金元顺安沣楹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：中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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9月22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	金元顺安沣楹债券型证券投资基金
基金简称	金元顺安沣楹债券
基金主代码	003135
交易代码	003135
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月22日
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	251,644,221.51份

2.2基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券资产，在控制基金资产净值波动的基础上，严格管理股票资产的投资比例，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1.大类资产配置策略 本基金根据宏观经济注债券、股票市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势，国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。 2.债券投资策略 （1）债券投资策略 本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。 1）在久期配置方面，本基金将对宏观经济走势、经济周期所处的阶段和货币政策等进行研究，预测未来收益率曲线变动趋势，并跟此积极调整债券组合的平均久期，提高债券组合的总投资收益。 2）在类属配置方面，本基金将对宏观经济周期、市场利率走势、资金供求变化，以及信用债券的信用风险等因素进行分析，根据各债券类属的风险收益特征，定期对债券类属资产进行优化配置和调整，确定债券类属资产的最优权重。 3）在期限结构配置方面，本基金将对市场收益率曲线变动情况进行研判，在长期、中期和短期债券之间进行配置，适时采用子弹型、哑铃型或梯形策略构建投资组合，以期在收益率曲线调整的过程中获得较好收益。 4）在个券选择方面，对于国债、央行票据等非信用类债券，本基金将根据宏观经济变量和宏观经济政策的分析，预测未来收益率曲线的变动趋势，综合考虑组合流动性需求投资品种；对于信用类债券，本基金将根据发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、流动性等因素，对信用债进行信用风险评估，系统发掘信用利差具有相对投资价值的品种进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。 5）证券公司短期公司债券投资策略 本基金将根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，并严格控制单只证券公司短期公司债券的投资比例。此外，由于证券公司短期公司债券概扰流动性相对较差，本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资，保证本基金的流动性。 （2）可转换债券及可交换债券投资策略 可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值，债券价值和隐含期权价值，本基金管理人将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。此外，本基金还将根据新发可转债和可交换债券的预计中签率、模型定价结果、积极参与可转债和可交换债券新券的申购。 （3）杠杆投资策略 本基金将对资金面进行综合分析的基础上，比较债券收益率、存款利率和融资成本，判断利差空间，力争通过杠杆操作放大组合收益。 （4）银行存款投资策略 本基金根据宏观经济指标分析各类资产的预期收益率水平，并据此制定和调整资产配置策略，当银行存款投资具有较高投资价值时，本基金将提高银行存款投资比例。 3.股票投资策略 本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自上而下”的投资策略，精选优质企业进行投资。本基金将结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司竞争优势等因素的判断，对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析，追求股票投资组合的长期稳健增值。 4.权证投资策略 本基金将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型计算权证价值。本基金权证操作将根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性结合本基金的需要进行该产品的投资。主要考虑运用的策略包括：限定风险，行业集中度、公司竞争优势等因素的判断，对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析，追求股票投资组合的长期稳健增值。
业绩比较基准	中债综合指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌有法	罗菲菲
	联系电话	021-68881801	010-58560666
	电子邮箱	service@jysa99.com	mstgqingxuan@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-666-0666	010-58560666
传真		021-68881875	010-58560701
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9006室	北京市西城区复兴门内大街2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9006室	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		任开宇	洪崎

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9月22日（基金合同生效日）至2016年12月31日
本期已实现收益	582,783.61
本期利润	-5,149,108.25
加权平均基金份额本期利润	-0.0242
本期加权平均净值利润率	-2.4352%
本期基金份额净值增长率	-2.33%
3.1.2期末数据和指标	2016年末
期末可供分配利润	-5,858,482.17
期末可供分配基金份额利润	-0.02
期末基金资产净值	245,785,739.34
期末基金份额净值	0.9767
3.1.3累计期末指标	2016年末
基金份额累计净值增长率	-2.33%

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。

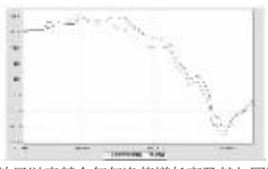
3.2基金净值表现

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	-2.40%	0.14%	-2.32%	0.13%	-0.08%	0.01%
自基金合同生效起至今	-2.33%	0.13%	-2.21%	0.14%	-0.12%	-0.01%

