

# 金元顺安丰利债券型证券投资基金

## 2016 年半年度报告

### 2016 年 6 月 30 日

基金管理人：金元顺安基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十七日

## 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 2016 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 2016 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.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 基金持有人数或资产净值预警情形的说明.....	13
5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	41
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.....	41

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	41
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	41
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12	投资组合报告附注	42
8	基金份额持有人信息	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	44
9	开放式基金份额变动	45
10	重大事件揭示	45
10.1	基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4	基金投资策略的改变	45
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	45
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	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8	其他重大事件	48
11	备查文件目录	49
11.1	备查文件目录	49
11.2	存放地点	49
11.3	查阅方式	49

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金元顺安丰利债券型证券投资基金
基金简称	金元顺安丰利债券
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
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	2,179,149,772.66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。通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	中债综合指数
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
姓名	凌有法	林葛

信息披露负责人

	联系电话	021-68882815	010-66060069
	电子邮箱	service@jysa99.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		021-68881801	95599
传真		021-68881875	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室	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	周慕冰

## 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.jysa99.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	中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室

## 3 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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	16,979,622.94
本期利润	24,767,066.82
加权平均基金份额本期利润	0.0240
本期加权平均净值利润率	1.98%
本期基金份额净值增长率	-1.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	483,462,116.85
期末可供分配基金份额利润	0.2219

期末基金资产净值	2,662,611,889.51
期末基金份额净值	1.222
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	24.83%

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	0.66%	0.10%	0.36%	0.04%	0.30%	0.06%
过去三个月	0.66%	0.10%	-0.52%	0.07%	1.18%	0.03%
过去六个月	-1.69%	0.34%	-0.21%	0.07%	-1.48%	0.27%
过去一年	5.71%	0.27%	3.26%	0.06%	2.45%	0.21%
过去三年	25.46%	0.30%	14.09%	0.11%	11.37%	0.19%
过去五年	26.76%	0.28%	24.75%	0.09%	2.01%	0.19%
自基金成立起至今	24.83%	0.28%	29.20%	0.08%	-4.37%	0.20%

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；

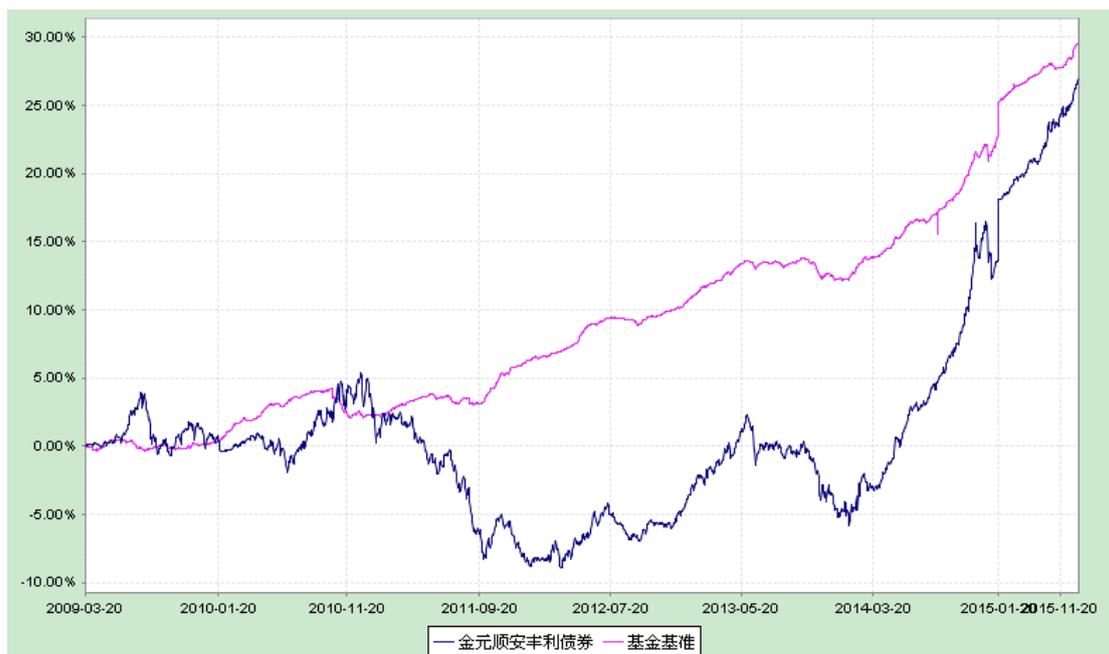
（2）本基金选择中债综合指数作为基金业绩基准。

#### 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

金元顺安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2016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。

