金元顺安丰利债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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08月22日

§1 重要提示

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。

§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
基金主代码	620003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年03月23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	2,310,487,794.73份
基金合同存续期	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,追求超越业绩比较基准的稳健收益和总回报。
投资策略	基于"自上而下"的原则,本基金采用久期控制下的主动性投资策略,并本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。经过对历史数据的统计分析发现,债券市场收益率受到宏观经济形势和市场供需两方面不同程度的影响,因此本基金在债券投资过程中,将采用若干定量模型来对宏观和市场两方面数据进行分析,并运用适当的策略来构建债券组合。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	封涌	贺倩
	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》
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(2019年01月01日-2019年06月30日)
本期已实现收益	53,407,706.22
本期利润	130,123,404.31
加权平均基金份额本期利润	0.0568
本期加权平均净值利润率	5.39%
本期基金份额净值增长率	5.79%
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	136,680,784.19
期末可供分配基金份额利润	0.0592
期末基金资产净值	2,447,168,578.92
期末基金份额净值	1.059
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	37.53%

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、上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	0.47%	0.31%	0.28%	0.03%	0.19%	0.28%
过去三个月	-2.04%	0.40%	-0.24%	0.06%	-1.80%	0.34%
过去六个月	5.79%	0.42%	0.24%	0.06%	5.55%	0.36%
过去一年	5.45%	0.35%	2.82%	0.06%	2.63%	0.29%
过去三年	10.17%	0.27%	0.03%	0.08%	10.14%	0.19%
自基金合同生效起至今	37.53%	0.28%	29.24%	0.08%	8.29%	0.20%

注:
1、本基金合同生效日为2009年03月23日,业绩基准累计增长率以2009年03月22日指数为基准;
2、本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%,其中对可转换债券(含分离交易可转债)的投资比例不高于基金资产的40%,对固定收益类以外的其他资产(包括股票、权证等)的投资比例不高于基金资产的20%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;
3、本基金在2015年11月27日将基金业绩比较基准由"中信标普全债指数"更改为"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

注:
1、本基金合同生效日为2009年03月23日,业绩基准累计增长率以2009年03月22日指数为基准;
2、本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%,其中对可转换债券(含分离交易可转债)的投资比例不高于基金资产的40%,对固定收益类以外的其他资产(包括股票、权证等)的投资比例不高于基金资产的20%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§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有限公司(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,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"的原则,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。

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、金元顺安成长动力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、金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安沣楹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、金元顺安桉盛债券型证券投资基金、金元顺安沣顺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、金元顺安沣泉债券型发起式证券投资基金等共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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
周博洋	本基金基金经理	2018-01-26	-	6年	金元顺安丰祥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、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安沣楹债券型证券投资基金、金元顺安桉盛债券型证券投资基金、金元顺安沣顺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发起式证券投资基金的基金经理。2014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。
孙权	本基金基金经理	2019-01-04	-	9年	金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安沣楹债券型证券投资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,上海财经大学硕士。曾任职于上海国际货币经纪有限责任公司,贵阳银行上海投资分行固定收益部投资经理,9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遵规守信情况的说明

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》、《金元顺安丰利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公平交易制度指导意见》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》,建立了科学的投资决策体系和完善的投资流程,从事前、事中、事后等各个业务环节严格控制不同投资组合之间的利益输送,涵盖了所有投资组合;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、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,本基金管理人通过监察稽核、事后分析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,本基金管理人实行集中交易制度,各投资组合的交易指令统一由交易部执行。在报告分析环节,本基金管理人对不同投资组合的同向交易价差进行分析,对不同投资组合在同一时间窗口下(日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差进行分析,根据设置的假设检验和交易价差的大小,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

上半年,本基金对股票及转债的仓位与行业分布进行了适当调整,整体仓位逐步下降。另外,在债市经历4、5月份调整之后,本产品开始加配中长期限利率债,利率债仓位逐步上升。

