

# 金元顺安保本混合型证券投资基金 （原金元惠理保本混合型证券投资基金） 2015年第2季度报告

2015年6月30日

基金管理人：金元顺安基金管理有限公司

（原“金元惠理基金管理有限公司”）

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年七月十七日

## § 1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年7月15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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 金元顺安保本混合型证券投资基金

基金简称:	金元顺安保本混合
交易代码:	620007
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2015年6月2日
报告期末基金份额总额:	38,865,975.13
投资目标:	在为适用本基金保本条款的基金份额提供保本保证的基础上，力争在本基金保本周期结束时，为投资者带来稳定的当期收益与长期的资本增值。
投资策略:	本基金按照“优化恒定比例组合保险策略”对股票、债券和现金的投资比例进行动态调整，从而达到防御下跌、参与增值的目的。本基金的股票投资采取行业配置指导下的个股精选方法，即：首先进行行业投资

	价值评估，确定拟投资的优势行业；其次进行行业内个股的精选，从质地和估值两个维度精选优质股票构建股票组合。本基金的债券投资组合以相对低估的债券作为主要投资对象，并通过对债券的信用、久期和凸性等的灵活配置，进行相对积极主动的操作，力争获取良好收益。	
业绩比较基准：	三年期银行定期存款税后收益率。	
风险收益特征：	本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，在极端情况下仍然存在本金损失的风险。	
基金管理人：	金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”）	
基金托管人：	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金元顺安保本混合A类	金元顺安保本混合C类
下属分级基金的交易代码	620007	001375
报告期末下属分级基金的份额总额	38,865,975.13份	-

## 2.2 原金元惠理保本混合型证券投资基金

基金简称：	金元惠理保本混合
交易代码：	620007
基金运作方式：	契约型开放式
基金合同生效日：	2011年8月16日
报告期末基金份额总额：	38,639,675.65
投资目标：	在为适用本基金保本条款的基金份额提供保本保证的基础上，力争在本基金保本周期结束时，为投资者带来稳定的当期收益与长期的资本增值。
投资策略：	本基金按照“优化恒定比例组合保险策略”对股票、债券和现金的投资比例进行动态调整，从而达到防御下跌、参与增值的目的。本基金的股票投资采取行业配置指导下的个股精选方法，即：首先进行行业投资

	价值评估，确定拟投资的优势行业；其次进行行业内个股的精选，从质地和估值两个维度精选优质股票构建股票组合。本基金的债券投资组合以相对低估的债券作为主要投资对象，并通过对债券的信用、久期和凸性等的灵活配置，进行相对积极主动的操作，力争获取良好收益。
业绩比较基准：	三年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征：	本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，在极端情况下仍然存在本金损失的风险。
基金管理人：	金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”）
基金托管人：	中国农业银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

项目	2015年第2季度报告	
	基金份额分类前（2015年4月01日-2015年6月1日）	基金份额分类后（2015年6月2日-2015年6月30日）
1. 本期已实现收益	189,785.14	180,176.37
2. 本期利润	621,916.27	-20,392.68
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0153	-0.0005
4. 期末基金资产净值	40,307,528.61	40,523,915.85
5. 期末基金份额净值	1.043	1.043

注：(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)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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 金元顺安保本混合型证券投资基金

3.2.1.1 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	净值增长率①	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
基金份额分类后至本报告期末	0.00%	0.08%	0.26%	0.01%	-0.26%	0.07%