## 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 24,500 万元。2016 年 3 月 11 日原公司外方股东惠理基金管理香港有限公司将所持有的金元顺安基金管理有限公司 49% 的股权转让给上海泉意金融信息服务有限公司（以下简称“上海泉意”）。变更后公司的股权结构为：金元证券

持有 51%的股权，上海泉意持有 49%的股权。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人管理金元顺安宝石动力混合型证券投资基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安价值增长混合型证券投资基金、金元顺安核心动力混合型证券投资基金、金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金、金元顺安新经济主题混合型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金和金元顺安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	-	9	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。9 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》、《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 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，启用投资交易系统内的公平交易模块。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

2016 年上半年经济增速延续下行趋势。GDP 同比增长 6.7%，比去年年底回落 0.2%。分项看，上半年固定资产投资同比增速下降到 9%，其中基础设施建设投资增速持续提高到 20.3%，而房地产投资和制造业投资增速分别下滑到 6.1%和 3.3%；社会消费品零售总额增速稳中有降，半年增速 10.3%，说明消费需求能力依然较强。国际经济形势复杂，拖累出口增速下滑到-7.8%。在政策托底拉动下，工业增加值增速勉强保持在 6%左右，PMI 指数维持在 50 水平，工业增加值累计同比 6%略高于一季度，PMI 指数虽然保持在荣枯分界线 50 以上，CPI 经过第一季度的反弹后重归回落到 2%以下，而 PPI 同比继续负增长，通缩形势不减，与经济下行趋势一致。

上半年央行采取稳健货币政策。一方面将差别准备金动态调节机制升级为 MPA 体系，使货币信贷保持平稳增长，上半年 M2 同比增长 11.8%明显回落，各项信贷同比增长也回落到

14.3%。另一方面，先后多次下调 MLF 利率，通过利率走廊机制降低货币市场资金利率，保持资金面平稳。与此同时，政府着力实施供给侧结构性改革，推动去杠杆去产能，大宗商品和房地产反弹，债市特别是信用债市场承压。

上证综指半年下跌 17.22%，中证转债指数下跌 11.9%，中债综合指数下跌 0.21%。

在报告期，本基金配置较短期限债券；并且灵活投资股票，在防御中追求股票市场和债市市场的收益。

#### 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-1.69%，同期业绩比较基准增长率为-0.21%。本基金落后基准 1.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从中长期来看我国经济总供需不匹配仍将持续，一方面在地方政府受制于债务压力和财政收入下降，财政投资发力难以为继；海外经济形势动荡对出口企业带来压力；另一方面过生产能状况并未得到显著缓解，虽然国家出台钢铁、煤炭等过剩行业的产能淘汰规划，但落实规划仍是漫长过程，企业盈利情况仍难大幅改善，社会整体资产回报率仍将持续下降。而随着房地产销售和投资增速以及商品价格从一季度过热的形势中逐渐趋缓，大类资产配置的风险偏好开始下降。

我们认为央行在汇率政策和利率政策上会继续顺应市场趋势，一方面逐步引导市场利率下行，同时增强汇率的市场化形成机制，引导实际有效汇率向合理水平回归。这将在财务成本和需求层面改善实体企业的状况，帮助企业复苏。另一方面，供给侧改革将破局，伴随“僵尸”企业的并购重组，市场出清进程加快。在以上政策合力之下，我们认为虽然经济总量增速可能继续下滑，但优质企业会得到解放，从而经济结构调整得以继续推进。

当前债券收益率呈现显著的平坦化现象。随着各级资管新政的推出，监管套利难度增加，资金成本必将进一步下台阶，推动收益率陡峭化下行。我们认为市场利率易下难上，我们将继续配置中高评级的债券，重点控制信用风险；股票方面继续坚持从下而上选择有良好业绩和合理估值的个股。

