

中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	49
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
7.3 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.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	72
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	74
7.6 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明细.....	74
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	74
7.8 报告期末按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.....	74
7.9 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.....	75
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	75
7.12 投资组合报告附注.....	75
§8 基金份额持有人信息.....	77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	77
§9 开放式基金份额变动.....	78
§10 重大事件揭示.....	79
10.1 基金份额持有人大会决议.....	79
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
10.4 基金投资策略的改变.....	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
10.8 其他重大事件.....	81
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	83

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	85
§12 备查文件目录.....	86
12.1 备查文件目录.....	86
12.2 存放地点.....	86
12.3 查阅方式.....	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中金丰鸿	
基金主代码	004712	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 7 月 7 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	100,917,178.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中金丰鸿 A	中金丰鸿 C
下属分级基金的交易代码:	004712	004713
报告期末下属分级基金的份额总额	100,890,203.05 份	26,975.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金使用资产的配置策略在债券及股票之间进行资产配置。债券部分的投资通过对于期限、久期、流动性和收益的管理，尽量做到满足流动性要求的前提下提高收益和安全性。股票部分的投资借助于量化的投资模型进行选股，严格按照模型进行投资，强调投资的纪律，降低随意性投资带来的风险。同时进行股票的打新操作，增强收益，力争基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×50%+中债综合财富（总值）指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中金基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李虹
	联系电话	010-63211122
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com
客户服务电话	400-868-1166	95511-3
传真	010-66159121	0755-82080387
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

	层	
邮政编码	100032	518001
法定代表人	林寿康	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	中金丰鸿 A	中金丰鸿 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	5,272,699.85	26,186.74
本期利润	-4,571,323.37	49,950.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0348	0.0533
本期加权平均净值利润率	-3.31%	5.00%
本期基金份额净值增长率	-5.42%	-6.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配利润	-750,616.79	-468.11
期末可供分配基金份额利润	-0.0074	-0.0174
期末基金资产净值	100,139,586.26	26,507.08
期末基金份额净值	0.9926	0.9826
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-0.74%	-1.74%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金丰鸿 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.84%	0.92%	-4.39%	0.92%	0.55%	0.00%
过去三个月	-5.83%	0.70%	-6.59%	0.69%	0.76%	0.01%
过去六个月	-5.42%	0.65%	-6.58%	0.72%	1.16%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-0.74%	0.49%	-5.96%	0.61%	5.22%	-0.12%

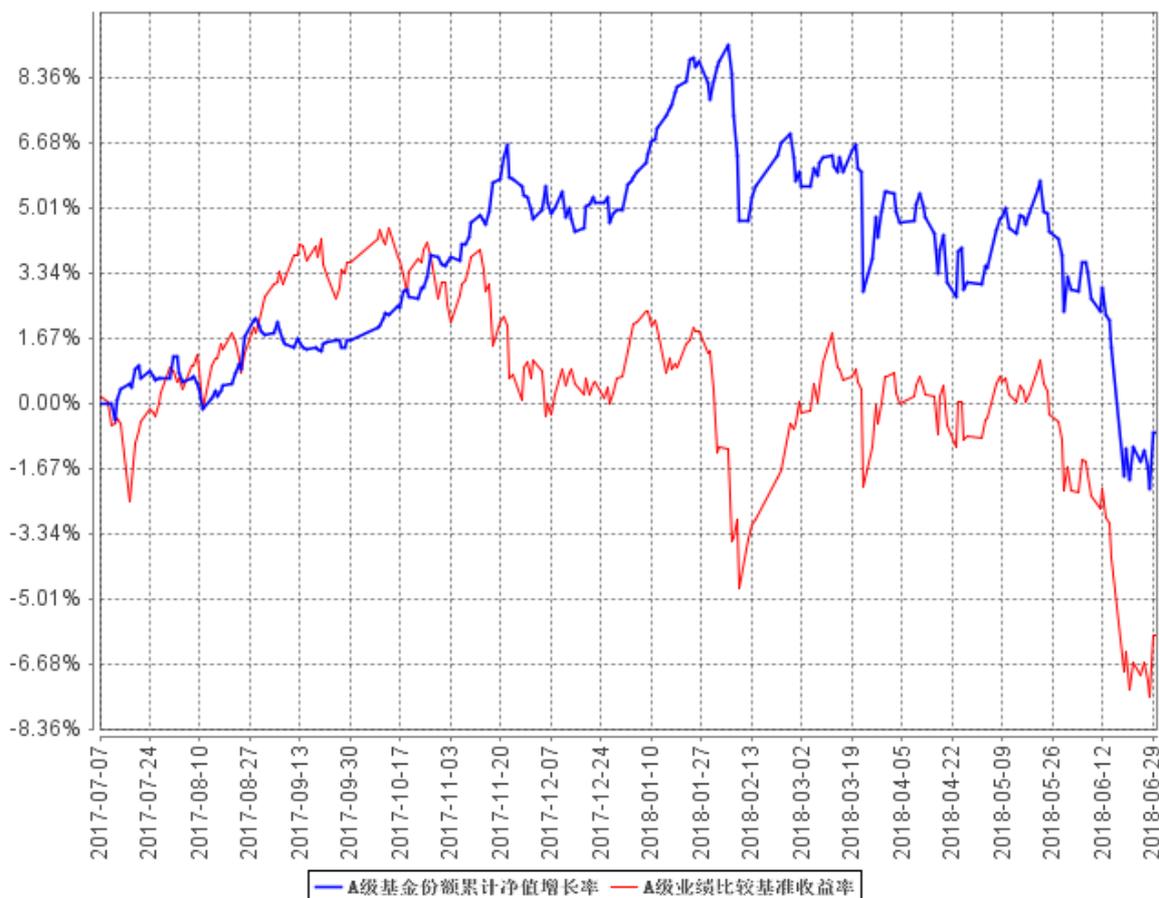
中金丰鸿 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.89%	0.92%	-4.39%	0.92%	0.50%	0.00%
过去三个月	-5.97%	0.70%	-6.59%	0.69%	0.62%	0.01%

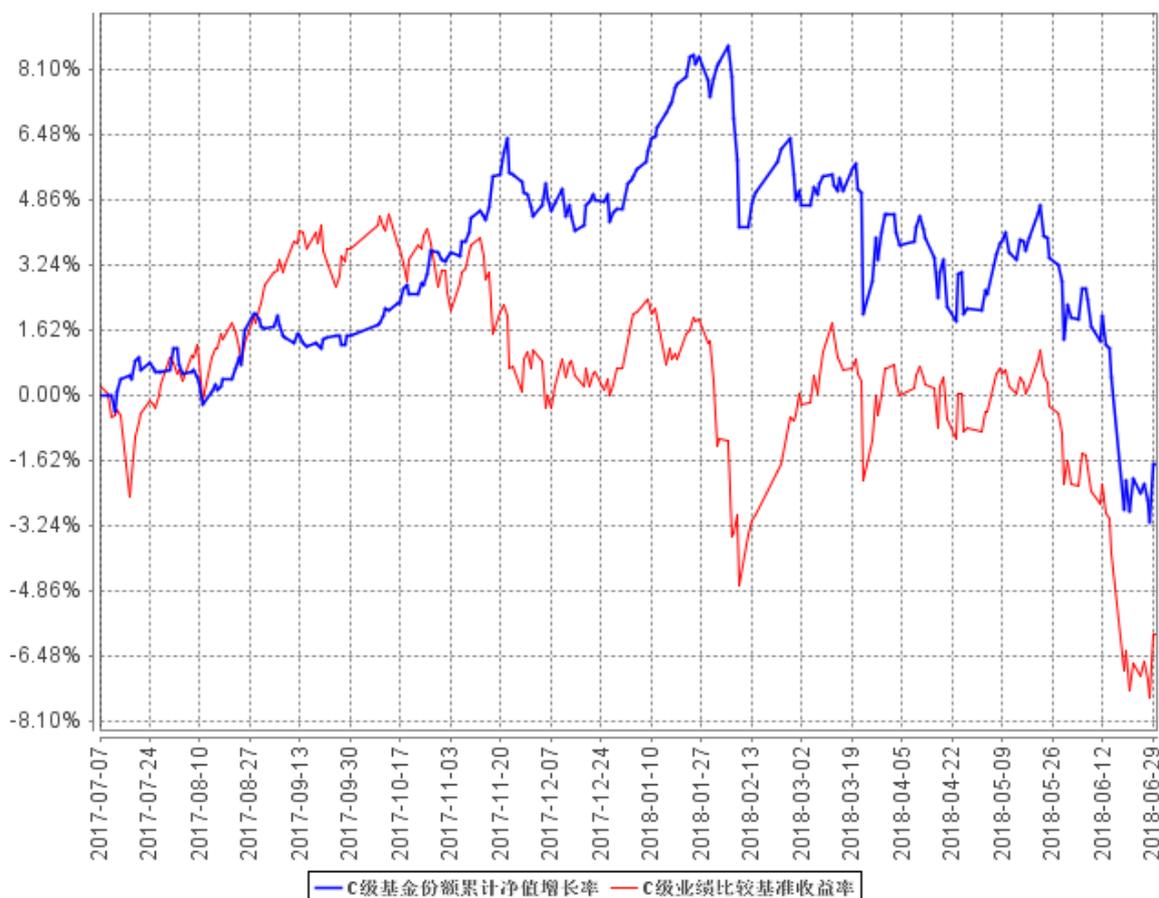
过去六个月	-6.09%	0.65%	-6.58%	0.72%	0.49%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-1.74%	0.50%	-5.96%	0.61%	4.22%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日。按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 2.5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层。

截至 2018 年 6 月 30 日，公司共管理 19 支开放式基金，证券投资基金管理规模 145.22 亿。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石玉	本基金基金经理	2017 年 7 月 7 日	-	11 年	石玉女士，管理学硕士。历任中国科技证券、联合证券职员，天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员，中国国际金融股份有限公司资产管理部高级研究员、基金经理助理、投资经理，现任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理，执行总经理。
郭党钰	本基金基金经理	2017 年 7 月 7 日	-	16 年	郭党钰先生，工商管理硕士。历任宁波镇海炼化投资经理；华泰证券项目经理；德恒证券高级经理；华策投资有限公司投资副总经理；招商基金管理有限公司投资经理，现任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理、执行总经理。
刘重晋	本基金基金经理	2017 年 8 月 2 日	-	7 年	刘重晋先生，博士。历任松河投资咨询（深圳）有

	理				限公司任副总经理、量化研究员。现任中金基金管理有限公司量化投资部基金经理、高级经理。
闫雯雯	本基金基金经理助理	2017年8月24日	-	10年	闫雯雯女士，工商管理硕士。曾任泰康资产管理有限公司国际投资部、信用评估部研究员，现任中金基金管理有限公司固定收益研究主管。

注：1、对本基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为本基金管理人对外披露的基金经理离任日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”为本基金管理人对外披露的任免日期。

2、本基金基金经理助理的任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

3、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来，A 股市场出现了较大幅度的下跌，沪深 300 指数从 4030 点下跌至 3510 点，下跌幅度达 12.9%，中证 500 指数从 6250 点下跌至 5217 点，下跌幅度达 16.5%，市场整体表现比较悲观。

