

金元顺安金元宝货币市场基金
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：宁波银行股份有限公司

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。

基金托管人宁波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..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 8 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况..... | 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..... | 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的说明..... | 15 |
| 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 基金持有人数或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..... | 50 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 50 |
| 7.2 债券回购融资情况..... | 50 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 51 |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 | 52 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 52 |
| 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 | 52 |
| 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 | 53 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 | 54 |
| 7.9 投资组合报告附注..... | 54 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 55 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 55 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 55 |
| 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 | 55 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 57 |
| §10 重大事件揭示..... | 58 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 58 |
| 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 | 58 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 58 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 59 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 59 |

| | |
|---|----|
| 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 | 59 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 59 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 | 60 |
| 10.9 其他重大事件 | 60 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 62 |
| 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 | 62 |
| §12 备查文件目录 | 64 |
| 12.1 备查文件目录 | 64 |
| 12.2 存放地点 | 64 |
| 12.3 查阅方式 | 64 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称 | 金元顺安金元宝货币市场基金 | |
| 基金简称 | 金元顺安金元宝货币 | |
| 交易代码 | 620010 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2014 年 8 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 | 宁波银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 4,145,599,498.60 份 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 金元顺安金元宝 A 类 | 金元顺安金元宝 B 类 |
| 下属分级基金的交易代码 | 620010 | 620011 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 67,842,806.08 份 | 4,077,756,692.52 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时，通过对国内外宏观经济走势、货币政策和财政政策的研究，结合对货币市场利率变动的预期，进行积极的投资组合管理。 |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款利率（税后） |
| 风险收益特征 | 本基金系货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低 |

| | |
|--|--------------------------------------|
| | 风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。 |
|--|--------------------------------------|

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 | 宁波银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 凌有法 | 贺碧波 |
| | 联系电话 | 021-68881801 | 0574-89103213 |
| | 电子邮箱 | service@jysa99.com | hebibo@nbc.cn |
| 客户服务电话 | | 400-666-0666 | 95574 |
| 传真 | | 021-68881875 | 0574-89103213 |
| 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 | 中国浙江宁波市鄞州区宁东路345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 | 中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号 |
| 邮政编码 | | 200120 | 315100 |
| 法定代表人 | | 任开宇 | 陆华裕 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.jysa99.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 本基金管理人、基金托管人办公地址 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------|----------------------------------|
| 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 |
| 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 |

§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） | |
|---------------|--------------------------------------|------------------|
| | 金元顺安金元宝 A 类 | 金元顺安金元宝 B 类 |
| 本期已实现收益 | 1,159,655.11 | 79,172,684.33 |
| 本期利润 | 1,159,655.11 | 79,172,684.33 |
| 本期净值收益率 | 1.8446% | 1.9657% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2017 年 6 月 30 日） | |
| | 金元顺安金元宝 A 类 | 金元顺安金元宝 B 类 |
| 期末基金资产净值 | 67,842,806.08 | 4,077,756,692.52 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2017 年 6 月 30 日） | |
| | 金元顺安金元宝 A 类 | 金元顺安金元宝 B 类 |
| 累计净值收益率 | 10.9465% | 11.7234% |

注：

- 1、本基金于 2014 年 8 月 1 日成立，合同生效当期不是完整的报告期。
- 2、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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。
- 3、上述基金财务指标不包括持有人认购和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。
- 4、本基金利润分配按月结转份额。
- 5、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金元顺安金元宝 A 类

| 阶段 | 份额净值 收益率① | 净值收益率 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 | 0.3452% | 0.0013% | 0.1110% | 0.0000% | 0.2342% | 0.0013% |
| 过去三个月 | 1.0167% | 0.0015% | 0.3371% | 0.0000% | 0.6796% | 0.0015% |
| 过去六个月 | 1.8446% | 0.0022% | 0.6716% | 0.0000% | 1.1730% | 0.0022% |
| 过去一年 | 3.2800% | 0.0025% | 1.3590% | 0.0000% | 1.9210% | 0.0025% |
| 自基金成立 起至今 | 10.9465% | 0.0078% | 4.0171% | 0.0000% | 6.9294% | 0.0078% |

金元顺安金元宝 B 类

| 阶段 | 份额净值 收益率① | 净值收益率 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 | 0.3650% | 0.0013% | 0.1110% | 0.0000% | 0.2540% | 0.0013% |
| 过去三个月 | 1.0768% | 0.0015% | 0.3371% | 0.0000% | 0.7397% | 0.0015% |
| 过去六个月 | 1.9657% | 0.0022% | 0.6716% | 0.0000% | 1.2941% | 0.0022% |
| 过去一年 | 3.5273% | 0.0025% | 1.3590% | 0.0000% | 2.1683% | 0.0025% |
| 自基金成立 起至今 | 11.7234% | 0.0078% | 4.0171% | 0.0000% | 7.7063% | 0.0078% |

