(上接819版)

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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本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基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及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利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注**7.4.2**中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.8.4 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。

7.4.8.4.1 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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资及买入返售金融资产等。

7.4.8.4.11 利率风险敞口

下表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

单位：人民币元

本期末 2017年10月09日（基金合同失效前日）	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	804,913.85	-	-	-	804,913.85
结算备付金	1,519,787.79	-	-	-	1,519,787.79
存出保证金	167,431.19	-	-	-	167,431.19
交易性金融资产	162,395,000.00	34,948.60	4,079,890.00	40,217,654.61	206,727,493.21
应收证券清算款	-	-	-	3,017,516.96	3,017,516.96
应收利息	-	-	-	1,681,132.69	1,681,132.69
资产总计	164,887,132.83	34,948.60	4,079,890.00	44,916,304.26	213,918,275.69
负债					
卖出回购金融资产款	32,579,849.13	-	-	-	32,579,849.13
应付证券清算款	-	-	-	2,875,475.18	2,875,475.18
应付赎回款	-	-	-	49,471.09	49,471.09
应付管理人报酬	-	-	-	154,018.69	154,018.69
应付托管费	-	-	-	38,504.66	38,504.66
应付交易费用	-	-	-	278,086.65	278,086.65
应交税费	-	-	-	148,089.60	148,089.60
应付利息	-	-	-	58,778.98	58,778.98
预提费用	-	-	-	150,655.68	150,655.68
应付赎回费	-	-	-	609.03	609.03
负债合计	32,579,849.13	-	-	3,753,689.56	36,333,538.69
利率敏感度缺口	132,307,283.70	34,948.60	4,079,890.00	41,162,614.70	177,584,737.00
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,202,143.66	-	-	-	10,202,143.66
结算备付金	355,381.52	-	-	-	355,381.52
存出保证金	33,421.57	-	-	-	33,421.57
交易性金融资产	79,616,000.00	164,231,171.90	2,287,205.20	85,641,911.71	331,776,288.81
应收利息	-	-	-	2,281,694.36	2,281,694.36
应收申购款	-	-	-	296.44	296.44
买入返售金融资产	50,000,000.00	-	-	-	50,000,000.00
资产总计	140,206,946.75	164,231,171.90	2,287,205.20	87,923,902.51	394,649,226.36
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	402,914.37	402,914.37
应付托管费	-	-	-	67,152.40	67,152.40
应付交易费用	-	-	-	70,646.31	70,646.31
应交税费	-	-	-	148,089.60	148,089.60
预提费用	-	-	-	55,000.00	55,000.00
负债总计	-	-	-	743,802.68	743,802.68
利率敏感度缺口	140,206,946.75	164,231,171.90	2,287,205.20	87,180,099.83	393,905,423.68

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。

7.4.8.4.2 利率风险的敏感性分析

假设	以中央国债登记结算有限责任公司公布的2017年10月09日（基金合同失效前日）和2016年12月31日各债券的基点价值（BP价值）为主要计算依据；		
	债券持仓结构保持不变；		
	银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年10月09日（基金合同失效前日）	上年度末 2016年12月31日
	市场利率上升1BP	-14,983.15	-64,100.00
	市场利率下降1BP	14,987.52	64,200.00

注：

上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

7.4.8.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.8.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.8.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年10月09日（基金合同失效前日）		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产——股票投资	40,217,654.61	22.65	85,641,911.71	21.74
交易性金融资产——基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产——债券投资	166,509,838.60	93.76	246,134,377.10	62.49
交易性金融资产——贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产——权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	206,727,493.21	116.41	331,776,288.81	84.23

注：

本基金投资组合中股票、权证的投资比例为基金资产的0%--40%，债券、货币市场工具等占基金资产的比例为60%--100%，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%。

7.4.8.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合中股票投资的贝塔系数紧密相关		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年10月09日（基金合同失效前日）	上年度末 2016年12月31日
	沪深300指数上涨5%	2,030,724.75	5,715,500.00
	沪深300指数下跌5%	-2,030,724.75	-5,715,500.00

注：

本基金管理人运用资本——资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.8.4.4 采用风险价值法管理风险

风险价值（VaR）含义是指：在市场正常波动下，某一金融资产或证券组合的最大可能损失。更为确切的是指，在一定概率水平（置信度）下，某一金融资产或证券组合价值在未来特定时期内的最大可能损失。用公式表示为：$Prob(\Delta P \setminus VaR)=\alpha$ 或 $Prob(\Delta P \setminus VaR)=\alpha$，