资金方面:上半年资金面整体宽松,特别是在跨季及跨半年末等重要时点上,各期限资金供需相对平衡,关键品种回购利率较为平稳。针对上半年资金面的平稳表现,我们认为,主要原因在于央行更多地进行提前操作,并更加加强与市场预期,导致市场资金供给充裕。

债市方面:上半年债券收益率震荡调整,并于6月下旬开始下行。主要原因在于影响债市的核心因素逐渐好转,带动债券尤其是利率债与高等级信用债的需求回暖。第一,资金面宽松,回购利率持续下行,债券收益率从短端逐步被拉低;第二,机构对经济下行压力及资金面宽松等因素的担忧增加,避险情绪有所抬升;第三,中美国债利差处在较高水平,吸引外资机构较大规模增持中国国债;第四,包商事件导致市场风险偏好下降,直接导致利率债及高等级信用债需求改善。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安丰利债券基金份额净值为1.059元;

本报告期内,基金份额净值增长率为5.79%,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

展望下半年,我们认为债券牛市氛围将继续,下半年债券收益率有望继续震荡下行。从经济基本面来看,2019年全球经济处于下行阶段,国内经济增长也面临一定的下行压力。具体而言,经济增长的波动与固定资产投资密切相关,而房地产、基础设施建设和制造业投资中,尤其需要关注房地产投资。房地产市场的产业链横跨较大,上游包括钢铁、水泥等建材,下游包括家电、家具等领域。此外,通胀抑制债券表现,但年内通胀不可能已经见顶。数据显示,今年上半年CPI有所抬升,其主要原因是猪肉价格上涨,叠加鲜菜、鲜果季节性涨价。我们预计,后续鲜菜、鲜果涨价的持续性不足,猪肉价格继续上涨幅度有限,预计三季度CPI将处于下降趋势,这利好债市投资。

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、监察稽核部等部门负责人组成。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方法符合现行法律、法规的要求;
(4)评价现行估值方法是否恰当反映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)对于认为不合适或不再合适的估值方法提出召开估值工作小组讨论。

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

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2019年01月01日至2019年06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的真实、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。

中国农业银行股份有限公司
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:金元顺安丰利债券型证券投资基金
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	13,294,222.84	9,889,408.57
结算备付金		11,914,667.85	11,494,461.84
存出保证金		509,318.14	319,984.76
交易性金融资产	6.4.7.2	3,191,031,557.08	2,888,985,952.34
其中:股票投资		364,252,834.94	424,359,658.14
基金投资		-	-
债券投资		2,826,778,722.14	2,464,626,294.20
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	57,125,315.71	40,850,181.28
应收证券清算款		-	2,515.20
应收利息	6.4.7.5	41,304,680.79	53,704,047.30
应收股利		-	-
应收申购款		34.97	19.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,315,179,797.38	3,005,246,571.27
负债和所有者权益	附注号	本期末2019年06月30日	上年度末2018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		854,121,908.55	674,299,157.05
应付证券清算款		9,357,532.06	-
应付赎回款		57,514.97	11,250.11
应付管理人报酬		1,394,869.98	1,411,019.88
应付托管费		398,534.31	403,148.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	946,551.58	410,050.11
应交税费		965,858.44	944,789.27
应付利息		674,109.06	969,156.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	94,339.51	75,000.19
负债合计		868,011,218.46	678,523,571.92
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	2,310,487,794.73	2,323,997,984.50
未分配利润	6.4.7.10	136,680,784.19	2,725,014.85
所有者权益合计		2,447,168,578.92	2,326,722,999.35
负债和所有者权益总计		3,315,179,797.38	3,005,246,571.27

