

金元顺安丰利债券型证券投资基金
2017 年半年度报告摘要

2017 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：二〇一七年八月二十六日

§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 2017 年 8 月 25 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§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	2,229,179,414.48 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在注重资产安全性和流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的稳健收益和总回报。
投资策略	基于“自上而下”的原则，本基金采用久期控制下的主动性投资策略，并本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。经过对历史数据的统计分析发现，债券市场收益率受到宏观经济形势和债券市场供需两方面不同程度的影响，因此本基金在债券投资过程中，将采用若干定量模型来对宏观和市场两方面数据进行分析，并运用适当的策略来构建债券组合。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金系债券型基金，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
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@jysa99.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-666-0666	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》、《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	本基金管理人、基金托管人办公地址

§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（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	30,962,242.13
本期利润	70,325,402.49
加权平均基金份额本期利润	0.0315
本期加权平均净值利润率	3.00%
本期基金份额净值增长率	3.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017年6月30日）
期末可供分配利润	151,054,276.71
期末可供分配基金份额利润	0.0678
期末基金资产净值	2,380,233,691.19
期末基金份额净值	1.068
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017年6月30日）
基金份额累计净值增长率	29.69%

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、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。

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	1.52%	0.17%	0.90%	0.06%	0.62%	0.11%
过去三个月	3.59%	0.27%	-0.88%	0.08%	4.47%	0.19%
过去六个月	3.09%	0.22%	-2.11%	0.08%	5.20%	0.14%
过去一年	3.89%	0.18%	-3.50%	0.10%	7.39%	0.08%
过去三年	25.95%	0.26%	6.87%	0.12%	19.08%	0.14%
自基金成立起至今	29.69%	0.27%	24.67%	0.08%	5.02%	0.19%

注：

- 1、本基金合同生效日为 2009 年 3 月 23 日，业绩基准累计增长率以 2009 年 3 月 22 日指数为基准；
- 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%；
- 3、本基金在 2015 年 11 月 27 日将基金业绩比较基准由“中信标普全债指数”更改为“中债综合指数”。

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 2017 年 6 月 30 日）



注：

- 1、本基金合同生效日为 2009 年 3 月 23 日，业绩基准累计增长率以 2009 年 3 月 22 日指数为基准；
- 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%。

§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（以下简称“金元顺安”）成立于 2006 年 11 月，由金元证券股份有限公司（以下简称“金元证券”）与比利时联合资产管理公司（以下简称“比联资管”）共同发起设立的中外合资基金管理有限公司。公司总部设在上海陆家嘴，旗下设立了北京分公司，以及一个子公司——上海金元百利资产管理有限公司。

2012 年 3 月，经中国证监会核准，比联资管将所持有的 49% 股权转让于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。

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，公司注册资本增加至 24,500 万元。

2016 年 3 月，经中国证监会核准，惠理香港将所持有的 49% 股权转让于上海泉意金融信息服务有限公司（以下简称“泉意金融”），公司更名为金元顺安基金管理有限公司（以下简称“金元顺安”）。

金元顺安始终坚持以“取信于市场、取信于社会”作为行为准则，遵循“诚实信用，勤勉尽责，以专业经营方式管理和运作基金财产和客户资产，在合法、合规的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，从而使公司稳步、健康发展”的投资理念。遵守法律、行政法规和中国证券监督管理委员会的规定，遵守社会公德、商业道德，诚实守信，遵循基金份额持有人利益优先、公平对待其管理的不同基金财产和客户资产的原则，接受政府和社会公众的监督，承担社会责任。

截止至 2017 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、金元顺安金元宝货币市场基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金、金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安核盛债券型证券投资基金和金元顺安核泰债券型证券投资基金共 14 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	-	10	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、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安沅楹债券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。10 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》、《金元顺安丰利债券型证券投资基金基金合同》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

本基金管理人高度重视投资者利益保护。本报告期内，本基金管理人严格遵守公司投资交易业务流程及公平交易制度。公司投资交易行为监控体系由稽核监察部和交易室监督，确保公平交易制度的

