

(上接B120版)

7.4.7.4 买入返售金融资产
7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位:人民币元

项目	2018年12月31日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	2017年12月31日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
交易所市场	40,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	40,000,000.00	-

注:本基金于本期末无买入返售金融资产。
7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券
注:本基金于本期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	2018年12月31日	2017年12月31日	2018年12月31日	2017年12月31日
应收固定存款利息	1,839.72	-	2,293.87	-
应收定期存款利息	-	-	-	-
应收其他存款利息	-	-	-	-
应收债券兑付利息	45.54	-	3,097.32	-
应收债券利息	6.40	-	-	-
应收资产支持证券利息	-	-	-	-
应收买入返售证券利息	-	-	-20,085.80	-
应收申购款利息	-	-	-	-
应收黄金合约手续费	-	-	-	-
其他	6.71	-	13.26	-
合计	1,898.38	-	-14,649.16	-

注:其他为应收结算保证金利息。
7.4.7.6 其他资产
注:本基金于本期末及上年度末均无其他资产。
7.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	2018年12月31日	2017年12月31日	2018年12月31日	2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	24,466.05	-	229,892.58	-
银行间市场应付交易费用	-	-	-	-
合计	24,466.05	-	229,892.58	-

7.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	2018年12月31日	2017年12月31日	2018年12月31日	2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-	-	-
应付赎回费	11.23	-	293.89	-
预提费用	130,000.00	-	140,000.00	-
合计	130,111.23	-	240,293.89	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	91,423,221.18	91,423,221.18
本期申购	1,419,212.90	1,419,212.90
本期赎回(以“-”号填列)	-72,365,867.14	-72,365,867.14
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	20,476,566.94	20,476,566.94

注:申购转换入份额,赎回转换转出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	2018年12月31日	2017年12月31日	2018年12月31日	2017年12月31日
上年度末	11,369,298.16	229,281.38	11,587,580.54	-
本期利润	-7,222,075.53	-3,233,269.04	-10,456,343.57	-
本期基金份额交易产生的变动数	-8,042,370.62	3,165,093.16	-4,877,301.46	-
其中:基金申购款	45,509.81	-46,379.49	130.32	-
基金赎回款	-8,087,880.43	3,210,448.65	-4,877,431.78	-
本期已分配利润	-3,906,146.93	161,082.50	-3,745,064.49	-
本期末	-3,906,146.93	161,082.50	-3,745,064.49	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	89,975.16	-	111,004.78	-
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	13,042.31	-	44,942.79	-
其他	673.02	-	953.02	-
合计	102,690.49	-	156,899.59	-

注:其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
卖出股票成交总额	182,106,126.96	465,071,814.90	-	-
减:卖出股票成交总额	189,642,989.73	456,422,807.99	-	-
买卖股票差价收入	-6,476,862.77	8,648,006.91	-	-

7.4.7.13 债券投资收益

注:本基金于本期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注:本基金于本期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

注:本基金于本期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

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注:本基金于本期及上年度可比期间均无衍生金融工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
股票资产产生的股利收益	412,960.29	-	1,167,345.46	-
基金资产产生的股利收益	-	-	-	-
合计	412,960.29	-	1,167,345.46	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
1.交易性金融资产	-3,233,268.04	2,974,706.67	-	-
-股票投资	-3,233,268.04	2,974,706.67	-	-
-债券投资	626.76	-	-	-
-资产支持证券投资	-	-	-	-
-贵金属投资	-	-	-	-
-其他	-	-	-	-
2.衍生工具	-	-	-	-
-权证投资	-	-	-	-
3.其他	-	-	-	-
减:应记金融商品公允价值变动产生的资产增值	-	-	-	-
合计	-3,233,268.04	2,974,706.67	-	-

7.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	65,387.82	-	318,414.01	-
基金转换费收入	227.96	-	3,327.39	-
合计	66,215.78	-	321,741.40	-

7.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	508,197.87	-	1,272,434.06	-
银行间市场交易费用	-	-	-	-
交易基金产生的费用	-	-	-	-
其中:申购费	-	-	-	-
赎回费	508,197.87	-	1,272,434.06	-

7.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
审计费用	30,000.00	-	40,000.00	-
信息披露费	100,000.00	-	100,000.00	-
债券账户维护费	18,000.00	-	13,500.00	-
其他费用	400.00	-	-	-
银行费用	4,823.42	-	11,736.13	-
合计	153,223.42	-	165,236.13	-

注:其他费用为开户费。

7.4.7.21 分部报告

截至本报告期末,本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务,因此,无需作披露的分部报告。

7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
民生加银基金管理有限公司(“民生加银基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
建设银行	基金托管人、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司(“中国民生银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
加拿大皇家银行	基金管理人的股东
三峡财务有限责任公司	基金管理人的股东
民生加银资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

注:本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.9.1.2 权证交易

注:本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

注:本基金于本期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	678,526.61	-	1,338,863.71	-
其中:支付销售机构客户的维护费	155,872.53	-	427,143.43	-

注:1)基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日基金资产净值

2)于2018年12月31日的应付基金管理费为人民币21,968.03元

(2017年12月31日:145,498.25元)。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	113,087.63	-	223,144.00	-

注:1)基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日基金资产净值

2)于2018年12月31日的应付基金托管费为人民币3,661.33元

(2017年12月31日:人民币24,249.71元)。

7.4.9.2.3 销售服务费

注:本基金于本期末及上年度末均无应支付关联方的销售服务费。

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金于本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。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金于本期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况,于本期末及上年度末亦未持有本基金份额。

7.4.9.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金于本期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.9.5 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	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
建设银行	8,369,391.09	89,975.16	7,935,302.15	111,004.78

注:本基金本期的活期银行存款由基金托管人建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.9.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

注:本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.10 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票