注:
报告截止日2019年06月30日,基金份额净值1.059元,基金份额总额2,310,487,794.73份。

6.2 利润表

会计主体:金元顺安丰利债券型证券投资基金
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	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01月01日至2018年06月30日
一、收入		155,327,045.03	-12,701,542.44
1.利息收入		61,650,038.50	62,775,405.63
其中:存款利息收入	6.4.7.11	177,911.98	247,991.80
债券利息收入		60,249,312.54	62,322,931.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,222,813.98	204,482.04
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		16,810,474.27	-18,674,035.88
其中:股票投资收益	6.4.7.12	9,123,391.44	-17,194,916.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	6,961,503.46	-6,802,958.59
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	725,579.37	5,323,839.66
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	76,715,698.09	-56,803,357.63
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	150,834.17	445.44
减:二、费用		25,203,640.72	26,899,041.35
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	8,365,856.10	8,934,934.40
2.托管费	6.4.10.2.2	2,390,244.65	2,552,838.41
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	6.4.7.19	3,927,403.05	1,031,789.15
5.利息支出		10,218,555.86	14,014,441.78
其中:卖出回购金融资产支出		10,218,555.86	14,014,441.78
6.税金及附加		169,934.77	198,226.05
7.其他费用	6.4.7.20	131,646.29	166,811.56
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		130,123,404.31	-39,600,583.79
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		130,123,404.31	-39,600,583.79

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:金元顺安丰利债券型证券投资基金
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)	2,323,997,984.50	2,725,014.85	2,326,722,999.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	130,123,404.31	130,123,404.31
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)	-13,510,189.77	3,832,365.03	-9,677,824.74
其中:1.基金申购款	728,309,244.49	21,947,360.24	750,256,604.73
2.基金赎回款	-741,819,434.26	-18,114,995.21	-759,934,429.47
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)	2,310,487,794.73	136,680,784.19	2,447,168,578.92
项目	上年度可比期间 2018年01月01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)	2,300,195,908.67	212,106,159.02	2,512,302,067.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-39,600,583.79	-39,600,583.79
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)	-77,392,148.10	-8,303,249.74	-85,695,397.84
其中:1.基金申购款	124,020,053.51	12,434,241.75	136,454,295.26
2.基金赎回款	-201,412,201.61	-20,737,491.49	-222,149,693.10
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)	2,222,803,760.57	164,202,325.49	2,387,006,086.06

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

金元顺安丰利债券型证券投资基金(原名为:金元比联丰利债券型证券投资基金,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[2009]101号文《关于同意金元比联丰利债券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)向社会公开发行募集,基金合同于2009年03月23日正式生效,首次设立募集规模为1,474,806,481.51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均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。

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于2012年03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,按照中国证监会同意,将金元比联丰利债券型证券投资基金更名为金元惠理丰利债券型证券投资基金,并于2012年05月02日公告。

2015年02月05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03月06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03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,金元惠理丰利债券型证券投资基金相应更名为金元顺安丰利债券型证券投资基金,并于2015年07月15日进行公告。

本基金的投资范围为固定收益类金融工具,包括国内依法公开发行、上市的国债、央行票据、金融债、信用等级为BBB+及以上的企业(公司)债、可转换债券(含分离交易可转债)、债券回购、资产支持证券,以及股票等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。

此外,本基金在对新股的定价因素和预期因素进行综合考察的前提下,积极参与一级市场申购,以期获得新股申购收益,保留在股票市场系统性风险较低而且股票动态估值水平合理的前提下进行股票二级市场投资的选择权。

本基金业绩比较基准为:中债综合指数。

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》、中国证监会颁布的《关于进一步规范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06月30日的财务状况以及2019年01月01日至06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、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

6.4.6.1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04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09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[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。

6.4.6.2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征增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年05月01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。

6.4.6.3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)及地方教育附加。

6.4.6.4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。

6.4.6.5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;

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	13,294,222.84
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	13,294,222.84

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		352,873,757.31	364,252,834.94	11,379,077.63
贵金属投资——金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,038,759,081.34	1,033,058,722.14	-5,700,359.20
	银行间市场	1,775,252,018.89	1,793,720,000.00	18,467,981.11
	合计	2,814,011,100.23	2,826,778,722.14	12,767,621.91
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,166,884,857.54	3,191,031,557.08	24,146,699.54

6.4.7.3衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/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

单位:人民币元

项目	本期末2019年06月30日 账面余额	其中:买断式逆回购
交易所市场	6,650,000.00	
银行间市场	50,475,315.71	
合计	57,125,315.71	

