

金元顺安保本混合型证券投资基金
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	
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	
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	511,339,992.98 份	
下属分级基金的基金简称	A 类份额	C 类份额
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	16,954,604.34 份	494,385,388.64 份

注：

- 1、本基金合同生效日为 2011 年 8 月 16 日；
- 2、本基金第一个保本周期为 3 年，自 2011 年 8 月 16 日起至 2014 年 8 月 15 日。建仓期自 2011 年 8 月 16 日起至 2012 年 2 月 15 日，在建仓期和本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日；
- 3、本基金第二个保本周期为 3 年，自 2014 年 9 月 23 日起至 2017 年 9 月 22 日。过渡期自 2014 年 8 月 18 日起至 2014 年 9 月 22 日。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日；
- 4、本基金自 2015 年 6 月 2 日起，新增 C 类份额。

2.2 基金产品说明

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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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	本基金系保本基金，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	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）	
	A 类份额	C 类份额
本期已实现收益	966,329.37	24,270,495.44
本期利润	1,539,305.61	35,351,951.51
加权平均基金份额本期利润	0.0772	0.0765
本期加权平均净值利润率	7.13%	7.04%
本期基金份额净值增长率	7.38%	7.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017 年 6 月 30 日）	
	A 类份额	C 类份额
期末可供分配利润	3,625,653.98	59,233,498.00
期末可供分配基金份额利润	0.2138	0.1198
期末基金资产净值	19,013,508.03	553,618,886.64
期末基金份额净值	1.121	1.120
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017 年 6 月 30 日）	
	A 类份额	C 类份额
基金份额累计净值增长率	25.95%	4.58%

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。

5、本基金 A 类份额累计净值增长率计算起始日为 2011 年 8 月 16 日，C 类份额累计净值增长率计算起始日为 2016 年 9 月 19 日。

6、本基金自 2015 年 6 月 2 日起，新增 C 类份额。

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

A 类份额

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	0.90%	0.14%	0.23%	0.01%	0.67%	0.13%
过去三个月	5.75%	0.35%	0.69%	0.01%	5.06%	0.34%
过去六个月	7.38%	0.32%	1.36%	0.01%	6.02%	0.31%
过去一年	5.06%	0.26%	2.75%	0.01%	2.31%	0.25%
过去三年	13.23%	0.17%	9.60%	0.01%	3.63%	0.16%
自基金成立起至今	25.95%	0.17%	21.94%	0.01%	4.01%	0.16%

C 类份额

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	0.90%	0.16%	0.23%	0.01%	0.67%	0.15%
过去三个月	5.66%	0.35%	0.69%	0.01%	4.97%	0.34%
过去六个月	7.28%	0.32%	1.36%	0.01%	5.92%	0.31%

自基金成立 起至今	4.58%	0.29%	2.18%	0.01%	2.40%	0.28%
--------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

注：

- 1、本基金合同生效日为 2011 年 8 月 16 日；
- 2、本基金第一个保本周期为 3 年，自 2011 年 8 月 16 日起至 2014 年 8 月 15 日。建仓期自 2011 年 8 月 16 日起至 2012 年 2 月 15 日，在建仓期和本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日；
- 3、本基金第二个保本周期为 3 年，自 2014 年 9 月 23 日起至 2017 年 9 月 22 日。过渡期自 2014 年 8 月 18 日起至 2014 年 9 月 22 日。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日；
- 4、本基金自 2015 年 6 月 2 日起，新增 C 类份额；
- 5、本基金 A 类份额基准累计增长率以 2011 年 8 月 15 日收益率为基准，C 类份额基准累计增长率以 2016 年 9 月 16 日收益率为基准；
- 6、本基金业绩比较基准为“三年期银行定期存款税后收益率”。

