

(上接B057版)

项目	2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金净值(份)	期末净值
上年度末	33,106,691.16	33,106,691.16
本期申购	3,466,171,424.72	3,466,171,424.72
本期赎回(以“-”号填列)	-1,416,161,826.52	-1,416,161,826.52
本期末	2,772,416,289.36	2,772,416,289.36

注:申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换转出份额。

7.4.7.10未分配利润

单位:人民币元			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,528,795.84	-792,246.82	8,043,462.83
本期利润	79,940,467.01	-39,593,062.89	39,447,694.12
本期基金份额交易产生的变动	806,452,319.72	-106,134,553.64	700,297,766.08
其中:基金申购款	866,149,406.42	-189,611,260.72	676,537,864.47
基金赎回款	-148,617,086.70	80,377,217.96	-68,240,068.62
本期已分配利润	-666,800,142.83	-	-666,800,142.83
本期末	227,498,642.36	-149,500,832.36	80,998,710.00

7.4.7.11存款利息收入

单位:人民币元			
项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日至2015年12月31日	
定期存款利息收入	389,723.49	9,800.89	
活期存款利息收入	-	-	
其他存款利息收入	-	-	
利息收入合计	389,723.49	9,800.89	
其他	46,890.56	9,977.11	
合计	436,614.05	21,143.42	

7.4.7.12股票投资收益

单位:人民币元			
项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日至2015年12月31日	
卖出股票成交总额	1,243,412,910.43	16,524,871.68	
减:卖出股票成本总额	1,395,891,392.84	14,841,721.57	
买卖股票差价收入	49,481,517.59	683,149.11	

7.4.7.13债券投资收益

单位:人民币元			
项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日至2015年12月31日	
卖出债券(债券及债券利息收入)成交总额	1,686,823,219.85	116,543,227.76	
减:卖出债券(债券及债券利息收入)成本总额	1,646,517,676.03	109,172,015.32	
减:应收利息总额	33,026,763.02	3,440,030.97	
买卖债券(债券及债券利息收入)差价收入	-22,700,218.26	2,801,173.36	

7.4.7.14资产支持证券投资收益
本基金本报告期末及上年度可比期间均无资产支持证券投资收

益。
7.4.7.15贵金属投资收益
本基金本报告期末及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16衍生工具收益
本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.17股利收益

单位:人民币元			
项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日至2015年12月31日	
股票投资收益产生的股利收益	4,172,513.45	986.00	
基金分红产生的股利收益	4,172,513.32	986.00	
合计	4,172,513.32	986.00	

7.4.7.18公允价值变动收益

单位:人民币元			
项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日至2015年12月31日	
1.交易性金融资产	-39,616,052.89	-269,767.03	
—股票投资	-6,991,186.19	46,107.52	
—债券投资	-32,619,207.76	-315,475.87	
—资产支持证券投资	-	-	
—基金投资	-	-	
—贵金属投资	-	-	
—其他	-	-	
2.衍生工具	-	-	
—股权投资	-	-	
—其他投资	-	-	
合计	-39,616,052.89	-269,767.03	

单位:人民币元			
项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日至2015年12月31日	
基金赎回费收入	1,099,696.96	32,526.90	
其他	4,000.00	12,265.61	
其他收入	287.97	4,882.30	
合计	1,100,384.93	47,674.81	

7.4.7.20交易费用

单位:人民币元			
项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日至2015年12月31日	
交易所市场交易费用	3,272,622.36	47,382.70	
银行间市场交易费用	28,510.00	360.00	
合计	3,302,132.36	47,742.70	

7.4.7.21其他费用

单位:人民币元			
项目	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	
审计费用	66,000.00	66,000.00	
信息披露费	110,000.00	150,000.00	
银行间债券市场维护费	9,000.00	31,000.00	
其他费用	6,000.00	-	
合计	191,000.00	247,000.00	
银行支付手续费	40,562.77	1,797.84	
合计	246,422.77	238,827.84	

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项说明

7.4.8.1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。

7.4.8.2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、增值税中披露的事项外,本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关
金元顺安基金管理有限公司	基金管理人,上市关联方,基金销售机构
中国银河证券股份有限公司	基金托管人,基金认购机构
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金认购机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的股东
上海宏利资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1股票交易
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股票交易。

7.4.10.1.2权证交易
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。

7.4.10.1.3债券交易

金额单位:人民币元			
关联方名称	本期2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日至2015年12月31日	
成交金额	130,332,606.86	49,027.6	62.4%
占当期债券成交金额的比例	-	-	-
金元证券股份有限公司	130,332,606.86	49,027.6	62.4%

7.4.10.1.4债券回购交易

金额单位:人民币元			
关联方名称	本期2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日至2015年12月31日	
成交金额	-	-	-
占当期债券回购成交金额的比例	-	-	-
金元证券股份有限公司	-	-	-

7.4.10.1.5应支付关联方的佣金
本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付的关联方佣金。

7.4.10.2关联方报酬

7.4.10.2.1基金管理费

单位:人民币元			
项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日至2015年12月31日	
当期发生的基金应支付的管理费	13,86,462.46	30,349.41	
其中:支付销售机构的手续费	50,586.68	32,146.42	

注:

1. 基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%的年费率计提。计算方法如下:H=E×0.7%/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。
基金管理人管理本基金每日计算,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费划款指令,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、公休日等,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依据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。

7.4.10.2.2基金托管费

单位:人民币元			
项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日至2015年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	3,664,789.28	86,428.43	