6.4.7.4.2期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均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	6,971.96
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	4,825.44
应收债券利息	41,203,002.34
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	89,674.86
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	206.19
合计	41,304,680.79

6.4.7.6其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

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	916,234.16
银行间市场应付交易费用	30,317.42
合计	946,551.58

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	120.16
预提费用	94,219.35
合计	94,339.51

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	2,323,997,984.50	2,323,997,984.50
本期申购	728,309,244.49	728,309,244.49
本期赎回(以"-"号填列)	-741,819,434.26	-741,819,434.26
本期末	2,310,487,794.73	2,310,487,794.73

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	161,027,497.72	-158,302,482.87	2,725,014.85
本期利润	53,407,706.22	76,715,698.09	130,123,404.31
本期基金份额交易产生的变动数	127,842.63	3,704,522.40	3,832,365.03
其中:基金申购款	53,292,524.36	-31,345,164.12	21,947,360.24
基金赎回款	-53,164,681.73	35,049,686.52	-18,114,995.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	214,563,046.57	-77,882,262.38	136,680,784.19

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	72,479.18
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	101,813.75
其他	3,619.05
合计	177,911.98

6.4.7.12股票投资收益

单位:人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
卖出股票成交总额	1,524,234,163.55
减:卖出股票成本总额	1,515,110,772.11
买卖股票差价收入	9,123,391.44

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	6,961,503.46
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	6,961,503.46

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	1,390,061,931.39
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	1,351,296,343.46
减:应收利息总额	31,804,084.47
买卖债券差价收入	6,961,503.46

6.4.7.13.3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。

6.4.7.14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

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

6.4.7.15衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

6.4.7.16股利收益

单位:人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	725,579.37
基金投资产生的股利收益	-
合计	725,579.37

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	76,715,698.09
——股票投资	78,351,976.41
——债券投资	-1,636,278.32
——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	76,715,698.09

6.4.7.18其他收入

单位:人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
基金赎回费收入	150,834.17
合计	150,834.17

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	3,913,770.55
银行间市场交易费用	13,632.50
合计	3,927,403.05

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	34,712.18
信息披露费	59,507.17
汇划手续费	18,826.94
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	131,646.29

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
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

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。

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
金元证券股份有限公司	125,210,546.10	4.32%	-	-

注:
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。

6.4.10.1.2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。

6.4.10.1.3债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日 成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日 成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
金元证券股份有限公司	327,805,693.97	35.18%	105,465,438.36	34.96%

6.4.10.1.4债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
金元证券股份有限公司	4,248,910,000.00	31.43%	-	-

注:
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。

6.4.10.1.5应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
金元证券股份有限公司	116,608.08	5.50%	116,608.08	12.73%
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
金元证券股份有限公司	-	-	-	-

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01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,365,856.10	8,934,934.40
其中:支付销售机构的客户维护费	388,381.08	40,654.99

注:
基金管理费按前一日的基金资产净值的0.70%的年费率计提。
计算方法如下:
H=E×0.70%÷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
基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日等,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01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,390,244.65	2,552,838.41

注:
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×0.20%÷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,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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
基金合同生效日(2009年03月23日)持有的基金份额	20,000,400.00	20,000,400.00
报告期初持有的基金份额	17,500,400.00	17,500,400.00
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	17,500,400.00	17,500,400.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.76%	0.79%

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 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日 期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	13,294,222.84	72,479.18	14,519,795.50	63,396.26

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101,813.75元,2019年06月30日止结算备付金余额为人民币11,914,667.85元。2018年01月01日至2018年06月30日止期间获得的利息收入为人民币178,713.38元,2018年06月30日止结算备付金余额为人民币17,719,973.85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