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

金元顺安保本混合型证券投资基金

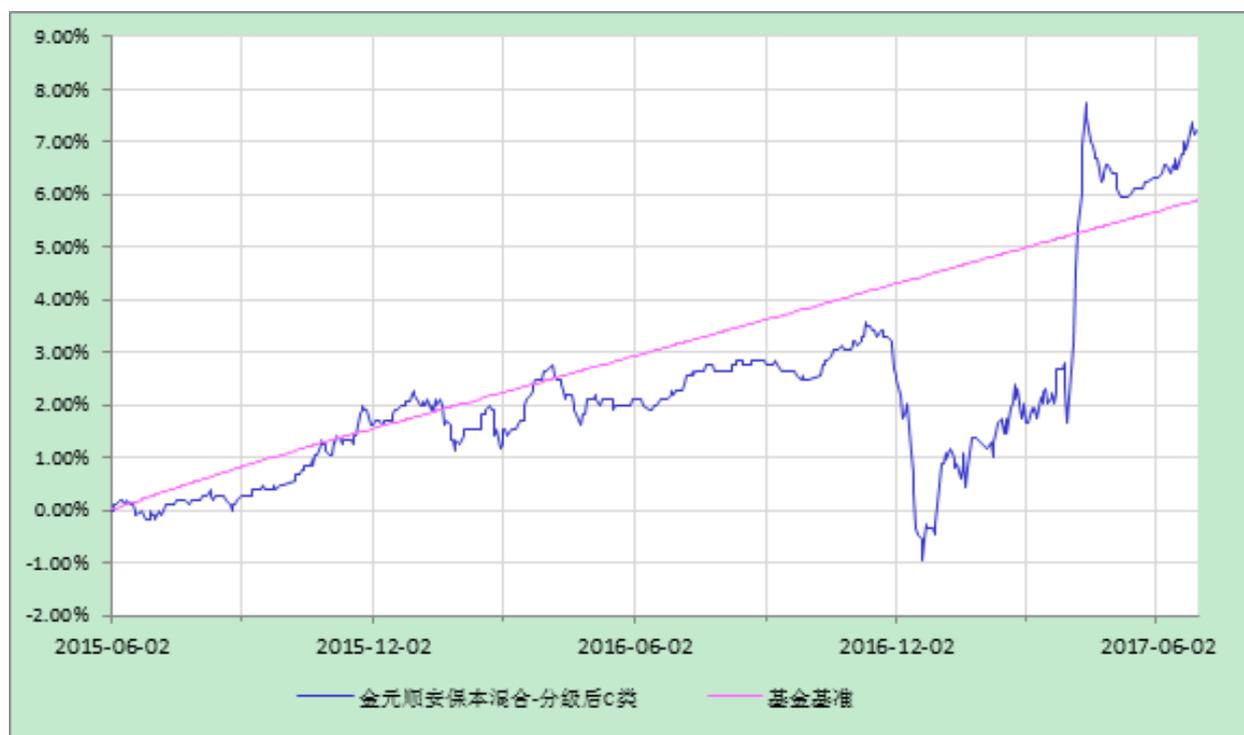
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 8 月 16 日至 2017 年 6 月 30 日)

A 类份额



C 类份额



注：

- 1、本基金合同生效日为 2011 年 8 月 16 日；
- 2、本基金第一个保本周期为 3 年，自 2011 年 8 月 16 日起至 2014 年 8 月 15 日。建仓期自 2011

年 8 月 16 日起至 2012 年 2 月 15 日，在建仓期和本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日；

3、本基金第二个保本周期为 3 年，自 2014 年 9 月 23 日起至 2017 年 9 月 22 日。过渡期自 2014 年 8 月 18 日起至 2014 年 9 月 22 日。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日；

4、本基金自 2015 年 6 月 2 日起，新增 C 类份额；

5、本基金 A 类份额基准累计增长率以 2011 年 8 月 15 日收益率为基准，C 类份额基准累计增长率以 2016 年 9 月 16 日收益率为基准。

§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	2012-07-18	-	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的基金经理，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》、《金元顺安保本混合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

上半年我国经济基本面表现出良好的韧性，PMI 维持高位。各主要商品的供给侧改革仍在持续，力度超出预期，叠加秋季需求旺季以及冬季环保限产，预期后续将对债券市场带来持续的压力，基本面拐点短时难以显现。此外，在商品大涨背景下，须密切关注上游价格上涨是否有传导至 CPI 的迹象；资金面上，虽然去杠杆是金融监管的主基调，但央行维持了温和去杠杆的态度，预期后续资金面仍将维持“不松不紧”的局面。

操作上，短久期的债券仍有不错的绝对收益，且在资金面“不松不紧”的情况下，期限利差有望继续朝着有利于短债的方向前进，本基金将继续保持较低的组合久期，以流动性较好的高等级信用债和利率债为主，获取票息收益。

