

(上接 D357 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(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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归属第二层次还是第三层次;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换。

2.除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需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 报告期末按行业分类的股票投资组合 8.2.1 报告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 D359 版)

关联方名称 2017年01月01日至2017年12月31日 2016年01月01日至2016年12月31日

Table with 4 columns: 关联方名称, 成交金额, 占当期债券回购成交金额的比例, 成交金额, 占当期债券回购成交金额的比例

7.4.4.2 关联方报酬 7.4.4.2.1 基金管理费 单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日, 上年度可比期间

支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.3 销售服务费 单位:人民币元

Table with 4 columns: 获得销售服务费的各关联方名称, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日, 上年度可比期间

支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.10%的年费率计提,每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况无。

Table with 4 columns: 关联方名称, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日, 上年度可比期间

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

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(%)

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

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(%)

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

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 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

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(%)

8.12 投资组合报告附注 8.12.1 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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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(%)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 份额单位:份

Table with 4 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者

9.2 期末基金管理人从业人数持有本基金的情况 本报告期末,本基金管理人的从业人数持有本基金。

9.3 期末基金管理人从业人数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、基金投资和研发部门负责人未持有本基金。

9.4 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.5 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.6 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.7 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.8 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.9 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.10 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.11 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.12 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.13 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.14 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.15 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.16 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.17 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.18 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.19 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.20 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.21 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.22 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.23 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.24 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.25 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.26 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.27 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.28 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.29 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.30 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.31 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.32 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.33 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.34 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.35 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.36 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.37 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.38 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.39 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.40 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.41 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.42 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.43 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

9.44 期末基金管理人从业人数持有本开放式基金的情况 本报告期末,本基金管理人未持有本开放式基金。

付情况 金额单位:人民币元

Table with 6 columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 应付该券商的佣金

①为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的标准,即: 1.经营行为规范,在近三年内无重大违规行为。

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,本基金未召开基金份额持有人大会。

3.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

4.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

5.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

6.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

7.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

8.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

9.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

10.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

11.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

12.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

13.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

14.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

15.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

16.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

17.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

18.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

19.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

20.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

21.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

22.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

23.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

24.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

25.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

26.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

27.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

28.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

29.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

30.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

31.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

32.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

33.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

34.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

35.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

36.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

37.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

38.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

39.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

40.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

41.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,本基金未召开基金份额持有人大会。

42.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,本基金未召开基金份额持有人大会。