

# 金元惠理丰利债券型证券投资基金

## 2015 年半年度报告摘要

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：二〇一五年八月二十九日

## 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金元惠理丰利债券型证券投资基金
基金简称	金元惠理丰利债券
基金主代码	620003
交易代码	620003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月23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
报告期末基金份额总额	32,780,498.63份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在注重资产安全性和流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的稳健收益和总回报。
投资策略	基于“自上而下”的原则，本基金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。经过对历史数据的统计分析发现，债券市场收益率受到宏观经济形势和债券市场供需两方面不同程度的影响，因此本基金在债券投资过程中，将采用若干定量模型来对宏观和市场两方面数据进行分析，并运用适当的策略来构建债券组合。
业绩比较基准	中信标普全债指数
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其风险收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	金元顺安基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司

		(原“金元惠理基金管理有 限公司”)	
信息披露负责人	姓名	凌有法	林葛
	联系电话	021-68881801	010-66060069
	电子邮箱	service@jyvpfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-666-0666	95599
传真		021-68881875	010-68121816
注册地址		上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		任开宇	刘士余

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	金元顺安基金管理有限公司(原“金 元惠理基金管理有限公司”)	上海市浦东新区花园石桥路33号花 旗集团大厦 3608 室

## 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)
本期已实现收益	2,332,468.31
本期利润	1,774,870.74
加权平均基金份额本期利润	0.0452
本期加权平均净值利润率	3.98%
本期基金份额净值增长率	3.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	5,124,808.13

期末可供分配基金份额利润	0.1563
期末基金资产净值	37,905,306.76
期末基金份额净值	1.156
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2015年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	18.09%

注：1：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2：期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3：表中的“期末”均指报告期最后一日，即6月30日。

4：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.09%	0.07%	0.22%	0.04%	-0.31%	0.03%
过去三个月	1.85%	0.10%	1.20%	0.04%	0.65%	0.06%
过去六个月	3.86%	0.10%	1.82%	0.08%	2.04%	0.02%
过去一年	14.68%	0.31%	7.26%	0.16%	7.42%	0.15%
过去三年	24.43%	0.29%	14.65%	0.10%	9.78%	0.19%
过去五年	19.83%	0.30%	21.30%	0.09%	-1.47%	0.21%
自基金成立起至今	18.09%	0.29%	25.13%	0.08%	-7.04%	0.21%

