

**金元顺安核心动力混合型证券投资基金  
更新招募说明书  
(2018年1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

二〇一八年三月

## 重要提示

金元顺安核心动力混合型证券投资基金（原名：金元比联核心动力股票型证券投资基金）根据 2009 年 12 月 22 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准金元比联核心动力股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2009]1424 号）和 2010 年 1 月 5 日《关于金元比联核心动力股票型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2010]6 号）的核准进行募集。

本基金基金合同于 2010 年 2 月 11 日生效。

金元顺安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”、“管理人”或“本公司”）股东于经上海市工商行政管理局名称变更预核准，于 2015 年 3 月 6 日更名为金元顺安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”），并于 2015 年 3 月 12 日依据《证券投资基金管理公司管理办法》等相关法律法规的规定向中国证监会完成备案手续。

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》、等法律法规的规定，并经基金管理人和基金托管人协商一致，本基金于 2015 年 7 月 15 日由“金元惠理核心动力股票型证券投资基金”更名为“金元顺安核心动力混合型证券投资基金”，基金合同及托管协议同时做相应修订变更。

2017 年 12 月 4 日，本基金就相关实质性内容的调整经中国证监会变更注册，并于 2017 年 1 月 15 日，经基金份额持有人大会审议通过。

金元顺安基金管理有限公司保证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注册，但中国证监会对本基金募集的核准及相关事项调整的变更注册及备案，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，基金管理人并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，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险；个别证券特有的非系统性风险；由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资人申购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。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50% 的除外。

本招募说明书更新内容截止日为 2018 年 02 月 10 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 12 月 31 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（涉及行政许可的凭证经营）

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 3.4 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。

公司日常经营管理由总经理负责。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、资产管理部、金融同业部、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，2017 年 9 月至今，任金元证券股份有限公司调研员；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，学士学位，冷天晴先生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，曾于 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集团有限公司执行董事、深圳滇中商业保理有限公司执行董事。

栗旻先生，董事，硕士学位。栗旻先生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。

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。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；1992 年 5 月，出任吉林大学商学院院长、博士

生导师。

潘书鸿先生，独立董事，学士学位。潘书鸿先生曾于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。

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。

## 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。李春光先生于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，副总经理，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：

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。16年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：

吴广利先生：2010年2月至2011年8月。

晏斌先生：2013年1月至2015年5月

林材先生：2015年5月至2015年7月

#### 5、投资决策委员会成员的姓名和职务

张嘉宾先生，总经理，简历同上。

侯斌女士，基金经理，简历同上。

闵杭先生，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。24年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

李杰先生，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。11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、金元顺安桉盛债券型证券投资基金和金元顺安元启灵活配置混合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。20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。8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。6年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

周博洋先生，金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安优质精选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和金元顺安沅楹债券型证券投资基金的基金经理，兰卡斯特大学理学硕士。曾任上海新世纪资信评估投资服务有限公司助理分析师，上海证券有限责任公司项目经理。2014年8月加入金元顺安基金管理有限公司。6年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

苏利华先生，金元顺安金元宝货币市场基金的基金经理，上海交通大学应用统计学硕士。曾任内蒙古自治区农村信用社联合社债券交易员。2016年8月加入金元顺安基金管理有限公司。6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，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的



募集、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 15 年以上；
- 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他职责。

#### （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》、《基金法》及其他法律法规的行为，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）将基金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）不公平地对待公司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）法律法规以及中国证监会禁止的其他行为。

3、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，不从事以下活动：

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反法律法规、基金合同或托管协议；

- (3) 故意损害基金份额持有人或本基金合同其他当事人的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 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；
- (8) 违反证券交易所业务规则，扰乱市场秩序；
- (9) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (10) 其他法律、法规及中国证监会禁止的行为。

#### **(五) 基金经理承诺**

- 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、不得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、不得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理。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 年末，中国工商银行资产托管部共有员工 230 人，平均年龄 33 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 年末，中国工商银行共托管证券投资基金 815 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 54 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

电话：021-68882850

传真：021-68882865

联系人：孙筱君

客户服务专线：400-666-0666、021-68881898

公司网址：[www.jysa99.com](http://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](http://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、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

6、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

7、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

8、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](http://bank.ecitic.com)

9、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](http://www.bank.pingan.com)

10、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](http://www.jyzq.cn)

11、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](http://www.e5618.com)