注：

- 1、本基金合同生效日为 2014 年 8 月 1 日，业绩基准收益率以 2014 年 7 月 31 日为基准；
- 2、本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、通知存款、短期融资券、一年以内（含一年）的银行定期存款和大量存单、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券，中期票据、资产支

持类证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。未来若法律法规或监管机构允许货币市场基金投资同业存单的，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，按照相关法律法规的规定参与同业存单的投资，不需召开基金份额持有人大会，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围；

3、本基金业绩比较基准为“同期七天通知存款利率（税后）”。

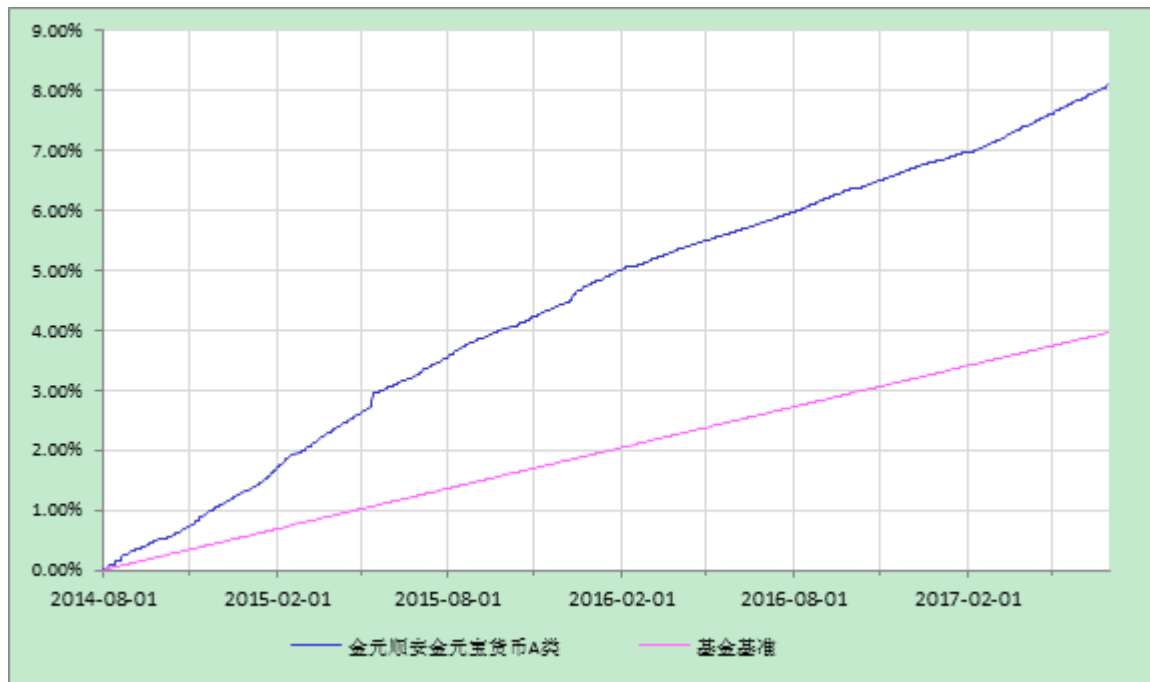
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金元顺安金元宝货币市场基金

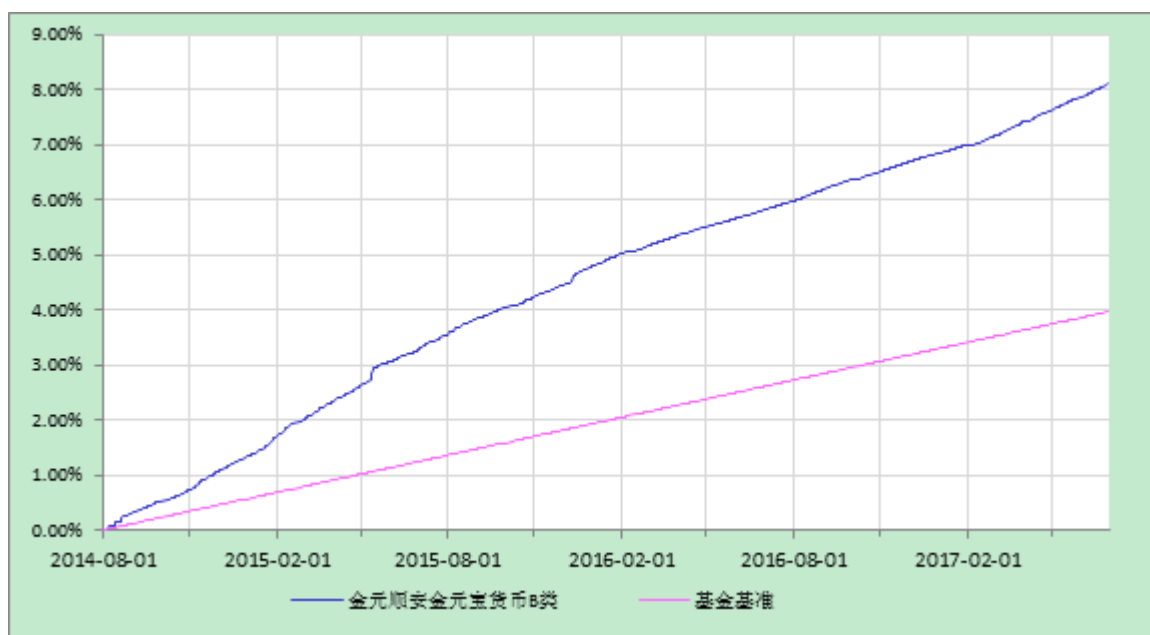
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2014 年 8 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）

