

金元顺安宝石动力混合型证券投资基金
更新招募说明书摘要
(2017年2号)

基金管理人：金元顺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇一七年九月

重要提示

金元顺安宝石动力混合型证券投资基金（原名为：金元比联宝石动力混合型证券投资基金，以下简称“本基金”），由金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金转型而来。金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金于2007年7月19日获中国证券监督管理委员会《关于同意金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监基金字[2007]213号）文件批准募集。

本基金于2007年8月15日正式生效。

本基金为契约型开放式证券投资基金，基金管理人和基金注册登记人为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

2012年3月15日，经金元比联第二届董事会第七次会议及第二届股东会第五次会议审议通过，并由中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]276号文核准，金元比联基金管理有限公司完成相关工商变更登记手续，并且变更公司名称为“金元惠理基金管理有限公司”。经本基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后，“金元比联宝石动力混合型证券投资基金”更名为“金元惠理宝石动力混合型证券投资基金”，并于2012年5月2日进行公告。

2015年2月5日，经金元惠理基金管理有限公司股东金元证券股份有限公司及惠理基金管理香港有限公司于以书面表决的方式达成更名决议。金元惠理基金管理有限公司于2015年3月6日完成相关工商变更登记手续，并且变更公司名称为“金元顺安基金管理有限公司”，并于2015年3月10日进行公告。经本基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后，“金元惠理宝石动力混合型证券投资基金”更名为“金元顺安宝石动力混合型证券投资基金”，并于2015年7月15日进行公告。

本基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金作出的任何决定，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，基金投资者认购或申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守，诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。作为主动配置的混合型基金，本基金将力争通过对股票、债券等大类资产的有效合理配置降低投资组合的波动性，但同时也可能存在因本基金如下原因而产生的风险：投资管理人对宏观经济情景、各类资产收益风险预期等判断有误从而导致资产配置比例不合适而产生的风险；本基金对各行业投资价值进行的优先排序有误导致行业投资比重不适应而产生的风险；本基金采用“金元顺安股票评级体系”精选优选行业内的最有投资价值的股票。在该体系中使用了预测性指标，包括盈利增长潜力、估值水平等，如果研究不深入、业绩预测不准会增加投资风险。投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险。

本招募说明书系依据该基金基金合同进行编写，并报经中国证监会备案。《基金合同》是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依《基金合同》取得基金份额起，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书更新内容截止日为 2017 年 8 月 10 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 6 月 30 日。

本招募说明书所载财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：金元顺安基金管理有限公司

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

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

成立日期：2006年11月13日

法定代表人：任开宇

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2006]222号

经营范围：募集基金、管理基金和经中国证监会批准的其他业务（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币2.45亿元

存续期间：持续经营

联系人：孙筱君

联系电话：021-68882850

股权结构：金元证券股份有限公司占公司总股本的51%，上海泉意金融信息服务有限公司占公司总股本的49%。

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司的权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不得以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的执行机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由8名董事组成，其中3名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会履行《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由4名监事组成，其中包括2名职工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责

检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

公司日常经营由总经理负责。公司根据经营运作需要设置基金投资部、专户投资部、固定收益及量化部、研究部、产品开发部、市场营销部、专户理财部、北京分公司（筹）、华东营销中心、华南营销中心、信息技术部、基金事务部、交易部、财务部、人事行政部、监察稽核部、金融同业部、资产管理部、创新投资部、金融市场部、资本市场部和投资部等 22 个职能部门。此外，公司董事会下设风险控制与合规审核委员会、资格审查委员会和薪酬管理委员会，公司总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

任开宇先生，董事长，博士学位。曾任长春证券有限公司总裁助理，新华证券有限公司监事长，金元证券有限公司投行总监。2008 年至今，任金元证券股份有限公司副总裁；2010 年 7 月出任金元顺安基金管理有限公司董事，2010 年 9 月出任金元顺安基金管理有限公司董事长。

史克新先生，董事，学士学位。曾任珠海会计师事务所注册会计师、君安证券有限公司审计师、北大方正投资有限公司副总经理、兴安证券东莞营业部总经理和深圳丽晶生物技术有限公司董事长。2007 年至今，任金元证券股份有限公司经纪服务总部总经理、副监事长。

冷天晴先生，董事，副董事长，学士学位。曾长期在军区部队服役，主要从事军队内部的管理工作，后相继于多家大型企业担任总经理、执行董事等高级职务，于 2012 年 9 月至 2013 年 5 月年任云南工投集团动力配煤股份有限公司总经理，现担任云南九天投资控股集团有限公司总经理，主持公司的全面工作，此外兼任云南滇中供应链管理有限公司执行董事、深圳滇中商业保理有限公司执行董事。具有丰富的企业业务开拓、经营管理经验。

李宪英先生，独立董事，硕士学位。曾任大庆市第一医院医师、大庆市中胜律师事务所律师，现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人。

张屹山先生，独立董事。吉林大学资深教授，曾任吉林大学数学系助教，吉林大学经济管理学院任副教授，日本关西学院大学客座教授，天治基金管理有限公司独立董事，吉林大学商学院院长、博士生导师。

张嘉宾先生，董事，公司总经理，兼任子公司董事长，工商管理硕士。曾任深业美国公司（新泽西）副总裁，瑞银华宝（纽约）业务经理，富国基金管理有限公司总经理助理、市场总监，信诚基金

管理有限公司副总经理、首席市场官，中国光大资产管理有限公司（香港）首席运营官，民生加银基金管理有限公司总经理。

潘书鸿先生，独立董事，学士学位。曾于1995年至1999年任上海功茂律师事务所行政主管，于1999年至2006年任上海崇林律师事务所（后更名为上海海之纯律师事务所）行政主管，此后自2006年至今在上海恒建律师事务所担任主任律师、首席合伙人。另外，潘书鸿先生自2013年至今在第十届上海律师协会担任副会长，自2016年至今在上海仲裁委员会担任仲裁员。

栗旻先生，董事，硕士学位。曾长期在中国农业银行多个岗位担任管理职位，自1996年始至2012年在农业银行先后担任了分行营业部公司业务部/国际业务部担任副总经理、总经理，在农行云南省分行下属的支行担任副行长、行长等职务。自2012年始担任深圳滇中商业保理有限公司总经理至今。其长期在银行系统及非银金融领域工作，并在多个岗位担任管理职位。

2、基金管理人监事会成员

郭长洲先生，监事会主席，本科学位，金元证券股份有限公司财务总监、财务部总经理。曾任山东济南乾聚会计师事务所经理、BDO利安达会计师事务所业务经理、航港金控投资有限公司业务经理，历任首都机场集团公司业务经理、首都机场财务有限公司总经理助理、首都机场地产集团有限公司财务部总经理、财务总监。

