

**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转型）**  
**2015 年半年度报告**  
**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：二〇一五年八月二十九日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人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。

---

## 1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
3 主要财务指标、基金净值表现.....	8
3.1 金元惠理保本混合型证券投资基金.....	8
3.1.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.1.2 基金净值表现.....	8
3.2 金元顺安保本混合型证券投资基金.....	10
3.2.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2.2 基金净值表现.....	10
4 管理人报告.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 基金持有人数或资产净值预警情形的说明.....	17
5 托管人报告.....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
6 年度财务报表.....	17
6.1 金元惠理保本混合型证券投资基金.....	17
6.1.1 资产负债表.....	17
6.1.2 利润表.....	19
6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.1.4 报表附注.....	21
6.2 金元顺安保本混合型证券投资基金.....	38
6.2.1 资产负债表.....	38
6.2.2 利润表.....	40
6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	41

---

6.2.4 报表附注.....	41
7 投资组合报告.....	57
7.1 金元惠理保本混合型证券投资基金.....	57
7.1.1 期末基金资产组合情况.....	57
7.1.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	57
7.1.3 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.....	57
7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	59
7.1.7 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.....	59
7.1.8 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贵金属投资明细.....	59
7.1.9 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.....	59
7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.1.12 投资组合报告附注.....	60
7.2 金元顺安保本混合型证券投资基金.....	61
7.2.1 期末基金资产组合情况.....	61
7.2.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	61
7.2.3 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.....	62
7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	63
7.2.7 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.....	64
7.2.8 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贵金属投资明细.....	64
7.2.9 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.....	64
7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.2.12 投资组合报告附注.....	65
8 基金份额持有人信息.....	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
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.....	67
9 开放式基金份额变动.....	68
9.1 金元惠理保本混合型证券投资基金.....	68
9.2 金元顺安保本混合型证券投资基金.....	68
10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 其他重大事件.....	74

11 备查文件目录.....	75
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点.....	75
12.3 查阅方式.....	75

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

<b>金元惠理保本混合型证券投资基金</b>		
基金名称	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	
基金主代码	620007	
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	
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	38,639,675.65	
基金合同存续期	不定期	
<b>金元顺安保本混合型证券投资基金</b>		
基金名称	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	
基金主代码	620007	
交易代码	620007	001375
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	
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	38,865,975.13	
基金合同存续期	不定期	
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 基金产品说明

<b>金元惠理保本混合型证券投资基金</b>	
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。
<b>金元顺安保本混合型证券投资基金</b>	
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。

### 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 (原“金元惠理基金管理有限公司”)	中国农业银行股份有限公司
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	北京复兴门内大街28号凯晨 世贸中心东座9层
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.jyvpfund.com
基金年度报告备置地点	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36楼3608

### 3 主要财务指标、基金净值表现

#### 3.1 金元惠理保本混合型证券投资基金

##### 3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	基金份额分类前(2015年1月1日-2015年6月1日)
本期已实现收益	932,439.35
本期利润	846,845.33
加权平均基金份额本期利润	0.0195
本期加权平均净值利润率	1.89%
本期基金份额净值增长率	1.96%
3.1.1.2 期末数据和指标	2015年6月1日
期末可供分配利润	5,291,805.28
期末可供分配基金份额利润	0.1370
期末基金资产净值	40,307,528.61
期末基金份额净值	1.043
3.1.1.3 累计期末指标	2015年6月1日
基金份额累计净值增长率	17.18%

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1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。

##### 3.1.2 基金净值表现

###### 3.1.2.1 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
过去三个月至分级前	1.46%	0.06%	0.62%	0.01%	0.84%	0.05%

过去六个月至分级前	1.96%	0.08%	1.59%	0.01%	0.37%	0.07%
过去一年至分级前	5.35%	0.10%	3.70%	0.01%	1.65%	0.09%
过去三年至分级前	11.71%	0.13%	12.19%	0.01%	-0.48%	0.12%
自基金成立起至至分级前	17.19%	0.14%	16.55%	0.01%	0.64%	0.13%

注：（1）本基金合同生效日为2011年8月16日；在2015年6月2日，对该基金进行份额分类，原份额转为A类份额，新增C类份额。

（2）本基金投资组合中股票、权证的投资比例为基金资产的0%-40%；债券、货币市场工具等占基金资产的60%-100%，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%。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。

### 3.1.2.2 自基金合同生效以来基金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

金元惠理保本混合型证券投资基金

转型前累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（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；在2015年6月2日，对该基金进行份额分类，原份额转为A类份额，新增C类份额。

（2）基金增长率为实际投资期间的收益率，未经过年化处理。

## 3.2 金元顺安保本混合型证券投资基金

### 3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	基金份额分类后（2015年6月2日-2015年6月30日）
本期已实现收益	180,176.37
本期利润	-20,392.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0005
本期加权平均净值利润率	-0.05%
本期基金份额净值增长率	0.00%
3.2.1.2 期末数据和指标	2015年6月30日
期末可供分配利润	5,256,453.21
期末可供分配基金份额利润	0.1352
期末基金资产净值	40,523,915.85
期末基金份额净值	1.043
3.2.1.3 累计期末指标	2015年6月30日
基金份额累计净值增长率	17.18%

