金元顺安宝石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	金元顺安宝石动力混合
基金主代码	620001
交易代码	620001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月16日
报告期末基金份额总额	109,542,326.98份
投资目标	本基金主要投资具有稳健基础的中国优质企业,追求本基金资产的稳定收益与长期资本增值。
投资策略	在不同的市场阶段,本基金将分别从宏观经济情景、各类资产收益风险预期等方面进行深入分析,在股票与债券资产之间进行策略性资产配置,以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上,优化基金资产组合。
业绩比较基准	标普中国A股300指数×50%+中证综合债指数×50%
风险收益特征	本基金为一只稳健增长型的混合型基金,其风险收益特征从长期平均及预期来看,低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场型基金,属于中等预期收益、中等预期风险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	1,469,347.56
2.本期利润	2,144,262.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.0193
4.期末基金资产净值	110,407,039.70
5.期末基金份额净值	1.0079

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①①	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	1.96%	0.36%	2.62%	0.25%	-0.66%	0.11%

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.本基金业绩比较基准为:标普中国A股300指数×50%+中证综合债指数×50%;
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

金元顺安宝石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
(2007年8月15日至2017年3月31日)

注:
1.本基金合同生效日为2007年8月15日,基金的建仓期系自2007年8月15日起至2008年3月14日,在建仓期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定;
2.本基金业绩比较基准为:标普中国A股300指数×50%+中证综合债指数×50%;
3.本基金投资组合中,股票资产占基金资产的比例为40%-60%,债券资产占基金资产的比例为35%-65%,权证不超过基金资产净值的3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。

§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	本基金基金经理	2011-12-22	-	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行业研究员,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,金元顺安核心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。15年基金等金融行业从业经历,具有基金从业资格。
闵杭	本基金基金经理	2015-10-16	-	23	金元顺安消费主题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、金元顺安宏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、金元顺安金速宝货币市场基金和金元顺安牧盛债券型证券投资基金的基金经理,上海交通大学工学学士。曾任渊时证券投资有限公司上海自营分公司总经理,申银万国证券投资有限公司证券投资总部投资总监。2015年8月加入金元顺安基金管理有限公司。23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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及其在国实施准则、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,基金运作基本合法合规,无损害基金持有人利益的情况。
本报告期内,本基金不曾出现违规三十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	54,523,845.45	48.96
	其中:股票	54,523,845.45	48.96
2	固定收益投资	45,505,788.90	40.86
	其中:债券	45,505,788.90	40.86
	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	10,226,897.34	9.18
7	其他资产	1,118,698.11	1.00
8	合计	111,375,229.80	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	2,197,443.52	1.99
C	制造业	20,242,135.46	18.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	21,986,042.47	19.91
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,990.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,635.00	0.03
J	金融业	10,057,599.00	9.11
K	房地产业	-	-
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	54,523,845.45	49.38

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	600276	恒瑞医药	132,540	7,200,898.20	6.52
2	600491	龙元建设	464,079	5,244,092.70	4.75
3	600502	安徽水利	517,577	4,953,211.89	4.49
4	600068	葛洲坝	390,200	4,592,654.00	4.16
5	601618	中国中冶	884,300	4,492,244.00	4.07
6	600036	招商银行	186,400	3,573,288.00	3.24
7	600562	天地科技	631,000	3,571,460.00	3.23
8	601377	兴业证券	422,250	3,234,435.00	2.93
9	601169	北京银行	333,600	3,206,896.00	2.90
10	600362	江西铜业	158,100	2,727,225.00	2.47

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	19,986,000.00	18.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,872,750.00	9.85
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	14,647,038.90	13.27
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	45,505,788.90	41.22

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	018002	国开1302	105,000	10,872,750.00	9.85
2	122652	12杨农债	100,010	10,390,038.90	9.41
3	019539	16国债11	100,000	9,994,000.00	9.05
4	010303	03国债(3)	100,000	9,992,000.00	9.05
5	1380055	13万正债	100,000	4,257,000.00	3.86

