

2. 2 由以上推定

当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等,采用估值技术时,尽可能使用市场参数,减少使用与金融工具自身相关的不可观察参数。

[illegible][illegible]

除支付除息日按上市公司公布的基金份额净值计算的金额扣减由上市公司扣回的持有人所得税后的净额确认为基金资产净值外,基金还有可能采用公允价值计量其他类型的金融资产,公允价值变动虽等公允价值变动形成的公允价值变动损益,但与相关金融资产公允价值变动收入或费用计入投资收益。

4. 其他收入

4.1 基金收入 基金除利息收入外,还可能通过其他途径,经合理估值可能流入与净收入可以可靠计量确认。

7.4.10 费用的确认和计量

1) 基金需按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率逐日计提确认。

2) 基金需按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提确认。

3) 实际回购金融负债利息支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率,自实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率在回购期内逐日计提确认。

5. 费用支出

进行资产、债券、权证等交易过程中产生的交易费用,在发生时按照确定的金额列入费用支出。

6. 其他费用

基金管理人需根据有关法规及相关协议的规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值在第四位,则采用待摊或预提方法。

7.4.11 基金收益的分配政策

1) 基金收益分配的方式或形式:利用再投资方式 指将基金红利按除息日确认的基金份额净值计算其基准自转为基金份额进行再投资,基金份额持有人可选择将现金方式或红利再投资方式;若基金份额持有人事先无明确选择,本基金默认采用再投资方式。

2) 基金收益分配的时间和频率:基金管理人根据基金申购赎回资金流自行安排,当投资者的现金红利大于一定金额,不足以支付赎回或基金份额申购费用时,基金登记机构将投资者的现金红利按权益分配日 1 基金份额净值折算成基金份额计入投资者的基金份额并自动转为基金份额。

3) 基金收益分配比例:基金收益分配比例不低于基金收益,每次分配的基金份额不低于申购费用和申购费补差。

[illegible][illegible]

关联方的名称	与本基金的关系
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、代销机构
博时汇华(集团)有限公司	本基金管理人股东
渤海国际信托有限公司	本基金管理人股东
河北省国有资产控股运营有限公司	本基金管理人股东
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册地代理机构、基金直销机构
中国银河证券股份有限公司	本基金管理人、代销机构

7.4.8 本报告期内无可能对本报告期内的关联交易产生重大影响的关联交易事项。

7.4.9 报告期内无基金从业人员买卖证券的行为。

上述关联交易均在正常业务范围内按照商业条件订立。

本基金报告期内上年度可比期间为2011年12月28日	基金合同生效日	2011年12月31日	本基金未通过关联方交易单独进行证券投资
7.4.8.1.4.2权益类资产			
本基金报告期内上年度可比期间为2011年12月28日	基金合同生效日	2011年12月31日	本基金未通过关联方交易单独进行证券投资
7.4.8.1.4.3固定收益类资产			
本基金报告期内上年度可比期间为2011年12月28日	基金合同生效日	2011年12月31日	本基金未通过关联方交易单独进行证券投资
7.4.8.1.4.4结构化产品			
本基金报告期内上年度可比期间为2011年12月28日	基金合同生效日	2011年12月31日	本基金未通过关联方交易单独进行证券投资
7.4.8.1.4.5其他类资产			
本基金报告期内上年度可比期间为2011年12月28日	基金合同生效日	2011年12月31日	本基金未通过关联方交易单独进行证券投资
7.4.8.1.5基金管理人			
本基金报告期内上年度可比期间为2011年12月28日	基金合同生效日	2011年12月31日	本基金无应付关联方款项的余额。
7.4.8.1.6基金托管费			
本基金报告期内上年度可比期间为2011年12月28日	基金合同生效日	2011年12月31日	本基金无应付关联方款项的余额。
7.4.8.1.7基金管理费			
本基金报告期内上年度可比期间为2011年12月28日	基金合同生效日	2011年12月31日	本基金无应付关联方款项的余额。

单位：人民币元

[illegible]

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月28日至(符合合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	256,763.97	6,902.05
① 基金托管费：基金托管人按照基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ 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 ② 基金销售服务费：基金管理人向基金持有人支付基金销售机构支付，经基金管理人核准后于次月30日前支付给基金销售机构，一次支付给基金销售机构，若遇法定节假日、休市日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付的自然日支付，在支付工作日内。 ③ 7.4.8.3 关联方与关联方进行银行间市场的债券、票据、回购、权证和外汇交易，以及银行间债券市场的债券、回购业务，应同时符合基金合同第12.2.2条基金合同有效期限内2011年12月31日，本基金未与关联方进行银行间市场的债券、票据、回购、权证和外汇交易。		