李春光先生，监事，硕士学位，具有上海证交所颁发的董秘资格证书。曾于2005年至2015年在云南凌云律师事务所担任律师，自2015年至今在上海泉意金融信息服务有限公司担任副总经理。

陈渝鹏先生，员工监事，兼任子公司监事会主席，硕士学位，金元顺安基金管理有限公司信息技术部总监。曾任银通证券信息部主管，金元证券电脑总部助理主管工程师。

洪婷女士，员工监事，本科学历，金元顺安基金管理有限公司财务部副总监。曾任职于昆山组合服饰有限公司出纳及华尔街英语金茂培训中心财务会计。

3、管理层人员情况

任开宇先生，董事长，简历同上。

张嘉宾先生，总经理，简历同上。

凌有法先生，督察长，硕士学位。曾任华宝信托有限公司发展研究中心研究员、债券业务部高级经理，联合证券有限公司固定收益部业务董事，金元证券有限公司资产管理部首席研究员，首都机场集团公司资本运营部专家。

符刃先生，副总经理，硕士学位。曾任海南国信资产管理公司总经理助理，香港海信投资有限公

司总经理，历任金元证券有限公司基金筹备组负责人，公司督察长。

邝晓星先生，财务总监，学士学位。曾任海南省国际信托投资公司上海宜山路证券营业部总经理，金元证券有限责任公司上海宜山路证券营业部总经理，金元证券有限责任公司财务总部经理助理，历任金元证券有限责任公司基金筹备组成员。

李锐先生，副总经理，硕士学位。曾任国金证券股份有限公司金融理财部总经理，中国民生银行石家庄分行历任金融市场部总经理助理（主持全面工作）、金融市场部副总经理（主持全面工作）。

陈嘉楠女士，副总经理，硕士学位。曾任职于上海金元百利资产管理有限公司创新金融部副总经理，西南证券股份有限公司投行部董事，新兴集团总经理助理，联想集团有限公司高级经理。

4、本基金基金经理

(1) 现任基金经理：

闵杭先生，总经理助理，投资总监，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。

(2) 历任基金经理：

李玲女士：2007 年 8 月至 2007 年 12 月；

何旻先生：2007 年 8 月至 2010 年 12 月；

黄奕女士：2009 年 5 月至 2010 年 6 月；

夏福陆先生：2010 年 12 月至 2011 年 12 月；

谷伟先生：2012 年 12 月至 2013 年 4 月；

晏斌先生：2013 年 1 月至 2015 年 11 月；

侯斌女士：2011 年 12 月至 2017 年 7 月。

5、投资决策委员会成员

张嘉宾先生，总经理，简历同上。

闵杭先生，基金经理，简历同上。

侯斌女士，金元顺安核心动力混合型证券投资基金的基金经理，上海财经大学经济学学士。曾任光大保德信基金管理有限公司行业研究员。2010年6月加入金元顺安基金管理有限公司，历任高级行业研究员，金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，金元顺安核心动力混合型证券投资基金基金经理助理，金元顺安价值增长混合型证券投资基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金和金元顺安宝石动力混合型证券投资基金的基金经理。15年基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。李杰先生，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。

缪玮彬先生，金元顺安价值增长混合型证券投资基金和金元顺安桉盛债券型证券投资基金的基金经理，复旦大学经济学硕士。曾任华泰资产管理有限公司固定收益部总经理，宝盈基金管理有限公司研究员，金元证券有限责任公司资产管理部总经理助理，联合证券有限责任公司高级投资经理，华宝信托投资有限责任公司投资经理。2016年10月加入金元顺安基金管理有限公司。19年基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

郭建新先生，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，西南财经大学经济学硕士。曾任河北银行股份有限公司资金运营中心债券交易经理。2016年9月加入金元顺安基金管理有限公司。7年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

孔祥鹏先生，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。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其它职责。

（四）基金管理人的承诺

- 1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
 - 2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
 - （1）管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
 - （2）不公平对待管理的不同基金财产；
 - （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
 - （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
 - （5）行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。
 - 3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；
 - 4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责；
 - 5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

（五）基金经理的承诺

- 1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- 2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- 3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- 4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（六）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

（1）健全性原则

内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

（2）有效性原则

通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

（3）独立性原则

公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

（4）相互制约原则

公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

（5）成本效益原则

公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

2、内部控制的主要内容

（1）控制环境

公司建立健全的法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

公司管理层树立内控优先的风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，建立风险控制优先、风险控制人人有责、一线人员第一责任的公司内控文化，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

公司建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，确保公司各项决策、决议的执行中，“四眼”原则贯穿全程。各部门及岗位有明确的授权分工、工作职责和业务流程，通过重要凭据传递及信息沟通制度，实现相关部门、相关岗位之间的监督制衡。

公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制。通过法律法规培训、制度教育、执业操守教育和行为准则教育等，确保公司人员了解与从业有关的法规与监管部门规定，熟知公司相关规章制度、岗位职责与操作流程，具备与岗位要求相适应的操守和专业胜任能力。

（2）风险评估

公司建立科学严密的风险评估体系，对公司的业务风险、人员风险、法律风险和财务风险等进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。通过科学的风险量化技术和严格的风险限额控制对投资风险实现定量分析和管控。通过收集与投资组合相关的会计和市场数据，建立一个投资风险测评与绩效评估的信息技术平台。由监察稽核部定期向投资决策委员会和风险管理委员会提交风险测评报告。

（3）内控机制

公司全部的经营管理决策，均按照明确成文的决策程序与规定进行，防止超越或违反决策程序的随意决策行为的发生。

操作层面上，公司依据自身经营特点，以各岗位目标责任制为基础形成第一道内控防线，以相关部门、相关岗位之间相互监督制衡形成第二道内控防线，以监察稽核部、风险管理委员会、督察长对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈形成第三道内控防线，并建立内部违规违章行为的处罚机制。同时，按照分级管理、规范操作、有限授权、业务跟踪的原则，制定公司授权管理制度，并严格区分业务授权与管理授权。

（4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

（5）监督与内部稽核

本公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管

理及基金运作中的相关风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期不定期出具监察稽核报告。

3、基金管理人关于内部控制的声明

- (1) 本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；
- (2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；
- (3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至 2017 年 3 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 205 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最

丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2017 年 3 月，中国工商银行共托管证券投资基金 709 只。自 2003 年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 53 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的职责

- 1、以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- 2、设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- 3、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- 4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 7、保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- 8、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
- 9、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 10、对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当

说明基金托管人是否采取了适当的措施；

- 11、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- 12、建立并保存基金份额持有人名册；
- 13、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 14、依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- 15、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- 16、按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；
- 17、参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 18、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- 19、因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 20、按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；
- 21、执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- 22、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(五) 基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014 年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2015 年、2016 年中国工商银行资产托管部均通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅，迄今已第十次获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，