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投资贵金属。
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投资权证。
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。
2016年4月12日上海证券交易所对中国冶金科工股份有限公司及董事会秘书肖学文予以通报批评,具体内容如下:
当事人:
中国冶金科工股份有限公司,A股证券简称:中国中冶,A股证券代码:601618;
肖学文,时任中国冶金科工股份有限公司董事会秘书。
经查明,中国冶金科工股份有限公司(以下简称"公司")在停复牌业务办理、信息披露等方面,公司董事会秘书肖学文在职责履行方面存在以下违规行为:
(1)公司重大事项未按分阶段披露原则披露,公司股票长期停牌理由不充分
公司以控股股东中国冶金科工集团有限公司(以下简称"中冶集团")正在筹划可能对公司股价产生影响的重大事项为由,申请自2015年8月26日起股票连续停牌。2015年12月9日,公司披露复牌公告称,所涉及重大事项为中冶集团整体成为中国五矿的全资子公司,公司股票于同日复牌。
公司股票停牌期间,上海证券交易所(以下简称"本所")公司监管部门先后向公司发出2份监管工作函、1份问询函,约见公司相关负责人进行谈话,多次督促公司及时披露重大事项的进展情况并尽早办理复牌。但公司在停牌期间披露的12份进展公告中均称,控股股东"正在筹划涉及本公司的重大事项"、"目前该事项正在筹划过程中,尚存在不确定性"。公司上述进展公告的内容完全相同,也未按照本所相关规定和工作要求明确重大事项的具体内容和预计复牌时间,直至12月9日公司复牌时才披露所涉及重大事项的内容为集团层面的股权划转,明间停牌长达3个半月。
根据公司复牌公告,公司相关重大事项不涉及上市公司层面的资产、股权调整,也不会引起上市公司实际控制人的变更。公司应当按照分阶段披露原则履行披露义务,但公司股票以上述事项为由停牌长达3个半月,停牌理由不充分。公司及董事会未能审慎办理公司停复牌事项,致使公司股票长时间停牌,对公司正常股票交易秩序造成不利影响。
(2)公司公告披露内容缺乏事实基础
公司于2015年12月9日披露的复牌公告中称,此次整合有利于公司"和极拓展智慧城市、海绵城市、美丽乡村建设,拓展先进制造与3D打印、互联网+等",涉及多项市场关注的新兴业务,但未披露公司相关业务筹划、准备和开展的具体情况,也未提供相关事实依据。公司公告缺乏事实基础,也未能充分揭示可能存在的风险。
综上所述,公司未按分阶段披露原则披露重大事项,公司股票长期停牌理由不充分,重要公告的信息披露内容缺乏事实基础等行为违反了《上海证券交易所股票上市规则(以下简称"《股票上市规则")》第1.4条、第2.1条、第2.5条、第7.5条、第12.3条的有关规定。公司董事会秘书肖学文作为公司信息披露事务具体负责人,对公司违法违规行为负有直接责任,违反了《股票上市规则》第1.4条、第2.2条、第3.1.4条和第3.2.2条的规定及在《董事(监事、高级管理人员)声明及承诺书》中做出的承诺。
鉴于上述违规事实和情节,经本所纪律处分委员会审核通过,根据《股票上市规则》第17.2条、第17.4条和《上海证券交易所纪律处分和惩戒实施办法》的相关规定,本所做出如下纪律处分决定:对中国冶金科工股份有限公司、董事会秘书肖学文予以通报批评。
对于上述纪律处分,本所将通报中国证监会,并记入上市公司诚信档案。
公司应当引以为戒,严格按照法律、法规和《股票上市规则》的规定,规范运作,审慎办理停复牌业务,认真履行信息披露义务;董事、监事、高级管理人员应当履行忠实勤勉义务,促使公司规范运作,并保证公司及时、公平、真实、准确和完整地披露所有重大信息。
现作出说明如下:
A.投资决策程序:基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案,综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配,同时在研究部的支持下,对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析,最终构建投资组合。