12、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

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

### 13、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](http://www.ebscn.com)

### 14、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](http://www.swhysc.com)

### 15、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

#### 16、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

#### 17、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

#### 18、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

公司网址：www.gtja.com

19、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

20、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

21、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 或致电各地营业网点

公司网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

22、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

公司网站：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

23、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](http://www.hfzq.com.cn)

24、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](http://www.cindasc.com)

25、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

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

#### 26、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1号楼2001

法定代表人：杨宝林

联系人：孙秋月

联系电话：0532-85022026

客服电话：95548

公司网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

#### 27、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](http://www.txsec.com)

#### 28、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

29、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

30、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

公司网址：www.fund123.cn

31、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

### 32、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

### 33、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

公司网址：www.erichfund.com

### 34、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](http://www.fundhaiyin.com)

35、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](http://www.chtfund.com)

36、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](http://www.leadbank.com.cn)、[a.leadfund.com.cn](http://a.leadfund.com.cn)

37、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](http://www.qianjing.com)

38、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](http://www.1234567.com.cn)

#### 39、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](http://www.cs.ecitic.com)

#### 40、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](http://www.jrj.com.cn)

#### 41、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

#### 42、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/

#### 43、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号金外滩国际广场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

#### 44、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：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元

法定代表人：鲍东华

联系人：宁博宇



联系电话：021-20665952

客服电话：4008666618

公司网址：www.lu.com/

45、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/

46、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

47、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](http://www.dtfunds.com)

48、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](http://www.91fund.com.cn)

49、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](http://www.shengshiview.com)

50、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](http://www.citicsf.com)

51、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](http://www.haojiyoujijin.com)

#### 52、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

法定代表人：王廷富

联系人：孙骏

电话：021-51327185

传真：021-50710161

客户服务电话：400-821-0203

公司网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

#### 53、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

法定代表人：江卉

传真：010-89188000

客户服务电话：4000988511、4000888816

公司网址：[fund.jd.com](http://fund.jd.com)

#### 54、深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

法定代表人：赖任军

联系人：张焱

电话：15813808579

传真：0755-66892399

客户服务电话：400-9302-888

公司网址：www.jfz.com

55、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

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户服务电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

56、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

电话：027-87006003-8015

客户服务电话：400-027-9899

公司网址：www.buyfunds.cn

57、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

电话：0574-87050038

客户服务电话：96528

086-574-89068221（值班电话）、086-574-87050028（投资者关系）

公司网址：[www.nbc.com.cn](http://www.nbc.com.cn)

58、方正证券股份有限公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：高利

联系人：高洋

电话：010-59355546

传真：010-56437013

客户服务电话：95571

公司网址：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

59、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 室

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：010-56282140

传真：010-62680827

客户服务电话：400-619-9059

公司网址：[www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

60、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

法定代表人：丁东华

联系人：许艳

电话：010-59287105

传真：010-59287825

客户服务电话：400-111-0889

公司网址：[www.gomefund.com](http://www.gomefund.com)

61、天津万家财富资产管理有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室

办公地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室

法定代表人：李修辞

联系人：杨雪

电话：010-59013825

客户服务电话：010-59013825

公司网址：[www.wanjiawealth.com](http://www.wanjiawealth.com)

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

客户服务电话：400-6767-523

公司网址：[www.zzwealth.cn](http://www.zzwealth.cn)

63、北京植信基金销售公司

注册地址：北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址：北京市朝阳区惠和南路盛世龙源10号

法定代表人：于龙

联系人：吴鹏

电话：010-56075718

客户服务电话：4006-802-123

公司网址：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

64、上海大智慧股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元

法定代表人：申健

联系人：江恩前

电话：021-20219988

传真：021-20219988

客户服务电话：021-20219988

公司网址：[www.wg.com.cn](http://www.wg.com.cn)

65、一路财富（北京）信息科技股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室

办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室

法定代表人：吴雪秀

联系人：徐越

联系电话：010-88312877

客户服务电话：4006-802-123

公司网址：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

66、世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层

法定代表人：姜昧军

联系人：王雯

电话：0755-83199511

客户服务电话：400-832-3000

公司网址：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

67、北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路38号院1号泰康金融中心38层

法定代表人：张冠宇

联系人：刘美薇

电话：010-85870662

客户服务电话：400-819-9858

公司网址：[www.datangwealth.com](http://www.datangwealth.com)

#### 68、上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市昆明路518号北美广场A1002室

法定代表人：王翔

联系人：李鑫

电话：021-65370077

客户服务电话：021-65370077

公司网址：[www.fofund.com.cn](http://www.fofund.com.cn)

