

# 金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金

## 2019 年半年度报告

2019 年 06 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 08 月 22 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 08 月 21 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。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 2019 年 06 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 .....	6
2.1	基金基本情况 .....	6
2.2	基金产品说明 .....	6
2.3	基金管理人和基金托管人.....	8
2.4	信息披露方式 .....	8
2.5	其他相关资料 .....	8
§3	主要财务指标和基金净值表现 .....	10
3.1	主要会计数据和财务指标.....	10
3.2	基金净值表现 .....	11
§4	管理人报告 .....	13
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	16
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§5	托管人报告 .....	19
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
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 .....	19
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 .....	19
§6	半年度财务会计报告（未经审计） .....	20

6.1	资产负债表 .....	20
6.2	利润表 .....	22
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	23
6.4	报表附注 .....	25
§7	投资组合报告 .....	46
7.1	期末基金资产组合情况.....	46
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	47
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	47
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	48
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12	投资组合报告附注 .....	49
§8	基金份额持有人信息 .....	51
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	51
§9	开放式基金份额变动 .....	53
§10	重大事件揭示 .....	54
10.1	基金份额持有人大会决议.....	54
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 .....	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4	基金投资策略的改变 .....	54

10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8	其他重大事件 .....	56
§11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
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.....	58
§12	备查文件目录 .....	59
12.1	备查文件目录 .....	59
12.2	存放地点 .....	59
12.3	查阅方式 .....	59

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	金元顺安沅泰定开债发起式
基金主代码	005818
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 05 月 09 日
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,009,999,000.00 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求持续、稳定的收益。
投资策略	<p>(一) 封闭期投资策略</p> <p>1、信用债投资策略</p> <p>本基金将重点投资信用类债券，以提高组合收益能力。信用债券相对央票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源，本基金将在公司内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下，积极投资信用债券，获取信用利差带来的高投资收益。</p> <p>债券的信用利差主要受两个方面的影响，一是市场信用利差曲线的走势；二是债券本身的信用变化。本基金依靠对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、信用债券供需情况等分析，判断市场信用利差曲线整体及分行业走势，确定各期限、各类属信用债券的投资比例。依靠内部评级系统分析各信用债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资，减持信用利差被低估、未来信用利差可能上升的信用债券。</p>

	<p>本基金不得投资煤炭、钢铁、有色金属、化工等国家限制的高耗能等过剩产业的信用债。</p> <p>2、收益率曲线策略</p> <p>收益率曲线形状变化代表长、中、短期债券收益率差异变化，相同久期债券组合在收益率曲线发生变化时差异较大。通过对同一类属下的收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，首先可以确定债券组合的目标久期配置区域并确定采取子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略；其次，通过不同期限间债券当前利差与历史利差的比较，可以进行增陡、减斜和凸度变化的交易。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>4、中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金将首先从行业层面看，投资于那些主营业务集中于处于成长期的行业、转型期较短且前景明朗的企业，谨慎投资具有较强的周期性或是易受政策因素影响的行业，审慎投资于行业门槛较低、竞争激烈的企业；其次，从个体层面看，投资于财务制度健全、财务信息完整真实的发债主体，重点关注那些在各自细分行业内处于领先地位或是那些正处于股票上市进程中的企业，审慎考量担保方实力，注重主体违约后的回收率。</p> <p>5、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金将根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，并严格控制单只证券公司短期公司债券的投资比例。此外，本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资，保证本基金的流动性。</p> <p>(二) 开放期投资策略</p> <p>本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p> <p>今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中债综合收益率</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>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</p>

	场基金，属于中低风险中低收益的证券投资基金品种。
--	--------------------------

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	封涌	张燕
	联系电话	021-68881801	0755-83199084
	电子邮箱	service@jysa99.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-666-0666	95555
传真		021-68881875	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		任开宇	李建红

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址



会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
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（2019 年 01 月 01 日- 2019 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	33,238,049.31
本期利润	34,389,383.44
加权平均基金份额本期利润	0.0275
本期加权平均净值利润率	2.62%
本期基金份额净值增长率	2.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2019 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	28,175,506.06
期末可供分配基金份额利润	0.0279
期末基金资产净值	1,053,106,768.86
期末基金份额净值	1.0427
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2019 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	7.30%

