

金元顺安沅楹债券型证券投资基金

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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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.....	9
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	11
3.1 主要会计数据和财务指标.....	11
3.2 基金净值表现.....	12
§4 管理人报告.....	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
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.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
§5 托管人报告.....	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20

§6 半年度财务会计报告（未经审计）	21
6.1 资产负债表.....	21
6.2 利润表.....	23
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
6.4 报表附注.....	26
§7 投资组合报告.....	50
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	56
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注.....	57
§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
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	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.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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.....	65
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金元顺安沅楹债券型证券投资基金
基金简称	金元顺安沅楹债券
基金主代码	003135
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 22 日
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	496,325,391.92 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券资产，在控制基金资产净值波动的基础上，严格管理股票资产的投资比例，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将密切关注债券、股票市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。</p> <p>2、债券资产投资策略</p> <p>(1) 债券投资策略</p> <p>本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置</p>

	<p>和个券选择四个层次进行投资管理。</p> <p>1) 在久期配置方面, 本基金将对宏观经济走势、经济周期所处阶段和宏观经济政策动向等进行研究, 预测未来收益率曲线变动趋势, 并据此积极调整债券组合的平均久期, 提高债券组合的总投资收益。</p> <p>2) 在类属配置方面, 本基金将对宏观经济周期、市场利率走势、资金供求变化, 以及信用债券的信用风险等因素进行分析, 根据各债券类属的风险收益特征, 定期对债券类属资产进行优化配置和调整, 确定债券类属资产的最优权重。</p> <p>3) 在期限结构配置方面, 本基金将对市场收益率曲线变动情况进行研判, 在长期、中期和短期债券之间进行配置, 适时采用子弹型、哑铃型或梯型策略构建投资组合, 以期在收益率曲线调整的过程中获得较好收益。</p> <p>4) 在个券选择方面, 对于国债、央行票据等非信用类债券, 本基金将根据宏观经济变量和宏观经济政策的分析, 预测未来收益率曲线的变动趋势, 综合考虑组合流动性决定投资品种; 对于信用类债券, 本基金将根据发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、流动性等因素, 对信用债进行信用风险评估, 积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资, 并采取分散化投资策略, 严格控制组合整体的违约风险水平。</p> <p>5) 证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金将根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选, 并严格控制单只证券公司短期公司债券的投资比例。此外, 由于证券公司短期公司债券整体流动性相对较差, 本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测, 尽量选择流动性相对较好的品种进行投资, 保证本基金的流动性。</p> <p>(2) 可转换债券及可交换债券投资策略</p> <p>可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值</p>
--	--

	<p>和内嵌期权价值，本基金管理人将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。此外，本基金还将根据新发可转债和可交换债券的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转债和可交换债券新券的申购。</p> <p>(3) 杠杆投资策略</p> <p>本基金将对资金面进行综合分析的基础上，比较债券收益率、存款利率和融资成本，判断利差空间，力争通过杠杆操作放大组合收益。</p> <p>(4) 银行存款投资策略</p> <p>本基金根据宏观经济指标分析各类资产的预期收益率水平，并据此制定和调整资产配置策略。当银行存款投资具有较高投资价值时，本基金将提高银行存款投资比例。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自上而下”的投资策略，精选优质企业进行投资。本基金将结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司竞争优势等因素的判断，对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析，追求股票投资组合的长期稳健增值。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金将通过权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型计算权证价值。本基金权证操作将根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性结合本基金的需要进行该产品的投资。主要考虑运用的策略包括：限量投资、趋势投资、优化组合策略、价差策略、双向权证策略等。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度

	中等偏低的投资品种。
--	------------

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	凌有法	罗菲菲
	联系电话	021-68881801	010-58560666
	电子邮箱	service@jysa99.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-666-0666	95568
传真		021-68881875	010-58560798
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 2 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 2 号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		任开宇	洪崎

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》
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	4,787,048.68
本期利润	11,234,100.34
加权平均基金份额本期利润	0.0354
本期加权平均净值利润率	3.57%
本期基金份额净值增长率	3.60%
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	5,907,786.12
期末可供分配基金份额利润	0.01
期末基金资产净值	502,233,178.04
期末基金份额净值	1.0119
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	1.19%