本基金股票和债券整体各占 50%仓位，股票部分仍然采用量化选股的投资策略，在不同的维度上进行投资组合的构建，利用基本面指标、技术面指标及情绪面指标等综合确定组合权重。在二季度内，盈利因子、价值因子等表现较好，虽然市场整体下跌，但量化策略整体跑赢了基准。债券部分我们主要配置 1 年左右到期的信用等级较高的债券。接下来，我们会密切监控市场变化以及策略表现，积极应对，在控制风险的同时尽可能获得更好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金丰鸿 A 基金份额净值为 0.9926 元，本报告期基金份额净值增长率为 -5.42%；截至本报告期末中金丰鸿 C 基金份额净值为 0.9826 元，本报告期基金份额净值增长率为 -6.09%；同期业绩比较基准收益率为 -6.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一季度，贸易战在一段时间内仍然会对市场造成一定影响，金融监管环境及宏观的货币政策有略微放松的趋势，仍需耐心等待与观察。当前市场环境下，盈利能力强、盈利稳定、经营质量好的公司更占优势，需要我们更加关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、

风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中金基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	576,686.27	156,208.16
结算备付金		1,066,745.34	1,109,445.61
存出保证金		48,559.71	37,266.39
交易性金融资产	6.4.7.2	59,987,835.91	188,493,215.50
其中：股票投资		50,407,440.91	62,921,745.50
基金投资		-	-
债券投资		9,580,395.00	125,571,470.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	38,700,000.00	2,900,000.00
应收证券清算款		250,882.34	-
应收利息	6.4.7.5	107,456.00	3,272,562.11
应收股利		-	-
应收申购款		749.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		100,738,914.57	195,968,697.77
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,147.04	95,194.74
应付赎回款		4,497.54	219.20
应付管理人报酬		125,796.26	248,853.47
应付托管费		8,386.39	16,590.26
应付销售服务费		15.54	1,652.82
应付交易费用	6.4.7.7	282,749.59	56,192.27
应交税费		5,133.12	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	143,095.75	200,000.52
负债合计		572,821.23	618,703.28
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	100,917,178.24	186,146,261.49
未分配利润	6.4.7.10	-751,084.90	9,203,733.00
所有者权益合计		100,166,093.34	195,349,994.49
负债和所有者权益总计		100,738,914.57	195,968,697.77

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，中金丰鸿 A 基金份额净值 0.9926 元，基金份额总额 100890203.05 份；中金丰鸿 C 基金份额净值 0.9826 元，基金份额总额 26975.19 份。中金丰鸿份额总额合计为 100917178.24 份。

6.2 利润表

会计主体：中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		-2,669,545.34
1.利息收入		2,925,414.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,519.61
债券利息收入		2,685,922.51
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		218,972.60
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,038,583.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,299,702.68
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-715,953.39
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	454,834.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-9,820,259.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	186,716.11
减：二、费用		1,851,827.86

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,040,202.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	69,346.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,180.27
4. 交易费用	6.4.7.18	511,029.89
5. 利息支出		107,272.23
其中：卖出回购金融资产支出		107,272.23
6. 税金及附加		9,100.90
7. 其他费用	6.4.7.19	111,695.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,521,373.20
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,521,373.20

注：本基金成立日期为 2017 年 7 月 7 日，本报告期无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	186,146,261.49	9,203,733.00	195,349,994.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,521,373.20	-4,521,373.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-85,229,083.25	-5,433,444.70	-90,662,527.95
其中：1.基金申购款	59,379,176.81	4,700,729.85	64,079,906.66
2.基金赎回款	-144,608,260.06	-10,134,174.55	-154,742,434.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益 (基金净值)	100,917,178.24	-751,084.90	100,166,093.34
---------------------	----------------	-------------	----------------

注：本基金成立日期为 2017 年 7 月 7 日，本报告期无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>孙菁</u>	<u>张纳</u>	<u>白娜</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2017 年 5 月 10 日证监许可 [2017] 672 号《关于准予中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式混合型证券投资基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）。

本基金通过中金基金管理有限公司直销柜台及中金基金网上直销平台进行销售，募集期为 2017 年 5 月 23 日至 2017 年 7 月 4 日。经向中国证监会备案，《中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 7 月 7 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 203,076,877.94 份，发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据经中国证监会备案的《中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购 / 申购时，收取认购 / 申购费用，但从本类别基金资产中不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取认购 / 申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况、自 2017 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表涵盖期间为自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

(2) 应收款项以实际利率法按摊余成本计量；

(3) 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

(1) 所转移金融资产的账面价值；

(2) 因转移而收到的对价。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比

例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 /（未弥补亏损）”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益 /（损失）核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 20%，若《中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告 [2017] 13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发 [2017] 6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值

日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (1) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (2) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试

点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	576,686.27
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	576,686.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	54,994,676.06	50,407,440.91	-4,587,235.15
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,560,365.11	5,562,795.00
	银行间市场	4,013,111.02	4,017,600.00
	合计	9,573,476.13	9,580,395.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	64,568,152.19	59,987,835.91	-4,580,316.28

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 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 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
买入返售金融资产 上交所	38,700,000.00	-
合计	38,700,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	290.17
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	480.00
应收债券利息	113,120.28
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-6,456.35
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	21.90
合计	107,456.00

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	281,703.46
银行间市场应付交易费用	1,046.13
合计	282,749.59

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.02
应付审计费用	33,588.36
应付信息披露费	109,507.37
合计	143,095.75

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金丰鸿 A		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	183,050,325.62	183,050,325.62
本期申购	59,336,088.04	59,336,088.04
本期赎回(以“-”号填列)	-141,496,210.61	-141,496,210.61
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	100,890,203.05	100,890,203.05

金额单位：人民币元

中金丰鸿 C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,095,935.87	3,095,935.87
本期申购	43,088.77	43,088.77
本期赎回(以“-”号填列)	-3,112,049.45	-3,112,049.45
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	26,975.19	26,975.19

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金丰鸿 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,931,938.67	5,128,606.27	9,060,544.94
本期利润	5,272,699.85	-9,844,023.22	-4,571,323.37
本期基金份额交易产生的变动数	-3,189,983.85	-2,049,854.51	-5,239,838.36
其中：基金申购款	1,563,132.79	3,134,585.83	4,697,718.62
基金赎回款	-4,753,116.64	-5,184,440.34	-9,937,556.98

本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,014,654.67	-6,765,271.46	-750,616.79

单位：人民币元

中金丰鸿 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	56,566.64	86,621.42	143,188.06
本期利润	26,186.74	23,763.43	49,950.17
本期基金份额交易产生的变动数	-81,434.66	-112,171.68	-193,606.34
其中：基金申购款	1,066.91	1,944.32	3,011.23
基金赎回款	-82,501.57	-114,116.00	-196,617.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,318.72	-1,786.83	-468.11

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	14,018.90
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	6,222.19
其他	278.52
合计	20,519.61

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	194,453,260.37
减：卖出股票成本总额	190,153,557.69
买卖股票差价收入	4,299,702.68

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-715,953.39
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-715,953.39

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	238,049,505.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	231,384,167.34
减：应收利息总额	7,381,291.17
买卖债券差价收入	-715,953.39

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	454,834.33
基金投资产生的股利收益	-
合计	454,834.33

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-9,820,259.79
——股票投资	-10,155,769.42
——债券投资	335,509.63
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-9,820,259.79

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	186,716.11
其他	-
合计	186,716.11

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	508,294.89
银行间市场交易费用	2,735.00
合计	511,029.89

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	33,588.36
信息披露费	59,507.37
上清所证书费用	600.00
帐户维护费	18,000.00
合计	111,695.73

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截止资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金本报告披露日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金管理有限公司（“中金基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期无应付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,040,202.09
其中：支付销售机构的客户维护费	159.27

注：1、支付基金管理人中金基金管理有限公司的基本管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基本管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	69,346.75

注：1、支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金丰鸿 A	中金丰鸿 C	合计
中金基金	-	3,056.23	3,056.23
合计	-	3,056.23	3,056.23

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；

2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.60% 的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：C 类基

金份额每日应计提的销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.60% / 当年天数。

3、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行	576,686.27	14,018.90

注：1、本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金通过“平安银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于 2018 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 1,115,305.05 元，本期间产生的利息收入为人民币 6,500.71 元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018年6月30日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

				数量（单位：份）	总金额
中金公司	601138	工业富联	网上发行	2,000	27,540.00

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	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
002051	中工国际	2018年4月9日	重大资产重组	15.27	-	-	26,600	443,008.07	406,182.00	-
000669	金鸿控股	2018年5月18日	重大资产重组	7.25	2018年8月6日	6.53	54,180	423,853.06	392,805.00	-
600022	山东钢铁	2018年3月27日	重大资产	2.02	2018年8月16日	1.83	154,100	328,712.00	311,282.00	-

			重组							
000426	兴业矿业	2018年6月19日	重大资产重组	7.21	2018年8月27日	6.47	25,325	204,519.87	182,593.25	-
600750	江中药业	2018年5月2日	重大资产重组	17.75	2018年8月1日	16.12	10,101	184,801.30	179,292.75	-
000825	太钢不锈	2018年4月16日	重大资产重组	6.00	-	-	16,400	97,816.14	98,400.00	-
002426	胜利精密	2018年6月19日	重大事项	3.60	2018年7月3日	3.26	20,800	81,749.00	74,880.00	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大资产重组	9.49	-	-	7,171	74,798.51	68,052.79	-
002359	北讯集团	2018年5月21日	重大资产重组	19.58	2018年8月21日	17.62	3,000	78,136.72	58,740.00	-
300603	立昂技术	2018年5月2日	重大资产重组	35.73	2018年8月24日	32.07	1,200	41,730.40	42,876.00	-
600811	东方集团	2018年5月	重大	4.30	-	-	9,600	42,472.39	41,280.00	-

		月 30 日	事项							
600678	四川金顶	2018 年 4 月 18 日	重大资产重组	10.24	-	-	3,800	38,978.29	38,912.00	-
600850	华东电脑	2018 年 5 月 14 日	重大资产重组	18.99		2018 年 8 月 15 日	18.00	1,900	37,793.00	36,081.00
300118	东方日升	2018 年 5 月 7 日	重大资产重组	10.80		2018 年 8 月 7 日	9.63	3,000	32,122.00	32,400.00
002011	盾安环境	2018 年 5 月 2 日	重大资产重组	6.40	-	-		3,900	26,663.85	24,960.00
600759	洲际油气	2018 年 3 月 27 日	重大资产重组	3.94	-	-		6,200	23,896.59	24,428.00
002512	达华智能	2018 年 6 月 19 日	重大事项	9.70	-	-		2,500	26,659.98	24,250.00
600641	万业企业	2018 年 4 月 17 日	重大资产重组	12.18		2018 年 8 月 9 日	10.96	1,800	22,938.00	21,924.00
600796	钱江生化	2018 年 5 月	重大	6.08	-	-		3,600	22,259.00	21,888.00