关联方名称	2012年12月31日		上年度末 2011年12月31日	
	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
东北证券股份有限公司	2,650,890.51	4.74%	-	-

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上期可比期间 2011年12月28日(基金合同生效日至2011年12月31日)		单位:人民币元
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入	
中国国债承销银行 股份有限公司	321,411.39	88,925.91	25,865,199.74	20,669.20	

7.4.9 关联方基金认购期与关联方持有基金份额的情况

7.4.9.1 认购基金份额的关联方名称及持有基金份额的情况

基金认购期末余额未持有因认购未缴足证券而持有未缴足款项的证券。

7.4.9.2 基金认购期末持有因认购未缴足证券而持有未缴足款项的证券。

本报告期末本基金未持有停牌券等流动性受限资产。

7.4.3 银行间市场债券投资

截至本报告期末 2023 年 9 月 30 日，本基金持有的在银行间市场正常交易中属于为质押的债券、7.4.3.2 银行间市场债券明细如下：

7.4.3.2 银行间市场债券明细如下：本基金持有的在交易所市场正常交易中属于为质押的债券、7.4.10(四)下理解并解释公允价值计量重要假设的依据和公允价值计量需要说明的其他事项。

截至本报告期末 2023 年 9 月 30 日，本基金无需要披露的公允价值信息和公允价值计量需要说明的其他事项。

§ 8 投资组合组合分析

8.1 期末基金资产配置情况

序号	项目	金额	余额单位：人民币元 占基金总资产的比例%
1	权益投资	45,804,785.66	77.48

2	用于其他用途	45,840,785.66	77.48
3	用于证券投资	11,515,937.60	19.46
4	其中：债券	11,515,937.60	19.46
5	资产支持证券	—	—
6	金融衍生品投资	—	—
7	买入返售金融资产	—	—
8	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
9	银行存款和结存准备金合计	378,423.86	0.64
10	其他各项资产	1,433,158.03	2.42
11	合计	59,168,307.15	100.00

2.8.2期末按行业分类的股票投资组合

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	2,088,000.00	3.57
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,821,068.16	28.77
D	食品、饮料	-	-
E	纺织、服装、皮毛	-	-
F	木材、家具	2,372,500.00	4.06
G	造纸、印刷	2,220,750.00	3.80
H	石油、化学、塑胶、塑料	925,000.00	1.58
I	电子	-	-

C6	金属、非金属	374,500.00	0.64
C7	机械、设备、仪表	6,128,750.00	10.48
C8	医药、生物制品	4,799,568.16	8.21
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	8,732,468.70	14.94
H	批发和零售业	4,808,920.00	8.22
I	金融、保险业	4,848,878.80	8.39
J	房地产业	2,540,675.00	4.33

K	社会服务业	4,005,000.00	6.85
L	传播与文化产业	1,995,000.00	3.41
M	综合类	-	-
	合计	45,840,785.66	78.40

8.3期末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

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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600837	海通证券	6,902,188.00	2.05
2	600030	中信证券	6,447,236.00	1.92
3	600030	中信证券	6,057,820.00	1.80
4	600066	宇通客车	5,627,759.28	1.68
5	600188	中国铁建	5,127,601.66	1.51
6	600048	保利地产	4,954,365.92	1.47
7	000623	吉林敖东	4,400,520.80	1.33

注：①卖出主要指一级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及发行权益类等证券。	
②卖出主要指二级市场成交金额 成交单价乘以成交数量 填列，不考虑相关交易费用。	
③买入主要指二级市场成交金额 成交单价乘以成交数量 填列，不考虑相关交易费用。	
单位：人民币元	
买入股票的成本（成交）总额	189,485,700.56
卖出股票的收入	150,199,834.06
注：①买入主要指二级市场市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及发行权益类等证券。	
②买入主要指二级市场成交金额 成交单价乘以成交数量 填列，不考虑相关交易费用。	
③卖出主要指二级市场成交金额 成交单价乘以成交数量 填列，不考虑相关交易费用。	
④未按照品种分拆的证券投资损益	金额单位：人民币元

9	合计			11,515,937.60	19.70
6.期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细					
单位：人民币元					
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	04121038	12国富发债 CP001	50,000	5,011,000.00	8.57
2	120318	12国富18	50,000	5,001,500.00	8.55
3	119002	工行转债	13,720	1,503,437.60	2.57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细					

2	应收证券清算款		1,113,243.39
3	应收股利		—
4	应收利息		60,045.46
5	应收申购款		9,869.18
6	其他应收款		—
7	待摊费用		—
8	其他		—
9	合计		1,433,158.03
8.9.4期末持有的处于转股期的可转换债券余额			
			金额单位：人民币元
项目	债券面值	债券余额	公允价值
			五、基金资产净值及资产负债率

