（上接827版）

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	837.22	626.61
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	14.50
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	38.82
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1.50	2.70
合计	838.72	682.63

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	208,450.02	223,679.32
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	208,450.02	223,679.32

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	51.54	10.59
预提费用	85,000.00	60,000.00
合计	85,051.54	60,010.59

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,036,115.08	25,036,115.08
本期申购	5,424,885.97	5,424,885.97
本期赎回（以"-"号填列）	-4,618,670.13	-4,618,670.13
本期末	25,842,330.92	25,842,330.92

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,728,423.84	-7,664,389.13	-935,965.29
本期利润	-3,898,294.18	-2,123,082.17	-6,021,376.35
本期基金份额交易产生的变动数	23,544.24	-288,491.74	-264,947.50
其中：基金申购款	904,247.46	-1,810,957.41	-906,709.95
基金赎回款	-880,703.22	1,522,465.67	641,762.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,853,673.90	-10,075,963.04	-7,222,289.14

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
活期存款利息收入	26,748.11	18,546.41
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,312.97	1,485.76
其他	68.65	443.97
合计	29,129.73	20,476.14

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	48,040,116.39	77,573,111.20
减：卖出股票成本总额	51,457,375.61	84,272,182.25
买卖股票差价收入	-3,417,259.22	-6,699,071.05

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	122,151.38	94,082.79
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	122,151.38	94,082.79

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
1.交易性金融资产	-2,123,082.17	-514,451.59
—股票投资	-2,123,082.17	-514,451.59
—债券投资	-	-
—资产支持证券投资	-	-
—基金投资	-	-
—贵金属投资	-	-
—其他	-	-
2.衍生工具	-	-
—权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-2,123,082.17	-514,451.59

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
基金赎回费收入	3,078.77	7,242.92
转换费收入	110.61	11.23
合计	3,189.38	7,254.15

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	123,783.03	238,334.78
银行间市场交易费用	-	-
合计	123,783.03	238,334.78

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
审计费用	55,000.00	60,000.00
信息披露费	90,000.00	90,000.00
汇划手续费	502.30	1,487.29
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	163,502.30	169,487.29

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除7.4.6.2增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
金元顺安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海海富金融信息服务有限公司	基金管理人的股东
上海金元百利资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

7.4.10.1.4 债券交易

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债券交易。

7.4.10.1.5 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	322,889.55	400,717.70
其中：支付销售机构的客户维护费	46,231.24	57,869.04

注：

基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。

计算方法如下：H=E×1.50%÷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，

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	53,814.94	66,786.31

注：

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。

计算方法如下：H=E×0.25%÷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，

基金托管费每日计提，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
基金合同生效日（2009年09月11日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	9,999,200.00	9,999,200.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	9,999,200.00	9,999,200.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	38.69%	39.94%

注：

期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末均未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

7.4.10.5 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01月01日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年01月01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
中国建设银行股份有限公司	4,172,925.03	26,748.11	4,554,299.97	18,546.41

注：

本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2017年度获得的利息收入为人民币2,312.97元（2016年获得的利息收入为人民币1485.76元），2017年末结算备付金余额为人民币0.00元（2016年末结算备付金余额为人民币32,218.21元）。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

7.4.11 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

代码	名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注说明
300040	九洲电气	2017-12-18	重大事项	9.67	2018-01-02	9.67	40,700	439,611.00	393,569.00	-
300109	新开源	2017-03-27	重大资产重组	46.46	2018-01-12	48.88	2,600	122,279.64	120,796.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入公司各个业务层面的全面控制过程之中，并建立了三道防线：以各岗位职责为基础，形成第一道防线；通过相关岗位之间、相关部门之间相互监督制衡，形成第二道防线；由督察长、风险控制委员会、监察稽核部对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务进行监督、检查、评价，形成的第三道防线。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，除附注7.4.12中列示的期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款和存出保证金。