## 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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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半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，未发现有关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

2016 年 8 月 26 日

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：金元顺安丰利债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	80,177,141.69	170,127.60
结算备付金		4,392,982.23	949,286.79
存出保证金		209,144.40	28,660.39
交易性金融资产	6.4.7.2	2,610,717,108.12	40,283,392.60
其中：股票投资	6.4.7.2	324,101,686.42	800,656.00
基金投资	6.4.7.2	-	-
债券投资	6.4.7.2	2,286,615,421.70	39,482,736.60
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	100,000,000.00	-
应收证券清算款		-	1,174,714.65
应收利息	6.4.7.5	33,277,648.76	774,145.76
应收股利		-	-
应收申购款		310.00	4,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,828,774,335.20	43,384,327.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015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		146,679,724.73	1,400,000.00
应付证券清算款		15,111,826.03	-
应付赎回款		10,480.68	300.79
应付管理人报酬		1,518,354.39	25,498.75
应付托管费		433,815.55	7,285.33
应付销售服务费		867,631.08	14,570.70
应付交易费用	6.4.7.7	720,505.65	28,291.91
应交税费		704,225.84	704,225.84
应付利息		33,808.86	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	82,072.88	55,000.68
负债合计		166,162,445.69	2,235,174.00

<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,179,149,772.66	33,105,691.16
未分配利润	6.4.7.10	483,462,116.85	8,043,462.63
所有者权益合计		2,662,611,889.51	41,149,153.79
负债和所有者权益总计		2,828,774,335.20	43,384,327.79

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.222 元，基金份额总额 2,179,149,772.66 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金元顺安丰利债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>34,432,843.60</b>	<b>2,350,397.57</b>
1.利息收入		20,832,354.65	1,476,753.03
其中：存款利息收入	6.4.7.11	184,238.77	9,495.54
债券利息收入		20,166,686.40	1,460,730.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		481,429.48	6,527.24
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,806,274.53	1,411,678.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,007,456.81	65,185.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,927,181.73	1,346,255.46
资产支持证券投资收 益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,725,999.45	237.50
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.18	7,787,443.88	-557,597.57
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.19	6,770.54	19,563.65
<b>减：二、费用</b>		<b>9,665,776.78</b>	<b>575,526.83</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,235,433.42	154,999.84

2. 托管费	6.4.10.2.2	1,210,123.86	44,285.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,420,247.70	88,571.32
4. 交易费用	6.4.7.20	1,389,454.13	493.80
5. 利息支出		287,548.41	171,282.54
其中：卖出回购金融资产支出		287,548.41	171,282.54
6. 其他费用	6.4.7.21	122,969.26	115,893.65
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>24,767,066.82</b>	<b>1,774,870.74</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>24,767,066.82</b>	<b>1,774,870.74</b>

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：金元顺安丰利债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	33,105,691.16	8,043,462.63	41,149,153.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	24,767,066.82	24,767,066.82
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)	2,146,044,081.50	450,651,587.40	2,596,695,668.90
其中：1. 基金申购款	2,149,646,439.70	451,424,198.82	2,601,070,638.52
2. 基金赎回款	-3,602,358.20	-772,611.42	-4,374,969.62
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)	2,179,149,772.66	483,462,116.85	2,662,611,889.51
项目	上年度可比期间 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

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：符刃，会计机构负责人：季泽

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

金元顺安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(系金元顺安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。

2015年2月5日，经金元惠理基金管理有限公司股东金元证券股份有限公司及惠理基

金管理香港有限公司以书面表决的方式达成更名决议。金元惠理基金管理有限公司于 2015 年 3 月 6 日完成相关工商变更登记手续，并且变更公司名称为“金元顺安基金管理有限公司”，并于 2015 年 3 月 10 日进行公告。经本基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后，金元惠理丰利债券型证券投资基金相应更名为金元顺安丰利债券型证券投资基金，并于 2015 年 7 月 15 日进行公告。

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。2015 年中信标准普尔指数信息服务(北京)有限公司终止维护中信标普全债指数。本基金管理人经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后，决定自 2015 年 11 月 27 日起，将本基金业绩基准从中信标普全债指数变更为中债综合指数。

