金元顺安沣楹债券型证券投资基金 2017年年度报告摘要

基金管理人:金元顺安基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
送出日期:2018年03月27日

§1 重要提示及目录

1.1重要提示

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年3月23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1月1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	金元顺安沣楹债券型证券投资基金
基金简称	金元顺安沣楹债券
基金主代码	003135
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年09月22日
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
报告期末基金份额总额	936,340,443.55份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

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、市场资金供求和估值水平等因素,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	本基金系债券型基金,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。

2.3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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌有法	罗菲菲
	联系电话	021-68881801	010-58560666
	电子邮箱	service@jyuan99.com	tgbhxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-666-0666	95568
传真		021-68881875	010-58560798
注册地址		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	北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址		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	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		任开宇	洪崎

2.4信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.jyuan99.com
基金年度报告备置地点	本基金管理人、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	2017年	2016-09-22(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	26,453,846.12	582,783.61
本期利润	21,232,901.03	-5,149,108.25
加权平均基金份额本期利润	0.0414	-0.0245
本期加权平均净值利润率	4.06%	-2.47%
本期基金份额净值增长率	6.06%	-2.33%
3.1.2期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	33,622,799.03	-5,858,482.17
期末可供分配基金份额利润	0.0359	-0.0233
期末基金资产净值	969,963,242.58	245,785,739.34
期末基金份额净值	1.0359	0.9767
3.1.3累计期末指标	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	3.59%	-2.33%

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。

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中已实现部分的孰低数(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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2基金净值表现

3.2.1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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.47%	0.20%	-1.16%	0.06%	0.69%	0.14%
过去六个月	2.37%	0.21%	-1.22%	0.05%	3.69%	0.16%
过去一年	6.06%	0.21%	-3.39%	0.06%	9.45%	0.15%
自基金合同生效起至今	3.59%	0.20%	-5.53%	0.09%	9.12%	0.11%

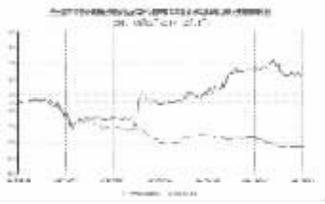
注:

1、本基金合同生效日为2016年9月22日,业绩基准累计增长率以2016年9月21日指数为基准;

2、本基金投资于债券资产不低于基金资产的80%;投资于股票资产不高于基金资产的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资产净值的5%;

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

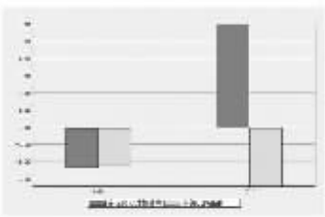


注:

1、本基金合同生效日为2016年9月22日,业绩基准累计增长率以2016年9月21日指数为基准;

2、本基金投资于债券资产不低于基金资产的80%;投资于股票资产不高于基金资产的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资产净值的5%。

3.2.3自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:

1、本基金合同生效日为2016年9月22日;

2、本基金业绩比较基准为“中债综合指数”。

3.3过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行过利润分配。

§4 管理人报告

4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

金元比联基金管理有限公司(以下简称“金元比联”、“公司”或“本基金管理人”,系金元顺安基金管理有限公司前身)成立于2006年11月,由金元证券股份有限公司(以下简称“金元证券”)与比利时联合资产管理公司(以下简称“比联资管”)共同发起设立的中外合资基金管理有限公司。公司总部设在上海陆家嘴,旗下设立北京分公司及子公司——上海金元百利资产管理有限公司。

2012年3月,经中国证监会核准,比联资管将所持有的金元比联49%股权转让于惠理基金管理香港有限公司(以下简称“惠理香港”),公司更名为金元惠理基金管理有限公司(以下简称“金元惠理”)。

2012年10月,经中国证监会核准,公司双方股东按持股比例向公司增资人民币9,500万元,公司注册资本增加至24,500万元。

2016年3月,经中国证监会核准,惠理香港将所持有的金元惠理49%股权转让于上海泉意金融信息服务有限公司(以下简称“泉意金融”),公司更名为金元顺安基金管理有限公司(以下简称“金元顺安”)。

