金元顺安沣楹债券型证券投资基金

【2017】第一季度报告

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:二〇一七年四月二十四日

§1重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	251,519,136.23份
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	本基金将密切关注债券、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的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。
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。
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

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-1,819,028.75
2.本期利润	-1,374,036.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0055
4.期末基金资产净值	244,289,292.01
5.期末基金份额净值	0.9713

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。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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	-0.55%	0.12%	-1.24%	0.07%	0.69%	0.05%

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、本基金合同生效日为2016年9月22日;

3、本基金业绩比较基准为:中债综合指数;

3.2.2自基金合同生效以来基金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

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2017年3月31日)

§4管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2016-9-22	-	10	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,10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管理人对投资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》等有关法律法规及其各项实施准则、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公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本报告期,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》,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、股票备选库管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等,重视交易执行环节的公平交易措施,启用投资交易系统中的公平交易模块,以确保公平对待各投资组合。在报告期内,本管理人对不同投资组合的交易价差、收益率进行分析,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2异常交易行为的专项说明

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年一季度我国经济呈现开门红。GDP同比增速6.9%,创5个季度以来新高,工业生产稳重有升,固定资产投资、进出口金额都有所回升,消费保持稳定。这是2016年供给侧结构性改革和房地产销售火爆所带来持续影响。伴随经济复苏,信用也延续扩张态势。一季度新增信贷4.5万亿,非标融资扩张迅速,社会融资总量同比12.5%,远远高于GDP增速。大宗商品价格继续上涨,PPI保持在7.6%的高位;金融泡沫和金融风险上升。监管层采取了中性偏紧的货币政策,央行对公开市场操作和MLF进行了一系列加息措施,深入推进MPA宏观审慎政策。银监会等部门出台一系列文件加强对影子银行的监管,切实促进金融去杠杆。在多种措施的作用下,资金面偏紧,债市急剧波动。而股市在供给侧改革和经济复苏的背景,稳步上涨。一季度上证综合指数上涨1.83%;中债总指数下跌1.43%

在报告期,本基金采取短久期债券策略,规避了流动性冲击的风险,并且获得良好的收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金净值增长率为-0.55%,同期业绩比较基准增长率-1.24%。本基金超越基准0.69%。

4.6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,进入加息通道,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。因为一季度经济数据良好,政府对经济增长下滑的容忍度有所提高,监管层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,经济里回下行通道,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,我们认为二季度流动性继续保持紧平衡,金融市场宽幅震荡,应该采取短久期防御策略,控制好流动性风险。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

在本报告期内,该基金未曾出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形。

§5投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	47,339,143.28	18.10
	其中:股票	47,339,143.28	18.10
2	固定收益投资	196,690,766.00	75.22
	其中:债券	196,690,766.00	75.22
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	14,315,321.03	5.47
7	其他资产	3,145,622.02	1.20
8	合计	261,490,852.33	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	17,213,000.48	7.05
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	24,518,832.80	10.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,866,496.00	1.58
K	房地产业	1,740,814.00	0.71
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	47,339,143.28	19.38

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600717	天津港	1,917,780	22,563,092.80	9.23
2	600160	巨化股份	417,854	4,694,143.34	1.92
3	300067	安诺其	418,000	3,440,140.00	1.41
4	300282	汇冠股份	133,576	3,355,429.12	1.37
5	002531	天顺风能	378,242	2,768,731.44	1.13
6	601601	中国太保	91,800	2,517,156.00	1.03
7	600018	上港集团	332,500	1,961,750.00	0.80
8	300230	永利股份	59,001	1,922,252.58	0.79
9	600155	宝硕股份	104,600	1,349,340.00	0.55
10	600376	首开股份	103,400	1,245,970.00	0.51

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	30,856,800.00	12.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	60,531,966.00	24.78
5	企业短期融资券	59,887,000.00	24.51
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	中期票据	45,415,000.00	18.59
9	其他	-	-
10	合计	196,690,766.00	80.52

5.5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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101460025	14潍坊滨投MTN001	200,000	21,172,000.00	8.67
2	011756001	17远东租赁SCP001	200,000	20,020,000.00	8.20
3	041602051	16协鑫发电CP001	200,000	19,874,000.00	8.14
4	101664066	16南通高新MTN001	200,000	19,370,000.00	7.93
5	136788	16京运01	200,000	19,336,000.00	7.92

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2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。

5.10.3本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期有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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,337.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,136,284.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,145,622.02

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告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的情况。

5.11.6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。

§6开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	251,644,221.51
报告期期间基金总申购份额	5,679.50
减:报告期期间基金总赎回份额	130,764.78
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期末基金份额总额	251,519,136.23

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年1月1日-2017年3月31日	250,811,924.95	-	-	250,811,924.95	99.72%
产品持有风险							

1、持有份额比例较高的投资者("高比例投资者")大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回,中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险,赎回款项延期获得。

2、基金净值大幅波动的风险

高比例投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费,相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产,可能对基金资产净值造成较大波动。

3、基金规模较小导致的风险

高比例投资者赎回后,可能导致基金规模较小,从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责,执行相关投资策略,力争实现投资目标。