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；

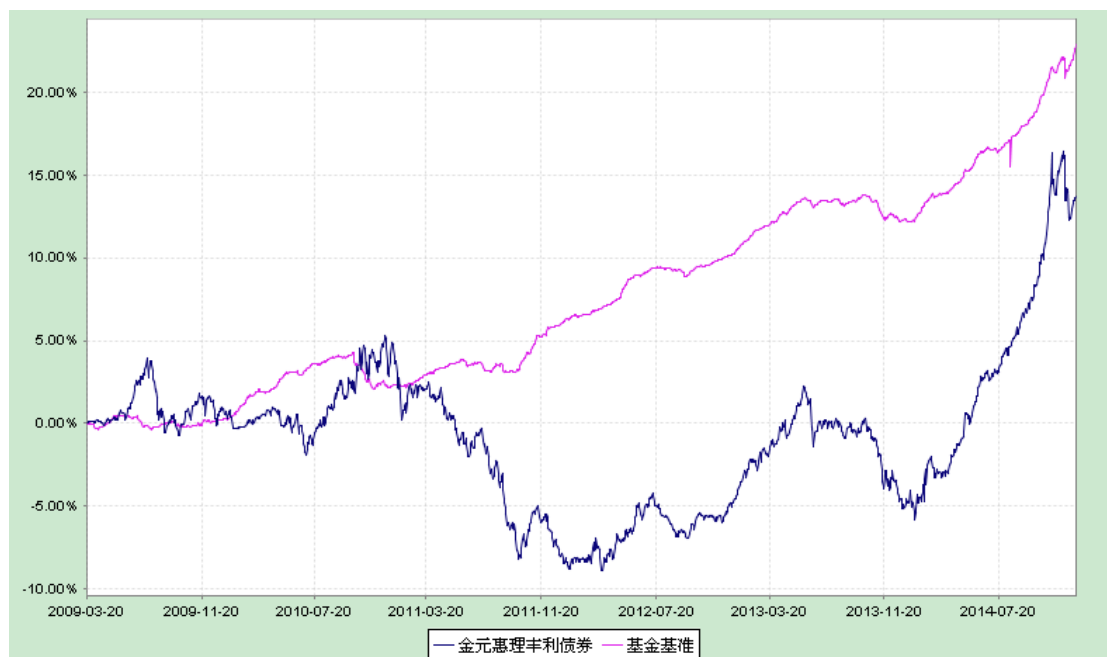
（2）本基金选择中信标普全债指数作为基金业绩基准。

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

金元惠理丰利债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2009年3月23日至2015年6月30日）



注：（1）本基金合同生效日为 2009 年 3 月 23 日；

（2）本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的 80%，其中对可转换债券（含分离交易可转债）的投资比例不高于基金资产的 40%，对固定收益类以外的其他资产（包括股票、权证等）的投资比例不高于基金资产的 20%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。报告期末各项资产配置符合基金合同的约定。

## 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金元顺安基金管理有限公司（原名为“金元比联基金管理有限公司”）成立于 2006 年 11 月，由金元证券有限公司（以下简称“金元证券”）与比利时联合资产管理公司（以下简称“KBC”）共同发起设立的中外合资基金管理公司。公司注册地为上海，注册资本 1.5 亿人民币，其中金元证券持有 51% 的股份，KBC 持有 49% 的股份。2012 年 3 月，经中国证监会核准，KBC 将所持有的 49% 股权转让惠理基金管理香港有限公司（以下简称“惠理香港”），公司更名为金元惠理基金管理有限公司，成为国内首家港资入股的合资基金公司，股权结构变更为：金元证券持有 51% 股权，惠理香港持有 49% 股权。2012 年 10 月，经中国证监会核准，公司双方股东按持股比例向公司增资人民币 9,500 万元，公司注册资本金增至 2.45 亿元。2015 年 3 月，经上海市工商行政管理局名称变更预核准，公司更名为金元顺安基金管理有限公司，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。

截至 2015 年 6 月 30 日, 本基金管理人管理金元惠理宝石动力混合型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、金元惠理价值增长股票型证券投资基金、金元惠理核心动力股票型证券投资基金、金元惠理消费主题股票型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、金元惠理丰祥债券型证券投资基金和金元惠理金元宝货币市场基金共十只开放式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
李杰	本基金基金经理	2012-06-14	-	8	金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金和金元顺安金元宝货币市场基金基金经理，上海交通大学理学硕士。曾任国联安基金管理有限公司数量策略分析员、固定收益高级研究员。2012 年 4 月加入金元顺安基金管理有限公司。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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期,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》和《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》,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,启用投资交易系统中的公平交易模块。在报告期内,对不同投资组合的交易价差、收益率进行分析,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,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《金元顺安基金管理有限公司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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年,我国经济增长出现弱势企稳迹象,主要指标有所回升。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 4.6%,基础设施建设投资仍然在 19.19% 高位,是维稳的重要力量,而制造业投资增速 9.7% 下滑趋缓;社会消费品零售总额增速小幅回落到 10.41%,趋于缓和;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在 6.3% 的水平上趋于稳定,下降动能减弱;CPI 稳定在 1.4% 底部区域,PPI 同比-4.8%,仍然较弱。

