

# 中金量化多策略灵活配置 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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、财务会计报告和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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>49</b>
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.....	76
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	77
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.....	78
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.....	78
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.....	78
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.....	78
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	78
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	79
7.12 投资组合报告附注.....	79
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>81</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	81
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	81
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.....	81
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>82</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>83</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	83
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.....	83
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	83
10.4 基金投资策略的改变.....	83
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	83
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.....	83
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	83
10.8 其他重大事件.....	84
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>87</b>
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.....	87

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	88
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>89</b>
12.1 备查文件目录.....	89
12.2 存放地点.....	89
12.3 查阅方式.....	89

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中金量化多策略
场内简称	-
基金主代码	003582
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 10 日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	130,068,061.71 份
基金合同存续期	-
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在严格控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的稳定增值。
投资策略	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多种量化策略。本基金在股票投资过程中将保持模型选股并构建股票投资组合的投资策略，强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险，力争基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型证券投资基金，高于债券型证券投资基金和货币市场基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李虹	田青
	联系电话	010-63211122	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-868-1166	010-67595096

传真	010-66159121	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 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 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心
邮政编码	100032	100033
法定代表人	林寿康	田国立

## 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	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
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

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)
本期已实现收益	-147,917.96
本期利润	-13,087,950.12
加权平均基金份额本期利润	-0.1006
本期加权平均净值利润率	-9.84%
本期基金份额净值增长率	-9.74%
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	-8,283,597.18
期末可供分配基金份额利润	-0.0637
期末基金资产净值	121,784,464.53
期末基金份额净值	0.936
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	-6.40%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数；

#### 3.2 基金净值表现

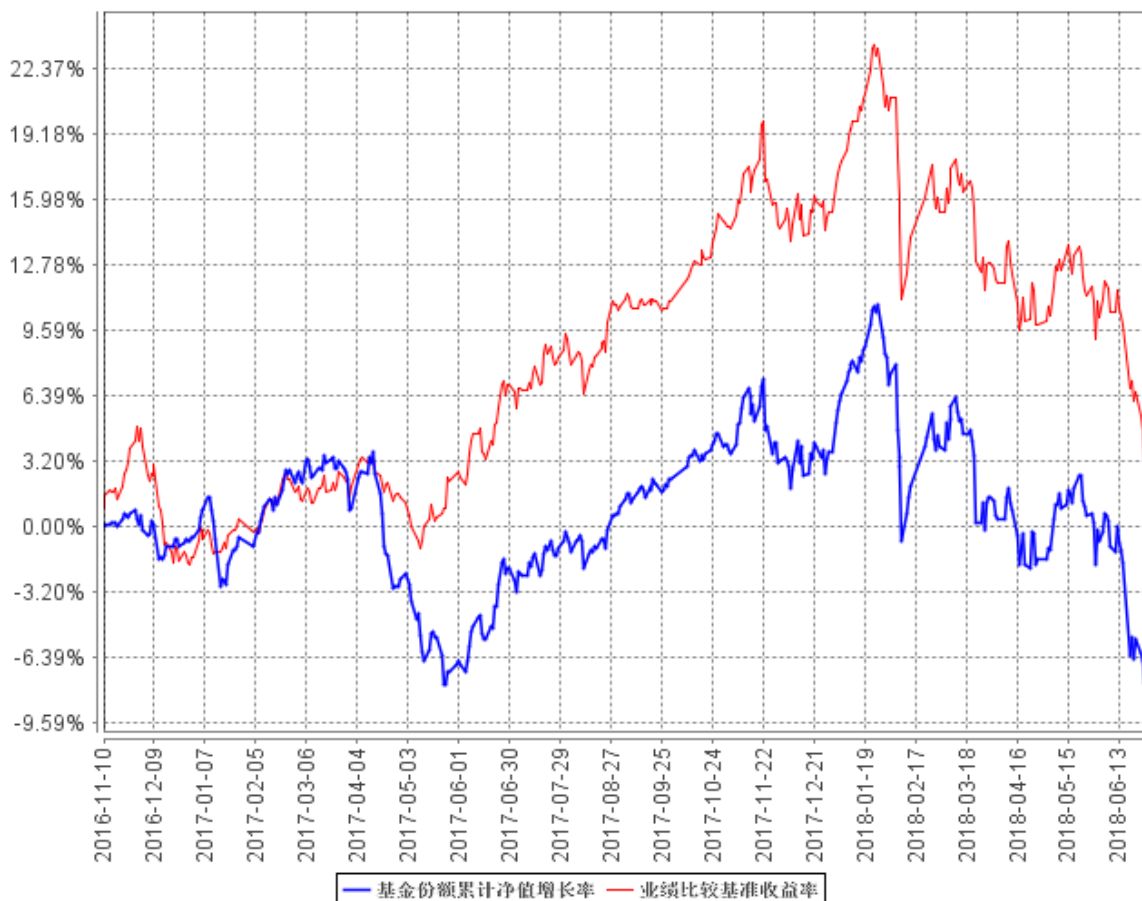
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.31%	1.34%	-6.03%	1.02%	-0.28%	0.32%
过去三个月	-7.78%	1.05%	-7.58%	0.91%	-0.20%	0.14%
过去六个月	-9.74%	1.04%	-9.57%	0.92%	-0.17%	0.12%
过去一年	-4.49%	0.83%	-2.44%	0.76%	-2.05%	0.07%
自基金合同生效起至今	-6.40%	0.74%	4.33%	0.67%	-10.73%	0.07%



### 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

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



## § 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 3 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 14 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		
魏宇	本基金的基金经理	2017 年 3 月 28 日	-	8 年	魏宇先生，香港大学统计专业博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发工作。2014 年 11 月，加入中金基金管理有限公司，现任中金基金管理有限公司量化公募投资部基金经理、副总经理。
石玉	本基金的基金经理	2017 年 3 月 29 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。
刘重晋	本基金	2017 年 8 月 2 日	-	7 年	刘重晋先生，博士。历任

	基金经 理				松河投资咨询（深圳）有 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。

1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、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，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》等相关法律法规和基金合同约定，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。在上半年，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。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

截至本报告期末本基金份额净值为 0.936 元；本报告期基金份额净值增长率为-9.74%，业绩比较基准收益率为-9.57%。

## 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《公开募集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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：中金量化多策略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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	696,171.25	270,702.03
结算备付金		835,555.90	1,351,204.10
存出保证金		27,138.72	15,637.15
交易性金融资产	6.4.7.2	119,020,358.70	128,368,601.63
其中：股票投资		109,012,458.70	121,264,401.63
基金投资		-	-
债券投资		10,007,900.00	7,104,200.00
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	1,400,000.00	5,500,000.00
应收证券清算款		100,033.55	1,366,632.07
应收利息	6.4.7.5	329,590.10	169,787.92
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		122,408,848.22	137,042,564.90
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		71,553.53	1,597,299.32
应付赎回款		35.72	-
应付管理人报酬		155,896.67	171,083.72
应付托管费		25,982.77	28,513.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	262,286.94	225,871.17

应交税费		408.58	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	108,219.48	140,000.00
负债合计		624,383.69	2,162,768.18
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	130,068,061.71	130,075,227.36
未分配利润	6.4.7.10	-8,283,597.18	4,804,569.36
所有者权益合计		121,784,464.53	134,879,796.72
负债和所有者权益总计		122,408,848.22	137,042,564.90

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.936 元，基金份额总额 130,068,061.71 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中金量化多策略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	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-10,789,397.41	352,095.17
1.利息收入		215,323.05	984,781.80
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,454.07	90,604.60
债券利息收入		136,517.97	626,491.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		64,351.01	267,685.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,935,301.68	-12,530,413.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	761,614.53	-13,616,655.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	38,831.09	-1,791.75
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,134,856.06	1,088,033.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-12,940,032.16	11,897,691.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	10.02	35.09
<b>减：二、费用</b>		2,298,552.71	3,366,786.53



1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	988,545.81	1,472,517.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	164,757.69	245,419.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,045,271.87	1,553,975.95
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		68.65	-
7. 其他费用	6.4.7.20	99,908.69	94,873.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-13,087,950.12	-3,014,691.36
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-13,087,950.12	-3,014,691.36

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金量化多策略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）	130,075,227.36	4,804,569.36	134,879,796.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,087,950.12	-13,087,950.12
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）	-7,165.65	-216.42	-7,382.07
其中：1.基金申购款	1,898.14	98.86	1,997.00
2.基金赎回款	-9,063.79	-315.28	-9,379.07
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）	130,068,061.71	-8,283,597.18	121,784,464.53

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	200,107,012.29	-1,003,454.22	199,103,558.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,014,691.36	-3,014,691.36
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)	-20,646.24	844.65	-19,801.59
其中：1.基金申购款	1,255.40	33.22	1,288.62
2.基金赎回款	-21,901.64	811.43	-21,090.21
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)	200,086,366.05	-4,017,300.93	196,069,065.12

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

中金量化多策略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 2016 年 6 月 27 日证监许可 [2016] 1415 号《关于准予中金量化多策略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《中金量化多策略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，托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称：“建设银行”）。

本基金通过中金基金管理有限公司直销中心、中金基金网上直销平台、中国国际金融股份有

限公司（以下简称“中金公司”）及北京肯特瑞财富投资管理有限公司等共同销售，自 2016 年 11 月 2 日起至 2016 年 11 月 7 日止。经向中国证监会备案，《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 10 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 200,107,412.33 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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金量化多策略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、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转换债券）、次级债、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、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的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日及 2017 年 6 月 30 日的财务状况、自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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

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 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《中金量化多策略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；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的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；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

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间未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：

(a) 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。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 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。

(f) 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	696,171.25
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：	696,171.25

### 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	118,765,462.96	109,012,458.70	-9,753,004.26
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	10,042,125.76	10,007,900.00	-34,225.76
	银行间市场	-	-	-
	合计	10,042,125.76	10,007,900.00	-34,225.76
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		128,807,588.72	119,020,358.70	-9,787,230.02

### 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	-	-
买入返售证券_交易所	1,400,000.00	-
合计	1,400,000.00	-

#### 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	150.40
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	376.00
应收债券利息	329,352.33
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-300.83
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	12.20
合计	329,590.10

#### 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	262,286.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	262,286.94

#### 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	0.14
预提费用	108,219.34
合计	108,219.48

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	130,075,227.36	130,075,227.36
本期申购	1,898.14	1,898.14
本期赎回(以“-”号填列)	-9,063.79	-9,063.79
- 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	130,068,061.71	130,068,061.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,022,470.95	782,098.41	4,804,569.36
本期利润	-147,917.96	-12,940,032.16	-13,087,950.12
本期基金份额交易产生的变动数	-319.92	103.50	-216.42
其中：基金申购款	103.62	-4.76	98.86
基金赎回款	-423.54	108.26	-315.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,874,233.07	-12,157,830.25	-8,283,597.18

#### 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	5,616.46
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	8,629.61
其他	208.00
合计	14,454.07

#### 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	396,367,923.25
减：卖出股票成本总额	395,606,308.72
买卖股票差价收入	761,614.53

**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	38,831.09
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	38,831.09

**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	8,030,899.61
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,733,257.01
减：应收利息总额	258,811.51
买卖债券差价收入	38,831.09