		月 2 日	资产重组							
300108	吉药控股	2018 年 6 月 12 日	重大资产重组	7.84	-	-	2,700	22,178.73	21,168.00	-
600687	刚泰控股	2018 年 6 月 11 日	重大事项	9.09		2018 年 8 月 20 日	8.18	2,300	21,945.17	20,907.00
002437	誉衡药业	2018 年 6 月 11 日	重大资产重组	6.20		2018 年 8 月 13 日	5.57	2,400	15,765.80	14,880.00
601727	上海电气	2018 年 6 月 6 日	重大资产重组	6.34		2018 年 8 月 7 日	5.71	1,900	10,999.65	12,046.00
600768	宁波富邦	2018 年 6 月 14 日	重大资产重组	11.04	-		-	1,000	11,218.12	11,040.00
002171	楚江新材	2018 年 6 月 7 日	重大事项	6.78	-		-	1,400	9,501.06	9,492.00
002431	棕榈股份	2018 年 5 月 30 日	重大事项	6.71	-		-	1,300	9,346.71	8,723.00
002778	高科石化	2018 年 4 月 23 日	重大资产	19.02		2018 年 7 月 20 日	18.00	420	8,132.46	7,988.40

			重							
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大资产重组	5.37	-	-	1,400	9,097.59	7,518.00	-
002573	清新环境	2018年6月19日	重大事项	11.55	-	-	650	8,707.02	7,507.50	-
300343	联创互联	2018年6月19日	重大事项	10.00	-	-	700	7,098.00	7,000.00	-
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项	7.47	2018年8月20日	7.25	800	5,973.00	5,976.00	-
002408	齐翔腾达	2018年6月19日	重大资产重组	12.28	-	-	400	5,324.86	4,912.00	-
002665	首航节能	2018年5月29日	重大资产重组	5.80	-	-	800	5,448.38	4,640.00	-
300072	三聚环保	2018年6月19日	重大事项	23.28	2018年7月10日	18.38	100	2,350.00	2,328.00	-
002477	雏鹰农牧	2018年6月14日	重大事项	3.31	-	-	700	2,586.03	2,317.00	-
600724	宁波富达	2018年5月3日	重大资产	3.29	2018年8月24日	3.05	600	1,962.00	1,974.00	-

			重组							
300131	英唐智控	2018年5月29日	重大资产重组	5.67	-	-	300	1,721.00	1,701.00	-
600122	宏图高科	2018年6月19日	重大资产重组	7.40	-	-	200	1,587.00	1,480.00	-
600335	国机汽车	2018年4月3日	重大事项	10.43	-	-	4,700	47,912.04	49,021.00	-
002102	冠福股份	2018年6月1日	重大资产重组	3.72	-	-	7,900	33,857.06	29,388.00	-
000967	盈峰环境	2018年5月18日	重大资产重组	8.70	2018年7月31日	8.01	200	1,720.00	1,740.00	-
002270	华明装备	2018年5月3日	重大资产重组	5.81	2018年7月3日	5.23	150	874.00	871.50	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险、管理风险、估值风险、操作风险、技术风险、合规性风险等。对于上述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对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制控制在合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券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，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	30,113,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	4,017,600.00	40,116,000.00
合计	4,017,600.00	70,229,000.00

注：以上按短期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	15,839,400.00
AAA 以下	41,895.00	28,520,826.20
未评级	-	-
合计	41,895.00	44,360,226.20

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风

险。本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金持有一家公司发行的证券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，不超过该证券的 10%。此外，本基金亦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。本基金所持有的大部分证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	576,686.27	-	-	-	576,686.27
结算备付金	1,066,745.34	-	-	-	1,066,745.34
存出保证金	48,559.71	-	-	-	48,559.71
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	50,407,440.91	50,407,440.91
交易性金融资产-债券投资	9,580,395.00	-	-	-	9,580,395.00

资					
买入返售金融资产	38,700,000.00	-	-	-	38,700,000.00
应收证券清算款	-	-	-	250,882.34	250,882.34
应收利息	-	-	-	107,456.00	107,456.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	749.00	749.00
资产总计	49,972,386.32	-	-	50,766,528.25	100,738,914.57
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	3,147.04	3,147.04
应付赎回款	-	-	-	4,497.54	4,497.54
应付管理人报酬	-	-	-	125,796.26	125,796.26
应付托管费	-	-	-	8,386.39	8,386.39
应付交易费用	-	-	-	282,749.59	282,749.59
应付销售服务费	-	-	-	15.54	15.54
应交税费	-	-	-	5,133.12	5,133.12
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	143,095.75	143,095.75
负债总计	-	-	-	572,821.23	572,821.23
利率敏感度缺口	49,972,386.32	-	-	50,193,707.02	100,166,093.34
上年度末 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	156,208.16	-	-	-	156,208.16
结算备付金	1,109,445.61	-	-	-	1,109,445.61
存出保证金	37,266.39	-	-	-	37,266.39
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	62,921,745.50	62,921,745.50
交易性金融资产-债券投资	125,570,288.20	-	1,181.80	-	125,571,470.00
买入返售金融资产	2,900,000.00	-	-	-	2,900,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,272,562.11	3,272,562.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	129,773,208.36	-	1,181.80	66,194,307.61	195,968,697.77
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	95,194.74	95,194.74
应付赎回款	-	-	-	219.20	219.20
应付管理人报酬	-	-	-	248,853.47	248,853.47
应付托管费	-	-	-	16,590.26	16,590.26

应付交易费用	-	-	-	56,192.27	56,192.27
应付销售服务费	-	-	-	1,652.82	1,652.82
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	200,000.52	200,000.52
负债总计	-	-	-	618,703.28	618,703.28
利率敏感度缺口	129,773,208.36	-	1,181.80	65,575,604.33	195,349,994.49

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	11,433.10	145,822.81
	市场利率上升 25 个基点	-11,433.10	-145,822.81

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他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。本基金部分投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	50,407,440.91	50.32	62,921,745.50	32.21
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	9,580,395.00	9.56	125,571,470.00	64.28
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	59,987,835.91	59.89	188,493,215.50	96.49

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	50,407,440.91	50.04
	其中：股票	50,407,440.91	50.04
2	固定收益投资	9,580,395.00	9.51
	其中：债券	9,580,395.00	9.51
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	38,700,000.00	38.42
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,643,431.61	1.63
7	其他各项资产	407,647.05	0.40
8	合计	100,738,914.57	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	236,844.00	0.24
B	采矿业	2,286,122.93	2.28
C	制造业	29,328,516.21	29.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,893,895.04	1.89
E	建筑业	1,007,349.80	1.01
F	批发和零售业	4,065,040.62	4.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,383,893.44	1.38
H	住宿和餐饮业	27,540.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,608,446.98	3.60
J	金融业	582,615.60	0.58
K	房地产业	3,519,668.35	3.51
L	租赁和商务服务业	480,558.84	0.48
M	科学研究和技术服务业	115,179.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	269,532.50	0.27

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	28,475.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	1,450,807.60	1.45
S	综合	122,955.00	0.12
	合计	50,407,440.91	50.32

7.2.2 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股票资产。

7.3 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	占基金资产净值比例（%）
1	600216	浙江医药	56,800	725,336.00	0.72
2	000848	承德露露	60,410	639,741.90	0.64
3	000718	苏宁环球	169,923	623,617.41	0.62
4	601717	郑煤机	106,950	621,379.50	0.62
5	300039	上海凯宝	105,390	611,262.00	0.61
6	600557	康缘药业	48,900	603,915.00	0.60
7	002603	以岭药业	41,400	578,772.00	0.58
8	603188	ST 亚邦	56,480	576,096.00	0.58
9	601168	西部矿业	90,500	568,340.00	0.57
10	600422	昆药集团	70,770	548,467.50	0.55
11	600978	宜华生活	79,313	541,707.79	0.54
12	600729	重庆百货	15,840	521,928.00	0.52
13	000528	柳工	46,410	497,051.10	0.50
14	603444	吉比特	3,889	496,975.31	0.50
15	600611	大众交通	120,280	478,714.40	0.48
16	600757	长江传媒	77,100	438,699.00	0.44
17	002233	塔牌集团	36,920	422,364.80	0.42
18	002317	众生药业	39,900	421,743.00	0.42
19	002051	中工国际	26,600	406,182.00	0.41
20	000581	威孚高科	18,000	397,980.00	0.40
21	000669	金鸿控股	54,180	392,805.00	0.39
22	002001	新和成	20,400	386,784.00	0.39
23	601311	骆驼股份	33,386	382,937.42	0.38

24	600694	大商股份	11,600	377,116.00	0.38
25	600516	方大炭素	15,460	376,914.80	0.38
26	600064	南京高科	50,979	374,185.86	0.37
27	000049	德赛电池	12,922	364,658.84	0.36
28	002463	沪电股份	95,400	356,796.00	0.36
29	000031	中粮地产	59,740	345,297.20	0.34
30	600655	豫园股份	36,105	341,192.25	0.34
31	601016	节能风电	118,400	339,808.00	0.34
32	600073	上海梅林	51,129	339,496.56	0.34
33	600500	中化国际	49,700	338,954.00	0.34
34	000830	鲁西化工	19,800	338,184.00	0.34
35	002195	二三四五	78,970	337,991.60	0.34
36	002002	鸿达兴业	70,700	325,927.00	0.33
37	600167	联美控股	32,100	321,000.00	0.32
38	601678	滨化股份	50,540	312,337.20	0.31
39	600022	山东钢铁	154,100	311,282.00	0.31
40	600618	氯碱化工	36,521	310,793.71	0.31
41	600648	外高桥	16,500	301,620.00	0.30
42	601928	凤凰传媒	47,518	288,909.44	0.29
43	603025	大豪科技	13,728	265,499.52	0.27
44	002280	联络互动	45,000	257,400.00	0.26
45	600597	光明乳业	25,200	248,724.00	0.25
46	600056	中国医药	13,500	246,645.00	0.25
47	000598	兴蓉环境	60,000	243,600.00	0.24
48	600017	日照港	74,820	240,172.20	0.24
49	601001	大同煤业	48,298	239,558.08	0.24
50	000887	中鼎股份	16,400	236,324.00	0.24
51	600572	康恩贝	30,860	221,266.20	0.22
52	600260	凯乐科技	8,200	220,088.00	0.22
53	002366	台海核电	15,400	219,604.00	0.22
54	600282	南钢股份	49,520	218,878.40	0.22
55	600639	浦东金桥	17,500	218,400.00	0.22
56	002221	东华能源	22,320	218,066.40	0.22
57	002056	横店东磁	30,800	215,908.00	0.22
58	000006	深振业 A	36,600	214,476.00	0.21
59	000999	华润三九	7,630	212,342.90	0.21
60	000501	鄂武商 A	16,740	205,734.60	0.21
61	603328	依顿电子	18,720	203,112.00	0.20
62	000758	中色股份	45,110	202,995.00	0.20