B.基金经理遵循价值投资理念,着重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。公司对出现的问题高度重视,进一步加强内部管理,相关责任人已经新任,公司日常经营活动一切正常,我们判断此次事件对公司负面影响有限,因此无人并持有公司股票。
2.关于处理建议(代码:600643)的处理说明
2016年7月1日,上海证券交易所上市公司监管一部通过了对上海爱建集团股份有限公司和董事会秘书予以监管关注的决定,具体内容如下:
经查明,2015年6月30日,公司因筹划重大事项停牌;2015年6月26日,公司披露进入重大资产重组停牌程序。2015年11月25日,公司披露重大资产重组预案,2015年12月9日,公司披露重大资产重组预案修订稿并复牌,停牌时间逾五个月。
2016年3月18日,公司终止重大资产重组事项并实施非公开发行股票的公告称,拟将重组方案由发行股份购买资产暨募集配套资金变为现金增资,调整为向上海均瑶(集团)有限公司非公开发行股份募集资金,调整原因为更好适配公司战略定位,继续做大做强金融主业。
经进一步核实,公司自2012年至2015年的年报中均披露公司的战略目标是将公司打造成为一家以金融业为主体,专注于提供财富管理和资产管理综合服务的成长性上市公司,公司上述战略定位系2012年确定,在筹划重大资产重组及复牌之后期间并未发生变化,公司积极落实上述战略定位为将长江重大资产重组,在停牌时间长达五个多月,复牌交易长达三个多月期间,公司均未对公司战略发展向导致重组终止的风险,对于重大资产重组的信息披露不完整、风险揭示不充分,
公司上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》(以下简称"《股票上市规则》")第1.4条、第2.1条和《上海证券交易所纪律处分和惩戒实施办法》第三条、第二十五条等有关规定,董事会秘书依学东作为信息披露具体事务负责人,未勤勉尽责,对公司的违规行为负有相应责任,违反了《股票上市规则》第2.2条、第3.1.4条、第3.2.2条的规定以及在《董事(监事、高级管理人员)声明及承诺书》中做出的承诺。
鉴于上述事实和情节,根据《股票上市规则》第17.1条和《上海证券交易所纪律处分和惩戒实施办法》有关规定,我邢作出如下监管措施决定:对上海爱建集团股份有限公司和董事会秘书依学东予以监管关注。
公司应当引以为戒,严格按照法律、法规和《股票上市规则》的规定,规范运作,认真履行信息披露义务;董事、监事和高级管理人员应当履行忠实勤勉义务,促使公司规范运作,并保证公司及时、公平、真实、准确和完整地履行信息披露义务。
现作出说明如下:
A.投资决策程序:基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案,综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配,同时在研究部的支持下,对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析,最终构建投资组合。
B.基金经理遵循价值投资理念,着重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。该处罚事件对公司生产经营产生影响,目前公司生产经营一切正常,我们判断此次事件对公司的生产经营活动没有影响,我们认为不会对整体的业绩造成影响。
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	35,129.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,083,568.29
5	应收申购款	9.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,118,698.11

