

(上接B111版)

六、基金资产净值的计算方法和公告方式
(一)估值方法
1. 证券交易所上市的价值证券的估值(本基金合同在证券交易所上市的价值证券包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值;
(2)交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(本基金合同另有规定的除外),选取估值日第三方估值机构提供的相应品种的公允价值估值;
(3)对在交易所上市交易的可转换债券,选取每日收盘价进行估值;
(4)交易所上市不存在活跃市场的价值证券,采用估值技术确定公允价值,交易所上市的价值证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:
(1)送股、转增股、配股和公开增发新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场价格估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;
(2)首次公开发行未上市的可转债和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;
(3)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值;对于活跃市场报价无法代表计量日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整,确认计量日的公允价值;对于不存在活跃市场且报价较少的品种,则采用估值技术确定公允价值;
(4)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的一级市场的估值方法进行估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3. 对在二级市场交易的不含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的公允价值估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的公允价值估值;对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的公允价值估值;对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的公允价值估值;对银行间市场上含权的固定收益品种的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异,且上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。
4. 同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的,按债券或股票所处的市场分别估值。
5. 中小企业私募债券采用估值技术确定公允价值,估值技术难以确定和计量其公允价值的,按成本估值。
6. 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值;对于活跃市场报价无法代表计量日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整,确认计量日的公允价值;对于不存在活跃市场且报价较少的品种,则采用估值技术确定公允价值;

7. 本基金投资股指期货合约,一般以股指期货当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。
8. 本基金投资股指期货合约,一般以股指期货当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。
9. 国债期货合约以估值日的结算价估值。估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日后结算价估值,从其规定。

10. 估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的,将依据下列信息提供机构提供的汇率为准:当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率的中间价,或者可以取得公允价值且较为可靠的权威机构提供的信息。
11. 当本基金发生重大申购赎回赎回情形时,本基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。
12. 如有确凿证据表明按上述方法对基金估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。
13. 相关法律法规及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定处理。
如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经双方平等协商解决,基金管理人和基金托管人仍应达成一致意见。按照基金管理人于基金资产净值的计算结果对外予以公布。
(二)估值程序

1. 估值程序
2. 估值程序

3. 估值程序

4. 估值程序

5. 估值程序

6. 估值程序

7. 估值程序

8. 估值程序

9. 估值程序

10. 估值程序

11. 估值程序

12. 估值程序

13. 估值程序

14. 估值程序

15. 估值程序

16. 估值程序

17. 估值程序

18. 估值程序

19. 估值程序

20. 估值程序

21. 估值程序

22. 估值程序

23. 估值程序

24. 估值程序

25. 估值程序

26. 估值程序

27. 估值程序

28. 估值程序

29. 估值程序

30. 估值程序

31. 估值程序

32. 估值程序

33. 估值程序

34. 估值程序

35. 估值程序

36. 估值程序

37. 估值程序

1. 基金估值程序
2. 基金估值程序
3. 基金估值程序
4. 基金估值程序
5. 基金估值程序
6. 基金估值程序
7. 基金估值程序
8. 基金估值程序
9. 基金估值程序
10. 基金估值程序
11. 基金估值程序
12. 基金估值程序
13. 基金估值程序
14. 基金估值程序
15. 基金估值程序
16. 基金估值程序
17. 基金估值程序
18. 基金估值程序
19. 基金估值程序
20. 基金估值程序
21. 基金估值程序
22. 基金估值程序
23. 基金估值程序
24. 基金估值程序
25. 基金估值程序
26. 基金估值程序
27. 基金估值程序
28. 基金估值程序
29. 基金估值程序
30. 基金估值程序
31. 基金估值程序
32. 基金估值程序
33. 基金估值程序
34. 基金估值程序
35. 基金估值程序
36. 基金估值程序
37. 基金估值程序
38. 基金估值程序
39. 基金估值程序
40. 基金估值程序
41. 基金估值程序
42. 基金估值程序
43. 基金估值程序
44. 基金估值程序
45. 基金估值程序
46. 基金估值程序
47. 基金估值程序
48. 基金估值程序
49. 基金估值程序
50. 基金估值程序
51. 基金估值程序
52. 基金估值程序
53. 基金估值程序
54. 基金估值程序
55. 基金估值程序
56. 基金估值程序
57. 基金估值程序
58. 基金估值程序
59. 基金估值程序
60. 基金估值程序
61. 基金估值程序
62. 基金估值程序
63. 基金估值程序
64. 基金估值程序
65. 基金估值程序
66. 基金估值程序
67. 基金估值程序
68. 基金估值程序
69. 基金估值程序
70. 基金估值程序
71. 基金估值程序
72. 基金估值程序
73. 基金估值程序
74. 基金估值程序
75. 基金估值程序
76. 基金估值程序
77. 基金估值程序
78. 基金估值程序
79. 基金估值程序
80. 基金估值程序
81. 基金估值程序
82. 基金估值程序
83. 基金估值程序
84. 基金估值程序
85. 基金估值程序
86. 基金估值程序
87. 基金估值程序
88. 基金估值程序
89. 基金估值程序
90. 基金估值程序
91. 基金估值程序
92. 基金估值程序
93. 基金估值程序
94. 基金估值程序
95. 基金估值程序
96. 基金估值程序
97. 基金估值程序
98. 基金估值程序
99. 基金估值程序
100. 基金估值程序