63	600664	哈药股份	50,800	201,676.00	0.20
64	603198	迎驾贡酒	10,740	197,293.80	0.20
65	002152	广电运通	33,500	196,980.00	0.20
66	601000	唐山港	81,760	192,136.00	0.19
67	601811	新华文轩	19,723	191,707.56	0.19
68	002332	仙琚制药	21,610	189,087.50	0.19
69	000778	新兴铸管	44,100	188,748.00	0.19
70	600743	华远地产	73,252	188,257.64	0.19
71	601801	皖新传媒	24,700	187,967.00	0.19
72	600153	建发股份	20,820	187,171.80	0.19
73	000926	福星股份	25,800	185,502.00	0.19
74	600126	杭钢股份	30,700	183,279.00	0.18
75	300274	阳光电源	20,410	183,077.70	0.18
76	000426	兴业矿业	25,325	182,593.25	0.18
77	002078	太阳纸业	18,700	181,203.00	0.18
78	600256	广汇能源	44,000	179,960.00	0.18
79	600750	江中药业	10,101	179,292.75	0.18
80	002815	崇达技术	11,100	178,710.00	0.18
81	300026	红日药业	48,910	178,521.50	0.18
82	601689	拓普集团	9,100	176,904.00	0.18
83	000552	靖远煤电	53,760	175,795.20	0.18
84	300297	蓝盾股份	20,927	169,717.97	0.17
85	000541	佛山照明	27,620	165,443.80	0.17
86	002640	跨境通	11,000	165,220.00	0.16
87	600580	卧龙电气	21,458	163,509.96	0.16
88	000519	中兵红箭	20,800	161,616.00	0.16
89	600426	华鲁恒升	9,100	160,069.00	0.16
90	600438	通威股份	22,710	156,699.00	0.16
91	002128	露天煤业	16,600	150,396.00	0.15
92	603799	华友钴业	1,500	146,205.00	0.15
93	600195	中牧股份	7,500	145,875.00	0.15
94	002373	千方科技	11,000	143,550.00	0.14
95	002064	华峰氨纶	34,430	142,195.90	0.14
96	600006	东风汽车	34,500	141,105.00	0.14
97	000997	新大陆	8,900	140,175.00	0.14
98	002004	华邦健康	27,300	138,684.00	0.14
99	002110	三钢闽光	8,600	137,858.00	0.14
100	300182	捷成股份	18,100	137,198.00	0.14
101	000661	长春高新	600	136,620.00	0.14

102	600143	金发科技	26,110	136,294.20	0.14
103	600649	城投控股	22,100	135,252.00	0.14
104	600499	科达洁能	19,300	132,398.00	0.13
105	600395	盘江股份	21,520	130,626.40	0.13
106	000488	晨鸣纸业	9,920	128,166.40	0.13
107	600062	华润双鹤	5,220	128,151.00	0.13
108	000685	中山公用	15,887	126,619.39	0.13
109	000547	航天发展	16,200	126,522.00	0.13
110	600060	海信电器	9,300	124,527.00	0.12
111	600338	西藏珠峰	6,000	124,320.00	0.12
112	603589	口子窖	2,020	124,129.00	0.12
113	600201	生物股份	7,233	123,611.97	0.12
114	600755	厦门国贸	16,900	123,201.00	0.12
115	002344	海宁皮城	25,200	122,472.00	0.12
116	000418	小天鹅 A	1,700	117,895.00	0.12
117	002277	友阿股份	25,510	117,601.10	0.12
118	600525	长园集团	11,020	116,481.40	0.12
119	600939	重庆建工	23,300	115,102.00	0.11
120	000400	许继电气	14,706	114,853.86	0.11
121	002176	江特电机	11,800	114,696.00	0.11
122	600704	物产中大	21,800	114,014.00	0.11
123	600737	中粮糖业	15,010	113,175.40	0.11
124	600545	卓郎智能	14,203	112,771.82	0.11
125	002416	爱施德	19,166	112,504.42	0.11
126	002354	天神娱乐	12,000	111,120.00	0.11
127	601127	小康股份	6,400	110,656.00	0.11
128	603568	伟明环保	4,320	109,296.00	0.11
129	002244	滨江集团	20,867	108,508.40	0.11
130	002174	游族网络	5,400	107,460.00	0.11
131	600808	马钢股份	29,800	106,982.00	0.11
132	600859	王府井	5,010	106,562.70	0.11
133	002517	恺英网络	14,100	101,379.00	0.10
134	600079	人福医药	7,490	99,017.80	0.10
135	002191	劲嘉股份	13,200	98,604.00	0.10
136	000825	太钢不锈	16,400	98,400.00	0.10
137	600511	国药股份	3,605	97,154.75	0.10
138	601179	中国西电	28,200	96,444.00	0.10
139	600748	上实发展	19,036	95,941.44	0.10
140	600160	巨化股份	12,990	95,086.80	0.09

141	002460	赣锋锂业	2,450	94,521.00	0.09
142	600863	内蒙华电	41,500	94,205.00	0.09
143	002589	瑞康医药	6,900	94,116.00	0.09
144	002440	闰土股份	8,000	93,520.00	0.09
145	000980	众泰汽车	13,100	93,141.00	0.09
146	000662	天夏智慧	14,241	91,569.63	0.09
147	600881	亚泰集团	24,290	90,601.70	0.09
148	000028	国药一致	1,800	89,820.00	0.09
149	300002	神州泰岳	21,500	89,655.00	0.09
150	600208	新湖中宝	23,200	88,624.00	0.09
151	600816	安信信托	12,240	88,617.60	0.09
152	300287	飞利信	12,000	86,280.00	0.09
153	600458	时代新材	11,664	85,847.04	0.09
154	002410	广联达	3,000	83,190.00	0.08
155	002261	拓维信息	18,000	82,800.00	0.08
156	603019	中科曙光	1,800	82,566.00	0.08
157	600582	天地科技	22,497	82,563.99	0.08
158	600640	号百控股	8,100	82,377.00	0.08
159	000553	沙隆达 A	5,200	82,212.00	0.08
160	300055	万邦达	7,000	80,430.00	0.08
161	000703	恒逸石化	5,140	76,483.20	0.08
162	000977	浪潮信息	3,200	76,320.00	0.08
163	002426	胜利精密	20,800	74,880.00	0.07
164	600970	中材国际	11,100	74,148.00	0.07
165	600765	中航重机	9,900	73,656.00	0.07
166	600325	华发股份	9,500	73,435.00	0.07
167	300088	长信科技	12,300	71,340.00	0.07
168	600657	信达地产	16,400	69,700.00	0.07
169	600380	健康元	5,864	69,547.04	0.07
170	300159	新研股份	9,800	69,384.00	0.07
171	002709	天赐材料	1,800	69,372.00	0.07
172	300324	旋极信息	7,171	68,052.79	0.07
173	002583	海能达	8,000	66,800.00	0.07
174	000012	南玻 A	13,490	66,775.50	0.07
175	601128	常熟银行	11,600	66,352.00	0.07
176	300308	中际旭创	1,100	66,044.00	0.07
177	000040	东旭蓝天	6,500	65,650.00	0.07
178	601231	环旭电子	7,200	65,304.00	0.07
179	601200	上海环境	4,000	63,320.00	0.06

180	002701	奥瑞金	11,400	62,244.00	0.06
181	600839	四川长虹	21,700	62,062.00	0.06
182	600823	世茂股份	14,700	61,446.00	0.06
183	002180	纳思达	2,200	60,412.00	0.06
184	300043	星辉娱乐	15,100	60,400.00	0.06
185	000860	顺鑫农业	1,610	60,375.00	0.06
186	603528	多伦科技	7,600	60,344.00	0.06
187	002375	亚厦股份	11,200	59,808.00	0.06
188	000078	海王生物	12,400	59,644.00	0.06
189	000975	银泰资源	5,880	59,623.20	0.06
190	600051	宁波联合	9,500	59,280.00	0.06
191	600376	首开股份	8,400	59,052.00	0.06
192	002359	北讯集团	3,000	58,740.00	0.06
193	300253	卫宁健康	4,700	58,233.00	0.06
194	600184	光电股份	4,700	58,233.00	0.06
195	300676	华大基因	600	58,086.00	0.06
196	002491	通鼎互联	5,210	57,674.70	0.06
197	600708	光明地产	13,360	57,448.00	0.06
198	002635	安洁科技	3,320	57,104.00	0.06
199	002022	科华生物	4,800	56,880.00	0.06
200	002707	众信旅游	5,900	56,640.00	0.06
201	000813	德展健康	6,800	56,032.00	0.06
202	000537	广宇发展	5,800	55,912.00	0.06
203	600885	宏发股份	1,840	55,052.80	0.05
204	000596	古井贡酒	620	55,043.60	0.05
205	600993	马应龙	3,200	54,432.00	0.05
206	000016	深康佳 A	10,269	53,912.25	0.05
207	000009	中国宝安	10,800	52,920.00	0.05
208	002304	洋河股份	400	52,640.00	0.05
209	000636	风华高科	3,310	52,562.80	0.05
210	002268	卫士通	2,400	52,392.00	0.05
211	000059	华锦股份	7,600	52,364.00	0.05
212	600908	无锡银行	8,700	51,243.00	0.05
213	000066	中国长城	7,200	51,192.00	0.05
214	002019	亿帆医药	2,885	50,920.25	0.05
215	600872	中炬高新	1,810	50,680.00	0.05
216	300113	顺网科技	2,910	50,663.10	0.05
217	002203	海亮股份	6,200	50,220.00	0.05
218	603986	兆易创新	460	49,919.20	0.05

219	000034	神州数码	3,100	49,538.00	0.05
220	601360	三六零	1,700	49,130.00	0.05
221	002407	多氟多	3,500	49,070.00	0.05
222	600335	国机汽车	4,700	49,021.00	0.05
223	601579	会稽山	5,000	48,950.00	0.05
224	600717	天津港	6,500	48,945.00	0.05
225	600643	爱建集团	5,200	48,880.00	0.05
226	002626	金达威	2,800	48,580.00	0.05
227	300315	掌趣科技	11,600	48,488.00	0.05
228	600180	瑞茂通	5,000	48,450.00	0.05
229	000046	泛海控股	8,500	48,365.00	0.05
230	002275	桂林三金	3,300	48,180.00	0.05
231	000885	同力水泥	4,700	47,752.00	0.05
232	600897	厦门空港	2,300	47,426.00	0.05
233	600230	沧州大化	2,140	47,422.40	0.05
234	002063	远光软件	5,600	47,376.00	0.05
235	002400	省广集团	14,600	47,158.00	0.05
236	002247	帝龙文化	5,700	46,740.00	0.05
237	600718	东软集团	3,570	46,624.20	0.05
238	000921	海信科龙	4,500	46,620.00	0.05
239	002146	荣盛发展	5,330	46,530.90	0.05
240	600873	梅花生物	11,100	46,398.00	0.05
241	600565	迪马股份	15,700	46,315.00	0.05
242	000892	欢瑞世纪	9,800	46,158.00	0.05
243	601088	中国神华	2,300	45,862.00	0.05
244	000070	特发信息	6,300	45,675.00	0.05
245	601238	广汽集团	4,100	45,674.00	0.05
246	600300	维维股份	14,000	45,640.00	0.05
247	002439	启明星辰	2,140	45,410.80	0.05
248	600373	中文传媒	3,500	44,975.00	0.04
249	600317	营口港	19,900	44,974.00	0.04
250	600895	张江高科	3,900	44,850.00	0.04
251	600169	太原重工	19,000	44,460.00	0.04
252	600277	亿利洁能	8,483	44,450.92	0.04
253	601003	柳钢股份	5,600	44,352.00	0.04
254	600521	华海药业	1,660	44,305.40	0.04
255	600966	博汇纸业	10,200	43,962.00	0.04
256	600781	辅仁药业	2,800	43,960.00	0.04
257	600566	济川药业	900	43,371.00	0.04