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无投资其他衍生工具。

**6.4.7.16 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	1,134,856.06
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,134,856.06

**6.4.7.17 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	-12,940,032.16
——股票投资	-12,902,966.12
——债券投资	-37,066.04
——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	-12,940,032.16

**6.4.7.18 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	9.25
转换费收入	0.77

合计	10.02
----	-------

#### 6.4.7.19 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	1,045,271.87
银行间市场交易费用	-
合计	1,045,271.87

#### 6.4.7.20 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	44,630.98
帐户维护费	18,600.00
汇划手续费	3,089.35
其他	-
合计	99,908.69

#### 6.4.7.21 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。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，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、基金注册登记机构及基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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
中国中投证券有限责任公司（“中投证券”）	基金管理人股东的一级全资子公司

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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中金公司	-	-	213,503,251.36	17.80%
中投证券	91,085,313.40	11.51%	170,721,887.74	14.23%

**6.4.10.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	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 成交总额的比例
中金公司	52,600.00	0.48%	10,991.20	0.11%

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日



	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中金公司	-	-	840,200,000.00	63.74%
中投证券	27,200,000.00	6.81%	19,000,000.00	1.44%

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期与上年度可比期间无关联方权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中投证券	66,601.69	11.51%	66,601.69	25.39%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中金公司	156,134.80	17.80%	9,530.69	1.30%
中投证券	124,848.67	14.23%	124,848.67	17.09%

#### 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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	988,545.81	1,472,517.15
其中：支付销售机构的客户维护费	5.87	0.00

注：支付基金管理人中金基金的基金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。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	164,757.69	245,419.54

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期无销售服务费。

#### 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

本报告期本基金未发生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自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人无运用自有资金投资本基金。

##### 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	696,171.25	5,616.46	4,488,610.68	59,439.34

注：本基金通过“建设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 862,694.62 元（2017年6月30日：人民币 2,533,410.06 元），当年产生的利息收入为人民币 8,837.61 元（自2017年1月1日至2017年6月30日止期间：人民币 31,165.26 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

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	1,000	13,770.00
------	--------	------	------	-------	-----------

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

##### 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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002310	东方园林	2018年5月25日	重大资	15.03	2018年8月27日	13.47	40,520	766,598.19	609,015.60	-

		日	产 重 组							
601390	中国 中铁	2018 年 5 月 7 日	重 大 资 产 重 组	7.47	2018 年 8 月 20 日	7.25	72,710	542,621.09	543,143.70	-
000415	渤海 金控	2018 年 1 月 17 日	重 大 资 产 重 组	5.84	2018 年 7 月 17 日	5.26	80,300	498,804.38	468,952.00	-
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	59,640	465,392.83	432,390.00	-
002450	康得 新	2018 年 6 月 4 日	重 大 资 产 重 组	17.08	-	-	24,897	518,019.80	425,240.76	-
002051	中工 国际	2018 年 4 月 9 日	重 大 资 产 重 组	15.27	-	-	27,000	437,995.57	412,290.00	-
300266	兴源 环境	2018 年 2 月 5 日	重 大 资 产 重 组	19.99	2018 年 7 月 2 日	17.99	14,000	352,066.00	279,860.00	-
600022	山东 钢铁	2018 年 3 月 27 日	重 大 资 产 重 组	2.02	2018 年 8 月 16 日	1.83	118,200	259,309.03	238,764.00	-

			组							
000008	神州 高铁	2018 年 6 月 6 日	重 大 事 项	4.96	2018 年 8 月 7 日	4.46	47,180	268,082.02	234,012.80	-
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	10,166	185,861.67	180,446.50	-
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	49,700	195,506.17	178,920.00	-
002602	世纪 华通	2018 年 6 月 12 日	重 大 资 产 重 组	32.50	-	-	4,900	166,281.29	159,250.00	-
000825	太钢 不锈	2018 年 4 月 16 日	重 大 资 产 重 组	6.00	-	-	21,600	122,813.98	129,600.00	-
600751	海航 科技	2018 年 1 月 12 日	重 大 资 产 重 组	6.49	-	-	17,800	112,358.43	115,522.00	-
000723	美锦 能源	2018 年 3 月 27 日	重 大 资 产 重 组	5.43	2018 年 7 月 31 日	4.89	17,900	110,634.56	97,197.00	-
300324	旋极 信息	2018 年 5 月 30 日	重 大 资 产 重	9.49	-	-	9,981	104,038.58	94,719.69	-

			组								
002252	上海莱士	2018年2月23日	重大资产重组	19.52	-	-	4,711	95,703.47	91,958.72	-	
600811	东方集团	2018年5月30日	重大事项	4.30	-	-	16,600	72,769.90	71,380.00	-	
002359	北讯集团	2018年5月21日	重大事项	19.58		2018年8月21日	17.62	3,400	89,911.85	66,572.00	-
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	1,700	58,876.68	60,741.00	-
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	2,800	54,578.25	53,172.00	-
002699	美盛文化	2018年2月5日	临时停牌	18.76		2018年7月2日	16.88	2,700	49,745.00	50,652.00	-
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	4,200	46,122.67	45,360.00	-
002512	达华智能	2018年6月19日	重大事项	9.70	-	-	3,500	37,249.77	33,950.00	-	
600293	三峡新材	2018年5月2日	重大事	5.68		2018年8月7日	5.11	5,767	38,983.30	32,756.56	-

		日	项		日					
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	3,200	30,410.34	29,088.00	-
300108	吉药控股	2018年6月12日	重大资产重组	7.84	-	-	3,700	30,393.01	29,008.00	-
002011	盾安环境	2018年5月2日	重大资产重组	6.40	-	-	4,400	30,119.30	28,160.00	-
002147	新光圆成	2018年1月18日	重大资产重组	14.76	-	-	1,900	26,868.97	28,044.00	-
600678	四川金顶	2018年4月18日	重大资产重组	10.24	-	-	2,700	27,554.27	27,648.00	-
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	4,400	28,917.57	27,280.00	-
600759	洲际油气	2018年3月27日	重大资产重组	3.94	-	-	6,300	22,974.68	24,822.00	-
600221	海航控股	2018年1月10日	重大资	3.23	2018年7月20日	2.91	7,000	22,168.47	22,610.00	-

		日	产 重 组		日					
600768	宁波 富邦	2018 年 6 月 14 日	重 大 资 产 重 组	11.04	-	-	1,900	21,236.00	20,976.00	-
601727	上海 电气	2018 年 6 月 6 日	重 大 事 项	6.34	2018 年 8 月 7 日	5.71	3,000	17,559.68	19,020.00	-
600796	钱江 生化	2018 年 5 月 2 日	重 大 资 产 重 组	6.08	-	-	3,100	19,115.00	18,848.00	-
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	1,500	19,048.00	18,270.00	-
002171	楚江 新材	2018 年 6 月 7 日	重 大 事 项	6.78	-	-	1,900	12,971.86	12,882.00	-
300197	铁汉 生态	2018 年 5 月 28 日	重 大 资 产 重 组	5.37	-	-	1,950	12,600.16	10,471.50	-
002431	棕榈 股份	2018 年 5 月 30 日	重 大 事 项	6.71	-	-	1,510	10,901.21	10,132.10	-
002573	清新 环境	2018 年 6 月 19 日	重 大 事 项	11.55	-	-	730	9,832.04	8,431.50	-
000779	三毛	2018	重	13.47	2018	12.12	600	7,489.46	8,082.00	-



	派神	年 3 月 21 日	大 资 产 重 组		年 8 月 21 日					
300343	联创 互联	2018 年 6 月 19 日	重 大 事 项	10.00	-	-	800	8,105.66	8,000.00	-
002778	高科 石化	2018 年 4 月 23 日	重 大 资 产 重 组	19.02	2018 年 7 月 20 日	18.00	400	8,074.98	7,608.00	-
002665	首航 节能	2018 年 5 月 29 日	重 大 资 产 重 组	5.80	-	-	1,100	7,366.56	6,380.00	-
002408	齐翔 腾达	2018 年 6 月 19 日	重 大 资 产 重 组	12.28	-	-	500	6,806.00	6,140.00	-
002143	印纪 传媒	2018 年 2 月 2 日	重 大 资 产 重 组	12.09	2018 年 7 月 9 日	10.88	400	5,455.00	4,836.00	-
000035	中国 天楹	2017 年 8 月 22 日	重 大 资 产 重 组	6.72	2018 年 7 月 9 日	6.05	600	3,951.00	4,032.00	-
000426	兴业 矿业	2018 年 6 月 19 日	重 大 事 项	7.21	2018 年 8 月 27 日	6.47	500	3,984.94	3,605.00	-
300131	英唐	2018	重	5.67	-	-	500	2,867.00	2,835.00	-

	智控	年 5 月 29 日	大资产重组							
300187	永清环保	2018 年 4 月 9 日	重大资产重组停牌	9.32	-	-	300	2,889.00	2,796.00	-
002477	雏鹰农牧	2018 年 6 月 14 日	重大事项	3.31	-	-	800	2,876.08	2,648.00	-
600724	宁波富达	2018 年 5 月 3 日	重大资产重组	3.29	2018 年 8 月 24 日	3.05	800	2,612.00	2,632.00	-
300072	三聚环保	2018 年 6 月 19 日	重大事项	23.28	2018 年 7 月 10 日	24.00	100	2,360.00	2,328.00	-
600122	宏图高科	2018 年 6 月 19 日	重大资产重组	7.40	-	-	200	1,591.00	1,480.00	-
0000967	盈峰环境	2018 年 5 月 18 日	重大资产重组	8.70	2018 年 7 月 31 日	7.84	100	862.00	870.00	-
002102	冠福股份	2018 年 6 月 1 日	重大资产重组	3.72	-	-	11,700	50,472.01	43,524.00	-

			组								
002270	华明装备	2018年5月3日	重大资产重组停牌	5.81		2018年7月3日	5.23	1,350	8,465.26	7,843.50	-
002411	必康股份	2018年6月19日	重大事项	27.75	-		-	212	6,155.00	5,883.00	-
002739	万达电影	2017年7月4日	重大资产重组	37.99	-		-	25,439	1,402,932.17	966,427.61	-
600335	国机汽车	2018年4月3日	重大资产重组	10.43	-		-	2,500	27,347.99	26,075.00	-

### 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

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

##### 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	3,007,200.00	60,300.00

AAA 以下	-	59,300.00
未评级	-	-
合计	3,007,200.00	119,600.00

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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2018 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	696,171.25	-	-	-	696,171.25
结算备付金	835,555.90	-	-	-	835,555.90
存出保证金	27,138.72	-	-	-	27,138.72
交易性金融资产- 股票投资	-	-	-	-109,012,458.70	109,012,458.70
交易性金融资产- 债券投资	10,007,900.00	-	-	-	10,007,900.00
买入返售金融资产	1,400,000.00	-	-	-	1,400,000.00
应收证券清算款	-	-	-	100,033.55	100,033.55
应收利息	-	-	-	329,590.10	329,590.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	12,966,765.87	-	-	-109,442,082.35	122,408,848.22
负债					
卖出回购金融资产 款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	71,553.53	71,553.53
应付赎回款	-	-	-	35.72	35.72
应付管理人报酬	-	-	-	155,896.67	155,896.67
应付托管费	-	-	-	25,982.77	25,982.77
应付交易费用	-	-	-	262,286.94	262,286.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	408.58	408.58
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	108,219.48	108,219.48
负债总计	-	-	-	624,383.69	624,383.69
利率敏感度缺口	12,966,765.87	-	-	-108,817,698.66	121,784,464.53
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	270,702.03	-	-	-	270,702.03
结算备付金	1,351,204.10	-	-	-	1,351,204.10
存出保证金	15,637.15	-	-	-	15,637.15
交易性金融资产- 股票投资	-	-	-	-121,264,401.63	121,264,401.63
交易性金融资产- 债券投资	6,984,600.00	400.00	119,200.00	-	7,104,200.00
买入返售金融资产	5,500,000.00	-	-	-	5,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,366,632.07	1,366,632.07
应收利息	-	-	-	169,787.92	169,787.92