央行继续执行稳健货币政策,提高流动性并优化信贷结构。上半年先后实施三次降息和两次降低存款准备金操作,保持每月一次频率,同时取消银行贷存比考核指标,进一步推进



利率市场化。并通过公开市场逆回购和定向工具投放基础货币，降低货币市场利率；另一方面，继续实施积极财政政策，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，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。货币金融条件继续宽松，shibor3M 利率从上年末的 5.1% 下降到 3.1% 上下；M2 增速从底部反弹至 11.8%，新增贷款规模也有所增加。

上半年资本市场大幅振荡，股市先涨后跌，债市振荡上涨。上证综指半年上涨 32.23%。；中标可转债指数下跌 10.41%；中证全债指数上涨 3.17%。

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，以波段操作为主；股票投资方面保持谨慎，低仓位运作，规避暴跌风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金净值增长率为 3.86%，同期业绩比较基准增长率为 1.82%。本基金超越基准 2.04%。

#### 4.5 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。展望下半年，我们认为股市调整将降低投资者风险偏好，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，大宗商品价格承压。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，下半年债券市场波动会增加。本基金将继续保持灵活的投资风格，并以精研挖掘个券为盈利的主要来源，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、估值低的绩优股为主要投资方向，并保持适当仓位运作。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.6.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

###### 4.6.1.1 估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由主管运营的副总经理、基金事务部、投资部、交易部、监察稽核部部门总监组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 对异常情况做出决策。

主管运营的副总经理是估值工作小组的组长，主管运营的副总经理在基金事务部总监或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

###### 4.6.1.2 基金事务部的职责分工

基金事务部负责日常证券资产估值。该部门和公司投资部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金事务部定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金事务部职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金事务部总监认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

#### 4.6.1.3 投资部的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
- ③ 评价并确认基金事务部提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

#### 4.6.1.4 交易部的职责分工

- ① 对基金事务部的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 通知基金事务部关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- ③ 评价并确认基金事务部提供的估值报告。

#### 4.6.1.5 监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价值的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

#### 4.6.2 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 基金持有人数或资产净值预警情形的说明

在本报告期内，该基金曾三次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 01 月 20 日，该基金连续二十七个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形；  
截止到 2015 年 04 月 22 日，该基金连续五十三个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形；  
截止到 2015 年 06 月 30 日，该基金连续三十九个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

### 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—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”）2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，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”）在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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”）的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部

## 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：金元惠理丰利债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	383,763.24	46,468.90
结算备付金		348,964.90	2,381,550.32
存出保证金		8,123.54	13,947.90
交易性金融资产	6.4.7.2	44,838,769.30	44,917,717.10
其中：股票投资	6.4.7.2	157,059.00	75,245.00
基金投资	6.4.7.2	-	-
债券投资	6.4.7.2	44,681,710.30	44,842,472.10
资产支持证券投资	6.4.7.2	-	-
贵金属投资	6.4.7.2	-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		44,180.16	131,608.34
应收利息	6.4.7.5	1,308,342.32	1,046,146.54
应收股利		-	-
应收申购款		93,264.70	300.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		47,025,408.16	48,537,739.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		8,100,000.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		164,565.29	428,900.45
应付管理人报酬		22,295.12	30,210.21

应付托管费		6,370.02	8,631.49
应付销售服务费		12,740.06	17,262.97
应付交易费用	6.4.7.6	7,580.95	25,099.91
应交税费		704,225.84	704,225.84
应付利息		639.00	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	101,685.12	60,401.87
负债合计		9,120,101.40	1,274,732.74
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.8	32,780,498.63	42,447,704.79
未分配利润	6.4.7.9	5,124,808.13	4,815,301.57
所有者权益合计		37,905,306.76	47,263,006.36
负债和所有者权益总计		47,025,408.16	48,537,739.10