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11利润分配情况-——非货币市场基金

本基金本报告期未进行利润分配。

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持有因认购新发/增发而流通受限的股票。

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
180205	18国开05	2019-07-01	107.51	300,000	32,253,000.00
180406	18农发06	2019-07-01	105.90	500,000	52,950,000.00
190205	19国开05	2019-07-01	97.95	200,000	19,590,000.00
190210	19国开10	2019-07-01	100.32	500,000	50,160,000.00
190402	19农发02	2019-07-01	99.83	500,000	49,915,000.00
101759068	17兴展投资MTN003	2019-07-01	102.34	100,000	10,234,000.00
101800286	18晋能MTN003	2019-07-01	103.51	300,000	31,053,000.00
101800354	18萧山钱江MTN003	2019-07-01	103.44	300,000	31,032,000.00
101800399	18海江投资MTN001	2019-07-01	102.81	300,000	30,843,000.00
101800432	18大同煤矿MTN002	2019-07-03	102.16	500,000	51,080,000.00
101800757	18泰州城建MTN001	2019-07-01	104.76	200,000	20,952,000.00
101800830	18义乌国资MTN002	2019-07-01	102.11	300,000	30,633,000.00
合计				4,000,000	410,695,000.00

注:
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376,898,908.55元,其中,人民币328,899,100.55元于2019年07月01日到期,人民币47,999,808.00元于2019年07月03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6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477,223,000.00元,其中,人民币239,000,000.00元于2019年7月1日到期,人民币238,223,000.00元于2019年7月4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。

6.4.13.2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

单位:人民币元

短期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	40,262,000.00	40,390,000.00
A-1以下	-	-
未评级	110,021,000.00	331,748,000.00
合计	150,283,000.00	372,138,000.00

注:
未评级债券包括国债、同业存单、中央银行票据、政策性金融债和超短期融资券。

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。

6.4.13.2.3 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 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	99,720,000.00
合计	-	99,720,000.00

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	615,181,234.17	671,825,282.40
AAA以下	1,633,688,797.97	1,269,970,099.30
未评级	427,625,690.00	50,972,912.50
合计	2,676,495,722.14	1,992,768,294.20

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。

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。

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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系,审慎评估各类资产的流动性,针对性制定流动性风险管理措施,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基金资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及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严密监控,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立了巨额赎回条款,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。

本基金所持证券大部分在银行间同业市场交易,其余亦可在证券交易所上市;因此,除在附注6.4.12中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外,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
资产					
银行存款	13,294,222.84	-	-	-	13,294,222.84
结算备付金	11,914,667.85	-	-	-	11,914,667.85
存出保证金	509,318.14	-	-	-	509,318.14
交易性金融资产	1,034,448,438.26	1,415,364,696.60	376,965,587.28	364,252,834.94	3,191,031,557.08
买入返售金融资产	57,125,315.71	-	-	-	57,125,315.71
应收利息	-	-	-	41,304,680.79	41,304,680.79
应收申购款	-	-	-	34.97	34.97
资产总计	1,117,291,962.80	1,415,364,696.60	376,965,587.28	405,557,550.70	3,315,179,797.38
负债					
卖出回购金融资产款	854,121,908.55	-	-	-	854,121,908.55
应付证券清算款	-	-	-	9,357,532.06	9,357,532.06
应付赎回款	-	-	-	57,514.97	57,514.97
应付管理人报酬	-	-	-	1,394,869.98	1,394,869.98
应付托管费	-	-	-	398,534.31	398,534.31
应付交易费用	-	-	-	946,551.58	946,551.58
应交税费	-	-	-	965,858.44	965,858.44
应付利息	-	-	-	674,109.06	674,109.06
其他负债	-	-	-	94,339.51	94,339.51
负债总计	854,121,908.55	-	-	13,889,309.91	868,011,218.46
利率敏感度缺口	263,170,054.25	1,415,364,696.60	376,965,587.28	391,668,240.79	2,447,168,578.92
上年度末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	9,889,408.57	-	-	-	9,889,408.57
结算备付金	11,494,461.84	-	-	-	11,494,461.84
存出保证金	319,984.76	-	-	-	319,984.76
交易性金融资产	1,001,085,000.00	1,358,263,949.80	105,277,344.40	424,359,658.14	2,888,985,952.34
买入返售金融资产	40,850,181.28	-	-	-	40,850,181.28
应收证券清算款	-	-	-	2,515.20	2,515.20
应收利息	-	-	-	53,704,047.30	53,704,047.30
应收申购款	-	-	-	19.98	19.98
资产总计	1,063,639,036.45	1,358,263,949.80	105,277,344.40	478,066,240.62	3,005,246,571.27
负债					
卖出回购金融资产款	674,299,157.05	-	-	-	674,299,157.05
应付赎回款	-	-	-	11,250.11	11,250.11
应付管理人报酬	-	-	-	1,411,019.88	1,411,019.88
应付托管费	-	-	-	403,148.53	403,148.53
应付交易费用	-	-	-	410,050.11	410,050.11
应交税费	-	-	-	944,789.27	944,789.27
应付利息	-	-	-	969,156.78	969,156.78
其他负债	-	-	-	75,000.19	75,000.19
负债总计	674,299,157.05	-	-	4,224,414.87	678,523,571.92
利率敏感度缺口	389,339,879.40	1,358,263,949.80	105,277,344.40	473,841,825.75	2,326,722,999.35

