华宸未来稳健添利债券型证券投资基金

2018 第四季度 报告

2018年12月31日

基金管理人:华宸未来基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月21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2019年1月17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。

华宸未来稳健添利债券型证券投资基金由华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金变更注册而来。2018年7月30日至2018年8月21日期间,华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金召开基金份额持有人大会,基金份额持有人大会计票日期为2018年8月22日。会议审议通过了《关于华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金变更的议案》,内容包括华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金调整基金投资范围、投资策略、投资限制、基金费用、估值方法、增设收取销售服务费的C类份额,并根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法律法规修订基金合同等,同意将“华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金”更名为“华宸未来稳健添利债券型证券投资基金”,上述基金份额持有人大会决议自表决之日起生效。自2018年8月24日起,《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金基金合同》生效,《华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。

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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宸稳健债券
场内简称	-
交易代码	000104
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年8月24日
报告期末基金份额总额	27,340,898.39份
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上,力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	资产配置策略。本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念,采用价值分析方法,在分析和判断财政政策、货币政策、宏观经济运行指标的基础上,自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券组合目标久期,期限结构配置及类属配置,同时,采用“自下而上”的方法,在研究分析信用风险、流动性风险、收益率水平、市场环境等因素基础上,自下而上的精选投资品种。 普通债券投资策略。本基金在普通债券投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,采用久期控制下的主动性投资策略,主要包括:久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段,对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测,相机抉动、积极调整。 可转换债券投资策略。可转换债券不同于一般的公司债券,该债券赋予投资者在一定条件下将可转换债券转换成股票的权利,投资者可能选具有回售等其他权利,因此从这方面看可转换债券的理论价值应等于普通债券的基础价值和可转换债券自身内在的期权价值之和。本基金在合理地给出可转换债券估值的基础上,尽量有效地挖掘出投资价值较高的可转换债券。 回购套利策略。本基金重要的操作策略之一,把信用产品投资和回购交易结合起来,管理人根据信用产品的特征,在信用风险和流动性风险可控的前提下,或者通过回购融资来降低融资成本,或者通过回购的不断滚动来获取信用债收益率和资金成本的利差。 资产支持证券投资策略。本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上,对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,以在控制风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	华宸未来基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华宸稳健债券A / 华宸稳健债券C
下属分级基金的场内简称	- / -
下属分级基金的交易代码	000104 / 006258
下属分级基金的前端交易代码	- / -
下属分级基金的后端交易代码	- / -
报告期末下属分级基金的份额总额	12,525,939.28份 / 14,814,959.31份
下属分级基金的风险收益特征	- / -

§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(2018年10月1日 - 2018年12月31日)	
	华宸稳健债券A	华宸稳健债券C
1.本期已实现收益	-161,708.61	40,237.57
2.本期利润	-52,353.21	94,229.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0042	0.0076
4.期末基金资产净值	13,254,024.53	15,883,389.73
5.期末基金份额净值	1.0581	1.0721

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、以上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(例如基金申购赎回费、基金转换费等),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 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

华宸稳健债券A

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	-0.40%	0.16%	1.99%	0.05%	-2.39%	0.11%

华宸稳健债券C

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	-0.33%	0.17%	1.99%	0.05%	-2.32%	0.12%

注:1、本基金转型日期为2018年8月24日。截至本报告期末,本基金转型后基金合同生效未满一年。

2、本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至本报告期末建仓期未结束。

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

注:1、本基金转型日期为2018年8月24日。截至本报告期末,本基金转型后基金合同生效未满一年。

2、本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至本报告期末建仓期未结束。

§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		
应晓立	本基金基金经理	2016年2月2日	-	9	2010年1月至2011年12月30日在中信期货公司交易部任交易员,2012年1月至2013年1月以及2014年3月至2015年6月在上海印盟投资管理有限公司研究部任研深研究员及研究总监;2013年1月至2014年2月在上海紫石投资有限公司任行业研究员及个产基金经理;2015年7月加入华宸未来基金管理有限公司投研部担任行业研究员。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过流程和系统控制保证有效实现公平交易管理要求,并通过对投资交易行为的监控和分析,确保管理人旗下各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节均得到公平对待。本报告期内,管理人严格执行各项公平交易制度及流程。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易的情形,未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

本报告期内,基金管理人未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年4季度,债市总体呈现分化态势,不同信用等级的债券走势继续分化,本基金主动减持了波动较大的可转债品种,增配了信用等级较高的利率债以及信用债品种,为将来净值的稳定增长打下了基础。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本报告期末基金A类份额净值为1.0581元,C类份额净值为1.0721元;报告期内本基金A类份额净值增长率为-0.40%,业绩比较基准收益率为1.99%;C类份额净值增长率为-0.33%,业绩比较基准收益率为1.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

存在连续20个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,时间段为2018年10月8日至2018年11月23日。本报告期内不存在连续20个工作日基金份额持有人数不满200人的情形。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	27,121,638.80	91.10
	其中:债券	27,121,638.80	91.10
	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	1,869,521.06	6.28
8	其他资产	778,806.36	2.62
9	合计	29,769,966.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

