

# 中金金序量化蓝筹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及董事保证本报告中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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 2 月 6 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>11</b>
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.....	11
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.....	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.....	13
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>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	72
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.....	72
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.....	72
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.....	73
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.....	73
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	73
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	73
7.12 投资组合报告附注.....	73
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>75</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	75
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.....	75
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>77</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>78</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
10.4 基金投资策略的改变.....	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
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.....	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
10.8 其他重大事件.....	79
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>81</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.....	81

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>83</b>
12.1 备查文件目录.....	83
12.2 存放地点.....	83
12.3 查阅方式.....	83

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金	
基金简称	中金金序量化蓝筹	
基金主代码	005405	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 2 月 6 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	118,626,525.77 份	
下属分级基金的基金简称:	中金金序量化蓝筹 A	中金金序量化蓝筹 C
下属分级基金的交易代码:	005405	005406
报告期末下属分级基金的份额总额	99,596,280.42 份	19,030,245.35 份

### 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，在充分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	本基金采用数量化技术对投资策略进行优化，将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数体现在数量模型中，通过数量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制，充分发挥数量化投资的优势。一方面，在偏好大盘蓝筹的基础上，构建最小化市场波动性的投资组合；另一方面，通过量化选股等策略追求超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*75%+中债综合指数收益率*25%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和预期收益高于货币市场基金、债券证券投资基金，低于股票型证券投资基金。

### 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
	联系电话	010-63211122
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.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	北京市西城区闹市口大街 1 号

	18 号丰融国际中心北楼 17 层	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

基金级别	中金金序量化蓝筹 A	中金金序量化蓝筹 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年2月6日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年2月6日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-1,358,330.33	786,656.02
本期利润	-7,319,329.36	-432,056.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0693	-0.0186
本期加权平均净值利润率	-7.04%	-1.81%
本期基金份额净值增长率	-7.06%	-2.84%
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	-7,029,181.44	-539,918.47
期末可供分配基金份额利润	-0.0706	-0.0284
期末基金资产净值	92,567,098.98	18,490,326.88
期末基金份额净值	0.9294	0.9716
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	-7.06%	-2.84%

#### 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

中金金序量化蓝筹 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	-4.86%	1.02%	-5.63%	0.96%	0.77%	0.06%
过去三个月	-5.57%	0.84%	-7.03%	0.85%	1.46%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-7.06%	0.78%	-12.86%	0.92%	5.80%	-0.14%