注：（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；

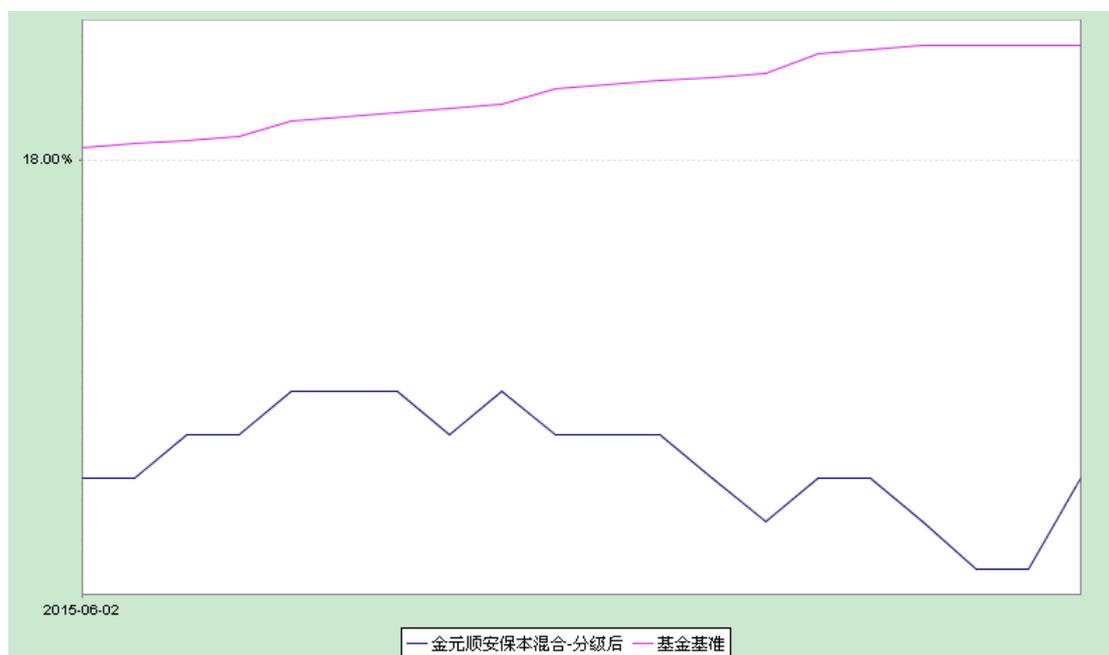
（2）业绩比较基准是三年期定期存款税后收益率。

### 3.2.1.2 自基金份额分类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

金元顺安保本混合型证券投资基金

基金份额分类后累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015年6月2日至2015年6月30日）



注：（1）本基金合同生效日为2011年8月16日；

（2）本基金建仓期为2011年8月16日至2012年2月15日，在建仓期和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；

（3）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、货币市场工具为60%-100%；其中，现金比例在5%以上，在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。

(4) 本基金自2015年6月2日起，新增C类份额。

### 3.2.2 金元顺安保本混合型证券投资基金

#### 3.2.2.1 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	净值增长率①	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
上报告期末至基金份额分类前	1.46%	0.06%	0.62%	0.01%	0.84%	0.05%

注：(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) 业绩比较基准是三年期定期存款税后收益率。

#### 3.2.2.2 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

金元惠理保本混合型证券投资基金

基金份额分类前前累计净值增长率历史走势图

(2011年8月16日至2015年6月1日)



注：（1）本基金合同生效日为 2011 年 8 月 16 日；

（2）本基金建仓期为 2011 年 8 月 16 日至 2012 年 2 月 15 日，在建仓期和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；

（3）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、货币市场工具为 60%-100%；其中，现金比例在 5%以上，在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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2012-7-19	-	8	金元惠理丰利债券型证券投资基金、金元惠理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和金元惠理金元宝货币市场基金基金经理，上海交通大学理学硕士。曾任国联安基金管理有限公司数量策略分析员、固定收益高级研究员。2012 年 4 月加入金元惠理基金管理有限公司。8 年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》等有关法律法规及其各项实施准则、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 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、股票备选库管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等，重视交易执行环节的公平交易措施，启用投资交易系统内的公平交易模块，以确保公平对待各投资组合。在报告期内，本管理人对不同投资组合的交易价差、收益率进行分析，公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《异常交易监控与报告制度》。本报告期，根据制度的规定，对交易进行了监控，未发现异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015 二三季度，我国经济增长出现弱势企稳迹象。固定资产投资同比增速下降到 11.4%，其中房地产投资增速下滑到 5.1%，基础设施建设投资仍然在 18.66% 高位，维稳的重要力量，而制造业投资增速下滑趋缓；社会消费品零售总额增速小幅回落到 10.37%；国际经济形势依然复杂，出口增幅徘徊在低位。工业增加值同比增速从三月份的低点 5.6% 反弹至 6.1%，下降动能减弱；CPI 稳定在 1.4% 底部区域，PPI 同比-4.6%，仍然较弱。

央行继续执行稳健货币政策，优化流动性和信贷结构，二季度先后两次降低存贷快利率，并有一次降准，同时取消银行贷存比考核指标，进一步推进利率市场化。货币金融条件继续宽松，shibor3M 利率从一季度的 4.9% 左右下降到 3.1% 上下；M2 增速从底部反弹至 10.8%，新增贷款规模也有所增加。另一方面，财

