

(上接 D354 版) 本基金的银行存款由基金托管人保管,按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 无

7.4.5 期末(2017 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券 7.4.5.1 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

Table with 10 columns: 证券代码, 证券名称, 可流通日期, 限售类型, 认购价格, 期末估值, 数量(张), 期末估值总额, 备注

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 无

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 无

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购 无

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购 无

7.4.6 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

(1)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,其账面价值接近于公允价值。

(2)以公允价值计量的金融工具 金融工具公允价值计量的方法 本基金以公允价值计量后续计量的金融资产与金融负债,其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性,被划分为三个层次:

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

2.除公允价值外,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 期末基金资产组合情况 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 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 8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

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

(上接 D356 版) 本基金的银行存款由基金托管人保管,按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 无

7.4.5 期末(2017 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券 无

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 无

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 无

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 7,262,749.11 元,是以如下债券作为质押:

Table with 6 columns: 债券代码, 债券名称, 回购到期日, 期末估值价值, 数量(张), 期末估值总额

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购 无

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

1.确定金融工具所属的公允价值层次的方法 在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次;第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

2.各层次金融工具公允价值 于 2017 年 12 月 31 日本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为人民币 29,791,235.86 元(2016 年 12 月 31 日:属于第二层的余额为人民币 169,792,532.84 元),无属于第一层次及第三层次的余额。

3.公允价值所属层次间的重大变动 本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具公允价值层次之间转换的时点,本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具,在第一层次和第二层次之间无重大转移(上年度:无)。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况(上年度:无)。

8.2 投资组合报告 8.1 期末基金资产组合情况 金额单位:人民币元

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

8.2.1 期末按行业分类的股票投资组合 8.2.1.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

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

(上接 D356 版) 本基金的银行存款由基金托管人保管,按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 无

7.4.5 期末(2017 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券 无

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 无

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 无

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 7,262,749.11 元,是以如下债券作为质押:

Table with 6 columns: 债券代码, 债券名称, 回购到期日, 期末估值价值, 数量(张), 期末估值总额

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购 无

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

1.确定金融工具所属的公允价值层次的方法 在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次;第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

2.各层次金融工具公允价值 于 2017 年 12 月 31 日本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为人民币 29,791,235.86 元(2016 年 12 月 31 日:属于第二层的余额为人民币 169,792,532.84 元),无属于第一层次及第三层次的余额。

3.公允价值所属层次间的重大变动 本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具公允价值层次之间转换的时点,本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具,在第一层次和第二层次之间无重大转移(上年度:无)。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况(上年度:无)。

8.2 投资组合报告 8.1 期末基金资产组合情况 金额单位:人民币元

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

8.2.1 期末按行业分类的股票投资组合 8.2.1.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

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

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 金额单位:人民币元

Table with 5 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(%)

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细 金额单位:人民币元

Table with 5 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(%)

\*“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细 金额单位:人民币元

Table with 5 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(%)

\*“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.4.4 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 摊余成本, 占基金资产净值比例(%)

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 8.5.1 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 摊余成本, 占基金资产净值比例(%)

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 摊余成本, 占基金资产净值比例(%)

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: 项目, 偏离情况

报告期内偏离度的绝对值在 0.25%(含)-0.5%的次数

报告期内偏离度的最高值

报告期内偏离度的最低值

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值

报告期内公允价值占基金资产净值比例 0.25%情况说明

8.8 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

8.9 投资组合报告附注 8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值,A 类基金份额的每份基金份额净值始终维持人民币 100.00 元,B 类基金份额的每份基金份额净值始终维持人民币 1.00 元。

本基金所持有的债券采用摊余成本法进行估值,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价或折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

8.9.2 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.3 期末其他各项资产构成

\*“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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

Table with 2 columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额

\*“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 8.5.1 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 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债券投资明细 金额单位:人民币元

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(%)

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

8.8 本报告期末未持有资产支持证券

8.9 本报告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

8.10 本报告期末未持有贵金属

8.11 本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.12 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.13 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.14 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.15 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.16 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.17 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.18 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.19 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.20 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.21 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.22 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.23 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.24 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.25 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.26 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.27 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.28 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.29 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.30 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.31 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.32 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.33 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.34 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.35 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.36 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.37 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.38 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.39 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.40 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.41 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.42 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.43 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.44 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.45 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.46 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.47 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.48 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.49 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.50 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.51 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.52 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.53 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.54 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.55 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.56 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.57 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.58 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.59 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.60 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.61 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.62 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.63 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.64 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.65 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.66 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.67 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.68 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.69 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.70 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.71 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.72 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.73 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.74 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.75 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.76 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.77 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.78 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.79 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.80 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.81 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.82 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.83 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.84 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.85 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.86 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.87 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.88 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.89 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

8.90 本报告期末持有的公允价值计量的权益类投资

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

1.本公司高级管理人员、基金投资和研究人员部门负责人持有本基金;

2.本基金基金经理未持有本开放式基金。

8.10 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 3 columns: 基金合同生效日(2016 年 07 月 21 日)基金份额总额, 本报告期初基金份额总额, 本报告期末基金份额总额

申购含红利再投、转换入份额及金额、赎回含转换转出份额及金额。

11.1 基金份额持有人大会决议

11.2 基金份额持有人大会决议

11.3 基金份额持有人大会决议

11.4 基金份额持有人大会决议

11.5 基金份额持有人大会决议

11.6 基金份额持有人大会决议

11.7 基金份额持有人大会决议

11.8 基金份额持有人大会决议

11.9 基金份额持有人大会决议

11.10 基金份额持有人大会决议

11.11 基金份额持有人大会决议

11.12 基金份额持有人大会决议

11.13 基金份额持有人大会决议

11.14 基金份额持有人大会决议

11.15 基金份额持有人大会决议

11.16 基金份额持有人大会决议

11.17 基金份额持有人大会决议

11.18 基金份额持有人大会决议

11.19 基金份额持有人大会决议

11.20 基金份额持有人大会决议

11.21 基金份额持有人大会决议

11.22 基金份额持有人大会决议

11.23 基金份额持有人大会决议

11.24 基金份额持有人大会决议

11.25 基金份额持有人大会决议

11.26 基金份额持有人大会决议

11.27 基金份额持有人大会决议

11.28 基金份额持有人大会决议

11.29 基金份额持有人大会决议

11.30 基金份额持有人大会决议

11.31 基金份额持有人大会决议

11.32 基金份额持有人大会决议

11.33 基金份额持有人大会决议

11.34 基金份额持有人大会决议

11.35 基金份额持有人大会决议

11.36 基金份额持有人大会决议

11.37 基金份额持有人大会决议

11.38 基金份额持有人大会决议

11.39 基金份额持有人大会决议

11.40 基金份额持有人大会决议

11.41 基金份额持有人大会决议

11.42 基金份额持有人大会决议

11.43 基金份额持有人大会决议

11.44 基金份额持有人大会决议

11.45 基金份额持有人大会决议

11.46 基金份额持有人大会决议

&lt;