（上接B820版）

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	150,723,245.79
AAA以下	-	-
未评级	400,040,352.15	369,268,890.66
合计	400,040,352.15	519,992,136.45

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。

6.4.13.3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。

6.4.13.3.1报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的同业存单、短期融资券及政策性金融债，均在银行间同业市场交易；本基金所持有的买入返售金融资产期限在六个月以内，因此，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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。

本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,625,670.76	-	-	-	20,625,670.76
交易性金融资产	3,447,215,834.73	-	-	-	3,447,215,834.73
买入返售金融资产	3,897,849,028.69	-	-	-	3,897,849,028.69
应收利息	-	-	-	16,444,852.92	16,444,852.92
应收申购款	-	-	-	5,300.00	5,300.00
资产总计	7,365,690,534.18	-	-	16,450,152.92	7,382,140,687.10
负债					
卖出回购金融资产款	503,498,644.75	-	-	-	503,498,644.75
应付管理人报酬	-	-	-	1,793,136.71	1,793,136.71
应付托管费	-	-	-	434,699.87	434,699.87
应付销售服务费	-	-	-	62,242.04	62,242.04
应付交易费用	-	-	-	68,636.87	68,636.87
应交税费	-	-	-	120,488.21	120,488.21
应付利息	-	-	-	345,831.00	345,831.00
应付利润	-	-	-	5,217,583.77	5,217,583.77
预提费用	-	-	-	137,931.73	137,931.73
负债总计	503,498,644.75	-	-	8,180,550.20	511,679,194.95
利率敏感度缺口	6,862,191,889.43	-	-	8,269,602.72	6,870,461,492.15
上年度末2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,490,649.02	-	-	-	8,490,649.02
结算备付金	839,041.10	-	-	-	839,041.10
交易性金融资产	2,958,595,466.08	-	-	-	2,958,595,466.08
买入返售金融资产	2,467,730,046.59	-	-	-	2,467,730,046.59
应收利息	-	-	-	17,711,115.55	17,711,115.55
应收申购款	-	-	-	25,000.00	25,000.00
资产总计	5,435,655,202.79	-	-	17,736,115.55	5,453,391,318.34
负债					
卖出回购金融资产款	99,999,830.00	-	-	-	99,999,830.00
应付管理人报酬	-	-	-	1,314,517.65	1,314,517.65
应付托管费	-	-	-	318,670.96	318,670.96
应付销售服务费	-	-	-	49,338.36	49,338.36
应付交易费用	-	-	-	70,140.54	70,140.54
应付利息	-	-	-	31,771.35	31,771.35
应付利润	-	-	-	3,847,533.55	3,847,533.55
预提费用	-	-	-	154,000.00	154,000.00
负债总计	99,999,830.00	-	-	5,785,972.41	105,785,802.41
利率敏感度缺口	5,335,655,372.79	-	-	11,950,143.14	5,347,605,515.93

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2018年06月30日和2017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；		
	银行存款以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益/卖出回购金融资产的利息支出在交易时确定，不受利率变化影响；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	市场利率下降1个基点	106,281.35	41,457.85
	市场利率上升1个基点	-106,281.35	-41,455.90

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。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种和证券交易所的债券回购产品，且以摊余成本进行后续计量，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、买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款以及其他金融负债，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3,447,215,834.73元，无属于第一层次和第三层次的余额。（于2017年06月30日，第二层次的余额为人民币3,249,856,000.00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

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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年度末均未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2018年08月24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	固定收益投资	3,447,215,834.73	46.70
	其中：债券	3,447,215,834.73	46.70
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,897,849,028.69	52.80
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	20,625,670.76	0.28
4	其他各项资产	16,450,152.92	0.22
5	合计	7,382,140,687.10	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	7.04	
	其中：买断式回购融资	0.01	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	503,498,644.75	7.33
	其中：买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	61
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期及上年度可比期间不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

7.3.2期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	58.05	7.33
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	18.42	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	12.68	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	3.19	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	14.87	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		107.21	7.33

