

(上接B116版)

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。

第三层次公允价值初始金额和本期变动金额
本基金在报告期末未持有公允价值归属属于第三层次的金融工具,本基金在报告期末发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 截至资产负债表日,本基金的资产净值为人民币34,454,802.82元,已连续超过90个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元。

(3) 除上述事项外,截至资产负债表日本基金无需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

项目	本期(2018年1月1日至2018年12月31日)	上年度可比期间(2017年1月1日至2017年12月31日)
1.交易性金融资产	-1,130,407,934	2,750,191,326
一般债券投资	-1,130,407,934	2,750,191,326
债券投资	-	-
货币市场投资	-	-
其他	-	-
2.衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3.其他	-	-
减:应交增值税(公允价值变动产生的增值税)	-	-
合计	-1,130,407,934	2,750,191,326

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

金额单位:人民币元

项目名称	本期(2018年1月1日至2018年12月31日)	上年度可比期间(2017年1月1日至2017年12月31日)
1.交易性金融资产	-1,130,407,934	2,750,191,326
一般债券投资	-1,130,407,934	2,750,191,326
债券投资	-	-
货币市场投资	-	-
其他	-	-
2.衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3.其他	-	-
减:应交增值税(公允价值变动产生的增值税)	-	-
合计	-1,130,407,934	2,750,191,326

7.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

金额单位:人民币元

项目	本期(2018年1月1日至2018年12月31日)	上年度可比期间(2017年1月1日至2017年12月31日)
基金管理费收入	19,488.94	9,023.70
转换费收入	1,696.59	876.01
合计	21,344.63	10,079.71

7.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

金额单位:人民币元

项目	本期(2018年1月1日至2018年12月31日)	上年度可比期间(2017年1月1日至2017年12月31日)
1.证券交易费用	970,542.41	1,481,270.52
银行间市场交易费用	-	-
股票交易费用	-	-
基金交易费用	-	-
其中:申购费用	-	-
赎回费用	-	-
卖出回购费用	-	-
合 计	970,542.41	1,481,270.52

7.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

金额单位:人民币元

项目	本期(2018年1月1日至2018年12月31日)	上年度可比期间(2017年1月1日至2017年12月31日)
1.审计费用	30,000.00	30,000.00
信息技术费	100,000.00	100,000.00
通信费/邮费	36,000.00	36,000.00
银行费用	7,346.08	6,196.16
合 计	173,346.08	172,196.16

7.4.7.21 分部报告

截至本报告期末,本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务,因此,无披露的分部报告。

7.4.8 关联方关系

关联方名称

与本基金的关系

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.9 本报告期内及上年度可比期间的关联交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

注:本基金本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.9.1.2 债券交易

注:本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.9.1.3 债券回购交易

注:本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.9.1.4 权证交易

注:本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金于本期及上年度末均无应支付关联方的佣金。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

单位:人民币元

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	600011	华能国际	102,721	1,422,260.08
2	600488	保利地产	96,406	1,398,972.95
3	002444	美康生物	71,800	1,073,410.00
4	000661	中南建设	100,277	1,407,053.07
5	300644	深信服	11,700	1,048,320.00
6	002516	深南电路	12,400	994,108.00
7	001398	工商银行	158,300	837,407.00
8	600647	山东黄海	26,500	801,626.00
9	000636	招商银行	31,153	795,056.00
10	000002	万科A	31,792	767,285.44

7.4.9.2.2 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

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	600799	华友钴业	9,404,277.42	10.11	
2	600698	海螺水泥	8,777,026.31	17.67	
3	600011	华能国际	6,542,047.66	13.17	
4	600690	东方雨虹	6,006,361.04	12.09	
5	600302	华阳国际	5,768,983.21	11.61	
6	002093	华体科技	5,633,817.00	11.34	
7	001398	工商银行	4,512,050.00	10.90	
8	600702	招商银行	4,246,110.00	10.51	
9	600454	深信服	4,104,280.00	10.47	
10	002323	华昌能源	3,949,712.00	10.29	
11	600309	华能国际	3,822,214.24	10.21	
12	600011	华能国际	3,648,200.00	10.05	
13	600698	海螺水泥	3,547,912.00	9.97	
14	600011	华能国际	3,492,000.00	9.87	
15	600011	华能国际	3,400,000.00	9.78	
16	600690	东方雨虹	3,300,000.00	9.68	
17	600302	华阳国际	3,200,000.00	9.58	
18	600011	华能国际	3,100,000.00	9.48	
19	600698	海螺水泥	3,000,000.00	9.38	
20	600011	华能国际	2,900,000.00	9.28	
21	600011	华能国际	2,800,000.00	9.18	
22	600302	华阳国际	2,700,000.00	9.0	