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	1.17%	0.16%	0.90%	0.06%	0.27%	0.10%
过去三个月	4.18%	0.28%	-0.88%	0.08%	5.06%	0.20%
过去六个月	3.60%	0.22%	-2.11%	0.08%	5.71%	0.14%
自基金成立起至今	1.19%	0.19%	-4.27%	0.10%	5.46%	0.09%

注：

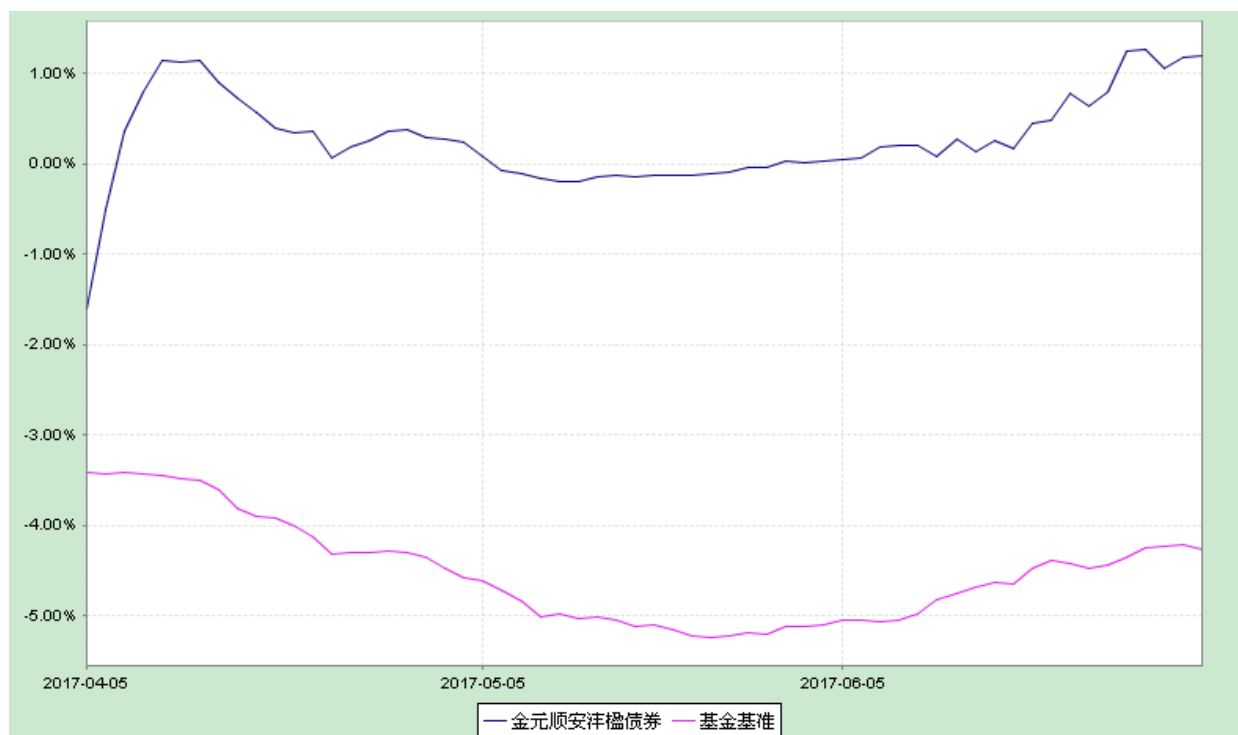
- 1、本基金合同生效日为 2016 年 9 月 22 日，业绩基准累计增长率以 2016 年 9 月 21 日指数为基准；
- 2、本基金投资于债券资产不低于基金资产的 80%；投资于股票资产不高于基金资产的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；
- 3、本基金业绩比较基准为“中债综合指数收益率”。

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

金元顺安沅楹债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 9 月 22 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：

- 1、本基金合同生效日为 2016 年 9 月 22 日，业绩基准累计增长率以 2016 年 9 月 21 日指数为基准；
- 2、本基金投资于债券资产不低于基金资产的 80%；投资于股票资产不高于基金资产的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金元顺安基金管理有限公司（以下简称“金元顺安”）成立于 2006 年 11 月，由金元证券股份有限公司（以下简称“金元证券”）与比利时联合资产管理公司（以下简称“比联资管”）共同发起设立的中外合资基金管理有限公司。公司总部设在上海陆家嘴，旗下设立了北京分公司，以及一个子公司——上海金元百利资产管理有限公司。

