

(上接B817版)

-40%，其中，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，权证不高于基金资产净值的3%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下。

6.4.13.4.3其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的中间价格风险来源于资产价格的系统性风险,即与基金投资组合中股票价格的系统性风险相关	
	公允价值变动	对资产负债表日净资产的影响(单位:人民币元)
假设	假设利率变动±50%	0.00
	假设汇率变动±5%	0.00
分析	假设利率变动±50%	-3,486,488.23
	假设汇率变动±5%	-7,734,008.50

注:本基金管理人运用资本——资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析,上表为市场价格风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,证券市场整体的价格发生合理、可能的变动时,将对基金资产净值产生的影响。

6.4.13.4.4采用公允价值法处理金融资产

公允价值(VaR)含义是指:在市场正常波动下,某一金融资产或证券组合的最大可能损失。更为确切的是指,在一定置信水平(置信度)下,某一金融资产或证券组合的价值在未来特定时期内的最大可能损失。用公式表示为:Prob(ΔP|VaR)=1-α或Prob(-ΔP|VaR)=α。

其中Prob表示:资产价值损失小于可能损失上限的概率;ΔP表示:某一金融资产在一定持有期Δt的价值损失额;VaR表示:给定置信水平α下的在险价值,即可能的损失上限;α为:给定的置信水平。

假设	在90%的置信水平下采用国际公认的风险管理方法	
	公允价值变动	对资产负债表日净资产的影响(单位:人民币元)
假设	假设利率变动±50%	0.00
	假设汇率变动±5%	0.00
分析	假设利率变动±50%	-3,486,488.23
	假设汇率变动±5%	-7,734,008.50

注:上述分析衡量了在99%的置信水平下,所持有的权益类资产组合在资产负债表日最后一个交易日内由于市场价格风险所导致的最大潜在损失。

6.4.14有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1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银行存款、结算备付金、存保保证金、应收款项以及其他金融负债,其到期期限不长,公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1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63,227,516.33元,属于第二层次的余额为人民币11,483,965.11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128,938,693.29元,属于第二层次的余额为人民币123,683.10元,无属于第三层次的余额。)

6.4.14.1.2.2公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的投资品种,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将相关投资品种的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的公允价值变动调整而具有重要意义的输入值所属的最低层次,确定相关投资公允价值所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。

6.4.14.1.2.3第三层次公允价值价值和期末变动金额

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期末不以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,本基金无需披露的承诺事项。

6.4.14.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需披露的其他事项。

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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	74,711,481.64	89.07
2	固定收益	74,711,481.64	89.07
3	衍生金融资产	-	-
4	金融资产公允价值变动	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
9	合计	149,422,963.28	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	58,747,483.11	69.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,527,438.11	12.51
E	建筑业	-	-
F	批发性零售业	14,139,164.54	16.84
G	交通运输、仓储和邮政业	96,193,961.09	113.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,234,100.00	5.01
J	金融业	4,234,100.00	5.01
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	81,238.14	0.10
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
S	合计	174,711,481.64	206.80

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持有港股通投资股票。

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	000066	长城证券	387,174	6,210,270.06	7.52
2	600133	东部集团	70,100	5,160,160.00	6.17
3	002581	中广核技	806,800	5,116,464.00	6.09
4	600194	广汇能源	130,160	4,314,464.00	5.11
5	600743	华明装备	137,800	4,062,320.00	4.83
6	600000	浦发银行	228,529	4,306,726.54	5.10
7	600048	华彬集团	100,000	4,216,000.00	5.00
8	600382	浙江广厦	226,100	4,004,486.00	4.81
9	600277	宇通客车	417,000	3,790,500.00	4.51
10	600228	佳沃食品	654,000	3,749,100.00	4.44
11	601036	华鲁恒升	866,200	3,736,420.00	4.43
12	600946	晋钢股份	77,714	3,746,037.86	4.43
13	600686	海南高速	111,000	3,716,200.00	4.40
14	601077	正海生物	164,428	3,070,033.88	3.64
15	600761	安徽合力	203,000	3,526,704.00	4.20
16	600936	方正证券	144,000	3,432,480.00	4.09
17	600607	万科A	226,546	2,481,140.00	2.92
18	600061	上海港务	102,422	1,969,491.56	2.31
19	601330	绿庭光伏	4,371	81,238.14	0.10
20	600800	江苏银行	6,384	48,464.00	0.06
21	600890	山东黄金	1,871	80,151.00	0.09
22	602706	东方雨润	1,786	25,103.00	0.03
23	600166	长城军工	9,488	16,478.00	0.02