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	14,122,143.28	400.00	119,200.00	122,800,821.62	137,042,564.90
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,597,299.32	1,597,299.32
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	171,083.72	171,083.72
应付托管费	-	-	-	28,513.97	28,513.97
应付交易费用	-	-	-	225,871.17	225,871.17
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	-	-	-	2,162,768.18	2,162,768.18
利率敏感度缺口	14,122,143.28	400.00	119,200.00	120,638,053.44	134,879,796.72

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	3,424.86	5,105.74
市场利率上升 25 个基点	-3,424.86	-5,105.74	

#### 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	109,012,458.70	89.51	121,264,401.63	89.91
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	10,007,900.00	8.22	7,104,200.00	5.27
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	119,020,358.70	97.73	128,368,601.63	95.17

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	6,246,546.87	6,204,376.38
	业绩比较基准下降 5%	-6,246,546.87	-6,204,376.38

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*80%+中证全债指数收益率\*20%

#### 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	109,012,458.70	89.06
	其中：股票	109,012,458.70	89.06
2	固定收益投资	10,007,900.00	8.18
	其中：债券	10,007,900.00	8.18
	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	1,400,000.00	1.14
	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	1,531,727.15	1.25
7	其他各项资产	456,762.37	0.37
8	合计	122,408,848.22	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	374,739.88	0.31
B	采矿业	3,038,672.52	2.50
C	制造业	51,671,684.74	42.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,902,557.15	3.20
E	建筑业	5,275,282.35	4.33
F	批发和零售业	5,764,148.07	4.73
G	交通运输、仓储和邮政业	3,562,424.98	2.93
H	住宿和餐饮业	35,766.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,132,187.04	3.39
J	金融业	16,363,917.24	13.44
K	房地产业	7,821,628.76	6.42
L	租赁和商务服务业	1,732,738.76	1.42
M	科学研究和技术服务业	137,240.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	1,184,247.29	0.97

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	71,568.80	0.06
R	文化、体育和娱乐业	3,788,502.62	3.11
S	综合	155,152.50	0.13
	合计	109,012,458.70	89.51

## 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	601318	中国平安	41,230	2,415,253.40	1.98
2	600519	贵州茅台	3,200	2,340,672.00	1.92
3	600016	民生银行	221,600	1,551,200.00	1.27
4	002304	洋河股份	8,403	1,105,834.80	0.91
5	600015	华夏银行	144,260	1,074,737.00	0.88
6	601006	大秦铁路	127,500	1,046,775.00	0.86
7	000425	徐工机械	236,700	1,003,608.00	0.82
8	000157	中联重科	240,510	988,496.10	0.81
9	002739	万达电影	25,439	966,427.61	0.79
10	600376	首开股份	133,539	938,779.17	0.77
11	600887	伊利股份	33,533	935,570.70	0.77
12	600369	西南证券	239,600	922,460.00	0.76
13	601169	北京银行	149,480	901,364.40	0.74
14	000651	格力电器	18,850	888,777.50	0.73
15	600208	新湖中宝	230,010	878,638.20	0.72
16	601166	兴业银行	60,500	871,200.00	0.72
17	600170	上海建工	286,025	869,516.00	0.71
18	600585	海螺水泥	24,600	823,608.00	0.68
19	000858	五粮液	10,660	810,160.00	0.67
20	600153	建发股份	89,416	803,849.84	0.66
21	600919	江苏银行	125,300	803,173.00	0.66
22	600104	上汽集团	22,490	786,925.10	0.65
23	601888	中国国旅	11,900	766,479.00	0.63

24	600741	华域汽车	31,978	758,518.16	0.62
25	000069	华侨城 A	104,540	755,824.20	0.62
26	300027	华谊兄弟	121,300	747,208.00	0.61
27	000338	潍柴动力	83,100	727,125.00	0.60
28	000333	美的集团	12,944	675,935.68	0.56
29	600089	特变电工	95,058	658,751.94	0.54
30	601168	西部矿业	103,000	646,840.00	0.53
31	002603	以岭药业	45,900	641,682.00	0.53
32	600383	金地集团	60,660	618,125.40	0.51
33	000895	双汇发展	23,364	617,043.24	0.51
34	600309	万华化学	13,430	609,990.60	0.50
35	002310	东方园林	40,520	609,015.60	0.50
36	300039	上海凯宝	102,370	593,746.00	0.49
37	601717	郑煤机	101,800	591,458.00	0.49
38	600674	川投能源	66,010	575,607.20	0.47
39	600557	康缘药业	46,400	573,040.00	0.47
40	601009	南京银行	73,550	568,541.50	0.47
41	000718	苏宁环球	154,430	566,758.10	0.47
42	603188	ST 亚邦	54,950	560,490.00	0.46
43	600219	南山铝业	206,350	559,208.50	0.46
44	000623	吉林敖东	30,530	548,929.40	0.45
45	601390	中国中铁	72,710	543,143.70	0.45
46	601328	交通银行	93,250	535,255.00	0.44
47	601668	中国建筑	97,074	530,024.04	0.44
48	603288	海天味业	7,100	522,844.00	0.43
49	601601	中国太保	15,983	509,058.55	0.42
50	002294	信立泰	13,410	498,449.70	0.41
51	601229	上海银行	31,600	498,016.00	0.41
52	000826	启迪桑德	28,240	493,635.20	0.41
53	601211	国泰君安	32,900	484,946.00	0.40
54	000100	TCL 集团	167,200	484,880.00	0.40
55	600820	隧道股份	81,330	480,660.30	0.39
56	000625	长安汽车	53,380	480,420.00	0.39
57	601997	贵阳银行	38,300	473,388.00	0.39
58	600216	浙江医药	36,810	470,063.70	0.39
59	000415	渤海金控	80,300	468,952.00	0.39
60	601818	光大银行	127,303	465,928.98	0.38
61	600978	宜华生活	67,600	461,708.00	0.38
62	600611	大众交通	115,875	461,182.50	0.38

63	000528	柳 工	42,679	457,092.09	0.38
64	002233	塔牌集团	38,600	441,584.00	0.36
65	000581	威孚高科	19,810	437,999.10	0.36
66	000669	金鸿控股	59,640	432,390.00	0.36
67	002572	索菲亚	13,410	431,533.80	0.35
68	600516	方大炭素	17,700	431,526.00	0.35
69	600757	长江传媒	75,736	430,937.84	0.35
70	600398	海澜之家	33,720	429,592.80	0.35
71	600036	招商银行	16,130	426,477.20	0.35
72	002450	康得新	24,897	425,240.76	0.35
73	603444	吉比特	3,300	421,707.00	0.35
74	600795	国电电力	159,400	417,628.00	0.34
75	600655	豫园股份	44,010	415,894.50	0.34
76	600729	重庆百货	12,543	413,291.85	0.34
77	002051	中工国际	27,000	412,290.00	0.34
78	600500	中化国际	60,320	411,382.40	0.34
79	601186	中国铁建	47,198	406,846.76	0.33
80	600694	大商股份	12,200	396,622.00	0.33
81	600064	南京高科	53,788	394,803.92	0.32
82	601607	上海医药	16,500	394,350.00	0.32
83	600028	中国石化	59,700	387,453.00	0.32
84	600705	中航资本	82,430	384,948.10	0.32
85	000568	泸州老窖	6,300	383,418.00	0.31
86	600867	通化东宝	15,810	378,965.70	0.31
87	601333	广深铁路	89,110	378,717.50	0.31
88	601288	农业银行	109,000	374,960.00	0.31
89	601021	春秋航空	10,700	374,821.00	0.31
90	002317	众生药业	34,300	362,551.00	0.30
91	601311	骆驼股份	30,700	352,129.00	0.29
92	600648	外高桥	19,161	350,263.08	0.29
93	601016	节能风电	121,500	348,705.00	0.29
94	000031	中粮地产	59,610	344,545.80	0.28
95	600422	昆药集团	43,900	340,225.00	0.28
96	000887	中鼎股份	22,910	330,133.10	0.27
97	600167	联美控股	32,600	326,000.00	0.27
98	600073	上海梅林	48,930	324,895.20	0.27
99	002463	沪电股份	86,600	323,884.00	0.27
100	601928	凤凰传媒	52,910	321,692.80	0.26
101	600373	中文传媒	24,849	319,309.65	0.26

102	000848	承德露露	28,410	300,861.90	0.25
103	600276	恒瑞医药	3,911	296,297.36	0.24
104	600017	日照港	92,278	296,212.38	0.24
105	601678	滨化股份	47,633	294,371.94	0.24
106	600837	海通证券	31,030	293,854.10	0.24
107	600649	城投控股	47,230	289,047.60	0.24
108	600518	康美药业	12,550	287,144.00	0.24
109	600886	国投电力	39,400	286,438.00	0.24
110	601991	大唐发电	92,500	280,275.00	0.23
111	300266	兴源环境	14,000	279,860.00	0.23
112	600031	三一重工	30,870	276,903.90	0.23
113	600572	康恩贝	38,610	276,833.70	0.23
114	000876	新希望	42,850	271,669.00	0.22
115	000999	华润三九	9,578	266,555.74	0.22
116	601099	太平洋	112,300	262,782.00	0.22
117	601801	皖新传媒	33,400	254,174.00	0.21
118	600256	广汇能源	61,010	249,530.90	0.20
119	601088	中国神华	12,478	248,811.32	0.20
120	002415	海康威视	6,671	247,694.23	0.20
121	600009	上海机场	4,320	239,673.60	0.20
122	601788	光大证券	21,800	239,364.00	0.20
123	002152	广电运通	40,650	239,022.00	0.20
124	600022	山东钢铁	118,200	238,764.00	0.20
125	600639	浦东金桥	18,910	235,996.80	0.19
126	000002	万科 A	9,587	235,840.20	0.19
127	000008	神州高铁	47,180	234,012.80	0.19
128	000423	东阿阿胶	4,320	232,459.20	0.19
129	601001	大同煤业	46,400	230,144.00	0.19
130	000598	兴蓉环境	56,300	228,578.00	0.19
131	002002	鸿达兴业	49,300	227,273.00	0.19
132	600000	浦发银行	23,756	227,107.36	0.19
133	600618	氯碱化工	26,637	226,680.87	0.19
134	000006	深振业 A	38,500	225,610.00	0.19
135	000501	鄂武商 A	18,324	225,201.96	0.18
136	000627	天茂集团	31,351	220,084.02	0.18
137	601117	中国化学	32,690	220,003.70	0.18
138	000997	新大陆	13,900	218,925.00	0.18
139	601618	中国中冶	65,632	218,554.56	0.18
140	601898	中煤能源	45,110	217,881.30	0.18