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 06 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	0.30%	0.04%	0.28%	0.03%	0.02%	0.01%
过去三个月	1.02%	0.04%	-0.24%	0.06%	1.26%	-0.02%
过去六个月	2.90%	0.05%	0.24%	0.06%	2.66%	-0.01%
过去一年	7.48%	0.06%	2.82%	0.06%	4.66%	0.00%
自基金合同生效起至今	7.30%	0.07%	3.17%	0.06%	4.13%	0.01%

注：

1、本基金合同生效日为 2018 年 05 月 09 日，业绩基准累计增长率以 2018 年 05 月 08 日指数为基准；

2、本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；

3、本基金业绩比较基准为“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

金元顺安沅泰定期开放债券型发起式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



注：

1、本基金合同生效日为 2018 年 05 月 09 日，业绩基准累计增长率以 2018 年 05 月 08 日指数为基准；

2、本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。

## §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

金元比联基金管理有限公司（以下简称“金元比联”、“公司”或“本基金管理人”，系金元顺安基金管理有限公司前身）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，旗下设立北京分公司及子公司——上海金元百利资产管理有限公司。

2012 年 03 月，经中国证监会核准，比联资管将所持有的金元比联 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（以下简称“金元惠理”）。

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 03 月，经中国证监会核准，惠理香港将所持有的金元惠理 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”）。

2017 年 11 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 34,000 万元。

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 2019 年 06 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、金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安优质精选灵活配置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、金元顺安桉盛债券型证券投资基金、金元顺安元启灵活

配置混合型证券投资基金、金元顺安沣泰定期开放债券型发起式证券投资基金、金元顺安沣泰定期开放债券型发起式证券投资基金和金元顺安沣泉债券型证券投资基金共 15 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		
苏利华	本基金基金经理	2018-05-09	-	6 年	金元顺安金元宝货币市场基金和金元顺安沣泰定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，上海交通大学应用统计学硕士。曾任内蒙古自治区农村信用社联合社债券交易员。2016 年 8 月加入金元顺安基金管理有限公司。6 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》、《证券投资基金销售管理办法》、《金元顺安沣泰定期开放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

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《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公平交易管理制度》，建立了科学完善的制度和流程，从事前、事中、事后等各个业务环节严格控制不同基金之间可能存在的利益输送，覆盖了全部开放式基金及特定客户资产管理组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节。

在投资环节，本基金管理人建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。在交易环节，为确保交易的公平执行，本基金管理人交易管理实行集中交易，投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开，各投资组合的所有证券买卖活动须通过交易部集中统一完成。在报告分析环节，本基金管理人每季度和每年对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异、对连续四个季度期间内、不同时间窗内（日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差进行分析，根据收益率差异和交易价差的大小，说明是否符合公平交易的原则，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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》、《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的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

经济基本面，上半年经济整体回落，呈现出供需两弱的情况。需求端方面，出口和消费是拖累经济下行的主要因素。投资增速仍然较高，主要靠地产和基建支撑。

政策方面，上半年中美贸易冲突升级，MLF 较大规模到期，以及包商银行被接管事件引发流动性冲击，央行为稳定预期，进行定向降准，并加大公开市场投放力度，货币政策整体偏宽松。

流动性方面，央行实施全面降准，流动性总体合理充裕，资金价格中枢有所下移。但 5 月，包商银行被监管层接管打破了银行“刚兑”信仰，形成一定流动性冲击，不同资信主体的流动性分层现象显著化。

在报告期，本基金采取适中久期、高杠杆策略，配置高等级信用债以及利率债，获得良好的收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安沅泰定开债发起式基金份额净值为 1.0427 元，本报告期内，基金份额净值增长率为-0.01%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面，下半年经济下行压力突显，房地产投资从高位开始回落，出口和消费仍然乏力，基建投资支撑加大，但短期内也难以快速回升。通胀压力可控。

政策方面，经济下行压力要求货币政策继续发挥逆周期调节作用，同时美联储降息预期升温引领全球央行开启新一轮宽松周期，为国内宽松打开空间，预计央行货币政策将维持宽松基调。