股市方面，上半年上证综合指数上涨 2.83%；中债总全价指数下跌 2.47%。

在报告期，本基金采取短久期债券策略，规避债市下跌的风险；股票方面精选业绩良好低估值的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

基金 A 份额净值增长率为 7.38%，业绩比较基准 1.36%；基金超过业绩比较基准 6.02%；基金 C 份

额净值增长率 7.28%，同期业绩比较基准增长率为 1.36%，基金超过基准 5.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前全球各经济体处于不同的周期，影响金融市场的因素比较复杂。具体看，美国就业市场和通胀水平接近政策目标，但特朗普上台后政策推行不及预期，各项经济指标喜忧参半。欧元区复苏步伐在加强，表现超出预期，其央行也表态“再通胀”替代通缩风险。在全球货币政策趋紧的背景下，6 月末主要经济体 10 年国债利率水平大幅攀升，中国货币政策放松空间受到制约。

目前经济基本面表现出良好的韧性，而长远看，随着房地产调控政策的深入，以及金融去杠杆的推进，四季度经济可能出现稳中趋缓的态势。

在这样复杂的经济形势下，我们认为三季度流动性继续保持不紧不松状态，金融市场宽幅震荡，应该采取短久期防御策略，以获取票息收益为主要手段，同时积极参与波段性的交易机会。信用债方面，将坚持选择高评级信用债，防范信用风险。

股市方面，我们预期股市有结构性行情，将坚持基本面研究思路，坚持自下而上选择优质个股，以及灵活调整仓位。

我们将按照以上思路投资债券和股票，同时严格控制仓位和久期，按照保本基金 CPPI 模型的要求进行投资，保证资产的安全。

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：金元顺安保本混合型证券投资基金

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	695,337.49	10,202,143.66
结算备付金		107,560.77	355,381.52
存出保证金		134,688.93	33,421.57
交易性金融资产	6.4.7.2	573,227,810.76	331,776,288.81
其中：股票投资	6.4.7.2	89,337,810.76	85,641,911.71
基金投资	6.4.7.2	-	-
债券投资	6.4.7.2	483,890,000.00	246,134,377.10
资产支持证券投资	6.4.7.2	-	-
贵金属投资	6.4.7.2	-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	50,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,422,561.64	2,281,694.36
应收股利		-	-
应收申购款		13,763.49	296.44
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		576,601,723.08	394,649,226.36
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		3,000,000.00	-
应付证券清算款		1,812.33	-
应付赎回款		66,899.23	-
应付管理人报酬		374,313.20	402,914.37
应付托管费		93,578.29	67,152.40
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	188,187.94	70,646.31
应交税费		148,089.60	148,089.60
应付利息		-1,208.22	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	97,656.04	55,000.00
负债合计		3,969,328.41	743,802.68
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	509,773,242.69	375,278,856.68
未分配利润	6.4.7.10	62,859,151.98	18,626,567.00

所有者权益合计		572,632,394.67	393,905,423.68
负债和所有者权益总计		576,601,723.08	394,649,226.36

注：

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.121 元、C 类基金份额净值为 1.120 元，A 类基金份额总额 16,954,604.34 份、C 类基金份额总额 494,385,388.64 份。

6.2 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：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		40,873,146.45	288,851.02
1.利息收入		9,386,759.81	400,369.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	57,896.20	27,554.02
债券利息收入		5,550,484.00	362,098.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,778,379.61	10,717.22
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,799,377.97	-9,198.89
其中：股票投资收益	6.4.7.12	25,487,751.24	-46,357.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-6,443,258.61	36,503.31
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	754,885.34	654.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	11,654,432.31	-104,764.65
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	32,576.36	2,444.95
减：二、费用		3,981,889.33	269,621.82
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,174,349.28	150,690.05
2.托管费	6.4.10.2.2	518,614.01	25,114.94
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	777,101.12	3,012.07
5.利息支出		358,470.51	-
其中：卖出回购金融资产支出		358,470.51	-
6.其他费用	6.4.7.21	153,354.41	90,804.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		36,891,257.12	19,229.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36,891,257.12	19,229.20