2017年11月,经中国证监会核准,公司双方股东按持股比例向公司增资人民币9,500万元,公司注册资本增加至34,000万元。

金元顺安始终坚持以“取信于市场、取信于社会”作为行为准则,遵循“诚实信用,勤勉尽责,以专业经营方式管理和运作基金财产和客户资产,在合法、合规的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,从而使公司稳步、健康发展”的投资理念。遵守法律、行政法规和中国证券监督管理委员会的规定,遵守社会公德、商业道德,诚实守信,遵循基金份额持有人利益优先、公平对待其管理的不同基金财产和客户资产的原则,接受政府和社会公众的监督,承担社会责任。

截止至2017年12月31日,本基金管理人管理金元顺安宝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、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安价值增长混合型证券投资基金、金元顺安核心动力混合型证券投资基金、金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安优质精选灵活配置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、金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安金元宝货币市场基金、金元顺安沣楹债券型证券投资基金、金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安桉盛债券型证券投资基金、金元顺安桉泰债券型证券投资基金和金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金共15只开放式证券投资基金。

此外,金元顺安桉裕纯债债券型证券投资基金和金元顺安桉和纯债型证券投资基金尚在募集期内。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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	2016-09-22	-	10年	金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安优质精选灵活配置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的基金经理,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》、《金元顺安沣楹债券型证券投资基金基金合同》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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》,建立了科学完善的制度和流程,从事前、事中、事后等各个业务环节严格控制不同基金之间可能存在的利益输送,覆盖了全部开放式基金及特定客户资产管理组合;涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动;贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节。

在投资环节,本基金管理人建立了科学的投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻。同时,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。在交易环节,为确保交易的公平执行,本基金管理人交易管理实行集中交易,投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开,各投资组合的所有证券买卖活动须通过交易部集中统一完成。在报告分析环节,本基金管理人每季度和每年对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异,对连续四个季度期间内、不同时间窗内(日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差进行分析,根据收益率差异和交易价差的大小,说明是否符合公平交易的原则,由投资组合经理、督察长、总经理签署后,妥善保存分析报告备查。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。本报告期内,本基金管理人严格遵守公司投资交易业务流程及公平交易制度。公司投资交易行为监控体系由稽核监察部和交易部监督,确保公平交易制度的执行和实现。

本报告期内,本基金管理人对旗下开放式基金与其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3异常交易行为的专项说明

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》、《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》及其他相关法律法规和公司内部规章制度,制定了《金元顺安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》,涵盖了所有可投资证券的一级市场申购、二级市场交易所公开竞价交易、交易所大宗交易、银行间债券交易以及非公开发行股票申购、以公司名义进行的一级市场债券交易等可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本基金管理人采用定量分析和定性分析相结合的方式,建立并严格执行有效的异常交易日常监控制度,形成定期交易监控报告,按照报告路线实行及时报告的机制。本报告期内,未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2017年我国经济形势表现较好。GDP增速先高后低,全年增速6.8%;而CPI录得1.6%水平,较上年有所下降。受全球经济复苏形势同步向好影响,2017年我国出口形势明显改善,出口金额同比增速录得7.91%,结束之前两年连续负增长的局面。2017年我国消费品零售市场仍然稳健,新增消费额增加平稳,消费增速保持在10.3%,成为经济增长的重要支撑。

2017年我国固定资产投资增速缓步下行,同比名义增长7.2%,比2016年下滑了0.9个百分点。基建投资和制造业投资小幅反弹,但地产调控政策影响下,17年全国商品房销售面积7.7%,较上年22.5%的增速大幅下降,带动地产投资增速下滑。受供给侧改革和环保限产影响,2017年PPI维持在高位震荡,但向下游传导缓慢,加之国内食品价格表现疲弱,CPI增速下滑。2017年政策继续着力于金融去杠杆,推出大资管监管政策,把住货币总闸门。在多种措施的作用下,资金面持续紧缩。全年新增贷款13.53万亿,社会融资总量19.4万亿。