流动性方面，流动性将保持充裕状态，但资金利率波动中枢进一步下移的空间已较为有限。目前货币市场利率中枢处于较低位置，资金价格可能先维持低位，后稍有上行。

本基金将坚持适中久期、高评级信用债策略，获取票息收益。同时关注利率债交易行情，积极把握交易机会。在控制风险的基础上获取最佳回报。

#### 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询；
- (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

报告期内本基金利润分配情况如下：

经本基金管理人计算并由基金托管人招商银行股份有限公司复核，以 2019 年 04 月 26 日已实现的可分配收益为基准，本基金向基金份额持有人每 10 份基金份额派发红利 0.30 元。权益登记日及除息日：2019 年 04 月 30 日，红利发放日：2018 年 05 月 06 日，本基金分红方式为现金分红和红利再投。

#### 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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形。

本报告期内，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

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款,对托管产品的投资行为进行监督,并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度/年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本半年度/年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

招商银行股份有限公司

2019年8月21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：金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 06 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	15,425,285.17	10,208,772.52
结算备付金		9,453,298.82	6,234,488.84
存出保证金		1,981.52	19,821.35
交易性金融资产	6.4.7.2	1,296,790,000.00	1,355,539,500.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,296,790,000.00	1,355,539,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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	26,276,770.22	24,107,236.64
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,347,947,335.73	1,396,109,819.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		293,999,619.00	341,999,806.50
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		258,974.51	267,994.84
应付托管费		86,324.82	89,331.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,022.29	1,679.50
应交税费		92,069.64	66,775.82
应付利息		312,715.51	367,401.95
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	82,841.10	55,000.00
负债合计		294,840,566.87	342,847,990.24
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,009,999,000.00	1,009,999,000.00

未分配利润	6.4.7.10	43,107,768.86	43,262,829.11
所有者权益合计		1,053,106,768.86	1,053,261,829.11
负债和所有者权益总计		1,347,947,335.73	1,396,109,819.35

注：

报告截止日 2019 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0427 元，基金份额总额 1,009,999,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2018 年 06 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>40,740,950.51</b>	<b>-476,550.12</b>
1.利息收入		33,669,911.76	6,998,943.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	175,034.21	103,326.59
债券利息收入		33,043,290.63	5,620,136.63
资产支持证券利息收入		-	297,912.06
买入返售金融资产收入		451,586.92	977,568.02
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,919,704.62	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,919,704.62	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,151,334.13	-7,475,493.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		<b>6,351,567.07</b>	<b>1,229,390.30</b>
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,938,978.75	429,274.83
2.托管费	6.4.10.2.2	646,326.25	143,091.65
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	6.4.7.19	4,920.93	3,873.81
5.利息支出		3,606,779.82	615,803.52
其中：卖出回购金融资产支出		3,606,779.82	615,803.52
6.税金及附加		47,815.12	14,233.78
7.其他费用	6.4.7.20	106,746.20	23,112.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>34,389,383.44</b>	<b>-1,705,940.42</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>34,389,383.44</b>	<b>-1,705,940.42</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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）	1,009,999,000.00	43,262,829.11	1,053,261,829.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,389,383.44	34,389,383.44
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）	-	9,903,771.93	9,903,771.93
其中：1.基金申购款	471,608,187.13	28,390,812.87	499,999,000.00
2.基金赎回款	-471,608,187.13	-18,487,040.94	-490,095,228.07
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）	-	-44,448,215.62	-44,448,215.62
五、期末所有者权益（基金净值）	1,009,999,000.00	43,107,768.86	1,053,106,768.86

  

项 目	上年度可比期间 2018 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2018 年 06 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)	1,009,999,000.00	-	1,009,999,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,705,940.42	-1,705,940.42
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	1,009,999,000.00	-1,705,940.42	1,008,293,059.58

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:

邝晓星	符刃	季泽
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金（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[2018]511 号文《关于准予金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由金元顺安基金管理有限公司作为发起人自 2018 年 4 月 16 日至 2018 年 5 月 7 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2018）验字第 60657709\_B02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2018 年 5 月 9 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,009,999,000.00 元，在募集期间未产生利息，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,009,999,000.00 元，折合 1,009,999,000.00 份基金份额。

