

(上接B371版) 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告相一致的说明

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

7.4.5.2 会计估计变更的说明

7.4.5.3 差错更正的说明

7.4.6 税项

(1) 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

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行

(4) 本基金的城镇维护建设费、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳

7.4.7 关联方关系

Table with 2 columns: 关联方名称, 与本基金的关系

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.2 关联方报酬

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间

7.4.8.2.2 基金托管费

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间

7.4.8.2.3 销售服务费

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

Table with 3 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间

7.4.8.6 本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管,按约定利率计息

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

7.4.10 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

(a) 金融工具公允价值计量的方法

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

(d) 不以公允价值计量的金融工具

(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 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

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

8.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

Table with 2 columns: 国家/地区, 公允价值

8.3 期末按行业分类的权益投资分布

Table with 2 columns: 行业类别, 公允价值

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股票投资明细

Table with 10 columns: 序号, 公司名称(英文), 公司名称(中文), 证券代码, 所在证券市场, 所属国家(地区), 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.6 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.7 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.8 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.9 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.10 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.11 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.12 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.13 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.14 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.15 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.16 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.17 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.18 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.19 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.20 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:1、买入金额按买入成交金额(成交单乘以成交数量),不包括相关交易费用

2、所用证券代码采用ISIN代码

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:1、卖出金额按卖出成交金额(成交单乘以成交数量),不包括相关交易费用

2、所用证券代码采用ISIN代码

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

Table with 2 columns: 买入成本(成交金额), 卖出收入(成交金额)

注:买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额(成交单乘以成交数量),不包括相关交易费用

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

8.7 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

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

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基金投资明细

Table with 5 columns: 序号, 基金名称, 基金类型, 运作方式, 管理人, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未披露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

8.11.2 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

8.11.3 期末其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 3 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 持有人结构

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 2 columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金总份额比例(%)

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的情况

9.3.1 基金高级管理人员、基金投资和管理部门负责人、该只基金的基金经理未持有该只基金

9.3.2 基金基金经理未持有该只基金

9.3.3 基金基金经理未持有该只基金

9.3.4 基金基金经理未持有该只基金

9.3.5 基金基金经理未持有该只基金

9.3.6 基金基金经理未持有该只基金

9.3.7 基金基金经理未持有该只基金

9.3.8 基金基金经理未持有该只基金

9.3.9 基金基金经理未持有该只基金

9.3.10 基金基金经理未持有该只基金

9.3.11 基金基金经理未持有该只基金

9.3.12 基金基金经理未持有该只基金

9.3.13 基金基金经理未持有该只基金

9.3.14 基金基金经理未持有该只基金

9.3.15 基金基金经理未持有该只基金

9.3.16 基金基金经理未持有该只基金

9.3.17 基金基金经理未持有该只基金

9.3.18 基金基金经理未持有该只基金

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

Table with 6 columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 佣金, 佣金占成交金额的比例

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.3 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.4 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.5 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.6 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.7 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.8 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.9 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.10 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.11 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.12 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.13 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.14 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.15 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.16 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.17 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.18 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.19 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.20 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.21 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.22 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.23 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.24 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

求,经海外投资决策委员会批准,公司将提前终止租用其交易席位

3、除海通证券的交易席位为与优化配置基金共用的交易席位外,本报告期内新增服务券商STEPHENS,INC.、DEUTSCHE BANK AG,报告期内无剔除单元

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.3 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.4 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.5 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.6 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.7 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.8 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.9 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.10 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.11 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.12 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.13 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.14 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.15 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.16 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.17 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.18 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.19 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.20 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.21 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.22 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.23 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 股票回购交易, 权证交易, 基金交易

11.7.24 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况