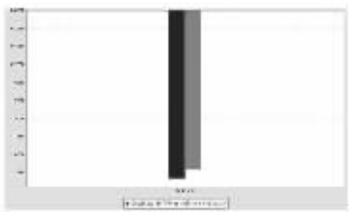
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金元顺安沣楹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
（2016年9月22日至2016年12月31日）



3.2.3合同生效日以来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

金元顺安沣楹债券型证券投资基金
合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：

1、本基金合同生效日为2016年9月22日；

2、基金增长率为实际投资期间的收益率，未经过年化处理；

3.3过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行过利润分配。

§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	2016-09-22	-	9	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》、《金元顺安沣楹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，本基金开始建仓，并遭受债券下跌冲击，收益与基准相当。

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-2.33%，同期业绩比较基准增长率为-2.21%。本基金落后基准0.12%。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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沣楹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、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理人——金元顺安基金管理有限公司在金元顺安沣楹债券型证券投资基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有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，金元顺安沣楹债券型证券投资基金未进行利润分配。

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

由金元顺安沣楹债券型证券投资基金管理人——金元顺安基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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沣楹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_B11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沣楹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：金元顺安沣楹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
资产：		
银行存款	7.4.7.1	12,552,985.13
结算备付金		51,193.04
存出保证金		1,144.32
交易性金融资产	7.4.7.2	201,256,710.00
其中：股票投资	7.4.7.2	2,729,300.00
基金投资		-
债券投资	7.4.7.2	198,527,410.00
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	30,000,165.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	2,130,917.98
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		245,993,115.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		165.29
应付管理人报酬		137,584.67
应付托管费		19,654.97
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	4,970.83
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	45,000.37
负债合计		207,376.13
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	251,644,221.51
未分配利润	7.4.7.10	-5,858,482.17
所有者权益合计		245,785,739.34
负债和所有者权益总计		245,993,115.47

注：

1、报告截止日2016年12月31日，基金份额净值为人民币0.9767元，基金份额总额251,644,221.51份。

2、本基金合同于2016年9月22日生效。

7.2利润表

会计主体：金元顺安沣楹债券型证券投资基金

本报告期：2016年9月22日（基金合同生效日）至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年9月22日（基金合同生效日）至2016年12月31日
一、收入		-4,557,748.31
1.利息收入		1,973,175.68
其中：存款利息收入	7.4.7.11	44,984.82
债券利息收入		1,392,068.57
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		536,122.29
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-799,110.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2.02
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-799,112.05
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	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-5,731,891.86
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	77.90
减：二、费用		591,359.94
1. 管理人报酬	7.4.10.2	403,245.19
2. 托管费	7.4.10.2	57,606.48
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.20	4,040.21
5. 利息支出		49,781.63
其中：卖出回购金融资产支出		49,781.63
6. 其他费用	7.4.7.21	76,686.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,149,108.25
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列		-5,149,108.25

7.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安沣楹债券型证券投资基金

本报告期：2016年9月22日（基金合同生效日）至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月22日（基金合同生效日）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）	200,971,336.64	-	200,971,336.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,149,108.25	-5,149,108.25
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）	50,672,884.87	-709,373.92	49,963,510.95
其中：1.基金申购款	50,775,082.25	-709,917.28	50,065,164.97
2.基金赎回款	-102,197.38	543.36	-101,654.02
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）	251,644,221.51	-5,858,482.17	245,785,739.34

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

金元顺安沣楹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（2016）1650号文《关于准予金元顺安沣楹债券型证券投资基金注册的批复》的批准，由金元顺安基金管理有限公司作为基金管理人于2016年8月18日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2016）验字第60778298_B01号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年9月22日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为200,867,178.41元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币104,158.23元，以上实收基金（本息）合计为人民币200,971,336.64元，折合200,971,336.64份基金份额。本基金管理人为金元顺安基金管理有限公司，注册登记机构为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含可分离型可转换债券）、可交换债券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款以及其他银行存款）、非金融企业债务融资工具、同业存单、货币市场工具、股票（含中小板、创业板及其他依法上市的股票）、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准：中债综合指数收益率。

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9月22日（基金合同生效日）至2016年12月31日止期间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。本期财务报表的实际编制期间系2016年9月22日（基金合同生效日）至2016年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，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

1、股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

2、债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的