注:
基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。

计算方法如下:H=E×0.20%/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前3个工作日内从基金资产中一次性支取,若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
7.4.10.2.3销售服务费

单位:人民币元			
获得销售服务费的各关联方名称	本期2016年1月1日至2016年12月31日	与本报告期基金应支付的销售服务费	
金元顺安基金管理有限公司	-	2,834,113.56	
银河证券股份有限公司	-	23,922.71	
金元证券股份有限公司	-	53,377.42	
合计	-	2,911,413.69	
获得销售服务费的各关联方名称	本期2015年1月1日至2015年12月31日	与本报告期基金应支付的销售服务费	
金元顺安基金管理有限公司	-	2,547.64	
银河证券股份有限公司	-	59,176.68	
金元证券股份有限公司	-	94,067.41	
合计	-	156,791.13	

注:

1. 2016年7月18日前,基金的销售服务费按前一日基金资产净值0.4%的年费率计提。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

计算方法如下:H=E×0.4%/当年天数,H为本基金份额每日应计提的销售服务费,E为本基金份额前一日基金资产净值。

2. 基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3. 自2016年7月18日起,本基金不再计提销售服务费。
7.4.10.3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的债券(含回购)交易。

7.4.10.4各关联方投资本基金的情况
7.4.10.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日至2015年12月31日	
报告期末持有本基金份额	20,000,400.00	20,000,400.00	
报告期末前10名持有人总份额	-	-	
报告期间买入/卖出总份额	-	-	
减:报告期间买入/卖出总份额	2,500,000.00	20,000,400.00	
报告期末持有本基金份额	17,500,400.00	20,000,400.00	
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.77%	60.41%	

7.4.10.4.2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

本基金本报告期末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。

7.4.10.5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	本期2016年1月1日至2016年12月31日	本期余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	139,879,483.78	389,723.49	9,800.86

注:本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户流转于中国证券登记结算有限责任公司,2016年度获得的利息收入为人民币45,860.55%(2015年度获得的利息收入为人民币9,977.11%),2016年末结算备付金余额为人民币2,923,561.37元。(2015年末结算备付金余额为人民币949,286.79元)
7.4.10.6本基金在承销期内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入关联方承销证券。

单位:人民币元			
序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额应派现金股息/每股派现
1	2016-12-12	2016-12-12	1.970
合计	-	-	1.970

项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	上期2015年1月1日至2015年12月31日	
基金赎回费收入	1,099,696.96	32,526.90	
其他	4,000.00	12,265.61	
其他收入	287.97	4,882.30	
合计	1,100,384.93	47,674.81	

7.4.12.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.12.1.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.12.1.2报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.12.1.3报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.4.12.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票
本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。
7.4.12.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.12.3.1银行间市场债券正回购

债券代码	债券名称	回购到期日	期末待购金额	数量(张)	期末待购金额
011609676	16国债07	2017-01-04	100.00	100.00	0.0000
合计	-	-	1,000.00	100.00	0.0000

注:截至本报告期末2016年12月31日止,基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额98,999,731.50元,于2017年1月4日到期。

7.4.12.2.3交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额249,000,000.00元,其中49,000,000.00元于2017年1月3日到期,100,000,000.00元于2017年1月4日到期,100,000,000.00元于2017年1月11日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.13金融工具风险及管理
7.4.13.1风险管理政策和组织架构
本基金在日常经营活动中涉及的金融工具主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理体系融入公司各个业务层面的全面控制过程之中,并建立了三道防线:以各岗位职责为基石,形成第一道防线;通过相关部门之间、相关岗位之间相互监督制衡,形成第二道防线;由督察长、风险控制委员会、监察稽核部对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务进行监督、检查、评价,形成的第三道防线。

7.4.13.2信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以降低信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元			
短期信用评级	本期2016年12月31日	上期末2015年12月31日	
A-1	381,063,000.00	-	
A-1以下	-	-	
未评级	130,622,000.00	2,100,400.00	
合计	511,685,000.00	2,100,400.00	

注:未评级债券为超短期融资券和政策性金融债。

7.4.13.2.2按长期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元			
长期信用评级	本期2016年12月31日	上期末2015年12月31日	
AAA	3,079,020,216.00	67,416,313.20	
AA/AAA以下	1,071,027,232.00	17,490,200.00	
未评级	400,326,426.80	13,089,763.40	
合计	4,550,373,874.80	98,000,000.00	

注:未评级债券为国债和政策性金融债。

7.4.13.3流动性风险
流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度;本基金流动性风险一方面来自于基金资产估值时可采用公允价值而持有的基金估值,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券大部分在银行间同业市场交易,其余亦可在证券交易所上市;因此,本期末本基金其它资产均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4市场风险
市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。
7.4.13.4.1利率风险
利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等,生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

7.4.13.4.1.1利率风险敞口						单位:人民币元
本报告 2016年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计	
资产						
银行存款	139,879,693.78	-	-	-	139,879,693.78	
结算备付金	2,022,561,617.27	-	-	-	2,022,561,617.27	
存出保户金	600,342,939.00	-	-	-	600,342,939.00	
交易性金融资产	867,506,000.00	1,325,106,133.00	230,817,142.50	10,776,652.66	2,517,349,891.56	
衍生金融资产	-	-	-	-	-	
应收证券清算款	-	-	-	-	-	0.00
应收利息	-	-	-	44,875,987.09	44,875,987.09	
应收申购款	-	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	
资产总计	1,010,967,388.14	1,325,106,133.00	230,817,142.50	138,652,641.75	2,708,631,263.69	
负债						
应付赎回款	-	-	-	0.04	0.04	