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。

### 3.2.2 基金净值表现

#### 3.2.2.1 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
转型后至报告期末	0.00%	0.08%	0.28%	0.01%	-0.28%	0.07%

注：（1）本基金合同生效日为2011年8月16日；

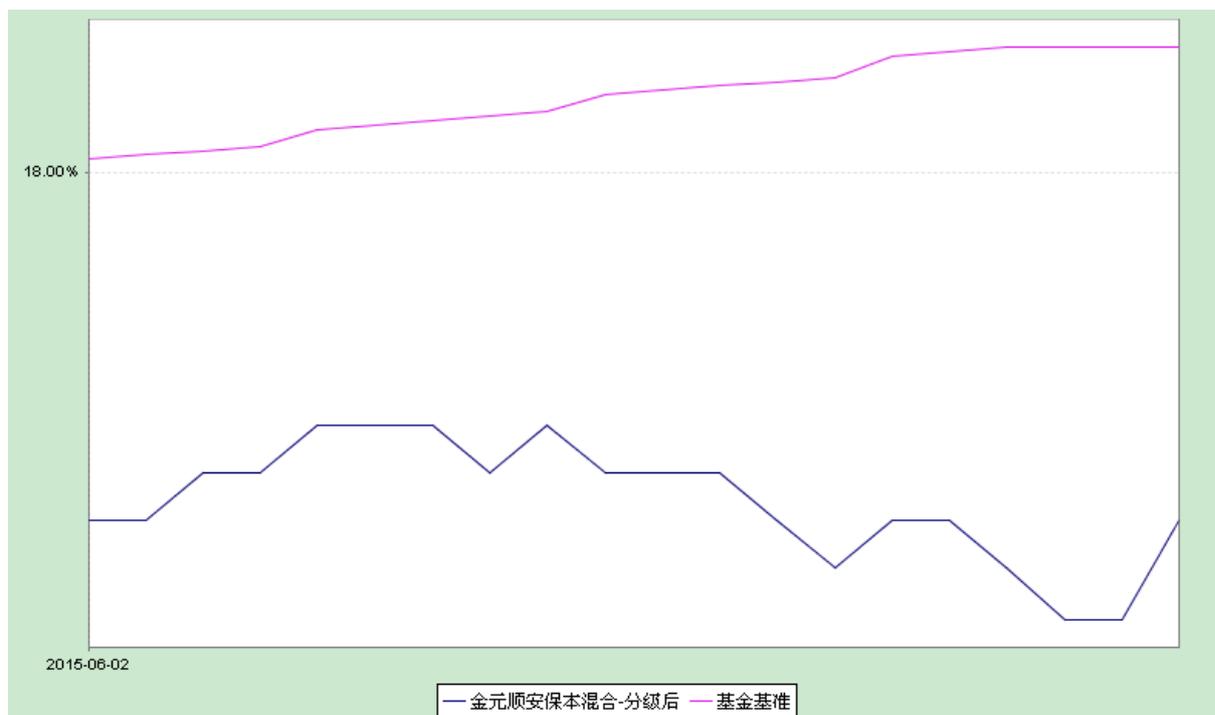
（2）本基金投资组合中股票、权证的投资比例为基金资产的0%-40%；债券、货币市场工具等占基金资产的60%-100%，其中，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。

### 3.2.2.2 自基金转型以来基金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

金元顺安保本混合型证券投资基金

转型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；在 2015 年 6 月 2 日，对该基金进行份额分类，原份额转为 A 类份额，新增 C 类份额。

(2) 基金增长率为实际投资期间的收益率，未经过年化处理。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金元顺安基金管理有限公司（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	2012-07-18	-	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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起了《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》，涵盖了各投资组合、投资市场、投资标的的公平交易制度规范，贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程，并通过分析报告、监控、稽核的方式保证制度流程的有效执行。

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

本报告期，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《异常交易监控与报告制度》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

净值增长率为 1.96%，同期业绩比较基准增长率为 1.87%。本基金超越基准 0.09%。

#### 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，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。

#### 4.6 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

本报告期内本基金未进行利润分配。

---

#### 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，该基金曾两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 02 月 25 日，该基金连续五十二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 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。

### 6 年度财务报表

#### 6.1 金元惠理保本混合型证券投资基金

##### 6.1.1 资产负债表

会计主体：金元惠理保本混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 1 日

单位：人民币元

资产	附注号	2015年6月1日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.1.4.7.1	179,228.05	3,658,287.22
结算备付金		-	60,306.98
存出保证金		1,382.48	3,037.88
交易性金融资产	6.1.4.7.2	39,644,478.00	18,326,467.00
其中：股票投资	6.1.4.7.2	-	326,400.00
基金投资	6.1.4.7.2	-	-
债券投资	6.1.4.7.2	39,644,478.00	18,000,067.00
资产支持证券投资	6.1.4.7.2	-	-
贵金属投资	6.1.4.7.2	-	-
衍生金融资产	6.1.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.1.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	25,011,250.00
应收利息	6.1.4.7.5	1,023,377.74	198,433.16
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.1.4.7.6	-	-
资产总计		40,848,466.27	47,257,782.24
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>2015年6月1日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.1.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		204,108.66	156,565.90
应付管理人报酬		43,697.11	48,631.74
应付托管费		7,282.85	8,105.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.1.4.7.7	4,826.10	7,973.87
应交税费		148,089.60	148,089.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.1.4.7.8	132,933.34	62,362.19
负债合计		540,937.66	431,728.57
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.1.4.7.9	35,062,576.91	41,529,902.37

未分配利润	6.1.4.7.10	5,244,951.70	5,296,151.30
所有者权益合计		40,307,528.61	46,826,053.67
负债和所有者权益总计		40,848,466.27	47,257,782.24

注：报告截止日 2015 年 6 月 1 日，基金份额净值 1.043 元，基金份额总额 38,639,675.65 份。

### 6.1.2 利润表

会计主体：金元惠理保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 1 日

单位：人民币元

项目	附注号	2015年1月1日-2015年6月1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>1,202,325.00</b>	<b>2,364,477.17</b>
1. 利息收入		772,841.04	1,380,297.00
其中：存款利息收入	6.1.4.7.11	11,591.11	4,123.25
债券利息收入		666,871.22	1,371,155.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		94,378.71	5,018.05
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		471,994.66	-110,887.24
其中：股票投资收益	6.1.4.7.12	104,400.00	14,739.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.1.4.7.13	365,569.66	-171,332.95
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.1.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.1.4.7.15	-	-
股利收益	6.1.4.7.16	2,025.00	45,705.92
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.17	-85,594.02	1,070,506.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.18	43,083.32	24,560.76
<b>减：二、费用</b>		<b>355,479.67</b>	<b>627,539.81</b>
1. 管理人报酬	6.1.4.10.2.1	224,233.61	334,845.17
2. 托管费	6.1.4.10.2.2	37,372.27	55,807.54
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.1.4.7.19	811.96	1,055.89
5. 利息支出		474.03	97,891.70
其中：卖出回购金融资产支出		474.03	97,891.70
6. 其他费用	6.1.4.7.20	92,587.80	137,939.51

