

金元顺安丰利债券型证券投资基金

2018年度报告摘要

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
送出日期：2019年03月26日

§ 1 重要提示及目录

基金管理人的董事会、监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。本年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事签发。

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2019年03月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息，确认本报告不存在虚假记载、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。投资人应充分了解基金的说明书及其更新。

本报告自2018年01月01日起至2018年12月31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 |
| 基金代码 | 630003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年01月21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 |
| 报告期末基金资产净值 | 2,323,997,984.69元 |
| 基金份额净值 | 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，追求长期稳定的资本增值。

投资策略 本基金在严格遵守法律法规的前提下，通过资产配置，寻求在风险与收益之间取得平衡。

业绩比较基准 中债综合全价指数

本基金系债券型基金，其风险收益特征低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于中风险收益特征的基金。

基金管理人和基金托管人

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

报告期末基金资产总额

2,323,997,984.69元

基金份额的申购赎回

不定期

4.3 公平交易制度和控制方法

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、事后各个环节严格执行控制不使基金经理在自身利益和公司利益发生冲突的情况下存在不公平交易行为，从而达到防范和减少不公平交易行为的目的。

本基金管理人通过建立科学的决策体系，加强交易执行环节的内部控制，开通并完善工作机制，业务流程和手段确保公平交易制度的贯彻。同时，通过对投资交易行为的监控、评估分析评价以及对公平交易过程的监督，本基金管理人和每一对交易对象对各自买卖的证券品种、交易时机、交易价格等方面进行分析，从而识别不公平交易行为并及时向公司相关部门报告，从而进一步提高公平交易的透明度，保障公平交易制度的执行。

4.3.2 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。本公司报告期内，本基金管理人严格遵守公司投资交易制度及公平交易制度。公司投资交易行为由稽核监察部和交易监督部，确保公平交易制度的执行和实行。

报告期内，基金管理人严格按照《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》及其他有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公平交易制度（限制和指导原则）》，涵盖了所有可投资证券的一级市场、二级市场交易所公开竞价交易、交易所大宗交易、银行间同业交易以及公开的对冲型产品，以公司名义进行的一级市场债券交易等可能影响公平交易的交易行为。

本基金管理人采用定价机制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，形成定期监测、定期报告、定期调整、定期评估的机制。

本基金管理人未发现报告期内存在不公平交易行为。

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 报告期内本基金的运作情况和操作分析

2018年上证综指下跌24.5%，深成300下跌25.31%，中证500下跌33.32%，创业板指数下跌31.12%，2018年的A股市场震荡下行。从行业角度，受益于电子元件跌幅居首，休闲服务、食品饮料等相对具有较强的防御性。报告期内，前期持有较重的周期行业，在季度调整了持仓结构后，将金融、基建等行业仓位权重提升，提升了在银行、地产、社会融资需求改善方面的配置比例，降低了在医药、食品饮料等行业的配置比例。

4.4.2 报告期内本基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.00元，基金份额总额2,323,997,984.69元。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金管理人依然看好权益市场的投资价值，但随着经济数据的持续走弱，经济动能的不足，使得市场对经济的预期减弱，从而对股市的支撑作用减弱。

本基金管理人认为，目前A股市场整体估值水平已经处于历史低位，但结构性分化依然明显，部分行业估值依然较高，但整体估值水平较低，且行业间估值差异较大，因此，本基金管理人认为，A股市场整体估值水平依然具备一定的吸引力，但个股估值差异依然显著，建议投资者关注低估值、高股息率的品种。

4.6 管理人内部对本基金的盈亏概率及投资风格的说明

4.6.1 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.2 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.3 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.4 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.5 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.6 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.7 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.8 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.9 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.10 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.11 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.12 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.13 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.14 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.15 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.16 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.17 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.18 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.19 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.20 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.21 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.22 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.23 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.24 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.25 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.26 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.27 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.28 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.29 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.30 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.31 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.32 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.33 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.34 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.35 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.36 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.37 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.38 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.39 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.40 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.41 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.42 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.43 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.44 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.45 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.46 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.47 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.48 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.49 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.50 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.51 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.52 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.53 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.54 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.55 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.56 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.57 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.58 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.59 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.60 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.61 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.62 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.63 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.64 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.65 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.66 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.67 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.68 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.69 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.70 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.71 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.72 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.73 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.74 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.75 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.76 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.77 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.78 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.79 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.80 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.81 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.82 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.83 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.84 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.85 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.86 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.87 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.88 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.89 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.90 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.91 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.92 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.93 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.94 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.95 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.96 有参与价值类及固定收益类产品的投资。

4.6.97 有参与价值类及固定收益