

信息披露

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等,应收款项是指在活跃市场中没有报价且回收金额不确定的非衍生金融资产。

金融资产的后续计量以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及其他金融资产。本基金目前暂无金融负债。本基金持有的金融资产在资产负债表日公允价值变动计入当期损益的金融资产,其公允价值变动计入当期损益。本基金持有的其他金融资产在资产负债表日公允价值变动计入当期损益的金融资产,其公允价值变动计入当期损益。

对于公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产和金融负债的公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售金融资产或转移金融负债的价格。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

公允价值计量使用的估值技术包括市场法、成本法和现金流量折现法等。估值技术使用的输入值包括可观察输入值和不可观察输入值。

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

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	601366	中信证券	829,194	3,597,242.26	0.96
2	601299	工商银行	400,000	1,746,000.00	0.48
3	000001	平安银行	200,000	1,620,000.00	0.45
4	002023	银江股份	100,000	1,480,000.00	0.39
5	600048	小天鹅A	100,000	915,000.00	0.25
6	000887	山东黄金	100,000	807,000.00	0.23

注:本基金期末未持有资产支持证券。

8.4 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或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	000001	平安银行	4,276,500.00	0.59
2	601366	中信证券	3,928,375.00	0.56
3	600048	小天鹅A	2,509,847.00	0.35
4	002023	银江股份	1,828,000.00	0.26
5	600136	东信软件	1,998,641.00	0.28
6	600118	华信国际	1,995,424.87	0.28
7	000066	长城汽车	1,840,300.00	0.27
8	601289	中国东航	1,825,000.00	0.27
9	000129	工商银行	1,912,519.00	0.27
10	000050	中国联通	1,919,877.66	0.27
11	000751	广生堂	1,900,000.00	0.27
12	000998	华鲁恒升	1,847,000.00	0.26
13	000080	中信银行	1,752,822.00	0.25
14	600637	恒顺醋业	1,300,000.00	0.18
15	600579	汇金股份	1,254,296.50	0.17
16	000887	山东黄金	1,246,278.80	0.17
17	000428	华信国际	1,151,101.20	0.16
18	600108	华鲁恒升	954,000.00	0.13
19	002004	华信国际	904,000.00	0.12
20	004229	华信国际	809,939.00	0.11

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或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	600060	海信电器	2,409,722.42	0.35
2	600004	鹏都钢	2,208,468.20	0.31
3	600316	鲁南钨业	1,812,492.06	0.25
4	600118	华信国际	1,792,349.00	0.25
5	002073	银江股份	1,273,043.87	0.23
6	000066	长城汽车	1,248,879.07	0.24
7	000050	中国联通	1,248,844.00	0.24
8	002095	汇金股份	1,593,541.00	0.22
9	000880	海信电器	1,044,174.95	0.21
10	600057	汇金股份	1,118,972.41	0.16
11	002528	华信国际	1,077,144.22	0.15
12	600637	恒顺醋业	1,062,293.95	0.15
13	002004	华信国际	984,000.00	0.13
14	000418	小天鹅A	959,075.16	0.13
15	002194	华信国际	925,807.48	0.13
16	000025	华信国际	760,514.00	0.11
17	002429	华信国际	712,884.00	0.10
18	000000	华信国际	645,568.70	0.09
19	000887	山东黄金	415,555.01	0.06

8.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

买入股票成本(元)	卖出股票收入(元)
23,269,678.70	23,269,678.70

注:本报告期1.1.4.2.4.2.4.3买入的“买入金额”或“买入股票成本”、“卖出金额”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交金额含交易费用)填写,不包括印花税。

8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	金融债	-	-
3	企业债	-	-
4	央行票据	-	-
5	中期票据	10,000,000.00	2.70
6	同业拆借	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他	66,111,724.00	17.87
9	合计	10,000,000.00	2.70

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

8.10.3 本期股指期货投资评价

8.10.4 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.5 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.6 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.7 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.8 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.9 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.10 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.11 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.12 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.13 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.14 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.15 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.16 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.17 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.18 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.19 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.20 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.21 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.22 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.23 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.24 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.25 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.26 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.27 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.28 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.29 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.30 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.31 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.32 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.33 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.34 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.35 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.36 股指期货投资对基金资产净值的影响

8.10.37 股指期货投资对基金资产净值的影响

27	002230	科大讯飞	8,891,561.12	5.43
28	300284	朗科存储	8,838,699.77	5.38
29	601002	晋煤蓝天	8,776,641.10	5.34
30	000955	海通证券	8,711,037.89	5.30
31	000009	深宝安A	8,681,616.60	5.29
32	000502	中国国旅	8,656,913.92	5.24
33	002883	广弘济信	8,603,245.99	5.20
34	601097	华谊兄弟	8,578,026.01	5.20
35	600848	天仪股份	8,517,966.53	5.14
36	300324	华信国际	8,485,222.00	5.12
37	002678	金安国医	8,318,739.00	5.11
38	000915	山东黄金	8,203,465.82	5.00
39	601118	华信国际	8,200,412.20	5.00
40	000411	美锦能源	8,158,168.50	4.98
41	000515	ST华信	8,126,466.00	4.90
42	600709	华信国际	8,092,029.00	