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		846,845.33	1,736,937.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		846,845.33	1,736,937.36

### 6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元惠理保本混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月1日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日-2015年6月1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）	41,529,902.37	5,296,151.30	46,826,053.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	846,845.33	846,845.33
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）	-6,467,325.46	-898,044.93	-7,365,370.39
其中：1. 基金申购款	5,785,896.62	777,976.39	6,563,873.01
2. 基金赎回款	-12,253,222.08	-1,676,021.32	-13,929,243.40
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）	35,062,576.91	5,244,951.70	40,307,528.61
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）	56,393,917.81	3,255,168.40	59,649,086.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,736,937.36	1,736,937.36
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）	-6,935,629.06	-487,864.30	-7,423,493.36
其中：1. 基金申购款	423,000.59	30,286.23	453,286.82
2. 基金赎回款	-7,358,629.65	-518,150.53	-7,876,780.18
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）	49,458,288.75	4,504,241.46	53,962,530.21

报告附注为财务报表的组成部分

---

本报告页码从 6.1.1 至 6.1.4，财务报表由下列负责人签署；

基金管理公司负责人：张嘉宾，主管会计工作负责人：符刃，会计机构负责人：季泽

#### 6.1.4 报表附注

##### 6.1.4.1 基金基本情况

金元惠理保本混合型证券投资基金（原名为金元比联保本混合型证券投资基金，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[2011]523 号文《关于核准金元比联保本混合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 2011 年 8 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 277,669,494.24 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的保本周期为三年，自基金合同生效之日（即 2011 年 8 月 16 日）起至三个公历年后对应日（即 2014 年 8 月 15 日）止。本基金第一个保本周期期满后，在符合基金合同规定的保本基金存续的条件下，转入第二个保本周期，担保人变更为深圳市高新投集团有限公司。本基金在第一个保本周期到期日和第二个保本周期开始之间设置过渡期。过渡期自 2014 年 8 月 18 日（含）至 2014 年 9 月 22 日（含）。本基金第二个保本期为三年，自本基金公告的保本周期起始日（即 2014 年 9 月 23 日）起至三年后对应日（即 2017 年 9 月 22 日）止。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，基金担保人为深圳市高新投集团有限公司。

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 2012 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，将金元比联保本混合型证券投资基金更名为金元惠理保本混合型证券投资基金，并于 2012 年 5 月 2 日公告。

本基金过渡期的最后一个工作日为“到期换算日”，本基金对在“到期换算日”登记在册的基金份额持有人所持有的基金份额（包括第一个保本周期到期后选择或默认选择转入第二个保本周期的基金份额和过渡期申购期申购、转换转入的基金份额），以“到期换算日”的基金估值为基础，在基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.0000 元的基金份额，基金份额数额按“到期换算比例”相应调整。经本公司计算，并经本基金托管人中国农业银行股份有限公司复核，2014 年 9 月 22 日本基金折算前的基金份额净值为 1.102 元，“到期换算比例”为 1:1.102009034。折算后本基金的总份额由 60,284,769.24 份调整为 66,434,360.29 份，基金份额净

---

值调整为 1.000 元。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括中小板、创业板及其他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、企业债、公司债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具、权证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。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。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。本基金业绩比较基准为：三年期银行定期存款税后收益率。

#### **6.1.4.2 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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年度及以后期间的财务报告中施行。

#### **6.1.4.3 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 1 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 6 月 1 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **6.1.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金 2015 年 1 月 1 日至 6 月 1 日止期间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。

#### **6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.1.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金 2015 年 1 月 1 日至 6 月 1 日止期间未发生会计政策变更。

##### **6.1.4.5.2 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。

##### **6.1.4.5.3 差错更正的说明**

本基金 2015 年 1 月 1 日至 6 月 1 日止期间未发生会计差错更正。

#### **6.1.4.6 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。

#### 6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 1 日
活期存款	179,228.05
定期存款	-
其他存款	-
合计	179,228.05

##### 6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 1 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	14,091,263.17	14,173,478.00	82,214.83
	银行间市场	25,066,460.27	25,471,000.00	404,539.73
	合计	39,157,723.44	39,644,478.00	486,754.56
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		39,157,723.44	39,644,478.00	486,754.56

#### 6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.1.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日未持有买入返售金融资产。

##### 6.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月1日
应收活期存款利息	2,258.90
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	195.03
应收债券利息	1,020,918.68
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	5.13
合计	1,023,377.74

#### 6.1.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日无其他资产余额。

#### 6.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月1日
交易所市场应付交易费用	4,826.10
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,826.10

#### 6.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月1日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	56.94
预提信息披露费用	49,973.04
审计费用	82,903.36
合计	132,933.34

#### 6.1.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月1日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,769,432.36	41,529,902.37
本期申购	6,375,620.28	5,785,896.62
本期赎回（以“-”号填列）	-13,505,376.99	-12,253,222.08
本期末	38,639,675.65	35,062,576.91

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.1.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,281,451.64	14,699.66	5,296,151.30
本期利润	932,439.35	-85,594.02	846,845.33
本期基金份额交易产生的变动数	-938,517.42	40,472.49	-898,044.93
其中：基金申购款	813,970.03	-35,993.64	777,976.39
基金赎回款	-1,752,487.45	76,466.13	-1,676,021.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,275,373.57	-30,421.87	5,244,951.70