#### 69、奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

电话：0755-89460500

客户服务电话：400-684-0500

公司网址：[www.ifansteps.com.cn](http://www.ifansteps.com.cn)

#### 70、深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区福华路355号岗厦皇庭中心8楼DE（凯恩斯）

法定代表人：高锋



联系人：廖嘉琪

电话：0755-82880158

客户服务电话：400-804-8688

公司网址：[www.foreseakeynes.com](http://www.foreseakeynes.com)

71、济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼冠捷大厦3层307单元

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516 转 814

客户服务电话：010-65309516

公司网址：[www.jianfortune.com](http://www.jianfortune.com)

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

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

法定代表人：任开宇

电话：021-68881801

传真：021-68881875

### （四）律师事务所

名称：上海通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：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：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

#### （五）会计师事务所

名称：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

金元顺安核心动力混合型证券投资基金

#### 五、基金类型

混合型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

中国经济产业结构调整以及发展方式转变将带来新的挑战和发展契机，具备核心竞争力将成为投资主题。本基金主要投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司；力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的证券精选，在精细化风险管理的基础上构建优化组合，谋求基金资产长期持续稳定的合理回报。

#### 七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等）、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例：

股票资产占基金资产的60%—95%。债券资产、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%—40%，其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 八、基金的投资策略

本基金主要投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司；力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的证券精选，力争获取持续稳健的投资超额收益。在资产配置方面，本基金根据国内外宏观经济、政策环境、市场运行趋势等因素确定基金的大类资产配置比例；在债券投资方面，选择具有票息优势的债券品种作为主要的债券投资标的；最后，在综合考量投资组合的风险收益特征基础

上，本基金完成组合构建。

### 1、资产配置策略

本基金的资产配置策略分为两个层次：第一层为大类资产配置策略，以确定基金资产在股票、债券和现金之间的比例；第二层是单个证券（包括股票和债券）的选择；在该层次中，本基金以宏观经济预测和行业趋势分析辅助股票选择。

### 2、大类资产配置策略

本基金将遵循定量与定性分析相结合原则、及时性原则、动态调整原则三大原则，通过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进行大类资产配置。

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。

### 3、股票投资策略

在股票投资方面，本基金采取自下而上的方法，从成长和估值两个维度选择投资目标。

#### （1）成长性分析

##### 成长性分析的体系

本基金管理人认为，企业的未来成长潜力主要体现在成长的表现和成长的质量两个方面。成长的表现反映了企业未来成长是否可以估计，成长的质量则决定了企业未来成长是否可持续。为此，本基金管理人构建了如下表所示的“企业成长潜力分析体系”，以之为工具具体分析企业的未来成长状况。

基于基金实际运作的可操作性，本基金管理人分析企业的成长性主要考察企业在未来1—2年相关指标的发展变化。

##### 企业成长潜力分析体系

##### 指标类别    基本指标

成长表现指标    预期主营业务收入增长率

预期每股收益增长率

成长质量指标    预期主营业务利润率

预期净资产收益率

预期存货周转率

预期应收账款周转率

#### 成长性分析的具体实现方法

对企业未来成长潜力的分析，本基金管理人主要通过投资团队的实地调研，并结合各证券研究机构的研究成果与个人的分析判断，采取因素主观赋权和打分排序的方法，优选成长潜力良好的上市公司。

本基金管理人的投资团队进行实地调研的要点如下：

- 所处行业的发展空间和竞争态势；
- 主导产品市场供求变化趋势及其产能的扩张程度；
- 主导产品的差异性 or 替代性；
- 主导产品市场占有率变动趋势，重点考察企业的渠道建设情况；
- 企业的研究能力和新产品的推出能力；
- 成本控制能力，是否具有比较成本优势；
- 是否经历过市场不景气阶段的考验；
- 企业的管理能力与规模扩张是否匹配；
- 企业管理层是否稳定，重点考察企业业务发展骨干的稳定性。

#### 2) 估值考量的具体方法

对于成长型企业，本基金主要通过相对估值法进行估值判断，同时以绝对估值法作为估值参考。对于相对估值法，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，该估值倍数若跌到 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，该估值倍数若跌到 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。

对于绝对估值法，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) 个股确定方法

依据实地调研结果及企业成长潜力分析体系，本基金管理人将考察范围内的相关企业进行综合打分并由高到低进行排序，选取综合分值排在前 50 名的股票作为股票投资组合的拟投资标的。其次结合估值考量，选择被低估的股票，形成优化的股票组合。