#### 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	80,177,141.69
定期存款	-
其他存款	-
合计	80,177,141.69

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		312,008,928.80	324,101,686.42	12,092,757.62
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	197,942,688.21	198,068,421.70	125,733.49
	银行间市场	2,091,900,133.07	2,088,547,000.00	-3,353,133.07
	合计	2,289,842,821.28	2,286,615,421.70	-3,227,399.58
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,601,851,750.08	2,610,717,108.12	8,865,358.04

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所	100,000,000.00	-
合计	100,000,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 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取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	9,591.59
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	1,779.12
应收债券利息	33,266,193.36
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	84.69
合计	33,277,648.76

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	706,884.59
银行间市场应付交易费用	13,621.06
合计	720,505.65

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	23.64
预提信息披露费用	54,700.10
审计费用	27,349.14
合计	82,072.88

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,105,691.16	33,105,691.16
本期申购	2,149,646,439.70	2,149,646,439.70
本期赎回（以“-”号填列）	-3,602,358.20	-3,602,358.20
本期末	2,179,149,772.66	2,179,149,772.66

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 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	8,825,708.45	-782,245.82	8,043,462.63
本期利润	16,979,622.94	7,787,443.88	24,767,066.82
本期基金份额交易产生的变动数	559,119,680.40	-108,468,093.00	450,651,587.40
其中：基金申购款	560,069,398.16	-108,645,199.34	451,424,198.82
基金赎回款	-949,717.76	177,106.34	-772,611.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	584,925,011.79	-101,462,894.94	483,462,116.85

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	161,606.45
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	21,571.33
其他	1,060.99
合计	184,238.77

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	350,659,741.53
减：卖出股票成本总额	344,652,284.72
买卖股票差价收入	6,007,456.81

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	414,239,974.73
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	409,388,155.48
减：应收利息总额	6,779,000.98
债券投资收益	-1,927,181.73

**6.4.7.14 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,725,999.45
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,725,999.45

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	7,787,443.88
——股票投资	12,006,275.10
——债券投资	-4,218,831.22
——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	7,787,443.88

## 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	2,562.57
配股手续费	-
新股手续费返还	-
印花税返还	-
转换费收入	207.97
其他	4,000.00
合计	6,770.54

## 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	1,374,429.13
银行间市场交易费用	15,025.00
合计	1,389,454.13

## 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	27,349.14
信息披露费	54,700.10
银行汇划手续费	18,740.02
转托管费	4,000.00
上市年费	-

持有人大会费用	-
银行间债券账户维护费	9,000.00
账户维护费	9,180.00
其他费用	-
合计	122,969.26

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

2016年3月11日原公司外方股东惠理基金管理香港有限公司将所持有的金元顺安基金管理有限公司49%的股权转让给上海泉意金融信息服务有限公司。变更后公司的股权结构为：金元证券股份有限公司持有51%的股权，上海泉意金融信息服务有限公司持有49%的股权。

##### 6.4.9.2 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	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
上海泉意金融信息服务有限公司	基金管理人的股东
上海金元百利资产管理有限公司	基金管理人的子公司

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期债券成交总

		额的比例		额的比例
金元证券股份有限公司	49,972,993.15	52.20%	69,973,120.17	75.43%

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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%

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%

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。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,235,433.42	154,999.84
其中：支付销售机构的客户维护费	11,194.41	17,033.59

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,210,123.86	44,285.68

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。

#### 6.4.10.2.3 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
	2016年1月1日至2016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	2,344,274.09
农业银行股份有限公司	21,977.64
金元证券股份有限公司	48,777.24
合计	2,415,028.97
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	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

注：a.基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 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。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
期初持有的基金份额	20,000,400.00	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	20,000,400.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.9178%	61.01%

##### 6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末均未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

##### 6.4.10.5 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	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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	80,177,141.69	161,606.45	383,763.24	3,705.97

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，2016年1月1日至2016年6月30日止期间获得的利息收入为人民币 21,571.33 元，2016年6月30日止结算备付金余额为人民币 4,392,982.23 元。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