要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（六）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构

（一）直销机构

金元顺安基金管理有限公司

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

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

法定代表人：任开宇

邮政编码: 200120

联系人: 孙筱君

联系电话: 021-68882850

传真: 021-68882865

客服电话: 400-666-0666、021-6881898

公司网址: www.jysa99.com

(二) 代销机构

1、中国工商银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 易会满

联系人: 杨菲

联系电话: 010-66107909

客服电话: 95588

公司网址: www.icbc.com.cn

2、中国农业银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人: 周慕冰

联系人: 张伟

联系电话: 010-85109230

客服电话: 95599

公司网址: www.abchina.com

3、交通银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：张作伟

联系电话：021-58781234

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

4、招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：于菲

联系电话：0755-83161095

客服电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

5、中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

联系人：文彦娜

联系电话：010-68858101

客服电话：95580

公司网址：www.psbc.com

6、华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：董金

联系电话：010-85238441

客服电话：95577

公司网站：www.hxb.com.cn

7、上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：姚磊

联系电话：021-61614467

客服电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

8、中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：穆婷

联系电话：010-57092619

客服电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

9、中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

联系人：王媛

联系电话：010-89937322

客服电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

10、上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

联系人：王笑

联系电话：021-68475732

客服电话：021-962888

公司网址：www.bankofshanghai.com

11、平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：谢永林

联系人：张莉

联系电话：021-38637673

客服电话：95511-3

公司网址：www.bank.pingan.com

12、金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

联系电话：0755-83025022

客服电话：4008-888-228

公司网址：www.jyzq.cn

13、中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F

法定代表人：何亚刚

联系人：李微

联系电话：010-59355941

客服电话：400-889-5618

公司网址：www.e5618.com

14、中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

联系电话：010-85156398

客服电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

15、光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：李晓哲

联系电话：021-22169111

客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

16、申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

联系电话：021-33388211

客服电话：95523、4008895523

公司网址：www.swhysc.com

17、海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：李笑鸣

联系电话：021-23219275

客服电话：95553

公司网址：www.htsec.com

18、兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

联系人：柯延超

联系电话：0591-38507950

客服电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

19、招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系人：黄蝉君

联系电话：0755-82960167

客服电话：95565、400-8888-111

公司网址：www.newone.com.cn

20、国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟镇

联系电话：021-38676767

客服电话：95521

网址：www.gtja.com

21、华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市江东中路 228 号

办公地址：江苏省南京市江东中路 228 号

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82493561

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

22、中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

客服电话: 4008-888-888

公司网址: www.chinastock.com.cn

23、广发证券股份有限公司

注册地址: 广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼 (4301-4316 房)

办公地址: 广州市天河北路大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人: 孙树明

联系人: 黄岚

联系电话: 020-87555888-333

客服电话: 95575、致电各地营业网点

公司网址: www.gf.com.cn

24、国元证券股份有限公司

注册地址: 安徽省合肥市梅山路 18 号

办公地址: 安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座

法定代表人: 蔡咏

联系人: 陈琳琳

联系电话: 0551-2246273

客服电话: 95578

公司网址: www.gyzq.com.cn

25、中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

联系人: 侯艳红

联系电话: 010-60838995

客服电话: 400-889-5548

公司网址: www.cs.ecitic.com

26、华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7—8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

联系人：郭相兴

联系电话：021-20655175

客服电话：0591-96326

公司网址：www.hfzq.com.cn

27、信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63081493

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

28、长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦

法人代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

联系电话：021-68751860

客服电话：95579、4008-888-999

网址：www.95579.com

29、中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：孙秋月

联系电话：0532-85022026

客服电话：96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

30、天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

联系电话：010-66045152

客服电话：010-66045678

公司网址：www.txsec.com

31、上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：陆敏

联系电话：021-20211847

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.howbuy.com

32、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼

法定代表人：汪静波

联系人: 张裕

联系电话: 021-38509680

客服电话: 400-821-5399

公司网址: www.noah-fund.com

33、杭州数米基金销售有限公司

注册地址: 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

办公地址: 浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人: 陈柏青

联系人: 韩爱彬

联系电话: 0571-26888888

客服电话: 4000-766-123

网址: www.fund123.cn

34、深圳众禄基金销售有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人: 薛峰

联系人: 童彩平

联系电话: 0755-33227950

客服电话: 4006-788-887

公司网址: www.zlfund.cn

35、和讯信息科技有限公司

注册地址: 北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址: 北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

法定代表人: 王莉

联系人: 刘洋

联系电话: 021-20835787

客服电话: 400-920-0022

公司网址: www.hexun.com

36、上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人: 张跃伟

联系人: 何昶

联系电话: 021-20691922

客服电话: 400-820-2899

网址: www.erichfund.com

37、上海天天基金销售有限公司

注册地址: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址: 徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 层

法定代表人: 其实

联系人: 朱玉

联系电话: 021-54509988

客服电话: 400-1818-188

公司网址: www.1234567.com.cn

38、上海利得基金销售有限公司

注册地址: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址: 上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人: 李兴春

联系人: 曹怡晨

联系电话: 021-60195148

客服电话: 400-921-7755

公司网址: www.leadbank.com.cn、a.leadfund.com.cn

39、北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：陈剑炜

联系电话：010-57418813

客服电话：400-893-6885

公司网址：www.qianjing.com

40、北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：周斌

联系人：祖杰

联系电话：010-57756159

客服电话：4008-980-618

公司网址：www.chtfund.com

41、海银基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号陆家嘴金融服务广场 16F

法定代表人：刘惠

联系人：何春燕

联系电话：021-80133828

客服电话：400-808-1016

公司网址：www.fundhaiyin.com

42、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 9 层

法定代表人：张彦

联系人：张燕

联系电话：010-58325388

客服电话：400-166-1188

公司网址：www.jrj.com.cn

43、兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

联系人：曾鸣

联系电话：021-52629999-218906

客服电话：95561

公司网址：www.cib.com.cn

44、浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

法定代表人：凌顺平

联系人：刘晓倩

联系电话：0571-88911818-8653

客服电话：4008-773-772

公司网址：fund.10jqka.com.cn

45、上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号外滩国际广场 19 楼

法定代表人：金佶

联系人：陈云卉

联系电话：021-33323999-5611

客服电话：400-820-2819

公司网址：www.chinapnr.com

46、上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：鲍东华

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

客服电话：4008-6666-18

公司网址：www.lu.com

47、申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：韩志谦

联系人：唐岚

联系电话：010-88085258

客服电话：4008-000-562

公司网址：www.hysec.com

48、中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京建国门外大街国贸写字楼 2 座 28 层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

联系电话：010-65051166-6493

客服电话: 400-910-1166

公司网址: www.cicc.com

49、大泰金石基金销售有限公司

注册地址: 南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址: 上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人: 袁顾明