2012 年 3 月，经中国证监会核准，比联资管将所持有的 49% 股权转让于惠理基金管理香港有限公司（以下简称“惠理香港”），公司更名为金元惠理基金管理有限公司。

2012 年 10 月，经中国证监会核准，公司双方股东按持股比例向公司增资人民币 9,500 万元，公司注册资本增加至 24,500 万元。

2016 年 3 月，经中国证监会核准，惠理香港将所持有的 49% 股权转让于上海泉意金融信息服务有限公司（以下简称“泉意金融”），公司更名为金元顺安基金管理有限公司（以下简称“金元顺安”）。

金元顺安始终坚持以“取信于市场、取信于社会”作为行为准则，遵循“诚实信用，勤勉尽责，以专业经营方式管理和运作基金财产和客户资产，在合法、合规的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，从而使公司稳步、健康发展”的投资理念。遵守法律、行政法规和中国证券监督管理委员会的规定，遵守社会公德、商业道德，诚实守信，遵循基金份额持有人利益优先、公平对待其管理的不同基金财产和客户资产的原则，接受政府和社会公众的监督，承担社会责任。

截止至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人管理金元顺安宝石动力混合型证券投资基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安价值增长混合型证券投资基金、金元顺安核心动力混合型证券投资基金、金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金、金元顺安新经济主题混合型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安金元宝货币市场基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金、金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安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		
李杰	本基金基金经理	2016-09-22	-	10	金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金和金元顺安金元宝货币市场基金基金经理，上海交通大学理学硕士。曾任国联安基金管理有限公司数量策略分析员、固定收益高级研究员。2012 年 4 月加入金元顺安基金管理有限公司。10 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》、《金元顺安沅楹债券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

2017 年初经济呈现开门红，一季度 GDP 同比增速 6.9%，创 5 个季度以来新高，工业生产稳重有升，固定资产投资、进出口金额都有所回升，消费保持稳定。一季度新增信贷 4.5 万亿，社会融资总量同比 12.5%，远远高于 GDP 增速。大宗商品价格继续上涨，PPI 保持在 7.6% 的高位。二季度随着地产调控政策的密集出台，经济高位回落，工业增加值同比增速从 7.6% 下滑到四、五月的 6.5%。PPI 下行明显，从 7.6% 下滑到 5.5%，CPI 受其影响维持稳定。在多年的流动性宽松环境中，金融机构杠杆上升，资金在金融体系空转。1 月开始，央行引导银行间资金利率逐步上行。一行三会密集出台文件加强对影子银行的监管，切实促进金融去杠杆。同业存单收益率不断创新高，债市剧烈波动。上半年上证综合指数上涨 2.86%；中债总指数下跌 1.1%

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

在报告期，本基金采取短久期策略，获得良好的收益。

报告期内本基金净值增长率为 3.6%，同期业绩比较基准增长率-2.10%。本基金超越基准 5.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

始于去年年底的金融去杠杆已有初步成效，6 月份资金面重回宽松，考虑到政策的延续性，预期央行将继续维持中性偏紧的资金面。美国经济持续向好，美联储强调年内 3 次加息和缩表计划，欧央行等陆续发表鹰派言论，全球债市收益率或将上升。基本面看，我国补库存周期进入尾声，经济缓中趋稳，CPI 温和，去杠杆政策下，信用扩张有所放缓，M2 和社融增速小幅下。基本面对债市形成一定支撑，下半年有阶段性配置机会。我们将在总体适当防御的前提下，增强组合的流动性和波动操作，获得确定性的收益。

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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行认真的复核，未发现基金管理人有关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，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§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：金元顺安沅楹债券型证券投资基金