258	300603	立昂技术	1,200	42,876.00	0.04
259	300166	东方国信	2,900	42,717.00	0.04
260	002061	浙江交科	4,000	41,880.00	0.04
261	300657	弘信电子	1,400	41,440.00	0.04
262	600811	东方集团	9,600	41,280.00	0.04
263	000062	深圳华强	2,100	41,160.00	0.04
264	600108	亚盛集团	14,000	40,460.00	0.04
265	002080	中材科技	4,720	40,120.00	0.04
266	300272	开能健康	3,700	40,071.00	0.04
267	000513	丽珠集团	910	39,994.50	0.04
268	600528	中铁工业	3,900	39,858.00	0.04
269	000918	嘉凯城	8,700	39,585.00	0.04
270	600410	华胜天成	4,500	39,375.00	0.04
271	600875	东方电气	5,310	39,347.10	0.04
272	000543	皖能电力	8,900	39,249.00	0.04
273	600372	中航电子	3,000	39,180.00	0.04
274	002736	国信证券	4,300	39,130.00	0.04
275	603160	汇顶科技	600	38,934.00	0.04
276	600678	四川金顶	3,800	38,912.00	0.04
277	300406	九强生物	2,700	38,880.00	0.04
278	002493	荣盛石化	3,750	38,700.00	0.04
279	000100	TCL 集团	13,300	38,570.00	0.04
280	600329	中新药业	2,030	38,570.00	0.04
281	600936	广西广电	8,100	38,556.00	0.04
282	600161	天坛生物	1,980	38,313.00	0.04
283	600713	南京医药	7,800	38,142.00	0.04
284	002916	深南电路	600	38,106.00	0.04
285	000766	通化金马	3,200	38,016.00	0.04
286	002528	英飞拓	9,000	37,530.00	0.04
287	002287	奇正藏药	1,300	37,427.00	0.04
288	603569	长久物流	2,612	37,299.36	0.04
289	002183	怡亚通	5,600	37,240.00	0.04
290	603369	今世缘	1,630	37,212.90	0.04
291	002567	唐人神	8,200	37,146.00	0.04
292	603225	新凤鸣	1,854	37,024.38	0.04
293	600623	华谊集团	3,700	36,926.00	0.04
294	000625	长安汽车	4,100	36,900.00	0.04
295	603288	海天味业	500	36,820.00	0.04
296	300194	福安药业	7,800	36,660.00	0.04

297	002503	搜于特	10,400	36,400.00	0.04
298	000606	顺利办	5,500	36,300.00	0.04
299	000631	顺发恒业	10,520	36,083.60	0.04
300	600850	华东电脑	1,900	36,081.00	0.04
301	601991	大唐发电	11,900	36,057.00	0.04
302	002032	苏泊尔	700	36,050.00	0.04
303	601020	华钰矿业	2,600	35,854.00	0.04
304	603660	苏州科达	1,580	35,787.00	0.04
305	600094	大名城	6,210	35,769.60	0.04
306	600018	上港集团	5,999	35,754.04	0.04
307	600602	云赛智联	6,100	35,380.00	0.04
308	603806	福斯特	1,600	35,216.00	0.04
309	600459	贵研铂业	3,260	35,208.00	0.04
310	601958	金铂股份	5,600	35,112.00	0.04
311	600594	益佰制药	3,900	34,944.00	0.03
312	001696	宗申动力	7,100	34,790.00	0.03
313	002314	南山控股	8,600	34,658.00	0.03
314	300546	雄帝科技	1,600	34,464.00	0.03
315	000895	双汇发展	1,300	34,333.00	0.03
316	600598	北大荒	3,700	33,892.00	0.03
317	002600	领益智造	6,500	33,735.00	0.03
318	600828	茂业商业	6,600	33,660.00	0.03
319	002308	威创股份	4,040	33,532.00	0.03
320	600869	智慧能源	7,100	33,512.00	0.03
321	601666	平煤股份	8,000	33,440.00	0.03
322	601997	贵阳银行	2,700	33,372.00	0.03
323	603877	太平鸟	1,000	33,330.00	0.03
324	300027	华谊兄弟	5,410	33,325.60	0.03
325	002841	视源股份	620	33,114.20	0.03
326	300010	立思辰	2,700	33,048.00	0.03
327	300498	温氏股份	1,500	33,030.00	0.03
328	600782	新钢股份	5,900	32,922.00	0.03
329	300219	鸿利智汇	3,400	32,912.00	0.03
330	002092	中泰化学	3,400	32,776.00	0.03
331	601186	中国铁建	3,800	32,756.00	0.03
332	600261	阳光照明	8,700	32,712.00	0.03
333	603766	隆鑫通用	6,000	32,580.00	0.03
334	300118	东方日升	3,000	32,400.00	0.03
335	300384	三联虹普	800	32,216.00	0.03

336	600801	华新水泥	2,140	32,164.20	0.03
337	601515	东风股份	4,100	31,652.00	0.03
338	000883	湖北能源	7,700	31,647.00	0.03
339	600488	天药股份	7,600	31,236.00	0.03
340	600420	现代制药	3,000	31,200.00	0.03
341	601677	明泰铝业	3,100	31,124.00	0.03
342	000908	景峰医药	6,600	31,086.00	0.03
343	002568	百润股份	2,300	31,073.00	0.03
344	002501	利源精制	5,000	31,000.00	0.03
345	603567	珍宝岛	2,300	30,820.00	0.03
346	600723	首商股份	4,400	30,756.00	0.03
347	603603	博天环境	1,500	30,735.00	0.03
348	002038	双鹭药业	800	30,392.00	0.03
349	600105	永鼎股份	8,300	30,212.00	0.03
350	600312	平高电气	5,320	30,004.80	0.03
351	000069	华侨城 A	4,100	29,643.00	0.03
352	002482	广田集团	4,940	29,491.80	0.03
353	002102	冠福股份	7,900	29,388.00	0.03
354	002093	国脉科技	3,800	29,298.00	0.03
355	601777	力帆股份	5,600	29,288.00	0.03
356	600350	山东高速	7,200	29,160.00	0.03
357	002422	科伦药业	900	28,890.00	0.03
358	600998	九州通	1,700	28,832.00	0.03
359	600829	人民同泰	4,000	28,640.00	0.03
360	000829	天音控股	3,900	28,587.00	0.03
361	601998	中信银行	4,600	28,566.00	0.03
362	601567	三星医疗	3,900	28,392.00	0.03
363	002705	新宝股份	2,900	28,333.00	0.03
364	600292	远达环保	4,800	28,176.00	0.03
365	600658	电子城	5,360	28,032.80	0.03
366	002041	登海种业	4,100	27,962.00	0.03
367	002505	大康农业	13,000	27,820.00	0.03
368	002534	杭锅股份	4,100	27,757.00	0.03
369	600132	重庆啤酒	1,000	27,690.00	0.03
370	600894	广日股份	4,638	27,503.34	0.03
371	002777	久远银海	1,000	27,470.00	0.03
372	002206	海利得	5,500	27,445.00	0.03
373	002544	杰赛科技	2,000	27,380.00	0.03
374	002368	太极股份	940	27,325.80	0.03

375	002099	海翔药业	5,300	27,189.00	0.03
376	601158	重庆水务	5,000	27,100.00	0.03
377	000736	中交地产	2,450	27,072.50	0.03
378	002073	软控股份	4,700	27,025.00	0.03
379	601908	京运通	5,900	27,022.00	0.03
380	600120	浙江东方	1,980	26,829.00	0.03
381	000719	中原传媒	4,000	26,760.00	0.03
382	002636	金安国纪	3,300	26,631.00	0.03
383	300448	浩云科技	2,320	26,564.00	0.03
384	600348	阳泉煤业	3,700	26,455.00	0.03
385	601866	中远海发	10,600	26,394.00	0.03
386	002249	大洋电机	6,100	26,291.00	0.03
387	002251	步步高	2,300	26,174.00	0.03
388	002057	中钢天源	3,800	26,030.00	0.03
389	300083	劲胜智能	5,400	26,028.00	0.03
390	002581	未名医药	2,400	25,560.00	0.03
391	300174	元力股份	1,200	25,416.00	0.03
392	002223	鱼跃医疗	1,300	25,337.00	0.03
393	600279	重庆港九	5,700	25,308.00	0.03
394	600777	新潮能源	11,500	25,185.00	0.03
395	002011	盾安环境	3,900	24,960.00	0.02
396	002164	宁波东力	4,300	24,854.00	0.02
397	000021	深科技	3,630	24,756.60	0.02
398	600563	法拉电子	500	24,745.00	0.02
399	603658	安图生物	300	24,738.00	0.02
400	600483	福能股份	3,600	24,732.00	0.02
401	600688	上海石化	4,300	24,467.00	0.02
402	600759	洲际油气	6,200	24,428.00	0.02
403	002483	润邦股份	5,800	24,360.00	0.02
404	002595	豪迈科技	1,400	24,346.00	0.02
405	300130	新国都	1,800	24,282.00	0.02
406	002818	富森美	920	24,269.60	0.02
407	002512	达华智能	2,500	24,250.00	0.02
408	600081	东风科技	2,400	24,240.00	0.02
409	002454	松芝股份	4,100	24,067.00	0.02
410	603355	莱克电气	800	24,040.00	0.02
411	600536	中国软件	1,110	24,009.30	0.02
412	000878	云南铜业	2,500	23,850.00	0.02
413	601966	玲珑轮胎	1,500	23,655.00	0.02

414	600691	阳煤化工	7,700	23,562.00	0.02
415	000557	西部创业	7,300	23,506.00	0.02
416	600812	华北制药	5,400	23,436.00	0.02
417	002380	科远股份	1,800	23,400.00	0.02
418	600299	安迪苏	2,010	23,396.40	0.02
419	300150	世纪瑞尔	4,800	23,184.00	0.02
420	601126	四方股份	4,500	22,905.00	0.02
421	000539	粤电力 A	5,400	22,896.00	0.02
422	600179	安通控股	2,260	22,893.80	0.02
423	300204	舒泰神	2,100	22,722.00	0.02
424	600613	神奇制药	3,700	22,681.00	0.02
425	600835	上海机电	1,200	22,632.00	0.02
426	000039	中集集团	1,700	22,576.00	0.02
427	002880	卫光生物	500	22,480.00	0.02
428	600308	华泰股份	4,500	22,410.00	0.02
429	300415	伊之密	2,400	22,368.00	0.02
430	600775	南京熊猫	3,900	22,074.00	0.02
431	603816	顾家家居	300	22,053.00	0.02
432	002688	金河生物	4,200	22,008.00	0.02
433	600641	万业企业	1,800	21,924.00	0.02
434	000521	长虹美菱	5,700	21,888.00	0.02
435	600796	钱江生化	3,600	21,888.00	0.02
436	600236	桂冠电力	3,800	21,698.00	0.02
437	002091	江苏国泰	3,400	21,590.00	0.02
438	600612	老凤祥	600	21,564.00	0.02
439	002372	伟星新材	1,210	21,404.90	0.02
440	600676	交运股份	4,300	21,371.00	0.02
441	300108	吉药控股	2,700	21,168.00	0.02
442	000902	新洋丰	2,300	21,160.00	0.02
443	300410	正业科技	900	21,159.00	0.02
444	600466	蓝光发展	3,400	21,080.00	0.02
445	600173	卧龙地产	4,900	21,070.00	0.02
446	601137	博威合金	2,600	21,008.00	0.02
447	601222	林洋能源	4,200	20,916.00	0.02
448	600687	刚泰控股	2,300	20,907.00	0.02
449	603566	普莱柯	1,300	20,553.00	0.02
450	601006	大秦铁路	2,500	20,525.00	0.02
451	000525	红太阳	1,200	20,340.00	0.02
452	601628	中国人寿	900	20,268.00	0.02