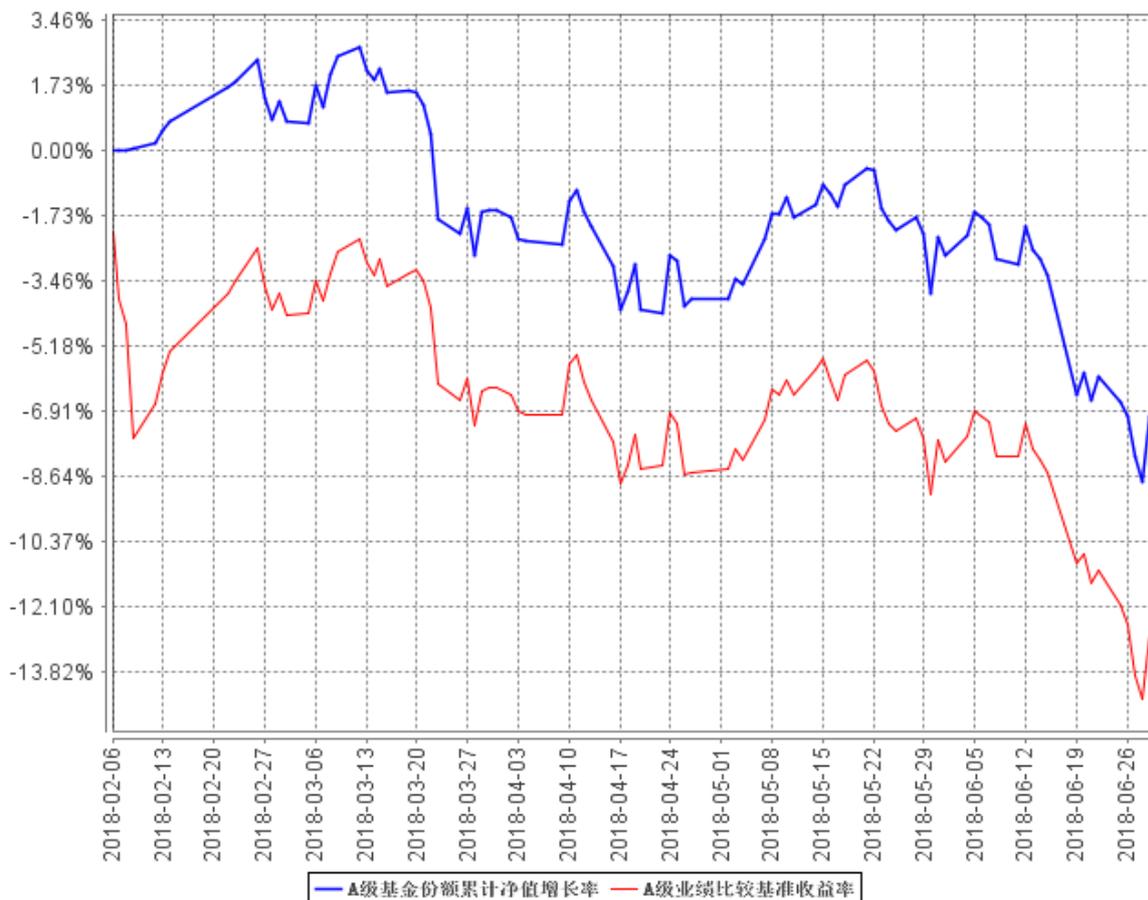
中金金序量化蓝筹 C

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	-4.89%	1.02%	-5.63%	0.96%	0.74%	0.06%

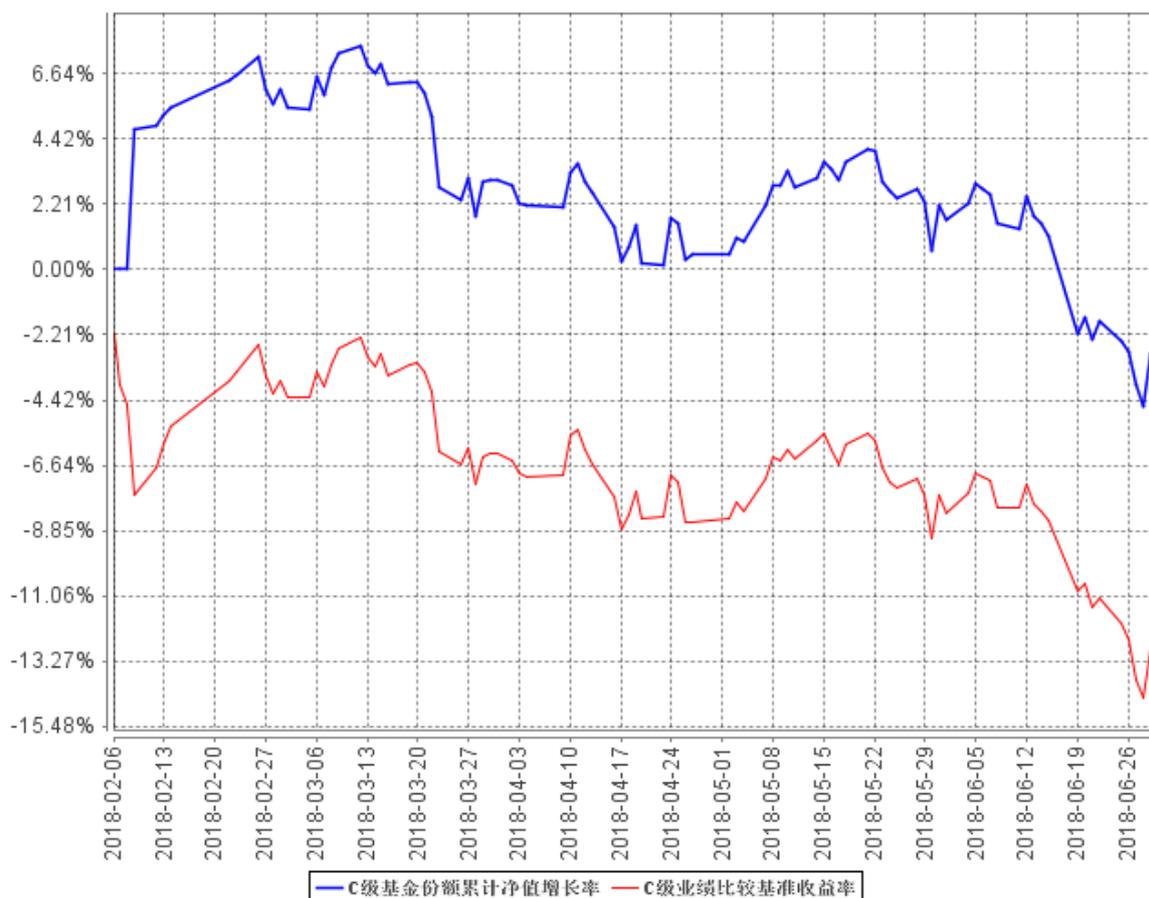
过去三个月	-5.71%	0.85%	-7.03%	0.85%	1.32%	0.00%
自基金合同生效起至今	-2.84%	0.93%	-12.86%	0.92%	10.02%	0.01%