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	784,119.64	12,552,985.13
结算备付金		8,507.05	51,193.04
存出保证金		71,590.84	1,144.32
交易性金融资产	6.4.7.2	533,776,223.71	201,256,710.00
其中：股票投资	6.4.7.2	91,928,865.71	2,729,300.00
基金投资	6.4.7.2	-	-
债券投资	6.4.7.2	441,847,358.00	198,527,410.00
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	-	30,000,165.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	6,567,391.67	2,130,917.98
应收股利		-	-
应收申购款		39.96	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		541,207,872.87	245,993,115.47
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		38,399,755.90	-
应付证券清算款		5,325.32	-
应付赎回款		35,108.43	165.29
应付管理人报酬		275,803.46	137,584.67
应付托管费		39,400.47	19,654.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	111,289.05	4,970.83
应交税费		-	-
应付利息		21,152.54	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	86,859.66	45,000.37
负债合计		38,974,694.83	207,376.13
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	496,325,391.92	251,644,221.51
未分配利润	6.4.7.10	5,907,786.12	-5,858,482.17

所有者权益合计		502,233,178.04	245,785,739.34
负债和所有者权益总计		541,207,872.87	245,993,115.47

注：

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0119 元，基金份额总额 496,325,391.92 份。

6.2 利润表

会计主体：金元顺安沅楹债券型证券投资基金

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		13,008,930.16	-
1.利息收入		5,278,696.33	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	40,913.34	-
债券利息收入		5,085,067.01	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		152,715.98	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,272,664.86	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,750,347.31	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,125,855.47	-
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	648,173.02	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	6,447,051.66	-
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	10,517.31	-
减：二、费用		1,774,829.82	-
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,081,862.92	-
2.托管费	6.4.10.2.2	154,551.82	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	281,795.68	-
5.利息支出		151,558.14	-
其中：卖出回购金融资产支出		151,558.14	-
6.其他费用	6.4.7.21	105,061.26	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,234,100.34	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,234,100.34	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安沅楹债券型证券投资基金

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）	251,644,221.51	-5,858,482.17	245,785,739.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,234,100.34	11,234,100.34
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）	244,681,170.41	532,167.95	245,213,338.36
其中：1.基金申购款	245,370,663.38	531,130.70	245,901,794.08
2.基金赎回款	-689,492.97	1,037.25	-688,455.72
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）	496,325,391.92	5,907,786.12	502,233,178.04
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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-
-----------------	---	---	---

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

金元顺安沅楹债券型证券投资基金（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[2016]1650 号文《关于准予金元顺安沅楹债券型证券投资基金注册的批复》的批准，由金元顺安基金管理有限公司作为基金管理人于 2016 年 8 月 18 日向社会公开募集，基金合同于 2016 年 9 月 22 日正式生效，首次设立募集规模为 200,971,336.64 份基金份额。

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含可分离型可转换债券）、可交换债券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款以及其他银行存款）、非金融企业债务融资工具、同业存单、货币市场工具、股票（含中小板、创业板及其他依法上市的股票）、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相关规定。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。

本基金业绩比较基准：中债综合指数收益率。

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	784,119.64
定期存款	-
其他存款	-
合计	784,119.64

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		90,693,643.61	91,928,865.71	1,235,222.10
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	82,216,416.76	80,739,858.00	-1,476,558.76
	银行间市场	360,151,003.54	361,107,500.00	956,496.46
	合计	442,367,420.30	441,847,358.00	-520,062.30
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		533,061,063.91	533,776,223.71	715,159.80

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	483.62
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	3.42
应收债券利息	6,566,875.65
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	28.98
合计	6,567,391.67

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	97,372.49
银行间市场应付交易费用	13,916.56
合计	111,289.05

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	79.21
预提信息披露费用	59,507.37
审计费用	27,273.08
合计	86,859.66

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	251,644,221.51	251,644,221.51
本期申购	245,370,663.38	245,370,663.38
本期赎回（以“-”号填列）	-689,492.97	-689,492.97
本期末	496,325,391.92	496,325,391.92

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	755,175.80	-6,613,657.97	-5,858,482.17
本期利润	4,787,048.68	6,447,051.66	11,234,100.34
本期基金份额交易产生的变动数	5,003,030.78	-4,470,862.83	532,167.95

其中：基金申购款	5,014,494.66	-4,483,363.96	531,130.70
基金赎回款	-11,463.88	12,501.13	1,037.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,545,255.26	-4,637,469.14	5,907,786.12

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	38,831.67
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	1,875.26
其他	206.41
合计	40,913.34