联系人: 赵明

联系电话: 021-20324155

客服电话: 400-928-2266

公司网址: www.dtfunds.com

50、上海联泰资产管理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人: 燕斌

联系人: 兰敏

联系电话: 021-52822063-8102

客服电话: 021-52822063

公司网址: www.91fund.com.cn

51、北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址: 北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址: 北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21 层

法定代表人: 蒋煜

联系人: 徐晓荣

联系电话: 010-58170876

客服电话: 400-818-8866

公司网址: www.shengshiview.com

52、中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

联系电话：010-60833754

客服电话：400-9908-826

公司网址：www.citicsf.com

53、宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：中国浙江宁波市宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：于波涛

联系电话：0574-87050038

客服电话：95574

公司网址：www.nbc.com.cn

54、北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：马怡

联系电话：010-56282140

客服电话：400-619-9059

公司网址：www.fundzone.cn

55、天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

办公地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

法定代表人：丁东华

联系人：许艳

联系电话：010-59287105

客服电话：400-111-0889

公司网址：www.gomefund.com

56、泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路 3 号

法定代表人：林卓

联系人：姜焕洋

联系电话：0411-88891212

客服电话：400-6411-999

公司网址：www.haojiyoujijin.com

57、方正证券

注册地址：长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F

法定代表人：高利

联系人：高洋

联系电话：010-59355546

客服电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

58、上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座、

法定代表人：王廷富

联系人：孙骏

联系电话：021-51327185

客户服务电话：400-821-0203

公司网址：www.520fund.com.cn

59、北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东总部 A 座 17 层

法定代表人：江卉

联系人：赵德赛

联系电话：18600280556

客服电话：4000988511/4000888816

公司网址：<http://fund.jd.com>

60、珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

电话：020-89629099

客服电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

61、武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城 7 栋 2301

法定代表人：陶捷

联系人：徐博

联系电话：027-87006003-8015

客服电话：400-027-9899

公司网址：www.buyfunds.cn

62、上海中正达广投资管理有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

联系人：戴珉薇

联系电话：13774232592

客服电话：400-6767-523

公司网址：www.zzwealth.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

(三) 注册登记机构

金元顺安基金管理有限公司

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

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

法定代表人：任开宇

联系电话：021-68881801

传真：021-68881875

(四) 出具法律意见书的律师事务所

上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31356000

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

（五）审计基金财产的会计师事务所

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：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

办公地址：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

法人代表：葛明

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：印艳萍

经办注册会计师：汤骏、印艳萍

四、基金的名称

金元顺安宝石动力混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

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

七、基金的投资范围

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

八、基金的投资策略

本基金资产配置策略分为两个层次：第一个层次是大类资产配置策略，确定本基金在股票、债券及现金资产类别上的配置比例；第二个层次是采用行业配置指导下的个股精选策略，挖掘具有稳健基础的中国优质企业，构建股票组合。

1、大类资产配置

（1）配置原则

本基金将遵循以下大类资产配置原则：

1) 定量与定性分析相结合原则：本基金将通过量化分析和定性判断，对股票、债券的风险收益特征进行研究比较，并依此确定基金资产在股票、债券及现金三大类资产之间的配置比例。

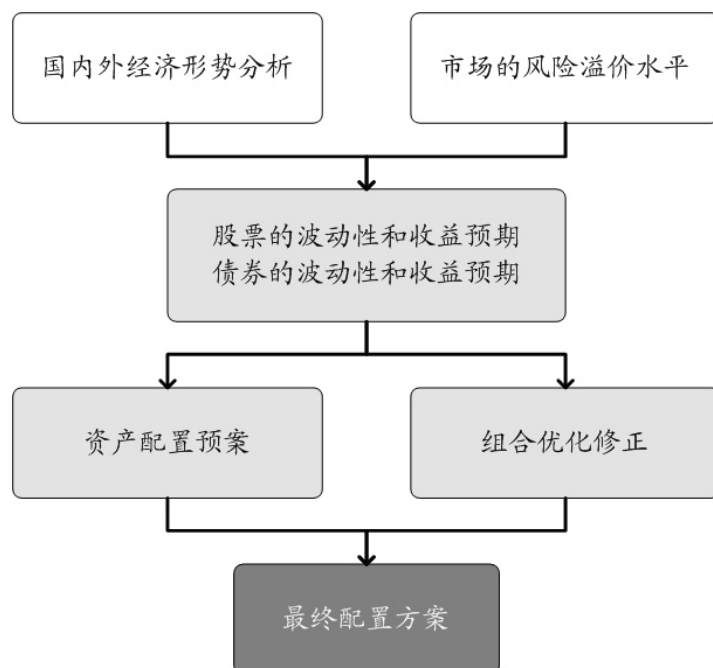
2) 及时性原则：针对市场的不确定性，本基金将随着各类证券风险收益特征的相对变化，及时调整基金资产在各类资产间的配置比例。

3) 动态调整原则：在基金实际管理过程中，本基金管理人将根据宏观经济形势以及中国证券市场的结构性调整与阶段性变化，动态调整基金资产在股票、债券和现金之间的配置比例。

（2）配置流程

大类资产配置策略的关键在于自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析的有机结合。一方面，本基金将分析和预测众多的宏观经济变量和关注经济结构调整过程中政策、法规的相关变化，另一方面，本基金会对股票市场整体估值水平、债券市场整体收益率曲线变化进行定量分析，从而得出对可投资市场走势和波动特征的判断。基于上述研究结果，本基金将决定股票、债券和现金等大类资

