

(上接B937版)

金额单位:人民币元					
	本期末(2017年12月31日)	1年内	1-5年	5年以上	合计
关联方名称	2017年01月01日至2017年12月31日				
当期佣金	占当期佣金总额的比	期末应付佣金比例	当期应付佣金比例		
金元证券股份有限公司	68,530.04	71.0%	68,530.04	11.7%	
关联方名称	2016年01月01日至2016年12月31日				
当期佣金	占当期佣金总额的比	期末应付佣金比例	当期应付佣金比例		
金元证券股份有限公司	-	-	-	-	
注:					

上述佣金按市场佣金率计算,以账户由中国证券登记结算有限责任公司代收代管,经手续费和券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包含佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.14 债券交易
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.15 货币基金
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.16 关联方报账

7.4.10.21 基金管理费

金额单位:人民币元

项目	本期	2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间	2016年01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,626,721.80	421,781.62		1,723,323.23
其中:支付申购(赎回)费用的客户管理费	210,124.9			

注:

基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。

计算方法如下:H=E×1.5% ×当年天数,

H为每日应计提的基金管理费,

E为前一日的基金资产净值;

基金管理费每日计息,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日,休息日,支付日期顺延。

7.4.10.22 基金托管费

金额单位:人民币元

项目	本期	2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间	2016年01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	271,120.24	70,297.00		

注:

基金管理费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。

计算方法如下:H=E×0.25% ×当年天数,

H为每日应计提的基金托管费,

E为前一日的基金资产净值;

基金管理费每日计息,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日,休息日,支付日期顺延。

7.4.10.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

7.4.10.4各关联方投资本基金的情况

7.4.10.41 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.42 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

本基金报告期内除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

金额单位:人民币元

项目	本期末	2017年12月31日	上年度可比期间	2016年12月31日
当期发生的托管费	271,120.24	70,297.00		

注:

基金管理费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。

计算方法如下:H=E×0.25% ×当年天数,

H为每日应计提的基金管理费,

E为前一日的基金资产净值;

基金管理费每日计息,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日,休息日,支付日期顺延。

7.4.10.6在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.7利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.10.8期末持有的流通受限证券

7.4.10.9因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

项目	本期末	2017年12月31日	上年度可比期间	2016年12月31日
当期利息收入	0.00	0.00	0.00	0.00
利息收入	0.00	0.00	0.00	0.00
其他收入	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	131,326,060.30	9268	19,580,033.46	89.02

注:

本基金投资组合中股票资产比例为基金资产的60%-95%,其中,投资于新经济主题相关的上市公司股票的比例不低于本基金股票资产的80%;债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具占基金总资产的5%-40%,其中,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不高于基金资产净值的5%,权证不高于基金资产净值的3%,用于支付负债后,本基金面临的整体市场风格风险列示如下。

7.4.13.4.2其他价格风险的敏感性分析

本基金的市场价格波动受证券市场的系统性风险,由基金投资组合中股票的投资的贝塔系数

以下分析中,股市收益率是指上证综合指数的收益率,风险溢价是指股票的预期收益率减去无风险利率。

相关风险的变动对本基金资产净值的影响程度(单位:人民币元)

分析

7.4.13.4.3其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末	2017年12月31日	上年度可比期间	2016年12月31日
当期利息收入	0.00	0.00	0.00	0.00
利息收入	0.00	0.00	0.00	0.00
其他收入	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	131,326,060.30	9268	19,580,033.46	89.02

注:

本基金投资组合中股票资产比例为基金资产的60%-95%,其中,投资于新经济主题相关的上市公司股票的比例不低于本基金股票资产的80%;债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具占基金总资产的5%-40%,其中,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不高于基金资产净值的5%,权证不高于基金资产净值的3%,用于支付负债后,本基金面临的整体市场风格风险列示如下。

7.4.13.4.4风险价值(VaR)分析

风险价值(VaR)含义是指:在正常情况下,某一金融产品或证券

组合的最大可能损失。更为确切的是,指在一定概率水平(置信度)

下,某一金融产品或证券组合价值在未来特定时期内的最大可能损失。

用公式表示为:Prob(Ap)VaR=1- α 或Prob(Ap)VaR = α ,

其中Prob表示,资产价值损失小于或等于损失上限的概率,Ap表示

某一金融产品在一定持有期限Ap的资产价值损失率;VaR表示:给定置信水平Ap下的在险价值,即可能的损失上限; α :给定的置信水平。

在95%的置信水平下,本基金的VaR为-7,704,0006元,-1,107,70000元。

7.4.13.4.5风险价值(VaR)的敏感性分析

风险价值(VaR)的敏感性分析,上表为市场价格风险的敏感性分析,反映了在其变量不变的假设下,证券市场价格组合的价格发生变动、可能的变动时,将对基金资产净值产生影响的程度。

7.4.13.4.6风险价值(VaR)的稳定性分析

风险价值(VaR)的稳定性分析,上表为市场价格风险的稳定性分析,反映了在其变量不变的假设下,证券市场价格组合的稳定性。

7.4.13.4.7风险价值(VaR)的波动性分析

风险价值(VaR)的波动性分析,上表为市场价格风险的波动性分析,反映了在其变量不变的假设下,证券市场价格组合的波动性。

7.4.13.4.8风险价值(VaR)的期限敏感性分析

风险价值(VaR)的期限敏感性分析,上表为市场价格风险的期限敏感性分析,反映了在其变量不变的假设下,证券市场价格组合的期限敏感性。

7.4.13.4.9风险价值(VaR)的流动性敏感性分析

风险价值(VaR)的流动性敏感性分析,上表为市场价格风险的流动性敏感性分析,反映了在其变量不变的假设下,证券市场价格组合的流动性敏感性。

7.4.13.4.10风险价值(VaR)的信用风险敏感性分析

风险价值(VaR)的信用风险敏感性分析,上表为市场价格风险的信用风险敏感性分析,反映了在其变量不变的假设下,证券市场价格组合的信用风险敏感性。

7.4.13.4.11风险价值(VaR)的汇率风险敏感性分析

风险价值(VaR)的汇率风险敏感性分析,上表为市场价格风险的汇率风险敏感性分析,反映了在其变量不变的假设下,证券市场价格组合的汇率风险敏感性。

7.4.13.4.12风险价值(VaR)的利率风险敏感性分析

风险价值(VaR)的利率风险敏感性分析,上表为市场价格风险的利率风险敏感性分析,反映了在其变量不变的假设下,证券市场价格组合的利率风险敏感性。

7.4.13.4.13风险价值(VaR)的行业风险敏感性分析

风险价值(VaR)的行业风险敏感性分析,上表为市场价格风险的行业风险敏感性分析,反映了在其变量不变的假设下,证券市场价格组合的行业风险敏感性。

7.4.13.4.14风险价值(VaR)的地区风险敏感性分析

风险价值(VaR)的地区风险敏感性分析,上表为市场价格风险的地区风险敏感性分析,反映了在其变量不变的假设下,证券市场价格组合的地区风险敏感性。

7