

(上接B311版)

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元			
项目	本期末 2016年12月31日	上期末 2015年12月31日	
活期存款	261,027,688.09	63,266,186.63	
定期存款	--	--	
其中:存定期限1-3个月	--	--	
其他存款	--	--	
合计	261,027,688.09	63,266,186.63	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元			
项目	成本	2016年12月31日 公允价值	公允价值变动
股票	280,180,186.26	271,773,088.49	-19,027,188.77
贵金属投资-金交所黄金合约	--	--	--
交易性金融资产	--	--	--
债券	--	--	--
银行间市场	--	--	--
合计	--	--	--
资产支持证券	--	--	--
基金	--	--	--
其他	--	--	--
合计	280,180,186.26	271,773,088.49	-19,027,188.77

项目	成本	2016年12月31日 公允价值	公允价值变动
股票	280,180,181.91	310,712,185.61	17,791,166.42
贵金属投资-金交所黄金合约	--	--	--
交易性金融资产	--	--	--
债券	--	--	--
银行间市场	--	--	--
合计	--	--	--
资产支持证券	--	--	--
基金	--	--	--
其他	--	--	--
合计	280,180,181.91	310,712,185.61	17,791,166.42

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
 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所取得的债券
 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	上期末 2015年12月31日	
应收债券利息	5,615.13	13,460.34	
应收中期票据利息	--	--	
应收其他利息	--	--	
应收债券付息利息	1,829.64	663.91	
应收债券息	--	--	
应收买入返售证券利息	--	--	
应收中期票据利息	--	--	
应收资金合约清算利息	323.40	934.69	
其他	--	--	
合计	7,767.17	16,338.01	

注:其他为应收权证保证金利息。

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	上期末 2015年12月31日	
交易所市场应付交易费用	1,774,000.16	1,151,180.62	
银行间市场应付交易费用	--	--	
合计	1,774,000.16	1,151,180.62	

7.4.7.8 其他负债

单位:人民币元			
项目	本期末 2016年12月31日	上期末 2015年12月31日	
应付赎回费	1,264.72	2,794.62	
应付赎回款	--	--	
应付赎回款	340,000.00	440,000.00	
其他	141,264.77	442,794.62	
合计	482,529.49	885,589.24	

7.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元			
项目	2016年1月1日至2016年12月31日 基金份额(份)	2016年12月31日 基金份额(份)	2015年12月31日 基金份额(份)
上年度末	317,184,201.22	317,184,201.22	317,184,201.22
本期申购(以“+”填列)	108,492,215.27	108,492,215.27	--
本期赎回(以“-”填列)	-141,032,688.29	-141,032,688.29	--
基金拆分/份额折算变动额	--	--	--
基金拆分/份额折算变动额	--	--	--
本期申购(以“+”填列)	--	--	--
本期赎回(以“-”填列)	--	--	--
本期末	284,643,728.20	284,643,728.20	317,184,201.22

注:申购含红利再投及转换入份额,赎回含转换出份额。

7.4.10 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	89,473,080.18	-13,962,787.10	67,050,303.08
本期净利润	-19,406,880.33	-36,319,462.19	-54,866,332.62
本期公允价值变动损益	-6,462,583.36	1,900,491.87	-3,761,711.39
其中:基金申购款	16,596,341.91	-17,676,520.89	-1,082,178.98
基金赎回款	-22,248,926.17	19,479,382.76	-2,669,523.41
本期已分配利润	--	--	--
本期末	56,163,426.56	-48,181,367.42	8,402,289.17

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	上期 2015年1月1日至2015年12月31日	
活期存款利息收入	300,799.04	962,379.03	
定期存款利息收入	--	--	
其他存款利息收入	--	--	
其他货币资金利息收入	40,576.78	202,313.80	
其他	16,620.92	63,710.96	
合计	358,006.62	1,168,393.80	

注:其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

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	
卖出股票成交总额	-2,797,186,326.05	8,433,866,968.00	
减:卖出股票成本总额	-2,804,211,048.04	8,297,422,987.85	
公允价值变动损益	-7,075,318.89	366,833,981.21	

7.4.7.13 债券投资收益
 本基金于本期及上年度可比期间均无债券投资收益。

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

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	
投资收益产生的股利收益	1,289,148.43	2,542,160.00	
基金投资产生的股利收益	--	--	
合计	1,289,148.43	2,542,160.00	

