（上接B197版）

项目（金通宝货币A类）	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	–	–	–
本期利润	86,588.62	–	86,588.62
本期基金份额交易产生的变动数	–	–	–
其中:基金申购款	–	–	–
基金赎回款	–	–	–
本期已分配利润	–86,588.62	–	–86,588.62
本期末	–	–	–

7.4.7.10.2金通宝货币B类

单位:人民币元

项目（金通宝货币B类）	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	–	–	–
本期利润	79,767,250.83	–	79,767,250.83
本期基金份额交易产生的变动数	–	–	–
其中:基金申购款	–	–	–
基金赎回款	–	–	–
本期已分配利润	–79,767,250.83	–	–79,767,250.83
本期末	–	–	–

7.4.7.11存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月20日（基金合同生效日）至2017年12月31日
活期存款利息收入	39,635.91	62,004.13
定期存款利息收入	–	8,740,416.67
其他存款利息收入	–	–
结算备付金利息收入	–	3,067.68
其他	–	–
合计	39,635.91	8,805,488.48

7.4.7.12股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.13债券投资收益

7.4.7.13.1债券投资收益——买卖债券差价收入

单位:人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月20日（基金合同生效日）至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	14,134,730.460.78	10,205,496,104.44
减:卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	14,119,578,222.23	10,197,762,696.41
减:应收利息总额	15,072,525.88	7,930,087.68
买卖债券差价收入	79,712.67	–196,679.65

7.4.7.13.2资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.17公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

7.4.7.18其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.19交易费用

本基金本报告期及上年度可比期间均无交易费用。

7.4.7.20其他费用

单位:人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月20日（基金合同生效日）至2017年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
汇划手续费	26,572.47	19,902.45
账户维护费	45,000.00	19,500.00
其他费用	1,200.00	600.00
账户开户费	–	400.00
合计	222,772.47	190,402.45

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1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。

7.4.8.2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。

7.4.9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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司	基金托管人
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东
上海泉恩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

注:

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1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。

7.4.10.1.2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。

7.4.10.1.3债券交易

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交易。

7.4.10.1.4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。

7.4.10.1.5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关联方的佣金。

7.4.10.2关联方报酬

7.4.10.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月20日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,931,800.54	3,328,534.47
其中:支付销售机构的客户维护费	2,193.58	4,221.77

注:

1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数,

H为每日应计提的基金管理费,

E为前一日的基金资产净值。

2、基金管理费每日计算,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管理费划款指令,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付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.10.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月20日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,186,360.15	665,706.90

注:

1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.05%÷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。

2、基金托管费每日计算,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托管费划款指令,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。

7.4.10.2.3销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2018年01月01日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金通宝货币A类	金通宝货币B类	合计
金元顺安基金管理有限公司	1,009.69	236,983.72	237,993.41
合计	1,009.69	236,983.72	237,993.41
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2017年01月20日（基金合同生效日）至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金通宝货币A类	金通宝货币B类	合计
金元顺安基金管理有限公司	1,314.90	132,855.59	134,170.49
合计	1,314.90	132,855.59	134,170.49

注:

1、本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%,对于由B类降级为A类的基金份额份额持有人,年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。B类基金份额的年销售服务费率为0.01%,对于由A类升级为B类的基金份额持有人,年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受B类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同,具体如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数,

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费,

E为前一日该类基金份额的基金资产净值。

2、基金销售服务费每日计提,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付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.3与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位:人民币元

本期2018年01月01日至2018年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行股份有限公司	198,956,222.46	–	528,660,000.00	33,431.63	209,000,000.00	13,987.94

7.4.10.4各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

金通宝货币A类

份额单位:份

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月20日（基金合同生效日）至2017年12月31日
基金合同生效日（2017年01月20日）持有的基金份额	–	–
报告期初持有的基金份额	–	–
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	–	–
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–

金通宝货币B类

份额单位:份

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月20日（基金合同生效日）至2017年12月31日
基金合同生效日（2017年01月20日）持有的基金份额	–	–
报告期初持有的基金份额	25,154,540.32	–
报告期间申购/买入总份额	15,468,913.81	25,154,540.32
报告期间因拆分变动份额	–	–
减:报告期间赎回/卖出总份额	40,623,454.13	–
报告期末持有的基金份额	–	25,154,540.32
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	2.50%

注:

期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.10.4.2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

份额单位:份

金通宝货币B类

关联方名称	本期末2018年12月31日		上年度末2017年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上海金元百利资产管理有限公司	–	–	233,044,410.74	23.15%

注:

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资A类基金。

7.4.10.5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2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间2017年01月20日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	2,620,941.95	39,635.91	1,568,522.97	62,004.13

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,2018年度获得的利息收入为人民币0.00元（2017年1月20日（基金合同生效日）至2017年12月31日:人民币3,067.68元,2018年末结算备付金余额为人民币0.00元（2017年末:人民币0.00元）。