9.2 期末基金管理人从事基金业务持有开放式基金的情况	
项目	持有份额总数(份)
基金管理人公司所有从业人员持有本开放式基金	753,708.70
占基金总份额比例	1.35%
注：1) 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金总份额的数量均为：50万份或超过100万份) 2) 本基金基金经理持有该只基金总份额的数量均为：0	
§ 10 开放式基金基金变动	
基金合同生效日(2011年12月28日)基金份额总额	335,865,199.76
单位：份	

[illegible]

券商名称	交易单元 数量	股票交易 成交金额	占当期股票 成交总量的 比例	应付该券商的佣金	占当期佣金 总量的比例	备注
五矿证券有限公司	1	147,215,413.29	43.43%	128,823.55	43.80%	
国信证券股份有限公司	1	172,973,059.02	51.03%	144,335.53	50.25%	
招商证券股份有限公司	1	18,760,682.31	5.35%	17,079.55	5.95%	

注：D类交易的基本佣金率通过券商的交易单元交易规模、权证交易和组合支付券商的佣金合计，不指股票交易佣金。

②交易单元的选择标准和程序：
 1、交易单元的选择标准：
 ①券商注册资本不低于1亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况良好；③交易单元的技术设施符合本所的要求；④券商信誉良好，经营行为规范；⑤前一年度未发生重大违法违规行为；⑥券商具有中国证监会核准的经纪业务资格；⑦券商具有中国证监会核准的融资融券业务资格；⑧券商具有中国证监会核准的IB业务资格；⑨券商具有中国证监会核准的期货业务资格；⑩券商具有中国证监会核准的基金销售业务资格；⑪券商具有中国证监会核准的证券承销业务资格；⑫券商具有中国证监会核准的证券自营业务资格；⑬券商具有中国证监会核准的证券资产管理业务资格；⑭券商具有中国证监会核准的证券经纪业务资格；⑮券商具有中国证监会核准的证券融资融券业务资格；⑯券商具有中国证监会核准的证券IB业务资格；⑰券商具有中国证监会核准的证券期货IB业务资格；⑱券商具有中国证监会核准的证券期货资产管理业务资格；⑲券商具有中国证监会核准的证券期货自营业务资格；⑳券商具有中国证监会核准的证券期货经纪业务资格；㉑券商具有中国证监会核准的证券期货融资融券业务资格；㉒券商具有中国证监会核准的证券期货资产管理业务资格；㉓券商具有中国证监会核准的证券期货自营业务资格；㉔券商具有中国证监会核准的证券期货经纪业务资格；㉕券商具有中国证监会核准的证券期货融资融券业务资格；㉖券商具有中国证监会核准的证券期货资产管理业务资格；㉗券商具有中国证监会核准的证券期货自营业务资格；㉘券商具有中国证监会核准的证券期货经纪业务资格；㉙券商具有中国证监会核准的证券期货融资融券业务资格；㉚券商具有中国证监会核准的证券期货资产管理业务资格；㉛券商具有中国证监会核准的证券期货自营业务资格；㉜券商具有中国证监会核准的证券期货经纪业务资格；㉝券商具有中国证监会核准的证券期货融资融券业务资格；㉞券商具有中国证监会核准的证券期货资产管理业务资格；㉟券商具有中国证监会核准的证券期货自营业务资格；㊱券商具有中国证监会核准的证券期货经纪业务资格；㊲券商具有中国证监会核准的证券期货融资融券业务资格；㊳券商具有中国证监会核准的证券期货资产管理业务资格；㊴券商具有中国证监会核准的证券期货自营业务资格；㊵券商具有中国证监会核准的证券期货经纪业务资格；㊶券商具有中国证监会核准的证券期货融资融券业务资格；㊷券商具有中国证监会核准的证券期货资产管理业务资格；㊸券商具有中国证监会核准的证券期货自营业务资格；㊹券商具有中国证监会核准的证券期货经纪业务资格；㊺券商具有中国证监会核准的证券期货融资融券业务资格；㊻券商具有中国证监会核准的证券期货资产管理业务资格；㊼券商具有中国证监会核准的证券期货自营业务资格；㊽券商具有中国证监会核准的证券期货经纪业务资格；㊾券商具有中国证监会核准的证券期货融资融券业务资格；㊿券商具有中国证监会核准的证券期货资产管理业务资格；

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
平安证券股份有限公司	3,681,396.00	63.34%	1,777,700,000.00	100.00%	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2,130,984.00	36.66%	-	-	-	-

东方基金管理有限责任公司
二〇一三年三月二十七日