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末及上年度末均未因认购新发/增发证券而持有流通受限债券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末及上年度末均未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值 总额
101658024	16南方水泥 MTN001	2016-07-07	99.48	500,000	49,740,000.00
011699979	16粤广告 SCP001	2016-07-07	99.82	500,000	49,910,000.00
合计		-	-	1,000,000	99,650,000.00

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 96,500,000.00 元, 其中上交所 4 天正回购期末余额为 70,000,000.00 元, 于 2016 年 7 月 1 日到期; 其中上交所 7 天正回购期末余额为 26,500,000.00 元, 于 2016 年 7 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

##### 6.4.13.2.1 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 2016 年 6 月 30 日	上年末 2015 年 12 月 31 日
A-1	308,433,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	652,302,780.00	2,198,460.00
合计	960,735,780.00	2,198,460.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债和超短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 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	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年末 2015 年 12 月 31 日
AAA	346,638,000.00	17,416,313.20
AAA 以下	647,731,000.00	6,798,200.00
未评级	331,510,641.70	13,069,763.40
合计	1,325,879,641.70	37,284,276.60

注：未评级债券为国债和政策性金融债。

#### 6.4.13.3 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和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部门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。

#### 6.4.13.4 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、外汇风险和市场其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 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、存出保证金、债券投资和买入返售金融资产等，生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	80,177,141.69	-	-	-	80,177,141.69
结算备付金	4,392,982.23	-	-	-	4,392,982.23
存出保证金	209,144.40	-	-	-	209,144.40
交易性金融资产	1,168,496,280.00	842,646,900.00	275,472,241.70	324,101,686.42	2,610,717,108.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	33,277,648.76	33,277,648.76
应收申购款	-	-	-	310.00	310.00
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	100,000,000.00
资产总计	1,353,275,548.32	842,646,900.00	275,472,241.70	357,379,645.18	2,828,774,335.20
负债					
应付赎回费	-	-	-	23.64	23.64
应付管理人报	-	-	-	1,518,354.39	1,518,354.39

酬					
应付托管费	-	-	-	433,815.55	433,815.55
应付交易费用	-	-	-	720,505.65	720,505.65
应付销售服务费	-	-	-	867,631.08	867,631.08
卖出回购金融资产款	146,679,724.73	-	-	-	146,679,724.73
应付利息	-	-	-	33,808.86	33,808.86
应付证券清算款	-	-	-	15,111,826.03	15,111,826.03
其他负债	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	704,225.84	704,225.84
预提费用	-	-	-	82,049.24	82,049.24
应付赎回款	-	-	-	10,480.68	10,480.68
负债总计	146,679,724.73	-	-	19,482,720.96	166,162,445.69
利率敏感度缺口	1,206,595,823.59	842,646,900.00	275,472,241.70	337,896,924.22	2,662,611,889.51
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	170,127.60	-	-	-	170,127.60
结算备付金	949,286.79	-	-	-	949,286.79
存出保证金	28,660.39	-	-	-	28,660.39
交易性金融资产	2,198,460.00	22,572,400.00	14,711,876.60	800,656.00	40,283,392.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,174,714.65	1,174,714.65
应收利息	-	-	-	774,145.76	774,145.76
应收申购款	-	-	-	4,000.00	4,000.00
买入返售金融	-	-	-	-	-

资产					
资产总计	3,346,534.78	22,572,400.00	14,711,876.60	2,753,516.41	43,384,327.79
负债					
应付赎回费	-	-	-	0.68	0.68
应付管理人报酬	-	-	-	25,498.75	25,498.75
应付托管费	-	-	-	7,285.33	7,285.33
应付交易费用	-	-	-	28,291.91	28,291.91
应付销售服务费	-	-	-	14,570.70	14,570.70
卖出回购金融资产款	1,400,000.00	-	-	-	1,400,000.00
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	704,225.84	704,225.84
预提费用	-	-	-	55,000.00	55,000.00
应付赎回款	-	-	-	300.79	300.79
负债总计	1,400,000.00	-	-	835,174.00	2,235,174.00
利率敏感度缺口	1,946,534.78	22,572,400.00	14,711,876.60	1,918,342.41	41,149,153.79

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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 2016 年 6 月 30 日和 2015 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、结算备付金以活期存款利率或定期存款利率计息，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。买入返售金融资产利息收益/卖出回购金融资产的利息支出在交易时确定，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：人民币万元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	市场利率下降1个基点	增加65.65万元	增加2.02万元