其中 $Prob$ 表示：资产价值损失小于可能损失上限的概率；ΔP 表示：某一金融资产在一定持有期 Δt 的价值损失额；VaR 表示：给定置信水平 α 下的在险价值，即可能的损失上限；α 为：给定的置信水平。

假设	在99%的置信水平下采用风险价值模型来管理风险；		
	以7月1日起至资产负债表日止期间的交易日为观察期；		
	预期期末基金的资产组合的结构保持不变；		
	本基金的基金净值日对数收益率服从正态分布；		
分析	风险价值	本期末 2017年10月09日（基金合同失效前日）	上年度末 2016年12月31日
	合计	7,230,114.74	2,294,800.00

注：

上述分析衡量了在99%的置信水平下，所持有的权益类资产组合在资产负债表日后一个交易日内由于市场价格风险所导致的最大潜在损失。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.11.1 公允价值

7.4.11.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.11.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.11.1.2.1 各层次金融工具公允价值

对于2017年10月9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工具中属于第一层次的余额为人民币42,851,280.21元，属于第二层次的余额为人民币163,856,213.00元，无属于第三层次的余额。（于2016年12月31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工具中属于第一层次的余额为人民币86,515,937.15元，属于第二层次的余额为人民币245,260,351.66元，无属于第三层次的余额。）

7.4.11.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券等公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.11.1.2.3 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期未均不以第三层次公允价值计量。

7.4.11.1.3 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。

7.4.11.1.4 其他重事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.11.1.5 财务报表的批准

本财务报表已于**2018**年**3**月**27**日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告（转型前）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金资产的比例（%）
1	权益投资	46,579,203.86	25.78
	其中：股票	46,579,203.86	25.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	130,430,798.30	72.18
	其中：债券	130,430,798.30	72.18
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,169,287.88	0.65
8	其他各项资产	2,510,992.09	1.39
9	合计	180,690,282.13	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	23,957,284.39	14.32
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	2,944,190.00	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	15,538,029.74	9.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	275,724.00	0.16
J	金融业	3,620,508.00	2.16
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	243,467.73	0.15
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	46,579,203.86	27.84

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	名称	数量	期末公允价值	公允价值占基金资产净值比例（%）
1	000507	珠海港	413,400	4,208,412.00	2.51
2	000905	厦门港务	375,263	3,955,272.02	2.36
3	601228	广州港	522,700	3,193,697.00	1.91
4	600867	通化东宝	130,300	2,982,567.00	1.78
5	000429	粤高速A	336,152	2,726,192.72	1.63
6	000538	云南白药	25,800	2,626,182.00	1.57
7	000725	京东方A	441,800	2,558,022.00	1.53
8	002043	兔宝宝	172,917	2,119,962.42	1.27
9	600196	复星医药	47,000	2,091,500.00	1.25
10	600703	三安光电	73,523	1,866,748.97	1.12
11	300296	利亚德	93,900	1,830,111.00	1.09
12	600755	厦门国贸	175,900	1,776,590.00	1.06
13	601398	工商银行	284,200	1,762,040.00	1.05
14	601988	中国银行	425,000	1,687,250.00	1.01
15	002475	立讯精密	68,600	1,607,984.00	0.96
16	002456	欧菲科技	76,800	1,581,312.00	0.95
17	002709	天赐材料	32,900	1,513,071.00	0.90
18	600897	厦门空港	64,700	1,454,456.00	0.87
19	600153	建发股份	105,000	1,167,600.00	0.70
20	603986	兆易创新	5,200	848,224.00	0.51
21	002045	国光电器	49,200	827,544.00	0.49
22	002334	英威腾	86,000	731,000.00	0.44
23	002511	中顺洁柔	37,200	605,616.00	0.36
24	300188	美亚柏科	13,800	275,724.00	0.16
25	000069	华侨城A	28,677	243,467.73	0.15
26	600036	招商银行	5,900	171,218.00	0.10
27	603818	曲美家居	11,500	167,440.00	0.10