#### 6.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月1日
活期存款利息收入	8,701.28
定期存款利息收入	

其他存款利息收入	
结算备付金利息收入	2,717.01
其他	172.82
合计	11,591.11

#### 6.1.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月1日
卖出股票成交总额	303,000.00
减：卖出股票成本总额	198,600.00
买卖股票差价收入	104,400.00

#### 6.1.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月1日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,382,565.17
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,952,073.60
减：应收利息总额	64,921.91
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	365,569.66

#### 6.1.4.7.14 贵金属投资收益

本基金2015年1月1日至6月1日止期间未进行贵金属投资。

#### 6.1.4.7.15 衍生工具收益

本基金2015年1月1日至6月1日止期间未进行衍生工具投资。

#### 6.1.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月1日
股票投资产生的股利收益	2,025.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,025.00

#### 6.1.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月1日
1. 交易性金融资产	-85,594.02
——股票投资	-127,800.00
——债券投资	44,205.98
——资产支持证券投资	
——基金投资	
——贵金属投资	
——其他	
2. 衍生工具	
——权证投资	
3. 其他	
合计	-85,594.02

#### 6.1.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月1日
基金赎回费收入	40,748.95
转换费收入	2,279.89
其他	54.48
合计	43,083.32

#### 6.1.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月1日
交易所市场交易费用	636.96
银行间市场交易费用	175.00
合计	811.96

#### 6.1.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月1日
审计费用	22,903.36
信息披露费	49,973.04
其他费用	
账户维护费	18,150.00
银行汇划手续费	1,561.40
合计	92,587.80

#### 6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.1.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.1.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.1.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.1.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、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

##### 6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

###### 6.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.1.4.10.1.1 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1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	303,000.00	100.00%	150,847.00	43.88%

###### 6.1.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 1 日至期间及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.1.4.10.1.3 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1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	6,023,262.32	27.79%	11,699,987.82	94.67%

#### 6.1.4.10.1.4 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1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	145,000,000.00	53.62%	56,000,000.00	36.13%

#### 6.1.4.10.1.5 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1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	275.85	100.00%	413.19	8.56%
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	137.34	43.88%	137.34	3.01%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.1.4.10.2 关联方报酬

##### 6.1.4.10.2.1 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1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	224,233.61	334,845.17
其中：支付销售机构的客户维护费	81,297.01	150,855.99

a.基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。

计算方法如下： $H=E \times 1.20\% / \text{当年天数}$ ，

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。

#### 6.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月1日	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	37,372.27	55,807.54

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。

#### 6.1.4.10.3 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 1 日期间及上年度可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

#### 6.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日-2015年6月1日	2014年1月1日至2014年6月30日
期初持有的基金份额	9,789,874.55	-

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	9,789,874.55	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	25.34%	-

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

本报告期末 2015 年 6 月 1 日除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

#### 6.1.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 1 日		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	179,228.05	8,701.28	252,290.83	2,842.76

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 6 月 1 日止期间获得的利息收入为人民币 2,717.01 元，2015 年 6 月 1 日止结算备付金余额为人民币 0 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 1,217.15，2014 年 6 月 30 日止结算备付金余额为人民币 120,260.65 元。

#### 6.1.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 1 日止期间及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.1.4.11 利润分配情况

本基金本报告期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 1 日止期间未进行利润分配。

#### 6.1.4.12 期末（2015 年 6 月 1 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.1.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日 未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.1.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入公司各个业务层面的全面控制过程之中，并建立了三道防线：以各岗位职责为基础，形成第一道防线；通过相关岗位之间、相关部门之间相互监督制衡，形成第二道防线；由督察长、风险控制委员会、监察稽核部对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务进行监督、检查、评价，形成的第三道防线。

##### 6.1.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级证券，且通过分散化投资以降低信用风险。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.1.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	2015年6月1日	上年末 2014年12月31日
A-1	10,109,000.00	-
A-1 以下	5,049,500.00	-
未评级	4,848,000.00	1,430,865.00
合计	20,006,500.00	1,430,865.00

注：未评级债券为国债和政策性金融债。

##### 6.1.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	2015年6月1日	上年末 2014年12月31日
AAA		1,104,560.00
AAA 以下	5,202,000.00	5,420,642.00
未评级	14,435,978.00	10,044,000.00
合计	19,637,978.00	16,569,202.00

注：未评级债券为国债和政策性金融债。

### 6.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，本年末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 6.1.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和市场价格风险。

#### 6.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险；本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、买入返售证券及债券投资等。

##### 6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6 月01日	1个月以 内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月-1 年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	-	-	-	-	-	179,228.0 5	-	-	-	179,228.0 5
结算备付 金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
存出保证 金	-	-	-	-	-	1,382.48	-	-	-	1,382.48
交易性金 融资产	-	-	-	-	-	20,006,50 0.00	15,362,00 0.00	4,275,978 .00	-	39,644,47 8.00
衍生金融 资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券 清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	1,023,377 .74	1,023,377 .74
应收申购 款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
买入返售	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

金融资产										
资产总计	-	-	-	-	-	20,187,11 0.53	15,362,00 0.00	4,275,978 .00	1,023,377 .74	40,848,46 6.27
负债										
应付赎回费	-	-	-	-	-	-	-	-	56.94	56.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	43,697.11	43,697.11
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	7,282.85	7,282.85
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	4,826.10	4,826.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	-	-	-	-	-	148,089.6 0	148,089.6 0
预提费用	-	-	-	-	-	-	-	-	132,876.4 0	132,876.4 0
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	204,108.6 6	204,108.6 6
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	540,937.6 6	540,937.6 6
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	20,187,11 0.53	15,362,00 0.00	4,275,978 .00	482,440.0 8	40,307,52 8.61
上年度末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	6个月以内	3个月-1年	6个月-1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	-	-	-	-	-	3,658,287 .22	-	-	-	3,658,287 .22
结算备付金	-	-	-	-	-	60,306.98	-	-	-	60,306.98
存出保证金	-	-	-	-	-	3,037.88	-	-	-	3,037.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,437,807 .00	15,562,26 0.00	-	326,400.0 0	18,326,46 7.00
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	198,433.1	198,433.1