执行和实现。

本报告期内，本基金管理人对旗下开放式基金与其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》及其他相关法律法规和公司内部规章制度，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》，涵盖了所有可投资证券的一级市场申购、二级市场交易所公开竞价交易、交易所大宗交易、银行间债券交易以及非公开发行股票申购、以公司名义进行的一级市场债券交易等可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本基金管理人采用定量分析和定性分析相结合的方式，建立并严格执行有效的异常交易日常监控制度，形成定期交易监控报告，按照报告路线实行及时报告的机制。本报告期内，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

2017 年上半年经济增速底部企稳，GDP 同比增长 6.9%，比去年年底有所回升。分项看，上半年固定资产投资同比增速回升至 8.6%，其中房地产开发投资和制造业投资增速分别回升至 8.5% 和 5.5%，而基础设施建设投资增速有所下滑至 16.85%；社会消费品零售总额依然保持稳健，半年增速 10.4% 说明消费需求依然较强。工业增加值回升至 6.9%，PMI 指数持续维持在 51 以上，CPI 累计同比增长 1.41%，PPI 在供给侧改革背景下同比大幅转正，上半年累计同比增长 6.60%，反应实体经济企稳。

上半年央行采取中性偏紧的货币政策，政策监管和金融去杠杆成为市场主基调，部分银行同业存单在 6 月中下旬甚至突破 5% 的高位。在此环境下，上半年 M2 同比增长 9.4%，首度落入个位数增长区间，显示金融监管大有成效。

上证综指半年上涨 2.86%，中证转债上涨 2.58%，中债综合指数下跌 2.11%。

在报告期，本基金配置较短期限债券并灵活投资股票，防御中追求收益。

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 3.09%，同期业绩比较基准增长率为 -2.11%。本基金超越基准 5.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前供给侧改革成效显著，海外经济也持续复苏，国内工业品价格持续走强，企业盈利大幅好转，工业增加值同比持续回升，制造业投资也有回暖。受益于棚改货币化，三四线城市的地产投资走强对实体经济构成一定支撑。货币政策与流动性方面，防范金融风险仍是主线，货币政策放松的可能性不大，但维稳形势下整体流动性也不会太紧。

当前债券收益率曲线显得十分平坦，一方面在中性偏紧的资金面环境下短端利率维持在相对高位，而长端利率在经济中长期悲观预期下稳定在一定水平，不过伴随经济数据连续出现强劲表现，市场对基本面的判断或出现一定分歧，带动长端收益率上行。但从中长期看，国内经济结构仍有失衡问题，新周期可能难以出现，因此短期内我们还是选择防御策略为主，等待时机。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

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。估值工作小组由分管运营的副总经理、基金事务部、投资研究部、交易部、监察稽核部等部门总监组成。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。

分管运营的副总经理担任估值工作小组的组长，分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。

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时，可以提议召开估值工作小组会议。

3、投资研究部的职责分工

- (1) 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问询；
- (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、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。

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 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：2017 年 6 月 30 日

金额单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,778,287.57	139,879,683.78
结算备付金		2,945,256.22	2,923,561.37
存出保证金		394,918.57	609,142.99
交易性金融资产	6.4.7.2	2,654,326,109.13	2,517,341,908.46
其中：股票投资	6.4.7.2	446,270,063.08	93,784,632.66
基金投资	6.4.7.2	-	-
债券投资	6.4.7.2	2,208,056,046.05	2,423,557,275.80
资产支持证券投资	6.4.7.2	-	-
贵金属投资	6.4.7.2	-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	32,398,163.32	44,875,987.09
应收股利		-	-
应收申购款		39.96	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,692,842,774.77	2,705,630,283.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016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		308,548,817.17	347,999,731.50
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		11,826.92	16.41
应付管理人报酬		1,356,618.11	1,695,445.15
应付托管费		387,605.17	484,412.90
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,301,337.83	1,108,481.21
应交税费		704,225.84	704,225.84
应付利息		167,238.47	178,965.28
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	131,414.07	55,000.04
负债合计		312,609,083.58	352,226,278.33
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,229,179,414.48	2,272,415,295.36
未分配利润	6.4.7.10	151,054,276.71	80,988,710.00

所有者权益合计		2,380,233,691.19	2,353,404,005.36
负债和所有者权益总计		2,692,842,774.77	2,705,630,283.69