7.4.10.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位:人民币元

本期2018年01月01日至2018年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量	总金额
中国民生银行股份有限公司	111815012	18民生银行CD012	网下发行	500,000	49,427,200.00
中国民生银行股份有限公司	111815082	18民生银行CD082	网下发行	500,000	49,404,750.00
中国民生银行股份有限公司	111815108	18民生银行CD108	网下发行	1,000,000	99,602,400.00
中国民生银行股份有限公司	111815190	18民生银行CD190	网下发行	500,000	49,492,300.00
中国民生银行股份有限公司	111815635	18民生银行CD635	网下发行	500,000	49,596,450.00

7.4.11利润分配情况——货币市场基金

金通宝货币A类

单位:人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
86,588.62	–	–	86,588.62	–

金通宝货币B类

单位:人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
79,767,250.83	–	–	79,767,250.83	–

7.4.12期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1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持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2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暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1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
180207	18国开07	2019–01–04	99.92	500,000	49,962,293.83
180404	18农发04	2019–01–04	100.04	500,000	50,021,326.55
111815603	18民生银行CD603	2019–01–04	99.51	50,000	4,975,620.19
合计	–	–	–	1,050,000	104,959,240.57

注:

截至本报告期末2018年12月31日止,基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额人民币104,749,522.87元,于2019年1月4日到期。

7.4.12.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31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金融资产款余额。

7.4.13金融工具风险及管理

7.4.13.1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、风险控制委员会、监察稽核部对公司各机构、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;本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。

本基金投资的债券与非金融企业债务融资工具须具有评级资质的资信评级机构进行信用评级,信用评级主要参照最近一个会计年度的主体信用评级,如果对发行人同时有两家以上境内机构评级的,应采用孰低原则确定其评级,并结合基金管理人内部信用评级进行独立判断与认定。

7.4.13.2.1按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末2018年12月31日	上年度末2017年12月31日
A–1	–	–
A–1以下	–	–
未评级	99,983,620.38	109,772,631.71
合计	99,983,620.38	109,772,631.71

注:

未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债和超短期融资券。

7.4.13.2.2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。

7.4.13.2.3按短期信用评级列示的同业存单投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末2018年12月31日	上年度末2017年12月31日
A–1	–	–
A–1以下	–	–
未评级	1,303,909,151.27	735,950,972.84
合计	1,303,909,151.27	735,950,972.84

7.4.13.2.4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2018年12月31日	上年度末2017年12月31日
AAA	–	–
AAA以下	–	–
未评级	140,578,191.17	39,978,914.86
合计	140,578,191.17	39,978,914.86

注:

未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债。

7.4.13.2.5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。

7.4.13.2.6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。

7.4.13.3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。

7.4.13.3.1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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的政策性金融债和同业存单等,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一个月以内,因此,除在附注7.4.12中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外,本报告期末本基金的其他资产均能及时变现。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。

7.4.13.4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。

7.4.13.4.1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。

7.4.13.4.1.1利率风险敞口

单位:人民币元

本期末2018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	2,620,941.95	–	–	–	2,620,941.95
交易性金融资产	1,544,470,962.82	–	–	–	1,544,470,962.82
买入返售金融资产	479,376,879.07	–	–	–	479,376,879.07
应收利息	–	–	–	5,998,841.78	5,998,841.78
资产总计	2,026,468,783.84	–	–	5,998,841.78	2,032,467,625.62
负债					
卖出回购金融资产款	104,749,522.87	–	–	–	104,749,522.87
应付管理人报酬	–	–	–	510,620.59	510,620.59
应付托管费	–	–	–	102,124.14	102,124.14
应付销售服务费	–	–	–	20,705.04	20,705.04
应付交易费用	–	–	–	48,216.52	48,216.52
应付利息	–	–	–	100,346.19	100,346.19
其他负债	–	–	–	59,400.00	59,400.00
负债总计	104,749,522.87	–	–	841,412.48	105,590,935.35
利率敏感度缺口	1,921,719,260.97	–	–	5,157,429.30	1,926,876,690.27
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	1,568,522.97	–	–	–	1,568,522.97
交易性金融资产	885,702,519.41	–	–	–	885,702,519.41
买入返售金融资产	125,000,000.00	–	–	–	125,000,000.00
应收利息	–	–	–	4,225,395.07	4,225,395.07
应收申购款	–	–	–	12,261.46	12,261.46
资产总计	1,012,271,042.38	–	–	4,237,656.53	1,016,508,698.91
负债					
卖出回购金融资产款	9,499,865.75	–	–	–	9,499,865.75
应付管理人报酬	–	–	–	260,706.89	260,706.89
应付托管费	–	–	–	52,141.35	52,141.35
应付销售服务费	–	–	–	12,251.44	12,251.44
应付交易费用	–	–	–	30,236.58	30,236.58
应付利息	–	–	–	7,094.52	7,094.52
其他负债	–	–	–	150,400.00	150,400.00
负债总计	9,499,865.75	–	–	512,830.78	10,012,696.53
利率敏感度缺口	1,002,771,176.63	–	–	3,724,825.75	1,006,496,002.38