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

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	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	400,040,352.15	5.82
	其中：政策性金融债	400,040,352.15	5.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	819,969,737.31	11.93
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,227,205,745.27	32.42
8	其他	-	-
9	合计	3,447,215,834.73	50.17
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	150315	15进出15	1,300,000	129,875,421.17	1.89
2	011801001	18冀中能源SCP006	1,000,000	99,871,300.45	1.45
3	111896616	18江苏江南农村商业银行CD041	1,000,000	99,807,883.07	1.45
4	111811028	18平安银行CD028	1,000,000	99,735,376.84	1.45
5	111811033	18平安银行CD033	1,000,000	99,654,138.96	1.45
6	111815040	18民生银行CD040	1,000,000	99,646,184.69	1.45
7	111818128	18华夏银行CD128	1,000,000	99,390,441.74	1.45
8	111809147	18渤发银行CD147	1,000,000	99,390,441.74	1.45
9	111810238	18兴业银行CD238	1,000,000	99,390,441.74	1.45
10	111815222	18民生银行CD222	1,000,000	99,390,441.74	1.45

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25（含）—0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1916%
报告期内偏离度的最低值	0.0568%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1076%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

7.9.2本基金投资的前十名证券的发行主体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。

7.9.3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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	16,444,852.92
4	应收申购款	5,300.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	16,450,152.92

7.9.4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
金元顺安金元宝A类	4,866	8,628.45	12,541,065.71	29.87%	29,444,991.04	70.13%
金元顺安金元宝B类	43	158,801,754.31	6,808,504,039.00	99.71%	19,971,396.40	0.29%
合计	4,909	1,399,564.37	6,821,045,104.71	99.28%	49,416,387.44	0.72%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	保险类机构	859,226,789.43	12.51%
2	银行类机构	812,730,033.60	11.83%
3	其他机构	719,981,397.38	10.48%
4	其他机构	366,076,015.72	5.33%
5	券商类机构	303,818,757.94	4.42%
6	银行类机构	302,246,035.06	4.40%
7	其他机构	300,000,000.00	4.37%
8	信托类机构	280,000,000.00	4.08%
9	保险类机构	256,252,301.02	3.73%
10	保险类机构	215,007,748.65	3.13%

8.3 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	金元顺安金元宝A类	286,003.99	0.681%
	金元顺安金元宝B类	-	-
	合计	286,003.99	0.004%

9.4 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	金元顺安金元宝A类	10-50
	金元顺安金元宝B类	0-10
	合计	10-50
本基金基金经理持有本开放式基金	金元顺安金元宝A类	0-10
	金元顺安金元宝B类	0-10
	合计	0-10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	金元顺安金元宝A类	金元顺安金元宝B类
基金合同生效日（2014年08月01日）基金份额总额	102,015,289.97	295,648,515.56
本报告期期初基金份额总额	42,516,152.72	5,305,089,363.21
本报告期基金总申购份额	30,447,229.99	8,758,740,411.71
减：本报告期基金总赎回份额	30,977,325.96	7,235,354,339.52
本报告期期末基金份额总额	41,986,056.75	6,828,475,435.40

§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2018年01月27日公告，增聘周博洋先生担任金元顺安丰利债券型证券投资基金、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、金元顺安沣楹债券型证券投资基金的基金经理；

（2）本基金管理人于2018年01月27日公告，增聘苏利华先生担任金元顺安金元宝货币市场基金的基金经理；

（3）本基金管理人于2018年02月10日公告，李杰先生不再担任金元顺安丰利债券型证券投资基金、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、金元顺安沣楹债券型证券投资基金的基金经理；

（4）本基金管理人于2018年03月27日公告，增聘贾丽杰女士担任金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安价值增长混合型证券投资基金的基金经理；

（5）本基金管理人于2018年03月31日公告，缪玮彬先生不再担任金元顺安价值增长混合型证券投资基金的基金经理；

（6）本基金管理人于2018年04月05日公告，增聘张博先生担任金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；

（7）本基金管理人于2018年04月24日公告，《金元顺安沣顺定期开放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；

（8）本基金管理人于2018年05月09日公告，闵杭先生不再担任金元顺安金通宝货币市场基金的基金经理；

（9）本基金管理人于2018年05月10日公告，《金元顺安沣泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》正式生效，苏利华先生担任该基金的基金经理；

（10）本基金管理人于2018年06月21日公告，闵杭先生不再担任金元顺安桉盛债券型证券投资基金、金元顺安桉泰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核或处罚等情况。

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	
国金证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	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2018年06月30日止，本基金无新租或退租交易单元。

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
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	43,184,973.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

