

(上接B056版)

| 项目          | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 |
|-------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 股票资产产生的股利收益 | 41,812.20                       | 131,406.12                           |
| 基金投资产生的股利收益 | -                               | -                                    |
| 合计          | 41,812.20                       | 131,406.12                           |

7.4.2.18公允价值变动收益

单位:人民币元

| 项目名称      | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -700,436.63                     | -3,489,906.28                        |
| —股票投资     | -469,476.63                     | -3,489,906.18                        |
| —债券投资     | -34,960.00                      | -                                    |
| —资产支持证券投资 | -                               | -32,030.10                           |
| —基金投资     | -                               | -                                    |
| —贵金属投资    | -                               | -                                    |
| 2.衍生金融资产  | -                               | -                                    |
| —其他       | -                               | -                                    |
| 3.衍生金融负债  | -                               | -                                    |
| —其他       | -                               | -                                    |
| 4.其他      | -                               | -                                    |
| 合计        | -700,436.63                     | -3,489,906.28                        |

7.4.2.19其他收入

单位:人民币元

| 项目      | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 6,417.00                        | 67,211.38                            |
| 转换费收入   | -                               | 10,104.09                            |
| 其他      | 21.42                           | -                                    |
| 其他应付款   | -                               | 165.96                               |
| 合计      | 6,438.42                        | 77,381.43                            |

7.4.2.20交易费用

单位:人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 189,218.61                      | 1,213,222.76                         |
| 银行间市场交易费用 | -                               | -                                    |
| 合计        | 189,218.61                      | 1,213,222.76                         |

7.4.2.21其他费用

单位:人民币元

| 项目    | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 |
|-------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用  | 60,000.00                       | 60,000.00                            |
| 信息披露费 | 80,000.00                       | 150,000.00                           |
| 银行手续费 | 18,300.00                       | 18,300.00                            |
| 银行汇划费 | 1,066.26                        | 3,264.97                             |
| 其他费用  | -                               | -                                    |
| 合计    | 159,466.26                      | 231,464.97                           |

7.4.3或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.3.1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。

7.4.3.2资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,除7.4.6.2营业外、增值和披露的事项外,本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.3.3关联方关系

| 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、注册地机构、基金服务机构 |
| 中银汇安资产管理(上海)有限公司   | 基金管理人、基金代销机构       |
| 上海海康资产管理(上海)有限公司   | 基金管理人、基金代销机构       |
| 上海金元吉利资产管理(上海)有限公司 | 基金管理人、基金代销机构       |
| 上海金元吉利资产管理(上海)有限公司 | 基金管理人、基金代销机构       |

7.4.3.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.4.1通过关联方交易单元进行的交易

4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

4.10.1.1 股票交易

7.4.3.4.2关联方交易

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。

7.4.3.4.3债券交易

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交易。

7.4.3.4.4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。

7.4.3.4.5支付关联方的佣金

4.10.13 债券交易

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交易。

4.10.14 债券回购交易

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证券交易、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究和市场及产品信息服务。

7.4.3.4.6关联方报酬

7.4.3.4.6.1基金管理费

| 项目              | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期支付给基金托管人的管理费  | 524,067.48                      | 588,072.21                           |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 74,129.63                       | 131,461.19                           |

注:

1.基金管理费按前一日基金资产净值的一定比例年费率计提。  
计算方法如下: $H = E \times R \div 365$  为当年天数,  
H为每日应支付的基金管理费,  
E为前一日基金资产净值。  
基金管理人管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理人管理费划款指令,基金托管人复核后于次月3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。  
2.根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》,基金管理人及基金销售机构在基金销售协议中约定的销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户服务费,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,客户维护费从基金管理费中列支。

7.4.3.4.6.2基金托管费

| 项目             | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期支付给基金托管人的托管费 | 54,014.63                       | 58,011.98                            |

注:

基金托管费按前一日基金资产净值的一定比例年费率计提。  
计算方法如下: $H = E \times R \div 365$  为当年天数,  
H为每日应支付的基金托管费,  
E为前一日基金资产净值。  
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月3个工作日内从基金资产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

7.4.3.4.6.3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(含回购)交易。

7.4.3.4.6.4各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.6.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内未有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.3与关联方债券的银行存款余额及当期产生的利息收入

划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

注:本基金的资金交易结算资金通过托管银行备付金账户转入中国证券登记结算有限责任公司,2016年获得的利息收入为人民币1,006.84元(2015年度获得的利息收入为人民币5,519.93元),2016年末结算资产余额为人民币68,289.58元(2015年末结算资产余额为人民币102,556.03元)。

7.4.3.4.6.4.4基金在承销期间参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购买关联方承销的证券。

7.4.3.4.6.4.5利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.3.4.6.4.6报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.7与关联方债券的银行存款余额及当期产生的利息收入

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： $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$ ，

H为每日应支付的基金托管费

注:

基金托管费按前一日基金资产净值的一定比例年费率计提。  
计算方法如下: $H = E \times R \div 365$  为当年天数,  
H为每日应支付的基金托管费,  
E为前一日基金资产净值。  
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月3个工作日内从基金资产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

