

上接B293版

项目	本期末 2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
股票	83,564,009.05	86,790,430.01	3,226,420.96
贵金属投资—金交所黄金合约	—	—	—
债券	228.00	120.06	-107.94
银行间市场	—	—	-107.94
资产支持证券	228.00	120.06	—
货币市场基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	83,564,238.05	86,790,550.07	3,226,312.02
项目	上期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	935,493,773.19	117,481,831.18	11,569,067.96
贵金属投资—金交所黄金合约	—	—	—
债券	—	140.47	-68.23
银行间市场	—	—	-68.23
合计	228.00	140.47	-68.23
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	105,022,001.30	117,481,971.65	11,569,969.99

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

项目	本期末 2016年12月31日		
	合约/名义金额	资产	负债
利率衍生工具	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—
权益衍生工具	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—
合计	—	—	—
项目	上期末 2015年12月31日		
	合约/名义金额	资产	负债
利率衍生工具	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—
权益衍生工具	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—
合计	—	—	—

注：本基金于本期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

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

项目	本期末 2016年12月31日		
	账面余额	减值准备	其中：坏账准备的金额
合计	—	—	—
项目	上期末 2015年12月31日		
	账面余额	减值准备	其中：坏账准备的金额
合计	—	—	—

注：本基金于本期末及上年度末均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

项目	本期末 2016年12月31日					
	债券代码	债券名称	约定到期日	公允价值	数量（张）	估值总额
合计	—	—	—	—	—	—
项目	上期末 2015年12月31日					
	债券代码	债券名称	约定到期日	公允价值	数量（张）	估值总额
合计	—	—	—	—	—	—

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

项目	本期末 2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
应收应收利息	9,276.33	—	12,635.37
应收其他利息	—	—	—
应收债券付息资产	228.04	—	524.26
应收债券利息	0.04	—	0.03
应收中期票据利息	—	—	—
应收黄金合约利息	—	—	—
其他	37.18	—	11.23
合计	9,341.59	—	13,170.66

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

项目	本期末 2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
其他应收款	—	—	—
待摊费用	—	—	—
合计	—	—	—

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

项目	本期末 2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
交易所市场应付交易费用	608,467.06	—	620,547.03
银行间市场应付交易费用	—	—	—
合计	608,467.06	—	620,547.03

7.4.7.8 其他负债

项目	本期末 2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
应付应付交易款项—保证金	115.16	—	5,236.76
应付应付利息	97,537,306.23	-13,447,500.25	78,149,803.00
应付应付股利	24,542,394.03	—	24,542,394.03
合计	340,915.15	—	448,235.65

7.4.7.9 实收基金

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	基金份额（份）	账面金额	
上年度末	65,468,161.97	65,468,161.97	
本期申购（以“+”号填列）	24,542,394.03	24,542,394.03	
本期赎回（以“-”号填列）	-40,624,773.35	-40,624,773.35	
基金拆分/份额折算/赎回费返还	—	—	
本期申购	—	—	
本期赎回（以“-”号填列）	—	—	
合计	79,326,382.73	79,326,382.73	

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	已实现利润	未实现利润	未分配利润合计
上年度末	97,537,306.23	-13,447,500.25	78,149,803.00
本期利润	-15,456,243.32	4,054,320.71	-11,401,912.61
本期利润分配	—	—	—
其中：基金管理人	23,506,261.28	-8,376,471.16	15,229,790.12
基金持有人	-18,962,494.03	12,332,800.07	-26,629,693.75
本期未分配利润	79,326,382.73	-23,776,620.62	51,860,000.27
合计	—	—	—

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
存放在金融机构收入	413,722.18	—	475,087.46
定期存款利息收入	—	—	—
其他存款利息收入	—	—	—
其他	4,294.88	—	27,000.46
合计	428,017.06	—	502,087.92

注：本期其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
卖出股票成交金额	680,285,460.09	2,016,034,002.27	
卖出股票成本总额	682,199,346.27	1,882,524,092.42	
买卖股票差价收入	-2,913,886.23	164,009,909.85	

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
卖出债券成交金额	—	—	—
卖出债券成本总额	—	—	—
买卖债券差价收入	—	—	—
其他	—	—	—
合计	—	—	—

7.4.7.14贵金属投资收益
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

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

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
股票投资收益产生的股利收益	403,441.68	—	262,307.25
基金管理人支付的股利收益	403,441.68	—	262,307.25
合计	—	—	—

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
1.受托管理金融资产	-8,323,461.34	-4,817,514.46	
—一般股权投资	-8,323,431.63	-4,817,440.12	
—债券投资	-10.01	-73.34	
—资产支持证券投资	—	—	
—基金管理人	—	—	
—其他	—	—	
2.衍生工具	—	—	
—权证投资	—	—	
其他	—	—	
合计	-8,323,461.34	-4,817,514.46	

7.4.7.18 其他收入

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
基础金融收入	75,000.00	246,940.33	
转换费收入	3,037.36	10,602.11	
合计	78,037.36	257,542.44	

7.4.7.19 交易费用

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
交易所市场交易费用	1,092,362.03	—	5,779,548.72
银行间市场交易费用	—	—	—
合计	1,092,362.03	—	5,779,548.72

7.4.7.20 其他费用

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
审计费用	40,000.00	40,000.00	
信息披露费	300,000.00	300,000.00	
其他费用	200.00	—	
合计	6,200.00	11,441.54	
债券承销手续费	42,000.00	18,000.00	
合计	38,462.00	300,441.54	

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
中信建投银行	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
加银大新银行	基金管理人控股股东
民生加银资产管理有限公司	基金管理人控股子公司
民生加银资产管理（香港）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
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
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
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

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
当期发生的基金应支付的管理费	2,306,440.73	3,318,423.86	
其中：支付销售机构的费用（注）	301,000.07	3,026,423.86	

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为前一日的基金资产净值

2) 于2016年12月31日的应付基金管理费为人民币168,825.82元。（2015年12月31日：人民币228,021.46元）

7.4.9.2.2 基金托管费

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	公允价值	公允价值变动	
当期发生的基金应支付的托管费	367,574.76	544,772.33	
其中：支付销售机构的费用（注）	301,000.07	3,026,423.86	

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为前一日的基金资产净值

2)于2016年12月31日的应付基金托管费为人民币28,137.62元。（2015年12月31日：人民币38,003.58元）

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

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

基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.9.4.2 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

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	期末余额	当期利息收入	当期利息收入
中国建设银行	47,167,135.45	413,722.18	59,919,433.00
注：	—	—	475,087.46

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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（2016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

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

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	数量（股）	期末账面成本	期末公允价值	备注
000436	华发股份	2017年1月1日	重组停牌	200,000	6,526,669.38	—	
600499	世昌新材	2017年1月1日	重组停牌	—	—	6,748,000.00	
600499	世昌新材	2017年1月1日	重组停牌	16,360	—	200,000	3,676,000.00

7.4.10.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券
7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。