注：

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.068 元，基金份额总额 2,229,179,414.48 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

金额单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		88,281,513.10	34,432,843.60
1.利息收入		51,706,973.39	20,832,354.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	175,395.39	184,238.77
债券利息收入		50,891,643.67	20,166,686.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		639,934.33	481,429.48
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,859,917.76	5,806,274.53
其中：股票投资收益	6.4.7.12	36,446,649.88	6,007,456.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-42,785,481.69	-1,927,181.73
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	3,478,914.05	1,725,999.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	39,363,160.36	7,787,443.88
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	71,297.11	6,770.54
减：二、费用		17,956,110.61	9,665,776.78
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	8,128,832.07	4,235,433.42
2.托管费	6.4.10.2.2	2,322,523.36	1,210,123.86
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	2,420,247.70
4.交易费用	6.4.7.20	2,413,875.41	1,389,454.13
5.利息支出		4,910,620.53	287,548.41
其中：卖出回购金融资产支出		4,910,620.53	287,548.41
6.其他费用	6.4.7.21	180,259.24	122,969.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		70,325,402.49	24,767,066.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		70,325,402.49	24,767,066.82

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	2,272,415,295.36	80,988,710.00	2,353,404,005.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,325,402.49	70,325,402.49
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）	-43,235,880.88	-259,835.78	-43,495,716.66
其中：1.基金申购款	48,972,913.13	3,275,501.32	52,248,414.45
2.基金赎回款	-92,208,794.01	-3,535,337.10	-95,744,131.11
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）	2,229,179,414.48	151,054,276.71	2,380,233,691.19
项目	上年度可比期间 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
-----------------	------------------	----------------	------------------

报表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，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 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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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、会计估计与上年度会计报表相一致。

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、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值

税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

4、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]132 号《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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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 关联方关系

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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	136,452,403.02	59.45%	49,972,993.15	52.20%

6.4.8.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付的关联方佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,128,832.07	4,235,433.42
其中：支付销售机构的客户维护费	40,042.67	11,194.41

注：

1、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。

2、基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

6.4.8.2.2 基金托管费

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,322,523.36	1,210,123.86

注：

1、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。

2、基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.8.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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

注：

1、2016 年 7 月 18 日前，基金的销售服务费按前一日的基金资产净值的 0.40% 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：

$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$ ，

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。

2、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。

3、自 2016 年 7 月 18 日起，本基金不再计提销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	17,500,400.00	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	-	2,500,000.00
期末持有的基金份额	17,500,400.00	17,500,400.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.79%	0.77%

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末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的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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	2,778,287.57	102,635.59	80,177,141.69	161,606.45

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，2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间获得的利息收入为人民币 29,138.60 元，2017 年 6 月 30 日止结算备付金余额为人民币 2,945,256.22 元。

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002409	雅克科技	2017-04-24	重大资产重组	21.13	-	-	288,500	6,682,485.04	6,096,005.00	-
300271	华宇软件	2017-06-22	拟披露重大事项	16.59	2017-07-04	16.80	1,557,656	24,946,201.68	25,841,513.04	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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
011756017	17 三安 SCP002	2017-07-03	99.98	300,000	29,994,000.00
041670004	16 怡亚通 CP001	2017-07-03	100.69	200,000	20,138,000.00

120227	12 国开 27	2017-07-04	100.51	200,000	20,102,000.00
150406	15 农发 06	2017-07-04	99.92	800,000	79,936,000.00
011753037	17 义乌国资 SCP002	2017-07-04	100.41	400,000	40,164,000.00
011756030	17 昆山国创 SCP002	2017-07-04	100.13	300,000	30,039,000.00
041767005	17 云工投 CP001	2017-07-04	99.99	50,000	4,999,500.00
101658065	16 龙盛 MTN001	2017-07-04	96.77	400,000	38,708,000.00
011754038	17 金隅 SCP002	2017-07-05	100.28	500,000	50,140,000.00
合计		-	-	3,150,000	314,220,500.00

注：

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 308,548,817.47 元，于 2017 年 7 月 5 日到期。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1 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。

6.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 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 418,811,578.09 元，第二层次的余额为人民币 2,235,514,531.04 元，无属于第三层次的余额。（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。）