6.3 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：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）	375,278,856.68	18,626,567.00	393,905,423.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	36,891,257.12	36,891,257.12
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）	134,494,386.01	7,341,327.86	141,835,713.87
其中：1.基金申购款	143,225,490.36	9,139,743.39	152,365,233.75
2.基金赎回款	-8,731,104.35	-1,798,415.53	-10,529,519.88
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）	509,773,242.69	62,859,151.98	572,632,394.67
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）	21,566,826.47	3,775,400.91	25,342,227.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,229.20	19,229.20
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）	-192,191.94	-34,369.59	-226,561.53
其中：1.基金申购款	566,724.51	97,468.80	664,193.31
2.基金赎回款	-758,916.45	-131,838.39	-890,754.84
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）	21,374,634.53	3,760,260.52	25,134,895.05
-----------------	---------------	--------------	---------------

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（系金元顺安基金管理有限公司的前身）向社会公开发发行募集，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。

本基金的第一个保本周期为三年，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。

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。

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，将“金元惠理保本混合型证券投资基金”相应更名为“金元顺安保本混合型证券投资基金”，并于 2015 年 7 月 15 日进行公告。

2015 年 6 月 2 日，本基金管理人与托管人协商一致，并报中国证监会备案后，根据申购、赎回费用收取的不同，对本基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，投资者在申购该类基金份额时收取申购费用。另外增设 C 类份额，投资者在申购时不收取申购费，且在 2017 年 9 月 22 日（第二个保本周期到期日）前，单笔申购该类基金份额的金额须高于 200 万元（含 200 万元）。《金元惠理保本混合型证券投资基金基金合同》即日失效，《金元顺安保本混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

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。

6.4.2 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	48,464,021.93	94.28%	-	-

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	2,174,349.28	150,690.05
其中：支付销售机构的客户维护费	35,024.02	37,668.13

注：

1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$ ，

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两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、公休假等，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	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
当期发生的基金应支付的托管费	518,614.01	25,114.94

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。

6.4.8.3 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 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	
	A类份额	C类份额	A类份额	C类份额
期初持有的基金份额	9,789,874.55	-	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	6,500,000.00	-	-	-
期末持有的基金份额	3,289,874.55	-	9,789,874.55	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.40%	-	2.59%	-

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**A 类份额**

本基金 A 类份额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。

C 类份额

本基金 C 类份额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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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	
	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	695,337.49	48,910.59	3,906,218.87	26,867.18

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 8,075.72 元，2017 年 12 月 31 日止结算备付金余额为人民币 107,560.77 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 538.23 元，2016 年 12 月 31 日止结算备付金余额为人民币 7,427.32 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	-	-	70,100	1,624,059.60	1,481,213.00	-
300271	华宇软件	2017-06-22	拟披露重大事项	16.59	2017-07-04	16.80	360,100	5,757,081.96	5,974,059.00	-

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

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

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，本基金因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为 3,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 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。

6.4.10 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

6.4.10.1.1 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、买入返售金融资产、应收款项以及其他金融负债，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资产中属于第一层次的余额为人民币 81,882,538.76 元，属于第二层次的余额为人民币 491,345,272.00 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资产中属于第一层次的余额为人民币 11,196,535.54 元，属于第二层次的余额为人民币 40,000.00 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 第三层次公允价值期初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	89,337,810.76	15.49
	其中：股票	89,337,810.76	15.49
2	固定收益投资	483,890,000.00	83.92
	其中：债券	483,890,000.00	83.92
	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	802,898.26	0.14
7	其他各项资产	2,571,014.06	0.45
8	合计	576,601,723.08	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	65,560,799.30	11.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,815,576.00	1.02
F	批发和零售业	6,059,328.00	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	2,007,884.96	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,894,222.50	1.73
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	89,337,810.76	15.60