### 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 2018 年 2 月 6 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，截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

## § 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	本基金基金经理	2018 年 2 月 6 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。

- 1、上述基金经理的任职日期为本基金合同生效日。
- 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。
- 3、本基金无基金经理助理。

### 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

在报告期内，本基金采用量化选股的投资策略，运作正常。模型主要在大中盘股里进行选股，同时精选了多只债券进行配置，仓位上保持和业绩比较基准一致。我们会继续在选股模型和配置模型上进行研究和改进，力争更好的表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金金序量化蓝筹 A 基金份额净值为 0.9294 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.06%；截至本报告期末中金金序量化蓝筹 C 基金份额净值为 0.9716 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.84%；同期业绩比较基准收益率为-12.86%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年的宏观经济环境非常复杂。第一，名义 GDP 在高位，一些经济指标显示经济活跃度高。第二，深化供给侧改革，发展巩固新兴产业，独角兽回归引导资金流向支持实体经济。第三，以金融“去杠杆”为目的的各项政策继续推进。第四，中美贸易战逐渐升级，对我国传统产业和新

兴产业的发展都会产生重要的影响。股市受到各种因素的共同作用，呈现出震荡向下的趋势。2018 年上半年，上证 50 指数下跌 13.30%，沪深 300 指数下跌 12.90%，中证 500 指数下跌 16.53%，中证 800 指数下跌 13.85%，中证 1000 指数下跌 20.08%，创业板指下跌 8.33%。展望 2018 年下半年，国内经济发展的韧性相信能够持续，政策层面大方向依然会延续，中美贸易摩擦的变数较大，总体上我们对股市的看法并不乐观，因此在投资时会更加注重风险控制，尽量减小净值的波动。

#### 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验。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：中金金序量化蓝筹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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	1,756,789.41
结算备付金		1,251,510.89
存出保证金		34,821.10
交易性金融资产	6.4.7.2	99,644,094.48
其中：股票投资		82,200,044.48
基金投资		-
债券投资		17,444,050.00
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	9,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	444,445.90
应收股利		-
应收申购款		1,599.85
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		112,133,261.63
<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>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		658,155.68
应付赎回款		-
应付管理人报酬		94,140.71
应付托管费		23,535.17
应付销售服务费		6,278.05
应付交易费用	6.4.7.7	206,685.96

应交税费		1,175.66
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	85,864.54
负债合计		1,075,835.77
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	118,626,525.77
未分配利润	6.4.7.10	-7,569,099.91
所有者权益合计		111,057,425.86
负债和所有者权益总计		112,133,261.63

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，中金金序量化蓝筹 A 基金份额净值 0.9294 元，基金份额总额 99596280.42 份；中金金序量化蓝筹 C 基金份额净值 0.9716 元，基金份额总额 19030245.35 份。中金金序量化蓝筹份额总额合计为 118626525.77 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-6,435,473.08
1.利息收入		436,391.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	65,127.55
债券利息收入		141,256.78
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		230,006.97
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-819,898.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,738,628.43
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	2,033.81
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	916,695.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,179,711.70
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	1,127,746.22
<b>减：二、费用</b>		<b>1,315,912.93</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	499,142.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	124,785.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	35,400.75
4. 交易费用	6.4.7.19	566,343.73
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		339.83
7. 其他费用	6.4.7.20	89,900.70
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-7,751,386.01</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-7,751,386.01</b>

注：本基金合同生效日为2018年2月6日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月6日(基金合同生效日)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）	203,049,881.65	-	203,049,881.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,751,386.01	-7,751,386.01
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）	-84,423,355.88	182,286.10	-84,241,069.78
其中：1.基金申购款	1,971,104.64	97,675.31	2,068,779.95
2.基金赎回款	-86,394,460.52	84,610.79	-86,309,849.73

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）	118,626,525.77	-7,569,099.91	111,057,425.86

注：本基金合同生效日为 2018 年 2 月 6 日，无上年度可比期间数据。

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

中金金序量化蓝筹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 6 月 16 日证监许可[2017]936 号《关于准予中金金序量化蓝筹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、《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金招募说明书》和《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式,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直销柜台、中金基金网上直销平台及中国银河证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司及包商银行股份有限公司等共同销售,募集期为 2017 年 12 月 5 日起至 2018 年 1 月 30 日。经向中国证监会备案,《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 203,049,881.65 份(含利息转份额 8.28 份以及于 2018 年 3 月 21 日银行结息转份额 55.87 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《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金合同》和《中金金序量化蓝筹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,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额

