

(上接 B806 版)

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融资产,其因利率期限不同,公允价值与账面价值相若。

6.4.14.12 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.12.1 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 06 月 30 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工具中属于第一层次的余额为人民币 5,036,588.62 元,属于第二层次的余额为人民币 3,986,295.00 元,无属于第三层次的余额。(于 2017 年 06 月 30 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工具中属于第一层次的余额为人民币 5,036,588.62 元,属于第二层次的余额为人民币 3,986,295.00 元,无属于第三层次的余额。)

6.4.14.12.2 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,若出现重大事项停牌、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不将相关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具有重大影响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所属第二层次或第三层次。本基金政策为以公允价值计量确定金融工具公允价值层次间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.12.3 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基本期末和上期末均不在第三层次公允价值计量。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日,本基金的资产净值为人民币 16,746,630.14 元,已连续超过 742 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元。本基金资产管理人就已上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定,向中国证监会说明原因和拟采取方案,本基金资产管理人将积极采取除持续经营,加大宣传推介力度,提高投研能力等措施,尽快扭转这一状况。

除此之外,本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 08 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,249,797.12	60.13
	其中:股票	10,249,797.12	60.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,018,769.50	17.71
	其中:债券	3,018,769.50	17.71
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买入返售金融资产中的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,819,676.88	16.54
8	其他各项资产	999,098.50	5.83
9	合计	17,047,342.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,891,995.00	41.15
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,050,000.00	6.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
K	金融业	248,555.00	1.48
L	房地产业	837,330.00	5.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	卫生、社会保障和公共管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生健康工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,220,917.12	7.29
S	综合	-	-
合计		10,249,797.12	61.21

7.2.2 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有港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601888	中国国航	13,000	837,330.00	4.92
2	603658	安图生物	10,000	824,600.00	4.50
3	600267	海正药业	50,000	727,000.00	4.24
4	600867	通化东宝	50,000	719,100.00	4.39
5	000418	小天鹅A	10,000	693,500.00	4.14
6	600392	盛邦药业	40,000	690,200.00	3.88
7	600373	中安药业	50,000	642,500.00	3.47
8	600051	华泰股份	24,000	640,500.00	3.63
9	601228	广州酒家	100,000	581,000.00	3.44
10	603396	新伟基	6,904	578,417.12	3.45
11	603283	展鹏股份	3,000	516,600.00	3.08
12	002371	北方华创	10,000	496,700.00	2.97
13	000507	珠海中珠	50,000	469,000.00	2.80
14	600111	北方稀土	40,000	455,200.00	2.72
15	600282	南侨股份	10,000	442,000.00	2.64
16	002110	三钢闽光	24,500	392,735.00	2.35
17	600656	辉瑞医药	10,000	334,800.00	2.00
18	001979	招商蛇口	13,100	249,555.00	1.49

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002110	三钢闽光	889,974.00	4.60	
2	600267	海正药业	859,179.11	4.41	
3	600999	招商局港	814,000.00	4.49	
4	600392	盛邦药业	733,300.00	4.15	
5	601888	中国国航	735,569.00	4.11	
6	600521	华泰股份	734,000.00	4.10	
7	000910	大亚圣象	739,608.00	3.86	
8	600867	通化东宝	731,589.00	3.82	
9	600373	中安药业	723,800.00	3.78	
10	600887	伊利股份	723,409.00	3.78	
11	600787	北方华创	723,190.00	3.78	
12	001979	招商蛇口	722,530.00	3.78	
13	000418	小天鹅A	685,511.00	3.59	
14	603816	桐君药业	673,214.00	3.52	
15	600392	盛邦药业	659,365.00	3.45	
16	600011	北方稀土	734,000.00	3.33	
17	601033	桐君药业	598,700.00	3.13	
18	601111	中国国航	595,000.00	3.11	
19	601628	中国人寿	590,150.00	3.08	
20	600185	格力电器	569,200.00	2.97	
21	603096	招商局港	564,243.32	2.96	
22	601228	广州酒家	557,000.00	2.91	
23	000717	新钢股份	553,200.00	2.89	
24	000651	格力电器	548,615.00	2.87	
25	001979	招商蛇口	544,099.00	2.86	
26	600153	建发股份	542,360.00	2.83	
27	600029	南方航空	523,500.00	2.74	
28	000507	珠海中珠	504,470.00	2.64	
29	601228	广州酒家	504,165.00	2.63	
30	600111	北方稀土	490,000.00	2.56	
31	600282	南侨股份	488,000.00	2.55	
32	002371	北方华创	453,681.00	2.37	