#### 4) 股票组合的调整

本基金管理人将根据相关企业成长性和估值倍数的发展变化，定期调整股票投资组合。

### 4、债券投资策略

本基金在满足流动性及风险监控要求下，通过宏观经济方面自上而下的分析及债券市场方面自下而上的判断，把握市场利率水平的运行态势，根据债券市场收益率曲线的整体运动方向进行债券投资。

具体的投资策略主要有：

#### 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。

#### 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。

#### 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。

### 5、其他资产的投资策略

#### (1) 权证投资策略

本基金将通过研究权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型计算权证价值。本基金权证操作将根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性结合本基金的需要进行该产品的投资。主要考虑运用的策略包括：限量投资、趋势投资、优化组合策略、价差策略、双向权证策略等。

## （2）资产支持证券投资策略

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。

## 6、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

本基金股票投资部分的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准为中国债券总指数。本基金的整体业绩基准为：

沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

本基金选择上述业绩比较基准的理由如下：

沪深 300 指数由专业指数提供商“中证指数有限公司”编制和发布，由从上海和深圳证券交易所中选取的 300 只 A 股作为样本股编制而成。该指数以成份股的可自由流通股数进行加权，指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性和市场影响力。

中国债券总指数是中央国债登记结算有限责任公司编制的，采用市值加权计算的债券指数，其中涵盖了可流通的记账式国债和金融债，基本上可以反映中国债券市场的趋势特征。由于该债券指数较好地反映了我国债券市场价格总水平的波动幅度和变动趋势，涵盖的投资范围较宽，作为本基金固定收益证券投资的投资基准较为适当。

随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金，或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者出现更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 2 个工作日在至少一种指定媒体上予以公告。

## 十、风险收益特征

本基金系混合型基金，其风险收益特征从长期平均及预期来看，低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。

## 十一、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 2018 年 X 月 X 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 12 月 31 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	130,590,640.61	90.52
	其中：股票	130,590,640.61	90.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,649,052.27	9.46
8	其他资产	35,441.23	0.02
	合计	144,275,134.11	100.00



2、期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,172,812.78	1.51
C	制造业	59,455,168.02	41.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,271,113.83	1.58
E	建筑业	10,295,947.89	7.17
F	批发和零售业	68,184.92	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	1,694,447.93	1.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	741,898.16	0.52
J	金融业	40,889,972.00	28.49
K	房地产业	12,213,591.79	8.51
L	租赁和商务服务业	175,436.80	0.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	305,030.49	0.21
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	307,036.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	130,590,640.61	90.99

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

### 3、期末按市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	000333	美的集团	149,580	8,291,219.40	5.78
2	601318	中国平安	116,713	8,167,575.74	5.69
3	000651	格力电器	162,600	7,105,620.00	4.95
4	002713	东易日盛	284,600	6,742,174.00	4.70
5	000910	大亚圣象	285,600	6,540,240.00	4.56
6	000921	海信科龙	434,286	6,045,261.12	4.21
7	000666	经纬纺机	273,300	5,307,486.00	3.70
8	000036	华联控股	535,600	4,841,824.00	3.37
9	600048	保利地产	280,897	3,974,692.55	2.77
10	600519	贵州茅台	5,556	3,875,254.44	2.70

### 4、期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 6、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、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持有贵金属。

### 8、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

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 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投资股指期货。

##### （2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 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）本基金投资的前十名证券的发行主体本期有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

##### 关于格力电器（代码：000651）的处罚说明

A、2017年7月26日，珠海格力电器股份有限公司（以下简称“公司”或“格力电器”）收到中国证券监督管理委员会广东监管局（以下简称“广东证监局”）对公司董事徐自发先生下达的行政监管措施决定书《关于对徐自发采取出具警示函措施的决定》（[2017]39号，以下简称“《决定书》”），有关情况如下：

##### 一、《决定书》的主要内容

“徐自发，经查，你于2015年6月起至今任格力电器董事。2016年11月24日，你通过交易所集中竞价交易的方式买入格力电器股票575,300股，成交均价为26.39元/股，成交金额1,518.22万元。2017年5月22日，你再次通过交易所集中竞价交易的方式，卖出格力电器股票400,825股，成交均价为33.45元/股，成交金额1,340.76万元。你作为格力电器的董事，将持有的格力电器股票在买入后不足6个月卖出，违反了《证券法》第四十七条的规定，现对你采取出具警示函的监管措施。你应该认真吸取教训，加强证券法律法规学习，严格规范买卖上市公司股票行为，采取切实有效措施杜绝此类违规行为再次