7. 基金估值程序

8. 基金估值程序

9. 基金估值程序

10. 基金估值程序

11. 基金估值程序

12. 基金估值程序

13. 基金估值程序

14. 基金估值程序

15. 基金估值程序

16. 基金估值程序

17. 基金估值程序

18. 基金估值程序

19. 基金估值程序

20. 基金估值程序

21. 基金估值程序

22. 基金估值程序

23. 基金估值程序

24. 基金估值程序

25. 基金估值程序

26. 基金估值程序

27. 基金估值程序

28. 基金估值程序

29. 基金估值程序

30. 基金估值程序

31. 基金估值程序

32. 基金估值程序

33. 基金估值程序

34. 基金估值程序

35. 基金估值程序

36. 基金估值程序

37. 基金估值程序

38. 基金估值程序

39. 基金估值程序

40. 基金估值程序

41. 基金估值程序

42. 基金估值程序

43. 基金估值程序

44. 基金估值程序

45. 基金估值程序

46. 基金估值程序

47. 基金估值程序

48. 基金估值程序

49. 基金估值程序

50. 基金估值程序

51. 基金估值程序

52. 基金估值程序

53. 基金估值程序

54. 基金估值程序

55. 基金估值程序

56. 基金估值程序

57. 基金估值程序

58. 基金估值程序

59. 基金估值程序

《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1. 《基金合同》经基金管理人、基金托管人及基金投资者三方代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续,并经中国证监会书面确认后生效。

2. 《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3. 《基金合同》自生效之日起即具有法律约束力,基金管理人和基金持有人均须遵守《基金合同》各当事人具有同等的法律约束力。

4. 《基金合同》正本一式六份,除上列各方各执一份外,基金管理人、基金托管人各持二份,每份具有同等的法律效力。

5. 《基金合同》可印制或翻印,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

七、基金费用
(一)基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的与基金募集活动有关的律师费、审计费以及其他费用,不从基金资产中支付,其他基金服务机构根据本基金招募说明书规定的费率收取认购费。

(二)基金上市前重要事项
本基金募集期间上市交易公告书公告前无重要事项发生。

(三)基金资产净值表
本基金2018年6月12日资产负债表如下:

资产:
银行存款 397,955,778.08
其他货币资金 2,090,944.72
持有待售金融资产 3,941.21
交易性金融资产 85,328,158.36
买入返售金融资产 85,328,158.36
基金投资
债券投资
资产支持证券投资
衍生金融资产
买入返售金融资产 29,000,000.00
应收证券清算款 14,401,089.95
应收利息 782,245.35
应收股利
应收申购款
其他资产
资产总计 751,402,157.67
负债:
短期借款
应付短期融资券
应付债券
应付利息
应付股利
应付赎回款
其他负债
负债合计 8,847,012.07
所有者权益:
实收资本 379,196,052.24
未分配利润 742,555,145.60
所有者权益合计 742,555,145.60
负债和所有者权益总计 751,402,157.67

(四)基金费用
清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五)基金财产清算剩余资产的分配
依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用,交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六)基金财产清算的公告
清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七)基金财产清算账册及文件的保存
基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