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.156 元，基金份额总额 32,780,498.63 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金元惠理丰利债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>2,350,397.57</b>	<b>5,721,913.50</b>
1.利息收入		1,476,753.03	2,365,304.25
其中：存款利息收入	6.4.7.10	9,495.54	11,095.90
债券利息收入		1,460,730.25	2,335,461.26
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,527.24	18,747.09
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,411,678.46	-897,583.05
其中：股票投资收益	6.4.7.11	65,185.50	133,913.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	1,346,255.46	-1,104,968.59
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	237.50	73,471.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-557,597.57	4,253,382.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	19,563.65	809.72
<b>减：二、费用</b>		<b>575,526.83</b>	<b>1,239,856.14</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	154,999.84	191,051.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	44,285.68	54,585.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	88,571.32	109,172.03
4. 交易费用	6.4.7.17	493.80	8,224.46
5. 利息支出		171,282.54	747,668.69
其中：卖出回购金融资产支出		171,282.54	747,668.69
6. 其他费用	6.4.7.18	115,893.65	129,153.93
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,774,870.74</b>	<b>4,482,057.36</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,774,870.74</b>	<b>4,482,057.36</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元惠理丰利债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	42,447,704.79	4,815,301.57	47,263,006.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,774,870.74	1,774,870.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-9,667,206.16	-1,465,364.18	-11,132,570.34
其中：1. 基金申购款	23,660,052.21	3,153,168.88	26,813,221.09
2. 基金赎回款	-33,327,258.37	-4,618,533.06	-37,945,791.43
四、本期向基金份额持有	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	32,780,498.63	5,124,808.13	37,905,306.76
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	59,874,969.57	-4,221,896.27	55,653,073.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,482,057.36	4,482,057.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-5,533,531.75	189,083.12	-5,344,448.63
其中：1. 基金申购款	1,636,006.70	-37,602.88	1,598,403.82
2. 基金赎回款	-7,169,538.45	226,686.00	-6,942,852.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	54,341,437.82	449,244.21	54,790,682.03

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张嘉宾，主管会计工作负责人：邝晓星，会计机构负责人：季泽

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

金元惠理丰利债券型证券投资基金（原名为金元比联丰利债券型证券投资基金，以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]101 号文《关于同意金元比联丰利债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人金元比联基金管理有限公司（系金元惠理基金管理有限公司的前身）向社会公开发行募集，基金合同于 2009 年 3 月 23 日正式生效，首次设立募集规模为 1,474,806,481.51 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构为金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”），基金托管人为中国农业银



行股份有限公司。

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，并由中国证监会证监许可[2012]276号文核准，金元比联基金管理有限公司已于2013年3月15日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”。随后，报请中国证监会同意，将金元比联丰利债券型证券投资基金更名为金元惠理丰利债券型证券投资基金，并于2012年5月2日公告。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法公开发行、上市的国债、央行票据、金融债、信用等级为BBB+及以上的企业(公司)债、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券和债券回购等，以及股票等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。基于“自上而下”的原则，本基金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。本基金的业绩比较基准为：中信标普全债指数。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金半年度会计报表所采用的会计政策与上年度会计报表相一致，会计估计发生变更。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据基金业协会中基协发(2014)24 号关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的通知（以下简称“本通知”）的要求，固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

## 6.4.6 税项

### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”）	基金管理人、基金发起人/注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
惠理基金管理香港有限公司	基金管理人的股东
上海金元百利资产管理有限公司（原：上海金元惠理资产管理有限公司）	基金管理人的子公司

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日

	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
金元证券股份有限公司	-	-	1,993,771.91	41.40%

**6.4.8.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行权证交易。

**6.4.8.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
金元证券股份有限公司	69,973,120.17	75.43%	51,887,161.82	75.65%

**6.4.8.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
金元证券股份有限公司	3,200,000.00	0.58%	419,500,000.00	38.25%

**6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
金元证券股份有限公司	-	-	1,815.10	23.94%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
金元证券股份有限公司	1,815.10	41.40%	1,815.10	21.08%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）

经手续费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	154,999.84	191,051.10
其中：支付销售机构的客户 维护费	17,033.59	27,294.02