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。

7.4.13.4.1.2利率风险的敏感性分析

假设	1、以中央国债登记结算有限责任公司公布的2018年12月31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; 2、假设债券持仓结构保持不变; 3、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/卖出回购金融资产款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12月31日	上年度末2017年12月31日
	市场利率下降1个基点	26,927.21	13,287.84
	市场利率上升1个基点	–26,925.77	–13,287.08

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。

7.4.13.4.2外汇风险

本基金所有资产及负债均以人民币计价,因此无外汇风险。

7.4.13.4.3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。

7.4.14有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1公允价值

7.4.14.1.1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、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。

7.4.14.1.2以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日,本基金持有的交易性金融资产中属于第二层次的余额为人民币1,544,470,962.82元,无属于第一层次和第三层次的余额,（2017年12月31日,本基金持有的交易性金融资产中属于第二层次的余额为人民币885,702,519.41元,无属于第一层次和第三层次的余额）。

7.4.14.1.2.2公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的交易性金融资产的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.1.2.3第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的交易性金融资产第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3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。

7.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2019年3月25日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	固定收益投资	1,544,470,962.82	75.99
	其中:债券	1,544,470,962.82	75.99
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	479,376,879.07	23.59
	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	2,620,941.95	0.13
4	其他各项资产	5,998,841.78	0.30
5	合计	2,032,467,625.62	100.00

8.2 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	7.57	
	其中:买断式回购融资	–	
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	104,749,522.87	5.44
	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

注:

本基金本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1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	54
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

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。

8.3.2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	40.56	5.44
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天（含）—60天	41.33	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天（含）—90天	12.89	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天（含）—120天	2.59	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天（含）—397天（含）	7.80	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
合计		104.17	5.44

8.4 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。

8.5 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	240,561,811.55	12.48
	其中:政策性金融债	240,561,811.55	12.48
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	1,303,909,151.27	67.67
8	其他	–	–
9	合计	1,544,470,962.82	80.15
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

8.6 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	111815596	18民生银行CD596	2,000,000	199,115,582.00	10.33
2	111808309	18中信银行CD309	2,000,000	198,926,551.21	10.32
3	111816370	18上海银行CD370	1,000,000	99,946,656.85	5.19
4	111819313	18恒丰银行CD313	1,000,000	99,798,983.73	5.18
5	111819430	18恒丰银行CD430	1,000,000	99,744,509.56	5.18
6	111821340	18渤海银行CD340	1,000,000	99,737,715.70	5.18
7	111810560	18兴业银行CD560	1,000,000	99,535,629.11	5.17
8	111815603	18民生银行CD603	1,000,000	99,512,403.79	5.16
9	111818235	18华夏银行CD235	1,000,000	99,453,960.57	5.16
10	111810616	18兴业银行CD616	1,000,000	99,222,259.43	5.15

8.7 "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	0.1666%
报告期内偏离度的最低值	–0.0356%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0465%

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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1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。

8.9.2本基金投资的前十名证券的发行主体本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。

8.9.3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	5,998,841.78
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	5,998,841.78

8.9.4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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
金通宝货币A类	1,093	1,183.30	129,254.55	9.99%	1,164,090.97	90.01%
金通宝货币B类	11	175,053,031.34	1,925,583,344.75	100.00%	0.00	–
合计	1,104	1,745,359.32	1,925,712,599.30	99.94%	1,164,090.97	0.06%

9.2 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	机构	739,526,735.32	38.38%
2	机构	319,046,894.61	16.56%
3	机构	220,913,454.71	11.46%
4	机构	215,263,415.06	11.17%
5	机构	165,549,998.98	8.59%
6	机构	79,043,204.68	4.10%
7	机构	71,816,413.62	3.73%
8	机构	49,720,076.06	2.58%
9	机构	35,476,441.27	1.84%
10	机构	24,442,350.78	1.27%

9.3 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	金通宝货币A类	140,835.78	10.89%
	金通宝货币B类	–	–
	合计	140,835.78	0.01%

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	金通宝货币A类	10–50
	金通宝货币B类	0–10
	合计	10–50
本基金基金经理持有本开放式基金	金通宝货币A类	0–10
	金通宝货币B类	0–10
	合计	0–10

§10 开放式基金份额变动

单位:份

	金通宝货币A类	金通宝货币B类
基金合同生效日（2017年01月20日）基金份额总额	581,694.80	267,002,140.00
本报告期期初基金份额总额	7,174,485.74	999,321,516.64
本报告期基金总申购份额	2,960,947.31	15,062,393,199.83
减:本报告期基金总赎回份额	8,842,087.53	14,136,131,371.72
本报告期期末基金份额总额	1,293,345.52	1,925,583,344.75

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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的基金经理;

（2）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优质精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;

（3）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祥债券型证券投资基金的基金经理;

（4）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;

（5）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沣楹债券型证券投资基金的基金经理;

（6）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的基金经理;

（