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	629,291.34	334,462.44
	市场利率上升1个基点	-629,291.34	-334,348.51

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。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,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

金额单位:人民币元

项目	本期末 2019年06月30日 公允价值	占基金资产净值比例(%)	上年度末 2018年12月31日 公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产——股票投资	364,252,834.94	14.88	424,359,658.14	18.24
交易性金融资产——基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产——债券投资	2,826,778,722.14	115.51	2,464,626,294.20	105.93
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	3,191,031,557.08	130.40	2,888,985,952.34	124.17

注:
本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%,其中对可转换债券(含分离交易可转债)的投资比例不高于基金资产的40%,对固定收益类以外的其他资产(包括股票、权证等)的投资比例不高于基金资产的20%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。于资产负债表日,本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2其他价格风险的敏感性分析

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,除市场指标发生变动,其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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
	HS300指数下跌5%	-19,750,386.62	-23,242,078.12
	HS300指数上涨5%	19,750,386.62	23,242,078.12

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 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	合计	137,623,968.18	194,216,155.90

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、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2019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工具中属于第一层次的余额为人民币853,208,867.08元,第二层次的余额为人民币2,337,822,690.00元,无属于第三层次的余额。(于2018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工具中属于第一层次的余额为人民币500,143,989.96元,第二层次的余额为人民币2,421,309,997.50元,无属于第三层次的余额。)

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,本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3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

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	364,252,834.94	10.99
	其中:股票	364,252,834.94	10.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,826,778,722.14	85.27
	其中:债券	2,826,778,722.14	85.27
	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	57,125,315.71	1.72
	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	25,208,890.69	0.76
8	其他各项资产	41,814,033.90	1.26
9	合计	3,315,179,797.38	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	-	-
B	采矿业	14,200.00	-
C	制造业	181,524,209.29	7.42
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	28,197,785.00	1.15
J	金融业	75,155,163.12	3.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	21,896,550.00	0.89
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	57,464,927.53	2.35
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	364,252,834.94	14.88

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	601318	中国平安	407,300	36,090,853.00	1.47
2	600887	伊利股份	830,400	27,743,664.00	1.13
3	601211	国泰君安	1,291,600	23,700,860.00	0.97
4	601888	中国国旅	247,000	21,896,550.00	0.89
5	002371	北方华创	305,500	21,155,875.00	0.86
6	600763	通策医疗	236,355	20,938,689.45	0.86
7	300015	爱尔眼科	655,864	20,312,108.08	0.83
8	300347	泰格医药	210,300	16,214,130.00	0.66
9	600030	中信证券	645,252	15,363,450.12	0.63
10	601989	中国重工	2,706,800	15,049,808.00	0.61
11	600690	青岛海尔	846,600	14,637,714.00	0.60
12	002179	中航光电	437,380	14,634,734.80	0.60
13	600276	恒瑞医药	220,300	14,539,800.00	0.59
14	000333	美的集团	275,400	14,282,244.00	0.58
15	600050	中国联通	2,315,000	14,260,400.00	0.58
16	300059	东方财富	1,028,300	13,933,465.00	0.57
17	000661	长春高新	40,000	13,520,000.00	0.55
18	300760	迈瑞医疗	80,700	13,170,240.00	0.54
19	002202	金风科技	981,843	12,204,308.49	0.50
20	002582	好想你	1,168,000	10,582,080.00	0.43
21	002531	天顺风能	850,000	5,134,000.00	0.21
22	000063	中兴通讯	149,700	4,869,741.00	0.20
23	600968	海油发展	4,000	14,200.00	0.00
24	601698	中国卫通	1,000	3,920.00	0.00