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
本基金本报告期末未持有股票。
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	111,875,874.22
报告期期间基金总申购份额	149,001.20
减:报告期期间基金总赎回份额	2,482,548.52
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	109,542,326.90

§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
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
1、2017年1月19日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com上公布金元顺安保本混合型证券投资基金2016年第4季度报告;
2、2017年2月25日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com上公布金元顺安保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告
3、2017年2月20日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com上公布金元顺安基金管理有限公司关于将同业存单纳为金元顺安保本混合型证券投资金投资范围的公告
4、2017年2月23日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com上公布金元顺安基金关于参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告;
5、2017年3月29日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com上公布金元顺安保本混合型证券投资基金2016年年度报告(正文);
6、2017年3月29日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jysa99.com上公布金元顺安保本混合型证券投资基金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保本混合型证券投资基金募集注册的文件
2、《金元顺安保本混合型证券投资基金基金合同》
3、《金元顺安保本混合型证券投资基金基金招募说明书》
4、《金元顺安保本混合型证券投资基金托管协议》
5、关于申请募集注册金元顺安保本混合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

金元顺安保本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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	金元顺安保本混合-分级后
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月2日
报告期末基金份额总额	513,427,926.62份
投资目标	在为适用本基金保本条款的基金份额提供保本保证的基础上,力争在本基金保本周期结束时,为投资者带来稳定的当期收益与长期的资本增值。
投资策略	本基金按照"优化指定比例组合保险策略"对股票、债券和现金的投资比例进行动态调整,从而达到防御下跌,参与增值的目的。本基金的股票投资采取行业配置指导下的个股精选方法,即:首先进行行业投资价值评估,确定拟投资的优势行业;其次进行行业内个股的精选,从质地和估值两个维度精选优质股票构建股票组合。本基金的债券投资组合以相对低估的债券作为主要投资对象,并通过对债券的信用、久期和凸性等的灵活配置,进行相对积极主动的操作,力争获取良好收益。
业绩比较基准	二年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本基金,属于证券投资基金中的低风险品种。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构。在极端情况下仍然存在本金损失的风险。
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

下属分级基金的基金简称	A类份额	C类份额
下属分级基金的交易代码	620007	001375
报告期末下属分级基金的份额总额	19,042,537.98份	494,385,388.64份

§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)	
	A类份额	C类份额
1.本期已实现收益	56,495.76	1,736,210.01
2.本期利润	408,264.50	5,759,930.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0184	0.0134
4.期末基金资产净值	20,190,103.11	524,026,865.77
5.期末基金份额净值	1.060	1.060

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
1.A类份额:

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	1.53%	0.29%	0.68%	0.01%	0.85%	0.28%

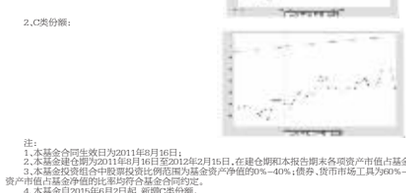
2.C类份额:

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	1.53%	0.28%	0.68%	0.01%	0.85%	0.27%

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.业绩比较基准是三年期定期存款税后收益率。
3.2.2自基金转型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

金元顺安保本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
(2015年4月2日至2017年3月31日)

1.A类份额:



2.C类份额:

注:
1.本基金合同生效日为2011年8月16日;
2.本基金建仓期为2011年8月16日至2012年2月15日,在建仓期和本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定;
3.本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的0%-40%;债券、货币市场工具为60%-100%;其中,现金比例在5%以上,在本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。
4.本基金自2015年6月2日起,新增C类份额。

§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	2012-7-18	-	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、金元顺安丰盈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。

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	4,261,518	50,115,451.68	9.21
2	600160	巨化股份	969,774	10,759,066.54	1.98
3	000088	盐田港	1,347,700	10,606,390.00	1.95
4	000507	珠海港	1,376,800	10,215,856.00	1.88
5	000671	阳光城	1,679,666	9,204,569.68	1.69
6	600759	洲际油气	882,518	7,051,318.82	1.30
7	002531	天顺风能	907,700	6,644,364.00	1.22
8	601601	中国太保	196,700	5,393,514.00	0.99
9	600376	首开股份	420,800	5,070,640.00	0.93
10	601669	中国电建	658,100	5,054,208.00	0.93

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	29,977,000.00	5.51
	其中:政策性金融债	29,977,000.00	5.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	60,116,000.00	11.05
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	118,224,000.00	21.72
9	其他	-	-
10	合计	208,317,000.00	38.28

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	111708090	17中信银行CD090	400,000	39,564,000.00	7.27
2	111716036	17上海银行CD036	400,000	39,548,000.00	7.27
3	111792052	17东莞银行CD008	400,000	39,112,000.00	7.19
4	011756001	17远东租赁SCP001	300,000	30,030,000.00	5.52
5	150417	15农发17	200,000	20,020,000.00	3.68