453	603612	索通发展	700	20,020.00	0.02
454	600240	华业资本	2,700	19,791.00	0.02
455	002345	潮宏基	2,300	19,780.00	0.02
456	600851	海欣股份	2,402	19,744.44	0.02
457	300511	雪榕生物	2,200	19,536.00	0.02
458	601618	中国中冶	5,800	19,314.00	0.02
459	600697	欧亚集团	900	19,161.00	0.02
460	000617	中油资本	1,700	19,108.00	0.02
461	002681	奋达科技	2,200	19,052.00	0.02
462	300082	奥克股份	3,900	19,032.00	0.02
463	002657	中科金财	1,200	19,008.00	0.02
464	600741	华域汽车	800	18,976.00	0.02
465	000150	宜华健康	700	18,970.00	0.02
466	603609	禾丰牧业	2,000	18,880.00	0.02
467	000411	英特集团	1,400	18,690.00	0.02
468	300294	博雅生物	600	18,594.00	0.02
469	002479	富春环保	3,281	18,537.65	0.02
470	002119	康强电子	1,640	18,532.00	0.02
471	002048	宁波华翔	1,500	18,495.00	0.02
472	300158	振东制药	3,600	18,432.00	0.02
473	600125	铁龙物流	2,200	18,414.00	0.02
474	000563	陕国投 A	5,400	18,360.00	0.02
475	600614	鹏起科技	3,200	18,272.00	0.02
476	600188	兖州煤业	1,400	18,256.00	0.02
477	002238	天威视讯	2,700	18,171.00	0.02
478	002217	合力泰	2,200	18,150.00	0.02
479	603869	新智认知	1,100	18,139.00	0.02
480	600295	鄂尔多斯	2,000	17,980.00	0.02
481	601877	正泰电器	800	17,856.00	0.02
482	002399	海普瑞	800	17,712.00	0.02
483	000937	冀中能源	4,300	17,673.00	0.02
484	002686	亿利达	2,500	17,625.00	0.02
485	600176	中国巨石	1,720	17,595.60	0.02
486	000861	海印股份	7,000	17,570.00	0.02
487	002851	麦格米特	600	17,568.00	0.02
488	600183	生益科技	1,915	17,541.40	0.02
489	601058	赛轮金宇	7,200	17,496.00	0.02
490	002295	精艺股份	2,600	17,472.00	0.02
491	002531	天顺风能	4,000	17,400.00	0.02

492	002090	金智科技	1,200	17,352.00	0.02
493	600827	百联股份	1,700	17,340.00	0.02
494	000919	金陵药业	2,300	17,227.00	0.02
495	000750	国海证券	4,800	17,136.00	0.02
496	600057	厦门象屿	3,412	17,025.88	0.02
497	300273	和佳股份	2,510	17,017.80	0.02
498	002653	海思科	1,400	16,800.00	0.02
499	600575	皖江物流	4,500	16,695.00	0.02
500	000601	韶能股份	3,800	16,682.00	0.02
501	603883	老百姓	200	16,632.00	0.02
502	600398	海澜之家	1,300	16,562.00	0.02
503	300381	溢多利	1,900	16,549.00	0.02
504	000524	岭南控股	1,800	16,452.00	0.02
505	600297	广汇汽车	2,800	16,408.00	0.02
506	600444	国机通用	1,400	16,142.00	0.02
507	603688	石英股份	1,200	16,128.00	0.02
508	002588	史丹利	3,100	16,058.00	0.02
509	600267	海正药业	1,100	15,994.00	0.02
510	300058	蓝色光标	2,800	15,960.00	0.02
511	601800	中国交建	1,400	15,946.00	0.02
512	002242	九阳股份	900	15,921.00	0.02
513	600773	西藏城投	2,300	15,916.00	0.02
514	002118	紫鑫药业	2,220	15,873.00	0.02
515	300358	楚天科技	1,600	15,856.00	0.02
516	600315	上海家化	400	15,852.00	0.02
517	601010	文峰股份	5,200	15,756.00	0.02
518	600114	东睦股份	1,600	15,632.00	0.02
519	300196	长海股份	1,500	15,285.00	0.02
520	002030	达安基因	990	15,265.80	0.02
521	600665	天地源	4,300	15,265.00	0.02
522	002323	*ST 百特	3,000	15,240.00	0.02
523	600075	新疆天业	2,300	14,950.00	0.01
524	002437	誉衡药业	2,400	14,880.00	0.01
525	300389	艾比森	900	14,877.00	0.01
526	002294	信立泰	400	14,868.00	0.01
527	300559	佳发教育	500	14,865.00	0.01
528	600990	四创电子	300	14,796.00	0.01
529	600615	丰华股份	1,700	14,739.00	0.01
530	002642	荣之联	1,600	14,704.00	0.01

531	002807	江阴银行	2,600	14,612.00	0.01
532	600761	安徽合力	1,600	14,528.00	0.01
533	600663	陆家嘴	900	14,211.00	0.01
534	600390	五矿资本	1,800	13,950.00	0.01
535	002340	格林美	2,300	13,915.00	0.01
536	601999	出版传媒	2,500	13,875.00	0.01
537	000785	武汉中商	1,800	13,860.00	0.01
538	300604	长川科技	380	13,820.60	0.01
539	600677	航天通信	1,700	13,719.00	0.01
540	600971	恒源煤电	1,920	13,708.80	0.01
541	600309	万华化学	300	13,626.00	0.01
542	300396	迪瑞医疗	740	13,616.00	0.01
543	002462	嘉事堂	700	13,580.00	0.01
544	600385	山东金泰	1,300	13,572.00	0.01
545	002361	神剑股份	3,300	13,563.00	0.01
546	300513	恒泰实达	500	13,495.00	0.01
547	600645	中源协和	700	13,482.00	0.01
548	002679	福建金森	600	13,446.00	0.01
549	600893	航发动力	600	13,392.00	0.01
550	600118	中国卫星	700	13,370.00	0.01
551	000030	富奥股份	1,800	13,356.00	0.01
552	300248	新开普	2,154	13,182.48	0.01
553	300199	翰宇药业	920	13,137.60	0.01
554	603669	灵康药业	1,100	13,002.00	0.01
555	300129	泰胜风能	3,600	12,996.00	0.01
556	000949	新乡化纤	4,400	12,980.00	0.01
557	600683	京投发展	2,800	12,852.00	0.01
558	601368	绿城水务	1,900	12,825.00	0.01
559	600973	宝胜股份	3,500	12,775.00	0.01
560	600967	内蒙一机	1,000	12,740.00	0.01
561	600961	株冶集团	1,900	12,692.00	0.01
562	600015	华夏银行	1,700	12,665.00	0.01
563	000672	上峰水泥	1,400	12,614.00	0.01
564	603663	三祥新材	700	12,544.00	0.01
565	002599	盛通股份	1,200	12,516.00	0.01
566	600089	特变电工	1,800	12,474.00	0.01
567	002033	丽江旅游	1,700	12,359.00	0.01
568	002349	精华制药	2,100	12,264.00	0.01
569	002336	人人乐	1,100	12,254.00	0.01

570	300395	菲利华	900	12,240.00	0.01
571	601599	鹿港文化	3,000	12,210.00	0.01
572	000862	银星能源	3,900	12,207.00	0.01
573	600366	宁波韵升	2,000	12,200.00	0.01
574	600919	江苏银行	1,900	12,179.00	0.01
575	002597	金禾实业	600	12,168.00	0.01
576	600131	岷江水电	2,100	12,159.00	0.01
577	002405	四维图新	600	12,150.00	0.01
578	300346	南大光电	930	12,117.90	0.01
579	601727	上海电气	1,900	12,046.00	0.01
580	000869	张裕 A	300	11,958.00	0.01
581	600780	通宝能源	3,200	11,936.00	0.01
582	600016	民生银行	1,700	11,900.00	0.01
583	002305	南国置业	3,900	11,778.00	0.01
584	002232	启明信息	1,500	11,715.00	0.01
585	600864	哈投股份	2,600	11,700.00	0.01
586	000898	鞍钢股份	2,100	11,697.00	0.01
587	000850	华茂股份	3,100	11,656.00	0.01
588	002613	北玻股份	3,700	11,655.00	0.01
589	000900	现代投资	2,800	11,648.00	0.01
590	002383	合众思壮	700	11,585.00	0.01
591	000880	潍柴重机	1,499	11,527.31	0.01
592	000903	云内动力	4,500	11,520.00	0.01
593	601166	兴业银行	800	11,520.00	0.01
594	600551	时代出版	1,300	11,492.00	0.01
595	601328	交通银行	2,000	11,480.00	0.01
596	300202	聚龙股份	1,100	11,473.00	0.01
597	600000	浦发银行	1,200	11,472.00	0.01
598	000811	冰轮环境	2,400	11,400.00	0.01
599	300492	山鼎设计	500	11,395.00	0.01
600	600037	歌华有线	1,100	11,352.00	0.01
601	601818	光大银行	3,100	11,346.00	0.01
602	002415	海康威视	300	11,139.00	0.01
603	300189	神农基因	3,000	11,130.00	0.01
604	600754	锦江股份	300	11,088.00	0.01
605	002678	珠江钢琴	1,300	11,076.00	0.01
606	600642	申能股份	2,200	11,044.00	0.01
607	600768	宁波富邦	1,000	11,040.00	0.01
608	002390	信邦制药	1,500	10,980.00	0.01

609	300221	银禧科技	1,100	10,890.00	0.01
610	002209	达意隆	1,500	10,860.00	0.01
611	600617	国新能源	2,000	10,860.00	0.01
612	603556	海兴电力	585	10,629.45	0.01
613	600039	四川路桥	3,170	10,397.60	0.01
614	002724	海洋王	1,840	10,285.60	0.01
615	000421	南京公用	2,100	10,206.00	0.01
616	600843	上工申贝	1,200	10,068.00	0.01
617	600155	华创阳安	1,400	10,066.00	0.01
618	300527	中国应急	1,000	10,060.00	0.01
619	601233	桐昆股份	580	9,987.60	0.01
620	600058	五矿发展	1,200	9,972.00	0.01
621	002187	广百股份	1,200	9,888.00	0.01
622	000959	首钢股份	2,400	9,864.00	0.01
623	002496	ST 辉丰	3,600	9,828.00	0.01
624	600586	金晶科技	3,000	9,810.00	0.01
625	300237	美晨生态	1,360	9,764.80	0.01
626	002533	金杯电工	2,000	9,700.00	0.01
627	600136	当代明诚	800	9,680.00	0.01
628	300184	力源信息	900	9,648.00	0.01
629	300061	康旗股份	900	9,630.00	0.01
630	600011	华能国际	1,500	9,540.00	0.01
631	000591	太阳能	2,600	9,516.00	0.01
632	300218	安利股份	1,400	9,506.00	0.01
633	300244	迪安诊断	500	9,505.00	0.01
634	002425	凯撒文化	2,000	9,500.00	0.01
635	002171	楚江新材	1,400	9,492.00	0.01
636	300267	尔康制药	2,100	9,492.00	0.01
637	600262	北方股份	500	9,450.00	0.01
638	300418	昆仑万维	500	9,440.00	0.01
639	300119	瑞普生物	1,100	9,405.00	0.01
640	300034	钢研高纳	1,000	9,360.00	0.01
641	000761	本钢板材	2,300	9,292.00	0.01
642	300045	华力创通	1,000	9,270.00	0.01
643	002772	众兴菌业	1,100	9,207.00	0.01
644	002150	通润装备	1,400	9,184.00	0.01
645	600383	金地集团	900	9,171.00	0.01
646	300449	汉邦高科	500	9,145.00	0.01
647	300376	易事特	1,700	9,129.00	0.01