8.2影响投资者决策的其他重要信息

1、2017年1月19日,在《中国证券报》和www.jysa99.com上公布金元顺安沣楹债券型证券投资基金2016年第4季度报告;

2、2017年3月29日,在《中国证券报》和www.jysa99.com上公布金元顺安沣楹债券型证券投资基金2016年年度报告(正文);

3、2017年3月29日,在《中国证券报》和www.jysa99.com上公布金元顺安沣楹债券型证券投资基金2016年年度报告(摘要)。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会准予金元顺安沣楹债券型证券投资基金募集注册的文件

2、《金元顺安沣楹债券型证券投资基金合同》

3、《金元顺安沣楹债券型证券投资基金基金招募说明书》

4、《金元顺安沣楹债券型证券投资基金托管协议》

5、关于申请募集注册金元顺安沣楹债券型证券投资基金的法律意见书

6、基金管理人业务资格批件、营业执照

7、基金托管人业务资格批件、营业执照

8、中国证监会要求的其他文件

9.2存放地点

金元顺安基金管理有限公司

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

9.3查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间至办公地点进行查询,或登录本基金管理人网站www.jysa99.com查阅。投资者对本报告书存有疑问,可咨询本基金管理人金元顺安基金管理有限公司,本公司客服电话400-666-0666、021-68881898。

金元顺安基金管理有限公司
二〇一七年四月二十四日

金元顺安核心动力混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:金元顺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十四日

§1重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2基金产品概况

基金简称	金元顺安核心动力混合
基金主代码	620005
交易代码	620005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月11日
报告期末基金份额总额	141,179,977.90份
投资目标	通过运用"核心—卫星"股票投资策略,将大部分基金资产用于完全复制大型上市公司股票指数(中证100指数)的业绩表现,并将部分资产投资于中证100指数以外的具备良好成长潜力且价值被低估的上市公司股票,在控制组合风险的前提下,追求基金资产中长期的稳定增值。
投资策略	本基金的资产配置策略分为两个层次:第一层为大类资产配置策略,以确定基金资产在股票、债券和现金之间的比例;第二层以"核心—卫星"策略作为基金股票资产的配置策略。
业绩比较基准	中证100指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,其风险收益特征从长期平均及预期来看,低于股票型基金,高于债券型基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的证券投资基金品种。
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	231,485.21
2.本期利润	1,508,602.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0566
4.期末基金资产净值	150,103,714.73
5.期末基金份额净值	1.063

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。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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	4.94%	0.45%	3.61%	0.41%	1.33%	0.04%

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、本基金选择中证100指数作为股票投资部分的业绩基准,选择中债总指数作为债券投资部分的业绩基准,复合业绩比较基准为:中证100指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%;

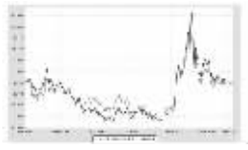
3、本基金合同生效日为2010年2月11日。

3.2.2自基金合同生效以来基金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

金元顺安核心动力混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年2月11日至2017年3月31日)



§4管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
侯斌	本基金经理	2015-7-3	-	15	金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安宝石动力混合型证券投资基金和金元顺安核心动力混合型证券投资基金的基金经理,上海财经大学经济学学士,曾任光大保德信基金管理有限公司行业研究员。2010年6月加入金元顺安基金管理有限公司,历任高级行业研究员,金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理,金元顺安宝石动力混合型证券投资基金基金经理助理,金元顺安价值增长混合型证券投资基金基金经理助理,15年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管理人对投资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》等有关法律法规及其各项实施准则、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公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本报告期,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》,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、股票备选库管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等,重视交易执行环节的公平交易措施,启用投资交易系统中的公平交易模块,以确保公平对待各投资组合。在报告期内,本管理人对不同投资组合的交易价差、收益率进行分析,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2异常交易行为的专项说明

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《异常交易监控与报告制度》。本报告期,根据制度的规定,对交易进行了监控,未发现异常交易行为。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金重点投资于价值低估、成长性好的股票,整体仓位适中,行业集中度较低,电子通信、医药生物和机械设备的行业权重相对较高。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为-2.49%,业绩比较基准收益率为3.39%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观来看,1月、2月经济数据表现良好,工业用电量、铁路公路水路货运量、民间投资、进出口增速都进一步提升,企业利润、财政收入也加快增长。预计后续主要宏观数据仍会延续前两个月的良好势头,一季度经济将好于预期。虽然一季度经济有所企稳,但今年整体下行压力犹在,经济重新进入回升周期的可能性较小。

从流动性来看,今年货币政策预计将保持稳健中性,市场流动性水平不会过于宽裕,市场仍将处于存量博弈下的震荡状态。

从基本面来看,在目前已披露一季度业绩预告的公司中,钢铁、化工、电气设备等传统行业受益于一季度经济回暖,业绩表现优异,预计未来股价走势将强于大盘。在一季报正式发布前,业绩增长兑现确定性高的公司将存在较好的投资机会。