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	114,423,930.37
减：卖出股票成本总额	109,673,583.06
买卖股票差价收入	4,750,347.31

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	252,257,435.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	252,401,147.51
减：应收利息总额	3,982,142.97
债券投资收益	-4,125,855.47

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	648,173.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	648,173.02

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	6,447,051.66
——股票投资	1,631,020.12
——债券投资	4,816,031.54
——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	6,447,051.66

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	517.31
配股手续费	-
新股手续费返还	-
印花税返还	-
转换费收入	-
其他	10,000.00
合计	10,517.31

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	273,783.18
银行间市场交易费用	7,512.50
转托管费	500.00
合计	281,795.68

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
银行汇划手续费	2,780.81
转托管费	-
上市年费	-
持有人大会费用	-
银行间债券账户维护费	9,000.00
账户维护费	6,000.00
债券结算费	-
其他费用	500.00
合计	105,061.26

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
中国民生银行股份有限公司	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

本基金本报告期末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 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,081,862.92	-
其中：支付销售机构的客户维护费	1,406.19	-

注：

1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数},$$

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 3 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、公休日等，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 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	154,551.82	-

注：

1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数},$$

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 3 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

本基金本报告期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
中国民生银行股份有限公司	784,119.64	38,831.67	-	-

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 1,875.26 元，2016 年末结算备付金余额为人民币 8,507.05 元。

2016年9月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间获得的利息收入为人民币10,126.35元, 2016年末结算备付金余额为人民币51,193.04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

本基金本报告期末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

金额单位: 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002409	雅克科技	2017-04-24	重大资产重组	21.13	-	-	2,500	57,872.00	52,825.00	-
300271	华宇软件	2017-06-22	拟披露重大事项	16.59	2017-07-04	16.80	285,700	4,568,175.57	4,739,763.00	-

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

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
011753037	17 义务国资 SCP002	2017-07-05	100.41	200,000	20,082,000.00

011764034	17 蒙高路 SCP001	2017-07-05	100.24	100,000	10,024,000.00
合计		-	-	300,000	30,106,000.00

注：

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金因从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 29,399,755.90 元，于 2017 年 7 月 5 日到期。

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，本基金因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为 9,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日到期。

该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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	75,173,000.00	19,788,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	220,607,000.00	4,992,000.00
合计	295,780,000.00	24,780,000.00

注：

未评级债券为国债、政策性金融债和超短期融资券。

6.4.13.2.2 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	12,323,958.00	31,518,210.00
AAA 以下	103,941,400.00	142,229,200.00
未评级	29,802,000.00	-
合计	146,067,358.00	173,747,410.00

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	784,119.64	-	-	-	784,119.64
结算备付金	8,507.05	-	-	-	8,507.05
存出保证金	71,590.84	-	-	-	71,590.84
交易性金融资产	388,387,958.00	53,459,400.00	-	91,928,865.71	533,776,223.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	6,567,391.67	6,567,391.67
应收申购款	-	-	-	39.96	39.96
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
资产总计	389,252,175.53	53,459,400.00	-	98,496,297.34	541,207,872.87
负债					
应付赎回费	-	-	-	79.21	79.21
应付管理人报酬	-	-	-	275,803.46	275,803.46
应付托管费	-	-	-	39,400.47	39,400.47
应付交易费用	-	-	-	111,289.05	111,289.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	38,399,755.90	-	-	-	38,399,755.90
应付利息	-	-	-	21,152.54	21,152.54
应付证券清算款	-	-	-	5,325.32	5,325.32
其他负债	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	-	-
预提费用	-	-	-	86,780.45	86,780.45
应付赎回款	-	-	-	35,108.43	35,108.43
负债总计	38,399,755.90	-	-	574,938.93	38,974,694.83
利率敏感度缺口	350,852,419.63	53,459,400.00	-	97,921,358.41	502,233,178.04
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	12,552,985.13	-	-	-	12,552,985.13
结算备付金	51,193.04	-	-	-	51,193.04

