投资理念，看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。此次事件涉及下属分支机构销售产品信息披露不全、上市公司治理结构不够完善等问题，我们判断此次事件对公司负面影响有限，公司已经整改，生产经营活动一切正常，我们认为不会对整体的业绩造成影响，因此买入并持有公司股票。

3、关于兔宝宝（代码：002043）的处罚决定

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

德华兔宝宝装饰新材股份有限公司监事丁观芬：

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

现作出说明如下：

A.投资决策程序：基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案，综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配，同时在研究部的支持下，对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析，最终构建投资组合。

B.基金经理遵循价值投资理念，看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。此次事件是公司高管短线交易公司股票，我们判断此次事件对公司负面影响有限，公司生产经营活动一切正常，我们认为不会对整体的业绩造成影响，因此买入并持有公司股票。

4、关于万科 A（代码：000002）的处罚说明

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

万科企业股份有限公司：

2016 年 7 月 19 日，我局收到你公司现场提交的《关于提请查处钜盛华及其控制的相关资管计划违法违规行为的报告》，就你公司举报事项，我局已依法开展核查。

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

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

二、你公司应对信息披露事务管理方面存在的问题进行全

面梳理，完善信息披露内部管理制度，切实发挥信息披露委员会在公司治理和信息披露方面的监督和指导作用。

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

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

现作出说明如下：

A.投资决策程序：基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案，综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配，同时在研究部的支持下，对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析，最终构建投资组合。

B.基金经理遵循价值投资理念，看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。且该公司为中证 100 权重股。该处罚主要是针对二级市场违规投资行为，并不影响公司的经营和公司价值，因此继续持有该公司股票。

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	71,190.12
2	应收证券清算款	155,572.84
3	应收股利	-
4	应收利息	1,777.52
5	应收申购款	10,011,424.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,239,964.71

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
3,243	34,316.02	92,476,272.37	83.10%	18,810,579.65	16.90%

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	2,473.60	0.002%

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（2012 年 7 月 31 日）基金份额总额	728,928,409.64
本报告期期初基金份额总额	21,256,657.59
本报告期基金总申购份额	117,570,466.70
减：本报告期基金总赎回份额	27,540,272.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	111,286,852.02

§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	
东方证券股份有限公司	1	136,500,404.18	37.02%	127,122.22	37.19%	-
方正证券股份有限公司	1	129,131,306.38	35.02%	120,259.51	35.19%	-
国信证券股份有限公司	1	80,070,444.20	21.72%	72,968.83	21.35%	-
华泰证券股份有限公司	1	23,002,883.17	6.24%	21,422.75	6.27%	-
恒泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-

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
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国民族证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

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	金元顺安新经济主题混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《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》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-02-23
3	金元顺安新经济主题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》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-03-16

4	金元顺安新经济主题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》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-03-16
5	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》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-03-22
6	金元顺安新经济主题混合型证券投资基金 2016 年年度报告（正文）	《中国证券报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-03-29
7	金元顺安新经济主题混合型证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）	《中国证券报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-03-29
8	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》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-03-29
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费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《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》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-04-22
11	金元顺安新经济主题混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-04-24
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》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-05-17
13	金元顺安新经济主题混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《证券日报》和 www.jysa99.com	2017-06-29

§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 4 月 10 日-2017 年 6 月 30 日	-	61,080,279.23	-	61,080,279.23	54.89%
机构	2	2017 年 4 月 7 日-2017 年 4 月 10 日	-	10,516,213.85	3,371,000.00	8,546,153.85	7.68%
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。 							

§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新经济主题混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安新经济主题混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安新经济主题混合型证券投资基金基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安新经济主题混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册金元顺安新经济主题混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

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 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