648	002424	贵州百灵	800	9,088.00	0.01
649	600569	安阳钢铁	2,300	9,062.00	0.01
650	300366	创意信息	1,000	8,980.00	0.01
651	603305	旭升股份	300	8,979.00	0.01
652	002641	永高股份	2,600	8,970.00	0.01
653	601098	中南传媒	700	8,848.00	0.01
654	002250	联化科技	1,000	8,820.00	0.01
655	002444	巨星科技	800	8,808.00	0.01
656	002431	棕榈股份	1,300	8,723.00	0.01
657	000739	普洛药业	1,200	8,592.00	0.01
658	002791	坚朗五金	700	8,533.00	0.01
659	002421	达实智能	2,100	8,505.00	0.01
660	300440	运达科技	1,300	8,489.00	0.01
661	603606	东方电缆	1,135	8,444.40	0.01
662	300087	荃银高科	800	8,384.00	0.01
663	002509	天广中茂	2,800	8,148.00	0.01
664	300608	思特奇	400	8,100.00	0.01
665	600785	新华百货	400	8,072.00	0.01
666	002778	高科石化	420	7,988.40	0.01
667	603728	鸣志电器	500	7,855.00	0.01
668	600004	白云机场	600	7,854.00	0.01
669	600340	华夏幸福	300	7,725.00	0.01
670	300197	铁汉生态	1,400	7,518.00	0.01
671	002573	清新环境	650	7,507.50	0.01
672	000786	北新建材	400	7,412.00	0.01
673	603123	翠微股份	1,200	7,320.00	0.01
674	603676	卫信康	400	7,296.00	0.01
675	000756	新华制药	700	7,224.00	0.01
676	300042	朗科科技	300	7,182.00	0.01
677	601111	中国国航	800	7,112.00	0.01
678	603380	易德龙	400	7,052.00	0.01
679	300343	联创互联	700	7,000.00	0.01
680	600023	浙能电力	1,500	6,990.00	0.01
681	002672	东江环保	530	6,937.70	0.01
682	002279	久其软件	700	6,937.00	0.01
683	300677	英科医疗	300	6,897.00	0.01
684	600053	九鼎投资	400	6,868.00	0.01
685	601988	中国银行	1,900	6,859.00	0.01
686	603990	麦迪科技	200	6,788.00	0.01

687	002878	元隆雅图	300	6,774.00	0.01
688	601636	旗滨集团	1,500	6,675.00	0.01
689	603679	华体科技	300	6,615.00	0.01
690	002166	莱茵生物	900	6,588.00	0.01
691	000607	华媒控股	1,600	6,576.00	0.01
692	000851	高鸿股份	1,220	6,563.60	0.01
693	600219	南山铝业	2,400	6,504.00	0.01
694	601608	中信重工	2,500	6,500.00	0.01
695	000639	西王食品	500	6,415.00	0.01
696	600475	华光股份	600	6,414.00	0.01
697	600428	中远海特	1,800	6,390.00	0.01
698	002726	龙大肉食	900	6,336.00	0.01
699	600166	福田汽车	3,100	6,293.00	0.01
700	600809	山西汾酒	100	6,289.00	0.01
701	300523	辰安科技	100	6,228.00	0.01
702	002299	圣农发展	400	6,196.00	0.01
703	600862	中航高科	1,000	6,150.00	0.01
704	002829	星网宇达	200	6,118.00	0.01
705	002241	歌尔股份	600	6,114.00	0.01
706	000877	天山股份	900	6,075.00	0.01
707	600138	中青旅	300	5,979.00	0.01
708	601390	中国中铁	800	5,976.00	0.01
709	002196	方正电机	800	5,880.00	0.01
710	600250	南纺股份	800	5,816.00	0.01
711	601898	中煤能源	1,200	5,796.00	0.01
712	601225	陕西煤业	700	5,754.00	0.01
713	600879	航天电子	800	5,624.00	0.01
714	600009	上海机场	100	5,548.00	0.01
715	601169	北京银行	900	5,427.00	0.01
716	603208	江山欧派	200	5,378.00	0.01
717	002014	永新股份	800	5,320.00	0.01
718	000555	神州信息	400	5,312.00	0.01
719	600996	贵广网络	700	5,194.00	0.01
720	300296	利亚德	400	5,152.00	0.01
721	000910	大亚圣象	300	5,070.00	0.01
722	601899	紫金矿业	1,400	5,054.00	0.01
723	002376	新北洋	300	4,962.00	0.00
724	603228	景旺电子	100	4,944.00	0.00
725	002013	中航机电	650	4,920.50	0.00

726	002408	齐翔腾达	400	4,912.00	0.00
727	002487	大金重工	1,300	4,758.00	0.00
728	600415	小商品城	1,100	4,741.00	0.00
729	002199	东晶电子	500	4,735.00	0.00
730	002127	南极电商	500	4,695.00	0.00
731	600578	京能电力	1,500	4,680.00	0.00
732	600986	科达股份	500	4,680.00	0.00
733	002665	首航节能	800	4,640.00	0.00
734	002107	沃华医药	500	4,605.00	0.00
735	600418	江淮汽车	700	4,557.00	0.00
736	600273	嘉化能源	500	4,530.00	0.00
737	002084	海鸥住工	900	4,284.00	0.00
738	000667	美好置业	2,000	4,260.00	0.00
739	600705	中航资本	900	4,203.00	0.00
740	600331	宏达股份	1,600	4,144.00	0.00
741	601288	农业银行	1,200	4,128.00	0.00
742	002197	证通电子	500	4,100.00	0.00
743	000402	金融街	500	4,025.00	0.00
744	002684	猛狮科技	340	4,005.20	0.00
745	601139	深圳燃气	720	3,996.00	0.00
746	002429	兆驰股份	1,600	3,968.00	0.00
747	000404	长虹华意	900	3,897.00	0.00
748	300127	银河磁体	300	3,897.00	0.00
749	600028	中国石化	600	3,894.00	0.00
750	300424	航新科技	200	3,884.00	0.00
751	002601	龙鳞佰利	300	3,879.00	0.00
752	000656	金科股份	800	3,840.00	0.00
753	300261	雅本化学	800	3,832.00	0.00
754	600389	江山股份	200	3,790.00	0.00
755	600061	国投资本	400	3,712.00	0.00
756	300290	荣科科技	500	3,610.00	0.00
757	000561	烽火电子	600	3,552.00	0.00
758	600589	广东榕泰	800	3,536.00	0.00
759	600386	北巴传媒	900	3,501.00	0.00
760	600917	重庆燃气	500	3,405.00	0.00
761	603399	吉翔股份	200	3,380.00	0.00
762	603012	创力集团	500	3,360.00	0.00
763	601886	江河集团	400	3,292.00	0.00
764	002484	江海股份	500	3,270.00	0.00

765	002465	海格通信	400	3,212.00	0.00
766	000153	丰原药业	500	3,185.00	0.00
767	600449	宁夏建材	400	3,152.00	0.00
768	002671	龙泉股份	700	3,122.00	0.00
769	300183	东软载波	200	3,074.00	0.00
770	601668	中国建筑	560	3,057.60	0.00
771	601028	玉龙股份	600	3,012.00	0.00
772	002920	德赛西威	100	2,990.00	0.00
773	601633	长城汽车	300	2,946.00	0.00
774	000156	华数传媒	300	2,892.00	0.00
775	000565	渝三峡 A	600	2,850.00	0.00
776	600409	三友化工	320	2,755.20	0.00
777	600567	山鹰纸业	700	2,702.00	0.00
778	002663	普邦股份	900	2,673.00	0.00
779	000876	新希望	420	2,662.80	0.00
780	000951	中国重汽	200	2,658.00	0.00
781	000686	东北证券	400	2,564.00	0.00
782	603678	火炬电子	100	2,492.00	0.00
783	002839	张家港行	400	2,436.00	0.00
784	002555	三七互娱	200	2,430.00	0.00
785	603001	奥康国际	200	2,382.00	0.00
786	300072	三聚环保	100	2,328.00	0.00
787	002477	雏鹰农牧	700	2,317.00	0.00
788	000600	建投能源	400	2,228.00	0.00
789	002648	卫星石化	200	2,206.00	0.00
790	300232	洲明科技	220	2,173.60	0.00
791	603585	苏利股份	100	2,128.00	0.00
792	002311	海大集团	100	2,110.00	0.00
793	600976	健民集团	100	2,099.00	0.00
794	300626	华瑞股份	200	2,032.00	0.00
795	300416	苏试试验	100	2,019.00	0.00
796	002518	科士达	200	1,994.00	0.00
797	600724	宁波富达	600	1,974.00	0.00
798	002543	万和电气	100	1,932.00	0.00
799	300438	鹏辉能源	100	1,931.00	0.00
800	000590	启迪古汉	200	1,898.00	0.00
801	000998	隆平高科	100	1,886.00	0.00
802	000970	中科三环	200	1,870.00	0.00
803	300134	大富科技	200	1,788.00	0.00

804	600522	中天科技	200	1,762.00	0.00
805	000967	盈峰环境	200	1,740.00	0.00
806	300131	英唐智控	300	1,701.00	0.00
807	300239	东宝生物	400	1,692.00	0.00
808	601018	宁波港	400	1,684.00	0.00
809	000518	四环生物	400	1,652.00	0.00
810	600252	中恒集团	500	1,620.00	0.00
811	000890	法尔胜	300	1,560.00	0.00
812	000906	浙商中拓	300	1,542.00	0.00
813	002043	兔宝宝	200	1,532.00	0.00
814	000089	深圳机场	200	1,530.00	0.00
815	002266	浙富控股	400	1,500.00	0.00
816	600122	宏图高科	200	1,480.00	0.00
817	000952	广济药业	100	1,437.00	0.00
818	002045	国光电器	200	1,430.00	0.00
819	000690	宝新能源	200	1,392.00	0.00
820	300303	聚飞光电	500	1,370.00	0.00
821	600129	太极集团	100	1,361.00	0.00
822	600021	上海电力	200	1,348.00	0.00
823	300323	华灿光电	100	1,292.00	0.00
824	603298	杭叉集团	100	1,229.00	0.00
825	000899	赣能股份	300	1,227.00	0.00
826	603309	维力医疗	100	1,206.00	0.00
827	600804	鹏博士	100	1,200.00	0.00
828	300001	特锐德	100	1,136.00	0.00
829	601398	工商银行	200	1,064.00	0.00
830	600650	锦江投资	100	1,048.00	0.00
831	600673	东阳光科	100	1,033.00	0.00
832	300230	永利股份	200	1,030.00	0.00
833	600965	福成股份	100	1,010.00	0.00
834	002556	辉隆股份	200	1,000.00	0.00
835	601900	南方传媒	100	944.00	0.00
836	600190	锦州港	300	939.00	0.00
837	002270	华明装备	150	871.50	0.00
838	002160	常铝股份	200	868.00	0.00
839	000979	中弘股份	800	808.00	0.00
840	601019	山东出版	100	801.00	0.00
841	002489	浙江永强	200	728.00	0.00
842	300171	东富龙	100	676.00	0.00

