

金元顺安丰祥债券型证券投资基金 2017年年度报告摘要

(上接 B833 版)

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产 / 负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各买入返售金融资产期末余额

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		其中：买断式逆回购
	账面余额		
交易所市场	5,300,000.00	-	-
银行间市场	19,000,148.50	-	-
合计	24,300,148.50	-	-
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日		
交易所市场	-	-	-
银行间市场	-	-	-
合计	-	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收定期存款利息	192.11	645.01
应收短期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收债券付息利息	355.80	314.70
应收债券本息	2,905,271.37	3,475,516.03
应收买入返售金融资产利息	59,062.86	-
应收申购款利息	-	-
应收基金合约管理费	-	-
其他	2.30	1.10
合计	2,964,884.44	3,476,476.84

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	10,178.85	6,071.98
合计	10,178.85	6,071.98

7.4.7.8 其他负债

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回款	-	291
预提费用	140,000.00	60,000.00
合计	140,000.00	60,002.91

7.4.7.9 实收基金

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
上年度末	197,955,320.03	197,955,320.03
本期申购	273,631,717.49	273,631,717.49
本期赎回 (以“-”号填列)	-317,639,917.94	-317,639,917.94
本期末	153,947,119.58	153,947,119.58

申购含红利再投、转换入份额、赎回含转出份额。

7.4.7.10 未分配利润

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
上年度末	197,955,320.03	197,955,320.03
本期基金净收益产生的变动额	9,374,032.85	10,048,032.40
其中：基金净收益	26,737,584.60	15,949,692.40
基金利润归	17,363,551.75	12,062,491.75
基金分配利润	-23,044,869.65	-23,044,869.65
本期末	10,891,400.59	-6,691,688.89

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	34,068.29	387,683.25
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	6,807.87	4,159.13
合计	40,868.54	391,934.74

7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期以及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出债券（含转股及债券到期兑付）成交金额	917,377,739.89	567,498,163.67
减：卖出回购、债券转股及债券到期兑付成交金额	906,060,260.36	556,170,351.18
减：应收利息总额	19,696,864.53	11,603,446.49
买断债券差价收入	-8,976,387.00	-275,634.00

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期以及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期以及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期以及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.16 利息收入

本基金本报告期以及上年度可比期间均无利息收入。

7.4.7.17 公允价值变动收益

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产——股票投资	3,288,219.10	-5,357,280.32
——债券投资	3,288,219.10	-5,357,280.32
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	3,288,219.10	-5,357,280.32

7.4.7.18 其他收入

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	201,224.50	2,671,579.19
转换费收入	25,078.60	224
其他收入	9,219.72	-
合计	235,522.82	2,671,581.63

7.4.7.19 交易费用

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	839.03	155.70
银行间市场交易费用	17,805.50	7,400.00
合计	18,644.53	7,555.70

7.4.7.20 其他费用

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	180,000.00	60,000.00
汇划手续费	18,939.47	15,611.22
账户维护费	36,360.00	36,360.00
销售机构管理费	1,200.00	-
其他费用	-	700.00
合计	296,499.47	192,671.22

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,除**7.4.6.2**增值权中披露的事项外,本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系关联方发生变化的情况。

关联方名称	与本基金的关系
金元顺安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人、基金托管机构
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海富安基金销售有限公司	基金管理人的股东
北京金安汇利资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度末均未支付关联方的佣金。

7.4.10.1.4 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
	成交金额	成交金额
金元证券股份有限公司	17,689,936.00	13,026,775.48

7.4.10.1.5 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,440,716.41	1,716,440.80
其中:支付销售机构的客户维护费	27,803.89	50,463.31

注:

基金管理费按前一日的基金资产净值**的 0.60%**按年计提。

计算方法如下: $H = E \times 0.60\%$ / 当年天数,

H 为每日应计提的基金管理费,

E 为前一日的基金资产净值,

基金管理费每日计算,逐日累计至每月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管

理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	480,238.76	572,146.98

注:

基金托管费按前一日的基金资产净值**的 0.20%**按年计提。

计算方法如下:

$H = E \times 0.20\%$ / 当年天数,

H 为每日应计提的基金托管费,

E 为前一日的基金资产净值,

基金托管费每日计算,逐日累计至每月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管

理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况

本基金基金管理人以外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
中国工商银行股份有限公司	616,277.19	73,723,424.74

注:

本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户存于中国证券登记结算有限责任公司,

2017 年度获得的利息收入为人民币**6,807.87**元(2016 年度获得的利息收入为人民币**4,159.13**元)。

2017 年末结算备付金余额为人民币**790,666.81**元(2016 年末结算备付金余额为人民币**699,380.09**元)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接同关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况——非货币市场基金

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
可供分配利润	1,274,589.55	10,048,032.40
其中:基金净收益	26,737,584.60	15,949,692.40
基金利润归	17,363,551.75	12,062,491.75
基金分配利润	-23,044,869.65	-23,044,869.65
本期末	10,891,400.59	-6,691,688.89

7.4.12 利润分配政策

本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.1 利润分配政策

本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.2 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.3 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.4 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.5 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.6 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.7 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.8 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.9 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.10 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.11 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.12 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.13 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.14 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.15 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.16 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.17 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.18 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.19 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.20 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12.21 未分配利润

截至本报告期末,本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。