本基金的基金管理人与注册登记机构均为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、政策性金融债、公开发行的次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括但不限于协议存款、定期存款及其他银行存款等）、同业存单、货币市场工具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，但须符合中国证监会相关规定。本基金不投资股票、权证等资产。

本基金业绩比较基准：中债综合指数收益率。

### 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（以下统称“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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

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

#### **6.4.6 税项**

##### **6.4.6.1 增值税**

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；

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；

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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

#### **6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加**

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### **7.4.6.3 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[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。

#### **6.4.6.4 个人所得税**

根据财政部、国家税务总局财税[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。

#### **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 2019 年 06 月 30 日
活期存款	15,425,285.17
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	15,425,285.17

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 06 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资——金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	658,620,485.47	665,021,000.00
	银行间市场	625,026,102.59	631,769,000.00
	合计	1,283,646,588.06	1,296,790,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,283,646,588.06	1,296,790,000.00	13,143,411.94

## 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 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中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	2,986.05
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	4,254.00
应收债券利息	26,269,529.27
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.90
合计	26,276,770.22

#### 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 2019 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	8,022.29
合计	8,022.29

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
审计费用	24,795.19
信息披露费	58,045.91
合计	82,841.10

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,009,999,000.00	1,009,999,000.00
本期申购	471,608,187.13	471,608,187.13
本期赎回（以“-”号填列）	-471,608,187.13	-471,608,187.13
本期末	1,009,999,000.00	1,009,999,000.00

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	31,270,751.30	11,992,077.81	43,262,829.11
本期利润	33,238,049.31	1,151,334.13	34,389,383.44
本期基金份额交易产生的变动数	8,114,921.07	1,788,850.86	9,903,771.93
其中：基金申购款	17,294,595.86	11,096,217.01	28,390,812.87
基金赎回款	-9,179,674.79	-9,307,366.15	-18,487,040.94
本期已分配利润	-44,448,215.62	-	-44,448,215.62
本期末	28,175,506.06	14,932,262.80	43,107,768.86

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	107,758.00
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	67,253.64
其他	22.57
合计	175,034.21

**6.4.7.12 股票投资收益**

本基金本报告期无股票投资收益。

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,919,704.62
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,919,704.62

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	615,321,853.74
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	603,463,860.28
减：应收利息总额	5,938,288.84
买卖债券差价收入	5,919,704.62

**6.4.7.13.3 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。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.1 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期均无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**



单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
1.交易性金融资产	1,151,334.13
——股票投资	-
——债券投资	1,151,334.13
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,151,334.13

**6.4.7.18 其他收入**

本基金本报告期均无其他收入。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	20.93
银行间市场交易费用	4,900.00

合计	4,920.93
----	----------

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	58,045.91
汇划手续费	5,305.10
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	106,746.20

#### 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，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 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、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东

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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期末有应支付关联方的佣金。

##### 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 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年05月09日(基金合同生效日)至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,938,978.75	429,274.83
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：

本基金管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 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、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2018 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	646,326.25	143,091.65

注：

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（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
----	----	---------

	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日	2018 年 05 月 09 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 06 月 30 日
基金合同生效日 (2018 年 05 月 09 日) 持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.99%	0.99%

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有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

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 05 月 09 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	15,425,285.17	107,758.00	15,995,153.80	91,298.76

注:

本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司,

2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日止期间获得的利息收入为人民币 67,253.64 元，2019 年 06 月 30 日止结算备付金余额为人民币 9,453,298.82 元。2018 年 05 月 09 日至 2018 年 06 月 30 日止期间获得的利息收入为人民币 91,298.76 元，2018 年 06 月 30 日止结算备付金余额为人民币 9,873,895.01 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

本基金本报告期末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——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2019-04-30	2019-04-30	0.300	44,448,215.62	-	44,448,215.62	-
合计			0.300	44,448,215.62	-	44,448,215.62	-

#### 6.4.12 期末（2019 年 06 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

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有的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
1728014	17 华夏银行 01	2019-07-02	101.99	500,000	50,995,000.00
1822034	18 华夏租赁 01	2019-07-02	101.21	500,000	50,605,000.00
合计				1,000,000	101,600,000.00