市场利率上升1个基点	减少65.62万元	减少2.02万元
------------	-----------	----------

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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。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 2016年6月30日		上年度末 2015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	324,101,686.42	12.17	800,656.00	1.95
交易性金融资产-债券投资	2,286,615,421.70	85.88	39,482,736.60	95.95
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	2,610,717,108.12	98.05	40,283,392.60	97.90

注：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%。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。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合中股票投资的贝塔系数紧密相关。
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。

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：人民币万元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	沪深300指数下跌5%	减少1,659.52万元	减少3.49万元
沪深300指数上涨5%	增加1,659.52万元	增加3.49万元	

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

风险价值（VaR）含义是指：在市场正常波动下，某一金融资产或证券组合的最大可能损失。更为确切的是指，在一定概率水平（置信度）下，某一金融资产或证券组合价值在未来特定时期内的最大可能损失。用公式表示为： $\text{Prob}(\Delta P > \text{VaR}) = 1 - \alpha$  或： $\text{Prob}(\Delta P < \text{VaR}) = \alpha$  其中 Prob 表示：资产价值损失小于可能损失上限的概率。  $\Delta P$  表示：某一金融资产在一定持有期  $\Delta t$  的价值损失额。 VAR 表示：给定置信水平  $\alpha$  下的在险价值，即可能的损失上限。  $\alpha$  为：给定的置信水平。

假设	在 99% 的置信水平下采用风险价值模型来管理风险；		
	以资产负债表日前 120 个交易日为观察期；		
	预测期间本基金的资产组合的结构保持不变；		
	本基金的基金净值日对数收益率服从正态分布。		
分析	风险价值	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	合计	增加1,486.63万元	增加6.46万元

注：上述分析衡量了在 99% 的置信水平下，所持有的权益类资产组合在资产负债表日后一个交易日内由于市场价格风险所导致的最大潜在损失。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

##### 6.4.14.1.1 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。

##### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 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 522,170,108.12 元, 第二层次的余额为人民币 2,088,547,000.00 元, 无属于第三层次的余额。

#### 6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况, 本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

根据中国证券投资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》的规定, 自 2015 年 4 月 10 日起, 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(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, 相关固定收益品种的公允价值所属层级从第一层次转入第二层次。

#### 6.4.14.1.2.3 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。

#### 6.4.14.2 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。

#### 6.4.14.3 其他事项

截至本财务报表批准日, 本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 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	324,101,686.42	11.46
	其中: 股票	324,101,686.42	11.46
2	固定收益投资	2,286,615,421.70	80.83
	其中: 债券	2,286,615,421.70	80.83
	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	100,000,000.00	3.54

	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	84,570,123.92	2.99
7	其他各项资产	33,487,103.16	1.18
8	合计	2,828,774,335.20	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	27,993,881.40	1.05
C	制造业	15,909,736.96	0.60
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	71,784,529.68	2.70
J	金融业	199,983,878.10	7.51
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	8,429,660.28	0.32
S	综合	-	-
	合计	324,101,686.42	12.17

## 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	600036	招商银行	4,519,011	79,082,692.50	2.97

2	601318	中国平安	1,594,003	51,071,856.12	1.92
3	601601	中国太保	1,649,493	44,602,290.72	1.68
4	300287	飞利信	2,814,342	37,712,182.80	1.42
5	300271	华宇软件	1,800,864	34,072,346.88	1.28
6	601699	潞安环能	4,280,410	27,993,881.40	1.05
7	601688	华泰证券	1,333,353	25,227,038.76	0.95
8	600056	中国医药	1,003,136	15,909,736.96	0.60
9	300133	华策影视	541,404	8,429,660.28	0.32

