

宝盈祥泰养老混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016年12月31日
基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示
基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

基金管理人承诺:遵守基金合同,恪守诚信,勤勉尽责,严格控制投资风险,保障基金份额持有人的合法权益。

4.4 报告期内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
报告期内,受益于前期持续宽松的货币政策和财政刺激措施,叠加供给侧改革因素,大宗商品价格上涨带动上游企业盈利,宏观经济整体逐步显现企稳态势。

4.4.2 报告期内基金业绩表现
本基金在本报告期内净值增长率为0.58%,同期业绩比较基准收益率为2.50%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2017年,我们将受益于前期宽松的货币政策,力度不断加大的财政刺激措施以及供给侧改革因素,宏观经济短期仍将呈现逐步企稳态势。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照新会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金持有的投资品种进行估值。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法律法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对于本基金持有人户数或基金份额净值预警情形的说明
本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

4.9 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.10 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.11 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.12 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.13 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.14 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.15 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.16 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.17 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.18 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.19 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.20 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.21 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.22 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.23 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.24 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.25 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.26 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.27 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.28 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.29 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.30 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.31 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.32 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.33 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.34 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.35 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.36 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.37 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.38 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.39 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.40 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.41 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.42 报告期内基金管理人、基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突,基金管理人参与决定本基金估值程序,本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2016年1月1日至2016年12月31日, 2015年12月31日, 2016年12月31日. Rows include 资产, 负债, 所有者权益, etc.

报表附注为财务报表的重要组成部分。
本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:
李义文 胡坤

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人
7.4 报表附注
7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
7.4.2.1 会计政策变更的说明

7.4.2.2 会计估计变更的说明
7.4.2.3 差错更正的说明

7.4.3 税项
根据财政部、国家税务总局财税[2004]7号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关政策法规和实务操作,主要税列示如下:

1.证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税或增值税。
2.对证券投资基金在证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入、股利、利息收入、债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3.对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到税款当年的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4.对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在从基金支付上述收入时扣代扣20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5.对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,受让方不再缴纳印花税。

6.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.4 关联方关系
关联方关系: 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构。

注:1.本基金本报告期内无存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。
2.下述关联交易均在正常业务范围外一般商业条款订立。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易
本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行交易(2015年度:无)。

7.4.5.2 关联方报酬
7.4.5.2.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2016年1月1日至2016年12月31日, 2015年12月31日. Rows include 基金管理费, 基金托管费, etc.

注:基金托管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×1.20%÷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

7.4.5.2.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2016年1月1日至2016年12月31日, 2015年12月31日. Rows include 基金托管费, etc.

注:基金托管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

7.4.5.2.3 销售服务费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2016年1月1日至2016年12月31日, 2015年12月31日. Rows include 销售服务费, etc.

7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易
单位:人民币元

Table with columns: 品种, 2016年1月1日至2016年12月31日, 2015年12月31日. Rows include 回购, etc.

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管,按银行约定利率或约定利率计息。
7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券(2015年度:无)。

7.4.5.7 其他关联交易事项的说明
本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项(2015年度:无)。

7.4.6 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
单位:人民币元

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 停牌日期, 停牌原因, 数量(股), 公允价值, 估值调整金额. Rows include 300881, 000706, etc.

7.4.6.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事债券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
单位:人民币元

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 停牌日期, 停牌原因, 数量(股), 公允价值, 估值调整金额. Rows include 300881, 000706, etc.

7.4.6.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(2015年12月31日:无)。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2016年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券(20