7.4.13.4.11 利率风险敞口

下表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,172,925.03	-	-	-	4,172,925.03
存出保证金	3,251.09	-	-	-	3,251.09
交易性金融资产	-	-	-	14,782,381.00	14,782,381.00
应收利息	-	-	-	838.72	838.72
应收申购款	-	-	-	4,084.86	4,084.86
资产总计	4,176,176.12	-	-	14,787,304.58	18,963,480.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,016.22	22,016.22
应付管理人报酬	-	-	-	23,932.40	23,932.40
应付托管费	-	-	-	3,988.74	3,988.74
应付交易费用	-	-	-	208,450.02	208,450.02
预提费用	-	-	-	85,000.00	85,000.00
应付赎回费	-	-	-	51.54	51.54
负债总计	-	-	-	343,438.92	343,438.92
利率敏感缺口	4,176,176.12	-	-	14,443,865.66	18,620,041.78
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,554,299.97	-	-	-	4,554,299.97
结算备付金	32,218.21	-	-	-	32,218.21
存出保证金	5,923.37	-	-	-	5,923.37
交易性金融资产	-	-	-	19,827,210.68	19,827,210.68
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应收利息	-	-	-	682.63	682.63
应收申购款	-	-	-	3,246.65	3,246.65
资产总计	6,592,441.55	-	-	19,831,139.96	26,423,581.51
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,000,000.00	2,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	3,230.73	3,230.73
应付管理人报酬	-	-	-	31,295.20	31,295.20
应付托管费	-	-	-	5,215.88	5,215.88
应付交易费用	-	-	-	223,679.32	223,679.32
预提费用	-	-	-	60,000.00	60,000.00
应付赎回费	-	-	-	10.59	10.59
负债总计	-	-	-	2,323,431.72	2,323,431.72
利率敏感缺口	6,592,441.55	-	-	17,507,708.24	24,100,149.79

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.12 利率风险的敏感性分析

于2017年12月31日，本基金未持有交易性债券投资（2016年12月31日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016年12月31日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产——股票投资	14,782,381.00	79.39	19,827,210.68	82.27
交易性金融资产——基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产——债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产——贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产——权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	14,782,381.00	79.39	19,827,210.68	82.27

注：

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的60%—95%，债券资产、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%—40%，其中基金保留的现金或投资于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%。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，因与基金投资组合中股票投资的市场系数紧密相关		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
	沪深300指数下跌5%	-619,196.55	-1,482,500.00
	沪深300指数上涨5%	619,196.55	1,482,500.00

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，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

风险价值（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，在一定概率水平（置信度）下，某一金融资产或证券组合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99%的置信水平下采用风险价值模型来管理风险；		
	以7月1日起至资产负债表日止期间的交易日为观察期；		
	假测期间本基金的资产组合的结构保持不变；		
	本基金的基金净值日对数收益率服从正态分布。		
分析	风险价值	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
	合计	4,466,180.35	525,300.00

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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 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银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、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。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 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工具中属于第一层次的余额为人民币14,268,016.00元，属于第二层次的余额人民币为514,365.00，无属于第三层次的余额。（于2016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工具中属于第一层次的余额为人民币16,461847.68元，属于第二层次的余额为人民币3,365,363.00，无属于第三层次的余额。）

7.4.14.1.2.2 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，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。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。

7.4.14.1.2.3 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本期末和上期末均不以第三层次公允价值计量。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金的资产净值为人民币18,620,041.78元，已连续超过个620个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元。本基金资产管理人已就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报送解决方案。本基金资产管理人将积极采取开展持续营销、加大宣传力度、提高投研能力等措施，尽快扭转这一状况。

除此以外，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2018年3月27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

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	14,782,381.00	77.95
	其中：股票	14,782,381.00	77.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
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：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,172,925.03	22.01
8	其他各项资产	8,174.67	0.04
9	合计	18,963,480.70	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	447,037.00	2.40
B	采矿业	362,496.00	1.95
C	制造业	10,296,198.00	55.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	389,372.00	2.09
E	建筑业	97,812.00	0.53
F	批发和零售业	1,177,048.00	6.32
G	交通运输、仓储和邮政业	783,548.00	4.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	471,410.00	2.53
J	金融业	382,500.00	2.05
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	374,960.00	2.01
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	14,782,381.00	79.39