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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投资贵金属。
5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未投资权证。
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、关于中国重工(代码:601989)的处罚说明
2016年11月7日,中国重工因涉嫌受组织调查的公告,具体内容如下:
本公司董事会及全体董事保证公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。
中国船舶重工股份有限公司(以下简称"公司")从国务院国有资产监督管理委员会网站获悉,公司监事会主席郑长虹涉嫌严重违纪,正在接受组织调查。
本次事件未对公司生产经营产生影响,目前公司生产经营一切正常。公司将根据该事项进展情况,及时履行信息披露义务。公司所有的信息均以上海证券交易所网站及公司指定信息披露媒体发布的公告为准,敬请广大投资者注意投资风险。
现作出说明如下:
A.投资决策程序:基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案,综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配,同时在研究部的支持下,对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析,最终构建投资组合。
B.基金经理遵循价值投资理念,着重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。该处罚事件对公司生产经营产生影响,目前公司生产经营一切正常,我们判断此次事件对公司的生产经营活动没有影响,我们认为不会对整体的业绩造成影响。
2.关于处理建议(代码:600643)的处理说明
2016年7月1日,上海证券交易所上市公司监管一部通过了对上海爱建集团股份有限公司和董事会秘书予以监管关注的决定,具体内容如下:
经查明,2015年6月30日,公司因筹划重大事项停牌;2015年6月26日,公司披露进入重大资产重组停牌程序。2015年11月25日,公司披露重大资产重组预案,2015年12月9日,公司披露重大资产重组预案修订稿并复牌,停牌时间逾五个月。
2016年3月18日,公司终止重大资产重组事项并实施非公开发行股票的公告称,拟将重组方案由发行股份购买资产暨募集配套资金变为现金增资,调整为向上海均瑶(集团)有限公司非公开发行股份募集资金,调整原因为更好适配公司战略定位,继续做大做强金融主业。
经进一步核实,公司自2012年至2015年的年报中均披露公司的战略目标是将公司打造成为一家以金融业为主体,专注于提供财富管理和资产管理综合服务的成长性上市公司,公司上述战略定位系2012年确定,在筹划重大资产重组及复牌之后期间并未发生变化,公司积极落实上述战略定位为将长江重大资产重组,在停牌时间长达五个多月,复牌交易长达三个多月期间,公司均未对公司战略发展向导致重组终止的风险,对于重大资产重组的信息披露不完整、风险揭示不充分,
公司上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》(以下简称"《股票上市规则》")第1.4条、第2.1条和《上海证券交易所纪律处分和惩戒实施办法》第三条、第二十五条等有关规定,董事会秘书依学东作为信息披露具体事务负责人,未勤勉尽责,对公司的违规行为负有相应责任,违反了《股票上市规则》第2.2条、第3.1.4条、第3.2.2条的规定以及在《董事(监事、高级管理人员)声明及承诺书》中做出的承诺。
鉴于上述事实和情节,根据《股票上市规则》第17.1条和《上海证券交易所纪律处分和惩戒实施办法》有关规定,我邢作出如下监管措施决定:对上海爱建集团股份有限公司和董事会秘书依学东予以监管关注。
公司应当引以为戒,严格按照法律、法规和《股票上市规则》的规定,规范运作,认真履行信息披露义务;董事、监事和高级管理人员应当履行忠实勤勉义务,促使公司规范运作,并保证公司及时、公平、真实、准确和完整地履行信息披露义务。
现作出说明如下:
A.投资决策程序:基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案,综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配,同时在研究部的支持下,对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析,最终构建投资组合。
B.基金经理遵循价值投资理念,着重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。该处罚事件对公司生产经营产生影响,目前公司生产经营一切正常,我们判断此次事件对公司的生产经营活动没有影响,我们认为不