从风格来看,大强小弱的格局可能贯穿2017全年,高分红、高价值或高增长的股票值得重点关注。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

在本报告期内,本基金曾出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形:截止到2017年03月31日,该基金连续四百三十四个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§5投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,516,016.42	77.60
	其中:股票	18,516,016.42	77.60
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	2,000,000.00	8.38
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,294,999.51	13.81
7	其他资产	49,291.09	0.21
8	合计	23,860,307.02	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

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	596,471.00	2.50
B	采矿业	248,010.00	1.06
C	制造业	11,648,509.00	49.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	610,165.00	2.60
E	建筑业	353,774.00	1.51
F	批发和零售业	451,104.00	1.92
G	交通运输、仓储和邮政业	236,471.00	1.01
H	住宿和餐饮业	112,690.00	0.48
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,011,732.50	8.57
J	金融业	13,360.00	0.06
K	房地产业	446,506.82	1.90
L	租赁和商务服务业	379,393.18	1.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	226,575.00	0.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	115,940.00	0.49
Q	卫生和社会工作	238,260.00	1.02
R	文化、体育和娱乐业	837,054.92	3.57
S	综合	-	-
	合计	18,516,016.42	78.90

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	41,513	1,536,396.13	1.02
2	600016	民生银行	110,482	936,887.36	0.62
3	601166	兴业银行	51,221	830,292.41	0.55
4	600036	招商银行	39,497	757,157.49	0.50
5	600519	贵州茅台	1,856	717,084.16	0.48
6	601328	交通银行	104,960	653,900.80	0.44
7	002443	金洲管道	50,000	597,000.00	0.40
8	000651	格力电器	18,400	583,280.00	0.39
9	000333	美的集团	17,180	572,094.00	0.38
10	300503	昊志机电	9,100	557,011.00	0.37

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	46,000.00	0.03
8	其他	-	-
9	合计	46,000.00	0.03

5.5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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	460	46,000.00	0.03

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2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。

5.10.3本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期有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。

1、关于任子行(代码:300311)的处罚说明

任子行网络技术股份有限公司(以下简称"公司")于2016年12月13日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》,编号:深证调查字16272号,通知书的内容为:因你公司涉嫌信息披露违法违规,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,我会决定对你公司立案调查。

现作出说明如下:

公司涉嫌信息披露违法违规,尚未收到证监会的最终调查结论。目前股价在消化负面消息后趋于平稳,将择机清仓该股票。

投资决策程序:基金经理根据基本面、技术面等因素选股,该股票在去年12月出现负面消息后股价超跌,但基本面优良,因此在3月底纳入股票组合,但权重很低,目前不在前10大持仓中。

2、关于胜利精密(代码:002426)的处罚说明

近日,证监会对1宗内幕交易案作出行政处罚决定:

在1宗内幕交易案中,卫强、李文龙、高某根、陈某良、包某青、王某仓是苏州胜利精密制造科技股份有限公司(简称胜利精密)收购转型这一内幕信息的知情人。内幕信息敏感期间内,卫强使用本人账户买入"胜利精密"股票约8万股,成交金额约80万元,获利约13万元;李文龙使用其配偶李某英账户买入"胜利精密"股票8万股,成交金额935万元;陈某良配偶陆小萍使用王某勇账户买入"胜利精密"股票约118万股,成交金额约1,103万元,卖出1万股,成交金额约8.8万元,获利约133万元;欧阳俊东与高某根、包某青、陈某良存在频繁通话,其使用本人及王某勤、蔡某喜、顾某珍账户买入"胜利精密"股票约439万股,成交金额约3,886万元,获利约717万元;袁某超与王某仓有通讯联系,张琴与袁某超关系密切,其使用本人账户买入"胜利精密"股票约9.6万股,成交金额约110万元。卫强、李文龙、陆小萍、欧阳俊东、张琴的上述行为违反了《证券法》第73条、76条规定,构成内幕交易行为。依据《证券法》第203条规定,我会决定没收卫强违法所得约13万元,并处以约13万元罚款;对李文龙处以10万元罚款;没收陆小萍违法所得约133万元,并处以约133万元罚款;没收欧阳俊东违法所得约717万元,并处以约717万元罚款;对张琴处以10万元的罚款。 @ 上述行为违反了证券法律法规,破坏了市场秩序,必须坚决予以打击。我会将持续对市场操纵、内幕交易以及基金公司违法违规行为保持高压态势,严厉查处,切实维护市场公开、公平、公正。

现作出说明如下:

新闻涉及内幕消息知情人利用消息非法获利,发生时间久远,与本基金购买此股票时间完全不重合。

投资决策程序:基金经理根据基本面、技术面等因素选股,个股权重较为分散。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,322.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	418.95
5	应收申购款	121,393.009.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,402,751.72

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002426	胜利精密	597,000.00	0.40	重大资产重组

5.11.6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。

§6开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	27,286,028.30
报告期期间基金总申购份额	114,410,851.62
减:报告期期间基金总赎回份额	516,902.02
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期末基金份额总额	141,179,977.90

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	13,724,914.64
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	13,548,780.49
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	9.60%

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号