6.4.10.1.2.2 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。

6.4.10.1.2.3 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。

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 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	446,270,063.08	16.57
	其中：股票	446,270,063.08	16.57
2	固定收益投资	2,208,056,046.05	82.00
	其中：债券	2,208,056,046.05	82.00
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,723,543.79	0.21
7	其他各项资产	32,793,121.85	1.22
8	合计	2,692,842,774.77	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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

C	制造业	321,067,292.54	13.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	49,876,061.28	2.10
F	批发和零售业	24,462,000.00	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	8,054,520.28	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,810,188.98	1.80
J	金融业	-	-
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	446,270,063.08	18.75

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

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	000333	美的集团	1,437,251	61,859,283.04	2.60
2	000858	五粮液	923,460	51,399,783.60	2.16
3	600068	葛洲坝	4,437,372	49,876,061.28	2.10
4	600089	特变电工	4,246,817	43,869,619.61	1.84
5	002705	新宝股份	2,415,945	36,311,653.35	1.53
6	002242	九阳股份	1,534,842	30,190,342.14	1.27
7	000568	泸州老窖	573,729	29,019,212.82	1.22
8	300271	华宇软件	1,557,656	25,841,513.04	1.09
9	002007	华兰生物	697,147	25,445,865.50	1.07
10	600511	国药股份	675,000	24,462,000.00	1.03
11	002043	兔宝宝	1,672,151	23,142,569.84	0.97
12	300287	飞利信	1,553,583	14,261,891.94	0.60
13	000768	中航飞机	657,431	12,123,027.64	0.51
14	002409	雅克科技	288,500	6,096,005.00	0.26
15	600548	深高速	528,832	4,780,641.28	0.20
16	600350	山东高速	528,045	3,273,879.00	0.14
17	002279	久其软件	215,680	2,706,784.00	0.11
18	300282	汇冠股份	76,300	1,609,930.00	0.07

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	600717	天津港	193,333,749.95	8.22
2	000333	美的集团	59,967,962.03	2.55
3	600350	山东高速	57,700,212.44	2.45
4	600548	深高速	54,871,016.91	2.33
5	002242	九阳股份	53,378,425.31	2.27
6	300230	永利股份	51,232,081.58	2.18
7	600759	洲际油气	50,651,774.00	2.15
8	000858	五粮液	49,743,457.58	2.11
9	600089	特变电工	49,210,858.00	2.09
10	600068	葛洲坝	48,686,159.60	2.07
11	600160	巨化股份	47,201,098.24	2.01
12	300067	安诺其	35,877,372.03	1.52
13	601601	中国太保	35,123,764.84	1.49
14	002705	新宝股份	35,118,430.59	1.49
15	600018	上港集团	32,520,409.37	1.38
16	300282	汇冠股份	30,623,605.41	1.30
17	000568	泸州老窖	28,541,654.70	1.21
18	000671	阳光城	26,782,285.00	1.14
19	002007	华兰生物	25,300,715.95	1.08
20	300271	华宇软件	24,946,201.68	1.06

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	600717	天津港	257,866,211.84	10.96
2	000671	阳光城	94,228,051.45	4.00
3	600160	巨化股份	48,805,246.72	2.07
4	600759	洲际油气	48,337,455.10	2.05
5	300230	永利股份	48,152,799.63	2.05
6	600350	山东高速	47,115,589.79	2.00
7	600548	深高速	46,173,603.98	1.96
8	601601	中国太保	33,807,946.00	1.44
9	600018	上港集团	32,581,200.73	1.38
10	300067	安诺其	31,355,385.28	1.33
11	002434	万里扬	24,920,970.11	1.06
12	603328	依顿电子	24,526,128.51	1.04
13	000905	厦门港务	23,240,027.00	0.99
14	601211	国泰君安	22,913,443.29	0.97
15	300282	汇冠股份	22,398,206.34	0.95
16	002531	天顺风能	22,274,818.23	0.95
17	002279	久其软件	22,193,434.40	0.94
18	000778	新兴铸管	21,239,094.45	0.90
19	002242	九阳股份	21,040,871.28	0.89
20	000429	粤高速 A	20,393,707.66	0.87

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	1,331,193,011.34
卖出股票的收入（成交）总额	1,029,105,608.02

