鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016年12月31日
基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2017年3月30日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了"标准无保留意见"的审计报告。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华互联网分级
场内简称	互联网
基金主代码	160636
相关交易代码	-
场内交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月16日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	177,366,564.99份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015年6月26日

下属分级基金的简称及代码	鹏华互联网分级	互联A	互联B
下属分级基金的场内简称	互联网	互联A	互联B
下属分级基金的交易代码	160636	150245	150246
报告期末下属分级基金份额总额	157,039,662.99份	10,163,451.00份	10,163,451.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法,按照成份股和新股市场的基准权重和建指数化投资组合,并根据标的指数成份股发生权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因其他特殊情况导致被动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。 本基金力争鹏华精选银行基础上,各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库,基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合;4.产格执行投资授权制度,明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分,合理确定基金经理的投资权限,超过投资权限的操作,应严格履行审批程序。在交易执行环节:1.所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成,集中交易室负责建立和执行交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;2.针对交易所公开竞价交易,集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序,交易系统则自动启用公平交易功能,由系统按照"未委托数量"的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配;如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易,且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时,交易系统自动按照"价格优先"原则进行委托;当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时,则交易系统自动按照"同一指令价格下的公平交易"模式,进行公平委托和交易量分配;3.银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行;银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易,各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4.新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行,对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节:1.为加强对日常投资交易行为的监控和管理,杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为,防范日常交易风险,公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制;所监控的交易包括但不限于:交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等;2.将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容,发现的异常情况由投资监察员进行分析;3.监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》,内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析;《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。	
	4.3.2 公平交易制度的执行情况 报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。同时,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析,未发现存在违反公平交易原则的现象。 4.3.3 异常交易行为的专项说明 报告期内,本基金未发生违法规且并对基金财产造成损失的异常交易行为。 本报告期内本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4次,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。 4.4 管理人对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析 本基金寒承指数基金的投资策略,在应对基金申购赎回的基础上,力争跟踪指数的收益,并将基金跟踪误差控制在合理范围内。 4.4.2 报告期内基金的业绩表现 报告期末,本基金份额净值为1.0200元,累计净值0.6350元;本报告期基金份额净值增长率为-24.52%,同期业绩比较基准收益率为-26.38%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 2016年国内、外资本市场跌宕起伏,"黑天鹅"事件频发。熔断、英国脱欧、美国大选以及保险举牌新规、债券市场流动性冲击等事件,均造成市场的短期的剧烈波动。对于A股市场,供给侧改革、环保压力并轨加需求刺激需求的经济"滞胀"成为贯穿全年投资逻辑。全年来看,以周期股和消费股为代表的价值股获得显著超额收益,而以创业板为代表的成长股受制于高估值压力,全年表现较为羸弱。 展望2017年,国内的政策基调相对确定;一方面2016年7月份中央政治局工作会议提出的"抑制资产泡沫"将贯穿2017年全年;另一方面,央行通过收紧流动性来降低金融体系的杠杆,防范金融风险,实现资金脱虚向实。而海外经济环境则面临巨大的不确定性,尤其是美国新任总统特朗普上台后,所带来的美国经济政策不确定性,将可能通过通胀和人民币汇率等两方面对国内经济带来挑战。 对于A股而言,我们认为2015年下半年以来,市场的调整已经比较充分,考虑到国内经济复苏的惯性以及供给侧改革的持续推进,对周期股走出牛熊市的趋势有较强的支撑,A股再次出现系统性风险的可能性较低,全年大概率维持区间震荡的格局,投资机会更多以结构性行情展开。盈利稳定、业绩较为确定且估值合理的价值股,以及估值与业绩增速较为匹配的成长股将有望在全年获得较好的投资回报。 本基金将积极应对各种因素指数跟踪效果带来的冲击,本基金将积极应对各种因素指数跟踪效果带来的冲击,努力使得跟踪误差控制在基金合同规定的范围内,力争为投资者带来超越指数收益回报。 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 1.有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述 (1)日常估值流程 基金的估值由基金会计负责,基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体,独立建账、独立核算,保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理;每日按时接收成交数据及权益数据,进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式,每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对;每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外,还设有基金会计复核岗位,负责基金会计核算的日常事后复核工作,确保基金净值核算无误。 配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格,在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验,熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。 (2)特殊业务估值流程 根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定,本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组,成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。 2.基金经理参与或决定估值的程度 基金经理不参与或决定基金日常估值。 基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论,发表相关意见和建议,与估值小组成员共同商定估值原则和政策。 3.本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。 4.本公司现没有进行任何定价服务的签约。 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 根据本基金基金合同约定,在存续期内,本基金(包括鹏华互联网分级份额、鹏华互联A份额、鹏华互联B份额)不进行收益分配。 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 无。	