存出保证金	1,144.32	-	-	-	1,144.32
交易性金融资产	37,200,210.00	161,327,200.00	-	2,729,300.00	201,256,710.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,130,917.98	2,130,917.98
应收申购款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	30,000,165.00	-	-	-	30,000,165.00
资产总计	79,805,697.49	161,327,200.00	-	4,860,217.98	245,993,115.47
负债					
应付赎回费	-	-	-	0.37	0.37
应付管理人报酬	-	-	-	137,584.67	137,584.67
应付托管费	-	-	-	19,654.97	19,654.97
应付交易费用	-	-	-	4,970.83	4,970.83
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	-	-	-	45,000.00	45,000.00
应付赎回款	-	-	-	165.29	165.29
负债总计	-	-	-	207,376.13	207,376.13
利率敏感度缺口	79,805,697.49	161,327,200.00	-	4,652,841.85	245,785,739.34

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 3.80 万元	增加 4.87 万元
	基准利率上升 1 个基点	减少 3.80 万元	减少 4.87 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	91,928,865.71	18.30	2,729,300.00	1.11
交易性金融资产—— 债券投资	441,847,358.00	87.98	198,527,410.00	80.77
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	533,776,223.71	106.28	201,256,710.00	81.88

注：

本基金投资于债券类金融工具的比例不低于基金资产的 80%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

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

	沪深 300 指数下跌 5%	减少 514.54 万元	减少 18.11 万元
	沪深 300 指数上涨 5%	增加 514.54 万元	增加 18.11 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 225.25 万元	增加 7.95 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，其因剩余期限不长，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 0 元，属于第二层次的余额为人民币 91,928,865.71 元，无属于第三层次的余额。（于 2016 年 12 月 31 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 2,729,300.00 元，属于第二层次的余额为人民币 198,527,410.00 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。

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

截至资产负债表日，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	91,928,865.71	16.99
	其中：股票	91,928,865.71	16.99
2	固定收益投资	441,847,358.00	81.64
	其中：债券	441,847,358.00	81.64
	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	792,626.69	0.15
7	其他各项资产	6,639,022.47	1.23
8	合计	541,207,872.87	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	67,647,453.85	13.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,203,672.00	2.03
F	批发和零售业	4,656,840.00	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	1,812,615.56	0.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,608,284.30	1.51
J	金融业	-	-
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	91,928,865.71	18.30

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	000333	美的集团	321,500	13,837,360.00	2.76
2	002242	九阳股份	564,227	11,098,345.09	2.21
3	600068	葛洲坝	907,800	10,203,672.00	2.03
4	000568	泸州老窖	187,300	9,473,634.00	1.89
5	600089	特变电工	860,277	8,886,661.41	1.77
6	002705	新宝股份	454,665	6,833,614.95	1.36
7	000858	五粮液	92,600	5,154,116.00	1.03
8	002007	华兰生物	136,818	4,993,857.00	0.99
9	002043	兔宝宝	344,285	4,764,904.40	0.95
10	300271	华宇软件	285,700	4,739,763.00	0.94
11	600511	国药股份	128,500	4,656,840.00	0.93
12	300287	飞利信	257,400	2,362,932.00	0.47
13	000768	中航飞机	124,900	2,303,156.00	0.46
14	600548	深高速	164,554	1,487,568.16	0.30
15	002279	久其软件	40,286	505,589.30	0.10
16	600350	山东高速	52,427	325,047.40	0.06
17	300282	汇冠股份	11,800	248,980.00	0.05
18	002409	雅克科技	2,500	52,825.00	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	600717	天津港	23,796,633.73	9.68
2	002242	九阳股份	13,435,105.00	5.47
3	000333	美的集团	13,254,803.00	5.39
4	600068	葛洲坝	9,948,114.47	4.05
5	600089	特变电工	9,947,513.00	4.05
6	000568	泸州老窖	9,441,609.02	3.84
7	002705	新宝股份	6,611,003.26	2.69
8	600350	山东高速	5,836,343.00	2.37
9	600759	洲际油气	5,818,623.00	2.37
10	300230	永利股份	5,738,673.46	2.33
11	600548	深高速	5,553,028.01	2.26
12	002043	兔宝宝	5,033,364.80	2.05
13	000858	五粮液	5,028,841.00	2.05
14	002007	华兰生物	4,965,599.70	2.02
15	600160	巨化股份	4,925,167.49	2.00
16	300282	汇冠股份	4,845,162.40	1.97
17	603328	依顿电子	4,634,526.17	1.89
18	002279	久其软件	4,608,038.99	1.87
19	300271	华宇软件	4,568,175.57	1.86
20	000768	中航飞机	4,468,292.00	1.82

