

(上接 D212 版) 注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

项目 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 上期可比期间 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日

注:支付基金管理人国信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

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。

(2)增值税 根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140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,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]156号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

上述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。

(3)除公允价值计量的金融资产和负债外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

8.1 投资组合报告 8.1.1 期末基金资产组合情况 金额单位:人民币元

序号 项目 金额 占基金总资产的比例(%)

8.2 期末按行业分类的股票投资组合 注:本基金本报告期末未持有沪港通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号 项目 金额 占基金总资产的比例(%)

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资明细

8.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名期权投资明细

8.12 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超过基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.13 本基金投资的前十名债券中,不存在投资于超过基金合同规定备选债券库之外的债券。

8.14 本基金投资的前十名资产支持证券中,不存在投资于超过基金合同规定备选资产支持证券库之外的资产支持证券。

8.15 本基金投资的前十名权证中,不存在投资于超过基金合同规定备选权证库之外的权证。

8.16 本基金投资的前十名贵金属中,不存在投资于超过基金合同规定备选贵金属库之外的贵金属。

8.17 本基金投资的前十名期货中,不存在投资于超过基金合同规定备选期货库之外的期货。

8.18 本基金投资的前十名期权中,不存在投资于超过基金合同规定备选期权库之外的期权。

8.19 本基金投资的前十名衍生品中,不存在投资于超过基金合同规定备选衍生品库之外的衍生品。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额 单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额 1,107,513,366.06

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 金额单位:人民币元

序号 债券代码 债券名称 公允价值 占基金资产净值比例(%)

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

注:根据基金合同约定,本基金不参与与贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:根据基金合同约定,本基金不参与与股指期货投资。

8.11 本期股指期货投资情况 注:根据基金合同约定,本基金不参与与股指期货投资。

8.12 本期权证投资情况 注:根据基金合同约定,本基金不参与与权证投资。

8.13 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资明细

8.14 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名期权投资明细

8.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细

8.16 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细

8.17 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细

8.18 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细

8.19 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细

8.20 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细

8.21 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细

8.22 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细

8.23 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细

8.24 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细

8.25 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细

8.26 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细

8.27 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细

8.28 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细

8.29 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细

8.30 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细

8.31 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细

8.32 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细

8.33 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细

8.10 开放式基金份额变动 单位:份

基金合同生效日(2016年7月27日)基金份额总额 926,628,850.45

8.11 重大事件揭示 11.1 基金份额持有人大会决议 报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 本报告期内,基金管理人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 本报告期内,基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变 本报告期内,基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 本报告期内基金管理人、托管人、托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

券商名称 交易单元数量 成交金额 占当期股票成交总额的比...

注:1.本报告期内基金新增27个证券公司交易单元,分别为兴业证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、上海证券股份有限公...

注:2.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:3.基金选择证券公司交易单元的选择程序如下: (1)本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:4.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:5.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:6.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:7.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:8.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:9.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:10.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:11.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:12.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:13.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:14.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:15.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:16.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:17.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:18.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:19.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:20.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:21.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。

注:22.本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选择交易单元的证券经纪机构。