141	000758	中色股份	47,592	214,164.00	0.18
142	000778	新兴铸管	49,500	211,860.00	0.17
143	601689	拓普集团	10,830	210,535.20	0.17
144	002280	联络互动	36,720	210,038.40	0.17
145	000049	德赛电池	7,340	207,134.80	0.17
146	600926	杭州银行	18,400	204,056.00	0.17
147	600201	生物股份	11,887	203,148.83	0.17
148	601811	新华文轩	20,486	199,123.92	0.16
149	300297	蓝盾股份	24,520	198,857.20	0.16
150	601336	新华保险	4,600	197,248.00	0.16
151	000963	华东医药	4,065	196,136.25	0.16
152	000961	中南建设	30,740	193,969.40	0.16
153	600126	杭钢股份	31,210	186,323.70	0.15
154	300026	红日药业	50,498	184,317.70	0.15
155	000926	福星股份	25,610	184,135.90	0.15
156	300251	光线传媒	17,810	181,305.80	0.15
157	600750	江中药业	10,166	180,446.50	0.15
158	600056	中国医药	9,800	179,046.00	0.15
159	002426	胜利精密	49,700	178,920.00	0.15
160	600352	浙江龙盛	14,941	178,544.95	0.15
161	600340	华夏幸福	6,910	177,932.50	0.15
162	600755	厦门国贸	23,975	174,777.75	0.14
163	000488	晨鸣纸业	13,400	173,128.00	0.14
164	600664	哈药股份	43,400	172,298.00	0.14
165	600597	光明乳业	17,400	171,738.00	0.14
166	000898	鞍钢股份	30,390	169,272.30	0.14
167	600704	物产中大	32,100	167,883.00	0.14
168	600062	华润双鹤	6,700	164,485.00	0.14
169	000547	航天发展	20,900	163,229.00	0.13
170	002221	东华能源	16,500	161,205.00	0.13
171	600143	金发科技	30,816	160,859.52	0.13
172	000541	佛山照明	26,735	160,142.65	0.13
173	000661	长春高新	700	159,390.00	0.13
174	002602	世纪华通	4,900	159,250.00	0.13
175	603198	迎驾贡酒	8,569	157,412.53	0.13
176	002146	荣盛发展	18,010	157,227.30	0.13
177	002373	千方科技	12,000	156,600.00	0.13
178	000552	靖远煤电	46,140	150,877.80	0.12
179	600535	天士力	5,800	149,756.00	0.12

180	002128	露天煤业	16,400	148,584.00	0.12
181	000725	京东方 A	41,800	147,972.00	0.12
182	600260	凯乐科技	5,500	147,620.00	0.12
183	600737	中粮糖业	19,478	146,864.12	0.12
184	600006	东风汽车	35,884	146,765.56	0.12
185	601988	中国银行	39,800	143,678.00	0.12
186	600160	巨化股份	19,280	141,129.60	0.12
187	000001	平安银行	15,450	140,440.50	0.12
188	603025	大豪科技	7,200	139,248.00	0.11
189	300182	捷成股份	18,300	138,714.00	0.11
190	002056	横店东磁	19,500	136,695.00	0.11
191	002174	游族网络	6,800	135,320.00	0.11
192	600023	浙能电力	29,000	135,140.00	0.11
193	002440	闰土股份	11,555	135,077.95	0.11
194	600606	绿地控股	20,540	134,331.60	0.11
195	000830	鲁西化工	7,800	133,224.00	0.11
196	002416	爱施德	22,677	133,113.99	0.11
197	002078	太阳纸业	13,720	132,946.80	0.11
198	002064	华峰氨纶	31,620	130,590.60	0.11
199	600079	人福医药	9,860	130,349.20	0.11
200	600426	华鲁恒升	7,410	130,341.90	0.11
201	002344	海宁皮城	26,700	129,762.00	0.11
202	000825	太钢不锈	21,600	129,600.00	0.11
203	002354	天神娱乐	13,840	128,158.40	0.11
204	002004	华邦健康	25,100	127,508.00	0.10
205	600580	卧龙电气	16,684	127,132.08	0.10
206	603019	中科曙光	2,700	123,849.00	0.10
207	002110	三钢闽光	7,700	123,431.00	0.10
208	600939	重庆建工	24,740	122,215.60	0.10
209	002277	友阿股份	26,500	122,165.00	0.10
210	600808	马钢股份	33,600	120,624.00	0.10
211	600690	青岛海尔	6,200	119,412.00	0.10
212	002410	广联达	4,300	119,239.00	0.10
213	603328	依顿电子	10,910	118,373.50	0.10
214	600582	天地科技	32,200	118,174.00	0.10
215	600061	国投资本	12,659	117,475.52	0.10
216	002589	瑞康医药	8,610	117,440.40	0.10
217	601179	中国西电	34,200	116,964.00	0.10
218	002332	仙琚制药	13,350	116,812.50	0.10

219	000413	东旭光电	19,200	116,352.00	0.10
220	601128	常熟银行	20,200	115,544.00	0.09
221	600751	海航科技	17,800	115,522.00	0.09
222	000783	长江证券	21,100	114,573.00	0.09
223	601000	唐山港	48,420	113,787.00	0.09
224	600688	上海石化	19,940	113,458.60	0.09
225	002640	跨境通	7,428	111,568.56	0.09
226	000980	众泰汽车	15,500	110,205.00	0.09
227	002508	老板电器	3,599	110,201.38	0.09
228	600881	亚泰集团	29,273	109,188.29	0.09
229	002191	劲嘉股份	14,600	109,062.00	0.09
230	000553	沙隆达 A	6,800	107,508.00	0.09
231	600048	保利地产	8,810	107,482.00	0.09
232	000977	浪潮信息	4,500	107,325.00	0.09
233	300088	长信科技	18,500	107,300.00	0.09
234	000975	银泰资源	10,520	106,672.80	0.09
235	600282	南钢股份	24,020	106,168.40	0.09
236	300287	飞利信	14,700	105,693.00	0.09
237	600019	宝钢股份	13,400	104,386.00	0.09
238	002180	纳斯达	3,800	104,348.00	0.09
239	600030	中信证券	6,220	103,065.40	0.08
240	601200	上海环境	6,500	102,895.00	0.08
241	600748	上实发展	20,150	101,556.00	0.08
242	001979	招商蛇口	5,320	101,346.00	0.08
243	601377	兴业证券	19,200	101,184.00	0.08
244	002815	崇达技术	6,200	99,820.00	0.08
245	000028	国药一致	2,000	99,800.00	0.08
246	603858	步长制药	2,300	98,417.00	0.08
247	601985	中国核电	17,400	98,310.00	0.08
248	600011	华能国际	15,410	98,007.60	0.08
249	000723	美锦能源	17,900	97,197.00	0.08
250	600458	时代新材	13,130	96,636.80	0.08
251	601231	环旭电子	10,600	96,142.00	0.08
252	300324	旋极信息	9,981	94,719.69	0.08
253	600511	国药股份	3,500	94,325.00	0.08
254	002407	多氟多	6,600	92,532.00	0.08
255	002252	上海莱士	4,711	91,958.72	0.08
256	600743	华远地产	35,600	91,492.00	0.08
257	600522	中天科技	10,364	91,306.84	0.07



258	600908	无锡银行	15,400	90,706.00	0.07
259	601800	中国交建	7,937	90,402.43	0.07
260	600050	中国联通	18,300	90,036.00	0.07
261	600499	科达洁能	13,100	89,866.00	0.07
262	600177	雅戈尔	11,660	89,782.00	0.07
263	601360	三六零	3,100	89,590.00	0.07
264	600380	健康元	7,540	89,424.40	0.07
265	000040	东旭蓝天	8,800	88,880.00	0.07
266	601238	广汽集团	7,900	88,006.00	0.07
267	600332	白云山	2,301	87,553.05	0.07
268	002491	通鼎互联	7,900	87,453.00	0.07
269	603986	兆易创新	800	86,816.00	0.07
270	000538	云南白药	800	85,568.00	0.07
271	600184	光电股份	6,800	84,252.00	0.07
272	600823	世茂股份	20,100	84,018.00	0.07
273	000012	南玻 A	16,860	83,457.00	0.07
274	002505	大康农业	38,700	82,818.00	0.07
275	600959	江苏有线	16,200	82,620.00	0.07
276	300315	掌趣科技	19,700	82,346.00	0.07
277	600195	中牧股份	4,217	82,020.65	0.07
278	600325	华发股份	10,583	81,806.59	0.07
279	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.07
280	600051	宁波联合	13,000	81,120.00	0.07
281	300253	卫宁健康	6,500	80,535.00	0.07
282	300002	神州泰岳	19,300	80,481.00	0.07
283	600643	爱建集团	8,500	79,900.00	0.07
284	600708	光明地产	18,340	78,862.00	0.06
285	000662	天夏智慧	12,141	78,066.63	0.06
286	002244	滨江集团	14,930	77,636.00	0.06
287	600390	五矿资本	9,800	75,950.00	0.06
288	002176	江特电机	7,800	75,816.00	0.06
289	600545	卓郎智能	9,490	75,350.60	0.06
290	000078	海王生物	15,620	75,132.20	0.06
291	000537	广宇发展	7,700	74,228.00	0.06
292	002203	海亮股份	9,100	73,710.00	0.06
293	300122	智飞生物	1,610	73,641.40	0.06
294	002709	天赐材料	1,900	73,226.00	0.06
295	000016	深康佳 A	13,910	73,027.50	0.06
296	600839	四川长虹	25,500	72,930.00	0.06

297	002626	金达威	4,200	72,870.00	0.06
298	600180	瑞茂通	7,500	72,675.00	0.06
299	600897	厦门空港	3,500	72,170.00	0.06
300	000034	神州数码	4,510	72,069.80	0.06
301	300308	中际旭创	1,200	72,048.00	0.06
302	002268	卫士通	3,300	72,039.00	0.06
303	600657	信达地产	16,940	71,995.00	0.06
304	000066	中国长城	10,100	71,811.00	0.06
305	000685	中山公用	9,000	71,730.00	0.06
306	000046	泛海控股	12,600	71,694.00	0.06
307	002375	亚厦股份	13,400	71,556.00	0.06
308	002275	桂林三金	4,900	71,540.00	0.06
309	601579	会稽山	7,300	71,467.00	0.06
310	600811	东方集团	16,600	71,380.00	0.06
311	000885	同力水泥	7,000	71,120.00	0.06
312	002022	科华生物	6,000	71,100.00	0.06
313	300159	新研股份	10,000	70,800.00	0.06
314	000060	中金岭南	14,500	70,470.00	0.06
315	002400	省广集团	21,560	69,638.80	0.06
316	000059	华锦股份	10,100	69,589.00	0.06
317	002385	大北农	16,847	69,578.11	0.06
318	000009	中国宝安	14,175	69,457.50	0.06
319	000921	海信科龙	6,700	69,412.00	0.06
320	000813	德展健康	8,400	69,216.00	0.06
321	600809	山西汾酒	1,100	69,179.00	0.06
322	002247	帝龙文化	8,415	69,003.00	0.06
323	000703	恒逸石化	4,620	68,745.60	0.06
324	600859	王府井	3,227	68,638.29	0.06
325	600816	安信信托	9,480	68,635.20	0.06
326	601225	陕西煤业	8,340	68,554.80	0.06
327	000892	欢瑞世纪	14,500	68,295.00	0.06
328	600873	梅花生物	16,300	68,134.00	0.06
329	000860	顺鑫农业	1,785	66,937.50	0.05
330	000070	特发信息	9,200	66,700.00	0.05
331	002359	北讯集团	3,400	66,572.00	0.05
332	601003	柳钢股份	8,400	66,528.00	0.05
333	002608	江苏国信	9,621	66,384.90	0.05
334	002195	二三四五	15,459	66,164.52	0.05
335	600230	沧州大化	2,980	66,036.80	0.05

