

747H 金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

747H5 生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

747H6 利息收益

单位：人民币元

项目	2017年01月01日至2017年09月30日	2016年01月01日至2016年09月30日
	基金合同生效以来前次报告期末	基金合同生效以来前次报告期末
股票投资产生的投资收益	761,612.16	489.56
基金投资产生的投资收益	-	-
合计	761,612.16	489.56

747H7 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	2017年01月01日至2017年09月30日	2016年01月01日至2016年09月30日
公允价值变动收益	-	-

项目	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日止 (期间费用)	2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日止
流动资产	1.交易性金融资产	9,987,807.77
	——股票投资	2,789,098.00
	——债券投资	-4,000,823.04
	——资产支持证券投资	-
	——基金投资	-
	——贵金属投资	-
	——其他	-
	2.衍生工具	-
	——权证投资	-
	3.其他	-
合计	9,987,807.77	-10,970,564.95

1426 其他收入		单位:人民币元	
项目	2017年01月01日至2017年09月09日 (基金合同生效期间)	2016年01月01日至2016年12月31日	上年度可比期间
基金赎回费收入	52,91646	4,76179	
利息收入	1858	-	
合计	52,93504	4,76179	
7479 交易费用		单位:人民币元	
项目	2017年01月01日至2017年10月09日 (基金合同生效期间)	2016年01月01日至2016年12月31日	上年度可比期间
交易所证券交易费用	1,261,26143	108,22356	
银行间债券交易费用	6,22800	4,11252	

合计	1,298,488.43	112,638.01
7470 其他负债		单位:人民币元
项目	2017年10月01日至2017年10月09日 (合并当期发生额)	2016年10月01日至2016年12月31日 (上年年末余额)
应付工资	42,499.78	55,000.00
应付福利费	198,163.92	93,000.00
应付手续费	24,595.08	7,743.83
应付客户维护费	27,270.00	36,300.00
应付货款	20,820.00	
合计	223,415.78	193,043.83

748 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7481 或有事项

360	7462 资产减值准备科目		
360	资产减值准备科目包括存货跌价准备(以下简称“存货减值准备”)、基金合同违约金(即 2019 年 8 月 6 日以前持有的基金份额持有人未支付的赎回款项)、应收股利减值准备、其他应收款减值准备、长期股权投资减值准备、固定资产减值准备、无形资产减值准备、商誉减值准备、递延所得税资产减值准备、其他资产减值准备(即 2019 年 8 月 6 日以前持有的基金份额持有人未支付的赎回款项、第一个保本周期结束后第二个保本周期赎回日(即 2019 年 9 月 25 日)起进入下一个保本周期、第二个保本周期赎回日(即 2019 年 9 月 25 日)起,由于第二个保本周期结束后,本基金合同未约定有本基金存续条件,按照《基金元耀安和定期开放证券投资基金运作基金合同》的约定,经中国证监会核准,本基金合同终止,本基金合同终止后本基金资产扣除基金费用、基金合同相关费用及为完成赎回款项支付而发生的费用后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配)		
366	资产减值准备科目包括坏账准备		
366	金融资产转移被禁止后,除上述事项及 7462 减值损失披露的事项外,本基金无其他需要披露的资产减值损失科目		
366	749 关联方关系		
366		关联方名称	与基金的关系
366	基金管理人基金管理人	基金管理人	基金管理人,基金管理人关联方,基金服务机构
366	基金托管人基金托管人	基金托管人	基金托管人,基金服务机构
366	基金销售机构基金销售机构	基金销售机构	基金销售机构,基金服务机构
366	基金注册登记机构基金注册登记机构	基金注册登记机构	基金注册登记机构,基金服务机构

591	上海海金贵金属股份有限公司	本公司管理人股东	
592	上海金汇资产管理股份有限公司	本公司管理人子公司	
-	740 本报告期及上年度可比期间的关联方交易		
-	741 以上关联方交易单行进行列示		
-	741.1 货币资金		
-	本公司本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单行进行股票交易。		
603	741.2 证券交易		
-	本公司本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单行进行权证交易。		
-	741.3 应收关联方款项		
-	本公司本报告期及上年度可比期间无应收关联方款项。		
-	741.4 预付账款		
-			金额单位：人民币元
367			
368			
369			
370			
371			
372			
373			
374			
375			
376			
377			
378			
379			
380			
381			
382			
383			
384			
385			
386			
387			
388			
389			
390			
391			
392			
393			
394			
395			
396			
397			
398			
399			
400			
401			
402			
403			
404			
405			
406			
407			
408			
409			
410			
411			
412			
413			
414			
415			
416			
417			
418			
419			
420			
421			
422			
423			
424			
425			
426			
427			
428			
429			
430			
431			
432			
433			
434			
435			
436			
437			
438			
439			
440			
441			
442			
443			
444			
445			
446			
447			
448			
449			
450			
451			
452			
453			
454			
455			
456			
457			
458			
459			
460			
461			
462			
463			
464			
465			
466			
467			
468			
469			
470			
471			
472			
473			
474			
475			
476			
477			
478			
479			
480			
481			
482			
483			