	§5 托管人报告 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。 报告期内,本基金未实施利润分配。 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 §6 审计报告 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了"标准无保留意见"的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。 §7 年度财务报表 7.1 资产负债表 会计主体:鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金 报告截止日:2016年12月31日 单位:人民币元 资产 / 附注号 / 本期末 2016年12月31日 / 上年度末 2015年12月31日 资产: 银行存款 / 10,931,314.83 / 16,864,878.49 结算备付金 / 84,928.41 / 830,196.07 存出保证金 / 19,808.20 / 540,002.12 交易性金融资产 / 171,130,605.61 / 286,557,377.72 其中:股票投资 / 171,130,605.61 / 286,557,377.72 基金投资 / - / - 债券投资 / - / - 资产支持证券投资 / - / - 贵金属投资 / - / - 衍生金融资产 / - / - 买入返售金融资产 / - / - 应收证券清算款 / - / 77,828.19 应收利息 / 2,490.07 / 3,959.12 应收股利 / - / - 应收申购款 / 35,577.49 / 599,510.08 递延所得税资产 / - / - 其他资产 / - / - 资产合计 / 182,204,724.61 / 305,473,751.79 负债和所有者权益 / 附注号 / 本期末 2016年12月31日 / 上年度末 2015年12月31日 负债: 短期借款 / - / - 交易性金融负债 / - / - 衍生金融负债 / - / - 卖出回购金融资产款 / - / - 应付证券清算款 / 398,355.96 / - 应付赎回款 / 82,203.19 / 1,467,864.58 应付管理人报酬 / 160,802.82 / 270,598.69 应付托管费 / 35,376.63 / 59,531.69 应付销售服务费 / - / - 应付交易费用 / 82,561.82 / 388,054.65 应交税费 / - / - 应付利息 / - / - 递延所得税负债 / - / - 其他负债 / 510,217.49 / 255,498.46 负债合计 / 1,289,555.91 / 2,441,568.07 所有者权益: 实收基金 / 285,312,741.81 / 360,751,758.21 未分配利润 / -104,377,572.91 / -57,719,574.49 所有者权益合计 / 180,935,168.90 / 303,032,183.72 负债和所有者权益总计 / 182,204,724.61 / 305,473,751.79 注:报告截止日2016年12月31日,鹏华互联网分级份额净值1.020元,鹏华互联A份额净值1.008元,鹏华互联B份额净值1.032元;基金份额总额177,366,564.99份,其中鹏华互联网分级份额157,039,662.99份,鹏华互联A份额10,163,451.00份,鹏华互联B份额10,163,451.00份。 7.2 利润表 会计主体:鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金 本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日 单位:人民币元 项目 / 附注号 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 / 上年度可比期间 2015年6月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日 一、收入 / -67,517,905.59 / -95,758,126.54 1.利息收入 / 104,822.76 / 352,633.76 其中:存款利息收入 / 104,822.76 / 352,633.76 债券利息收入 / - / - 资产支持证券利息收入 / - / - 买入返售金融资产收入 / - / - 其他利息收入 / - / - 2.投资收益(损失以"-"填列) / -15,791,498.38 / -130,168,522.13 其中:股票投资收益 / -16,735,190.64 / -130,272,909.96 基金投资收益 / - / - 债券投资收益 / - / - 资产支持证券投资收益 / - / - 贵金属投资收益 / - / - 衍生金融收益 / - / - 买入返售金融资产 / - / - 股利收益 / 953,692.26 / 104,387.83 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) / -52,080,301.13 / 33,128,214.24 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) / - / - 5.其他收入(损失以"-"号填列) / 238,071.16 / 929,547.59 减:二、费用 / 4,067,217.18 / 5,644,738.19 1.管理人报酬 / 7.4.8.2.1 / 2,148,145.20 / 1,747,386.20 2.托管费 / 7.4.8.2.2 / 472,591.50 / 384,425.01 3.销售服务费 / 7.4.8.2.3 / - / - 4.交易费用 / 826,909.72 / 3,131,976.57 5.利息支出 / - / - 其中:卖出回购金融资产支出 / - / - 6.其他费用 / 619,570.36 / 380,950.41 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) / -71,585,122.77 / -101,402,864.73 减:所得税费用 / - / - 四、净利润(净亏损以"-"号填列) / -71,585,122.77 / -101,402,864.73 7.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金 本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 / 实收基金 / 未分配利润 / 所有者权益合计 一、期初所有者权益(基金净值) / 360,751,758.21 / -57,719,574.49 / 303,032,183.72 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) / - / -71,585,122.77 / -71,585,122.77 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) / -75,439,016.40 / 24,927,124.35 / -50,511,892.05 其中:1.基金申购款 / 226,461,436.12 / -77,590,683.39 / 148,870,752.73 2.基金赎回款 / -301,900,452.52 / 102,517,807.74 / -199,382,644.78 四、本期末所有者权益(基金净值) / 285,312,741.81 / -104,377,572.91 / 180,935,168.90 上年度可比期间 2015年6月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日 项目 / 实收基金 / 未分配利润 / 所有者权益合计 一、期初所有者权益(基金净值) / 608,267,834.97 / - / 608,267,834.97 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) / - / -101,402,864.73 / -101,402,864.73 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) / -247,516,076.76 / 43,683,290.24 / -203,832,786.52 其中:1.基金申购款 / 660,598,386.22 / -122,426,165.87 / 538,172,220.35 2.基金赎回款 / -908,114,462.98 / 166,109,456.11 / -742,005,006.87 四、本期末所有者权益(基金净值) / 360,751,758.21 / -57,719,574.49 / 303,032,183.72 注:报告期末基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4次,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。	
	4.2 管理人直接投资本基金的声明 本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 4.2.1 基金经理(或基金经理小组)持有本开放式基金情况 单位:份 姓名 / 期初持有的基金份额 / 申购份额 / 赎回份额 / 持有的基金份额 王咏辉 / 0 / 0 / 0 / 0 本报告期内,基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 本报告期内,基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.3 发起式基金信息 发起式基金的名称 / 鹏华互联网分级 发起式基金的类型 / 契约型开放式 发起式基金的生效日 / 2015年6月16日 发起式基金的到期日 / 不定期 发起式基金的到期日的后续安排 / 基金合同生效满三年后,若基金资产净值低于2亿元,则基金合同自动终止,并按照基金合同有关约定进行基金财产的清算。 发起式基金的资产配置情况 / 本基金为指数基金,为了有效地跟踪标的指数,本基金将投资于标的指数成分股及其备选成分股的股票资产不低于基金资产净值的80%,其中,投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产不低于股票资产的90%,投资于其他股票、债券、现金等资产的比例不超过基金资产净值的20%,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%。 4.4 报告期内,发起式基金持有份额发生重大变动的情况 报告期内,发起式基金持有份额未发生重大变动。 4.5 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.6 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.7 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.8 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.9 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.10 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.11 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.12 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.13 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.14 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.15 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.16 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.17 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.18 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.19 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.20 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.21 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.22 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.23 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.24 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.25 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.26 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.27 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.28 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.29 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.30 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.31 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.32 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.33 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.34 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.35 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.36 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.37 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.38 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.39 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.40 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.41 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.42 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.43 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.44 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.45 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.46 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.47 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.48 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.49 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.50 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.51 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.52 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.53 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.54 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.55 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.56 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.57 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.58 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.59 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.60 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.61 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.62 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.63 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.64 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.65 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.66 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.67 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.68 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.69 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.70 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.71 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.72 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.73 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.74 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.75 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.76 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.77 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.78 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.79 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.80 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.81 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.82 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.83 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.84 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.85 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.86 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.87 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.88 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.89 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.90 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.91 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.92 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.93 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.94 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.95 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.96 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.97 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用情况 单位:人民币元 项目 / 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 交易费用 / 0 4.98 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金的风险收益情况 报告期内,发起式基金管理人运用固有资金投资本基金未发生损失。 4.99 报告期内,发起式基金管理人运用固