额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金销售费用的不同，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，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、《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金合同》和《中金金序量化蓝筹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 日的财务状况、自 2018 年 1 月 1 日至 2018 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、托管费和销售服务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 10%，若《中金金序量化精选混合型发起式基金基金合同》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该类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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本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	1,756,789.41
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：	1,756,789.41

### 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	89,326,572.75	82,200,044.48	-7,126,528.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	17,497,233.43	17,444,050.00
	银行间市场	-	-
	合计	17,497,233.43	17,444,050.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	106,823,806.18	99,644,094.48	-7,179,711.70

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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	9,000,000.00	-
合计	9,000,000.00	-

#### 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	307.03
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	563.20
应收债券利息	445,487.34
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-1,927.37
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	15.70
合计	444,445.90

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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	206,685.96
银行间市场应付交易费用	-
合计	206,685.96

#### 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	-
预提费用	85,864.54
合计	85,864.54

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金金序量化蓝筹 A		
项目	本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	110,750,932.51	110,750,932.51

本期申购	181,352.75	181,352.75
本期赎回(以“-”号填列)	-11,336,004.84	-11,336,004.84
- 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	99,596,280.42	99,596,280.42

金额单位：人民币元

中金金序量化蓝筹 C		
项目	本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	92,298,949.14	92,298,949.14
本期申购	1,789,751.89	1,789,751.89
本期赎回(以“-”号填列)	-75,058,455.68	-75,058,455.68
- 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	19,030,245.35	19,030,245.35

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金金序量化蓝筹 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,358,330.33	-5,960,999.03	-7,319,329.36
本期基金份额交易产生的变动数	139,972.34	150,175.58	290,147.92
其中：基金申购款	-1,678.43	-2,384.59	-4,063.02
基金赎回款	141,650.77	152,560.17	294,210.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,218,357.99	-5,810,823.45	-7,029,181.44

单位：人民币元

中金金序量化蓝筹 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

本期利润	786,656.02	-1,218,712.67	-432,056.65
本期基金份额交易产生的变动数	-164,680.85	56,819.03	-107,861.82
其中：基金申购款	83,728.49	18,009.84	101,738.33
基金赎回款	-248,409.34	38,809.19	-209,600.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	621,975.17	-1,161,893.64	-539,918.47

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日
活期存款利息收入	51,315.71
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	13,654.20
其他	157.64
合计	65,127.55

#### 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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日
卖出股票成交总额	186,216,879.76
减：卖出股票成本总额	187,955,508.19
买卖股票差价收入	-1,738,628.43

#### 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2月6日(基金合同生效日)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	2,033.81
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	2,033.81

#### 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2月6日(基金合同生效日)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	7,325,397.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,081,845.40
减：应收利息总额	241,517.99
买卖债券差价收入	2,033.81

#### 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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	916,695.72
基金投资产生的股利收益	-
合计	916,695.72

**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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-7,179,711.70
——股票投资	-7,126,528.27
——债券投资	-53,183.43
——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	-7,179,711.70

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日
基金赎回费收入	1,107,441.26
其他	20,304.96
合计	1,127,746.22

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	566,343.73
银行间市场交易费用	-
合计	566,343.73

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	32,977.24
信息披露费	52,887.30
其他	360.00
汇划手续费	3,676.16
合计	89,900.70

#### 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

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中金公司	325,104,723.11	70.19%
中投证券	138,080,317.29	29.81%

#### 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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
中金公司	18,568,601.43	75.52%
中投证券	6,018,379.20	24.48%

#### 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2月6日(基金合同生效日)至2018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
中金公司	1,081,000,000.00	75.41%
中投证券	352,500,000.00	24.59%

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期无关联方权证交易。

**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2月6日(基金合同生效日)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
中金公司	237,761.78	70.19%	105,716.26	51.15%
中投证券	100,969.70	29.81%	100,969.70	48.85%

**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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	499,142.34
其中：支付销售机构的客户维护费	3,523.96

注：1、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 1.00% 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×1.00%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2018 年 2 月 6 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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	124,785.58

注：1、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。

2、本基金合同生效日为 2018 年 2 月 6 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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金金序量化蓝筹 A	中金金序量化蓝筹C	合计
	中金基金	0.00	33,537.92
合计	0.00	33,537.92	33,537.92

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 0.40% 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。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 × 0.40% / 当年天数。

3、本基金合同生效日为 2018 年 2 月 6 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**

本基金本报告期没有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**

项目	本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	中金金序量化蓝筹 A	中金金序量化蓝筹 C
基金合同生效日（2018年2月6日）持有的基金份额	14,000,000.00	-
期初持有的基金份额	14,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	14,000,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.0567%	-

本基金本报告期末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

除基金管理人之外的其他关联方于本期末未持有本基金。

#### 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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,756,789.41	51,315.71