产在给定区间内的动态配置。



本基金大类资产配置的主要分析流程如下：

1) 宏观经济分析

根据主要的经济信号指标对国内外经济形势进行分析，判断经济所处的经济周期阶段、景气循环状况和未来运行趋势。

2) 经济周期、企业盈利与股票市场的关系分析

在经济所处周期阶段分析基础上，同时结合历史回溯，进一步分析企业未来盈利状况，判断股票市场未来趋势。

3) 市场的风险溢价水平分析

基于统计分析，对国内资本市场的风险溢价水平进行纵向（与历史比）和横向（与国外比）比较，判断国内资本市场的估值水平是否合理。

4) 股票和债券的波动性和收益预期

在上述分析的基础上，给出股票资产和债券资产的波动性和收益预期。

5) 资产配置预案

依据以上分析结果，给出资产配置预案。

6) 组合优化修正

利用投资决策系统资产配置管理功能对股票和债券的配置比例进行优化，以确定给定约束条件下组合中股票、债券和现金的最佳配置比例。

7) 最终配置方案

结合资产配置预案和组合优化修正的结果，确定资产配置的最终方案。

2、股票投资策略

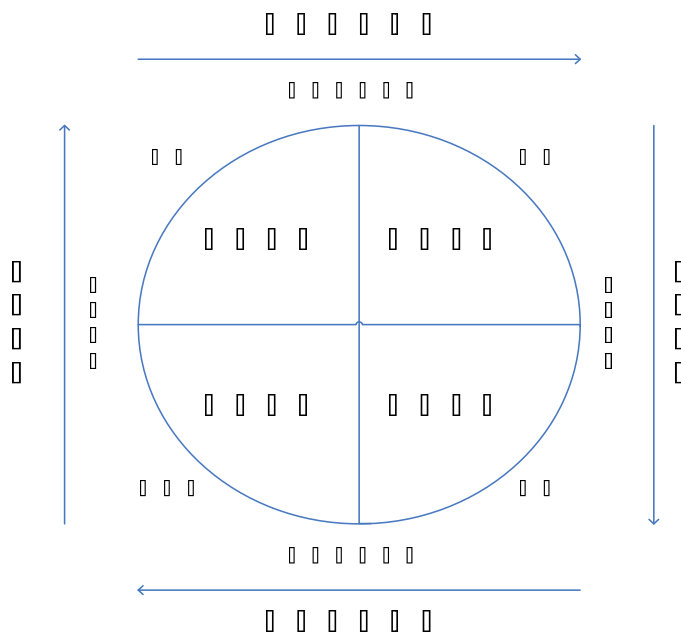
本基金采用行业配置指导下的个股精选策略：首先，采用“投资时钟”模型判断各行业的发展趋势，在此基础上，利用本基金管理人自行开发的“行业配置综合评分模型”对各行业的投资价值进行综合评分，确定拟投资行业及其配置权重；其次，采用本基金管理人建立的“金元顺安股票投资价值评估体系”对拟投资行业内上市公司从流动性、盈利质量、盈利增长潜力、公司治理以及估值水平等五个方面进行评估，精选出具有稳健增长且价值被低估的个股，构建股票组合。

(1) 行业配置策略

本基金以“全球行业分类标准（GICS）”作为行业分类标准。在此基础上，采用“投资时钟”模型分析不同经济环境下各行业的趋势，在明确各行业发展趋势之后，本基金管理人运用自行开发的“行业配置综合评分模型”，对各行业投资价值进行综合分析，通过主观赋权和打分排序的方法，取排名靠前的行业作为拟投资行业，并按照各行业的分值调整拟投资行业的配置比例。

1) 投资时钟

投资时钟主要表明了在经济周期的不同阶段，各个行业的表现如何。比如，在经济发展停滞时，防御型的行业表现较为出色；在经济快速发展时，周期性的行业表现较为出色。另一方面，通常价值型的行业在通货膨胀严重时表现较佳，而成长型的行业在通货膨胀下降时，相对表现较好。参见下图。



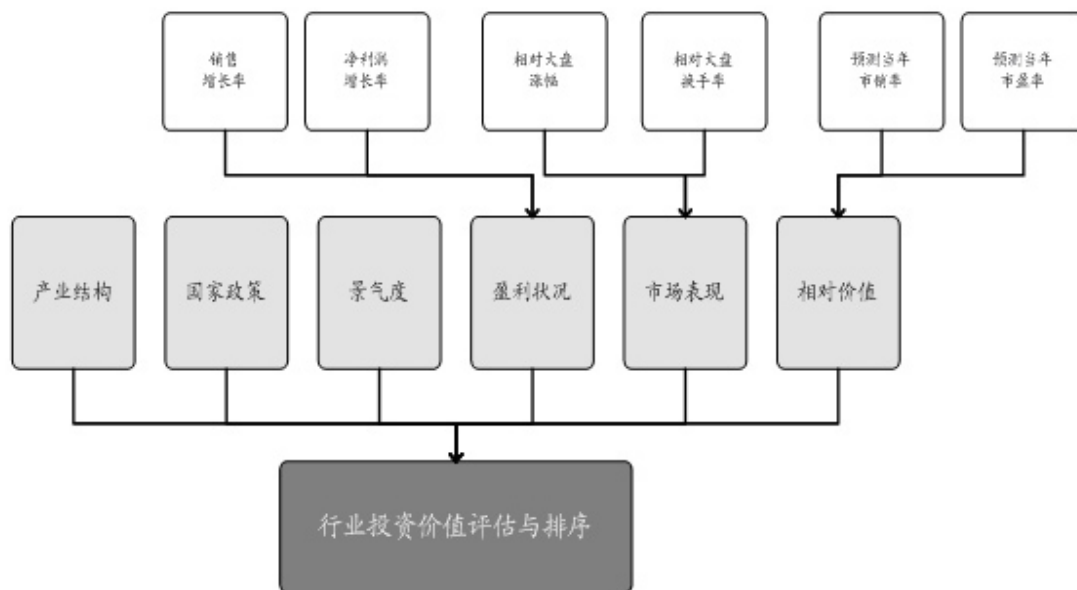
资料来源：美林投资管理，金元顺安基金管理有限公司

参照这一理论基础，本基金管理人的投研团队通过对宏观经济的分析，确定其所处的经济周期阶段，进而定性的预测在此阶段各行业的未来趋势。

2) 行业配置综合评分模型

在对行业趋势研判的基础上，本基金管理人建立“行业配置综合评分模型”来确定各行业的投资价值。该模型以五分制为基础，将行业的投资价值从六个主因素进行评估：产业结构、国家政策、景气度、盈利状况、市场表现以及相对价值。本基金管理人的投资团队结合各证券研究机构的行业研究成果与个人的分析判断，给出行业评分和行业评述，从而得到该行业各因素的得分，然后将各因素得分加总，从而得到行业的综合评分。

下图分别展示了行业配置综合评分模型的基本框架和具体实现方法。



| 主因素 | 子因素 | 评分方法 |
|------|-----|-----------|
| 产业结构 | | 垄断 5 分 |
| | | 寡占 4 分 |
| | | 垄断竞争 3 分 |
| | | 一般性竞争 2 分 |
| | | 强烈竞争 1 分 |
| 国家政策 | | 强烈支持 5 分 |
| | | 很支持 4 分 |
| | | 支持 3 分 |
| | | 放任 2 分 |
| | | 限制 1 分 |
| 景气度 | | 上升 5 分 |
| | | 复苏 4 分 |
| | | 平稳 3 分 |
| | | 见底 2 分 |