2017年资本市场走势分化。股市年稳步上涨,上证综合指数全年上涨5.4%;债市与之相反,持续下跌,中债总指数全年下跌1.05%

在报告期,本基金缩短债券久期,优选个股,收益大幅好于基准。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安沣楹债券基金份额净值为1.0359元;

本报告期内,基金份额净值增长率为6.06%,同期业绩比较基准收益率为-3.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年仍有望保持稳健经济增长。房地产面临调控政策的持续,销售增速有可能进一步下降,进而拖累房地产投资。政府不再片面追求经济增速的前提下,地方政府举债的监管压力和资管新规对基建项目的资金来源带来了压力。制造业投资持续多年的下降局面在2017年有明显缓解,但在中国经济整体处于从制造到服务经济结构转型大背景下,制造业投资大幅反弹的概率微乎其微。2018年全球经济景气程度仍会持续,出口会维持较好的局面。从需求端来看,面临内需放缓、外需接棒的局面。2018年CPI同比将温和抬升,走势前高后低,总体相对温和,预计CPI同比升至2.3%左右。2018年货币政策维持中性姿态,金融严监管还将持续,货币市场资金利率保持刚性,金融去杠杆仍在路上。国际市场看,主要经济体经济复苏,通胀抬升,全球将迎来货币政策正常化时期。

在这样复杂的经济形势下,我们认为全年流动性紧平衡,金融市场小幅震荡,应该采取中短久期策略,以获取票息收益为主要手段。同时积极参与波段性的交易机会。考虑到收益率中枢相对去年提升了100bps,预期全年收益能达到5.5%左右,远高于去年。信用债方面,将坚持选择高评级信用债,防范信用风险。

股市方面,我们将坚持基本面研究思路,坚持自下而上选择优质个股,以及灵活调整仓位。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人持续将规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益作为工作的基点,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履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序,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,独立地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业务部门进行整改,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、法规和公司实际运作情况,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作,重点加强了对于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范与控制,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,在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易,基金运作整体合法合规。在今后的工作中,本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、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估值程序等事项的说明

4.7.1有关参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工

1、估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由分管运营的副总经理、基金事务部、投资研究部、交易部、监察稽核部等部门总监组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责:

(1)制定估值制度并在必要时修改;

(2)确保估值方法符合现行法规;

(3)批准证券估值的步骤和方法;

(4)对异常情况做出决策。

分管运营的副总经理担任估值工作小组的组长,分管运营的副总经理在基金事务部总监或者其他两个估值小组成员的建议下,可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组2/3或以上多数票通过。

2、基金事务部的职责分工

基金事务部负责日常证券资产估值。该部门和公司投资部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后,基金事务部定期将证券估值表向估值工作小组报告,至少每月一次。

基金事务部职责:

(1)获得独立、完整的证券价格信息;

(2)每日证券估值;

(3)检查价格波动并进行一般准确性评估;

(4)向交易员或基金经理核实价格异常波动,并在必要时向估值工作小组报告;

(5)对每日证券价格信息和估值结果进行记录;

(6)对估值调整和人工估值进行记录;

(7)向估值工作小组报送月度估值报告。

基金事务部总监认为必要时,可以提议召开估值工作小组会议。

3、投资研究部的职责分工

(1)接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问询;

(2)对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议;

(3)评价并确认基金事务部提供的估值报告;

(4)向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4、交易部的职责分工

(1)对基金事务部的证券价格信息需求做出即时回应;

(2)通知基金事务部关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

(3)评价并确认基金事务部提供的估值报告。

5、监察稽核部的职责分工

(1)监督证券的整个估值过程;

(2)确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

(3)确保公司的估值制度和方法符合现行法律、法规的要求;

(4)评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价值的风险;

(5)对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯;

(6)对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7.2参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,本基金未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内,会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内,本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告已经安永华明会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容,可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务会计报告

