# 金元顺安丰利债券型证券投资基金 2016年年度报告摘要

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
报告送出日期:二〇一七年三月二十九日

§1 重要提示及目录

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2017年3月17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2016年1月1日起至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 |
| 基金主代码 | 620003 |
| 交易代码 | 620003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年3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 | 2,272,415,295.36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债券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 | 本基金属于债券型基金,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。 |

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 | 凌有法 | 林葛 |
| | 联系电话 | 021-68882815 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | service@yvpfund.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 021-68881801 | 95599 |
| 传真 | | 021-68881875 | 010-63201816 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦3608 | 北京市东城区建国门内大街69号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦3608 | 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》、《上海证券报》、《证券时报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.jysa99.com |
| 基金年度报告备置地点 | 本基金管理人、基金托管人办公地址 |

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2016年 | 2015年 | 2014年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 79,040,657.01 | 5,109,489.59 | 5,559,565.38 |
| 本期利润 | 39,447,604.12 | 4,839,722.56 | 10,126,488.03 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0239 | 0.1302 | 0.1885 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.97% | 11.20% | 18.66% |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.93% | 11.68% | 19.81% |
| 3.1.2期末数据和指标 | 2016年末 | 2015年末 | 2014年末 |
| 期末可供分配利润 | 80,988,710.00 | 8,043,462.63 | 4,815,301.57 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0356 | 0.2430 | 0.1134 |
| 期末基金资产净值 | 2,353,404,005.36 | 41,149,153.79 | 47,263,006.36 |
| 期末基金份额净值 | 1.036 | 1.243 | 1.113 |
| 3.1.3累计期末指标 | 2016年末 | 2015年末 | 2014年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 25.80% | 26.98% | 13.70% |

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12月31日。

4、所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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -1.16% | 0.16% | -2.32% | 0.15% | 1.16% | 0.01% |
| 过去六个月 | 0.78% | 0.14% | -1.42% | 0.11% | 2.20% | 0.03% |
| 过去一年 | -0.93% | 0.26% | -1.63% | 0.09% | 0.70% | 0.17% |
| 过去三年 | 32.56% | 0.28% | 13.40% | 0.11% | 19.16% | 0.17% |
| 过去五年 | 36.53% | 0.27% | 20.06% | 0.09% | 16.47% | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | 25.80% | 0.28% | 27.36% | 0.09% | -1.56% | 0.20% |

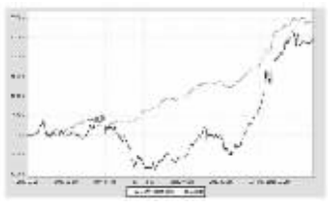
注:

1、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;

2、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

金元顺安丰利债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年3月23日至2016年12月31日)



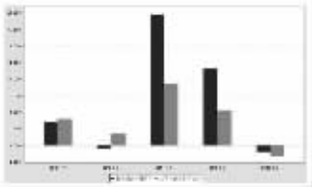
注:

1、本基金合同生效日为2009年3月23日;

2、报告期末各项资产配置符合基金合同的约定。

3.2.3过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金元顺安丰利债券型证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:

1、丰利债券基金合同生效日为2009年3月23日;

2、丰利债券基金和业绩比较基准2009年度数据按照实际存续期进行计算,非年化收益率。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位:人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2016 | 1.970 | 357,517,863.79 | 309,282,279.04 | 666,800,142.83 | - |
| 合计 | 1.970 | 357,517,863.79 | 309,282,279.04 | 666,800,142.83 | - |

§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

金元顺安基金管理有限公司(以下简称“金元顺安”)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。公司总部设在上海陆家嘴,旗下设立了北京分公司,以及一个子公司——金元百利资产管理有限公司。2012年3月,经中国证监会核准,比联资管将所持有的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。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3月,经中国证监会核准,惠理香港将所持有的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”)。

金元顺安始终坚持以“取信于市场、取信于社会为行为准则,诚实信用,勤勉尽责,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”的投资理念,遵守法律、行政法规和中国证监会的规定,遵守社会公德、商业道德,诚实守信,遵循基金份额持有人利益优先、公平对待其管理的不同基金财产和客户资产的原则,接受政府和社会公众的监督,承担社会责任。

截止至2016年12月31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、金元顺安成长动力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、金元顺安价值增长混合型证券投资基金、金元顺安核心动力混合型证券投资基金、金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金、金元顺安新经济主题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和金元顺安沣楹债券型证券投资基金共11只开放式证券投资基金。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李杰 | 本基金基金经理 | 2012-06-14 | - | 9 | 金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金、金元顺安沣楹债券型证券投资基金和金元顺安金元宝货币市场基金基金经理,上海交通大学理学硕士。曾任国联安基金管理有限公司数量策略分析员、固定收益高级研究员。2012年4月加入金元顺安基金管理有限公司,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》和《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管理办法》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》,建立了科学完善的制度和流程,从事前、事中、事后等各个业务环节严格控制不同基金之间可能存在的利益输送,覆盖了全部开放式基金及特定客户资产管理组合;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、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻。同时,通过对投资交易行为的监控、分析评估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,为确保交易的公平执行,本基金管理人交易管理实行集中交易,投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开,各投资组合的所有证券买卖活动须通过交易部集中统一完成。在报告分析环节,本基金管理人每季度和每年对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异、对连续四个季度期间内、不同时间窗内(日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差进行分析,根据收益率差异和交易价差的大小,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。本报告期内,本基金管理人严格遵守公司投资交易业务流程及公平交易制度。公司投资交易行为监控体系由稽核监察部和交易室监督,确保公平交易制度的执行和实现。