| | | 下滑 1 分 |
|------|---------|--|
| 盈利状况 | 销售增长率 | 比各行业平均值： 大于 1.5 为 5 分 大于 1.2 为 4 分 介于 1.2 至-1.2 为 3 分 小于-1.2 为 2 分 小于-1.5 为 1 分 |
| | 净利润增长率 | 比各行业平均值： 大于 1.5 为 5 分 大于 1.2 为 4 分 介于 1.2 至-1.2 为 3 分 小于-1.2 为 2 分 小于-1.5 为 1 分 |
| 市场表现 | 相对大盘涨幅 | 过去三个月： 大于 1.3 为 0 分 小于 1.3 大于 1.2 为 1 分 小于 1.2 大于 1.1 为 2 分 小于 1.1 大于 0.95 为 3 分 小于 0.95 大于 0.75 为 4 分 小于 0.75 为 5 分 |
| | 相对大盘换手率 | 过去三个月： 大于 1.3 为 0 分 小于 1.3 大于 1.2 为 1 分 小于 1.2 大于 1.05 为 2 分 小于 1.05 大于 0.95 为 3 分 |

| | | |
|------|---------|---|
| | | 小于 0.95 大于 0.8 为 4 分 |
| | | 小于 0.8 为 5 分 |
| 相对价值 | 预测当年市销率 | 比市场平均值： 大于 1.3 为 0 分 大于 1.2 小于 1.3 为 1 分 大于 1.1 小于 1.2 为 2 分 大于 0.9 小于 1.1 为 3 分 大于 0.8 小于 0.9 为 4 分 小于 0.8 为 5 分 |
| | 预测当年市盈率 | 比市场平均值： 大于 1.3 为 0 分 大于 1.2 小于 1.3 为 1 分 大于 1.1 小于 1.2 为 2 分 大于 0.9 小于 1.1 为 3 分 大于 0.8 小于 0.9 为 4 分 小于 0.8 为 5 分 |

本基金根据“行业配置综合评分模型”，采用主观赋权和打分排序的方法对各行业进行投资价值评估，取排名在前 75% 的行业作为拟投资行业。

3) 行业配置比例及调整

本基金确定拟投资行业的配置比例方法如下：对于投资价值评估得分高的行业，给予“增持”的评级，即在该行业市场权重的基础上增加一定比例的投资；对于评分居中的行业，本基金给予“中性”的评级，即在资产配置时维持该行业的市场权重；对于投资价值评估得分低的若干行业，本基金给予“减持”的评级，即在该行业市场权重的基础上减少一定比例的投资。

本基金管理人每季度对全部行业的投资价值进行综合评分和排序，定期的调整各个行业的投资权重。

(2) 股票组合的构建与调整

1) 初级股票池

本基金首先从全部 A 股中进行初步筛选,剔除明显不具投资价值的股票,构建初级股票池,剔除股票的特征如下:暂停上市股票;经营状况异常或最近财务报告严重亏损且短期内扭亏无望的股票;价格发生异常波动的股票;其他经本基金管理人投研人员认定应该剔除的股票等。

2) 核心股票池

在初级股票池的基础上,本基金以“基本面研究引导投资”为理念,从“稳健增长”角度出发精选个股。基于此,本基金建立了金元顺安股票评级体系,该体系从五个角度深入研究上市公司基本面以确定股票投资组合:流动性、盈利质量、盈利增长潜力、公司治理以及估值水平。

流动性筛选

本基金以日均成交额和流通市值作为上市公司流动性筛选的指标。根据目前的市场条件,本基金管理人确定流动性筛选标准如下:

A、90 个交易日内日平均成交额不低于 1,000 万元;

B、流通市值不低于 3 亿元。

本基金将根据未来中国证券市场的发展规模、上市公司日均成交额和流通市值的变化情况,以及本基金资金规模,相应调整上述流动性筛选标准。

盈利质量分析

下表列明了本基金盈利质量分析的相关指标框架,该分析框架从盈利表现、盈利速度、盈利稳健度三个方面对通过流动性筛选的上市公司进行盈利质量分析,本基金管理人将采用主观赋权和打分排序的方法,得到相关股票的综合评分,选取排名处于前 1/2 的股票进行盈利增长潜力的深入分析。本基金管理人主要考察的未来 1—2 年各相关指标的发展变化。

| 指标类别 | 基本指标 |
|------|---------|
| 盈利表现 | 净利润率 |
| | 净资产收益率 |
| | 主营业务利润率 |
| 盈利速度 | 存货周转率 |
| | 应收账款周转率 |

盈利稳健

速动比率

流动比率

净负债率

盈利增长潜力分析

下表展示了本基金股票组合进行盈利增长潜力分析的指标框架。该框架主要从盈利增长率和盈利利润率变化 2 个方面对通过盈利质量筛选的股票进行盈利增长潜力分析。本基金管理人将采用主观赋权和打分排序的方法，得到相关股票的综合评分，选取排名处于前 1/2 的股票进行公司治理分析。本基金管理人主要考察的未来 1—2 年各相关指标的发展变化。

| 指标类别 | 基本指标 |
|-------|------------|
| 盈利增长率 | 每股收益增长率 |
| | 主营业务收入增长率 |
| 盈利利润率 | 净利润率的变化 |
| | 主营业务利润率的变化 |

公司治理

下表是本基金进行上市公司公司治理分析的指标框架，各指标均以五分制为基础，本基金管理人通过对各种指标的主观赋权和打分排序，对上市公司的公司治理结构做出评判，得出综合评分，选取排名处于前 1/2 的股票进行估值分析。

| 评估模块 | 评估指标 |
|----------|-------------|
| 企业的纪律性约束 | 财务的纪律性 |
| | 企业战略与行为的纪律性 |
| | 信息披露的透明度 |
| 对股东利益的关注 | 与股东沟通渠道的建立 |
| | 对股东利益的保护 |

| | |
|----------|-------------------|
| | 管理层在企业中的利益 |
| | 是否合理地执行既定的策略 |
| 企业策略执行评估 | 对既往策略执行成败的合理解释 |
| | 处理危机的能力 |
| | 对社会、客户、员工及环境问题的态度 |
| 企业的社会责任感 | 执行社会责任的信息可得性 |
| | 社会责任的执行历史 |
| | 最近三年的新产品和服务 |
| 持续创新能力 | 科研人员素质 |
| | 研发费用所占收入比例 |

估值水平

本基金管理人认为股票估值水平会很大程度影响其投资回报率，故本基金在上述分析的基础上，对相关股票进行估值分析，精选价值被低估的上市公司，构建最终的核心股票池。

本基金主要采用相对估值法进行估值分析，同时以绝对估值法作为参考。

相对估值法

本基金具体采用的方法包括市销率法和 PEG 法。对市销率，在通常情况下，该估值倍数若跌倒 1 倍以下，就可视为低估，3 倍以上则是高估。对 PEG，在通常情况下，该估值倍数若跌倒 1 倍以下，就可视为低估，1.5 倍以上则算高估，2 倍以上则是严重高估。本基金将针对不同企业的有关特性，通过历史比较和同业比较，灵活应用上述 2 个估值倍数。对于某些特殊行业（比如金融行业等），本基金将采用适合该行业的估值方法进行估值判断。