政政策继续积极，政府加大稳增长的力度，先后推出两批次共计2万亿地方政府债务置换额度，缓解债务风险，并降低实体经济融资成本。同时，鼓励专项债发行，放开二套房贷款政策，通过存款保险条例，以防止系统性风险。

季度末因场外配资类产品去杠杆导致股市出现大幅下跌，股市收回前期涨幅。上证综指单季度上涨14.12%；；中标可转债指数下跌10.16%；中证全债指数上涨2.21%。

在报告期，本基金保持债券仓位适中，并增加了操作的灵活性，波段操作为主。股票仓位保持谨慎，仓位很低，规避了暴跌风险。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

净值增长率为1.46%，同期业绩比较基准增长率为0.88%。本基金超越基准0.58%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7月初A股出现大幅度剧烈调整。我们认为除了去杠杆这个因素之外，根本的原因是前期股市上涨过而偏离了基本面价值。只涨不跌的股市隐藏了巨大风险，不但调整概率大增，同时也堆积了大量资金，推高了风险偏好，使得债券收益率居高不下，实体经济融资成本难以降低。展望三季度，我们认为股市调整将引导债市收益率下行，切实降低金融体系和实体经济的风险，有利于经济进一步复苏。国际方面，美国经济复苏趋势还不够稳定；日本、欧洲和新兴市场经济依然疲软，希腊债务危机正在发酵。国内新的经济增长点正在形成，但内生动力依然不足。我们预期政府会加大稳增长的力度，继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，资金面维持宽松，货币市场利率保持在低位。

我们认为债券市场的牛市基础仍然存在；但是随着积极财政政策力度的加大，债券供给压力会增加，债券市场会延续震荡的格局。本基金将根据CPPI模型的要求适当控制组合仓位，严格控制久期，同时重点防范信用风险。股票市场方面，经过调整后的股票价值将逐渐显现，我们将继续重视价值发现，以流动性好、估值低的大盘蓝筹为主要投资方向，并保持适当仓位运作。

#### 4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

在本报告期内，该基金曾出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元

情形：

截止到2015年06月30日，该基金连续七十六个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 金元顺安保本混合型证券投资基金投资组合报告

（报告期：2015年6月2日-2015年6月30日）

#### 5.1.1 报告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	465,848.00	1.13
	其中：股票	465,848.00	1.13
2	固定收益投资	37,062,750.00	89.60
	其中：债券	37,062,750.00	89.60
	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	2,825,717.64	6.83
7	其他资产	1,012,647.11	2.45
8	合计	41,366,962.75	100.00

#### 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	-	-
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	465,848.00	1.15
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	465,848.00	1.15

### 5.1.3 报告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投资

#### 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	601998	中信银行	12,700	97,917.00	0.24
2	601336	新华保险	1,600	97,696.00	0.24
3	600000	浦发银行	5,500	93,280.00	0.23
4	601166	兴业银行	5,400	93,150.00	0.23
5	000776	广发证券	3,700	83,805.00	0.21
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

### 5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值
---	------	---------	---------

号			比例（%）
1	国家债券	16,688,750.00	41.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,131,000.00	25.00
	其中：政策性金融债	10,131,000.00	25.00
4	企业债券	10,243,000.00	25.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	37,062,750.00	91.46

#### 5.1.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	070215	07 国开 15	100,000	10,131,000.00	25.00
2	020077	15 贴债 03	60,000	5,941,800.00	14.66
3	019321	13 国债 21	55,000	5,531,350.00	13.65
4	010303	03 国债(3)	52,000	5,215,600.00	12.87
5	0980173	09 嘉善债	50,000	5,200,500.00	12.83

#### 5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

#### 5.1.7 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。

#### 5.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.1.9.1 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。

#### 5.1.9.2 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。

#### 5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.1.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.1.10.2 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持有国债期货。

##### 5.1.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.1.11 投资组合报告附注

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

##### 1. 关于中信银行（代码：601998）的处罚说明

2015年2月15日中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)、中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)作为债务融资工具“13 浙建投MTN001”主承销商，在获知发行人浙江省建设投资集团有限公司整合下属子公司少数股东权益事项后未及时组织召开持有人会议，违反了《银行间债券市场非金融企业债务融资工具持有人会议规程》的规定。依据相关自律规定，经自律处分会议审定，给予工商银行、中信银行勉谈话处分，并处责令改正。

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，对准备重点投资的证券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。该事件不影响公司的长期投资价值，因此买入并持有该公司股权。