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	002242	九阳股份	724,848	14,257,760.16	2.49
2	000333	美的集团	238,980	10,285,699.20	1.80
3	000568	泸州老窖	192,147	9,718,795.26	1.70
4	002705	新宝股份	593,190	8,915,645.70	1.56
5	600511	国药股份	167,200	6,059,328.00	1.06
6	000858	五粮液	107,400	5,977,884.00	1.04
7	300271	华宇软件	360,100	5,974,059.00	1.04
8	002007	华兰生物	161,973	5,912,014.50	1.03
9	600068	葛洲坝	517,400	5,815,576.00	1.02
10	002043	兔宝宝	399,617	5,530,699.28	0.97
11	300287	飞利信	362,000	3,323,160.00	0.58
12	000768	中航飞机	158,500	2,922,740.00	0.51
13	002409	雅克科技	70,100	1,481,213.00	0.26
14	600548	深高速	130,834	1,182,739.36	0.21
15	600350	山东高速	133,088	825,145.60	0.14
16	002279	久其软件	47,570	597,003.50	0.10
17	300282	汇冠股份	26,462	558,348.20	0.10

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	54,065,518.06	13.73

2	002242	九阳股份	20,580,392.89	5.22
3	600759	洲际油气	14,421,507.40	3.66
4	600350	山东高速	14,332,157.17	3.64
5	000671	阳光城	13,395,185.78	3.40
6	300230	永利股份	13,379,962.78	3.40
7	600548	深高速	13,378,062.29	3.40
8	600160	巨化股份	11,235,236.88	2.85
9	000088	盐田港	10,992,393.11	2.79
10	000507	珠海港	10,984,783.00	2.79
11	000768	中航飞机	10,667,107.00	2.71
12	600115	东方航空	9,999,538.00	2.54
13	000568	泸州老窖	9,703,715.82	2.46
14	000333	美的集团	9,621,989.00	2.44
15	002705	新宝股份	8,623,095.00	2.19
16	002246	北化股份	8,525,746.00	2.16
17	601601	中国太保	8,303,139.00	2.11
18	000400	许继电气	6,501,122.00	1.65
19	002531	天顺风能	6,382,212.00	1.62
20	603328	依顿电子	5,995,777.69	1.52

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	69,350,043.38	17.61
2	600350	山东高速	51,688,066.27	13.12
3	000671	阳光城	40,441,922.94	10.27
4	000507	珠海港	14,417,461.76	3.66
5	000768	中航飞机	14,370,269.22	3.65
6	000088	盐田港	14,254,484.00	3.62
7	300230	永利股份	12,724,311.83	3.23
8	600759	洲际油气	12,451,600.70	3.16
9	600160	巨化股份	12,226,386.00	3.10
10	600548	深高速	11,214,731.65	2.85
11	600115	东方航空	10,046,228.00	2.55
12	601989	中国重工	9,358,814.93	2.38
13	002246	北化股份	8,723,198.72	2.21
14	601601	中国太保	7,989,984.00	2.03
15	000400	许继电气	6,533,282.70	1.66
16	002531	天顺风能	6,419,388.20	1.63
17	000778	新兴铸管	6,253,155.33	1.59
18	002434	万里扬	6,174,887.28	1.57
19	603328	依顿电子	6,024,427.58	1.53
20	000651	格力电器	5,654,924.00	1.44

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	363,964,014.12
卖出股票的收入（成交）总额	390,458,541.85

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	39,780,000.00	6.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,952,000.00	1.74
	其中：政策性金融债	9,952,000.00	1.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	434,158,000.00	75.82
9	其他	-	-
10	合计	483,890,000.00	84.50

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	111717129	17 光大银行 CD129	500,000	49,460,000.00	8.64
2	111711259	17 平安银行 CD259	500,000	49,455,000.00	8.64
3	111707139	17 招商银行 CD139	500,000	49,450,000.00	8.64
4	111780225	17 上海农商银行 CD144	500,000	49,450,000.00	8.64
5	111712119	17 北京银行 CD119	400,000	39,556,000.00	6.91

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。

关于兔宝宝（代码：002043）的处罚决定

2017年5月15日,中小板公司管理部对德华兔宝宝装饰新材股份有限公司监事丁观芬出具监管函,具体内容如下:

德华兔宝宝装饰新材股份有限公司监事丁观芬:

你作为德华兔宝宝装饰新材股份有限公司(以下简称“公司”)监事,自2016年11月14日至12月12日买入公司股票6,000股,成交金额77,170元,2017年4月28日,你卖出公司股票6,000股,成交金额99,840元。你的上述股票买卖行为构成《证券法》第四十七条所界定的短线交易。你的上述行为违反了本所《股票上市规则(2014年修订)》第1.4条、第3.1.8条和《中小企业板上市公司规范运作指引(2015年修订)》第3.8.1条的规定。请你充分重视上述问题,吸取教训,及时整改,杜绝上述问题的再次发生。同时,我部提醒你:上市公司董事、监事、高级管理人员买卖股票应当按照国家法律、法规、本所《股票上市规则》和《中小企业板上市公司规范运作指引》等规定,不得违规交易股票。