绝对估值法

本基金具体采用的方法包括折现现金流法及股息折现法等方法。

3) 优化股票池

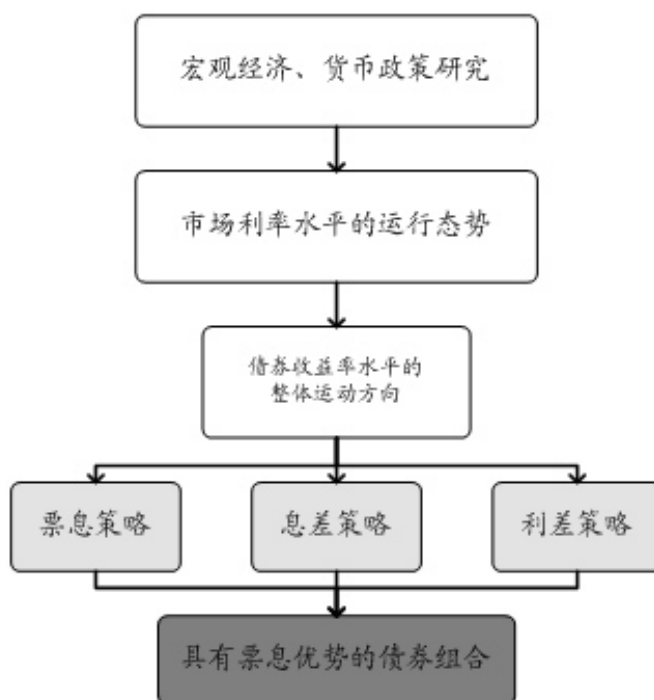
依据本基金股票筛选体系，本基金管理人的投研人员将对核心股票组合每月进行动态调整和监测，以保证进入最终优化股票池的质量。

3、债券投资策略

本基金债券投资策略主要包括债券投资组合策略、个券选择策略和债券组合的构建与调整三个方面。

（1）债券投资组合策略

本基金在综合分析宏观经济和货币政策的基础上，采用久期控制下的主动性投资策略，并本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。债券组合的具体投资实现方法如图表：



1) 票息策略

票息策略是指投资于较高票息的债券，通常来说，高票息债券一般为中长期期国债或信用等级低于国债的企业债券、次级债以及基金所允许投资的其它固定收益类产品。在利率水平及信用水平维持稳定的情况下，通过投资高票息债券，可以获取较高的利息收入，在提高债券组合的整体收益率水平的同时也获取较高的投资回报。

2) 息差策略

息差策略是指利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券的策

略。息差策略实际上就是杠杆放大策略。在进行放大策略操作时，必须考虑回购资金成本与债券收益率之间的关系。只有当债券收益率高于回购资金成本（即回购利率）时，息差策略才能取得正的收益。

3) 利差策略

利差策略是指对两个期限相近的债券的利差进行分析，从而对利差水平的未来走势做出判断，进而进行相应的债券置换。影响两个期限相近的债券的利差水平的因素主要有息票因素、流动性因素及信用评级因素等。当预期利差水平缩小时，可以买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两个债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，可以买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券，通过两个债券利差的扩大获得投资收益。利差策略实际上是某种形式上的债券互换，也是相对价值投资的一种常见策略。随着信用市场的发展，本基金将密切关注企业债以及其它固定收益类产品的信用状况的变化，从中分析信用利差的走势，积极进行信用利差投资策略。

(2) 个券选择

根据上述投资策略，本基金通过对个券相对于收益率曲线被低估（或高估）的程度分析，结合个券的信用等级、交易市场、流动性、息票率、税赋特点等，充分挖掘价值相对被低估的个券，以把握市场失效所带来的投资机会。

(3) 债券投资组合的构建与调整

1) 组合构建

通过上述投资策略，本基金初步完成债券组合的构建。在此过程中，本基金需要遵循以下原则：债券组合信用等级维持在投资级以上水平；将债券组合的流动性维持在适当的水平。

2) 组合调整

在投资过程中，本基金需要随时根据宏观经济、市场变化，以及基于流动性和风险管理的要求，对债券组合进行调整。

4、其他资产投资策略

(1) 权证投资策略

本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。本基金将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

(2) 资产支持证券

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

（3）现金头寸管理

为了尽可能避免基金操作过程中出现的现金过度和现金不足现象对基金运作的拖累，在现金头寸管理上，本基金通过对内生性与外生性未来现金流的预测进行现金预算管理，及时满足本基金运作中的流动性需求。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

中信标普 300 指数×50%+中信标普国债指数×50%

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为一只稳健增长型的混合型基金，其风险收益特征从长期平均及预期来看，低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场型基金，属于中等预期收益、中等预期风险的证券投资基金品种。本基金力争在股票、固定收益证券和现金等大类资产间的适度灵活配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2017 年 9 月 8 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 6 月 30 日。

1、期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 (元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 50,253,779.91 | 44.17 |
| | 其中：股票 | 50,253,779.91 | 44.17 |
| 2 | 固定收益投资 | 40,896,687.80 | 35.95 |
| | 其中：债券 | 40,896,687.80 | 35.95 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 21,879,607.87 | 19.23 |
| 7 | 其他资产 | 735,744.36 | 0.65 |
| 8 | 合计 | 113,765,819.94 | 100.00 |

2、期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 1,721,335.00 | 1.53 |
| C | 制造业 | 17,446,175.52 | 15.48 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 31,086,269.39 | 27.57 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 50,253,779.91 | 44.58 |

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量 (股) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------|---------------|---------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 223,057 | 11,065,857.77 | 9.82 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 438,646 | 10,488,025.86 | 9.30 |
| 3 | 600276 | 恒瑞医药 | 181,728 | 9,193,619.52 | 8.16 |
| 4 | 601939 | 建设银行 | 897,100 | 5,517,165.00 | 4.89 |
| 5 | 600521 | 华海药业 | 200,600 | 4,220,624.00 | 3.74 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 118,548 | 4,015,220.76 | 3.56 |
| 7 | 600056 | 中国医药 | 133,600 | 3,466,920.00 | 3.08 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 8 | 600547 | 山东黄金 | 59,500 | 1,721,335.00 | 1.53 |
| 9 | 000063 | 中兴通讯 | 23,800 | 565,012.00 | 0.50 |
| 10 | - | - | - | - | - |

4、期末按券种分类的债券投资组合

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

5、期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

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

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7、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。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证投资。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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持有股指期货合约。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（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。

（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。

（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。

11、投资组合报告附注

（1）本基金本期投资的前十名证券中出现发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

关于中国平安（代码：601318）的处罚说明

2017年2月22日中国证券监督管理委员会深圳监管局对敖翔涉嫌违法买卖股票案进行了调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据以及当事人依法享有的权利。