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日止，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人民币 93,999,619.00 元于 2019 年 07 月 02 日到期。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 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人民币 200,000,000.00 元，于 2019 年 07 月 02 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、分管风险管理副总经理、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部对公司各机构、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。

#### 7.4.13.2 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分散信用风险。

本基金投资于一家上市公司发行的股票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发行的证券，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

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资

**6.4.13.2.4 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 2019 年 06 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	592,074,000.00	720,532,500.00
AAA 以下	704,716,000.00	603,444,000.00
未评级	0.00	31,563,000.00
合计	1,296,790,000.00	1,355,539,500.00

注：

未评级债券包括国债、同业存单、中央银行票据及政策性金融债。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资

**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。

**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、存出保证金及债券投资。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	15,425,285.17	-	-	-	15,425,285.17
结算备付金	9,453,298.82	-	-	-	9,453,298.82
存出保证金	1,981.52	-	-	-	1,981.52
交易性金融资产	350,381,000.00	946,409,000.00	-	-	1,296,790,000.00
应收利息	-	-	-	26,276,770.22	26,276,770.22
资产总计	375,261,565.51	946,409,000.00	-	26,276,770.22	1,347,947,335.73
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	293,999,619.00	-	-	-	293,999,619.00
应付管理人报酬	-	-	-	258,974.51	258,974.51
应付托管费	-	-	-	86,324.82	86,324.82
应付交易费用	-	-	-	8,022.29	8,022.29
应交税费	-	-	-	92,069.64	92,069.64
应付利息	-	-	-	312,715.51	312,715.51
其他负债	-	-	-	82,841.10	82,841.10
负债总计	293,999,619.00	-	-	840,947.87	294,840,566.87

利率敏感度缺口	81,261,946.51	946,409,000.00	-	25,435,822.35	1,053,106,768.86
<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	10,208,772.52	-	-	-	10,208,772.52
结算备付金	6,234,488.84	-	-	-	6,234,488.84
存出保证金	19,821.35	-	-	-	19,821.35
交易性金融资产	319,113,000.00	1,004,863,500.00	31,563,000.00	-	1,355,539,500.00
应收利息	-	-	-	24,107,236.64	24,107,236.64
资产总计	335,576,082.71	1,004,863,500.00	31,563,000.00	24,107,236.64	1,396,109,819.35
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	341,999,806.50	-	-	-	341,999,806.50
应付管理人报酬	-	-	-	267,994.84	267,994.84
应付托管费	-	-	-	89,331.63	89,331.63
应付交易费用	-	-	-	1,679.50	1,679.50
应交税费	-	-	-	66,775.82	66,775.82
应付利息	-	-	-	367,401.95	367,401.95
其他负债	-	-	-	55,000.00	55,000.00
负债总计	341,999,806.50	-	-	848,183.74	342,847,990.24
利率敏感度缺口	<b>-6,423,723.79</b>	<b>1,004,863,500.00</b>	<b>31,563,000.00</b>	<b>23,259,052.90</b>	<b>1,053,261,829.11</b>

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 2019 年 06 月 30 日和 2018 年 12 月 31 日各债券的基点价值（BP 价值）为主要计算依据；		
	债券持仓结构保持不变；		
	银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率计息，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；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019 年 06 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	市场利率下降 1 个基点	162,177.15	312,827.97
	市场利率上升 1 个基点	-162,117.76	-312,697.04

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

项目	本期末 2019 年 06 月 30 日	上年度末 2018 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	-	-	-	-
交易性金融资产——基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产——债券投资	1,296,790,000.00	123.14	1,355,539,500.00	128.70
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	1,296,790,000.00	123.14	1,355,539,500.00	128.70

注：

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。于 2019 年 06 月 30 日，本基金主要投资于证券交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大市场价格风险。

#### 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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，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 2019 年 06 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二层次的余额为人民币 1,296,790,000.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额。（于 2018 年 06 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二层次的余额为人民币 1,127,118,000.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额。）

###### 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股票和可转换债券等，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股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### **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，本基金无需要披露的承诺事项。