10.9 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2017年年度资产净值的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-01-01
2	金元顺安金元宝货币市场基金2017年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-01-22
3	金元顺安基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加泰诚财富基金销售（大连）有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-01-24
4	金元顺安金元宝货币市场基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-01-27
5	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加济安财富为销售机构并参与费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-02-03
6	金元顺安金元宝货币市场基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-02-09
7	金元顺安金元宝货币市场基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-02-10
8	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加苏宁金融为销售机构并参与费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-03-08
9	金元顺安金元宝货币市场基金更新招募说明书[2018年1号]	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-03-17
10	金元顺安金元宝货币市场基金更新招募说明书摘要[2018年1号]	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-03-17
11	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加凤凰财富为销售机构并参与费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-03-21
12	金元顺安基金管理有限公司关于修改“金元顺安金元宝货币市场基金”基金合同及托管协议的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-03-26
13	金元顺安基金管理有限公司旗下部分公开募集证券投资基金修改法律文件及收取短期赎回费的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-03-26
14	金元顺安金元宝货币市场基金2017年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-03-28
15	金元顺安金元宝货币市场基金2017年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-03-28
16	金元顺安基金关于参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-03-30
17	金元顺安金元宝货币市场基金关于清明节假期前两个工作日基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-04-03
18	金元顺安金元宝货币市场基金2018年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-04-23
19	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加贵文基金为销售机构并参与费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-04-25
20	金元顺安金元宝货币市场基金关于劳动节假期前两个工作日基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-04-25
21	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加国泰君安为销售机构并参与费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-05-14
22	金元顺安金元宝货币市场基金关于端午节假期前一个工作日基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-06-13
23	金元顺安基金管理有限公司关于调整单日赎回限额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-06-23
24	金元顺安金元宝货币市场基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com	2018-06-29

§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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

金元顺安基金管理有限公司

二〇一八年八月二十五日

（上接B821版）

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

	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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
分析	HS300指数下跌5%	-690,334.65	-1,183,640.43
	HS300指数上涨5%	690,334.65	1,183,640.43

注：

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

6.4.13.4.4采用风险价值法管理风险

风险价值（VaR）含义是指：在市场正常波动下，某一金融资产或证券组合的最大可能损失。更为确切的是指，在一定概率水平（置信度）下，某一金融资产或证券组合价值在未来特定时期内的最大可能损失。用公式表示为：Prob（ΔP）VaR）=1-α或Prob（ΔP（VaR）=α，

其中Prob表示：资产价值损失小于可能损失上限的概率；ΔP表示：某一金融资产在一定持有期Δt的价值损失额；VAR表示：给定置信水平α下的在险价值，即可能的损失上限；α为：给定的置信水平。

假设	在99%的置信水平下采用风险价值模型来管理风险；		
	以01月01日起至资产负债表日止期间的交易日为观察期；		
	预测期间本基金的资产组合的结构保持不变；		
	本基金的基金净值日对数收益率服从正态分布；		
分析	风险价值	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	合计	4,131,306.74	5,288,025.99

注：

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

6.4.14有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1公允价值

6.4.14.1.1不以公允价值计量的金融工具

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工具中属于第一层次的余额为人民币10,970,726.04元，无第二层次余额，无第三层次余额。（于2017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工具中属于第一层次的余额为人民币14,594,479.05元，无第二层次余额，无第三层次余额。）

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，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年度末均未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，本基金的资产净值为人民币13,771,621.24元，已连续超过634个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元。本基金资产管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，向中国证监会说明原因和报送解决方案。本基金资产管理人将积极采取开展持续营销、加大宣传力度、提高投研能力等措施，尽快扭转这一状况。

除此以外，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2018年08月24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	10,970,726.04	78.11
	其中：股票	10,970,726.04	78.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,985,905.60	21.26
8	其他各项资产	89,204.83	0.64
9	合计	14,045,836.47	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	310,482.00	2.25
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,772,019.80	63.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	894,186.00	6.49
J	金融业	994,038.24	7.22
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	10,970,726.04	79.66

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002236	大华股份	58,296	1,314,574.80	9.55
2	002304	洋河股份	9,500	1,250,200.00	9.08
3	000651	格力电器	26,000	1,225,900.00	8.90
4	000333	美的集团	21,200	1,107,064.00	8.04
5	600036	招商银行	37,596	994,038.24	7.22
6	002456	欧菲科技	51,100	824,243.00	5.99
7	000725	京东方A	213,400	755,436.00	5.49
8	600519	贵州茅台	1,000	731,460.00	5.31
9	000858	五粮液	9,100	691,600.00	5.02
10	600887	伊利股份	13,400	373,860.00	2.71
11