金元顺安金元宝 A 类



金元顺安金元宝 B 类



注：

1、本基金合同生效日为 2014 年 8 月 1 日，业绩基准收益率以 2014 年 7 月 31 日为基准；

2、本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、通知存款、短期融资券、一年以内（含一年）的银行定期存款和大量存单、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券，中期票据、资产支持类证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。未来若法律法规或监管机构允许货币市场基金投资同业存单的，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，按照相关法律法规的规定参与同业存单的投资，不需召开基金份额持有人大会，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，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 | | |
| 李杰 | 本基金基金经理 | 2014-08-01 | - | 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的基金经理，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》、《金元顺安金元宝货币市场基金基金合同》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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年国内经济走势稳健，其中固定资产投资和出口均超出预期。制造业投资今年以来小幅回升，消费在年初受汽车拖累，快速下行后又有所回升，出口主要受益于国际经济向好和人民币贬值的拉动。

上半年资金面整体呈现紧平衡的状态，货币市场利率中枢上移，且长端上行幅度大于短端。随着季末财政投放的增加，市场得以流动性补充。

央行货币政策目标主要为金融稳定和国际收支平衡，其中金融去杠杆又是重点。前期央行在公开市场上提价缩量以配合去杠杆进程，进入 6 月以来，市场杠杆率有所下降，银行资产负债表增速下滑，金融机构之间信用扩张放缓，去杠杆初有成效，此时央行货币政策转为平稳流动性。

在报告期，本基金采取短久期债券策略，规避了流动性冲击的风险，并且获得良好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金业绩比较基准增长率为 0.6716%，A 类份额净值增长率为 1.8539%，超越业绩比较基准 1.1823%；B 类份额净值增长率为 1.9756%，超越业绩比较基准 1.304%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

得益于供给侧改革，短期内经济有望延续平稳发展势头。随着后期地产、基建和外需等贡献放缓、增速下滑，四季度经济有一定程度的下行压力。CPI 走势平稳，PPI 由降转升，通胀预期短期依旧稳定。

央行以及管理层在季末对市场流动性的补充并不意味着货币政策的收紧已经结束，国内货币政策中长期趋势性收紧，去杠杆仍然没有完全结束。机构自查结果及监管细则尚未出台，金融监管趋严的形势并未转向，只是更为有序、更为有节奏。

我们认为下半年货币政策维持稳健中性，短期以平稳流动性为主，中期待监管落地后再回归基本面，应该采取短久期防御策略，控制好流动性风险。

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

根据本基金基金合同“基金的收益与分配”之“收益分配原则”和相关法律法规的规定，本基金收益分配方式为红利再投资，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并全部分配，每月集中支付。

4.8 基金持有人数或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，本托管人在金元顺安金元宝货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：金元顺安金元宝货币市场基金

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 | 10,046,915.53 | 18,784,727.47 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 3,244,785,694.59 | 2,093,338,778.26 |
| 其中：股票投资 | 6.4.7.2 | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | 6.4.7.2 | 3,244,785,694.59 | 2,093,338,778.26 |
| 资产支持证券投资 | 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 | 1,384,060,932.92 | 2,082,401,190.60 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 6,467,711.33 | 13,107,312.29 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 512,001.00 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产总计 | | 4,645,873,255.37 | 4,207,632,008.62 |
| 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 | | 495,498,349.81 | 291,858,519.82 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,331,444.48 | 1,028,753.91 |
| 应付托管费 | | 322,774.41 | 249,394.90 |
| 应付销售服务费 | | 54,696.47 | 48,936.99 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 44,662.44 | 56,778.82 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | 63,433.21 | 200,216.06 |
| 应付利润 | | 2,822,943.92 | 1,505,985.06 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 135,452.03 | 64,000.00 |
| 负债合计 | | 500,273,756.77 | 295,012,585.56 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 4,145,599,498.60 | 3,912,619,423.06 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 4,145,599,498.60 | 3,912,619,423.06 |
| 负债和所有者权益总计 | | 4,645,873,255.37 | 4,207,632,008.62 |