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002110	三钢闽光	889,974.00	4.60
2	600267	海正药业	859,179.11	4.41
3	600999	招商局港	814,000.00	4.49
4	600392	盛邦药业	733,300.00	4.15
5	601888	中国国航	735,569.00	4.11
6	600521	华泰股份	734,000.00	4.10
7	000910	大亚圣象	739,608.00	3.86
8	600867	通化东宝	731,589.00	3.82
9	600373	中安药业	723,800.00	3.78
10	600887	伊利股份	723,409.00	3.78
11	600787	北方华创	723,190.00	3.78
12	001979	招商蛇口	722,530.00	3.78
13	000418	小天鹅A	685,511.00	3.59
14	603816	桐君药业	673,214.00	3.52
15	600392	盛邦药业	659,365.00	3.45
16	600011	北方稀土	734,000.00	3.33
17	601033	桐君药业	598,700.00	3.13
18	601111	中国国航	595,000.00	3.11
19	601628	中国人寿	590,150.00	3.08
20	600185	格力电器	569,200.00	2.97
21	603096	招商局港	564,243.32	2.96
22	601228	广州酒家	557,000.00	2.91
23	000717	新钢股份	553,200.00	2.89
24	000651	格力电器	548,615.00	2.87
25	001979	招商蛇口	544,099.00	2.86
26	600153	建发股份	542,360.00	2.83
27	600029	南方航空	523,500.00	2.74
28	000507	珠海中珠	504,470.00	2.64
29	601228	广州酒家	504,165.00	2.63
30	600111	北方稀土	490,000.00	2.56
31	600282	南侨股份	488,000.00	2.55
32	002371	北方华创	453,681.00	2.37

7.4.2 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

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(%)
1	600036	招商银行	2,103,100.00	10.93
2	601318	中国平安	1,727,505.75	9.09
3	000001	平安银行	1,668,264.00	8.72
4	600276	恒顺医药	1,572,420.00	8.22
5	002142	宁波银行	1,494,528.00	7.81
6	000043	中兴通讯	1,483,798.35	7.75
7	601601	中国人寿	1,332,058.00	6.97
8	601336	新华保险	1,256,729.72	6.66
9	600309	华芳化学	884,788.00	4.62
10	000725	南京医药	786,861.00	4.11
11	600999	招商局港	764,808.00	4.00
12	600067	北方华创	692,038.00	3.62
13	603816	桐君药业	691,000.00	3.61
14	001979	招商蛇口	688,902.00	3.59
15	600687	伊利股份	651,744.00	3.41
16	600010	华信国际	643,238.34	3.36
17	600011	中国国航	642,620.00	3.36
18	601033	桐君药业	604,000.00	3.16
19	601111	中国国航	573,500.00	3.00
20	601628	中国人寿	565,365.00	2.95
21	600185	格力电器	531,780.00	2.80
22	600029	南方航空	529,500.00	2.77
23	600153	建发股份	527,510.00	2.76
24	002456	航新科技	519,915.00	2.72
25	000651	格力电器	515,383.00	2.69
26	007117	麒麟软件	514,400.00	2.69
27	002110	三钢闽光	384,405.00	2.01

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(成交金额)	卖出股票收入(成交金额)
22,172,304.43	25,039,402.16

注: 本项的“买入金额”按买卖成交金额(成交单张乘以成交数量)填列,不考虑相关费用。

7.4.3 卖出股票的成本总额及卖出股票的收入总额

卖出股票成本(成交金额)	卖出股票收入(成交金额)
194,255,979.38	68,370,797.38

注: 本项的“卖出金额”按买卖成交金额(成交单张乘以成交数量)填列,不考虑相关费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000057	潍柴动力	1,029,900	9,660,462.00	6.54
2	000995	招商局港	1,153,402	9,077,273.74	6.14
3	601228	广州酒家	1,454,900	8,452,960.00	5.73
4	600218	上海钢联	1,069,146	8,372,111.40	4.31
5	000429	粤高速A	844,152	6,094,777.44	4.13
6	600897	厦门空港	292,800	6,033,420.00	4.08
7	600176	中国国航	550,347	5,630,049.81	3.81
8	600017	日照港	1,750,000	5,617,500.00	3.80
9	002078	太原重工	546,528	5,296,836.94	3.59
10	600030	中信证券	230,500	3,919,385.00	2.59
11	600755	厦门国贸	520,400	3,793,716.00	2.57
12	602682	南侨股份	682,500	3,016,650.00	2.04
13	600377	宁波海运	2,992,522.84	2,923,204.32	2.03