注：本基金通过“中国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1,286,331.99元，当期产生的利息收入为人民币15,513.63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	2,000	27,540.00

#### 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

本基金本报告期间未进行利润分配。

#### 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
002310	东方园林	2018年5月25日	重大事项	15.03	2018年8月27日	13.47	37,370	702,462.83	561,671.10	-
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	73,120	543,127.06	546,206.40	-
002450	康得新	2018年6月4日	重大事项	17.08	-	-	23,200	478,001.35	396,256.00	-
000669	金鸿能源	2018年6月13日	重大事项	7.25	2018年8月6日	6.53	42,840	334,121.27	310,590.00	-
000008	神州高铁	2018年6月8日	重大事项	4.96	2018年8月7日	4.46	42,802	243,533.11	212,297.92	-
002051	中工国际	2018年6月14日	重大事项	15.27	-	-	12,300	196,371.57	187,821.00	-
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	38,700	151,627.00	139,320.00	-
002602	世纪华通	2018年6月12日	重大事项	32.50	-	-	3,900	134,093.43	126,750.00	-
000723	美锦能源	2018年3月27日	重大事项	5.43	2018年7月31日	4.89	20,200	122,365.00	109,686.00	-
600750	江中药业	2018年6月21日	重大事项	17.75	2018年8月1日	16.12	4,760	82,670.26	84,490.00	-

		日								
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大事项	9.49	-	-	6,619	68,438.00	62,814.31	-
000825	太钢不锈	2018年4月16日	重大事项	6.00	-	-	10,000	56,133.46	60,000.00	-
600022	山东钢铁	2018年3月27日	重大事项	2.02		2018年8月16日	1.83	25,200	55,727.62	50,904.00
002359	齐星铁塔	2018年5月21日	重大事项	19.58		2018年8月21日	17.62	2,300	60,519.14	45,034.00
600811	东方集团	2018年5月30日	重大事项	4.30	-	-	10,300	44,991.90	44,290.00	-
300603	立昂技术	2018年5月2日	重大事项	35.73		2018年8月24日	32.07	900	30,844.80	32,157.00
002512	达华智能	2018年6月19日	重大事项	9.70	-	-	2,400	25,899.35	23,280.00	-
002437	誉衡药业	2018年6月11日	重大事项	6.20		2018年8月13日	5.57	3,100	20,661.21	19,220.00
600678	四川金顶	2018年4月18日	重大事项	10.24	-	-	1,800	18,370.13	18,432.00	-
600293	三峡新材	2018年6月8日	重大事项	5.68		2018年8月7日	5.11	3,100	20,867.87	17,608.00
600641	万业企业	2018年6月6日	重大事项	12.18		2018年8月9日	10.96	1,300	16,800.00	15,834.00

		日			日					
300118	东方日升	2018年5月7日	重大事项	10.80	2018年8月7日	9.63	1,100	12,348.57	11,880.00	-
600796	钱江生化	2018年6月28日	重大事项	6.08	-	-	1,900	11,752.00	11,552.00	-
600850	华东电脑	2018年6月22日	重大事项	18.99	2018年8月15日	18.00	600	11,476.73	11,394.00	-
002011	盾安环境	2018年5月2日	重大事项	6.40	-	-	1,700	11,728.11	10,880.00	-
300108	双龙股份	2018年6月12日	重大事项	7.84	-	-	800	6,606.39	6,272.00	-
002431	棕榈股份	2018年6月12日	重大事项	6.71	-	-	900	6,514.79	6,039.00	-
002778	高科石化	2018年6月19日	重大事项	19.02	2018年7月20日	18.00	300	6,065.11	5,706.00	-
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	400	3,906.93	3,636.00	-
002665	首航节能	2018年6月15日	重大事项	5.80	-	-	600	4,027.93	3,480.00	-
002573	清新环境	2018年6月19日	重大事项	11.55	-	-	300	4,257.51	3,465.00	-
600768	宁波富邦	2018年6月14日	重大事项	11.04	-	-	300	3,397.00	3,312.00	-