本报告期内,本基金管理人对旗下开放式基金与其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3异常交易行为的专项说明

本基金管理人《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

2016年我国经济形势表现出轻微的“滞胀”特征。GDP增速下滑势头得到遏制,全年增速6.7%,显示出底部企稳迹象;而CPI录得2%水平,通胀有所抬头。这个形势得益于供给侧结构性改革和房地产去库存政策。2016年房地产销售延续2015年以来的火爆势头,全年销售面积增速高达23%,带动房价上涨20%左右,泡沫迹象显现。同时,监管层推动钢铁煤炭行业的供给侧改革已淘汰落后产能,催生了大宗商品大幅上涨,使得PPI反转2015年的通缩走势,全年大幅7.2%,带来了巨大的通胀压力。伴随着房地产和资源领域的价格反弹,信用随之扩张,全年新增贷款12.6万亿,社会融资总量17.8万亿。随之而来影子银行复苏,一度出现“资产荒”现象,金融泡沫和金融风险上升。四季度监管层推出全面房地产调控措施,一线城市同时限购限贷;同时实施金融去杠杆,推出MPA宏观审慎和大资管监管政策;并且开始实施中性货币政策,把住货币总闸门。在多种措施的作用下,资金面紧缩,年底出现罕见的“资金荒”现象。

2016年资本市场急剧震荡。股市年初暴跌后稳步反弹,上证综合指数全年收跌12.31%;债市与之相反,先涨后跌,中债总指数全年下跌1.81%

在报告期,本基金采取低久期债券策略;股票方面精选个股,灵活变化仓位。在全年股债双杀的背景下,控制风险,下跌幅度较小,获得了超越基准的表现。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金净值增长率为-0.93%,同期业绩比较基准增长率为-1.63%。本基金超越基准0.70%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前全球各经济体处于不同的周期,2017年影响金融市场的因素比较复杂。具体看,美国就业市场和通胀水平接近政策目标,加息步伐加快,但短期内“特朗普交易”有所减弱。日欧近期PMI有所反弹,显示经济有复苏迹象,但复苏动能非常微弱,显示经济仍在底部,其央行将继续采取宽松政策。中国在供给侧改革和居民房地产加杠杆的推动下,短期内信用扩张明显,通胀压力较大,金融体现风险隐现,对货币政策形成制约。政府工作报告下调GDP增长目标到6.5%,并且降低M2增速目标到12%,而通胀目标设置在3%,显示政府对经济增长下滑的容忍度有所提高,将保持中性货币政策,把金融防风险上升到主要位置。但随着房地产调控政策的深入,以及金融去杠杆的推进,预期下半年企业补库存周期结束,经济重回下行通道,有可能提升“稳增长”在政策中的比重。

在这样复杂的经济形势下,我们认为全年流动性趋于紧张,金融市场宽幅震荡,应该采取短久期防御策略,以获取票息收益为主要手段。同时积极参与波段性的交易机会。考虑到收益率中枢相对去年提升了100bps,预期全年收益能达到4.5%左右,远高于去年水平,显示利率温和上行时期,债券仍然是不错的资产。信用债方面,将坚持选择高评级信用债,防范信用风险。

股市方面,供给侧改革和PPI上涨将改善部分行业企业利润情况,预期股市有结构性行情。我们将坚持基本面研究思路,坚持自下而上选择优质个股,以及灵活调整仓位

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、监察稽核部等部门总监组成。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、价格异常波动证券、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应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讯;

(6)对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

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

报告期内本基金利润分配情况如下:

经本基金管理人计算并由基金托管人中国农业银行股份有限公司复核,以2016年12月5日已实现的可分配收益为基准,本基金决定向基金份额持有人每10份基金份额派发红利1.97元。权益登记日及除息日:2016年12月12日,红利发放日:2016年12月13日,本基金分红方式为现金分红和红利再投。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期,会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

§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

本报告期内,本基金托管人在对金元顺安丰利债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,金元顺安丰利债券型证券投资基金的管理人——金元顺安基金管理有限公司在金元顺安丰利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,金元顺安丰利债券型证券投资基金以2016年12月5日已实现的可分配收益为基准,向基金份额持有人每10份基金份额派发红利1.97元。权益登记日及除息日:2016年12月12日,红利发放日:2016年12月13日,本基金分红方式为现金分红和红利再投。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对金元顺安基金管理有限公司编制和披露的金元顺安丰利债券型证券投资基金2016年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)对金元顺安基金管理有限公司金元顺安丰利债券型证券投资基金证券投资基金2016年12月31日的资产负债表,2016年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告(安永华明(2017)审字第60657709_B03号)。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人金元顺安基金管理有限公司的责任。