7.1 资产负债表

会计主体:金元顺安沣楹债券型证券投资基金

报告截止日:2017年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	4,590,557.64	12,552,985.13
结算备付金		2,425,065.78	51,193.04
存出保证金		275,919.17	1,144.32
交易性金融资产	7.4.7.2	1,144,162,361.69	201,256,710.00
其中:股票投资		159,666,107.79	2,729,300.00
基金投资		-	-
债券投资		984,496,253.90	198,527,410.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	30,000,165.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	16,703,683.04	2,130,917.98
应收股利		-	-
应收申购款		119.92	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,168,157,697.24	245,993,115.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		196,699,698.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		812.29	165.29
应付管理人报酬		576,348.05	137,584.67
应付托管费		82,335.43	19,654.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	559,573.93	4,970.83
应交税费		-	-
应付利息		220,685.16	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	55,001.80	45,000.37
负债合计		198,194,454.66	207,376.13
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	936,340,443.55	251,644,221.51
未分配利润	7.4.7.10	33,622,799.03	-5,858,482.17
所有者权益合计		969,963,242.58	245,785,739.34
负债和所有者权益总计		1,168,157,697.24	245,993,115.47

注:

报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.0359元,基金份额总额936,340,443.55份。

7.2 利润表

会计主体:金元顺安沣楹债券型证券投资基金

本报告期:2017年01月01日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年09月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入		30,180,264.38	-4,557,748.31
1.利息收入		22,736,286.85	1,973,175.68
其中:存款利息收入	7.4.7.11	78,914.22	44,984.82
债券利息收入		22,385,641.21	1,392,068.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		271,731.42	536,122.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		12,653,987.40	-799,110.03
其中:股票投资收益	7.4.7.12	16,088,211.86	2.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-4,115,767.42	-799,112.05
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	681,542.96	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-5,220,945.09	-5,731,891.86
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	10,935.22	77.90
减:二、费用		8,947,363.35	591,359.94
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	3,607,677.26	403,245.19
2.托管费	7.4.10.2.2	515,382.42	57,606.48
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	7.4.7.19	1,394,917.67	4,040.21
5.利息支出		3,213,610.63	49,781.63
其中:卖出回购金融资产支出		3,213,610.63	49,781.63
6.其他费用	7.4.7.20	215,775.37	76,686.43
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		21,232,901.03	-5,149,108.25
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		21,232,901.03	-5,149,108.25

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:金元顺安沣楹债券型证券投资基金

本报告期:2017年01月01日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	251,644,221.51	-5,858,482.17	245,785,739.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	21,232,901.03	21,232,901.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	684,696,222.04	18,248,380.17	702,944,602.21
其中:1.基金申购款	685,932,343.41	18,261,131.15	704,193,474.56
2.基金赎回款	-1,236,121.37	-12,750.98	-1,248,872.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	936,340,443.55	33,622,799.03	969,963,242.58

项目	上年度可比期间 2016年09月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	200,971,336.64	-	200,971,336.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,149,108.25	-5,149,108.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	50,672,884.87	-709,373.92	49,963,510.95
其中:1.基金申购款	50,775,082.25	-709,917.28	50,065,164.97
2.基金赎回款	-102,197.38	543.36	-101,654.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	251,644,221.51	-5,858,482.17	245,785,739.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

张嘉宾	符刃	李泽
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

金元顺安沣楹债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1650号文《关于准予金元顺安沣楹债券型证券投资基金注册的批复》的批准,由金元顺安基金管理有限公司作为基金管理人向社会公开募集,基金合同于2016年9月22日正式生效。

本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构为金元顺安基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券(含可分离型可转换债券)、可交换债券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款(含协议存款、定期存款以及其他银行存款)、非金融企业债务融资工具、同业存单、货币市场工具、股票(含中小板、创业板及其他依法上市的股票)、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准:中债综合指数收益率。

7.4.2会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年自1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

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资产主要包括股票投资和债券投资;

2、金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或收取该金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

1、股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

2、债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

3、权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

4、股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认;

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益,股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转;

5、分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述2、3中相关原则进行计算;

6、回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提