注：

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 4,145,599,498.60 份，其中下属 A 类基金份额总额 67,842,806.08 份；下属 B 类基金份额总额 4,077,756,692.52 份。

6.2 利润表

会计主体：金元顺安金元宝货币市场基金

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 | | 93,415,197.32 | 31,516,071.57 |
| 1.利息收入 | | 96,050,311.41 | 30,550,417.84 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 140,572.59 | 1,932,171.26 |
| 债券利息收入 | | 48,949,079.79 | 18,890,829.19 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 46,960,659.03 | 9,727,417.39 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -2,635,114.09 | 965,653.73 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -2,635,114.09 | 965,653.73 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以 | 6.4.7.17 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------------|----------------------|
| “-”号填列) | | | |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列) | 6.4.7.18 | - | - |
| 减：二、费用 | | 13,082,857.88 | 5,030,071.74 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 6,687,265.86 | 3,035,762.85 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,621,155.29 | 735,942.52 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 278,532.21 | 255,212.00 |
| 4.交易费用 | 6.4.7.19 | 449.00 | 735.00 |
| 5.利息支出 | | 4,350,203.49 | 902,170.13 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 4,350,203.49 | 902,170.13 |
| 6.其他费用 | 6.4.7.20 | 145,252.03 | 100,249.24 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列) | | 80,332,339.44 | 26,485,999.83 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列) | | 80,332,339.44 | 26,485,999.83 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安金元宝货币市场基金

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) | 3,912,619,423.06 | - | 3,912,619,423.06 |

| | | | |
|--|--|----------------|-------------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 80,332,339.44 | 80,332,339.44 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 232,980,075.54 | - | 232,980,075.54 |
| 其中：1.基金申购款 | 9,532,537,102.97 | - | 9,532,537,102.97 |
| 2.基金赎回款 | -9,299,557,027.43 | - | -9,299,557,027.43 |
| 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） | - | -80,332,339.44 | -80,332,339.44 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 4,145,599,498.60 | - | 4,145,599,498.60 |
| 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） | 1,003,538,161.46 | - | 1,003,538,161.46 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 26,485,999.83 | 26,485,999.83 |
| 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） | 4,014,421,287.19 | - | 4,014,421,287.19 |
| 其中：1.基金申购款 | 6,768,861,143.70 | - | 6,768,861,143.70 |
| 2.基金赎回款 | -2,754,439,856.51 | - | -2,754,439,856.51 |
| 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） | - | -26,485,999.83 | -26,485,999.83 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 5,017,959,448.65 | - | 5,017,959,448.65 |

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

金元顺安金元宝货币市场基金（原名为：金元惠理金元宝货币市场基金，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[2014]377 号文《关于同意金元惠理金元宝货币市场基金募集的批复》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前身）向社会公开募集，基金合同于 2014 年 8 月 1 日正式生效，首次设立募集规模为 397,663,805.53 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均为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

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。经本基金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，将“金元惠理金元宝货币市场基金”相应更名为“金元顺安金元宝货币市场基金”，并于 2015 年 7 月 15 日进行公告。

本基金根据投资者认（申）购本基金的金额，对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成不同的基金份额类别。本基金目前分设两类基金份额：A 类基金份额和 B 类基金份额。其中，A 类基金份额和 B 类基金份额以 300 万份为界限划分，单一持有人持有 300 万份基金份额以下的为 A 类份额，达到或超过 300 万份的为 B 类份额。若 A 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 300 万份时，本基金的登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额。若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 300 万份时，本基金的登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，期限在一年以内（含一年）的债券回购，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、中期票据、资产支持类证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具，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为同期七天通知存款利率（税后）。

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 | 10,046,915.53 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 10,046,915.53 |

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 | | | |
|----|-------|------------------------|------------------|--------------|---------|
| | | 摊余成本 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 (%) |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 3,244,785,694.59 | 3,249,856,000.00 | 5,070,305.41 | 0.1231 |
| | 合计 | 3,244,785,694.59 | 3,249,856,000.00 | 5,070,305.41 | 0.1231 |

注：

- 1、偏离金额=影子定价-摊余成本
- 2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值

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

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | |
|----|------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |

| | | |
|-------|------------------|---|
| 交易所市场 | 1,142,070,000.00 | - |
| 银行间市场 | 241,990,932.92 | - |
| 合计 | 1,384,060,932.92 | - |

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 | 3,478.57 |
| 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 | 242.47 |
| 应收债券利息 | 4,662,425.98 |
| 应收买入返售证券利息 | 1,801,564.31 |
| 应收申购款利息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 6,467,711.33 |