#### 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	601601	中国太保	130,371,318.93	316.83
2	601318	中国平安	118,508,156.96	288.00
3	600036	招商银行	111,380,820.42	270.68
4	601166	兴业银行	66,151,466.66	160.76
5	300143	星河生物	36,669,627.83	89.11
6	300287	飞利信	34,286,744.50	83.32
7	300271	华宇软件	31,930,465.41	77.60
8	601699	潞安环能	26,197,765.00	63.67
9	002675	东诚药业	23,816,303.69	57.88
10	601688	华泰证券	23,698,534.85	57.59
11	600056	中国医药	15,658,808.96	38.05
12	600485	信威集团	13,292,457.68	32.30
13	300133	华策影视	7,955,919.90	19.33
14	000587	金洲慈航	6,055,733.00	14.72
15	000977	浪潮信息	1,874,990.00	4.56
16	600703	三安光电	1,795,587.00	4.36
17	600893	中航动力	1,463,328.25	3.56
18	300113	顺网科技	1,249,841.00	3.04
19	600391	成发科技	1,204,731.00	2.93
20	300065	海兰信	1,204,188.00	2.93

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。

##### 7.4.2 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	601601	中国太保	89,765,328.48	218.15
2	601318	中国平安	69,146,778.71	168.04
3	601166	兴业银行	64,896,775.91	157.71
4	300143	星河生物	38,376,081.14	93.26
5	600036	招商银行	33,865,921.27	82.30
6	002675	东诚药业	24,720,226.63	60.07
7	600485	信威集团	13,532,193.20	32.89
8	000587	金洲慈航	6,636,498.37	16.13
9	000977	浪潮信息	1,612,376.00	3.92
10	600703	三安光电	1,470,278.00	3.57
11	600893	中航动力	1,343,856.00	3.27
12	300113	顺网科技	1,331,026.00	3.23
13	600391	成发科技	1,217,503.00	2.96
14	300065	海兰信	989,003.00	2.40
15	600276	恒瑞医药	747,355.00	1.82
16	002405	四维图新	706,455.82	1.72
17	002657	中科金财	302,085.00	0.73
18			-	-
19			-	-
20			-	-

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。

#### 7.4.3 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	655,947,040.04
卖出股票的收入（成交）总额	350,659,741.53

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	96,159,621.70	3.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	387,383,800.00	14.55

	其中：政策性金融债	387,383,800.00	14.55
4	企业债券	384,181,000.00	14.43
5	企业短期融资券	808,703,000.00	30.37
6	中期票据	610,188,000.00	22.92
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,286,615,421.70	85.88

#### 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	150218	15 国开 18	1,500,000	154,725,000.00	5.81
2	101552037	15 中油股 MTN002	1,000,000	102,780,000.00	3.86
3	011699579	16 魏桥铝电 SCP006	1,000,000	100,240,000.00	3.76
4	011699794	16 鄂能源股 SCP001	1,000,000	100,070,000.00	3.76
5	041654030	16 河钢 CP003	1,000,000	99,400,000.00	3.73

#### 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投资资产支持证券。

#### 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投资贵金属。

#### 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投资权证。

#### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期有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、关于招商银行（代码：600036）的处罚说明

2016 年 1 月 6 日吉林证监局对招商银行股份有限公司长春分行采取责令改正措施的决定，具体内容如下：

我局于 2015 年 12 月 3 日至 12 月 7 日对你行进行了基金销售业务专项检查，经查，发现你行存在以下问题：

一、你行未及时在网站更新基金销售人员资格情况，不符合中国证监会公告〔2008〕31 号第二部分第四条“各基金销售机构应当在 2009 年 1 月底前，将全部基金销售网点及销售人员资格情况在公司网站上披露，同时抄报中国证券业协会。今后每年的 1 月和 7 月基金销售机构应当对以上信息进行更新并报送中国证券业协会”的规定。

二、你行部分从事基金销售业务的人员未取得基金销售业务资格，不符合《证券投资基金销售管理办法》第五十七条第二款“宣传推介基金的人员、基金销售信息管理平台系统运营维护人员等从事基金销售业务的人员应当取得基金销售业务资格”的规定。

三、你行《投资人权益须知》的内容未包括投资者投诉方式和程序，不符合《证券投资基金销售机构内部控制指导意见》第二十七条“基金销售机构制定《投资人权益须知》，内容至少应当包括：……（五）向基金销售机构、自律组织以及监管机构的投诉方式和程序”的规定。