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	600020	中原高速	115,406,769.00	4.96
2	002371	北方华创	51,862,106.14	2.23
3	601766	中国中车	44,958,963.00	1.93
4	600958	东方证券	42,491,197.06	1.83
5	601888	中国国旅	41,101,856.43	1.77
6	300347	泰格医药	39,307,634.69	1.69
7	601211	国泰君安	36,186,522.00	1.56
8	601318	中国平安	35,653,971.00	1.53
9	300015	爱尔眼科	35,641,521.25	1.53
10	600763	通策医疗	35,232,470.68	1.51
11	000928	中钢国际	34,734,728.64	1.49
12	002051	中工国际	34,446,384.10	1.48
13	000661	长春高新	28,307,477.00	1.22
14	601688	华泰证券	27,577,067.04	1.19
15	600050	中国联通	26,957,500.00	1.16
16	600887	伊利股份	26,655,409.00	1.15
17	000429	粤高速A	23,695,757.69	1.02
18	002475	立讯精密	23,536,860.80	1.01
19	603501	韦尔股份	23,485,276.16	1.01
20	601668	中国建筑	23,479,888.00	1.01

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	600020	中原高速	114,364,287.04	4.92
2	601688	华泰证券	90,464,950.23	3.89
3	600030	中信证券	69,250,880.74	2.98
4	601555	东吴证券	49,491,045.50	2.13
5	601066	中信建投	45,929,309.32	1.97
6	600999	招商证券	39,512,081.30	1.70
7	601766	中国中车	39,175,844.30	1.68
8	000905	厦门港务	37,194,412.22	1.60
9	600958	东方证券	36,661,160.88	1.58
10	002371	北方华创	36,090,826.82	1.55
11	601398	工商银行	35,968,836.48	1.55
12	601186	中国铁建	31,096,572.80	1.34
13	600036	招商银行	30,647,569.68	1.32
14	300347	泰格医药	29,535,379.81	1.27
15	600755	厦门国贸	27,880,277.50	1.20
16	000928	中钢国际	27,139,745.75	1.17
17	002475	立讯精密	26,919,022.74	1.16
18	601318	中国平安	26,621,786.00	1.14
19	002051	中工国际	25,913,452.00	1.11
20	603501	韦尔股份	25,109,516.00	1.08

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

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	1,376,633,897.50
卖出股票收入(成交)总额	1,524,234,163.55

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	80,926,290.00	3.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	652,504,400.00	26.66
	其中:政策性金融债	446,624,400.00	18.25
4	企业债券	503,840,000.00	20.59
5	企业短期融资券	50,358,000.00	2.06
6	中期票据	1,050,194,000.00	42.91
7	可转债(可交换债)	488,956,032.14	19.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,826,778,722.14	115.51

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	1523003	15华夏人寿	2,000,000	205,880,000.00	8.41
2	136236	16复药01	1,000,000	100,720,000.00	4.12
3	190205	19国开05	600,000	58,770,000.00	2.40
4	113013	国君转债	516,560	58,495,254.40	2.39
5	180406	18农发06	500,000	52,950,000.00	2.16

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持有资产支持证券。

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持有贵金属。

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持有权证。

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	509,318.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	41,304,680.79
5	应收申购款	34.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,814,033.90