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 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 44,662.44 |
| 合计 | 44,662.44 |

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 | - |
| 信息披露费 | 94,219.55 |
| 债券账户维护费 | 9,000.00 |
| 审计费 | 32,232.48 |
| 合计 | 135,452.03 |

6.4.7.9 实收基金

金元顺安金元宝 A 类

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 | 83,503,075.63 | 83,503,075.63 |
| 本期申购 | 80,719,879.13 | 80,719,879.13 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -96,380,148.68 | -96,380,148.68 |
| 本期末 | 67,842,806.08 | 67,842,806.08 |

金元顺安金元宝 B 类

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 | 3,829,116,347.43 | 3,829,116,347.43 |
| 本期申购 | 9,451,817,223.84 | 9,451,817,223.84 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -9,203,176,878.75 | -9,203,176,878.75 |
| 本期末 | 4,077,756,692.52 | 4,077,756,692.52 |

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

金元顺安金元宝 A 类

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 | - | - | - |
| 本期利润 | 1,159,655.11 | - | 1,159,655.11 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -1,159,655.11 | - | -1,159,655.11 |
| 本期末 | - | - | - |

金元顺安金元宝 B 类

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 | - | - | - |
| 本期利润 | 79,172,684.33 | - | 79,172,684.33 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -79,172,684.33 | - | -79,172,684.33 |
| 本期末 | - | - | - |

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 | 114,582.64 |
| 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 | 25,989.95 |
| 其他 | - |
| 合计 | 140,572.59 |

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

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 | 4,205,512,629.96 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,193,867,055.69 |
| 减：应收利息总额 | 14,280,688.36 |
| 债券投资收益 | -2,635,114.09 |

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 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 | - |
| 银行间市场交易费用 | 449.00 |
| 合计 | 449.00 |

6.4.7.19 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 | 94,219.55 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 其他手续费 | 800.00 |
| 合计 | 145,252.03 |

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

本基金本报告期内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 |
| 宁波银行股份有限公司 | 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 | 6,687,265.86 | 3,035,762.85 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 98,593.58 | 265,032.43 |

注：

1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数},$$

H 为每日应计提的基金管理费，

E 为前一日的基金资产净值。

2、基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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 2 个工作日内从基金财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。

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 | 1,621,155.29 | 735,942.52 |

注：

1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% / \text{当年天数},$$

H 为每日应计提的基金托管费，

E 为前一日的基金资产净值。

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

6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|---------------------------------|-------------|------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 金元顺安金元宝 A 类 | 金元顺安金元宝 B 类 | 合计 |
| 金元顺安基金管理有限公司 | 6,082.61 | 196,761.30 | 202,843.91 |
| 金元证券股份有限公司 | 182.13 | - | 182.13 |
| 宁波银行股份有限公司 | 1,110.32 | 93.75 | 1,204.07 |
| 合计 | 7,375.06 | 196,855.05 | 204,230.11 |

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 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销售服务费 | | |
| | 金元顺安金元宝 A 类 | 金元顺安金元宝 B 类 | 合计 |
| 金元顺安基金管理有限公司 | 3,166.88 | 77,074.33 | 80,241.21 |
| 宁波银行股份有限公司 | 1,465.51 | 5.74 | 1,471.25 |
| 金元证券股份有限公司 | 767.80 | - | 767.80 |
| 合计 | 5,400.19 | 77,080.07 | 82,480.26 |

注：

1、本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额销售服务费年费率为 0.25%，B 类基金份额销售服务费年费率为 0.01%。本基金 A 类与 B 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$H = E \times \text{年销售服务费率} / \text{当年天数}$ ，

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费，

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值。

2、基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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

金额单位：人民币元

| 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | | | | | |
|---------------------------------------|--------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场 交易的各关 联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|---|--------|---------------|-------|------|-------|------|
| 宁波银行股份有限公司 | - | 99,860,207.73 | - | - | - | - |
| 上上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | | | | | | |
| 银行间市场 交易的各关 联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| - | - | - | - | - | - | - |

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

份额单位：份

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | 上上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | |
|-----------------------|---------------------------------------|----------------|---|----------------|
| | 金元顺安金元宝 A 类 | 金元顺安金元宝 B 类 | 金元顺安金元宝 A 类 | 金元顺安金元宝 B 类 |
| 期初持有的基金份额 | - | - | - | 12,540,975.72 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - | 2,669,838.75 | 106,514.83 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - | 2,669,838.75 | 12,647,490.55 |
| 期末持有的基金份额 | - | - | - | - |
| 期末持有的基金份额占 基金总份额比例 | - | - | - | - |

