

# 信息披露 Disclosure

(上接B305版)

7.4.7.3 衍生金融资产/负债  
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

单位：人民币元		
项目	本期 2016年12月31日	其中：买断式逆回购
银行间市场	11,400,000.00	-
交易所市场	11,400,000.00	-
合计	22,800,000.00	-
项目	上年度末 2015年12月31日	其中：买断式逆回购
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券  
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	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	979.85	2,222.00
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	176.33	456.67
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	8,876.17	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约手续费	-	-
其他	14.41	46.31
合计	6,042.76	2,764.98

注：其他为应收结算保证金利息。  
7.4.7.6 其他资产  
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	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	407,127.78	1,000,412.38
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	407,127.78	1,000,412.38

单位：人民币元		
项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易保证金	-	-
应付赎回款	71.86	603.96
预提费用	130,000.00	240,000.00
合计	130,071.86	240,603.96

单位：人民币元		
项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	期末余额
上年度末	61,821,763.67	61,821,763.67
本期申购	17,071,771.58	17,071,771.58
本期赎回(以“-”号填列)	-20,219,654.32	-20,219,654.32
—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	48,687,988.93	48,687,988.93

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

单位：人民币元		
项目	已实现部分	未实现部分
上年度末	28,354,796.06	-1,314,584.97
本期利润	-4,111,197.71	-7,236,273.46
本期基金份额交易产生的变动数	-954,542.19	246,322.86
其中：基金申购款	6,022,742.76	-3,433,889.02
基金赎回款	-6,977,286.36	3,680,211.88
本期已分配利润	-	-
本期末	23,289,056.16	-8,303,536.57

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
活期存款利息收入	91,681.73	90,536.46
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	6,764.44	21,103.62
其他	1,101.27	1,763.77
合计	99,537.44	113,433.84

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	460,124,918.89	1,332,891,964.33
减：卖出股票成本总额	461,362,986.49	1,369,767,529.16
买卖股票差价收入	-1,238,067.60	63,124,435.17

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
股票投资产生的股利收益	224,462.01	443,568.02
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	224,462.01	443,568.02

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	-7,236,273.46	-169,468.96
—股票投资	-7,236,273.46	-169,468.96
—债券投资	-	-
—资产支持证券投资	-	-
—商品期货投资	-	-
—其他	-	-
2.衍生工具	-	-
—权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-7,236,273.46	-169,468.96

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	31,165.17	276,790.19
转换费收入	419.06	58,377.83
合计	31,584.23	335,168.02

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	1,369,269.12	3,961,090.81
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,369,269.12	3,961,090.81

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
审计费用	30,000.00	40,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
律师费用	8,762.06	17,794.29
销售账户管理费	6,000.00	18,000.00
合计	144,762.06	175,794.29

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
当期发生的基金支付托管费	994,267.70	1,586,644.67
其中：支付销售机构的客户维护费	225,088.84	317,382.60

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2016年12月31日的应付基金管理费为人民币81,880.33元(2015年12月31日：人民币100,440.57元)。  
7.4.9.2.2 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
当期发生的基金支付托管费	994,267.70	1,586,644.67
其中：支付销售机构的客户维护费	225,088.84	317,382.60

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2016年12月31日的应付基金托管费为人民币13,646.73元(2015年12月31日：人民币16,740.10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  
基金管理人于本期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	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
中国民生银行	3,002,618.18	91,681.73

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，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  
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	上期 2015年1月1日至2015年12月31日
华泰证券	3,002,618.18	91,681.73

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
当期发生的基金支付托管费	165,709.48	264,440.79

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2016年12月31日的应付基金托管费为人民币13,646.73元(2015年12月31日：人民币16,740.10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  
基金管理人于本期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	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
中国民生银行	3,002,618.18	91,681.73

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，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  
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	上期 2015年1月1日至2015年12月31日
华泰证券	3,002,618.18	91,681.73

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
交易所市场交易费用	407,127.78	1,000,412.38
银行间市场交易费用	-	-
合计	407,127.78	1,000,412.38

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
应付券商交易保证金	-	-
应付赎回款	71.86	603.96
预提费用	130,000.00	240,000.00
合计	130,071.86	240,603.96

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
卖出股票成交总额	460,124,918.89	1,332,891,964.33
减：卖出股票成本总额	461,362,986.49	1,369,767,529.16
买卖股票差价收入	-1,238,067.60	63,124,435.17

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
股票投资产生的股利收益	224,462.01	443,568.02
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	224,462.01	443,568.02

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
1.交易性金融资产	-7,236,273.46	-169,468.96
—股票投资	-7,236,273.46	-169,468.96
—债券投资	-	-
—资产支持证券投资	-	-
—商品期货投资	-	-
—其他	-	-
2.衍生工具	-	-
—权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-7,236,273.46	-169,468.96

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	31,165.17	276,790.19
转换费收入	419.06	58,377.83
合计	31,584.23	335,168.02

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
交易所市场交易费用	1,369,269.12	3,961,090.81
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,369,269.12	3,961,090.81

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
审计费用	30,000.00	40,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
律师费用	8,762.06	17,794.29
销售账户管理费	6,000.00	18,000.00
合计	144,762.06	175,794.29

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
当期发生的基金支付托管费	994,267.70	1,586,644.67
其中：支付销售机构的客户维护费	225,088.84	317,382.60

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2016年12月31日的应付基金托管费为人民币13,646.73元(2015年12月31日：人民币16,740.10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  
基金管理人于本期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

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
当期发生的基金支付托管费	165,709.48	264,440.79

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2016年12月31日的应付基金托管费为人民币13,646.73元(2015年12月31日：人民币16,740.10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  
基金管理人于本期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	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
中国民生银行	3,002,618.18	91,681.73

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，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  
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	上期 2015年1月1日至2015年12月31日
华泰证券	3,002,618.18	91,681.73

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
交易所市场交易费用	407,127.78	1,000,412.38
银行间市场交易费用	-	-
合计	407,127.78	1,000,412.38

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
应付券商交易保证金	-	-
应付赎回款	71.86	603.96
预提费用	130,000.00	240,000.00
合计	130,071.86	240,603.96

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
卖出股票成交总额	460,124,918.89	1,332,891,964.33
减：卖出股票成本总额	461,362,986.49	1,369,767,529.16
买卖股票差价收入	-1,238,067.60	63,124,435.17

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
股票投资产生的股利收益	224,462.01	443,568.02
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	224,462.01	443,568.02

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
1.交易性金融资产	-7,236,273.46	-169,468.96
—股票投资	-7,236,273.46	-169,468.96
—债券投资	-	-
—资产支持证券投资	-	-
—商品期货投资	-	-
—其他	-	-
2.衍生工具	-	-
—权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-7,236,273.46	-169,468.96

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	31,165.17	276,790.19
转换费收入	419.06	58,377.83
合计	31,584.23	335,168.02

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
交易所市场交易费用	1,369,269.12	3,961,090.81
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,369,269.12	3,961,090.81

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