

(上接B588版)

份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

7.4.6.3 企业所得税
根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]11号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金在证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、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。

7.4.6.4 个人所得税
根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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,暂减按25%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;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司(“东方证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
上海上投资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
上海青泉基金投资管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金有限公司	与基金管理人同一批关键管理人员

注:以上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	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
成交金额	441,112,748.72	752,364,392.86
占当期股票成交总额的比例	100.00%	100.00%

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
成交金额	-	564,818.00
占当期债券成交总额的比例	-	100.00%

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
成交金额	408,213,687	184,085,227
占当期债券成交总额的比例	100.00%	100.00%

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
成交金额	606,600.19	416,084.35
占当期债券成交总额的比例	100.00%	100.00%

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.2 债券回购交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未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

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期佣金	408,213,687	184,085,227
占当期佣金总额的比例	100.00%	100.00%

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期佣金	606,600.19	416,084.35
占当期佣金总额的比例	100.00%	100.00%

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,199,618.67	5,461,729.33
其中:支付给基金托管人的费用	-	-

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E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。由基金托管人根据基金管理人的授权委托,于次月前2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、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,039,922.79	1,086,347.89

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托,于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,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

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未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

注:本报告期及上年度可比期间内基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位:份

	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
关联方名称	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例
东方证券股份 有限公司	0.00	0.0000%	4,037.00	0.0006%

注:东方证券股份有限公司于2017年6月22日在二级市场卖出4,037.00份

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

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	6,816,065.93	42,060.69	6,410,090.93	46,754.38

7.4.9.2 本行在承继过程中与关联方承继还款的情况

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9 期末(2017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

证券代码	证券名称	成功认购日期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300648	鹏鼎控股	2017年12月28日	新股发行	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科信技术	2017年12月28日	新股发行	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润农金控	2017年12月28日	新股发行	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新通联	2017年12月28日	新股发行	13.60	13.60	1,167	16,143.20	16,143.20	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价	复牌日期	停牌开始时间	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000430	中农网	2017年10月24日	13.34	-	-	1,196,353	15,112,304.11	15,969,882.62	-
300730	科信技术	2017年12月28日	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,983.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	35.26	2018年1月2日	35.79	821	10,311.76	29,940.46	-

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2017年12月31日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购截至本报告期末2017年12月31日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1公允价值

7.4.10.1.1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贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

7.4.10.1.2以公允价值计量的金融工具

7.4.10.1.2.1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人民币1,548,190,899.23元,属于第二层次的余额为人民币16,108,390.82元,无划分为第三层次的余额(于2016年12月31日,属于第一层次的余额为人民币987,222,527.33元,无划分为第二层次和第三层次的余额)。

7.4.10.1.2.2公允价值所属层次间的重大变动对于证券交易所上市的股票和可转换债券等,若出现重大事件停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别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不再将该股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的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,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.10.1.2.3第三层次公允价值余额和本期变动金额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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.10.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.10.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.10.4财务报表的批准

本财务报表已于2018年3月21日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,564,289,290.05	99.54
2	其中:股票	1,564,289,290.05	99.54
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	7,189,052.33	0.46
11	其他各项资产	49,531.76	0.00
12	合计	1,571,537,874.14	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金总资产的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	130,853,429.95	8.33
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,330,617,206.09	84.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	102,024,836.61	6.50
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计	-	1,563,495,484.68	99.57

8.2.2 期末积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	703,283.66	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计	-	833,585.37	0.05

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合注:本基金本报告期末未有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 期末指数投资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

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	000859	五粮液	3,067,975	245,069,943.00	15.61
2	600619	贵州茅台	347,167	242,159,469.63	15.42
3	600887	伊利股份	7,352,408	236,674,013.57	15.07
4	002204	洋河股份	967,949	111,314,135.00	7.09
5	000693	泸州老窖	1,178,174	77,759,484.00	4.95
6	601933	永辉超市	6,188,276	62,501,567.60	3.98
7	000895	双汇发展	1,599,972	42,369,258.00	2.70
8	000998	隆平高科	1,228,619	31,600,080.68	2.01
9	600438	通威股份	2,535,600	30,706,116.00	1.96
10	002714	牧原股份	566,074	29,922,671.64	1.91

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有指数股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.02
2	002629	赣锋锂业	4,569	178,794.97	0.01
3	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.00
4	002915	中钢钨材	1,085	38,181.15	0.00
5	603477	振源股份	1,955	37,022.70	0.00

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有积极股票明细,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

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	600438	通威股份	26,495,334.68	2.67
2	000859	五粮液	24,233,336.77	2.44
3	600887	伊利股份	16,893,480.74	1.70
4	002204	洋河股份	13,631,392.60	1.37
5	600598	北大荒	12,708,781.26	1.28
6	000729	燕京啤酒	12,456,291.46	1.26
7	000568	泸州老窖	11,402,866.83	1.15
8	600811	东方集团	10,252,077.65	1.04
9	000998	隆平高科	7,234,569.96	0.73
10	601933	永辉超市	6,663,482.07	0.67
11	600288	广生股份	6,527,463.42	0.66
12	002565	大富科技	6,269,497.40	0.64
13	600690	南山铝业	5,239,773.12	0.53
14	000826	鲁发发展	5,065,267.00	0.51
15	000676	新希望	4,192,225.00	0.42
16	603309	今世缘	4,079,854.85	0.41
17	002477	雅化股份	3,984,715.00	0.40
18	602385	大北农	3,264,379.36	0.33
19	602289	圣农发展	3,024,666.67	0.30
20	002629	百联股份	3,001,504.47	0.30