注：

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

金元顺安金元宝 A 类

本基金 A 类份额本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

金元顺安金元宝 B 类

份额单位：份

| 关联方名称 | 金元顺安金元宝 B 类本期末 2017 年 6 月 30 日 | | 金元顺安金元宝 B 类上年度末 2016 年 12 月 31 日 | |
|--------------------|-----------------------------------|----------------------|-------------------------------------|----------------------|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占 基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占 基金总份额的比例 |
| 上海金元百利 资产管理有限公司 | - | - | 132,105,883.27 | 3.45% |

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 |
| 宁波银行股份有限 公司 | 10,046,815.53 | 114,582.64 | 12,128,215.34 | 36,282.62 |

注：

除上表列示的金额外，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 25,989.95 元，2017 年 6 月 30 日止无结算备付金余额。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 4,024.61 元，2016 年 6 月 30 日止无结算备付金余额。

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在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

金元顺安金元宝 A 类

金额单位：人民币元

| 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|--------------|---------------|----------|--------------|----|
| 1,061,144.04 | 93,804.16 | 4,706.91 | 1,159,655.11 | - |

金元顺安金元宝 B 类

金额单位：人民币元

| 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|---------------|---------------|--------------|---------------|----|
| 64,289,773.88 | 13,570,658.50 | 1,312,251.95 | 79,172,684.33 | - |

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的股票。

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

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 |
|-----------|-------------------|------------|--------|-----------|---------------|
| 111797831 | 17 广州农村商业银行 CD088 | 2017-07-03 | 99.40 | 1,000,000 | 99,400,503.00 |
| 111797611 | 17 广州农村商业银行 CD082 | 2017-07-03 | 99.40 | 1,000,000 | 99,400,679.83 |
| 160202 | 16 国开 02 | 2017-07-03 | 98.90 | 500,000 | 49,451,052.40 |
| 130216 | 13 国开 16 | 2017-07-03 | 99.61 | 500,000 | 49,804,820.82 |
| 110236 | 11 国开 36 | 2017-07-03 | 99.35 | 500,000 | 49,675,016.00 |

| | | | | | |
|--------|----------|------------|--------|-----------|----------------|
| 150315 | 15 进出 15 | 2017-07-03 | 100.13 | 800,000 | 80,107,127.18 |
| 130212 | 13 国开 12 | 2017-07-03 | 100.01 | 700,000 | 70,006,343.88 |
| 合计 | | - | - | 5,000,000 | 497,845,543.11 |

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金融资产款余额。

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。本基金投资于具有良好信用等级的国债，企业债，可转债，央行票据，国家政策金融债券及短期融资券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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。

根据本基金的信用风险控制要求，本基金投资的短期融资券的信用评级，不低于以下标准：

- 1、国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；

2、根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：

(1) 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；

(2) 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。(同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准)。本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 20 个交易日内予以全部减持。

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 | - | 310,048,249.29 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 2,878,770,000.00 | 1,514,357,144.86 |
| 合计 | 2,878,770,000.00 | 1,824,405,394.15 |

注：

未评级债券为政策性金融债、同业存单及超短期融资券。

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 | - | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 371,086,000.00 | 268,933,384.11 |
| 合计 | 371,086,000.00 | 268,933,384.11 |

注：

未评级债券为政策性金融债。

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。

本基金所持有的大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的短期融资券、政策性金融债，均在银行间同业市场交易；本基金所持有的买入返售金融资产期限在六个月以内，因此，本期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，并同时通过独立的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。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

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 | 10,046,915.53 | - | - | - | 10,046,915.53 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-----------|------------------|---|---|--------------|------------------|
| 存出保证金 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | 3,244,785,694.59 | - | - | - | 3,244,785,694.59 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 6,467,711.33 | 6,467,711.33 |
| 应收申购款 | - | - | - | 512,001.00 | 512,001.00 |
| 买入返售金融资产 | 1,384,060,932.92 | - | - | - | 1,384,060,932.92 |
| 资产总计 | 4,643,893,543.04 | - | - | 6,979,712.33 | 4,645,873,255.37 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回费 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,331,444.48 | 1,331,444.48 |
| 应付托管费 | - | - | - | 322,774.41 | 322,774.41 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 44,662.44 | 44,662.44 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 54,696.47 | 54,696.47 |
| 卖出回购金融资产款 | 495,498,349.81 | - | - | - | 495,498,349.81 |
| 应付利息 | - | - | - | 63,433.21 | 63,433.21 |
| 应付利润 | - | - | - | 2,822,943.92 | 2,822,943.92 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - |
| 应交税金 | - | - | - | - | - |
| 预提费用 | - | - | - | 135,452.03 | 135,452.03 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 负债总计 | 495,498,349.81 | - | - | 4,775,406.96 | 500,273,756.77 |
| 利率敏感度缺口 | 4,143,395,193.23 | - | - | 2,204,305.37 | 4,145,599,498.60 |