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000905	厦门港务	4,115,944.00	2.46
2	000507	珠海港	4,059,019.00	2.43
3	002475	立讯精密	3,620,959.00	2.16
4	600703	三安光电	3,439,100.72	2.06
5	601228	广州港	3,399,830.00	2.03
6	600282	南钢股份	2,971,398.00	1.78
7	600867	通化东宝	2,863,763.00	1.71
8	000429	粤高速A	2,672,932.44	1.60
9	000725	京东方A	2,564,714.00	1.53
10	000538	云南白药	2,531,787.00	1.51
11	002456	欧菲科技	2,508,385.00	1.50
12	600755	厦门国贸	1,785,038.00	1.07
13	000825	太钢不锈	1,759,690.00	1.05
14	000717	韶钢松山	1,723,221.68	1.03
15	600196	复星医药	1,702,363.00	1.02
16	000998	隆平高科	1,697,708.00	1.01
17	000069	华侨城A	1,588,617.62	0.95
18	000568	泸州老窖	1,560,933.00	0.93
19	600507	方大特钢	1,558,746.00	0.93
20	600897	厦门空港	1,472,338.00	0.88

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600196	复星医药	4,974,364.00	2.97
2	000568	泸州老窖	3,253,781.08	1.94
3	601688	华泰证券	3,182,456.00	1.90
4	600020	中原高速	2,918,258.16	1.74
5	002409	雅克科技	2,891,824.00	1.73
6	600282	南钢股份	2,761,698.00	1.65
7	002475	立讯精密	2,155,264.00	1.29
8	600030	中信证券	1,864,066.00	1.11
9	600409	三友化工	1,834,741.00	1.10
10	600031	三一重工	1,833,631.00	1.10
11	600999	招商证券	1,830,706.00	1.09
12	000717	韶钢松山	1,801,280.96	1.08
13	000998	隆平高科	1,774,752.00	1.06
14	000425	徐工机械	1,764,902.00	1.05
15	002242	九阳股份	1,704,475.04	1.02
16	600507	方大特钢	1,668,330.00	1.00
17	000776	广发证券	1,642,811.00	0.98
18	600703	三安光电	1,636,749.00	0.98
19	000825	太钢不锈	1,577,242.00	0.94
20	000069	华侨城A	1,337,877.00	0.80

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	58,161,665.46
卖出股票收入（成交）总额	51,781,335.10

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,986,000.00	5.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	28,810,000.00	17.22
5	企业短期融资券	29,921,000.00	17.88
6	中期票据	39,233,000.00	23.45
7	可转债（可交换债）	3,454,798.30	2.06
8	同业存单	19,026,000.00	11.37
9	其他	-	-
10	合计	130,430,798.30	77.95

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111796652	17福州银行CD092	200,000	19,026,000.00	11.37
2	101468005	14中铝业MTN001	100,000	10,083,000.00	6.03
3	011754150	17鲁钢铁SCP004	100,000	9,994,000.00	5.97
4	019557	17国债03	100,000	9,986,000.00	5.97
5	041758034	17高新投CP001	100,000	9,965,000.00	5.96

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未投资贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和揽盘明细

本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和揽盘明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	184,477.52
2	应收证券清算款	287,139.94
3	应收股利	-
4	应收利息	2,035,604.26
5	应收申购款	3,770.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,510,992.09

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
金元顺安优质精选灵活配置混合A类	953	11,651.14	1,211,392.67	10.91%	9,892,146.54	89.09%
金元顺安优质精选灵活配置混合C类	2	67,288,399.27	134,576,798.54	100.00%	0.00	-
合计	955	152,544.86	135,788,191.21	93.21%	9,892,146.54	6.79%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	475,167.05	4.28%
	金元顺安优质精选灵活配置混合C类	-	-
	合计	475,167.05	0.33%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	10-50
	金元顺安优质精选灵活配置混合C类	0-10
	合计	10-50
本基金基金经理持有本开放式基金	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	0-10
	金元顺安优质精选灵活配置混合C类	0-10
	合计	0-10

§10 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	金元顺安优质精选灵活配置混合C类
基金合同生效日（2017年10月10日）基金份额总额	13,814,388.32	139,576,798.54
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	626,366.22	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,337,215.33	5,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,103,539.21	134,576,798.54

注：

"金元比联保本混合型证券投资基金"（系本基金前身）合同生效日为2011年8月16日。自2017年10月10日起，本基金转型为非保本的混合型证券投资基金，故本报告中，本基金基金合同生效日为2017年10月10日。

§10 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

	金元顺安保本混合A类	金元顺安保本混合C类
基金合同生效日（2011年08月16日）基金份额总额	277,669,494.24	-
本报告期期初基金份额总额	22,556,191.52	354,808,590.10
本报告期基金总申购份额	7,969,644.64	139,576,798.54
减：本报告期基金总赎回份额	16,711,447.84	354,808,590.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,814,388.32	139,576,798.54