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	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000066	长城证券	387,174	6,210,270.06	7.52
2	600133	东部集团	70,100	5,160,160.00	6.17
3	002581	中广核技	806,800	5,116,464.00	6.09
4	600194	广汇能源	130,160	4,314,464.00	5.11
5	600743	华明装备	137,800	4,062,320.00	4.83
6	600000	浦发银行	228,529	4,306,726.54	5.10
7	600048	华彬集团	100,000	4,216,000.00	5.00
8	600382	浙江广厦	226,100	4,004,486.00	4.81
9	600277	宇通客车	417,000	3,790,500.00	4.51
10	600228	佳沃食品	654,000	3,749,100.00	4.44
11	601036	华鲁恒升	866,200	3,736,420.00	4.43
12	600946	晋钢股份	77,714	3,746,037.86	4.43
13	600686	海南高速	111,000	3,716,200.00	4.40
14	601077	正海生物	164,428	3,070,033.88	3.64
15	600761	安徽合力	203,000	3,526,704.00	4.20
16	600936	方正证券	144,000	3,432,480.00	4.09
17	600607	万科A	226,546	2,481,140.00	2.92
18	600061	上海港务	102,422	1,969,491.56	2.31
19	601330	绿庭光伏	4,371	81,238.14	0.10
20	600800	江苏银行	6,384	48,464.00	0.06
21	600890	山东黄金	1,871	80,151.00	0.09
22	602706	东方雨润	1,786	25,103.00	0.03
23	600166	长城军工	9,488	16,478.00	0.02

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	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000066	长城证券	387,174	6,210,270.06	7.52
2	600133	东部集团	70,100	5,160,160.00	6.17
3	002581	中广核技	806,800	5,116,464.00	6.09
4	600194	广汇能源	130,160	4,314,464.00	5.11
5	600743	华明装备	137,800	4,062,320.00	4.83
6	600000	浦发银行	228,529	4,306,726.54	5.10
7	600048	华彬集团	100,000	4,216,000.00	5.00
8	600382	浙江广厦	226,100	4,004,486.00	4.81
9	600277	宇通客车	417,000	3,790,500.00	4.51
10	600228	佳沃食品	654,000	3,749,100.00	4.44
11	601036	华鲁恒升	866,200	3,736,420.00	4.43
12	600946	晋钢股份	77,714	3,746,037.86	4.43
13	600686	海南高速	111,000	3,716,200.00	4.40
14	601077	正海生物	164,428	3,070,033.88	3.64
15	600761	安徽合力	203,000	3,526,704.00	4.20
16	600936	方正证券	144,000	3,432,480.00	4.09
17	600607	万科A	226,546	2,481,140.00	2.92
18	600061	上海港务	102,422	1,969,491.56	2.31
19	601330	绿庭光伏	4,371	81,238.14	0.10
20	600800	江苏银行	6,384	48,464.00	0.06
21	600890	山东黄金	1,871	80,151.00	0.09
22	602706	东方雨润	1,786	25,103.00	0.03
23	600166	长城军工	9,488	16,478.00	0.02

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金的“买入金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关费用。

7.4.3.1 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金额(人民币元)
买入股票成本(成交金额)	261,384,076.90
卖出股票收入(成交金额)	198,434,964.66

7.4.3.2 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金额(人民币元)
买入股票成本(成交金额)	261,384,076.90
卖出股票收入(成交金额)	198,434,964.66

7.4.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金额(人民币元)
买入股票成本(成交金额)	261,384,076.90
卖出股票收入(成交金额)	198,434,964.66

7.4.3.4 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金额(人民币元)
买入股票成本(成交金额)	261,384,076.90
卖出股票收入(成交金额)	198,434,964.66

7.4.3.5 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金额(人民币元)
买入股票成本(成交金额)	261,384,076.90
卖出股票收入(成交金额)	198,434,964.66

7.4.3.6 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金额(人民币元)
买入股票成本(成交金额)	261,384,076.90
卖出股票收入(成交金额)	198,434,964.66

7.4.3.7 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金额(人民币元)
买入股票成本(成交金额)	261,384,076.90
卖出股票收入(成交金额)	198,434,964.66

7.4.3.8 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金额(人民币元)
买入股票成本(成交金额)	261,384,076.90
卖出股票收入(成交金额)	198,434,964.66

7.4.3.9 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金额(人民币元)
买入股票成本(成交金额)	261,384,076.90
卖出股票收入(成交金额)	198,434,964.66

7.4.3.10 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金额(人民币元)
买入股票成本(成交金额)	261,384,076.90
卖出股票收入(成交金额)	198,434,964.66

(上接B817版)

-40%，其中，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，权证不高于基金资产净值的3%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下。

6.4.13.4.3其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的中间价格风险来源于资产价格的系统性风险,即与基金投资组合中股票价格的系统性风险相关	
	公允价值变动	对资产负债表日净资产的影响(单位:人民币元)
假设	假设利率变动±50%	0.00
	假设汇率变动±5%	0.00
分析	假设利率变动±50%	-3,486,488