									6	6
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	25,011,250.00	25,011,250.00
资产总计	-	-	-	-	-	6,159,439.08	15,562,260.00	-	25,536,083.16	47,257,782.24
负债										
应付赎回费	-	-	-	-	-	-	-	-	2,362.19	2,362.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	48,631.74	48,631.74
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	8,105.27	8,105.27
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	7,973.87	7,973.87
应交税金	-	-	-	-	-	-	-	-	148,089.60	148,089.60
预提费用	-	-	-	-	-	-	-	-	60,000.00	60,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	156,565.90	156,565.90
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	431,728.57	431,728.57
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	6,159,439.08	15,562,260.00	-	25,104,354.59	46,826,053.67

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	以中央国债登记结算有限责任公司公布的 2015 年 06 月 01 日和 2014 年 12 月 31 日各债券的基点价值(BP 价值)为主要计算依据；		
	假设债券持仓结构保持不变；		
	银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		2015 年 6 月 1 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	市场利率下降 1BP	增加 0.66 万元	增加 0.40 万元
	市场利率上升 1BP	减少 0.66 万元	减少 0.40 万元

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

##### 6.1.4.13.4.3 其他价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月01日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	326,400.00	0.7
交易性金融资产-债券投资	39,644,478.00	98.36	18,000,067.00	38.44
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	39,644,478.00	98.36	18,326,467.00	39.14

注：本基金投资组合中股票、权证的投资比例为基金资产的0%-40%；债券、货币市场工具等占基金资产的60%-100%，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%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

##### 6.1.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

###### 6.1.4.14.1 公允价值

###### 6.1.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项、卖出回购金融资产款以及其他金融负债，因

其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 6.1.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 6.1.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 1 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 14,173,478.00 元，属于第二层次的余额为人民币 25,471,000.00 元，无属于第三层次的余额。

##### 6.1.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初确认金融工具公允价值层次之间转换的时点。2015 年 1 月 1 日至 6 月 1 日止，对于以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

##### 6.1.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上期末均不以第三层次公允价值计量。

#### 6.1.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.1.4.14.3 其他事项

截至本财务报表批准日，本基金管理人金元惠理基金管理有限公司已变更公司名称为“金元顺安基金管理有限公司”，已向中国证监会报备，并于 2015 年 3 月 10 日进行了公告。

除此以外，本基金无需要说明的其他重要事项。

## 6.2 金元顺安保本混合型证券投资基金

### 6.2.1 资产负债表

会计主体：金元顺安保本混合型证券投资基金

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
资产：		
银行存款	6.2.4.7.1	2,820,717.44

结算备付金		5,000.20
存出保证金		1,145.34
交易性金融资产	6.2.4.7.2	37,528,598.00
其中：股票投资	6.2.4.7.2	465,848.00
基金投资	6.2.4.7.2	-
债券投资	6.2.4.7.2	37,062,750.00
贵金属投资	6.2.4.7.2	
资产支持证券投资	6.2.4.7.2	-
衍生金融资产	6.2.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.2.4.7.5	901,704.20
应收股利		-
应收申购款		109,797.57
递延所得税资产		-
其他资产	6.2.4.7.6	-
资产总计		41,366,962.75
<b>负债和所有者权益</b>		<b>2015年6月30日</b>
<b>负 债：</b>	<b>附注号</b>	
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.2.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		547,082.86
应付管理人报酬		40,878.25
应付托管费		6,813.05
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.2.4.7.7	5,620.22
应交税费		148,089.60
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.2.4.7.8	94,562.92
负债合计		843,046.90
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.2.4.7.9	35,267,462.64
未分配利润	6.2.4.7.10	5,256,453.21
所有者权益合计		40,523,915.85
负债和所有者权益总计		41,366,962.75

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.043 元，基金份额总额 38,865,975.13 份。

## 6.2.2 利润表

会计主体：金元顺安保本混合型证券投资基金

本报告期：2015年6月2日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	2015年6月2日-2015年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>41,076.93</b>
1. 利息收入		141,696.71
其中：存款利息收入	6.2.4.7.11	1,356.19
债券利息收入		140,340.52
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		93,171.11
其中：股票投资收益	6.2.4.7.12	3,500.00
基金投资收益		-
债券投资收益	6.2.4.7.13	85,715.78
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资	6.2.4.7.14	
衍生工具收益	6.2.4.7.15	-
股利收益	6.2.4.7.16	3,955.33
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.17	-200,569.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.18	6,778.16
<b>减：二、费用</b>		<b>61,469.61</b>
1. 管理人报酬		39,545.83
2. 托管费		6,590.98
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.2.4.7.19	972.34
5. 利息支出		396.41
其中：卖出回购金融资产支出		396.41
6. 其他费用	6.2.4.7.20	13,964.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-20,392.68</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-20,392.68</b>

### 6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安保本混合型证券投资基金

本报告期：2015年6月2日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	2015年6月2日-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）	35,062,576.91	5,244,951.70	40,307,528.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,392.68	-20,392.68
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）	204,885.73	31,894.19	236,779.92
其中：1. 基金申购款	1,983,607.45	297,229.83	2,280,837.28
2. 基金赎回款	-1,778,721.72	-265,335.64	-2,044,057.36
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）	35,267,462.64	5,256,453.21	40,523,915.85

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从 6.2.1 至 6.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：张嘉宾，主管会计工作负责人：符刃，会计机构负责人：季泽

### 6.2.4 报表附注

#### 6.2.4.1 基金基本情况

金元惠理保本混合型证券投资基金（原名为金元比联保本混合型证券投资基金，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[2011]523号文《关于核准金元比联保本混合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2011年8月16日正式生效，首次设立募集规模为277,669,494.24份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的保本周期为三年，自基金合同生效之日（即2011年8月16日）起至三个公历年后对应日（即2014年8月15日）止。本基金第一个保本周期期满后，在符合基金合同规定的保本基金存续的条件下，转入第二个保本周期，担保人变更为深圳市高新投集团有限公司。本基金在第一个保本周期到期日和第二个保本周期开始之间设置过渡期。过渡期自2014年8月18日（含）至2014年9月22