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 基金管理人的重大人事变动

（**1**）本基金管理人于**2017**年**01**月**23**日公告，《金元顺安金通宝货币市场基金基金合同》正式生效，闵杭先生担任该基金的基金经理；

（**2**）本基金管理人于**2017**年**01**月**26**日公告，增聘郭建新先生担任金元顺安金通宝货币市场基金的基金经理；

（**3**）本基金管理人于**2017**年**03**月**25**日公告，聘任陈嘉楠女士担任公司副总经理；

（**4**）本基金管理人于**2017**年**03**月**31**日公告，《金元顺安核盛债券型证券投资基金基金合同》正式生效，闵杭先生担任该基金的基金经理；

（**5**）本基金管理人于**2017**年**04**月**06**日公告，增聘郭建新先生担任金元顺安核盛债券型证券投资基金的基金经理；

（**6**）本基金管理人于**2017**年**06**月**10**日公告，《金元顺安核泰债券型证券投资基金基金合同》正式生效，闵杭先生担任该基金的基金经理；

（**7**）本基金管理人于**2017**年**06**月**20**日公告，增聘郭建新先生担任金元顺安核泰债券型证券投资基金的基金经理；

（**8**）本基金管理人于**2017**年**06**月**29**日公告，增聘孔祥鹏先生担任金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；

（**9**）本基金管理人于**2017**年**06**月**29**日公告，增聘孔祥鹏先生担任金元顺安新经济主题混合型证券投资基金的基金经理；

（**10**）本基金管理人于**2017**年**07**月**15**日公告，侯斌女士不再担任金元顺安宝石动力混合型证券投资基金的基金经理；

（**11**）本基金管理人于**2017**年**07**月**15**日公告，侯斌女士不再担任金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；

（**12**）本基金管理人于**2017**年**08**月**04**日公告，增聘缪玮彬先生担任金元顺安核盛债券型证券投资基金的基金经理；

2. 基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人于**2016**年**8**月**29**日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于**2017**年**3**月**8**日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金由于不符合保本基金存续条件，按照《金元顺安保本混合型证券投资基金基金合同》预约定，本基金由保本混合型基金转型为本保本混合型基金，并相应调整基金投资策略为：

本基金的大类资产配置策略的关键在于自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析的有机结合。股票投资采取行业配置指导下的个股精选方法；债券投资组合以具票息优势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，力争获取超越债券基准的收益；权证投资主要考虑运用的策略包括，限量投资、趋势投资、优化组合策略、价差策略、双向权证策略等；资产支持证券投资主要分析资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值，本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，未发生改聘会计师事务所的情况。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽核或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
金元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	81,289,464.30	7.49%	75,703.91	13.05%	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	2	751,844,336.98	69.31%	316,962.29	54.64%	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	228,293,264.16	21.05%	175,088.91	30.18%	-
万和证券股份有限公司	2	23,313,483.97	2.15%	12,386.56	2.14%	-
中泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：

1. 专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字〔**1998**〕**29**号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[**2007**]**48**号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序：

（**1**）选择标准。

1）公司具有较强的研究实力，能够出具高质量的各种研究报告。研究及投资建议质量较高、报告出具及时、能及时地交流和对需求做出反应，有较广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

2）公司资信状况较好，无重大不良记录。

3）公司经营规范，能满足基金运作的合法、合规需求。

4）能够对持有人提供较高质量的服务。能够向持有人提供咨询、查询等服务；可以向投资人提供及时、主动的信息以及其它增值服务，无被持有人投诉的记录。

（**2**）选择流程。

公司投研和市场部门定期对券商服务质量根据选择标准进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元。

2. 截至本报告期末**2017**年**10**月**9**日止，本基金新租用海通证券股份有限公司**1**个上海交易单元**1**个深圳交易单元，万和证券股份有限公司**1**个上海交易单元**1**个深圳交易单元，华泰证券股份有限公司**1**个深圳交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易		备注
	成交金额	占当期债券成交总量的比例	成交金额	占当期债券回购交易成交总额的比例	成交金额	占当期权证交易成交总额的比例	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例	
金元证券股份有限公司	48,464,021.93	80.94%	-	-	-	-	-	-	
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	
华泰证券股份有限公司	1,463,416.00	2.44%	41,900,000.00	4.92%