## 2. 关于广发证券（000776）的处罚说明如下：

为保护投资者合法权益，促进融资类业务规范发展，按照2014年工作部署，中国证监会组织系统力量于2014年12月15日至28日期间，对45家证券公司的融资类业务进行了为期2周的现场检查。

从检查结果看，目前，证券公司融资融券等融资类业务总体运行平稳，风险相对可控，未发现重大违法违规行为。但检查发现，部分公司存在违规为到期融资融券合约展期、向不符合条件的客户融资融券、未按规定及时处分客户担保物、违规为客户与客户之间融资提供便利等问题。此外，个别证券公司还存在整改不到位、受过处理仍未改正甚至出现新的违规等问题。

为严法纪，强监管，进一步规范证券公司融资融券等业务的开展，中国证监会依法对相关公司进行处理，并责成公司内部追责。其中，中信证券、海通证券和国泰君安3家公司存在违规为到期融资融券合约展期问题，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多，对这3家公司采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。招商证券存在向不符合条件的客户融资融券问题，并且受过处理仍未改正，广发证券存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题，且涉及客户数量较多，对这2家公司采取责令限期改正的行政监管措施。

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，对准备重点投资的证券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。从处罚情况看，广发证券总体运行平稳，该事件不影响公司的长期投资价值，因此买入并持有该公司股权。

5.1.11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,145.34
2	应收证券清算款	
3	应收股利	-
4	应收利息	901,704.20
5	应收申购款	109,797.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,012,647.11

5.1.11.4 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。

5.1.11.5 报告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。

5.1.11.6 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。

## 5.2 原金元惠理保本混合型证券投资基金投资组合报告

（报告期：2015年4月01日-2015年6月1日）

### 5.2.1 报告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	-	-

	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	39,644,478.00	97.05
	其中：债券	39,644,478.00	97.05
	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	179,228.05	0.44
7	其他资产	1,024,760.22	2.51
8	合计	40,848,466.27	100.00

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.2.3 报告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投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.2.4 报告期末按债券品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	9,123,978.00	22.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,160,000.00	25.21
	其中：政策性金融债	10,160,000.00	25.21
4	企业债券	10,251,500.00	25.43
5	企业短期融资券	10,109,000.00	25.08
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	39,644,478.00	98.36

### 5.2.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券品种	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	070215	07 国开 15	100,000	10,160,000.00	25.21
2	041462043	14 大北农 CP001	100,000	10,109,000.00	25.08
3	0980173	09 嘉善债	50,000	5,202,000.00	12.91
4	123002	09 东华债	50,000	5,049,500.00	12.53
5	019321	13 国债 21	48,000	4,848,000.00	12.03

### 5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.2.7 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。

### 5.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.2.9.1 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。

#### 5.2.9.2 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。

### 5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.2.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.2.10.2 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持有国债期货。

#### 5.2.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.2.11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,382.48
2	应收证券清算款	
3	应收股利	-
4	应收利息	1,023,377.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,024,760.22

5.2.11.4 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。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部门

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。

## § 6 基金管理人运用固有资金投资原封闭式基金情况

单位：份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	9,789,874.55
报告期初至基金份额分类前买入总份额	-
报告期初至基金份额分类前卖出总份额	-
基金份额分类前最后一日管理人持有的封闭式基金份额	9,789,874.55

基金份额分类前最后一日持有的封闭式基金份额占基金总份额比例（%）	25.19
----------------------------------	-------

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

合同生效日基金份额总额	42,060,407.93
合同生效日至报告期末基金总申购份额	2,800,581.92
减：合同生效日至报告期末基金总赎回份额	5,995,014.72
合同生效日至报告期末拆分份额	-
报告期期末基金份额总额	38,865,975.13

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

1、2015年4月2日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jyvpfund.com上公布金元惠理保本混合型证券投资基金更新招募说明书[2015年1号]；

2、2015年4月21日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jyvpfund.com上公布金元惠理保本混合型证券投资基金2015年第1季度报告；

3、2015年6月2日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jyvpfund.com上公布金元顺安基金管理有限公司关于修改金元惠理保本混合型证券投资基金名称、份额分类及相关事项的公告；

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《金元顺安保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《金元顺安保本混合型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《金元顺安保本混合型证券投资基金托管协议》。

## 9.2 存放地点

上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 36 层 3608 室

## 9.3 查阅方式

<http://www.jyvpfund.com>

金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”）

二〇一五年七月十七日