336	600781	辅仁药业	4,200	65,940.00	0.05
337	002019	亿帆医药	3,700	65,305.00	0.05
338	002583	海能达	7,800	65,130.00	0.05
339	600863	内蒙华电	28,600	64,922.00	0.05
340	600317	营口港	28,620	64,681.20	0.05
341	600966	博汇纸业	15,000	64,650.00	0.05
342	600718	东软集团	4,950	64,647.00	0.05
343	600885	宏发股份	2,160	64,627.20	0.05
344	002439	启明星辰	3,000	63,660.00	0.05
345	300055	万邦达	5,500	63,195.00	0.05
346	601669	中国电建	11,600	62,176.00	0.05
347	000596	古井贡酒	700	62,146.00	0.05
348	002061	浙江交科	5,900	61,773.00	0.05
349	600872	中炬高新	2,200	61,600.00	0.05
350	002183	怡亚通	9,210	61,246.50	0.05
351	600970	中材国际	9,100	60,788.00	0.05
352	300603	立昂技术	1,700	60,741.00	0.05
353	601127	小康股份	3,510	60,687.90	0.05
354	002707	众信旅游	6,300	60,480.00	0.05
355	002080	中材科技	7,080	60,180.00	0.05
356	002261	拓维信息	13,000	59,800.00	0.05
357	300657	弘信电子	2,000	59,200.00	0.05
358	002701	奥瑞金	10,826	59,109.96	0.05
359	300166	东方国信	4,000	58,920.00	0.05
360	600372	中航电子	4,500	58,770.00	0.05
361	600277	亿利洁能	11,210	58,740.40	0.05
362	600936	广西广电	12,300	58,548.00	0.05
363	000766	通化金马	4,900	58,212.00	0.05
364	300676	华大基因	600	58,086.00	0.05
365	300406	九强生物	4,000	57,600.00	0.05
366	603225	新凤鸣	2,877	57,453.69	0.05
367	002736	国信证券	6,300	57,330.00	0.05
368	600108	亚盛集团	19,600	56,644.00	0.05
369	600713	南京医药	11,474	56,107.86	0.05
370	002528	英飞拓	13,400	55,878.00	0.05
371	600395	盘江股份	9,100	55,237.00	0.05
372	300272	开能健康	5,100	55,233.00	0.05
373	000062	深圳华强	2,800	54,880.00	0.05
374	002219	恒康医疗	5,200	54,808.00	0.05

375	002287	奇正藏药	1,900	54,701.00	0.04
376	002493	荣盛石化	5,300	54,696.00	0.04
377	600060	海信电器	4,040	54,095.60	0.04
378	300194	福安药业	11,500	54,050.00	0.04
379	002567	唐人神	11,900	53,907.00	0.04
380	600410	华胜天成	6,100	53,375.00	0.04
381	600850	华东电脑	2,800	53,172.00	0.04
382	000918	嘉凯城	11,600	52,780.00	0.04
383	600993	马应龙	3,100	52,731.00	0.04
384	600018	上港集团	8,800	52,448.00	0.04
385	300113	顺网科技	3,010	52,404.10	0.04
386	300384	三联虹普	1,300	52,351.00	0.04
387	600602	云赛智联	9,000	52,200.00	0.04
388	000631	顺发恒业	15,200	52,136.00	0.04
389	601958	金钼股份	8,300	52,041.00	0.04
390	600169	太原重工	22,200	51,948.00	0.04
391	002841	视源股份	972	51,914.52	0.04
392	603160	汇顶科技	800	51,912.00	0.04
393	600895	张江高科	4,500	51,750.00	0.04
394	603660	苏州科达	2,280	51,642.00	0.04
395	000606	顺利办	7,800	51,480.00	0.04
396	600459	贵研铂业	4,760	51,408.00	0.04
397	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.04
398	002699	美盛文化	2,700	50,652.00	0.04
399	300498	温氏股份	2,300	50,646.00	0.04
400	603806	福斯特	2,300	50,623.00	0.04
401	300546	雄帝科技	2,350	50,619.00	0.04
402	002314	南山控股	12,500	50,375.00	0.04
403	600614	鹏起科技	8,800	50,248.00	0.04
404	600521	华海药业	1,880	50,177.20	0.04
405	600828	茂业商业	9,703	49,485.30	0.04
406	600300	维维股份	15,100	49,226.00	0.04
407	600528	中铁工业	4,800	49,056.00	0.04
408	601666	平煤股份	11,700	48,906.00	0.04
409	603766	隆鑫通用	8,970	48,707.10	0.04
410	600161	天坛生物	2,517	48,703.95	0.04
411	600565	迪马股份	16,500	48,675.00	0.04
412	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.04
413	601111	中国国航	5,400	48,006.00	0.04

414	002503	搜于特	13,700	47,950.00	0.04
415	600261	阳光照明	12,700	47,752.00	0.04
416	300219	鸿利智汇	4,920	47,625.60	0.04
417	002308	威创股份	5,730	47,559.00	0.04
418	002568	百润股份	3,500	47,285.00	0.04
419	002600	领益智造	9,100	47,229.00	0.04
420	603603	博天环境	2,300	47,127.00	0.04
421	601515	东风股份	6,100	47,092.00	0.04
422	603567	珍宝岛	3,500	46,900.00	0.04
423	600420	现代制药	4,500	46,800.00	0.04
424	600875	东方电气	6,300	46,683.00	0.04
425	300010	立思辰	3,800	46,512.00	0.04
426	000883	湖北能源	11,300	46,443.00	0.04
427	601677	明泰铝业	4,600	46,184.00	0.04
428	000908	景峰医药	9,800	46,158.00	0.04
429	002092	中泰化学	4,786	46,137.04	0.04
430	600488	天药股份	11,200	46,032.00	0.04
431	000513	丽珠集团	1,040	45,708.00	0.04
432	600723	首商股份	6,500	45,435.00	0.04
433	300118	东方日升	4,200	45,360.00	0.04
434	002501	利源精制	7,300	45,260.00	0.04
435	002249	大洋电机	10,500	45,255.00	0.04
436	600105	永鼎股份	12,380	45,063.20	0.04
437	600312	平高电气	7,921	44,674.44	0.04
438	600782	新钢股份	8,000	44,640.00	0.04
439	002482	广田集团	7,300	43,581.00	0.04
440	002102	冠福股份	11,700	43,524.00	0.04
441	603568	伟明环保	1,720	43,516.00	0.04
442	002230	科大讯飞	1,350	43,294.50	0.04
443	300070	碧水源	3,100	43,183.00	0.04
444	603589	口子窖	700	43,015.00	0.04
445	601998	中信银行	6,880	42,724.80	0.04
446	600734	实达集团	6,200	42,470.00	0.03
447	601155	新城控股	1,368	42,366.96	0.03
448	300174	元力股份	2,000	42,360.00	0.03
449	600703	三安光电	2,200	42,284.00	0.03
450	600829	人民同泰	5,900	42,244.00	0.03
451	600637	东方明珠	2,800	42,168.00	0.03
452	002041	登海种业	6,179	42,140.78	0.03

453	603369	今世缘	1,840	42,007.20	0.03
454	000750	国海证券	11,700	41,769.00	0.03
455	000418	小天鹅 A	600	41,610.00	0.03
456	600132	重庆啤酒	1,500	41,535.00	0.03
457	601567	三星医疗	5,700	41,496.00	0.03
458	600594	益佰制药	4,610	41,305.60	0.03
459	002777	久远银海	1,500	41,205.00	0.03
460	001696	宗申动力	8,400	41,160.00	0.03
461	002099	海翔药业	8,010	41,091.30	0.03
462	000829	天音控股	5,600	41,048.00	0.03
463	002705	新宝股份	4,200	41,034.00	0.03
464	002206	海利得	8,200	40,918.00	0.03
465	601908	京运通	8,929	40,894.82	0.03
466	600658	电子城	7,810	40,846.30	0.03
467	002073	软控股份	7,100	40,825.00	0.03
468	600998	九州通	2,400	40,704.00	0.03
469	601158	重庆水务	7,500	40,650.00	0.03
470	600894	广日股份	6,846	40,596.78	0.03
471	300059	东方财富	3,080	40,594.40	0.03
472	002422	科伦药业	1,250	40,125.00	0.03
473	600869	智慧能源	8,500	40,120.00	0.03
474	002534	杭锅股份	5,900	39,943.00	0.03
475	600717	天津港	5,300	39,909.00	0.03
476	600094	大名城	6,872	39,582.72	0.03
477	000736	中交地产	3,550	39,227.50	0.03
478	601866	中远海发	15,600	38,844.00	0.03
479	002636	金安国纪	4,800	38,736.00	0.03
480	300083	劲胜智能	8,000	38,560.00	0.03
481	600329	中新药业	2,019	38,361.00	0.03
482	002595	豪迈科技	2,200	38,258.00	0.03
483	300448	浩云科技	3,341	38,254.45	0.03
484	002368	太极股份	1,310	38,081.70	0.03
485	002008	大族激光	710	37,764.90	0.03
486	600801	华新水泥	2,500	37,575.00	0.03
487	600598	北大荒	4,100	37,556.00	0.03
488	002057	中钢天源	5,455	37,366.75	0.03
489	002581	未名医药	3,500	37,275.00	0.03
490	000719	中原传媒	5,500	36,795.00	0.03
491	600483	福能股份	5,300	36,411.00	0.03