	金元证券股份有限公司	46,464,021.93	80.94%		
	741615 证券回购交易				
	本金在合同到期及上年度可预期期间向关联方交易单元进行借券回购交易。				
	74162 关联方交易				
	741621 基金管理费				

单位:人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2017年01月01日至2017年10月31日 (货币资金余额)	2016年01月01日至2016年12月31日		
当期发生的基金支付的管理费	2,855,068.06	1,574,228.78		
其中:支付给基金管理人的管理费	37,497.38	73,752.89		

注:

基金投资管理费=【期末基金资产净值×0.007%】÷当年天数。

其中:支付给基金管理人的管理费=【期末基金资产净值×0.007%】÷当年天数。

M4每季应计提的基金托管费			
M4每一日计提的基金托管费			
M4每一日计提的基金托管费，按托管人、由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次日首起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、公休日，则顺延至下一个工作日。			
74.022 基金托管费		单位：人民币元	
项目	2017年01月01日至2017年10月09日 (基金合同生效日至本报告期末)	2016年01月01日至2016年12月31日	上年度可比期间
当期发生的基金应支付的基金托管费	688,783.05	282,374.41	
注：			
基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。			
计算方式为：			
H ₀ ×0.20%÷当年天数			
M4每日应计提的基金托管费			

6.97	5月-6月基金资产净值。				
6.98	基金托管人报告期内，由基金管理人或基金托管人发送基金托管资料清单，基金托管人复核并于次月首日起3个工作日内向基金管理人提供一次书面复核资料清单，逐条说明并签字、盖章、注明日期。				
6.99	7403 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。				
7.00	7404 与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。				
7.01	7405 与关联方进行债券正回购交易。				
7.02	7406 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。				

份额单位:份				
项目	2017年1月1日至2017年10月09日基金合同生效(截止)	2017年1月1日至2016年12月31日	上年度末(截止)	2016年1月1日至2015年12月31日
A类份额	C类份额	A类份额	C类份额	
期初基金份额余额	9,798,474.93	-	9,798,474.93	9,798,474.93
期间申购/赎回总份额	-	-	-	-
期末基金份额余额	9,798,474.93	-	9,798,474.93	9,798,474.93

4301	基金：期间赎回（基金赎回）	9,789,874.55	-	-
4302	基金赎回获得的基金份额	-	-	9,789,874.55
4303	期末持有的基金份额投资基金的基金公允价值	-	-	259%
4304	基金：			
4305	期间申购/买入基金份额含红利再投、转换申购费、期间赎回/卖出基金份额含赎回费。			
7402	报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况			
7403	本报告期内，本基金未发生基金管理人之外的其他关联方投资本基金。			
7405	以美元计量的银行存款余额及相关的货币兑换的列报人			

单位：人民币元

关联方名称	2017年01月01日至2017年09月30日止会计期间		2016年01月01日至2016年12月31日止会计期间	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

[illegible][illegible][illegible]

					单位：人民币元
	短期信用评级列示的债券投资	基金资产		(占基金总资产比例)	
		2017年10月31日	-	2016年12月31日	-
A-1	-	-	-	28,692,000	-
A-以下	-	-	-	-	-
合计	-	162,395,000	-	29,886,000	-
B+级	-	-	-	-	-
合计	-	162,395,000	-	59,980,000	-
注：					
①	非信用等级包括国债、央行票据、中央银行票据、政策性金融债和超短期融资券。				
	74.22%短中期信用债评级列示的债券信息表				
					单位：人民币元

682	长期待摊费用	基本盘 2017年12月31日余额	4,978,896.00	2016年12月31日	29,331,168.00
AAA					23,330,168.00
AAA以下			34,948.00		135,088,515.30
非控股			-		22,125,693.20
合计			4,114,838.00		186,564,377.10
注:	长租公寓包含轻资产、联营合作、中央银行票据及政策性金融融资。 7453(下转 820 页)				
流动性风险是指金融资产工具变现的难易程度。本基金的投资性房地产一方面来自于基金自有而后可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。					
7453(下转 820 页)	(下转 820 页)				