---

日（含）。本基金第二个保本期为三年，自本基金公告的保本周期起始日（即 2014 年 9 月 23 日）起至三年后对应日（即 2017 年 9 月 22 日）止。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，基金担保人为深圳市高新投集团有限公司。

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 2012 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，将金元比联保本混合型证券投资基金更名为金元惠理保本混合型证券投资基金，并于 2012 年 5 月 2 日公告。

本基金过渡期的最后一个工作日为“到期换算日”，本基金对在“到期换算日”登记在册的基金份额持有人所持有的基金份额（包括第一个保本周期到期后选择或默认选择转入第二个保本周期的基金份额和过渡期申购期申购、转换转入的基金份额），以“到期换算日”的基金估值为基础，在基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.0000 元的基金份额，基金份额数额按“到期换算比例”相应调整。经本公司计算，并经本基金托管人中国农业银行股份有限公司复核，2014 年 9 月 22 日本基金折算前的基金份额净值为 1.102 元，“到期换算比例”为 1:1.102009034。折算后本基金的总份额由 60,284,769.24 份调整为 66,434,360.29 份，基金份额净值调整为 1.000 元。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括中小板、创业板及其他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、企业债、公司债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具、权证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。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。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。本基金业绩比较基准为：三年期银行定期存款税后收益率。

#### **6.2.4.2 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。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月，财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》；上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月，财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》，在2014年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

#### **6.2.4.3 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6月2日至6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **6.2.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金2015年6月2日至6月30日止期间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。

#### **6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.2.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本2015年6月2日至6月30日止期间未发生会计政策变更。

##### **6.2.4.5.2 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。

##### **6.2.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本2015年6月2日至6月30日止期间未发生会计差错更正。

#### **6.2.4.6 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。

#### 6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	2,820,717.44
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,820,717.44

##### 6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	497,550.00	465,848.00	-31,702.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	21,683,812.49	21,731,250.00
	银行间市场	15,061,050.00	15,331,500.00
	合计	36,744,862.49	37,062,750.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	37,242,412.49	37,528,598.00	286,185.51

##### 6.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.2.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

###### 6.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	976.98

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2.07
应收债券利息	900,724.70
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.45
合计	901,704.20

#### 6.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,445.22
银行间市场应付交易费用	175.00
合计	5,620.22

#### 6.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,782.47
预提审计费	27,273.08
预提信息披露费	59,507.37
合计	94,562.92

#### 6.2.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年6月2日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	38,639,675.65	35,062,576.91
本期申购	2,186,660.07	1,983,607.45
本期赎回(以“-”号填列)	-1,960,360.59	-1,778,721.72
本期末	38,865,975.13	35,267,462.64

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.2.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,275,373.57	-30,421.87	5,244,951.70
本期利润	180,176.37	-200,569.05	-20,392.68
本期基金份额交易产生的变动数	27,335.63	4,558.56	31,894.19
其中：基金申购款	299,350.44	-2,120.61	297,229.83
基金赎回款	-272,014.81	6,679.17	-265,335.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,482,885.57	-226,432.36	5,256,453.21

#### 6.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月2日至2015年6月30日
活期存款利息收入	1,348.57
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6.27
其他	1.35
合计	1,356.19

#### 6.2.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月2日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	93,000.00
减：卖出股票成本总额	89,500.00
买卖股票差价收入	3,500.00

#### 6.2.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月2日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,662,487.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,275,810.35
减：应收利息总额	300,961.65
债券投资收益	85,715.78

#### 6.2.4.7.14 贵金属投资收益

本基金 2015 年 6 月 2 日至 6 月 30 日止期间未进行贵金属投资。

#### 6.2.4.7.15 衍生工具收益

本基金 2015 年 6 月 2 日至 6 月 30 日止期间未进行衍生工具投资。

#### 6.2.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月2日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,955.33
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,955.33

#### 6.2.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月2日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-200,569.05
——股票投资	-31,702.00
——债券投资	-168,867.05
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-200,569.05

#### 6.2.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月2日至2015年6月30日
基金赎回费收入	5,296.49
配股手续费	-
新股手续费返还	-
印花税返还	-
转换费收入	1,481.67
其他	-
合计	6,778.16

#### 6.2.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月2日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	797.34

银行间市场交易费用	175.00
合计	972.34

#### 6.2.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月2日至2015年6月30日
审计费用	4,369.72
信息披露费	9,534.33
银行汇划费用	30.00
上市费	-
持有人大会费	-
账户维护费	30.00
其他费用	-
合计	13,964.05

#### 6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.2.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.2.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.2.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期 2015 年 6 月 2 日至 6 月 30 日止期间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。

##### 6.2.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
金元顺安基金管理有限公司（原“金元惠理基金管理有限公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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

#### 6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.2.4.10.1.1 股票交易

本基金 2015 年 6 月 2 日至 2015 年 6 月 30 日止期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.2.4.10.1.2 权证交易

本基金 2015 年 6 月 2 日至 2015 年 6 月 30 日止期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.2.4.10.1.3 债券交易

基金 2015 年 6 月 2 日至 2015 年 6 月 30 日止期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.2.4.10.1.4 债券回购交易

基金 2015 年 6 月 2 日至 2015 年 6 月 30 日止期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.2.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金 2015 年 6 月 2 日至 2015 年 6 月 30 日止期间无应支付的关联方佣金。

#### 6.2.4.10.2 关联方报酬

##### 6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月2日-2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	39,545.83
其中：支付销售机构的客户维护费	13,541.32

注：a.基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%的年费率计提。

计算方法如下： $H=E \times 1.20\% / \text{当年天数}$ ,

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。

##### 6.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月2日-2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,590.98