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	50,681,600.00	2.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	280,026,000.00	11.76
	其中：政策性金融债	280,026,000.00	11.76
4	企业债券	314,043,900.00	13.19
5	企业短期融资券	961,475,000.00	40.39
6	中期票据	538,589,000.00	22.63
7	可转债	4,836,546.05	0.20
8	同业存单	58,404,000.00	2.45
9	其他	-	-
10	合计	2,208,056,046.05	92.77

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	120227	12 国开 27	1,000,000	100,510,000.00	4.22
2	011751024	17 邮政集团 SCP001	1,000,000	100,250,000.00	4.21
3	018005	国开 1701	1,000,000	99,580,000.00	4.18
4	150406	15 农发 06	800,000	79,936,000.00	3.36
5	101360021	13 陕煤化 MTN002	500,000	51,335,000.00	2.16

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未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	394,918.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,398,163.32
5	应收申购款	39.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,793,121.85

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	4,201,749.30	0.18
2	128013	洪涛转债	177,283.75	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300271	华宇软件	25,841,513.04	1.09	拟披露重大事项

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
1,547	1,440,969.24	2,219,467,869.23	99.56%	9,711,545.25	0.44%

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	4,184.99	0.00019%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有份额总数（份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

份额单位：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	2,272,415,295.36
本报告期基金总申购份额	48,972,913.13
减：本报告期基金总赎回份额	92,208,794.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,229,179,414.48

§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，本基金未举行基金份额持有人大会。

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

1、本基金管理人于 2017 年 1 月 23 日公告，《金元顺安金通宝货币市场基金基金合同》正式生效，闵杭先生担任该基金的基金经理；

2、本基金管理人于 2017 年 1 月 26 日公告，增聘郭建新先生担任金元顺安金通宝货币市场基金的基金经理；

3、本基金管理人于 2017 年 3 月 25 日公告，聘任陈嘉楠女士担任公司副总经理。

4、本基金管理人于 2017 年 3 月 31 日公告，《金元顺安桉盛债券型证券投资基金基金合同》正式生效，闵杭先生担任该基金的基金经理；

5、本基金管理人于 2017 年 4 月 6 日公告，增聘郭建新先生担任金元顺安桉盛债券型证券投资基金的基金经理；

6、本基金管理人于 2017 年 6 月 10 日公告，《金元顺安桉泰债券型证券投资基金基金合同》正式生效，闵杭先生担任该基金的基金经理；

7、本基金管理人于 2017 年 6 月 20 日公告，增聘郭建新先生担任金元顺安桉泰债券型证券投资基金的基金经理；

8、本基金管理人于 2017 年 6 月 29 日公告，增聘孔祥鹏先生担任金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；

9、本基金管理人于 2017 年 6 月 29 日公告，增聘孔祥鹏先生担任金元顺安新经济主题混合型证券投资基金的基金经理。

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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，未发生涉及本基金管理人、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	
恒泰证券股份有限公司	2	2,046,166,817.46	86.69%	868,157.62	75.20%	-
国信证券股份有限公司	1	314,119,691.90	13.31%	286,256.95	24.80%	-
金元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

兴业证券股份有限公司	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	-	-	-	-	-
中国中投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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：

（1）选择标准

1) 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。

2) 公司资信状况较好，无重大不良记录。

3) 公司经营规范，能满足基金运作的合法、合规需求。

4) 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。

(2) 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 2017 年 6 月 30 日止，本基金新租用海通证券股份有限公司 1 个上海交易单元、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
恒泰证券股份有限公司	93,064,677.08	40.55%	2,349,200,000.00	100.00%	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	136,452,403.02	59.45%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

股份有限公司						
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	-	-	-	-	-	-
中国中投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

份额单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017 年 1 月 1 日-2017 年 6 月 30 日	882,426,835.72	-	-	882,426,835.72	39.59%
机构	2	2017 年 1 月 1 日-2017 年 6 月 30 日	479,952,901.18	-	-	479,952,901.18	21.53%
产品特有风险							
<ul style="list-style-type: none"> 持有份额比例较高的投资者（“比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。 基金净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 							

金元顺安基金管理有限公司

二〇一七年八月二十六日