492	002380	科远股份	2,800	36,400.00	0.03
493	002483	润邦股份	8,600	36,120.00	0.03
494	600299	安迪苏	3,100	36,084.00	0.03
495	002164	宁波东力	6,200	35,836.00	0.03
496	002454	松芝股份	6,100	35,807.00	0.03
497	600068	葛洲坝	4,950	35,689.50	0.03
498	600081	东风科技	3,500	35,350.00	0.03
499	600691	阳煤化工	11,500	35,190.00	0.03
500	600566	济川药业	729	35,130.51	0.03
501	300130	新国都	2,600	35,074.00	0.03
502	601777	力帆股份	6,700	35,041.00	0.03
503	000021	深科技	5,100	34,782.00	0.03
504	600812	华北制药	8,000	34,720.00	0.03
505	002093	国脉科技	4,500	34,695.00	0.03
506	000557	西部创业	10,700	34,454.00	0.03
507	300150	世纪瑞尔	7,100	34,293.00	0.03
508	002236	大华股份	1,520	34,276.00	0.03
509	002038	双鹭药业	900	34,191.00	0.03
510	002512	达华智能	3,500	33,950.00	0.03
511	600777	新潮能源	15,500	33,945.00	0.03
512	600308	华泰股份	6,800	33,864.00	0.03
513	000402	金融街	4,200	33,810.00	0.03
514	600536	中国软件	1,561	33,764.43	0.03
515	600613	神奇制药	5,500	33,715.00	0.03
516	300204	舒泰神	3,110	33,650.20	0.03
517	601126	四方股份	6,600	33,594.00	0.03
518	600292	远达环保	5,700	33,459.00	0.03
519	601137	博威合金	4,100	33,128.00	0.03
520	600438	通威股份	4,800	33,120.00	0.03
521	601966	玲珑轮胎	2,100	33,117.00	0.03
522	601020	华钰矿业	2,400	33,096.00	0.03
523	603355	莱克电气	1,100	33,055.00	0.03
524	603658	安图生物	400	32,984.00	0.03
525	000521	长虹美菱	8,561	32,874.24	0.03
526	600293	三峡新材	5,767	32,756.56	0.03
527	002688	金河生物	6,200	32,488.00	0.03
528	002091	江苏国泰	5,100	32,385.00	0.03
529	000902	新洋丰	3,500	32,200.00	0.03
530	600348	阳泉煤业	4,500	32,175.00	0.03

531	600835	上海机电	1,700	32,062.00	0.03
532	601628	中国人寿	1,421	32,000.92	0.03
533	600236	桂冠电力	5,600	31,976.00	0.03
534	002251	步步高	2,800	31,864.00	0.03
535	600570	恒生电子	600	31,770.00	0.03
536	002916	深南电路	500	31,755.00	0.03
537	600775	南京熊猫	5,600	31,696.00	0.03
538	300415	伊之密	3,400	31,688.00	0.03
539	002818	富森美	1,200	31,656.00	0.03
540	600279	重庆港九	7,100	31,524.00	0.03
541	002880	卫光生物	700	31,472.00	0.03
542	600482	中国动力	1,800	31,410.00	0.03
543	002001	新和成	1,654	31,359.84	0.03
544	600851	海欣股份	3,800	31,236.00	0.03
545	600676	交运股份	6,200	30,814.00	0.03
546	300410	正业科技	1,300	30,563.00	0.03
547	000039	中集集团	2,300	30,544.00	0.03
548	600173	卧龙地产	7,100	30,530.00	0.03
549	601222	林洋能源	6,100	30,378.00	0.02
550	600350	山东高速	7,500	30,375.00	0.02
551	000539	粤电力 A	7,100	30,104.00	0.02
552	002372	伟星新材	1,700	30,073.00	0.02
553	600183	生益科技	3,280	30,044.80	0.02
554	603566	普莱柯	1,900	30,039.00	0.02
555	002475	立讯精密	1,300	29,302.00	0.02
556	600125	铁龙物流	3,500	29,295.00	0.02
557	603799	华友钴业	300	29,241.00	0.02
558	600687	刚泰控股	3,200	29,088.00	0.02
559	601877	正泰电器	1,300	29,016.00	0.02
560	300108	吉药控股	3,700	29,008.00	0.02
561	600338	西藏珠峰	1,400	29,008.00	0.02
562	000525	红太阳	1,700	28,815.00	0.02
563	600612	老凤祥	800	28,752.00	0.02
564	000519	中兵红箭	3,700	28,749.00	0.02
565	000878	云南铜业	3,000	28,620.00	0.02
566	002657	中科金财	1,800	28,512.00	0.02
567	300511	雪榕生物	3,200	28,416.00	0.02
568	002011	盾安环境	4,400	28,160.00	0.02
569	002807	江阴银行	5,000	28,100.00	0.02



570	002217	合力泰	3,400	28,050.00	0.02
571	002147	新光圆成	1,900	28,044.00	0.02
572	600188	兖州煤业	2,140	27,905.60	0.02
573	600697	欧亚集团	1,300	27,677.00	0.02
574	600678	四川金顶	2,700	27,648.00	0.02
575	002241	歌尔股份	2,700	27,513.00	0.02
576	002090	金智科技	1,900	27,474.00	0.02
577	603609	禾丰牧业	2,900	27,376.00	0.02
578	300082	奥克股份	5,608	27,367.04	0.02
579	002223	鱼跃医疗	1,400	27,286.00	0.02
580	002437	誉衡药业	4,400	27,280.00	0.02
581	002119	康强电子	2,414	27,278.20	0.02
582	600120	浙江东方	2,010	27,235.50	0.02
583	300158	振东制药	5,310	27,187.20	0.02
584	000150	宜华健康	1,000	27,100.00	0.02
585	002238	天威视讯	4,000	26,920.00	0.02
586	300559	佳发教育	900	26,757.00	0.02
587	000411	英特集团	2,000	26,700.00	0.02
588	002531	天顺风能	6,100	26,535.00	0.02
589	603869	新智认知	1,600	26,384.00	0.02
590	002851	麦格米特	900	26,352.00	0.02
591	000919	金陵药业	3,500	26,215.00	0.02
592	002686	亿利达	3,700	26,085.00	0.02
593	600335	国机汽车	2,500	26,075.00	0.02
594	600179	安通控股	2,560	25,932.80	0.02
595	002456	欧菲科技	1,600	25,808.00	0.02
596	002635	安洁科技	1,500	25,800.00	0.02
597	000861	海印股份	10,200	25,602.00	0.02
598	002295	精艺股份	3,800	25,536.00	0.02
599	603612	索通发展	890	25,454.00	0.02
600	600525	长园集团	2,400	25,368.00	0.02
601	002653	海思科	2,110	25,320.00	0.02
602	601058	赛轮金宇	10,400	25,272.00	0.02
603	600295	鄂尔多斯	2,800	25,172.00	0.02
604	603883	老百姓	300	24,948.00	0.02
605	600057	厦门象屿	4,996	24,930.04	0.02
606	600196	复星医药	600	24,834.00	0.02
607	600759	洲际油气	6,300	24,822.00	0.02
608	600563	法拉电子	500	24,745.00	0.02

609	000617	中油资本	2,200	24,728.00	0.02
610	000524	岭南控股	2,700	24,678.00	0.02
611	600682	南京新百	1,500	24,660.00	0.02
612	600761	安徽合力	2,700	24,516.00	0.02
613	600297	广汇汽车	4,180	24,494.80	0.02
614	600176	中国巨石	2,380	24,347.40	0.02
615	600444	国机通用	2,100	24,213.00	0.02
616	300358	楚天科技	2,400	23,784.00	0.02
617	600315	上海家化	600	23,778.00	0.02
618	300381	溢多利	2,700	23,517.00	0.02
619	600240	华业资本	3,200	23,456.00	0.02
620	000601	韶能股份	5,300	23,267.00	0.02
621	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.02
622	600066	宇通客车	1,200	23,028.00	0.02
623	601010	文峰股份	7,600	23,028.00	0.02
624	603688	石英股份	1,700	22,848.00	0.02
625	600075	新疆天业	3,500	22,750.00	0.02
626	600271	航天信息	900	22,743.00	0.02
627	600221	海航控股	7,000	22,610.00	0.02
628	300396	迪瑞医疗	1,220	22,448.00	0.02
629	600436	片仔癀	200	22,386.00	0.02
630	002345	潮宏基	2,600	22,360.00	0.02
631	002399	海普瑞	1,000	22,140.00	0.02
632	600663	陆家嘴	1,400	22,106.00	0.02
633	002479	富春环保	3,910	22,091.50	0.02
634	600804	鹏博士	1,840	22,080.00	0.02
635	603816	顾家家居	300	22,053.00	0.02
636	600665	天地源	6,200	22,010.00	0.02
637	300003	乐普医疗	600	22,008.00	0.02
638	600827	百联股份	2,149	21,919.80	0.02
639	002323	*ST 百特	4,300	21,844.00	0.02
640	300294	博雅生物	700	21,693.00	0.02
641	600615	丰华股份	2,500	21,675.00	0.02
642	000671	阳光城	3,600	21,492.00	0.02
643	300389	艾比森	1,300	21,489.00	0.02
644	300196	长海股份	2,100	21,399.00	0.02
645	603669	灵康药业	1,800	21,276.00	0.02
646	002642	荣之联	2,300	21,137.00	0.02
647	600623	华谊集团	2,110	21,057.80	0.02

648	600768	宁波富邦	1,900	20,976.00	0.02
649	000030	富奥股份	2,800	20,776.00	0.02
650	300418	昆仑万维	1,100	20,768.00	0.02
651	600588	用友网络	840	20,588.40	0.02
652	002142	宁波银行	1,262	20,557.98	0.02
653	002361	神剑股份	5,000	20,550.00	0.02
654	600967	内蒙一机	1,600	20,384.00	0.02
655	002679	福建金森	900	20,169.00	0.02
656	600893	航发动力	900	20,088.00	0.02
657	600114	东睦股份	2,041	19,940.57	0.02
658	000869	张裕 A	500	19,930.00	0.02
659	300248	新开普	3,256	19,926.72	0.02
660	600385	山东金泰	1,900	19,836.00	0.02
661	600990	四创电子	400	19,728.00	0.02
662	000563	陕国投 A	5,800	19,720.00	0.02
663	600973	宝胜股份	5,400	19,710.00	0.02
664	600575	皖江物流	5,300	19,663.00	0.02
665	300273	和佳股份	2,900	19,662.00	0.02
666	600677	航天通信	2,400	19,368.00	0.02
667	600765	中航重机	2,600	19,344.00	0.02
668	600683	京投发展	4,200	19,278.00	0.02
669	002588	史丹利	3,700	19,166.00	0.02
670	600118	中国卫星	1,000	19,100.00	0.02
671	000503	国新健康	600	19,068.00	0.02
672	601727	上海电气	3,000	19,020.00	0.02
673	601368	绿城水务	2,800	18,900.00	0.02
674	300513	恒泰实达	700	18,893.00	0.02
675	000949	新乡化纤	6,400	18,880.00	0.02
676	600796	钱江生化	3,100	18,848.00	0.02
677	300523	辰安科技	300	18,684.00	0.02
678	600773	西藏城投	2,700	18,684.00	0.02
679	300129	泰胜风能	5,100	18,411.00	0.02
680	600640	号百控股	1,800	18,306.00	0.02
681	600641	万业企业	1,500	18,270.00	0.02
682	300058	蓝色光标	3,200	18,240.00	0.01
683	600366	宁波韵升	2,968	18,104.80	0.01
684	002349	精华制药	3,100	18,104.00	0.01
685	600961	株冶集团	2,700	18,036.00	0.01
686	603663	三祥新材	1,000	17,920.00	0.01