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。此次事件是公司高管短线交易公司股票,我们判断此次事件对公司负面影响有限,公司生产经营活动一切正常,我们认为不会对整体的业绩造成影响,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

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	134,688.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,422,561.64
5	应收申购款	13,763.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,571,014.06

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

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	5,974,059.00	1.04	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

份额级别	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
A 类份额	1,113	15,233.25	3,617,250.25	21.33%	13,337,354.09	78.67%
C 类份额	4	123,596,347.16	494,385,388.64	100.00%	-	-
合计	1,117	457,779.76	498,002,638.89	97.39%	13,337,354.09	2.61%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	A 类份额	859,459.81	5.07%
	C 类份额	-	-
	合计	859,459.81	0.17%

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(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	A 类份额	50~100
	C 类份额	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	A 类份额	0
	C 类份额	0

	合计	0
--	----	---

§9 开放式基金份额变动

份额单位：份

项目	A 类份额	C 类份额
基金合同生效日（2011 年 8 月 16 日） 基金份额总额	277,669,494.24	-
本报告期期初基金份额总额	22,556,191.52	354,808,590.10
本报告期基金总申购份额	4,020,444.12	139,576,798.54
减：本报告期基金总赎回份额	9,622,031.30	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,954,604.34	494,385,388.64

注：

1、本基金合同生效日为 2011 年 8 月 16 日；

2、本基金第一个保本周期为 3 年，自 2011 年 8 月 16 日起至 2014 年 8 月 15 日。建仓期自 2011 年 8 月 16 日起至 2012 年 2 月 15 日，在建仓期和本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日；

3、本基金第二个保本周期为 3 年，自 2014 年 9 月 23 日起至 2017 年 9 月 22 日。过渡期自 2014 年 8 月 18 日起至 2014 年 9 月 22 日。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日；

4、本基金第二个保本周期起始日为 2014 年 9 月 23 日；

5、本基金自 2015 年 6 月 2 日起，新增 C 类份额。

§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，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会。

本次基金份额持有人大会表决投票时间自 2016 年 12 月 23 日起，至 2017 年 1 月 22 日 24:00 结束。会议审议了《关于调整金元顺安保本混合型证券投资基金基金管理费率的议案》（以下简称“本次大会议案”），并由参加大会的基金份额持有人对本次大会议案进行表决。金元顺安保本混合型证券投资基金的基金托管人中国农业银行股份有限公司授权代表对基金份额持有人大会表决意见的计票进行了监督，北京市方圆公证处公证员对基金份额持有人大会过程及结果进行了公证；上海市通力律师事务所律师就基金份额持有人大会过程及结果进行了律师见证并发表了法律意见。

本次基金份额持有人大会表决结果为：355,182,813.24 份基金份额同意，0 份基金份额反对，0 份基金份额弃权。同意本次大会议案的基金份额占参加本次大会的持有人所持基金份额总数的 100%，达到参加本次大会的基金份额持有人所持基金份额总数的 50% 以上，符合《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《金元顺安保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，《关于调整金元顺安保本混合型证券投资基金基金管理费率的议案》获得通过。

本次基金份额持有人大会决议自 2017 年 1 月 23 日起生效。

自本次基金份额持有人大会决议公告之日即 2017 年 1 月 24 日起，本基金将执行调整后的管理费率，调整后的管理费率为：0.80% 年费率。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	751,844,336.98	100.00%	316,962.29	100.00%	-
金元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份 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	-	-	-	-	-

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	2,937,686.90	5.72%	315,000,000.00	99.06%	-	-
金元证券股份有限公司	48,464,021.93	94.28%	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	3,000,000.00	0.94%	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

§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	214,752,567.69	-	-	214,752,567.69	42.00%
机构	2	2017 年 1 月 1 日-2017 年 6 月 30 日	140,056,022.41	-	-	140,056,022.41	27.39%

产品特有风险

- 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