7.4.3.4.6.4.8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(含回购)交易。

7.4.3.4.6.4.9各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.6.4.9.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内未有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.9.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.9.3与关联方债券的银行存款余额及当期产生的利息收入

|              |                       |                       |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 单位:人民币       |                       |                       |
|              | 本期                    | 上年度可比期间               |
|              | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
| 期末余额         | 期末余额                  | 期末余额                  |
| 中国工商银行股份有限公司 | 54,029.77             | 12,356,372.88         |

注:本基金的资金交易结算资金通过托管银行备付金账户转入中国证券登记结算有限责任公司,2016年获得的利息收入为人民币1,006.84元(2015年度获得的利息收入为人民币5,519.93元),2016年末结算资产余额为人民币68,289.58元(2015年末结算资产余额为人民币102,556.03元)。

7.4.3.4.6.4.9.4基金在承销期间参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购买关联方承销的证券。

7.4.3.4.6.4.9.5利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.3.4.6.4.9.6报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.9.7与关联方债券的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:

基金托管费按前一日基金资产净值的一定比例年费率计提。  
计算方法如下: $H = E \times R \div 365$  为当年天数,  
H为每日应支付的基金托管费,  
E为前一日基金资产净值。  
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月3个工作日内从基金资产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

7.4.3.4.6.4.9.8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(含回购)交易。

7.4.3.4.6.4.9.9各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.6.4.9.9.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.9.9.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.9.9.3与关联方债券的银行存款余额及当期产生的利息收入

| 关联方名称        | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 |           |
|--------------|---------------------------------|--------------------------------------|-----------|
| 期末余额         | 期末余额                            | 期末余额                                 |           |
| 中国工商银行股份有限公司 | 54,029.77                       | 12,356,372.88                        | 46,330.32 |

注:

基金托管费按前一日基金资产净值的一定比例年费率计提。  
计算方法如下: $H = E \times R \div 365$  为当年天数,  
H为每日应支付的基金托管费,  
E为前一日基金资产净值。  
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月3个工作日内从基金资产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

7.4.3.4.6.4.9.9.4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(含回购)交易。

7.4.3.4.6.4.9.9.5各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.6.4.9.9.5.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.3与关联方债券的银行存款余额及当期产生的利息收入

| 关联方名称        | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 |           |
|--------------|---------------------------------|--------------------------------------|-----------|
| 期末余额         | 期末余额                            | 期末余额                                 |           |
| 中国工商银行股份有限公司 | 54,029.77                       | 12,356,372.88                        | 46,330.32 |

注:

基金托管费按前一日基金资产净值的一定比例年费率计提。  
计算方法如下: $H = E \times R \div 365$  为当年天数,  
H为每日应支付的基金托管费,  
E为前一日基金资产净值。  
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月3个工作日内从基金资产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.4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(含回购)交易。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.3与关联方债券的银行存款余额及当期产生的利息收入

| 关联方名称        | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 |           |
|--------------|---------------------------------|--------------------------------------|-----------|
| 期末余额         | 期末余额                            | 期末余额                                 |           |
| 中国工商银行股份有限公司 | 54,029.77                       | 12,356,372.88                        | 46,330.32 |

注:

基金托管费按前一日基金资产净值的一定比例年费率计提。  
计算方法如下: $H = E \times R \div 365$  为当年天数,  
H为每日应支付的基金托管费,  
E为前一日基金资产净值。  
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月3个工作日内从基金资产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.4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(含回购)交易。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.5各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.5.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.5.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.5.3与关联方债券的银行存款余额及当期产生的利息收入

| 关联方名称        | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 |           |
|--------------|---------------------------------|--------------------------------------|-----------|
| 期末余额         | 期末余额                            | 期末余额                                 |           |
| 中国工商银行股份有限公司 | 54,029.77                       | 12,356,372.88                        | 46,330.32 |

注:

基金托管费按前一日基金资产净值的一定比例年费率计提。  
计算方法如下: $H = E \times R \div 365$  为当年天数,  
H为每日应支付的基金托管费,  
E为前一日基金资产净值。  
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月3个工作日内从基金资产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.5.4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(含回购)交易。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.5.5各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.5.5.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.5.5.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.5.5.3与关联方债券的银行存款余额及当期产生的利息收入

| 关联方名称        | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 |           |
|--------------|---------------------------------|--------------------------------------|-----------|
| 期末余额         | 期末余额                            | 期末余额                                 |           |
| 中国工商银行股份有限公司 | 54,029.77                       | 12,356,372.88                        | 46,330.32 |

注:

基金托管费按前一日基金资产净值的一定比例年费率计提。  
计算方法如下: $H = E \times R \div 365$  为当年天数,  
H为每日应支付的基金托管费,  
E为前一日基金资产净值。  
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月3个工作日内从基金资产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.5.5.4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(含回购)交易。

7.4.3.4.6.4.9.9.5.5.