发生。”

## 二、相关说明

徐自发先生于2017年5月22日通过深圳证券交易所集中竞价交易系统减持了本公司部分股份。减持过程中，因其委托某券商营业部客户经理对短线交易相关法律法规理解偏差，出现本次短线交易。公司已于2017年5月27日对相关情况进行了公告（公告编号：2017-020），徐自发先生因本次短线交易产生的收益2,829,824.5元已经收归公司所有。

B、2017年8月17日深圳证券交易所对珠海格力电器股份有限公司董事徐自发给予公开谴责处分，具体内容如下：

经查明，珠海格力电器股份有限公司（以下简称“格力电器”）董事徐自发存在以下违规事实：

### 一、敏感期交易

徐自发的配偶韩凤兰于2017年4月5日卖出格力电器股票730,800股，交易金额2,307.1万元，而公司2016年年报的预约披露时间为2017年4月27日，以上行为构成敏感期交易，徐自发未能督促其配偶遵守相关规定。

### 二、短线交易

2016年11月24日，徐自发委托券商营业部以26.39元/股的价格买入格力电器股票575,300股，成交金额1,518.22万元。2017年5月22日，徐自发再次委该营业部以33.45元/股的价格卖出格力电器股票400,825股，成交金额1,340.76万元。徐自发卖出股票的时间距离前次买入的时间间隔不足六个月，构成短线交易。徐自发的上述行为违反了本所《股票上市规则（2014年修订）》第1.4条、第3.1.8条和本所《主板上市公司规范运作指引（2015年修订）》第3.8.15条的规定。鉴于上述违规事实及情节，依据本所《股票上市规则（2014年修订）》第17.3条的规定，经本所纪律处分委员会审议通过，本所作出如下处分决定：对珠海格力电器股份有限公司董事徐自发给予公开谴责的处分。对于珠海格力电器股份有限公司董事徐自发上述违规行为及本所给予的处分，本所将记入上市公司诚信档案，并向社会公开。

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。公司是行业龙头白

马公司，估值便宜。该处罚主要是针对公司监事个人买卖公司股票持有时间不符合《证券法》规定导致的，是针对个人的警示，且已处理完毕，并不影响公司的经营和公司价值，因此继续持有该公司股票。

(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	31,039.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,767.31
5	应收申购款	1,634.58
6	其他应收款	-
7	其他	-
	合计	35,441.23

(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 12 月 31 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
2010-2-11 至 2010-12-31	-1.10%	1.20%	-6.89%	1.27%	5.79%	-0.07%
2011-1-1 至 2011-12-31	-25.08%	1.06%	-16.41%	1.01%	-8.67%	0.05%
2012-1-1 至 2012-12-31	-1.08%	0.98%	8.70%	0.97%	-9.78%	0.01%
2013-1-1 至 2013-12-31	-0.55%	1.23%	-11.25%	1.16%	10.70%	0.07%
2014-1-1 至 2014-12-31	53.77%	1.25%	48.01%	1.06%	5.76%	0.18%
2015-1-1 至 2015-12-31	5.80%	2.15%	0.87%	1.97%	4.93%	0.18%
2016-1-1 至 2016-12-31	-14.59%	1.15%	-6.10%	1.01%	-8.49%	0.14%
2017-1-1 至 2017-12-31	27.67%	0.58%	22.55%	0.55%	5.12%	0.03%
自基金合同生 效起至今	29.33%	1.27%	29.03%	1.19%	0.30%	0.08%

注：

(1) 本基金合同生效日为 2010 年 2 月 11 日，业绩基准累计增长率以 2010 年 2 月 10 日指数为基准；

(2) 股票资产占基金资产的 60%—95%，债券资产、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%，其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；

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

2、自基金合同生效以来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

金元顺安核心动力混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2010年02月11日-2017年12月31日)



注：

(1) 本基金合同生效日为 2010 年 2 月 11 日，业绩基准累计增长率以 2010 年 2 月 10 日指数为基准；

(2) 股票资产占基金资产的 60%—95%，债券资产、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%，其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；

### 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、律师费和诉讼费；
- 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 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.8\% / \text{当年天数}$$

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。

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的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、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、基金托管费率相关费率。

调整基金管理费率、基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前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的各纳税主体，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

### 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

二〇一八年三月二十七日