注：a. 基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。

计算方法如下：

$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$ ，

H 为每日应支付的基金管理费，

E 为前一日的基金资产净值，基金管理费每日计提，按月支付。

由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，支付日期顺延。

b. 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	44,285.68	54,585.93

注：a. 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。

计算方法如下

$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$ ，H 为每日应支付的基金托管费，

E 为前一日的基金资产净值，基金托管费每日计提，按月支付。

由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

##### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
----------------	----------------------------

	当期发生的基金应支付的销售服务费
金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”）	632.46
农业银行股份有限公司	35,266.60
金元证券股份有限公司	45,584.38
合计	81,483.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
金元惠理基金管理有限公司	2,613.49
农业银行股份有限公司	55,277.64
金元证券股份有限公司	39,053.19
合计	96,944.32

注：a.基金的销售服务费按前一日的基金资产净值的 0.4%的年费率计提。

本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

计算方法如下： $H=E \times 0.4\% / \text{当年天数}$ ，

H 为本基金份额每日应计提的销售服务费，

E 为本基金份额前一日基金资产净值。

b.基金销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
期初持有的基金份额	-	20,000,400.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	20,000,400.00
期末持有的基金份额占基金 总份额比例	-	61.01%

注：基金管理人于本基金募集期间认购本基金份额时所适用的费率与本基金公告的费率一致。

#### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	383,763.24	3,705.97	350,577.03	3,323.96

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015年1月1日至2015年6月30日止期间获得的利息收入为人民币5,687.20元，2015年6月30日止结算备付金余额为人民币348,964.90元。2014年1月1日至2014年6月30日止期间获得的利息收入为人民币7,651.52元，2014年6月30日止结算备付金余额为人民币1,314,051.20元

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。**6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	157,059.00	0.33
	其中：股票	157,059.00	0.33
2	固定收益投资	44,681,710.30	95.02
	其中：债券	44,681,710.30	95.02
	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	732,728.14	1.56
7	其他各项资产	1,453,910.72	3.09
8	合计	47,025,408.16	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	157,059.00	0.41
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	157,059.00	0.41

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	3,000	80,730.00	0.21
2	601688	华泰证券	3,300	76,329.00	0.20



## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601688	华泰证券	98,835.00	0.21
2	600030	中信证券	96,900.00	0.21
3			-	-
4			-	-
5			-	-
6			-	-
7			-	-
8			-	-
9			-	-
10			-	-
11			-	-
12			-	-
13			-	-
14			-	-
15			-	-
16			-	-
17			-	-
18			-	-
19			-	-
20			-	-

注：1. 本项的“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 本基金本报告期仅 2 只股票发生买入交易。

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603368	柳州医药	55,826.00	0.12
2	300409	道氏技术	44,229.50	0.09
3			-	-
4			-	-
5			-	-
6			-	-

7			-	-
8			-	-
9			-	-
10			-	-
11			-	-
12			-	-
13			-	-
14			-	-
15			-	-
16			-	-
17			-	-
18			-	-
19			-	-
20			-	-

注：1. 本项的“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 本基金本报告期仅 2 只股票发生卖出交易。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	195,735.00
卖出股票的收入（成交）总额	100,055.50

注：本项的“买入股票的成本”、“卖出股票的收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	10,960,400.00	28.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	33,702,420.00	88.91
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	18,890.30	0.05
8	其他	-	-
9	合计	44,681,710.30	117.88

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	124072	12 曲公路	100,000	10,631,000.00	28.05
2	124343	13 阳江债	100,000	10,470,000.00	27.62
3	122718	12 渝南债	69,990	7,558,920.00	19.94
4	019217	12 国债 17	55,000	5,513,750.00	14.55
5	020077	15 贴债 03	55,000	5,446,650.00	14.37

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本基金投资国债期货的投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 1. 关于中信证券（代码：600030）的处罚说明

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。

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，中信证券总体运行平稳，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。