7.4.7.17 公允价值变动收益

项目名称	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	
1.交易性金融资产	-36,319,462.19	-2,389,189.66	
—股票投资	-36,319,462.19	-2,389,189.66	
—债券投资	--	--	
—资产支持证券投资	--	--	
—贵金属投资	--	--	
—其他	--	--	
2.衍生工具	--	--	
—公允价值变动	--	--	
3.其他	--	--	
合计	-36,319,462.19	-2,389,189.66	

7.4.7.18 其他收入

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	
基金赎回费收入	482,529.49	8,796,038.93	
转融通费收入	9,356.04	980,224.96	
合计	471,185.04	9,776,263.89	

7.4.7.19 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	上期 2015年1月1日至2015年12月31日	
交易所市场交易费用	7,329,186.24	21,488,146.89	
银行间市场交易费用	--	--	
合计	7,329,186.24	21,488,146.89	

7.4.7.20 其他费用

单位:人民币元			
项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上期 2015年1月1日至2015年12月31日	
审计费用	40,000.00	50,000.00	
信息披露费	150,000.00	30,000.00	
投资者服务费用	18,000.00	7,500.00	
其他费用	--	400.00	
合计	158,000.00	447,500.00	

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、基金服务机构
平安银行	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、基金营销机构
民生证券股份有限公司	基金管理人的股东
民生财富有限责任公司	基金管理人的子公司
民生证券资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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 应付关联方的佣金

本基金于本期末及上年度末均无应付关联方的佣金。

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	上期 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	4,867,152.46	11,466,182.64
其中:支付销售机构的客户维护费	1,193,124.43	3,754,136.26

注:1)基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基础资产净值的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为前一日的基础资产净值

2)于2016年12月31日的应付基金管理费为人民币383,934.23元(2015年12月31日:人民币506,291.59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	上期 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	813,139.23	1,944,448.76

注:1)基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基础资产净值的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为前一日的基础资产净值

2)于2016年12月31日的应付基金托管费为人民币63,989.02元(2015年12月31日:人民币84,215.25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

本基金本期及上年度可比期间内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
 本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

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	2016年1月1日至2016年12月31日 期末余额	2015年1月1日至2015年12月31日 期末余额	当期利息收入
平安银行	20,527,589.91	300,799.04	63,266,186.63

注:本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.9.6 本基金在承销期间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间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 期末及 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

74.9A.11 受限证券类别:股票										
证券代码	证券简称	成功认购日	可流向日	流通受限类别	认购数量	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601376	中国平安	2016年12月30日	2017年1月1日	新股上市	400	400	26,496	106,790.00	106,790.00	-
603077	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月1日	新股上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300582	隆华新材	2016年12月29日	2017年1月1日	新股上市	40.29	40.29	1,582	63,726.78	63,726.78	-
603689	航天晨光	2016年12月30日	2017年1月1日	新股上市	7.97	7.97	4,819	37,926.53	37,926.53	-
603228	新晨科技	2016年12月29日	2017年1月1日	新股上市	23.16	23.16	1,267	29,112.12	29,112.12	-
603038	富荣环保	2016年12月27日	2017年1月1日	新股上市	10.44	10.44	2,316	24,176.04	24,176.04	-
603206	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月1日	新股上市	14.63	14.63	1,562	22,862.06	22,862.06	-
300567	天沃科技	2016年12月29日	2017年1月1日	新股上市	14.11	14.11	1,430	20,250.18	20,250.18	-
002840	华锐股份	2016年12月30日	2017年1月1日	新股上市	636	636	1,814	11,881.70	11,881.70	-
003838	道恩股份	2016年12月29日	2017年1月1日	新股上市	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603198	华正新材	2016年12月29日	2017年1月1日	新股上市	5.37	5.37	1,074	10,063.38	10,063.38	-
603032	德棉股份	2016年12月29日	2017年1月1日	新股上市	5.81	5.81	1,628	9,468.68	9,468.68	-
300568	美都能源	2016年12月30日	2017年1月1日	新股上市	930	930	1,006	9,356.80	9,356.80	-
300691	万马钢	2016年12月30日	2017年1月1日	新股上市	307	307	2,396	7,266.72	7,266.72	-
300688	鼎胜新材	2016年12月27日	2017年1月1日	新股上市	494	494	1,380	6,817.20	6,817.20	-
002821	深美英	2016年11月18日	2017年1月11日	新股锁定	3053	143.49	21,409	663,616.77	3,071,977.41	-
603822	百合花	2016年12月29日	2017年1月1日	新股锁定	10,601	32.74	36,764	389,686.40	1,203,663.36	-
603960	苏州利达	2016年12月29日	2017年1月1日	新股锁定	8,031	32.22	26,007	308,836.21	857,945.64	-