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113013	国君转债	58,495,254.40	2.39
2	128016	雨虹转债	33,905,794.80	1.39
3	113508	新凤转债	30,803,849.30	1.26
4	127005	长证转债	29,053,685.88	1.19
5	113011	光大转债	27,782,920.00	1.14
6	110049	海尔转债	23,416,678.40	0.96
7	132004	15国盛EB	19,692,205.80	0.80
8	113009	广汽转债	17,201,688.00	0.70
9	113015	隆基转债	16,300,901.40	0.67
10	128029	太阳转债	13,838,718.53	0.57
11	113020	桐昆转债	13,093,964.00	0.54
12	128035	大族转债	12,931,679.68	0.53
13	128024	宁行转债	12,926,706.00	0.53
14	110047	山鹰转债	12,459,739.20	0.51
15	110046	圆通转债	11,902,830.50	0.49
16	113014	林洋转债	10,898,497.70	0.45
17	110040	生益转债	8,515,250.30	0.35
18	123003	蓝思转债	7,120,917.22	0.29
19	128019	久立转2	6,693,934.84	0.27
20	113504	艾华转债	5,324,249.90	0.22
21	113518	顾家转债	5,241,636.40	0.21
22	128037	岩土转债	4,985,333.72	0.20
23	128028	赣锋转债	4,147,780.00	0.17
24	128046	利尔转债	3,473,853.18	0.14
25	128015	久其转债	2,502,900.00	0.10
26	110038	济川转债	1,798,561.40	0.07
27	113505	杭电转债	1,780,750.00	0.07
28	113525	台华转债	1,522,313.70	0.06
29	110050	佳都转债	1,251,700.00	0.05
30	110048	福能转债	1,053,654.80	0.04
31	132007	16凤凰EB	484,610.00	0.02
32	132012	17巨化EB	374,976.00	0.02
33	128013	洪涛转债	167,440.00	0.01
34	113019	玲珑转债	34,947.20	-

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
1,045	2,210,993.11	2,303,017,391.35	99.68%	7,470,403.38	0.32%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

本报告期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年03月23日)基金份额总额	1,474,806,481.51
本报告期期初基金份额总额	2,323,997,984.50
本报告期基金总申购份额	728,309,244.49
减:本报告期基金总赎回份额	741,819,434.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,310,487,794.73

§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日公告金元顺安桉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,金元顺安桉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《金元顺安沣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沣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

2019年1月,中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019年4月,中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	1	125,210,546.10	4.32%	116,608.08	5.50%	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	175,508,006.62	6.05%	134,449.33	6.34%	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
万和证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	1,518,783,962.59	52.36%	1,101,786.56	51.92%	-
民族证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	1,081,365,545.74	37.28%	769,181.03	36.25%	-

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06月30日止,本基金退租华金证券有限责任公司1个上海交易单元1个深圳交易单元,新租长江证券股份有限公司1个上海交易单元。

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例	基金交易 成交金额	占当期基金成交总额的比例
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	327,805,693.97	35.18%	4,248,910,000.00	31.43%	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	98,090,429.27	10.53%	990,186,000.00	7.32%	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
万和证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	242,848,714.54	26.07%	5,496,153,000.00	40.66%	-	-	-	-
民族证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	262,930,642.57	28.22%	2,782,710,000.00	20.59%	-	-	-	-

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	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-01-01
2	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加凯石财富为销售机构并参与费率优惠的公告	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-01-07
3	金元顺安丰利债券型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-01-08
4	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	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-01-09
5	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	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-01-09
6	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	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-01-21
7	金元顺安基金管理有限公司旗下基金2018年四季度报告	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-01-21
8	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加阳光人寿保险股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-01-25
9	金元顺安基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-01-30
10	金元顺安基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长春高新股票估值调整情况的公告	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-03-01
11	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	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-03-26
12	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	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-03-26
13	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加嘉实财富管理有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-04-02
14	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	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-04-20
15	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	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-04-27
16	金元顺安丰利债券型证券投资基金更新招募说明书2019年1号	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-05-07
17	金元顺安丰利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要2019年1号	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-05-07
18	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金参加北京恒天明泽基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-05-18
19	金元顺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	《中国证券报》和www.jysa99.com	2019-06-25

金元顺安基金管理有限公司
二〇一九年八月二十二日