

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值
(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应收款项和其他金融负债,其账面价值接近于公允价值。
(2) 以公允价值计量的金融工具
① 金融工具公允价值计量的方法
本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债,其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量的重要性,被划分为三个层次:
第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。
② 各层级金融工具公允价值
本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的金額为人民币36,022,126.22元,属于第二层次的金額为人民币1,785,373.00元,无属于第三层次的金額。本基金合同于2016年12月29日生效,无上年同期数据。
③ 公允价值所属层级的重大变动
对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值技术对公允价值进行最佳估计,列入第二层次或第三层次。
本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具,在第一层次和第二层次之间无重大转换。
2. 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项

8.1 期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

8.4 报告期末股票投资组合的重大变动

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额

8.12.4 期末持有处于转股期的可转换债券

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

9.1 期末基金资产持有人信息

Table with 4 columns: 项目, 份额级别, 持有份额(份), 占基金总份额比例(%)

9.2 期末基金资产持有人的从业人数持有本基金的情况

Table with 4 columns: 项目, 份额级别, 持有份额(份), 占基金总份额比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

“买入金额”按买入成交金额(成交单乘以成交数量)填写,不考虑相关交易费用。8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额(成交单乘以成交数量)填写,不考虑交易费用。8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

中融基金管理有限公司 二〇一八年三月三十日