

# 信息披露Disclosure

## （上接B423版）

优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融同业往来有关增值税政策补充通知》、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》、财税[2017]12号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(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,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司(“平安基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行	基金托管人、基金销售机构
平安证券有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
三益基金销售有限公司	基金管理人的股东
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司(“平安证券”)	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
上海陆金所基金销售有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构

注: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

7.4.8.1.1 股票交易

关联方名称	金额单位:人民币元			
	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例	
平安证券	156,740,822.38	2.34%	-	-

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期			
	2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间	
	当期佣金	占当期佣金总额的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
平安证券	110,772.11	2.31%	81,331.02	12.65%

注:

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人于对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,563,760.79	9,836,804.36
其中:支付销售机构的客户维护费	2,571,141.03	3,873,734.06

注:支付基金管理人平安基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,092,291.76	1,639,467.32

注:支付基金托管行平安银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

无

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生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

无

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

无

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

单位:人民币元

率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

注:本基金的银行存款由基金托管行平安银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

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/增发交易而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票	证券代码	证券名称	成功认购日期	可流通日期	流通受限类别	认购价格	期末持仓股数	期末持仓市值	期末持仓成本	期末持仓市值/期末持仓成本	备注
601001	紫金矿业	2018年12月13日	2019年1月1日	新设未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有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

截至本报告期末2018年12月31日止,本基金未从事银行间市场债券正回购交易,无质押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止,本基金未从事证券交易所债券正回购交易,无质押债券。

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

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: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:相关资产或负债的不可观察输入值。

(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

于2018年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为264,697,762.05元,属于第二层次的余额为50,145.80元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次377,993,029.84元,第二层次5,192,374.68元,无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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)、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应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018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(2017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) 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

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	264,747,907.25	80.29
	其中:股票	264,747,907.25	80.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
	其中:买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	47,069,518.29	14.53
	其他各项资产	17,068,011.06	5.18
8	合计	329,725,427.20	100.00

8.2 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

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	13,605,390.00	4.15
B	采矿业	-	-
C	制造业	169,636,375.51	51.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,124,454.00	1.25
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,602,587.00	0.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,594,646.25	5.36
J	金融业	50,215.74	0.02
K	房地产业	48,977,779.35	14.93
L	租赁和商务服务业	6,682,272.00	2.04
M	科学研究和技术服务业	1,724,615.00	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	卫生和社会工作	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,750,573.00	0.53
S	综合	-	-
	合计	264,747,907.25	80.70

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

金额单位:人民币元

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(%)
1	601012	隆基股份	1,205,960	21,030,198.40	6.41
2	600438	通威股份	2,258,400	18,701,208.00	5.70
3	300271	华宇软件	1,169,500	17,554,195.00	5.35
4	300385	菲利华	1,140,304	16,363,352.40	4.99
5	600048	保利地产	1,267,500	15,194,341.00	4.63
6	300274	阳光电源	1,632,500	14,564,576.00	4.44
7	300263	聚光科技	494,000	12,435,120.00	3.75
8	300114	亿纬锂能	697,500	10,954,700.00	3.34
9	601979	招商港口	576,300	10,009,215.00	3.05
10	601155	新城控股	296,815	9,447,927.26	2.86

注:投资者欲了解本报告期末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。

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

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(%)
1	600048	保利地产	61,602,548.42	10.47
2	601336	新华保险	58,001,126.57	9.86
3	601998	中信银行	57,119,475.54	9.71
4	601979	招商港口	52,681,316.31	8.95
5	600600	青岛海尔	50,003,273.87	8.50
6	601012	隆基股份	47,406,420.10	8.06
7	002294	苏宁易购	46,116,654.55	7.84
8	600438	通威股份	44,330,266.81	7.54
9	601601	中国太保	42,885,798.72	7.29
10	600887	伊利股份	41,712,597.32	7.09
11	300274	阳光电源	40,211,776.98	6.84
12	002202	金风科技	39,905,404.94	6.78
13	601338	工商银行	39,894,913.56	6.77
14	300383	光润新材	38,573,465.58	6.56
15	000651	格力电器	38,056,797.01	6.47
16	600036	招商港口	35,592,517.05	6.05
17	600585	海螺水泥	35,262,327.93	5.99
18	600116	民生银行	35,262,600.00	5.99
19	601877	正泰电器	34,938,077.04	5.94
20	002036	联创电子	31,574,731.67	5.57
21	000963	华发股份	29,862,686.63	5.09
22	601089	中国铁建	29,771,169.00	5.06
23	601028	中国人寿	29,362,455.00	4.90
24	002648	卫星石化	29,342,988.10	4.90
25	002272	千方科技	28,543,400.00	4.75
26	600582	浙江龙盛	27,721,781.00	4.81
27	601288	农业银行	27,447,962.00	4.67
28	002709	天赐材料	27,044,944.74	4.60
29	000958	五 粮 花	26,874,447.00	4.57
30	601919	中远海控	26,770,766.00	4.55
31	600176	中国巨石	26,246,040.74	4.46