#### **6.4.14.3 其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

#### **6.4.14.4 财务报表的批准**

本财务报表已于 2019 年 08 月 21 日经本基金的基金管理人批准。

## §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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,296,790,000.00	96.20
	其中：债券	1,296,790,000.00	96.20
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	24,878,583.99	1.85
8	其他各项资产	26,278,751.74	1.95
9	合计	1,347,947,335.73	100.00

## 7.2 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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**

本基金本报告期末未持有股票。

**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**

本基金本报告期末未持有股票。

**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**

本基金本报告期末未持有股票。

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

本基金本报告期末未持有股票。

**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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	621,538,000.00	59.02
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	675,252,000.00	64.12
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	1,296,790,000.00	123.14
----	----	------------------	--------

#### 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	143274	17 君华 01	1,000,000	100,020,000.00	9.50
2	143104	17 陕能债	800,000	82,856,000.00	7.87
3	136434	16 葛洲 03	700,000	69,944,000.00	6.64
4	143145	17 皖盐债	700,000	69,839,000.00	6.63
5	143785	18 湘财 02	600,000	61,350,000.00	5.83

#### 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 本期国债期货投资政策

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 本期国债期货投资评价

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没有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	1,981.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,276,770.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,278,751.74

**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
2	504,999,500.00	1,009,999,000.00	100.00%	-	-

## 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	0	0

## 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额占基 金总份额比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.99%	10,000,000.00	0.99%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-

基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.99%	10,000,000.00	0.99%	-

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年05月09日)基金份额总额	1,009,999,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,009,999,000.00
本报告期基金总申购份额	471,608,187.13
减：本报告期基金总赎回份额	471,608,187.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,009,999,000.00

## §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、基金管理人的重大人事变动

(1) 本基金管理人于 2019 年 03 月 02 日公告金元顺安沅泰债券型证券投资基金基金合同终止，并于 2019 年 03 月 02 日进入基金财产清算程序；

(2) 本基金管理人于 2019 年 03 月 16 日公告，金元顺安沅盛债券型证券投资基金增设 C 类基金份额；

(3) 本基金管理人于 2019 年 05 月 18 日公告，聘任邝晓星先生担任公司总经理；

(4) 本基金管理人于 2019 年 06 月 11 日公告《金元顺安沅泉债券型发起式证券投资基金基金合同》正式生效，周博洋先生担任该基金的基金经理；

(5) 本基金管理人于 2019 年 06 月 19 日公告增聘孙权先生担任金元顺安沅泉债券型证券投资基金的基金经理；

#### 2、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动

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 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内，未发生改聘会计师事务所的情况。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 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	
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 2019 年 6 月 30 日止，本基金无新租交易单元。

### 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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证交易成交总额的比例	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
海通证券股份有限公司	20,863,079.45	100.00%	9,420,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金元顺安基金管理有限公司关于旗下基金 2018 年年度资产净值的公告	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-01-01
2	金元顺安基金管理有限公司关于开展直销柜台基金认、申购费 1 折的公告	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-01-09
3	金元顺安基金管理有限公司关于开展直销柜台基金转换费率的公告	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-01-09
4	金元顺安基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金调整信息披露媒体的公告	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-01-21
5	金元顺安基金管理有限公司旗下基金	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-01-21



	2018 年四季度报告		
6	金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回及转换业务公告	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-02-01
7	金元顺安基金管理有限公司 2018 年旗下证券投资基金年度报告	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-03-26
8	金元顺安基金管理有限公司 2018 年旗下证券投资基金年度报告摘要	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-03-26
9	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 第一季度报告	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-04-20
10	金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-04-26
11	金元顺安基金管理有限公司关于手工披露旗下基金 04 月 26 日行情的公告	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-04-27
12	金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回及转换业务公告	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-05-15
13	金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金更新招募说明书[2019 年 1 号]	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-06-22
14	金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要 [2019 年 1 号]	《证券日报》和 www.jysa99.com	2019-06-22

## §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

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	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日	999,999,000.00	471,608,187.13	471,608,187.13	999,999,000.00	99.01%

## 产品特有风险

- 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间至办公地点进行查询，或登录本基金管理人网站 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 查阅。投资者对本报告书存有疑问，可咨询本基金管理人金元顺安基金管理有限公司，本公司客服电话 400-666-0666、021-68881898。

金元顺安基金管理有限公司

二〇一九年八月二十二日