

(上接 D218 版) 对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括连续停牌)或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值所属第二层次还是第三层次。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具 于2017年12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12月31日:同)。(d)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。

(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。

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 关联方名称, 2017年12月31日, 2016年12月31日

Table with 4 columns: 债券代码, 债券名称, 期初公允价值, 期末公允价值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 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:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 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:本基金本报告期末未持有贵金属。 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

注:本基金本报告期末未持有权证。 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

本报告期内,本基金投资策略未改变。

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)