

金元顺安桉泰债券型证券投资基金

2017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：兴业银行股份有限公司
送出日期：2018年03月27日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月27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2017年6月9日（基金合同生效日）起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金名称	金元顺安桉泰债券型证券投资基金
基金简称	金元顺安桉泰债券
基金代码	003897
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年06月09日
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	219,470,407.40份
基金合同存续期间	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 在保持资产流动性基础上，严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供超越市场的当期收益以及长期稳定的回报。

投资策略 基金在严格限制和保本机制的约束下，通过对债券组合久期、期限结构、券种选择、杠杆运用、信用风险管理等的综合管理，在严格控制风险的基础上，为持有人寻求最大利益。

业绩比较基准 基金系开放式债券型基金，其预期收益率与收益波动率均低于混合型基金，高于货币市场基金，属于债券投资品种中风险程度适中且较低的债券资产。

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	兴业银行股份有限公司
姓名	凌波	曾廉禹
信息披露负责人	联系电话	021-68810101
	电子邮箱	service@jyswq.com
客户服务电话	400-666-0666	95661
传真	021-68810755	021-62363623
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区花木路33号花旗大厦7层	浦东新区花木路164号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区花木路33号花旗大厦9层	上海江宁路168号兴业大厦20楼
邮政编码	200120	200041
法定代表人	任开平	高建平

2.4 信息披露方式

本基金的信息披露方式包括但不限于《中国证券报》

登载基金定期报告的管理人互联网网址 www.jyswq.com

基金年度报告备置地 本公司管理人、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	本期2017年06月09日(基金合同生效日)-2017年12月31日
本期已实现收益	4,169,114.00
本期利润	4,015,966.63
加权平均基金份额利润	0.0170
本期平均净值利润率	1.68%
本期基金份额净增长率为	1.66%
3.1.2期末数据和指标	2017年末
期末可供分配利润	3,646,820.44
期末可供分配基金份额利润	0.0166
期末基金资产净值	223,116,317.92
期末基金份额净值	1.0166
3.1.3当年年末指标	2017年末
基金份额累计净值增长率	1.66%

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)扣减相关费用后的余额，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之和减去本期的分红款数(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，计费后实际收益水平要低于所列示数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1基金的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	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个	0.32%	0.23%	0.09%	0.16%	0.23%	0.07%
过去一个	1.38%	0.17%	0.89%	0.14%	0.49%	0.03%
自基金成立以来至今	1.66%	0.17%	2.15%	0.14%	-0.50%	0.03%

注：

1.本基金合同生效日为2017年6月9日，业绩基准收益率以2017年6月8日为基准；

2.本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于股票资产的比例不高于基金资产的20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金净资产值的5%；

3.本基金业绩比较基准为“中债综合指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%”。

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前海外经济保持良好增长，美联储今年可能多次加息，贸易保护主义抬头，外需可能不会像过去一样拉动经济增长。中央经济工作会议将防范化解重大风险作为三大攻坚战之一，未来风险将是金融体系的最重要的主题。随着监管政策进一步细化收紧，各种传统的套利和规避监管的路径都被堵死，货币政策存在由偏紧向中性转变的空间，不过目前金融稳定性应该是货币政策众矢之的定位。目前各行各种工具搭配，对流动性有收放，能够及时有效的控制资金面松紧，短期的宽松很难说明央行的态度发生转变。未来需要整体的杠杆水平出现明显下降，同时社融等宏观数据开始走弱，债券收益率才能出现趋势性下行。

4.6 管理人对本期基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续将合规操作、防范风险、保护基金持有人的利益作为工作的重点，进一步完善内部控制制度和流程体系，推动各项法规、内控体系和管理制度的落实，保证基金合同得到严格执行。公司监察稽核部按照权限和程序，通过实时监控、定期检查、报表揭示、专项检查、人员询问等方法，独立开展公司的监察稽核工作，并就在监察稽核过程中发现的问题，及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，公司重点开展的监察稽核工作包括：

1.依据相关法律、法规和公司实际情况，修订和完善公司各项内部管理制度，为保障基金份额持有人的利益，保障公司的规范运作提供制度保障。

2.开展对公司各项业务的日常监察稽核工作，查找各项业务中的风险漏洞，保证公司各项业务的合规运营，加强对各业务环节的专项稽核。

3.加强对公司投资、交易、研究、会计估值、市场营销等各项业务过程中的法律、合规及投资风险的防控与控制，在合法合规的基础上，充分保障基金份额持有人的利益。

4.开展反洗钱、反商业贿赂等各项工作，并通过开展法规培训等形式，提高员工的合规意识和风险责任意识。

通过上述工作的开展，在报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易、违法违规整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺一如既往地坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金投资估值程序等事项的说明

4.7.1有关采用估值方法及其原因的说明

4.7.2基金的估值方法

4.7.3基金的估值原则

4.7.4基金的估值程序

4.7.5基金的估值错误处理

4.7.6基金估值的特殊情形

4.7.7基金估值的披露

4.7.8基金估值的复核

4.7.9基金估值的公告

4.7.10基金估值的偏离度

4.7.11基金估值的临时调整

4.7.12基金估值的异常情况

4.7.13基金估值的其他情况

4.7.14基金估值的其他说明

4.7.15基金估值的其他说明

4.7.16基金估值的其他说明

4.7.17基金估值的其他说明

4.7.18基金估值的其他说明

4.7.19基金估值的其他说明

4.7.20基金估值的其他说明

4.7.21基金估值的其他说明

4.7.22基金估值的其他说明

4.7.23基金估值的其他说明

4.7.24基金估值的其他说明

4.7.25基金估值的其他说明

4.7.26基金估值的其他说明

4.7.27基金估值的其他说明

4.7.28基金估值的其他说明

4.7.29基金估值的其他说明

4.7.30基金估值的其他说明

4.7.31基金估值的其他说明

4.7.32基金估值的其他说明

4.7.33基金估值的其他说明

4.7.34基金估值的其他说明

4.7.35基金估值的其他说明

4.7.36基金估值的其他说明

4.7.37基金估值的其他说明

4.7.38基金估值的其他说明

4.7.39基金估值的其他说明

4.7.40基金估值的其他说明

4.7.41基金估值的其他说明

4.7.42基金估值的其他说明

4.7.43基金估值的其他说明

4.7.44基金估值的其他说明

4.7.45基金估值的其他说明

4.7.46基金估值的其他说明

4.7.47基金估值的其他说明

4.7.48基金估值的其他说明

4.7.49基金估值的其他说明

4.7.50基金估值的其他说明

4.7.51基金估值的其他说明

4.7.52基金估值的其他说明

4.7.53基金估值的其他说明

4.7.54基金估值的其他说明

4.7.55基金估值的其他说明