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。

#### 6.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金 2015 年 6 月 2 日至 2015 年 6 月 30 日止期间未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

#### 6.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

单位: 份

项目	本期
	2015 年 6 月 2 日-2015 年 6 月 30 日
基金合同生效日(2015 年 6 月 2 日)持有的基金份额	9,789,874.55
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	9,789,874.55
期末持有的基金份额占基金总份额比例	25.19%

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

报告期末 2015 年 6 月 30 日除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

##### 6.2.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期	
	2015年6月2日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	2,820,717.44	1,348.57

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 6 月 2 日至 2015 年 6 月 30 日止期间获得的利息收入为人民币 6.27 元, 2015 年 6 月 30 日止结算备付金余额为人民币 5,000.20 元。

##### 6.2.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金 2015 年 6 月 2 日至 2015 年 6 月 30 日止期间未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

##### 6.2.4.11 利润分配情况

本基金 2015 年 6 月 2 日至 2015 年 6 月 30 日止期间未进行利润分配。

#### 6.2.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

##### 6.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.2.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入公司各个业务层面的全面控制过程之中，并建立了三道防线：以各岗位职责为基础，形成第一道防线；通过相关岗位之间、相关部门之间相互监督制衡，形成第二道防线；由督察长、风险控制委员会、监察稽核部对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务进行监督、检查、评价，形成的第三道防线。

##### 6.2.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以降低信用风险。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.2.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年6月30日
A-1	-
A-1 以下	5,042,500.00
未评级	11,473,150.00
合计	16,515,650.00

注：未评级债券为国债和政策性金融债。

#### 6.2.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年6月30日
AAA	-
AAA 以下	5,200,500.00
未评级	15,346,600.00
合计	20,547,100.00

注：未评级债券为国债和政策性金融债。

#### 6.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，本年末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.2.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和市场价格风险。

##### 6.2.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险；本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、买入返售证券及债券投资等。

##### 6.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6 月30日	1个月以 内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月-1 年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	-	-	-	-	-	2,820,717 .44	-	-	-	2,820,717 .44
结算备付 金	-	-	-	-	-	5,000.20	-	-	-	5,000.20
存出保证 金	-	-	-	-	-	1,145.34	-	-	-	1,145.34
交易性金 融资产	-	-	-	-	-	16,515,65 0.00	15,331,50 0.00	5,215,600 .00	465,848.0 0	37,528,59 8.00
衍生金融	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

资产										
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	901,704.20	901,704.20
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	109,797.57	109,797.57
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-	-	19,342,512.98	15,331,500.00	5,215,600.00	1,477,349.77	41,366,962.75
负债										
应付赎回费	-	-	-	-	-	-	-	-	7,782.47	7,782.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	40,878.25	40,878.25
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	6,813.05	6,813.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	5,620.22	5,620.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	-	-	-	-	-	148,089.60	148,089.60
预提费用	-	-	-	-	-	-	-	-	86,780.45	86,780.45
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	547,082.86	547,082.86
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	19,342,512.98	15,331,500.00	5,215,600.00	634,302.87	40,523,915.85

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	以中央国债登记结算有限责任公司公布的 2015 年 06 月 30 日各债券的基点价值 (BP 价值) 为主要计算依据；
----	--

	假设债券持仓结构保持不变；	
	银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2015年6月30日
	市场利率下降 1BP	0.68 万元
	市场利率上升 1BP	0.68 万元

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.2.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.2.4.13.4.3 其他价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	465,848.00	1.15
交易性金融资产-债券投资	37,062,750.00	91.46
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	37,528,598.00	92.61

---

注：本基金投资组合中股票、权证的投资比例为基金资产的0%-40%；债券、货币市场工具等占基金资产的60%-100%，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%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

#### **6.2.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### 6.2.4.14.1 公允价值

###### 6.2.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项、卖出回购金融资产款以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 6.2.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 6.2.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2015年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币22,197,098.00元，属于第二层次的余额为人民币15,331,500.00元，无属于第三层次的余额。

###### 6.2.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初确认金融工具公允价值层次之间转换的时点。2015年6月2日至6月30日止期间，对于以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

###### 6.2.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上期末均不以第三层次公允价值计量。

##### 6.2.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.2.4.14.3 其他事项

截至本财务报表批准日，本基金管理人金元惠理基金管理有限公司已变更公司名称为“金元顺安基金管理有限公司”，已向中国证监会报备，并于2015年3月10日进行了公告。

除此以外，本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 金元惠理保本混合型证券投资基金

#### 7.1.1 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	-	-
	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	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	179,228.05	0.44
6	其他各项资产	1,024,760.22	2.51
7	合计	40,848,466.27	100

#### 7.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日未持有股票。

#### 7.1.3 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

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日未持有股票。

#### 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.1.4.1 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

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日未持有股票。

##### 7.1.4.2 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	600016	民生银行	303,000.00	0.65
2	-	-	-	-
3	-	-	-	-
4	-	-	-	-
5	-	-	-	-
6	-	-	-	-
7	-	-	-	-
8	-	-	-	-
9	-	-	-	-
10	-	-	-	-
11	-	-	-	-
12	-	-	-	-
13	-	-	-	-
14	-	-	-	-
15	-	-	-	-
16	-	-	-	-
17	-	-	-	-
18	-	-	-	-
19	-	-	-	-
20	-	-	-	-

#### 7.1.4.3 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	-
卖出股票的收入（成交）总额	303,000.00

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。

#### 7.1.5 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	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

#### 7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	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

#### 7.1.7 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 2015 年 6 月 1 日未持有资产支持证券。

#### 7.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日未持有贵金属。

#### 7.1.9 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 2015 年 6 月 1 日未持有权证。

#### 7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.1.10.1 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 2015 年 6 月 1 日未投资股指期货。

##### 7.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日未投资股指期货。

### 7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.1.11.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日未投资国债期货。

#### 7.1.11.2 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 2015 年 6 月 1 日未投资国债期货。

#### 7.1.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末 2015 年 6 月 1 日未投资国债期货。

### 7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形。

7.1.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

#### 7.1.12.3 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	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

