

(上接841版)

747 关联方关系

关联方名称	与本公司的关系
建信基金管理有限责任公司(“建信基金”)	基金管理人,注册登记机构,基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人,基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金管理人的股东,基金销售机构
美国安信金融公司	基金管理人的股东
中航信托股份有限公司	基金管理人的股东
建信基金管理有限公司	基金管理人的子公司
布朗兄弟哈里曼公司(Brown Brothers Harriman & Co.)	境外托管代理人
信安环球投资有限公司(Principia Global Investors, LLC)(“信安环球”)	境外投资顾问

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

748 本报告期及上年度可比期间的关联交易

7481 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7482 关联方报酬

74821 基金管理费

项目	本期	上期
2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	1,338,344.67	1,127,728.85
其中:支付托管费的客户净值	378,448.97	311,246.52

注:支付基金管理人和基金托管人的管理人报酬及托管费的基金资产净值 103%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的管理人报酬,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值×103%/(当年天数)

74822 基金托管费

项目	本期	上期
2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	258,285.15	219,280.24

支付基金管理人和基金托管人的托管费按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 0.35%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的托管费,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值×0.35%/(当年天数)

74823 基金销售服务费

无。

7483 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7484 各关联方对本基金的情况

74841 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	本期	上期
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日	
基金合同生效日(2016年1月21日)			
持有的基金余额	9,999,138.89	9,999,138.89	
期间申购金额	-	-	
期间赎回金额	-	-	
期间回购金额	-	-	
期间转入金额	-	-	
期间转出金额	-	-	
期末持有的基金余额	9,999,138.89	9,999,138.89	
基金总份额比例	143%	118%	

74842 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

无。

7485 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	上期度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
期末余额	2,635,047.73	17,109.59
当期利息收入	1,003,642.00	6,619.34
期末余额	4,452,776.56	24,823.14
当期利息收入	4,923,457.30	7,500.80

本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管,按定期利率计息。

7486 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7487 其他关联交易的说明

无。

7491 期末(2017年2月31日)本基金持有的流通受限证券

7492 申购/认购新发/增发证券而期未持有的流通受限证券

无。

7493 期末持有的停牌股票等流通受限股票

无。

74931 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

749311 银行间市场债券正回购

无。

74932 交易所市场债券正回购

无。

7494 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(2) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定;

第一次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二次:除第一次:最了解的输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(3) 继续的公允价值计量的金融工具

0 0 次公允价值公允价值

于2017年2月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为6,676,729.4元,无属于第二层次或第三层次的余额(2016年2月31日:第一层次6,052,547.47元,无第二层次或第三层次)。

(4) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(5) 三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(6) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年2月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016年2月31日:无)。

(7) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(8) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年2月21日颁布的财[2016]40号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品在2016年1月1日前运营中产生的增值税税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%征收率缴纳增值税。对资管产品在2016年1月1日前运营中产生的增值税税应税行为,未缴纳增值税的,已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金资产的比例(%)
1	股权投资	54,884,224.05	79.63
其中:普通股	44,380,203.33	64.40	
优先股	10,504,027.72	15.24	
债券	-	-	
贵金属	-	-	
2	基金投资	6,842,488.89	9.93
3	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	
资产支持证券	-	-	
4	金融衍生品投资	-	-
其中:远期	-	-	
5	买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,087,828.29	1.029
8	其他各项资产	95,534.68	0.14
9	合计	69,910,075.91	100.00

8.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	15,452,297.91	20.06
美国	12,271,826.60	18.31
韩国	10,797,417.03	16.11
泰国	4,714,787.77	7.04
泰国	3,275,771.70	4.89
白俄罗斯	2,510,215.57	3.75
巴西	2,117,108.62	3.25
美国	1,570,286.02	2.34
墨西哥	1,240,293.80	1.85
马来西亚	874,446.65	1.30
合计	54,884,224.05	81.89

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

74821 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

74822 关联方报酬

748221 基金管理费

项目	金额	单位:人民币元
2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	1,338,344.67	1,127,728.85
其中:支付托管费的客户净值	378,448.97	311,246.52

支付基金管理人和基金托管人的管理人报酬及托管费的基金资产净值 103%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的管理人报酬,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值×103%/(当年天数)

74823 基金托管费

项目	金额	单位:人民币元


<tbl