

(上接B071版)

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
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。
7.4.10.1.4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。
7.4.10.1.5应付往来款的佣金
金额单位:人民币元

注:2016年1月1日至2016年12月31日

关联方名称 本期 2016年1月1日至2016年12月31日

当期佣金 占当期佣金总额的比例(%) 期末应付佣金总额(元) 占期初应付佣金总额的比例(%)

金元证券股份有限公司 - - - -

2016年1月1日至2016年12月31日

关联方名称 本期 2016年1月1日至2016年12月31日

当期佣金 占当期佣金总额的比例(%) 期末应付佣金总额(元) 占期初应付佣金总额的比例(%)

金元证券股份有限公司 226,850.04 10.12% - -

注:上述款项按市场公允价值,以扣除由中证证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和手续费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围包括佣金收入方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2关联方报酬

7.4.10.2.1基金管理费

金额单位:人民币元

项目 本期 2016年1月1日至2016年12月31日

上一年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日

当期发生的管理人报酬 421,781.82 1,511,372.06

其中:支付给客户的管理费 210,121.49 762,972.34

注:1.基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。

计算方法如下: H=Ex 1.50% /当年天数。

H为每日应支付的基金管理费。

E为前一日的基金资产净值。

基金管理费按日计提,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,经基金托管人复核后于次月首日3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日,则顺延,支付日期同前述。

2.根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》,基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定依据销售金额的保有量计提一定比例的客户维护费,以扣除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支取。

7.4.10.2.2基金托管费

金额单位:人民币元

项目 本期 2016年1月1日至2016年12月31日

上一年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日

当期发生的托管费 70,200.00 261,899.29

注:1.基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。

计算方法如下: H=Ex 0.25% /当年天数。

H为每日应支付的基金托管费。

E为前一日的基金资产净值。

基金托管费按日计提,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,经基金托管人复核后于次月首日3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日,则顺延,支付日期同前述。

7.4.10.3与关联方进行银行同业市场的债券(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同业市场的债券(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报告期内基金投资运作情况

本基金本报告期及上年度末均未有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2报告期内未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有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

金额单位:人民币元

项目 本期 2016年1月1日至2016年12月31日

上一年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日

当期利息收入 70,200.00 261,899.29

注:本基金的证券交易结算资金通过托管银行付至客户账户,转存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3,880.21元(2015年度获得的利息收入人民币19,263.55元),2016年未结算应付金额为人民币395,372.22元(2015年未结算应付金额为人民币116,433.65元)。

7.4.10.6本基金在承销期内或与承销团承销证券的情况

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的证券。

7.4.11利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12期末持有的流通受限证券

7.4.12.1因认购新股/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期未因认购新股/增发证券而持有流通受限证券。

7.4.12.2期末持有的债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产余额。

7.4.12.3交易所市场证券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产余额。

7.4.13金融工具风险管理

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了政策/程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风

险敞口及内部控制流程,通过适当的管理及信息系统持续监控上述各类风

险。基金管理人将风险管理融入公司各个业务层面的全面控制过程中,并建

立了“三道防线”,即各相关部门负责,形成第一道防线;通过相关部门之间及

部门之间的相互监督,形成第二道防线;由督察长、风险控制委员会、稽核监察部对

公司各部门、各岗位、各项业务进行监督检查,形成第三道防线。

7.4.13.2信用风险

信用风险是本基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投

资证券发行人未能履行其应尽的义务而产生的信用风险。

本基金的信用风险主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项及

买入返售金融资产等。

本基金管理人每日对本基金的流动性需求进行持续的监测和分析。

7.4.13.3流动性风险

本基金的流动性风险主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及应收款项等。

7.4.13.4.1利率风险敞口

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

当期利息收入 3,379,003.99 12,038,762.33

当期利息收入 70,200.00 261,899.29

注:本基金的证券交易结算资金通过托管银行付至客户账户,转存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3,880.21元(2015年度获得的利息收入人民币19,263.55元),2016年未结算应付金额为人民币395,372.22元(2015年未结算应付金额为人民币116,433.65元)。

7.4.13.4.2信用风险敞口

截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产余额。

7.4.13.5金融工具公允价值

7.4.13.5.1金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

(注:2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。)

7.4.13.5.2金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.3金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.4金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.5金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.6金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.7金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.8金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.9金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.10金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.11金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.12金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.13金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.14金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.15金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.16金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.17金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,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工具中属于第一层次的余额为人民币18,903,543.44元,属于第二层次的余额为人民币490,000元,无属于第三层次的余额。

7.4.13.5.18金融工具公允价值

2016年1月1日至2016年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的