		日									
300343	联创 互联	2018 年 6 月 19 日	重大 事项	10.00	-	-	300	3,039.00	3,000.00	-	
000779	三毛 派神	2018 年 3 月 21 日	重大 事项	13.47		2018 年 8 月 21 日	12.12	200	2,439.00	2,694.00	-
300197	铁汉 生态	2018 年 5 月 28 日	重大 事项	5.37	-	-	450	2,912.28	2,416.50	-	
002171	楚江 新材	2018 年 6 月 7 日	重大 事项	6.78	-	-	300	2,086.36	2,034.00	-	
601727	上海 电气	2018 年 6 月 7 日	重大 事项	6.34		2018 年 8 月 7 日	5.71	300	1,755.93	1,902.00	-
600122	宏图 高科	2018 年 6 月 26 日	重大 事项	7.40	-	-	200	1,766.81	1,480.00	-	
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	200	1,612.04	1,442.00	-
002477	雏鹰 农牧	2018 年 6 月 14 日	重大 事项	3.31	-	-	400	1,451.10	1,324.00	-	
002408	齐翔 腾达	2018 年 6 月 21 日	重大 事项	12.28	-	-	100	1,371.15	1,228.00	-	
002102	冠福 股份	2018 年 6 月 1 日	重大 事项	3.72	-	-	2,200	9,586.88	8,184.00	-	
002411	必康 股份	2018 年 6 月 19 日	重大 事项	27.75	-	-	200	5,205.27	5,550.00	-	

		日								
002270	华明 装备	2018 年 5 月 3 日	重大 事项	5.81	2018 年 7 月 3 日	5.23	1,050	6,592.00	6,100.50	-
600335	国机 汽车	2018 年 4 月 3 日	重大 事项	10.43	-	-	800	8,574.00	8,344.00	-

### 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。

##### 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。

##### 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。

##### 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
AAA	-
AAA 以下	11,443,450.00
未评级	-
合计	11,443,450.00

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。

##### 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。

#### 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	1,756,789.41	-	-	-	1,756,789.41
结算备付金	1,251,510.89	-	-	-	1,251,510.89
存出保证金	34,821.10	-	-	-	34,821.10
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	82,200,044.48	82,200,044.48
交易性金融资产-债券投资	17,444,050.00	-	-	-	17,444,050.00
买入返售金融资产	9,000,000.00	-	-	-	9,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	444,445.90	444,445.90

应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	1,599.85	1,599.85
资产总计	29,487,171.40	-	-82,646,090.23	112,133,261.63
负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	658,155.68	658,155.68
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	94,140.71	94,140.71
应付托管费	-	-	23,535.17	23,535.17
应付交易费用	-	-	206,685.96	206,685.96
应付销售服务费	-	-	6,278.05	6,278.05
应交税费	-	-	1,175.66	1,175.66
应付利息	-	-	-	-
其他负债	-	-	85,864.54	85,864.54
负债总计	-	-	-1,075,835.77	-1,075,835.77
利率敏感度缺口	29,487,171.40	-	-81,570,254.46	111,057,425.86

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	13,939.48	-
市场利率上升 25 个基点	-13,939.48		

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	82,200,044.48	74.02
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	17,444,050.00	15.71
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	99,644,094.48	89.72

#### 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	82,200,044.48	73.31
	其中：股票	82,200,044.48	73.31
2	固定收益投资	17,444,050.00	15.56
	其中：债券	17,444,050.00	15.56
	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	9,000,000.00	8.03
	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	3,008,300.30	2.68
7	其他各项资产	480,866.85	0.43
8	合计	112,133,261.63	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	168,489.00	0.15
B	采矿业	2,194,403.25	1.98
C	制造业	37,250,018.83	33.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,989,767.94	2.69
E	建筑业	4,614,197.11	4.15
F	批发和零售业	3,720,166.75	3.35
G	交通运输、仓储和邮政业	2,726,050.00	2.45
H	住宿和餐饮业	4,570.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,664,035.05	2.40
J	金融业	15,831,502.37	14.26
K	房地产业	6,119,972.50	5.51

L	租赁和商务服务业	995,581.18	0.90
M	科学研究和技术服务业	34,555.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	617,148.60	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	51,188.20	0.05
R	文化、体育和娱乐业	2,118,042.70	1.91
S	综合	100,356.00	0.09
	合计	82,200,044.48	74.02

### 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	43,300	2,536,514.00	2.28
2	600519	贵州茅台	3,110	2,274,840.60	2.05
3	600016	民生银行	211,910	1,483,370.00	1.34
4	600015	华夏银行	137,250	1,022,512.50	0.92
5	002304	洋河股份	7,650	1,006,740.00	0.91
6	601006	大秦铁路	120,250	987,252.50	0.89
7	000425	徐工机械	232,700	986,648.00	0.89
8	600887	伊利股份	34,860	972,594.00	0.88
9	000157	中联重科	235,100	966,261.00	0.87
10	600369	西南证券	230,700	888,195.00	0.80
11	000858	五粮液	11,400	866,400.00	0.78
12	601169	北京银行	141,856	855,391.68	0.77
13	600208	新湖中宝	220,900	843,838.00	0.76
14	600170	上海建工	277,100	842,384.00	0.76
15	000651	格力电器	17,210	811,451.50	0.73
16	600376	首开股份	113,807	800,063.21	0.72
17	600585	海螺水泥	23,790	796,489.20	0.72
18	600104	上汽集团	22,620	791,473.80	0.71
19	601166	兴业银行	54,560	785,664.00	0.71
20	600919	江苏银行	117,900	755,739.00	0.68