| 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 | 18,784,727.47 | - | - | - | 18,784,727.47 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | 2,093,338,778.26 | - | - | - | 2,093,338,778.26 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 13,107,312.29 | 13,107,312.29 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 2,082,401,190.60 | - | - | - | 2,082,401,190.60 |
| 资产总计 | 4,194,524,696.33 | - | - | 13,107,312.29 | 4,207,632,008.62 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回费 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,028,753.91 | 1,028,753.91 |
| 应付托管费 | - | - | - | 249,394.90 | 249,394.90 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 56,778.82 | 56,778.82 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 48,936.99 | 48,936.99 |
| 卖出回购金融资产款 | 291,858,519.82 | - | - | - | 291,858,519.82 |
| 应付利息 | - | - | - | 200,216.06 | 200,216.06 |
| 应付利润 | - | - | - | 1,505,985.06 | 1,505,985.06 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---------|------------------|---|---|--------------|------------------|
| 应交税金 | - | - | - | - | - |
| 预提费用 | - | - | - | 64,000.00 | 64,000.00 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 负债总计 | 291,858,519.82 | - | - | 3,154,065.74 | 295,012,585.56 |
| 利率敏感度缺口 | 3,902,666,176.51 | - | - | 9,953,246.55 | 3,912,619,423.06 |

注：

上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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；买入返售金融资产利息收益/卖出回购金融资产的利息支出在交易时确定，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 |
| | 基准利率上升 1 个基点 | 减少 6.49 万元 | 减少 5.26 万元 |
| | 基准利率下降 1 个基点 | 增加 6.49 万元 | 增加 5.26 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或银行间同业市场交易的固定收益品种和债券回购产品，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

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 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产——债券投资 | 3,244,785,694.59 | 78.27 | 2,093,338,778.26 | 53.50 |
| 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 | 3,244,785,694.59 | 78.27 | 2,093,338,778.26 | 53.50 |

注：

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，期限在一年以内（含一年）的债券回购，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、中期票据、资产支持类证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，

可以将其纳入投资范围。

6.4.14 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、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二层次的余额为人民币 3,249,856,000.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。截止 2017 年 6 月 30 日，对于以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。

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 | 固定收益投资 | 3,244,785,694.59 | 69.84 |
| | 其中：债券 | 3,244,785,694.59 | 69.84 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,384,060,932.92 | 29.79 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 10,046,915.53 | 0.22 |
| 4 | 其他各项资产 | 6,979,712.33 | 0.15 |
| 5 | 合计 | 4,645,873,255.37 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例 (%) | |
|----|--------------|----------------|----------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | | 6.91 |
| | 其中：买断式回购融资 | | 0.10 |
| 序号 | 项目 | 金额 (元) | 占基金资产净值的比例 (%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 495,498,349.81 | 11.95 |
| | 其中：买断式回购融资 | 299,498,843.81 | 7.22 |

注：

本基金本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 发生日期 | 融资余额占基金资产净值的比例 (%) | 原因 | 调整期 |
|----|----------|--------------------|------|--------|
| 1 | 2017-1-9 | 28.67 | 巨额赎回 | 3 个自然日 |

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 47 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 57 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 28 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|------------------------|---------------------|---------------------|
| 1 | 30 天以内 | 49.44 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 1.19 | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 24.02 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 3.14 | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 27.48 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 2.38 | - |

| | | | |
|---|------------------------|--------|---|
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 8.59 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 111.90 | - |

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

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 | 摊余成本 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 368,944,366.58 | 8.90 |
| | 其中：政策性金融债 | 368,944,366.58 | 8.90 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 99,992,383.72 | 2.41 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 2,775,848,944.29 | 66.96 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 3,244,785,694.59 | 78.27 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 179,625,134.07 | 4.33 |

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量（张） | 摊余成本 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 111710297 | 17 兴业银行 CD297 | 2,000,000 | 197,885,100.25 | 4.77 |
| 2 | 150315 | 15 进出 15 | 1,300,000 | 130,174,081.67 | 3.14 |
| 3 | 011698581 | 16 潞安 SCP007 | 1,000,000 | 99,992,383.72 | 2.41 |
| 4 | 111796397 | 17 长安银行 CD029 | 1,000,000 | 99,709,103.08 | 2.41 |
| 5 | 111796609 | 17 青岛农商行 CD033 | 1,000,000 | 99,687,199.72 | 2.40 |
| 6 | 111796772 | 17 广东南粤银行 CD054 | 1,000,000 | 99,662,218.00 | 2.40 |
| 7 | 111796734 | 17 华融湘江银行 CD038 | 1,000,000 | 99,660,752.34 | 2.40 |
| 8 | 111797085 | 17 嘉兴银行 CD037 | 1,000,000 | 99,514,736.74 | 2.40 |
| 9 | 111797217 | 17 常熟农村商行 CD107 | 1,000,000 | 99,501,998.50 | 2.40 |
| 10 | 111797440 | 17 武汉农商行 CD004 | 1,000,000 | 99,489,261.89 | 2.40 |