8.2.2 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的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600203	福日电子	50,700	450,216.00	2.42
2	002666	德联集团	72,700	408,574.00	2.19
3	002583	海能达	54,900	404,613.00	2.17
4	002882	龙洲股份	35,600	399,788.00	2.15
5	000698	沈阳化工	67,500	398,925.00	2.14
6	002438	江苏神通	55,600	393,648.00	2.11
7	300040	九洲电气	40,700	393,569.00	2.11
8	000421	南京公用	62,600	389,372.00	2.09
9	600561	江西长运	46,800	383,760.00	2.06
10	000617	中油资本	25,500	382,500.00	2.05
11	000948	南天信息	37,000	379,250.00	2.04
12	002535	林州重机	80,300	379,016.00	2.04
13	300305	裕兴股份	49,400	377,416.00	2.03
14	600128	弘业股份	39,600	375,408.00	2.02
15	601226	华电重工	68,800	374,960.00	2.01
16	002674	兴业科技	36,400	374,920.00	2.01
17	002144	宏达高科	26,700	374,067.00	2.01
18	002328	新朋股份	54,000	371,520.00	2.00
19	600356	恒丰纸业	44,700	371,010.00	1.99
20	600243	青海华鼎	54,300	370,869.00	1.99
21	002566	益盛药业	42,100	367,954.00	1.98
22	002513	蓝丰生化	36,500	366,095.00	1.97
23	000713	丰乐种业	52,900	363,952.00	1.95
24	603979	金诚信	35,400	362,496.00	1.95
25	000880	潍柴重机	39,400	362,480.00	1.95
26	002593	日上集团	82,900	361,444.00	1.94
27	002612	朗姿股份	31,900	357,280.00	1.92
28	600981	汇鸿集团	60,800	351,424.00	1.89
29	300169	天晟新材	57,900	350,295.00	1.88
30	000570	苏宁云商A	62,500	348,750.00	1.87
31	600235	民丰特纸	52,900	347,553.00	1.87
32	600189	吉林森工	47,700	345,348.00	1.85
33	002420	毅昌股份	65,000	342,550.00	1.84
34	600475	华光股份	23,600	341,492.00	1.83
35	300200	高盟新材	34,000	335,920.00	1.80
36	600302	标准股份	55,900	334,282.00	1.80
37	002671	龙泉股份	48,300	330,855.00	1.78
38	300214	日科化学	60,300	305,118.00	1.64
39	300109	新开源	2,600	120,796.00	0.65
40	002426	胜利精密	17,700	103,191.00	0.55
41	002504	*ST弘高	15,600	97,812.00	0.53
42	002669	康达新材	4,200	93,702.00	0.50
43	002619	艾格拉斯	14,400	92,160.00	0.49
44	002006	精功科技	12,400	89,032.00	0.48
45	600975	新五丰	14,500	83,085.00	0.45
46	300163	先锋新材	12,700	73,914.00	0.40

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

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	002535	林州重机	440,547.00	1.83
2	002144	宏达高科	440,313.00	1.83
3	002328	新朋股份	439,946.00	1.83
4	002566	益盛药业	439,879.00	1.83
5	300040	九洲电气	439,611.00	1.82
6	000948	南天信息	439,559.00	1.82
7	002666	德联集团	439,538.00	1.82
8	600356	恒丰纸业	439,455.00	1.82
9	000421	南京公用	439,294.00	1.82
10	600561	江西长运	439,239.00	1.82
11	600235	民丰特纸	439,227.00	1.82
12	002682	龙洲股份	439,172.00	1.82
13	600203	福日电子	439,146.00	1.82
14	600243	青海华鼎	439,112.00	1.82
15	002438	江苏神通	438,090.00	1.82
16	600189	吉林森工	438,912.00	1.82
17	600302	标准股份	438,910.00	1.82
18	002674	兴业科技	438,836.70	1.82
19	000713	丰乐种业	438,706.97	1.82
20	002513	蓝丰生化	438,552.00	1.82

注：

本项的"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。

8.4.2 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

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	600303	曙光股份	1,408,546.00	5.84
2	002664	长鹰信质	1,266,266.00	5.25
3	600552	凯盛科技	1,011,499.00	4.20
4	000631	顺发恒业	316,528.40	1.31
5	600278	东方创业	307,121.00	1.27
6	600141	兴发集团	216,590.00	0.90
7	000921	海信科龙	213,484.00	0.89
8	600755	厦门国贸	209,405.00	0.87
9	600596	新安股份	205,344.00	0.85
10	600859	王府井	194,250.00	0.81
11	600704	物产中大	192,918.00	0.80
12	600597	光明乳业	190,831.00	0.79
13	002236	大华股份	190,034.00	0.79
14	002192	融捷股份	187,102.00	0.78
15	002496	辉丰股份	185,150.00	0.77