687	600971	恒源煤电	2,500	17,850.00	0.01
688	002033	丽江旅游	2,435	17,702.45	0.01
689	300395	菲利华	1,300	17,680.00	0.01
690	600551	时代出版	2,000	17,680.00	0.01
691	600864	哈投股份	3,900	17,550.00	0.01
692	002462	嘉事堂	900	17,460.00	0.01
693	600267	海正药业	1,200	17,448.00	0.01
694	600039	四川路桥	5,317	17,439.76	0.01
695	000166	申万宏源	3,973	17,362.01	0.01
696	002232	启明信息	2,200	17,182.00	0.01
697	002118	紫鑫药业	2,400	17,160.00	0.01
698	000903	云内动力	6,700	17,152.00	0.01
699	000672	上峰水泥	1,900	17,119.00	0.01
700	002517	恺英网络	2,350	16,896.50	0.01
701	300015	爱尔眼科	520	16,790.80	0.01
702	000811	冰轮环境	3,500	16,625.00	0.01
703	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01
704	000937	冀中能源	4,000	16,440.00	0.01
705	002405	四维图新	810	16,402.50	0.01
706	600157	永泰能源	9,200	16,376.00	0.01
707	300189	神农基因	4,410	16,361.10	0.01
708	002044	美年健康	720	16,272.00	0.01
709	002597	金禾实业	800	16,224.00	0.01
710	002340	格林美	2,677	16,195.85	0.01
711	002678	珠江钢琴	1,900	16,188.00	0.01
712	300061	康旗股份	1,500	16,050.00	0.01
713	600100	同方股份	1,800	15,804.00	0.01
714	600617	国新能源	2,900	15,747.00	0.01
715	300237	美晨生态	2,180	15,652.40	0.01
716	300202	聚龙股份	1,500	15,645.00	0.01
717	002065	东华软件	1,810	15,566.00	0.01
718	000543	皖能电力	3,510	15,479.10	0.01
719	002030	达安基因	1,000	15,420.00	0.01
720	600645	中源协和	800	15,408.00	0.01
721	002150	通润装备	2,300	15,088.00	0.01
722	002724	海洋王	2,689	15,031.51	0.01
723	002187	广百股份	1,800	14,832.00	0.01
724	000591	太阳能	4,030	14,749.80	0.01
725	300449	汉邦高科	800	14,632.00	0.01

726	600642	申能股份	2,900	14,558.00	0.01
727	300119	瑞普生物	1,700	14,535.00	0.01
728	600037	歌华有线	1,400	14,448.00	0.01
729	600586	金晶科技	4,400	14,388.00	0.01
730	300274	阳光电源	1,600	14,352.00	0.01
731	300199	翰宇药业	1,000	14,280.00	0.01
732	300218	安利股份	2,100	14,259.00	0.01
733	002496	ST 辉丰	5,200	14,196.00	0.01
734	300608	思特奇	700	14,175.00	0.01
735	002242	九阳股份	800	14,152.00	0.01
736	603556	海兴电力	777	14,118.09	0.01
737	000421	南京公用	2,900	14,094.00	0.01
738	002533	金杯电工	2,900	14,065.00	0.01
739	300267	尔康制药	3,100	14,012.00	0.01
740	300017	网宿科技	1,300	13,923.00	0.01
741	300045	华力创通	1,500	13,905.00	0.01
742	601999	出版传媒	2,500	13,875.00	0.01
743	000959	首钢股份	3,370	13,850.70	0.01
744	300604	长川科技	380	13,820.60	0.01
745	601233	桐昆股份	800	13,776.00	0.01
746	000400	许继电气	1,758	13,729.98	0.01
747	300366	创意信息	1,500	13,470.00	0.01
748	600843	上工申贝	1,600	13,424.00	0.01
749	002772	众兴菌业	1,600	13,392.00	0.01
750	603606	东方电缆	1,800	13,392.00	0.01
751	002425	凯撒文化	2,810	13,347.50	0.01
752	002641	永高股份	3,800	13,110.00	0.01
753	300034	钢研高纳	1,400	13,104.00	0.01
754	000785	武汉中商	1,700	13,090.00	0.01
755	300527	中国应急	1,300	13,078.00	0.01
756	600466	蓝光发展	2,080	12,896.00	0.01
757	000739	普洛药业	1,800	12,888.00	0.01
758	002171	楚江新材	1,900	12,882.00	0.01
759	300184	力源信息	1,200	12,864.00	0.01
760	002127	南极电商	1,350	12,676.50	0.01
761	601098	中南传媒	1,000	12,640.00	0.01
762	002424	贵州百灵	1,110	12,609.60	0.01
763	002421	达实智能	3,100	12,555.00	0.01
764	002390	信邦制药	1,700	12,444.00	0.01

765	300440	运达科技	1,900	12,407.00	0.01
766	002048	宁波华翔	1,000	12,330.00	0.01
767	002336	人人乐	1,100	12,254.00	0.01
768	002791	坚朗五金	1,000	12,190.00	0.01
769	600131	岷江水电	2,100	12,159.00	0.01
770	002558	巨人网络	500	11,890.00	0.01
771	300376	易事特	2,210	11,867.70	0.01
772	002027	分众传媒	1,240	11,866.80	0.01
773	601599	鹿港文化	2,900	11,803.00	0.01
774	600004	白云机场	900	11,781.00	0.01
775	002305	南国置业	3,900	11,778.00	0.01
776	000063	中兴通讯	900	11,727.00	0.01
777	000850	华茂股份	3,100	11,656.00	0.01
778	002613	北玻股份	3,700	11,655.00	0.01
779	000900	现代投资	2,800	11,648.00	0.01
780	600058	五矿发展	1,400	11,634.00	0.01
781	002383	合众思壮	700	11,585.00	0.01
782	600780	通宝能源	3,100	11,563.00	0.01
783	300087	荃银高科	1,100	11,528.00	0.01
784	002599	盛通股份	1,100	11,473.00	0.01
785	300244	迪安诊断	600	11,406.00	0.01
786	300492	山鼎设计	500	11,395.00	0.01
787	000786	北新建材	600	11,118.00	0.01
788	600754	锦江股份	300	11,088.00	0.01
789	002470	金正大	1,610	11,076.80	0.01
790	000761	本钢板材	2,720	10,988.80	0.01
791	000862	银星能源	3,500	10,955.00	0.01
792	002279	久其软件	1,100	10,901.00	0.01
793	300221	银禧科技	1,100	10,890.00	0.01
794	002209	达意隆	1,500	10,860.00	0.01
795	002299	圣农发展	700	10,843.00	0.01
796	300346	南大光电	830	10,814.90	0.01
797	002509	天广中茂	3,700	10,767.00	0.01
798	000880	潍柴重机	1,400	10,766.00	0.01
799	600085	同仁堂	300	10,584.00	0.01
800	300197	铁汉生态	1,950	10,471.50	0.01
801	600053	九鼎投资	600	10,302.00	0.01
802	002007	华兰生物	320	10,291.20	0.01
803	002431	棕榈股份	1,510	10,132.10	0.01

804	603569	长久物流	704	10,053.12	0.01
805	603228	景旺电子	200	9,888.00	0.01
806	000607	华媒控股	2,400	9,864.00	0.01
807	002726	龙大肉食	1,400	9,856.00	0.01
808	601636	旗滨集团	2,200	9,790.00	0.01
809	603123	翠微股份	1,600	9,760.00	0.01
810	600136	当代明诚	800	9,680.00	0.01
811	300043	星辉娱乐	2,400	9,600.00	0.01
812	002166	莱茵生物	1,300	9,516.00	0.01
813	600569	安阳钢铁	2,400	9,456.00	0.01
814	600262	北方股份	500	9,450.00	0.01
815	603728	鸣志电器	600	9,426.00	0.01
816	000970	中科三环	1,000	9,350.00	0.01
817	600155	华创阳安	1,300	9,347.00	0.01
818	002014	永新股份	1,400	9,310.00	0.01
819	002624	完美世界	300	9,303.00	0.01
820	000851	高鸿股份	1,700	9,146.00	0.01
821	002444	巨星科技	800	8,808.00	0.01
822	002153	石基信息	300	8,700.00	0.01
823	600475	华光股份	800	8,552.00	0.01
824	603585	苏利股份	400	8,512.00	0.01
825	000910	大亚圣象	500	8,450.00	0.01
826	002573	清新环境	730	8,431.50	0.01
827	600785	新华百货	413	8,334.34	0.01
828	601899	紫金矿业	2,300	8,303.00	0.01
829	002376	新北洋	500	8,270.00	0.01
830	002196	方正电机	1,100	8,085.00	0.01
831	000779	三毛派神	600	8,082.00	0.01
832	002081	金螳螂	800	8,080.00	0.01
833	300416	苏试试验	400	8,076.00	0.01
834	603208	江山欧派	300	8,067.00	0.01
835	300343	联创互联	800	8,000.00	0.01
836	600250	南纺股份	1,100	7,997.00	0.01
837	002270	华明装备	1,350	7,843.50	0.01
838	600428	中远海特	2,200	7,810.00	0.01
839	601608	中信重工	3,000	7,800.00	0.01
840	300296	利亚德	600	7,728.00	0.01
841	002487	大金重工	2,100	7,686.00	0.01
842	002778	高科石化	400	7,608.00	0.01

843	600389	江山股份	400	7,580.00	0.01
844	002013	中航机电	1,000	7,570.00	0.01
845	600166	福田汽车	3,700	7,511.00	0.01
846	603678	火炬电子	300	7,476.00	0.01
847	002684	猛狮科技	630	7,421.40	0.01
848	600862	中航高科	1,200	7,380.00	0.01
849	002107	沃华医药	800	7,368.00	0.01
850	603676	卫信康	400	7,296.00	0.01
851	002555	三七互娱	600	7,290.00	0.01
852	600273	嘉化能源	800	7,248.00	0.01
853	603380	易德龙	400	7,052.00	0.01
854	600331	宏达股份	2,700	6,993.00	0.01
855	300677	英科医疗	300	6,897.00	0.01
856	600415	小商品城	1,600	6,896.00	0.01
857	603990	麦迪科技	200	6,788.00	0.01
858	002878	元隆雅图	300	6,774.00	0.01
859	603399	吉翔股份	400	6,760.00	0.01
860	000156	华数传媒	700	6,748.00	0.01
861	002839	张家港行	1,100	6,699.00	0.01
862	603877	太平鸟	200	6,666.00	0.01
863	002084	海鸥住工	1,400	6,664.00	0.01
864	000555	神州信息	500	6,640.00	0.01
865	002199	东晶电子	700	6,629.00	0.01
866	603679	华体科技	300	6,615.00	0.01
867	600986	科达股份	700	6,552.00	0.01
868	002672	东江环保	500	6,545.00	0.01
869	000404	长虹华意	1,500	6,495.00	0.01
870	300127	银河磁体	500	6,495.00	0.01
871	000639	西王食品	500	6,415.00	0.01
872	002665	首航节能	1,100	6,380.00	0.01
873	002311	海大集团	300	6,330.00	0.01
874	600879	航天电子	900	6,327.00	0.01
875	000938	紫光股份	100	6,260.00	0.01
876	000756	新华制药	600	6,192.00	0.01
877	002408	齐翔腾达	500	6,140.00	0.01
878	002829	星网宇达	200	6,118.00	0.01
879	000877	天山股份	900	6,075.00	0.00
880	603305	旭升股份	200	5,986.00	0.00
881	600418	江淮汽车	910	5,924.10	0.00