这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。

选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了金元顺安丰利债券型证券投资基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和净值变动情况。

注册会计师:汤骏、朱昀

§7 年度财务报表

7.1 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:2016年12月31日

单位:人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 139,879,683.78 | 170,127.60 |
| 结算备付金 | | 2,923,561.37 | 949,286.79 |
| 存出保证金 | | 609,142.99 | 28,660.39 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 2,517,341,908.46 | 40,283,392.60 |
| 其中:股票投资 | 7.4.7.2 | 93,784,632.66 | 800,656.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | 7.4.7.2 | 2,423,557,275.80 | 39,482,736.60 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 1,174,714.65 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 44,875,987.09 | 774,145.76 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 4,000.00 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,705,630,283.69 | 43,384,327.79 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| 负债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 347,999,731.50 | 1,400,000.00 |
| 应付证券清算款 | | | - |
| 应付赎回款 | | 16.41 | 300.79 |
| 应付管理人报酬 | | 1,695,445.15 | 25,498.75 |
| 应付托管费 | | 484,412.90 | 7,285.33 |
| 应付销售服务费 | | - | 14,570.70 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 1,108,481.21 | 28,291.91 |
| 应交税费 | | 704,225.84 | 704,225.84 |
| 应付利息 | | 178,965.28 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 55,000.04 | 55,000.68 |
| 负债合计 | | 352,226,278.33 | 2,235,174.00 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 2,272,415,295.36 | 33,105,691.16 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 80,988,710.00 | 8,043,462.63 |
| 所有者权益合计 | | 2,353,404,005.36 | 41,149,153.79 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,705,630,283.69 | 43,384,327.79 |

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.036元,基金份额总额2,272,415,295.36份。

7.2 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:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 66,481,310.67 | 5,965,068.08 |
| 1.利息收入 | | 74,036,646.02 | 2,580,786.07 |
| 其中:存款利息收入 | 7.4.7.11 | 440,156.72 | 19,998.40 |
| 债券利息收入 | | 71,469,599.71 | 2,549,159.79 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,126,889.59 | 11,627.88 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 30,933,812.71 | 3,615,309.47 |
| 其中:股票投资收益 | 7.4.7.12 | 49,481,517.59 | 683,150.11 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | -22,720,218.20 | 2,931,173.36 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.16 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.17 | 4,172,513.32 | 986.00 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 7.4.7.18 | -39,593,052.89 | -269,767.03 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 7.4.7.19 | 1,103,904.83 | 38,739.57 |
| 减:二、费用 | | 27,033,706.55 | 1,125,345.52 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2 | 13,855,692.40 | 303,934.91 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2 | 3,958,769.28 | 86,838.43 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2 | 2,917,041.33 | 173,677.07 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.20 | 3,302,133.26 | 47,732.70 |
| 5. 利息支出 | | 2,753,647.51 | 274,304.57 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 2,753,647.51 | 274,304.57 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.21 | 246,422.77 | 238,857.84 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 39,447,604.12 | 4,839,722.56 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 39,447,604.12 | 4,839,722.56 |

7.3 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:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31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) | 33,105,691.16 | 8,043,462.63 | 41,149,153.79 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 39,447,604.12 | 39,447,604.12 |
| 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) | 2,239,309,604.20 | 700,297,786.08 | 2,939,607,390.28 |
| 其中:1.基金申购款 | 3,655,171,424.72 | 755,537,854.70 | 4,410,709,279.42 |
| 2.基金赎回款 | -1,415,861,820.52 | -55,240,068.62 | -1,471,101,889.14 |
| 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) | - | -666,800,142.83 | -666,800,142.83 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,272,415,295.36 | 80,988,710.00 | 2,353,404,005.36 |

| 项目 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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) | 42,447,704.79 | 4,815,301.57 | 47,263,006.36 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 4,839,722.56 | 4,839,722.56 |
| 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) | -9,342,013.63 | -1,611,561.50 | -10,953,575.13 |
| 其中:1.基金申购款 | 44,682,977.87 | 7,080,408.39 | 51,763,386.26 |
| 2.基金赎回款 | -54,024,991.50 | -8,691,969.89 | -62,716,961.39 |
| 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) | 33,105,691.16 | 8,043,462.63 | 41,149,153.79 |

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:张嘉宾,主管会计工作负责人:符刃,会计机构负责人:季泽

7.4 报表附注

7.4.1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3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已于2013年3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,报请中国证监会同意,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5月2日公告。

2015年2月5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3月6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3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7月15日进行公告。

本基金主要投资于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)、资产支持证券和债券回购等,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。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。本基金业绩比较基准为中债综合指数。

7.4.2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(以下合称“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》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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。

7.4.3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2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前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主要包括股票投资和债券投资;

2、金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方);本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止