21	300027	华谊兄弟	122,300	753,368.00	0.68
22	601888	中国国旅	11,200	721,392.00	0.65
23	000333	美的集团	13,730	716,980.60	0.65
24	600741	华域汽车	29,815	707,211.80	0.64
25	600153	建发股份	78,285	703,782.15	0.63
26	000069	华侨城 A	96,810	699,936.30	0.63
27	000338	潍柴动力	79,290	693,787.50	0.62
28	600089	特变电工	94,200	652,806.00	0.59
29	600383	金地集团	55,934	569,967.46	0.51
30	601668	中国建筑	102,980	562,270.80	0.51
31	002310	东方园林	37,370	561,671.10	0.51
32	601328	交通银行	95,900	550,466.00	0.50
33	000895	双汇发展	20,790	549,063.90	0.49
34	601390	中国中铁	73,120	546,206.40	0.49
35	600674	川投能源	62,212	542,488.64	0.49
36	600309	万华化学	11,900	540,498.00	0.49
37	601009	南京银行	68,560	529,968.80	0.48
38	000623	吉林敖东	29,300	526,814.00	0.47
39	601601	中国太保	16,412	522,722.20	0.47
40	600219	南山铝业	192,400	521,404.00	0.47
41	601211	国泰君安	33,500	493,790.00	0.44
42	000100	TCL 集团	163,900	475,310.00	0.43
43	600036	招商银行	17,780	470,103.20	0.42
44	002294	信立泰	12,310	457,562.70	0.41
45	000826	启迪桑德	25,870	452,207.60	0.41
46	601229	上海银行	28,600	450,736.00	0.41
47	600820	隧道股份	76,181	450,229.71	0.41
48	000625	长安汽车	49,608	446,472.00	0.40
49	601168	西部矿业	70,900	445,252.00	0.40
50	603288	海天味业	6,000	441,840.00	0.40
51	601818	光大银行	120,140	439,712.40	0.40
52	002603	以岭药业	31,300	437,574.00	0.39
53	601997	贵阳银行	35,100	433,836.00	0.39
54	600795	国电电力	161,300	422,606.00	0.38
55	601607	上海医药	17,160	410,124.00	0.37
56	601717	郑煤机	69,800	405,538.00	0.37
57	600028	中国石化	62,100	403,029.00	0.36
58	601288	农业银行	116,700	401,448.00	0.36
59	300039	上海凯宝	69,110	400,838.00	0.36

60	600516	方大炭素	16,300	397,394.00	0.36
61	002450	康得新	23,200	396,256.00	0.36
62	002572	索菲亚	12,250	394,205.00	0.35
63	601186	中国铁建	45,315	390,615.30	0.35
64	000568	泸州老窖	6,400	389,504.00	0.35
65	600557	康缘药业	31,000	382,850.00	0.34
66	000718	苏宁环球	104,200	382,414.00	0.34
67	600398	海澜之家	29,010	369,587.40	0.33
68	600705	中航资本	78,900	368,463.00	0.33
69	600867	通化东宝	15,000	359,550.00	0.32
70	601333	广深铁路	82,800	351,900.00	0.32
71	603188	亚邦股份	33,534	342,046.80	0.31
72	601021	春秋航空	9,600	336,288.00	0.30
73	600978	宜华生活	46,940	320,600.20	0.29
74	600276	恒瑞医药	4,210	318,949.60	0.29
75	600611	大众交通	79,710	317,245.80	0.29
76	600216	浙江医药	24,400	311,588.00	0.28
77	000669	金鸿能源	42,840	310,590.00	0.28
78	000528	柳工	28,720	307,591.20	0.28
79	600518	康美药业	12,999	297,417.12	0.27
80	600655	豫园股份	31,300	295,785.00	0.27
81	002233	塔牌集团	25,800	295,152.00	0.27
82	600031	三一重工	32,830	294,485.10	0.27
83	000581	威孚高科	13,300	294,063.00	0.26
84	603444	吉比特	2,300	293,917.00	0.26
85	600886	国投电力	40,300	292,981.00	0.26
86	600837	海通证券	30,700	290,729.00	0.26
87	600500	中化国际	41,100	280,302.00	0.25
88	600373	中文传媒	21,630	277,945.50	0.25
89	000876	新希望	43,300	274,522.00	0.25
90	600729	重庆百货	8,300	273,485.00	0.25
91	601311	骆驼股份	23,710	271,953.70	0.24
92	600757	长江传媒	47,077	267,868.13	0.24
93	601099	太平洋	112,730	263,788.20	0.24
94	002415	海康威视	7,000	259,910.00	0.23
95	600064	南京高科	34,728	254,903.52	0.23
96	600694	大商股份	7,729	251,269.79	0.23
97	000002	万科 A	10,079	247,943.40	0.22
98	000887	中鼎股份	16,900	243,529.00	0.22