#### 2. 关于华泰证券（代码：601688）的处罚说明

A. 2014 年 9 月 6 日公司收到中国证监会《关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正措施的决定（[2014]62 号）》，该决定书主要内容为：“你公司管理的华泰紫金增强债券集合资产管理计划、华泰紫金周期轮动集合资产管理计划等多个资产管理计划在 2013 年 1 月至 2014 年 3 月期间，存在同日或隔日通过交易对手实现不同计划之间间接进行债券买卖交易的情形。上述行为违反了《证券公司客户资产管理业务管理办法》第三条、第三十三条的规定。同时，中国人民银行南京分行于 2014 年 6 月就此事项对你公司进行行政处罚，但你公司并未及时向监管部门报告。按照《证券公司客户资产管理业务管理办法》第五十七条的规定，责令你公司予以改正。”

B. 根据中国证监会 2015 年 4 月 3 日召开的新闻发布会上对 2015 年第一季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报，我公司在融资融券业务开展中存在向不符合条件的客户融资融券、向风险承担能力不足的客户融资融券、未按照规定方式为部分客户开立融资融券信用账户等问题，违规情节较重。

C. 安徽证监局发现华泰证券股份有限公司合肥长江东大街证券营业部为 1 名在该公司从事证券交易时间不足半年的客户开立融资融券账户，并与该客户签订《保证书》，承诺提

供他人信用账户供其使用（未实际使用）。上述行为违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条、《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会公告〔2011〕31号）第十一条的相关规定，表明该营业部内部控制不完善。2015年4月24日安徽证监局对华泰证券股份有限公司合肥长江东大街证券营业部采取出具警示函措施的决定。

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,123.54
2	应收证券清算款	44,180.16
3	应收股利	-
4	应收利息	1,308,342.32
5	应收申购款	93,264.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,453,910.72

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,075	30,493.49	20,210,438.00	61.65%	12,570,060.63	38.35%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	213.62	0.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年3月23日）基金份额总额	1,474,806,481.51
本报告期期初基金份额总额	42,447,704.79
本报告期基金总申购份额	23,660,052.21
减：本报告期基金总赎回份额	33,327,258.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	32,780,498.63

### 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

本报告期内，未发生基金管理人、基金托管人的重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

**10.5 报告期内改聘会计师事务所情况**

本报告期内，未发生改聘会计师事务所的情况。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券股份有限公司	1	195,735.00	66.17%	178.19	66.17%	-
华泰证券股份有限公司	1	55,826.00	18.87%	50.83	18.88%	-
兴业证券股份有限公司	1	44,229.50	14.95%	40.27	14.95%	-
金元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金 融有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
合计	16	295,790.50	100.00%	269.29	100.00%	-

注：1.专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基金字<1998>29号)和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定，我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序：

**A.选择标准。**

a.公司具有较强的研究实力，能够出具高质量的各种研究报告。研究及投资建议质量较高、报告出具及时、能及时地交流和对需求做出反应，有较广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

b.公司资信状况较好，无重大不良记录。

C、公司经营规范，能满足基金运作的合法、合规需求。

d、能够对持有人提供较高质量的服务。能够向持有人提供咨询、查询等服务；可以向投资人提供及时、主动的信息以及其它增值服务，无被持有人投诉的记录。

**B.选择流程。**



公司投研和市场部门定期对券商服务质量根据选择标准进行量化评比,并根据评比的结果选择交易单元。

2: 截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止,本基金新租用兴业证券股份有限公司 1 个深圳交易单元,华泰证券股份有限公司 1 个上海交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国金证券股份有限公司	15,576,726.45	16.79%	202,000,000.00	36.65%	-	-
华泰证券股份有限公司	7,211,538.50	7.77%	346,000,000.00	62.77%	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	69,973,120.17	75.43%	3,200,000.00	0.58%	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证	-	-	-	-	-	-

券股份有限 公司						
合计	92,761,385.12	100.00%	551,200,000.00	100.00%	-	-

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”）

二〇一五年八月二十九日