经查明，敖翔存在以下违法事实：

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

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

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

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

敖翔的上述行为违反了《证券法》第四十三条“证券交易所、证券公司和证券登记结算机构的从业人员、证券监督管理机构的工作人员以及法律、行政法规禁止参与股票交易的其他人员，在任期或者法定限期内，不得直接或者以化名、借他人名义持有、买卖股票，也不得收受他人赠送的股票”的规定，构成了《证券法》第一百九十九条所述违法行为。

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

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

并称融资融券账户都由其操作。综合本案情况，虽然不排除敖某生可能使用“徐某珍”账户进行了股票交易，但在案证据足以认定敖翔主要控制和利用“徐某珍”账户进行股票交易的违法事实。

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

当事人应自收到本处罚决定书之日起 15 日内，将罚款汇交中国证券监督管理委员会（开户银行：中信银行总行营业部，账号：7111010189800000162，由该行直接上缴国库），并将注有当事人名称的付款凭证复印件送中国证券监督管理委员会稽查局和深圳证监局备案。当事人如对本处罚决定不服，可在收到本处罚决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会申请行政复议，也可在收到本处罚决定书之日起 6 个月内直接向有管辖权的人民法院提起行政诉讼。复议和诉讼期间，上述决定不停止执行。

现作出说明如下：

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

B.基金经理遵循价值投资理念，看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。此次事件是公司下属子公司平安证券一名部门员工利用个人账户参与股票市场交易而违规，是该员工的个人行为。我们判断此次事件对公司无任何影响，公司生产经营活动一切正常，我们认为不会对整体的业绩造成影响。

(2) 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 期末其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 26,758.08 |
| 2 | 应收证券清算款 | 34,062.88 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 673,820.40 |
| 5 | 应收申购款 | 1,103.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|----|------------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 735,744.36 |

(4) 本报告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。

(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。

(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。

十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金业绩数据截至 2017 年 6 月 30 日。

1、本报告期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 |
|---------------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 2007-8-15 至 2007-12-31 | 6.36% | 0.60% | 1.51% | 0.00% | 4.85% | 0.60% |
| 2008-1-1 至 2008-12-31 | -3.07% | 0.39% | 3.95% | 0.00% | -7.02% | 0.39% |
| 2009-1-1 至 2009-12-31 | -3.34% | 0.39% | 3.97% | 0.00% | -7.31% | 0.39% |
| 2010-1-1 至 2010-8-16 | -1.21% | 0.08% | 2.80% | 0.00% | -4.01% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至 | 3.44% | 0.39% | 12.32% | 0.00% | -8.88% | 0.39% |

| | | | | | | |
|---------------------------------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 2010-8-16 | | | | | | |
| 2010-8-17 至 2010-9-30 | 0.51% | 0.16% | - | - | - | - |
| 2010-10-1 (基 金转型日) 至 2010-12-31 | 4.88% | 1.16% | 3.07% | 0.86% | 1.81% | 0.30% |
| 2011-1-1 至 2011-12-31 | -25.02% | 0.95% | -11.44% | 0.65% | -13.58% | 0.30% |
| 2012-1-1 至 2012-12-31 | 1.84% | 0.66% | 5.75% | 0.62% | -3.91% | 0.04% |
| 2013-1-1 至 2013-12-31 | 4.99% | 1.00% | -1.75% | 0.69% | 6.74% | 0.31% |
| 2014-1-1 至 2014-12-31 | 29.83% | 0.96% | 26.18% | 0.59% | 3.65% | 0.37% |
| 2015-1-1 至 2015-12-31 | 13.69% | 1.81% | 5.72% | 1.21% | 7.97% | 0.60% |
| 2016-1-1 至 2016-12-31 | -18.99% | 1.10% | -3.68% | 0.68% | -15.31% | 0.42% |
| 2017-1-1 至 2017-6-30 | 6.42% | 0.43% | 6.08% | 0.29% | 0.34% | 0.14% |
| 自基金转型日 至 2017-6-30 | 7.00% | 1.10% | 29.30% | 0.75% | -22.30% | 0.35% |

注:

(1) 自 2007 年 8 月 15 日 (基金合同生效之日) 至 2010 年 9 月 30 日

1) 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;

2) 业绩比较基准是基金发行阶段三年期凭证式国债 (2007 年第三期), 票面利率为 3.66%, 发行期间因加息调整票面利率为 4.11%, 折算复合年增长率为 3.95%, 业绩比较基准收益率的计算公式如下:
基金成立前最后发行的一期三年期凭证式国债的复合年化收益率/年度时长×报告期时长。

(2) 自 2010 年 10 月 1 日 (基金转型之日) 至 2015 年 11 月 26 日

- 1) 本基金自 2010 年 10 月 1 日转型为混合型证券投资基金;
- 2) 转型后的基金业绩比较基准为: 中信标普 300 指数×50%+中信标普国债指数×50%;

(3) 自 2015 年 11 月 27 日 (基金业绩基准变更) 至今

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

- 2、基金累计份额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:

(1) 自 2007 年 8 月 15 日 (基金合同生效之日) 至 2010 年 9 月 30 日



注:

- 1) 本基金合同生效日为 2007 年 8 月 15 日;

2) 本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 0%—40%; 债券为 0%—95%; 现金比例在 5% 以上; 本基金的建仓期系自 2007 年 8 月 15 日起至 2008 年 3 月 14 日, 在建仓期末及本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。

(2) 自 2010 年 10 月 1 日 (基金转型之日) 至今



注:

- 1) 本基金从 2010 年 10 月 1 日起正式转型为混合型证券投资基金;
- 2) 本基金在 2015 年 11 月 27 日变更了业绩比较基准, 业绩比较基准由“中信标普 300 指数×50%+ 中信国债指数×50%”变更为“标普中国 A 股 300 指数×50%+中证综合债指数×50%”;
- 3) 本基金投资组合中, 股票资产占基金资产的比例为 40%—60%, 债券资产占基金资产的比例为 35%—55%, 权证不超过基金资产净值的 3%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%; 本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。

十三、基金的费用概览

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费;
- 2、基金托管人的托管费;
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;
- 5、基金份额持有人大会费用;

- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

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首日起 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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

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首日起 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。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—8 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、“重要提示”部分对招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期进行了更新；
- 2、“基金管理人”部分对基金管理人概况和主要人员情况进行了更新；
- 3、“基金托管人”部分对基金托管人情况进行了更新；
- 4、“相关服务机构”部分对代销机构进行了更新；
- 5、“基金的投资”部分对基金投资组合报告和基金的业绩进行了更新；
- 6、“对基金份额持有人的服务”部分对电子版资料发送服务进行了更新；
- 7、“其它应披露事项”部分进行了更新；

金元顺安基金管理有限公司

二〇一七年九月二十八日