注:本基金本报告期末未持有股票。

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	6,125,208.00	21.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,530,913.00	22.41
	其中:政策性金融债	6,530,913.00	22.41
4	企业债券	14,465,517.80	49.65
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	27,121,638.80	93.08

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	010303	03国债(3)	16,000	1,613,120.00	5.54
2	018007	国开1801	15,500	1,564,641.00	5.37
3	010107	21国债(7)	15,040	1,548,368.00	5.31
4	018006	国开1702	15,020	1,533,542.00	5.26
5	122329	14伊泰01	15,000	1,532,550.00	5.26

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末无持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	958.58
2	应收证券清算款	114,673.79
3	应收股利	-
4	应收利息	497,762.96
5	应收申购款	165,411.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	778,806.36

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华宸稳健债券A	华宸稳健债券C
报告期期初基金份额总额	12,525,272.65	918.91
报告期期间基金总申购份额	10,846.43	41,068,844.92
减:报告期期间基金总赎回份额	10,179.80	26,254,804.52
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	12,525,939.28	14,814,959.31

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	36.58

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年10月1日至2018年12月31日	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	36.58%
个人	1	2018年11月22日至2018年12月31日	0.00	12,642,948.57	2,800,000.00	9,842,948.57	36.00%
产品特有风险							

本基金由下存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,存在以下特有风险:(1)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大赎赎回导致的基金净值波动风险;(2)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大赎赎回导致的流动性风险;(3)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大赎赎回导致的巨赎赎回风险。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金设立的文件;

2、《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金基金合同》;

3、《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金托管协议》;

4、《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金招募说明书》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登陆基金管理人互联网站(http://www.hcmirae.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查询。

华宸未来基金管理有限公司

2019年1月21日

金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金

2018 第四季度 报告

2018年12月31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
报告送出日期:2019年01月21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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年01月18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2018年10月01日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金元顺安元启灵活配置混合
基金主代码	004685
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年11月14日
报告期末基金份额总额	80,076,789.33份
投资目标	通过积极灵活的资产配置,在严格控制投资组合风险的基础上,为参买规基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金通过发掘经济发展及结构转型过程中所显现的投资机会,为参获获持续稳健的投资超额收益。在资产配置方面,本基金根据国内外宏观经济、政策环境、市场运行趋势等因素确定基金的大类资产配置比例。 在权益资产投资方面,采用“自上而下”的方式,选择与政策调控、经济发展、国民改革具有相关性较高的行业中的个股进行配置;同时,结合“自下而上”的方式,精选上市公司股票作为投资方向。在债券投资方面,选择具有票息优势的债券品种作为主要的债券投资标的。最后,在综合考虑投资组合的风险收益特征基础上,本基金完成组合构建。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金系混合型基金,属于中高风险、中高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
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

§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(2018年10月01日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	8,605,606.11
2.本期利润	4,519,800.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0286
4.期末基金资产净值	87,062,720.73
5.期末基金份额净值	1.0872

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;

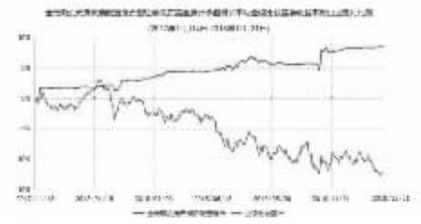
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.69%	0.36%	-3.31%	0.81%	8.00%	-0.45%

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



注:

1、本基金合同生效日为2017年11月14日,业绩基准累计增长率以2017年11月13日指数为基准;

2、本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的比例为0%-95%,权证投资比例占基金资产净值的比例不超过3%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

3、本基金业绩比较基准为“沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%”。

§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		
穆玮彬	本基金基金经理	2017-11-14	-	20年	金元顺安权盛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的基金经理,复旦大学经济学硕士。曾任华泰资产管理有限公司固定收益部总经理,安盟基金管理有限公司研究员,金元证券有限责任公司资产管理部总经理助理,联合证券有限责任公司高级投资经理,华安信托投资有限责任公司投资经理。2016年10月加入金元顺安基金管理有限公司。20年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》和《证券投资基金销售管理办法》、《金元顺安元启灵活配置混合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 公平交易专项说明

4.3.1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监监督,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。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金管理人《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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年四季度中国经济的下行压力有所加大,内外部因素的不确定性增加。投资的维稳力度不断加码,基建项目的审批和推进力度加快,但是消费和出口维持了下行态势,尤其受贸易爆棚和全球经济回落的影响,在集中赶出口因素消退后短期出口增长面临较大的不利环境,制造业PMI的持续回落预示着后期经济面临较大的压力。在此不利环境下,政策上采取了积极的措施去保证经济平稳运行,又主动避免刺激经济走老路而加大经济的系统性风险,因此在基建项目上立足于补短板和促结构调整,在货币政策上保持稳健偏宽松,注重定向调控,避免大水漫灌。但是指于经济下行周期和结构性因素,常常作间宽信用传导途径不畅,经济的企稳回升仍需一段时间。四季度,本基金保持一定久期的债券资产,以获取稳定回报,并根据股票市场的变化阶段性配置了股票资产。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安元启灵活配置混合基金份额净值为1.0872元;