882	601633	长城汽车	600	5,892.00	0.00
883	002411	必康股份	212	5,883.00	0.00
884	000988	华工科技	400	5,780.00	0.00
885	002366	台海核电	400	5,704.00	0.00
886	002429	兆驰股份	2,300	5,704.00	0.00
887	601139	深圳燃气	980	5,439.00	0.00
888	000667	美好置业	2,500	5,325.00	0.00
889	300656	民德电子	200	5,308.00	0.00
890	600578	京能电力	1,700	5,304.00	0.00
891	002250	联化科技	600	5,292.00	0.00
892	300261	雅本化学	1,100	5,269.00	0.00
893	300290	荣科科技	700	5,054.00	0.00
894	002197	证通电子	600	4,920.00	0.00
895	002465	海格通信	610	4,898.30	0.00
896	600589	广东榕泰	1,100	4,862.00	0.00
897	002143	印纪传媒	400	4,836.00	0.00
898	300042	朗科科技	200	4,788.00	0.00
899	300232	洲明科技	480	4,742.40	0.00
900	601933	永辉超市	600	4,584.00	0.00
901	002484	江海股份	700	4,578.00	0.00
902	600562	国睿科技	260	4,459.00	0.00
903	002601	龙鳞佰利	340	4,396.20	0.00
904	000656	金科股份	900	4,320.00	0.00
905	600386	北巴传媒	1,100	4,279.00	0.00
906	601886	江河集团	500	4,115.00	0.00
907	600917	重庆燃气	600	4,086.00	0.00
908	600129	太极集团	300	4,083.00	0.00
909	000035	中国天楹	600	4,032.00	0.00
910	603012	创力集团	600	4,032.00	0.00
911	002671	龙泉股份	900	4,014.00	0.00
912	600138	中青旅	200	3,986.00	0.00
913	600449	宁夏建材	500	3,940.00	0.00
914	300424	航新科技	200	3,884.00	0.00
915	002543	万和电气	200	3,864.00	0.00
916	000565	渝三峡 A	810	3,847.50	0.00
917	000153	丰原药业	600	3,822.00	0.00
918	600409	三友化工	420	3,616.20	0.00
919	000426	兴业矿业	500	3,605.00	0.00
920	000561	烽火电子	600	3,552.00	0.00

921	601028	玉龙股份	700	3,514.00	0.00
922	600567	山鹰纸业	900	3,474.00	0.00
923	002718	友邦吊顶	100	3,460.00	0.00
924	603158	腾龙股份	200	3,412.00	0.00
925	002663	普邦股份	1,100	3,267.00	0.00
926	000906	浙商中拓	600	3,084.00	0.00
927	300183	东软载波	200	3,074.00	0.00
928	300626	华瑞股份	300	3,048.00	0.00
929	002518	科士达	300	2,991.00	0.00
930	002920	德赛西威	100	2,990.00	0.00
931	600996	贵广网络	400	2,968.00	0.00
932	300239	东宝生物	700	2,961.00	0.00
933	300121	阳谷华泰	210	2,946.30	0.00
934	000952	广济药业	200	2,874.00	0.00
935	300131	英唐智控	500	2,835.00	0.00
936	300187	永清环保	300	2,796.00	0.00
937	000600	建投能源	500	2,785.00	0.00
938	000686	东北证券	430	2,756.30	0.00
939	300134	大富科技	300	2,682.00	0.00
940	600291	西水股份	200	2,672.00	0.00
941	000951	中国重汽	200	2,658.00	0.00
942	002477	雏鹰农牧	800	2,648.00	0.00
943	600724	宁波富达	800	2,632.00	0.00
944	000890	法尔胜	500	2,600.00	0.00
945	600803	新奥股份	225	2,596.50	0.00
946	601018	宁波港	600	2,526.00	0.00
947	603309	维力医疗	200	2,412.00	0.00
948	300072	三聚环保	100	2,328.00	0.00
949	000089	深圳机场	300	2,295.00	0.00
950	600252	中恒集团	700	2,268.00	0.00
951	300456	耐威科技	100	2,260.00	0.00
952	002266	浙富控股	600	2,250.00	0.00
953	002648	卫星石化	200	2,206.00	0.00
954	300303	聚飞光电	800	2,192.00	0.00
955	002045	国光电器	300	2,145.00	0.00
956	600508	上海能源	200	2,136.00	0.00
957	603038	华立股份	100	2,109.00	0.00
958	600976	健民集团	100	2,099.00	0.00
959	000690	宝新能源	300	2,088.00	0.00

960	000518	四环生物	500	2,065.00	0.00
961	300438	鹏辉能源	100	1,931.00	0.00
962	000590	启迪古汉	200	1,898.00	0.00
963	600190	锦州港	600	1,878.00	0.00
964	600388	龙净环保	140	1,789.20	0.00
965	002160	常铝股份	400	1,736.00	0.00
966	000899	赣能股份	400	1,636.00	0.00
967	300279	和晶科技	200	1,616.00	0.00
968	601019	山东出版	200	1,602.00	0.00
969	601398	工商银行	300	1,596.00	0.00
970	600021	上海电力	230	1,550.20	0.00
971	300230	永利股份	300	1,545.00	0.00
972	002043	兔宝宝	200	1,532.00	0.00
973	600122	宏图高科	200	1,480.00	0.00
974	600681	百川能源	100	1,296.00	0.00
975	300323	华灿光电	100	1,292.00	0.00
976	002322	理工环科	100	1,267.00	0.00
977	603993	洛阳钼业	200	1,258.00	0.00
978	603298	杭叉集团	100	1,229.00	0.00
979	002167	东方锆业	200	1,228.00	0.00
980	000979	中弘股份	1,200	1,212.00	0.00
981	300001	特锐德	100	1,136.00	0.00
982	002449	国星光电	100	1,064.00	0.00
983	600650	锦江投资	100	1,048.00	0.00
984	600673	东阳光科	100	1,033.00	0.00
985	600965	福成股份	100	1,010.00	0.00
986	002556	辉隆股份	200	1,000.00	0.00
987	300243	瑞丰高材	100	966.00	0.00
988	300155	安居宝	200	952.00	0.00
989	601900	南方传媒	100	944.00	0.00
990	002498	汉缆股份	400	884.00	0.00
991	002435	长江润发	100	881.00	0.00
992	000967	盈峰环境	100	870.00	0.00
993	600633	浙数文化	100	834.00	0.00
994	002489	浙江永强	200	728.00	0.00
995	300171	东富龙	100	676.00	0.00
996	000969	安泰科技	100	625.00	0.00
997	603618	杭电股份	100	616.00	0.00
998	300307	慈星股份	100	613.00	0.00

999	000592	平潭发展	200	568.00	0.00
1000	002519	银河电子	100	444.00	0.00
1001	000971	高升控股	100	433.00	0.00
1002	002124	天邦股份	100	432.00	0.00
1003	600026	中远海能	100	424.00	0.00
1004	600151	航天机电	100	406.00	0.00
1005	600790	轻纺城	100	358.00	0.00
1006	600010	包钢股份	120	186.00	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	600015	华夏银行	3,008,033.16	2.23
2	600674	川投能源	3,000,965.60	2.22
3	601318	中国平安	2,994,645.00	2.22
4	600177	雅戈尔	2,927,633.00	2.17
5	000338	潍柴动力	2,905,101.00	2.15
6	600519	贵州茅台	2,798,518.00	2.07
7	600016	民生银行	2,751,656.00	2.04
8	601006	大秦铁路	2,726,482.00	2.02
9	600066	宇通客车	2,617,403.78	1.94
10	000651	格力电器	2,581,264.00	1.91
11	601668	中国建筑	2,515,531.00	1.87
12	600688	上海石化	2,366,444.00	1.75
13	601009	南京银行	2,322,258.28	1.72
14	600153	建发股份	2,243,652.00	1.66
15	600170	上海建工	2,183,879.00	1.62
16	600887	伊利股份	2,139,370.00	1.59
17	600919	江苏银行	2,113,695.00	1.57
18	601328	交通银行	2,106,345.54	1.56
19	601169	北京银行	2,099,000.00	1.56
20	600208	新湖中宝	2,070,205.00	1.53

## 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	5,721,014.30	4.24
2	000333	美的集团	3,971,530.35	2.94
3	000651	格力电器	3,368,461.40	2.50
4	600036	招商银行	3,075,450.00	2.28
5	601328	交通银行	2,871,655.00	2.13
6	600519	贵州茅台	2,858,902.00	2.12
7	601668	中国建筑	2,838,127.70	2.10
8	000338	潍柴动力	2,788,074.80	2.07
9	601166	兴业银行	2,705,690.00	2.01
10	600177	雅戈尔	2,693,658.20	2.00
11	000002	万科 A	2,663,392.90	1.97
12	600000	浦发银行	2,606,589.22	1.93
13	600066	宇通客车	2,534,859.07	1.88
14	600016	民生银行	2,466,222.30	1.83
15	601288	农业银行	2,367,636.00	1.76
16	600887	伊利股份	2,365,569.49	1.75
17	000725	京东方 A	2,312,377.00	1.71
18	600674	川投能源	2,300,547.00	1.71
19	600015	华夏银行	2,257,629.00	1.67
20	002415	海康威视	2,161,826.86	1.60

## 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	396,257,331.91
卖出股票收入（成交）总额	396,367,923.25

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	7,000,700.00	5.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,007,200.00	2.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,007,900.00	8.22

## 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	019571	17 国债 17	70,000	7,000,700.00	5.75
2	112190	11 亚迪 02	30,000	3,007,200.00	2.47

## 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投资。

## 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投资。

## 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

本报告期末，本基金无股指期货投资。

## 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

本报告期末，本基金无国债期货投资。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末，本基金无国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期末，本基金无国债期货投资。

## 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	27,138.72
2	应收证券清算款	100,033.55
3	应收股利	-
4	应收利息	329,590.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	456,762.37

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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股票。

### 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

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
204	637,588.54	130,000,000.00	99.95%	68,061.71	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	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	7,565.95	0.0058%

### 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年11月10日）基金份额总额	200,107,412.33
本报告期期初基金份额总额	130,075,227.36
本报告期基金总申购份额	1,898.14
减：本报告期基金总赎回份额	9,063.79
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	130,068,061.71

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金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	股票交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票	佣金	占当期佣金

	数量		成交总额的比 例		总量的比例	备注
东兴证券	2	700,057,081.63	88.49%	511,932.39	88.49%	-
中投证券	2	91,085,313.40	11.51%	66,601.69	11.51%	-

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
东兴证券	10,945,510.81	99.52%	372,300,000.00	93.19%	-	-
中投证券	-	-	27,200,000.00	6.81%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中金	52,600.00	0.48%	-	-	-	-

## 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	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

2	中金量化多策略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
3	关于中金基金管理有限公司旗下基金新增中国中投证券有限责任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 1 月 20 日
4	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 2 月 7 日
5	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
6	中金基金管理有限公司更正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
7	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 2 月 10 日
8	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
9	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蚂蚁（杭州）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 16 日
10	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
11	中金基金管理有限公司关于网上直销通联支付农业银行渠道暂停服务的通知	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 27 日
12	关于根据《公开募集开放式证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	《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
13	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
14	中金量化多策略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
15	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

16	中金量化多策略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
17	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
18	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
19	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
20	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书及其摘要（2018 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 6 月 23 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	110,000,000.00	-	-	110,000,000.00	84.57%

#### 产品特有风险

##### (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，将来亦有可能会优选做空个股、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。

##### (7) 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。

## 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、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、本基金申请募集注册的法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照；
- 7、报告期内本基金在指定媒介上发布的各项公告；
- 8、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