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|-------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）—0.5%间的次数 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1370% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0897% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0664% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.25%的情况

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注**7.9.1 基金计价方法说明**

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

7.9.2 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.3 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 6,467,711.33 |
| 4 | 应收申购款 | 512,001.00 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 6,979,712.33 |

7.9.4 其他需说明的重要事项

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

| 份额级别 | 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 |
| 金元顺安金元宝 A 类 | 4,766 | 14,234.75 | 8,009,786.35 | 11.81% | 59,833,019.73 | 88.19% |
| 金元顺安金元宝 B 类 | 27 | 151,028,025.65 | 4,054,521,627.25 | 99.43% | 23,235,065.27 | 0.57% |
| 合计 | 4,793 | 864,927.92 | 4,062,531,413.60 | 98.00% | 83,068,085.00 | 2.00% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 金元顺安金元宝 A 类 | 931,665.48 | 1.38% |
| | 金元顺安金元宝 B 类 | - | - |
| | 合计 | 931,665.48 | 0.02% |

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 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|-------------|--------------------|
| 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 | 金元顺安金元宝 A 类 | 10~50 |
| | 金元顺安金元宝 B 类 | 0 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 金元顺安金元宝 A 类 | 0 |
| | 金元顺安金元宝 B 类 | 0 |

| | | |
|--|----|---|
| | 合计 | 0 |
|--|----|---|

§9 开放式基金份额变动

份额单位：份

| 项目 | 金元顺安金元宝 A 类 | 金元顺安金元宝 B 类 |
|---------------|----------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 83,503,075.63 | 3,829,116,347.43 |
| 本报告期基金总申购份额 | 80,719,879.13 | 9,451,817,223.84 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 96,380,148.68 | 9,203,176,878.75 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | -15,660,269.55 | 248,640,345.10 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 67,842,806.08 | 4,077,756,692.52 |

§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 | |
| 金元证券股份有限公司 | 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 |
| 金元证券股份有限公司 | - | - | 22,150,986,000.00 | 100.00% | - | - |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 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 | 金元顺安金元宝货币市场基金 2016 年第 4 季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www.jysa99.com | 2017-01-19 |
| 2 | 金元顺安金元宝货币市场基金关于春节前两个工作日基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www.jysa99.com | 2017-01-25 |
| 3 | 金元顺安金元宝货币市场基金更新招募 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证 | 2017-03-17 |

| | | | |
|----|--|--|------------|
| | 说明书[2017 年 1 号] | 券时报》和 www.jysa99.com | |
| 4 | 金元顺安金元宝货币市场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》和 www.jysa99.com | 2017-03-17 |
| 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》、《上海证券报》、《证券时报》和 www.jysa99.com | 2017-03-22 |
| 6 | 金元顺安金元宝货币市场基金 2016 年年度报告（正文） | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www.jysa99.com | 2017-03-29 |
| 7 | 金元顺安金元宝货币市场基金 2016 年年度报告（摘要） | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www.jysa99.com | 2017-03-29 |
| 8 | 金元顺安金元宝货币市场基金 2017 年第 1 季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www.jysa99.com | 2017-04-24 |
| 9 | 金元顺安金元宝货币市场基金关于劳动节假期前两个工作日基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www.jysa99.com | 2017-04-27 |
| 10 | 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》和 www.jysa99.com | 2017-05-17 |
| 11 | 金元顺安金元宝货币市场基金关于端午节假期前两个工作日基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和 www.jysa99.com | 2017-05-24 |

§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4月13日； 2017年4月18日-2017年4月18日； 2017年5月4日-2017年5月9日； 2017年6月22日-2017年6月30日 | 301,263,233.32 | 1,365,249,231.31 | 453,263,233.32 | 1,213,249,231.31 | 29.27% |
| 机构 | 2 | 2017年1月9日-2017年6月23日 | 616,016,444.92 | 518,645,865.46 | 507,000,000.00 | 627,662,310.38 | 15.14% |
| 机构 | 3 | 2017年1月10日-2017年2月7日 | 300,126,115.68 | 1,001,854,575.47 | 1,301,980,691.15 | - | 0.00% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |

- 持有份额比例较高的投资者（“比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。
- 基金净值大幅波动的风险
高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。
- 基金规模较小导致的风险
高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

§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金元宝货币市场基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安金元宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《金元顺安金元宝货币市场基金基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安金元宝货币市场基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册金元顺安金元宝货币市场基金的法律意见书；
- 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