本报告期内,基金份额净值增长率为2.69%,同期业绩比较基准收益率为-3.31%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形。

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的情形。

§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	238,719.00	0.27
	其中:股票	238,719.00	0.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	41,803,142.50	47.91
	其中:债券	41,803,142.50	47.91
	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	37,000,000.00	42.40
	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	3,305,829.77	3.79
8	其他资产	4,912,908.89	5.63
9	合计	87,260,600.16	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	22,256.00	0.03
B	采矿业	-	-
C	制造业	114,389.00	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	23,520.00	0.03
F	批发和零售业	26,544.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,750.00	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	22,260.00	0.03
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	238,719.00	0.27

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末持有港股通投资的股票。

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	300523	辰安科技	500	29,750.00	0.03
2	000411	英特集团	2,100	26,544.00	0.03
3	002728	特一药业	1,800	23,616.00	0.03
4	002713	东易日盛	1,500	23,520.00	0.03
5	300452	山河药辅	1,700	23,256.00	0.03
6	603968	醋化股份	1,800	22,752.00	0.03
7	002085	万丰奥威	2,900	22,475.00	0.03
8	002382	蓝帆医疗	1,500	22,290.00	0.03
9	002146	荣盛发展	2,800	22,260.00	0.03
10	600998	九州通	2,600	22,256.00	0.03

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	37,283,342.50	42.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,519,800.00	5.19
	其中:政策性金融债	4,519,800.00	5.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	41,803,142.50	48.01

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	010107	21国债(7)	362,150	37,283,342.50	42.82
2	018005	国开1701	45,000	4,519,800.00	5.19
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

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本期国债期货投资政策

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本期国债期货投资评价

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。

万丰奥威(002085)

因未及时披露公司重大事项,深圳证券交易所于2018-04-12依据相关法规给予万丰奥威监管关注处分决定;

2018年03月05日,万丰奥威因筹划非公开发行股票停牌,拟收购公司控股股东万丰奥特控股集团有限公司持有的浙江万丰实业有限公司51%股权,预计不构成重大资产收购,停牌不超过10个交易日。03月16日,万丰奥威按期复牌,但未披露停牌进展公告。04月04日,万丰奥威未按期复牌公告,也未披露停牌进展公告。04月09日,万丰奥威按露停牌进展公告,承诺公司股票在4月23日前复牌。

万丰奥威的上述行为违反了本所《股票上市规则(2014年修订)》第2.1条和12.14条的规定。

本基金管理人作出说明如下:

(1)投资决策程序:基金经理根据公司当前基本面及发展前景进行选股,个股权重分散,行业集中度较低。

(2)处分涉及的未及时披露公司重大事项,该事项发生在4月份且对公司基本面及股价没有较大的持续性影响,因此继续持有该公司股票。

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其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	55,607.23
2	应收证券清算款	4,088,231.79
3	应收股利	-
4	应收利息	768,570.11
5	应收申购款	99.88
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,912,908.89

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

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	78,554,026.33
报告期期间基金总申购份额	1,597,890.57
减:报告期期间基金总赎回份额	75,127.57
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	80,076,789.33

§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,本基金管理人未进行本基金的申购、赎回及红利再投资等交易。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年10月01日至2018年12月31日	49,998,000.00	0.00	0.00	49,998,000.00	62.44%
产品特有风险							

持有份额比例较高的投资者(“高比例投资者”)大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回,中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险,赎回款项延期获得。

? 基金净值大幅波动的风险

高比例投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费,相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产,可能对基金资产净值造成较大波动。

? 基金规模较小导致的风险

高比例投资者赎回后,可能导致基金规模较小,从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责,执行相关投资策略,力争实现投资目标。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2018年10月19日,在《证券时报》和www.jyxa99.com上公布金元顺安金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加众禄基金为销售机构的公告;

2、2018年10月23日,在《证券时报》和www.jyxa99.com上公布金元顺安基金管理有限公司关于旗下产品持有的股票估值调整情况的公告-紫光国微;

3、2018年10月26日,在《证券时报》和www.jyxa99.com上公布金元顺安基金管理有限公司旗下基金2018年三季度报告;

4、2018年11月29日,在《证券时报》和www.jyxa99.com上公布金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加前海财厚基金为销售机构并参与费率优惠的公告;

5、2018年12月18日,在《证券时报》和www.jyxa99.com上公布金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加北京加和基金销售有限公司基金为销售机构并参与费率优惠的公告;

6、2018年12月20日,在《证券时报》和www.jyxa99.com上公布金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加扬州国信