843	002562	兄弟科技	100	671.00	0.00
844	002498	汉缆股份	300	663.00	0.00
845	603993	洛阳钼业	100	629.00	0.00
846	002167	东方锆业	100	614.00	0.00
847	300307	慈星股份	100	613.00	0.00
848	000592	平潭发展	200	568.00	0.00
849	300032	金龙机电	100	561.00	0.00
850	300155	安居宝	100	476.00	0.00
851	600790	轻纺城	100	358.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600755	厦门国贸	2,071,407.00	1.06
2	600516	方大炭素	1,641,218.61	0.84
3	600757	长江传媒	1,486,873.00	0.76
4	000049	德赛电池	1,413,900.00	0.72
5	600079	人福医药	1,369,515.00	0.70
6	600743	华远地产	1,340,554.50	0.69
7	600580	卧龙电气	1,242,663.04	0.64
8	002048	宁波华翔	1,197,247.00	0.61
9	601717	郑煤机	1,162,503.00	0.60
10	600651	飞乐音响	1,157,373.85	0.59
11	600978	宜华生活	1,113,195.90	0.57
12	600282	南钢股份	1,111,103.00	0.57
13	600557	康缘药业	1,101,047.00	0.56
14	603444	吉比特	1,099,336.00	0.56
15	600618	氯碱化工	1,096,935.00	0.56
16	600750	江中药业	1,083,820.00	0.55
17	600094	大名城	1,076,055.00	0.55
18	002195	二三四五	1,063,863.00	0.54
19	600216	浙江医药	1,035,435.00	0.53
20	600628	新世界	1,030,837.00	0.53

7.4.2 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	601318	中国平安	11,100,450.28	5.68
2	600519	贵州茅台	5,692,716.20	2.91
3	600036	招商银行	4,494,706.68	2.30
4	601166	兴业银行	2,961,432.00	1.52
5	600016	民生银行	2,699,023.00	1.38
6	600887	伊利股份	2,548,994.29	1.30
7	601328	交通银行	2,392,501.00	1.22
8	601288	农业银行	2,177,044.00	1.11
9	600030	中信证券	2,093,709.00	1.07
10	600000	浦发银行	1,962,726.00	1.00
11	601398	工商银行	1,935,454.00	0.99
12	601668	中国建筑	1,850,532.00	0.95
13	601601	中国太保	1,757,230.60	0.90
14	600104	上汽集团	1,715,444.47	0.88
15	600755	厦门国贸	1,697,788.00	0.87
16	601169	北京银行	1,435,429.00	0.73
17	600048	保利地产	1,428,590.13	0.73
18	600837	海通证券	1,339,627.52	0.69
19	600516	方大炭素	1,250,698.80	0.64
20	601988	中国银行	1,225,854.00	0.63

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	187,795,022.52
卖出股票收入（成交）总额	194,453,260.37

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,520,900.00	5.51
	其中：政策性金融债	5,520,900.00	5.51
4	企业债券	41,895.00	0.04
5	企业短期融资券	4,017,600.00	4.01
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,580,395.00	9.56

7.6 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明细

金额单位：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	018005	国开 1701	55,000	5,520,900.00	5.51
2	011800221	18 中铝集 SCP002	40,000	4,017,600.00	4.01
3	122444	15 冠城债	420	41,895.00	0.04

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	48,559.71
2	应收证券清算款	250,882.34
3	应收股利	-
4	应收利息	107,456.00
5	应收申购款	749.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	407,647.05

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中金丰鸿 A	201	501,941.31	100,865,696.99	99.98%	24,506.06	0.02%
中金丰鸿 C	48	561.98	-	-	26,975.19	100.00%
合计	249	405,289.87	100,865,696.99	99.95%	51,481.25	0.05%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金丰鸿 A	5,307.09	0.0053%
	中金丰鸿 C	1,101.39	4.0830%
	合计	6,408.48	0.0064%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金丰鸿 A	0~10
	中金丰鸿 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中金丰鸿 A	0~10
	中金丰鸿 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金丰鸿 A	中金丰鸿 C
基金合同生效日（2017 年 7 月 7 日）基金份额总额	190,066,086.87	13,010,791.07
本报告期期初基金份额总额	183,050,325.62	3,095,935.87
本报告期基金总申购份额	59,336,088.04	43,088.77
减：本报告期基金总赎回份额	141,496,210.61	3,112,049.45
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	100,890,203.05	26,975.19

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，基金管理人与股东中国国际金融股份有限公司就侵犯商标权及不正当竞争事项，联合向北京市朝阳区人民法院起诉南京中金基金管理有限公司。截至 2018 年 6 月 30 日，该案已获法院受理，尚未开庭。除前述事项外，本报告期无涉及基金管理人的其他诉讼事项。

本报告期无涉及本基金基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	2	381,584,494.76	99.99%	279,043.87	99.99%	-

太平洋证券	2	39,953.65	0.01%	29.22	0.01%	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
国金证券	71,783,603.39	87.73%	812,500,000.00	97.04%	-	-
太平洋证券	5,043,879.47	6.16%	24,800,000.00	2.96%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	5,000,000.00	6.11%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增中投证券为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 1 月 4 日
2	中金基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 1 月 18 日
3	中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 1 月 19 日
4	中金基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职责的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 2 月 10 日
5	中金基金管理有限公司更正基金经理恢复履职日期的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 2 月 13 日
6	中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金招募说明书及其摘要（2018 年第 1 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 2 月 14 日
7	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 7 日
8	关于新增北京植信基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 22 日
9	关于根据《公开募集开放式证	《中国证券报》、《上海	2018 年 3 月 30 日

	券投资基金流动性风险管理规定》对短期投资行为收取短期赎回费的提示性公告	证券报》、《证券时报》及/或公司网站	
10	中金基金管理有限公司关于修改旗下部分开放式基金《基金合同》、《托管协议》等法律文件的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 30 日
11	中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金 2017 年度报告及摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 30 日
12	关于新增南京苏宁基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 4 月 11 日
13	中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 4 月 23 日
14	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金网上申购富士康工业互联网股份有限公司首次公开发行 A 股股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 5 月 30 日
15	关于新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 5 月 31 日
16	中金基金管理有限公司关于调整旗下基金所持长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 6 月 20 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	56,502,542.50	0.00	20,000,000.00	36,502,542.50	36.17%
	2	2018 年 4 月 18 日至 2018 年 6 月 30 日	0.00	21,491,310.04	0.00	21,491,310.04	21.30%

产品特有风险

(1) 本基金是混合型基金，股票资产占基金资产的比例范围为 0-95%；股票等权益类产品出现市场性整体下跌时将可能影响到本基金的业绩表现。

(2) 采用量化投资策略风险

1) 规模风险

规模风险是指管理资产规模过大导致的获利空间缩窄、投资回报下降的风险。若相似策略的产品规模过于庞大，各产品的交易单量大又相对集中，可能导致较大的滑点，从而影响本基金表现。所有的量化选股策略对资产规模都有一定的限制，过大的规模会对投资收益有影响。

2) 模型有效性及策略失败风险

模型有效性风险主要是模型捕捉的机会消失可能导致获利能力下降甚至丧失，所有的模型均有失效的可能，从而影响基金的表现；本基金的投资策略主要包括量化选股策略和其他策略，力求实现基金资产的稳定增值，但有可能因投资策略的失败而导致基金损失。

3) 股票选择风险

本基金的量化选股模型在注重基本面研究的同时，结合多种统计量化策略，主要包括多因子模型和统计套利模型等，期望筛选出对比做空的股指或个股有超额收益的股票。但有可能在某区间本基金买入的股票收益率低于做空的股指收益率，从而导致基金损失。

4) 本金损失风险

本基金灵活应用各种收益策略来对冲基金的系统性风险或进行投资个股的筛选，但投资策略的失败和投资市场的波动可能会导致投资本基金的投资者遭受本金损失，存在本金损失的风险。

5) 卖空风险

本基金适时采用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险，但可以不完全对冲，根据合同本基金可以持有净多头或净空头头寸，将来亦有可能通过做空个股、做空其他衍生工具的方式来实现投资目标。如果基金管理人判断失误可能导致本基金在某些市场情况下无法跑赢普通偏股型基金，也有可能在特殊情况下发生比普通偏股型基金更大的损失。

6) 金融数据的风险

本基金应用量化模型和外部提供商的金融数据协助进行量化选股。数据通常来源于不同的数据提供商，且在进行数据清洗、加工后作为量化模型的输入变量。采集到的原始金融数据的错误或不完整、预处理过程中的缺陷都可能直接影响量化模型的输出结果，形成数据风险，对基金的业绩产生不利的影响。

(3) 股指期货投资风险

1) 流动性风险：基金在股指期货市场成交不活跃时，可能在建仓和平仓股指期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

2) 基差风险：在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股票指数现货价格与股指期货合约价格波动不一致而遭受基差风险。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本基金投资产生影响。

3) 合约展期风险：本基金所投资的期货合约主要包括股指期货当月和近月合约。当基金所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

4) 到期日风险：股指期货合约到期时，基金财产如持有为平仓合约，中金所将按照交割结算价将基金持有的合约进行现金交割，导致基金无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

5) 股指期货保证金不足风险：由于股指期货价格朝不利方向变动，导致期货账户的资金低于金融期货交易所或者期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，股指期货头寸将被强行平仓，导致无法规避对冲系统性风险，直接影响本基金收益水平，从而产生风险。

6) 杠杆风险：股指期货作为金融衍生品，其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，基金可能承受超出保证金甚至基金资产本金的损失。

7) 对手方风险：基金管理人运用基金财产投资于股指期货时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金财产遭受损失。

8) 平仓风险：期货经纪公司或其客户保证金不足，又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所以对期货经纪公司的经纪账户强行平仓，资产管理计划财产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

(4) 国债期货投资风险 本基金对国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

(5) 资产支持证券投资风险

本基金投资品种包含资产支持证券品种，由于资产支持证券一般都针对特定机构投资人发行，且仅在特定机构投资人范围内流通转让，该品种的流动性较差，且抵押资产的流动性较差，因此，持有资产支持证券可能给组合资产净值带来一定的风险。另外，资产支持证券还面临提前偿还和延期支付的风险。

(6) 中小企业私募债券投资风险

本基金投资品种包含中小企业私募债券，中小企业私募债券是由非上市公司采用非公开方式发行的

债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

(7) 流通受限证券投资风险

本基金可以投资流通受限证券，该类证券有一定期限的锁定期，锁定期内不得上市交易或转让，由此可能给基金带来更大的流动性风险、操作风险和估值风险等各类风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金募集的注册的文件
- 2、《中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、本报告期内在指定媒介上披露的有关本基金的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件和复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2018年8月28日