

(上接B115版)

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 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、债券转及债券到期兑付/溢价收入	11,321,948.13
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	11,321,948.13

6.4.7.14.2 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、债券转及债券到期兑付/成本总额	16,526,977,690.23
减:卖出债券、债券转及债券到期兑付/成本总额	16,287,852,610.34
减:应收利息总额	120,703,001.76
卖出债券差价收入	11,321,948.13

6.4.7.14.3 资产支持证券投资

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。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

6.4.7.16 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。

6.4.7.17 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。

6.4.7.18 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。

6.4.7.19 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无公其他收入。

6.4.7.20 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	-
银行间市场交易费用	850.00
合计	850.00

6.4.7.21 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	37,010.88
信息披露费	61,562.66
银行维护费	18,000.00
其他费用	1,416.64
合计	118,161.07

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
金元顺安银行股份有限公司	基金管理人
金元顺安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海景富金融股份有限公司	基金管理人
中国宁波银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
上海金元利资产管理有限公司	基金管理人子公司

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

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。

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 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。

6.4.10.1.3 债券回购

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。

6.4.10.1.4 债券融券

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融券。

6.4.10.1.5 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未产生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
当期发生的基金应支付的托管费	19,307,652.89
其中:支付给销售机构的客户维护费	9,158,103.71

注:

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$

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。若遇法定节假日、公休等,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
当期发生的基金应支付的托管费	4,038,073.44

注:

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.08%年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$

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,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付。若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元	
项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,038,073.44

注:

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.08%年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$

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,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付。若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延。

6.4.10.3 销售服务费

单位:人民币元	
项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,038,073.44

注:

本基金分为不同的类别,适用不同的销售服务费。其中,A类基金份额销售服务费年费率为0.25%,B类基金份额销售服务费年费率为0.01%。本基金A类与B类基金份额销售服务费计提的计算方法如下:

$H = E \times \text{年销售服务费} \div \text{当年天数}$

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

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5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、公休等,支付日期顺延至最近可支付日支付。

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

单位:人民币元

信息披露

Disclosure

单位:人民币元	
长期信用评级	本期末 2019年06月30日
AAA	-
AAA以下	-
未评级	150,588,451.77
合计	150,588,451.77

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

单位:人民币元	
长期信用评级	本期末 2019年06月30日
AAA	99,962,800.07
AAA以下	-
未评级	-
合计	99,962,800.07

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已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的利益。

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;因此,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,期末未本基金的资金均能及时变现。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。

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,因此本基金的价值仍然在相应的利率风险。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	
项目	本期末 2019年06月30日
资产	-
银行存款	888,583,723.97
交易性金融资产	8,222,070,000.02
买入返售金融资产	3,432,500,869.74
应收证券清算款	50,373,750.00
应收利息	63,674,515.89
应收申购款	501.00
资产总计	12,404,154,850.82
负债	-
卖出回购金融资产款	567,986,690.33
应付管理人报酬	3,081,861.94
应付托管费	747,118.04
应付销售服务费	99,306.83
应付交易费用	308,620.13
应付股利	261,303.20
应付利息	5,043,687.05
其他负债	107,744.53
负债总计	567,986,690.33
利率敏感度缺口	11,836,168,160.49
利率敏感度缺口	11,836,168,160.49

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。

6.4.13.4.2 利率风险的敏感性分析

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日各债券的公允价值(即市值)为主要计算依据。

债券持仓结构如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

报告期内以摊余成本计量的固定收益类资产,其公允价值变动对基金资产净值的影响如下:

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8,222,070,000.82元,无属于第一层次和第二层次的余额。(于2018年06月30日,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二层次的余额。)

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
1	固定收益投资
其中:债券	-
资产支持证券	-
2	买入返售金融资产
其中:买断式回购/买入返售金融资产	-
3	银行存款和结算备付金合计
其他货币资产	-
5	合计

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元	
序号	项目
1	报告期末债券回购余额
其中:买断式回购/质押式回购	-
2	报告期末债券回购余额
其中:买断式回购/质押式回购	-

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	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	76

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	各期限段内基金资产净值
----	--------	-------------