32	601111	中国国航	26,112,451.40	4.44
33	300364	中文在线	25,443,724.45	4.32
34	002236	大华股份	25,389,513.03	4.32
35	000333	美的集团	25,196,970.84	4.28
36	601155	新城控股	25,173,765.67	4.28
37	300088	高新兴	25,022,423.73	4.25
38	000060	深天马A	24,677,827.49	4.19
39	002192	融捷股份	23,810,566.08	4.05
40	002384	东山精密	23,715,606.61	4.03
41	600522	中天科技	23,683,495.71	4.03
42	601618	光大银行	23,462,732.00	3.99
43	300324	旋极信息	23,385,496.28	3.98
44	000681	视觉中国	23,281,636.00	3.96
45	000895	双汇发展	22,634,630.95	3.90
46	601889	紫金矿业	22,621,475.19	3.85
47	600028	中国石化	21,585,850.00	3.67
48	300357	东方网力	21,358,120.09	3.63
49	002123	梦网集团	20,300,186.76	3.62
50	000796	北新建材	20,324,973.19	3.62
51	601689	瀚安环能	20,737,943.50	3.51
52	002544	杰赛科技	20,671,673.32	3.53
53	300070	碧水源	20,402,772.18	3.47
54	300476	胜宏科技	19,979,676.60	3.40
55	600763	通策医疗	19,929,648.06	3.39
56	600629	山东药玻	19,176,382.96	3.26
57	603708	家家悦	18,915,386.76	3.22
58	300266	利源达	18,789,081.13	3.20
59	603160	汇顶科技	18,302,900.64	3.11
60	300486	鼎龙股份	18,240,234.01	3.10
61	603383	老百姓	18,237,937.00	3.10
62	000651	长春高新	17,984,980.71	3.04
63	202171	华宇软件	17,857,230.06	3.03
64	601166	兴业银行	17,814,271.00	3.03
65	603393	洛阳钼业	17,813,708.00	3.03
66	600606	绿地控股	17,779,187.78	3.02
67	300396	菲利华	17,741,077.91	3.02
68	002009	天奇股份	17,566,186.00	2.99
69	000961	中南建设	17,505,870.00	2.98
70	002456	欧普科技	17,395,746.96	2.96
71	000049	华侨城A	17,251,693.20	2.93
72	300323	华仙光电	17,216,236.62	2.93
73	600118	中国卫通	17,185,237.00	2.92
74	002074	国轩高科	17,141,348.53	2.91
75	601988	中国银行	17,068,920.00	2.91
76	300406	三环集团	16,495,329.00	2.89
77	000039	中集集团	16,475,963.85	2.89
78	002372	伟星新材	16,332,019.24	2.78
79	002027	分众传媒	16,176,544.50	2.75
80	000671	阳光城	15,886,499.23	2.70
81	601772	黄河旋风	15,807,520.26	2.69
82	600483	招商银行	15,716,326.54	2.67
83	601231	环旭电子	15,625,210.00	2.66
84	600797	浙大网新	15,600,340.00	2.65
85	002507	涪陵榨菜	15,562,077.27	2.64
86	000002	万科A	15,515,211.00	2.64
87	002334	英威腾	15,333,077.15	2.61
88	300203	聚光科技	15,048,671.53	2.56
89	002440	固生科技	14,725,476.69	2.52
90	002013	中航机电	14,714,123.17	2.50
91	300310	宜通世纪	14,522,590.00	2.47
92	002388	太极股份	14,306,585.00	2.43
93	601222	津浦能源	14,033,441.50	2.39
94	000890	顺鑫农业	13,842,704.11	2.35
95	600286	安联神药	13,575,887.15	2.31
96	002477	智康农牧	13,369,989.82	2.27
97	000569	华锐股份	13,056,586.42	2.22
98	600271	航天信息	13,044,680.00	2.22
99	002727	一心堂	12,943,887.26	2.18
100	300294	博康生物	12,784,531.19	2.17
101	600521	华海药业	12,731,931.19	2.16
102	002142	宁波银行	12,677,459.08	2.15
103	600332	白云山	12,610,245.56	2.14
104	300137	先河环保	12,384,006.00	2.11
105	002415	海康威视	12,290,889.00	2.08
106	600115	东方航空	12,168,944.26	2.07
107	600967	通化东宝	12,121,890.22	2.06
108	300196	长盈股份	12,046,226.60	2.05
109	000537	广宇发展	11,847,207.00	2.01
110	002826	安诺股份	11,843,080.00	2.00