

信息披露

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成交日期	可流通数量	流通受限数量	认购价格	期末净值	期末净值	说明
60188	华泰证券	2018年1月10日	10,000,000	0	6.90	6.90	12,799,800,465.01	-

注:截至本报告期末2018年1月29日(基金合同失效前日),止,本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限债券及权证。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

2018年1月29日(基金合同失效前日),本基金无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

2018年1月29日(基金合同失效前日),本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

2018年1月29日(基金合同失效前日),本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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)以公允价值计量的资产和负债

公允价值计量结果所属层次取次对于公允价值计量整体而言具有更重要的最低层次的影响。

7.4.5 会计政策和会计估计变更及差错更正的说明

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资

基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《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]103号文《关于股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易关于做好证券交易印花

税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所涉税款若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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《关于金融同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产贷款、教育辅助服务

等增值税政策的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,暂不征收企业所得税。

(b)自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,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

以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,已缴纳相关管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品

转让收入免征增值税;对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税;同业存款利息收入免征增值税以及一般存款

利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股

东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得,由上市公司在向基金

支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税应纳税所得

额: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%计入个人所得应税应纳税所得额。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分

别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率,计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 关联方关系

关联方名称 与本基金的关系

诺安基金管理有限公司 发起人、管理人,注册地与过户机构、直销机构

中国银行股份有限公司 托管人、代销机构

中国工商银行股份有限公司 托管人、代销机构

深圳市招商证券股份有限公司 管理人股东

大恒新阳光科技股份有限公司 管理人股东

注:下述关联方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

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有应支付关联方的佣金。

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 2018年1月1日至2018年1月29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 1,732,346.88 37,634,540.76

其中:支付销售机构的客户维护费 1,013,265.26 14,316,880.43

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。管理费

的计算方法如下:

H=E×1.2%÷当年天数

E为每日应计提的基金管理费

H为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理

人向基金管理人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首

日3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日

或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目 2018年1月1日至2018年1月29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 288,724.50 6,272,423.46

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计

算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

E为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人复核后于次月前3个

工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日

或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

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

单位:人民币元

项目 2018年1月1日至2018年1月29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 288,724.50 6,272,423.46

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计

算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

E为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人复核后于次月前3个

工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日

或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

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

单位:人民币元

项目 2018年1月1日至2018年1月29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 288,724.50 6,272,423.46

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计

算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

E为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人复核后于次月前3个

工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日

或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

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

单位:人民币元

项目 2018年1月1日至2018年1月29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 288,724.50 6,272,423.46

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计

算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

E为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人复核后于次月前3个

工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日

或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

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

单位:人民币元

项目 2018年1月1日至2018年1月29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 288,724.50 6,272,423.46

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计

算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

E为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人复核后于次月前3个

工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日

或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

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

单位:人民币元

项目 2018年1月1日至2018年1月29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 288,724.50 6,272,423.46

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计

算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

E为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人复核后于次月前3个

工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日

或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

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

单位:人民币元

项目 2018年1月1日至2018年1月29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 288,724.50 6,272,423.46

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计

算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

E为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人复核后于次月前3个

工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日

或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

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

单位:人民币元

项目 2018年1月1日至2018年1月29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 288,724.50 6,272,423.46

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计

算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

E为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人复核后于次月前3个

工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日

或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

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

单位:人民币元

项目 2018年1月1日至2018年1月29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 288,724.50 6,272,423.46

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计

算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

E为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人复核后于次月前3个

工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日

或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

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

单位:人民币元

项目 2018年1月1日至2018年1月29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 288,724.50 6,272,423.46

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计

算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

E为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人复核后于次月前3个

工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日

或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

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

单位:人民币元

项目 2018年1月1日至2018年1月29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 288,724.50 6,272,423.46

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计

算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

E为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人复核后于次月前3个

工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日

或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

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

单位:人民币元

项目 2018年1月1日至2018年1月29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 288,724.50 6,272,423.46

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计

算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

E为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人复核后于次月前