四、你行在基金宣传推介材料中登载有个人的推荐性文字，不符合《证券投资基金销售管理办法》第三十五条“基金宣传推介材料必须真实、准确，与基金合同、基金招募说明书相符，不得有下列情形：……（六）登载单位或者个人的推荐性文字”的规定。

现要求你行对上述行为进行整改，并于 2016 年 1 月 31 日前向我局提交整改情况的书面报告，我局将组织检查验收。

如果对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 3 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

现作出说明如下：

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

B. 基金经理遵循价值投资理念，看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。我们判断此次事件对公司短期负面影响有限，再者公司经营多元化，涉及多个领域，受到处罚不会对整体的业绩造成持续的影响，因此买入并持有公司股票。

## 2、关于华泰证券（代码：601688）的处罚说明

华泰证券股份有限公司（以下简称“公司”）于 2015 年 8 月 24 日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（编号：渝证调查字 2015004 号），因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证券监督管理委员会决定对公司进行立案调查。

现作出说明如下：

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

B. 基金经理遵循价值投资理念，看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。我们判断此次事件对公司短期负面影响有限，公司对出现的问题高度重视，进一步加强内部管理，日常经营活动一切正常，因此买入并持有公司股票。

## 3、关于中国医药（代码：600056）的处罚说明

中国医药健康产业股份有限公司（以下简称“公司”）副总经理年大明因个人涉嫌经济问题，目前依法接受河南省检察机关调查，相关工作正在进行中，如后期涉及信息披露事项，公司将按照有关规定，及时发布公告。

现作出说明如下：

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

B. 基金经理遵循价值投资理念，看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。我们判断此次事件对公司短期负面影响有限，公司对出现的问题高度重视，进一步加强内部管理，日常经营活动一切正常，因此买入并持有公司股票。

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	209,144.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	33,277,648.76
5	应收申购款	310.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,487,103.16

#### 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。

## 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

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
1,006	2,166,152.86	2,168,882,629.91	99.53%	10,267,142.75	0.47%

### 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	1,021.37	0.00005%

### 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

报告期末本公司高管及投研部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

## 9 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	33,105,691.16
本报告期基金总申购份额	2,149,646,439.70
减：本报告期基金总赎回份额	3,602,358.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,179,149,772.66

## 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 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	
方正证券股份有限公司	1	382,543,572.30	38.00%	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	345,628,752.32	34.34%	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	153,607,370.06	15.26%	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	57,536,640.66	5.72%	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	56,840,230.41	5.65%	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	10,450,215.82	1.04%	-	-	-
金元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	-
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	1	-	-	-	-	-

券股份有限 公司						
-------------	--	--	--	--	--	--

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 2016 年 6 月 30 日止，本基金新租用国信证券股份有限公司 1 个深圳交易单元。

**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
方正证券股份有限公司	44,335,220.94	46.31%	2,084,700,000.00	72.70%	-	-
招商证券股份有限公司	1,380,719.38	1.44%	613,000,000.00	21.38%	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	170,000,000.00	5.93%	-	-
兴业证券股	-	-	-	-	-	-

份有限公司						
东方证券股 份有限公司	53,868.90	0.06%	-	-	-	-
金元证券股 份有限公司	49,972,993.15	52.20%	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 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	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

### 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	金元顺安丰利债券型证券投资基金2015年第4季度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》和 www.jyvpfund.com	2016-01-21
2	金元顺安丰利债券型证券投资基金2015年年度报告（正文）	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》和 www.jyvpfund.com	2016-03-29
3	金元顺安丰利债券型证券投资基金2015年年度报告（摘要）	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》和 www.jyvpfund.com	2016-03-29

4	金元顺安丰利债券型证券投资基金2016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	2016-04-21
5	金元顺安丰利债券型证券投资基金更新招募说明书[2016年1号]摘要	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》和 www.jyvpfund.com	2016-05-06
6	金元顺安丰利债券型证券投资基金更新招募说明书[2016年1号]	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》和 www.jyvpfund.com	2016-05-06

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、《金元顺安丰利债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《金元顺安丰利债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、《金元顺安丰利债券型证券投资基金招募说明书》。

### 11.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室

### 11.3 查阅方式

<http://www.jysa99.com>

金元顺安基金管理有限公司  
二〇一六年八月二十七日