#### 7.1.12.4 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 2015 年 6 月 1 日未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.1.12.5 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 2015 年 6 月 1 日未持有股票。

### 7.1.12.6 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。

## 7.2 金元顺安保本混合型证券投资基金

### 7.2.1 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	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	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	2,825,717.64	6.83
6	其他各项资产	1,012,647.11	2.45
7	合计	41,366,962.75	100.00

### 7.2.2 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

### 7.2.3 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

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

### 7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.2.4.1 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	601166	兴业银行	99,900.00	0.25
2	000776	广发证券	99,863.00	0.25
3	601998	中信银行	99,822.00	0.25
4	601336	新华保险	99,680.00	0.25
5	600000	浦发银行	98,285.00	0.24
6	600016	民生银行	89,500.00	0.22

注：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。

#### 7.2.4.2 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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	93,000.00	0.23
2	-	-	-	-
3	-	-	-	-
4	-	-	-	-
5	-	-	-	-
6	-	-	-	-

注：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。

#### 7.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	587,050.00
卖出股票的收入（成交）总额	93,000.00

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。

#### 7.2.5 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	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

#### 7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	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

#### 7.2.7 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 2015 年 6 月 30 日未持有资产支持证券。

#### 7.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末 2015 年 6 月 30 日未持有贵金属。

#### 7.2.9 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 2015 年 6 月 30 日未持有权证。

#### 7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.2.10.1 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 2015 年 6 月 30 日未投资股指期货。

##### 7.2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末 2015 年 6 月 30 日未投资股指期货。

#### 7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.2.11.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末 2015 年 6 月 30 日未投资国债期货。

##### 7.2.11.2 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 2015 年 6 月 30 日未投资国债期货。

---

### 7.2.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末 2015 年 6 月 30 日未投资国债期货。

### 7.2.12 投资组合报告附注

7.2.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年收到公开谴责、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。

7.2.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

#### 7.2.9.3 期末其他各项资产构成

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

#### 7.2.9.4 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 2015 年 6 月 30 日未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.2.9.5 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 2015 年 6 月 30 日前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.2.9.6 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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 金元惠理保本混合型证券投资基金

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
917	42,137.05	10,237,307.40	26.49%	28,402,368.25	73.51%

#### 8.1.2 金元顺安保本混合型证券投资基金

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
861	45,140.51	10,237,307.40	26.34%	28,628,667.73	73.66%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

#### 8.2.1 金元惠理保本混合型证券投资基金

报告期末 2015 年 6 月 1 日本公司所有从业人员未持有本基金。

#### 8.2.2 金元顺安保本混合型证券投资基金

报告期末 2015 年 6 月 30 日本公司所有从业人员未持有本基金。

### 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

#### 8.3.1 金元惠理保本混合型证券投资基金

报告期末 2015 年 6 月 1 日

项目	持有份额总数（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 8.3.2 金元顺安保本混合型证券投资基金

报告期末 2015 年 6 月 30 日

项目	持有份额总数（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	50-100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

### 9.1 金元惠理保本混合型证券投资基金

单位：份

报告期初基金份额总额	45,769,432.36
报告期初至基金合同生效日总申购份额	6,375,620.28
报告期初至基金合同生效日总赎回份额	13,505,376.99
报告期初至基金合同生效日拆分变动份额（份额 减少以“-”填列）	-
基金合同生效日基金份额总额	38,639,675.65

### 9.2 金元顺安保本混合型证券投资基金

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	38,639,675.65
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	2,186,660.07
基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	1,960,360.59
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-
基金合同生效日起至报告期末基金份额总额	38,865,975.13

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，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 为基金进行审计的会计师事务所情况

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 金元惠理保本混合型证券投资基金

##### 10.7.1.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

金元证券股份有限公司	1	303,000.00	100.00%	275.85	100.00%	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
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	303,000.00	100.00%	275.85	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。

#### 10.7.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
金元证券股份有限公司	6,023,262.32	27.79%	145,000,000.00	53.62%	-	-
国金证券股份有限公司	2,103,454.30	9.71%	106,600,000.00	39.42%	-	-
华泰证券股份有限公司	13,546,800.50	62.50%	18,800,000.00	6.95%	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	21,673,517.12	100.00%	270,400,000.00	100.00%	-	-

### 10.7.2 金元顺安保本混合型证券投资基金

#### 10.7.2.1 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	580,187.00	85.32%	528.20	85.31%	-
招商证券股 份有限公司	2	99,863.00	14.68%	90.92	14.69%	-
金元证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
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	1	-	-	-	-	-

券有限责任公司						
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	680,050.00	100.00%	619.12	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。

10.7.2.2 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	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				的比例
国金证券股份有限公司	8,148,419.17	100.00%	2,700,000.00	100.00%	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	8,148,419.17	100.00%	2,700,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金元顺安保本混合型证券投资基金2014年第4季度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》和	2015-01-23

		www.jyvpfund.com	
2	金元顺安保本混合型证券投资基金2014年年度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》和 www.jyvpfund.com	2015-03-31
3	金元顺安保本混合型证券投资基金更新招募说明书[2015年1号]	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》和 www.jyvpfund.com	2015-04-02
4	金元顺安保本混合型证券投资基金2015年第1季度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》和 www.jyvpfund.com	2015-04-21
5	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	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》和 www.jyvpfund.com	2015-06-02
6	金元顺安保本混合型证券投资基金半年度最后一个市场交易日（或自然日）净值公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》和 www.jyvpfund.com	2015-06-30

## 11 备查文件目录

### 12.1 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托管协议》；
- 3、《金元顺安保本混合型证券投资基金招募说明书》。

### 12.2 存放地点

上海浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 36 层

### 12.3 查阅方式

www.jyvpfund.com

---

金元顺安基金管理有限公司（原“金元顺安基金管理有限公司”）  
二〇一五年八月二十九日