各方当事人同意,因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为北京市,仲裁裁决是终局的并对各方当事人具有约束力,仲裁费败诉方承担。

争议处理期间,相关各方当事人应恪守基金管理人及基金托管人职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。
九、基金合同效力

截止至2018年6月12日,本基金的投资组合如下:
(一) 基金资产组合情况

(二) 按行业分类的股票投资组合

(三) 按行业分类的股票投资组合

(四) 按行业分类的股票投资组合

(五) 按行业分类的股票投资组合

(六) 按行业分类的股票投资组合

(七) 按行业分类的股票投资组合

(八) 按行业分类的股票投资组合

(九) 按行业分类的股票投资组合

(十) 按行业分类的股票投资组合

(十一) 按行业分类的股票投资组合

(十二) 按行业分类的股票投资组合

(十三) 按行业分类的股票投资组合

(十四) 按行业分类的股票投资组合

(十五) 按行业分类的股票投资组合

(十六) 按行业分类的股票投资组合

(十七) 按行业分类的股票投资组合

(十八) 按行业分类的股票投资组合

(十九) 按行业分类的股票投资组合

(二十) 按行业分类的股票投资组合

(二十一) 按行业分类的股票投资组合

(二十二) 按行业分类的股票投资组合

(二十三) 按行业分类的股票投资组合

(二十四) 按行业分类的股票投资组合

(二十五) 按行业分类的股票投资组合

(二十六) 按行业分类的股票投资组合

(二十七) 按行业分类的股票投资组合

(二十八) 按行业分类的股票投资组合

(二十九) 按行业分类的股票投资组合

(三十) 按行业分类的股票投资组合

(三十一) 按行业分类的股票投资组合

(三十二) 按行业分类的股票投资组合

(三十三) 按行业分类的股票投资组合

(三十四) 按行业分类的股票投资组合

(三十五) 按行业分类的股票投资组合

(三十六) 按行业分类的股票投资组合

(三十七) 按行业分类的股票投资组合

(三十八) 按行业分类的股票投资组合

资产类别 市值(元) 占总资产比例(%)

股票 85,328,158.36 11.30%

债券 85,328,158.36 11.30%

基金投资

资产支持证券

衍生金融资产

买入返售金融资产

应收证券清算款

应收利息

应收股利

应收申购款

其他资产

资产总计

负债:

短期借款

应付短期融资券

应付债券

应付利息

应付股利

应付赎回款

其他负债

负债合计

所有者权益:

实收资本

未分配利润

所有者权益合计

负债和所有者权益总计

(二) 按行业分类的股票投资组合

(三) 按行业分类的股票投资组合

(四) 按行业分类的股票投资组合

(五) 按行业分类的股票投资组合

(六) 按行业分类的股票投资组合

(七) 按行业分类的股票投资组合

(八) 按行业分类的股票投资组合

(九) 按行业分类的股票投资组合

(十) 按行业分类的股票投资组合

(十一) 按行业分类的股票投资组合

(十二) 按行业分类的股票投资组合

(十三) 按行业分类的股票投资组合

(十四) 按行业分类的股票投资组合

(十五) 按行业分类的股票投资组合

(十六) 按行业分类的股票投资组合

(十七) 按行业分类的股票投资组合

(十八) 按行业分类的股票投资组合

(十九) 按行业分类的股票投资组合

(二十) 按行业分类的股票投资组合

(二十一) 按行业分类的股票投资组合

(二十二) 按行业分类的股票投资组合

(二十三) 按行业分类的股票投资组合

(二十四) 按行业分类的股票投资组合

(二十五) 按行业分类的股票投资组合

(二十六) 按行业分类的股票投资组合

(二十七) 按行业分类的股票投资组合

(二十八) 按行业分类的股票投资组合

(二十九) 按行业分类的股票投资组合

6.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

6.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库。

6.3 其他说明

九、重大事件提示

6.4 持有者于转股期间可转换债券期限

6.5 持有者于转股期间可转换债券期限

6.6 持有者于转股期间可转换债券期限

6.7 持有者于转股期间可转换债券期限

6.8 持有者于转股期间可转换债券期限

6.9 持有者于转股期间可