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	600717	天津港	30,968,489.27	12.60
2	600759	洲际油气	5,551,377.00	2.26
3	300230	永利股份	5,415,385.42	2.20
4	600160	巨化股份	5,092,947.95	2.07
5	000671	阳光城	5,052,788.00	2.06
6	600350	山东高速	4,767,740.42	1.94
7	002434	万里扬	4,739,913.04	1.93
8	603328	依顿电子	4,654,481.21	1.89
9	002279	久其软件	4,242,159.30	1.73
10	601601	中国太保	4,156,297.00	1.69
11	600548	深高速	3,750,108.34	1.53
12	300282	汇冠股份	3,553,918.16	1.45
13	300067	安诺其	3,190,562.00	1.30
14	600018	上港集团	3,189,172.00	1.30
15	000429	粤高速 A	3,121,919.11	1.27
16	002531	天顺风能	2,671,474.78	1.09
17	000905	厦门港务	2,442,222.00	0.99
18	000768	中航飞机	2,305,733.00	0.94
19	600115	东方航空	1,985,950.86	0.81
20	002242	九阳股份	1,809,597.95	0.74

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	197,242,128.65
卖出股票的收入（成交）总额	114,423,930.37

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	19,827,000.00	3.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,975,000.00	1.99
	其中：政策性金融债	9,975,000.00	1.99
4	企业债券	60,912,858.00	12.13
5	企业短期融资券	295,780,000.00	58.89
6	中期票据	55,352,500.00	11.02
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	441,847,358.00	87.98

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	011759018	17 皖山鹰 SCP001	300,000	30,054,000.00	5.98

2	011754056	17 永达 SCP001	300,000	30,024,000.00	5.98
3	101461030	14 温现代 MTN001	200,000	20,222,000.00	4.03
4	1282492	12 铜有色 MTN1	200,000	20,152,000.00	4.01
5	011759038	17 宏图高科 SCP002	200,000	20,134,000.00	4.01

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。

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	71,590.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,567,391.67
5	应收申购款	39.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,639,022.47

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300271	华宇软件	4,739,763.00	0.94	拟披露重大事项

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
665	746,353.97	495,282,263.78	99.79%	1,043,128.14	0.21%

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	79,721.92	0.016%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有份额总数（份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

份额单位：份

基金合同生效日（2016年9月22日）基金份额总额	200,971,336.64
本报告期期初基金份额总额	251,644,221.51
本报告期基金总申购份额	245,370,663.38
减：本报告期基金总赎回份额	689,492.97
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	496,325,391.92

§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	
恒泰证券股份有限公司	2	311,657,189.02	100.00%	131,388.21	100.00%	-
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
恒泰证券股份有限公司	22,106,190.97	100.00%	130,600,000.00	93.55%	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	9,000,000.00	6.45%	-	-

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	金元顺安沅楹债券型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	《中国证券报》和 www.jysa99.com	2017-01-19
2	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》和 www.jysa99.com	2017-03-22

3	金元顺安沅楹债券型证券投资基金 2016 年年度报告（正文）	《中国证券报》和 www.jysa99.com	2017-03-29
4	金元顺安沅楹债券型证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）	《中国证券报》和 www.jysa99.com	2017-03-29
5	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》和 www.jysa99.com	2017-03-29
6	金元顺安沅楹债券型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	《中国证券报》和 www.jysa99.com	2017-04-24
7	金元顺安沅楹债券型证券投资基金更新 招募说明书[2017 年 1 号]	《中国证券报》和 www.jysa99.com	2017-05-05
8	金元顺安沅楹债券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》和 www.jysa99.com	2017-05-05
9	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》和 www.jysa99.com	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

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 1 月 1 日 -2017 年 6 月 30 日	250,811,924.95	-	-	250,811,924.95	50.53%
机构	2	2017 年 4 月 20 日 -2017 年 6 月 30 日	-	99,610,518.98	-	99,610,518.98	20.07%
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沅楹债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安沅楹债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安沅楹债券型证券投资基金基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安沅楹债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册金元顺安沅楹债券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