99	600648	外高桥	13,200	241,296.00	0.22
100	000423	东阿阿胶	4,434	238,593.54	0.21
101	601016	节能风电	83,000	238,210.00	0.21
102	000031	中粮地产	40,900	236,402.00	0.21
103	601788	光大证券	21,230	233,105.40	0.21
104	601898	中煤能源	47,011	227,063.13	0.20
105	601991	大唐发电	74,900	226,947.00	0.20
106	600000	浦发银行	23,590	225,520.40	0.20
107	002317	众生药业	21,200	224,084.00	0.20
108	600649	城投控股	36,160	221,299.20	0.20
109	600422	昆药集团	28,374	219,898.50	0.20
110	601336	新华保险	5,100	218,688.00	0.20
111	600167	联美控股	21,700	217,000.00	0.20
112	002463	沪电股份	57,400	214,676.00	0.19
113	600926	杭州银行	19,200	212,928.00	0.19
114	600017	日照港	66,300	212,823.00	0.19
115	600009	上海机场	3,830	212,488.40	0.19
116	000008	神州高铁	42,802	212,297.92	0.19
117	000961	中南建设	33,600	212,016.00	0.19
118	601088	中国神华	10,550	210,367.00	0.19
119	600073	上海梅林	31,430	208,695.20	0.19
120	000963	华东医药	4,245	204,821.25	0.18
121	601117	中国化学	30,110	202,640.30	0.18
122	601928	凤凰传媒	32,900	200,032.00	0.18
123	300251	光线传媒	19,500	198,510.00	0.18
124	000627	天茂集团	28,161	197,690.22	0.18
125	600352	浙江龙盛	16,426	196,290.70	0.18
126	601618	中国中冶	58,800	195,804.00	0.18
127	601678	滨化股份	31,265	193,217.70	0.17
128	600340	华夏幸福	7,500	193,125.00	0.17
129	000848	承德露露	17,967	190,270.53	0.17
130	600572	康恩贝	26,400	189,288.00	0.17
131	002051	中工国际	12,300	187,821.00	0.17
132	000999	华润三九	6,600	183,678.00	0.17
133	600256	广汇能源	42,840	175,215.60	0.16
134	002146	荣盛发展	19,400	169,362.00	0.15
135	000898	鞍钢股份	29,850	166,264.50	0.15
136	000598	兴蓉环境	40,600	164,836.00	0.15
137	601801	皖新传媒	21,400	162,854.00	0.15

138	000725	京东方 A	45,800	162,132.00	0.15
139	600704	物产中大	30,906	161,638.38	0.15
140	600639	浦东金桥	12,510	156,124.80	0.14
141	000001	平安银行	16,630	151,166.70	0.14
142	600535	天士力	5,834	150,633.88	0.14
143	600606	绿地控股	22,700	148,458.00	0.13
144	601988	中国银行	41,000	148,010.00	0.13
145	000006	深振业 A	25,000	146,500.00	0.13
146	601689	拓普集团	7,500	145,800.00	0.13
147	000997	新大陆	9,200	144,900.00	0.13
148	002280	联络互动	25,200	144,144.00	0.13
149	601001	大同煤业	28,812	142,907.52	0.13
150	000758	中色股份	31,000	139,500.00	0.13
151	002426	胜利精密	38,700	139,320.00	0.13
152	000049	德赛电池	4,850	136,867.00	0.12
153	000778	新兴铸管	31,900	136,532.00	0.12
154	000501	鄂武商 A	10,900	133,961.00	0.12
155	600690	青岛海尔	6,840	131,738.40	0.12
156	600023	浙能电力	28,110	130,992.60	0.12
157	002152	广电运通	22,200	130,536.00	0.12
158	002602	世纪华通	3,900	126,750.00	0.11
159	600201	生物股份	7,370	125,953.30	0.11
160	600061	国投资本	13,220	122,681.60	0.11
161	300297	蓝盾股份	15,110	122,542.10	0.11
162	600056	中国医药	6,600	120,582.00	0.11
163	000413	东旭光电	19,800	119,988.00	0.11
164	600048	保利地产	9,820	119,804.00	0.11
165	000783	长江证券	21,800	118,374.00	0.11
166	000547	航天发展	15,100	117,931.00	0.11
167	002373	千方科技	8,900	116,145.00	0.10
168	600019	宝钢股份	14,800	115,292.00	0.10
169	300026	红日药业	31,000	113,150.00	0.10
170	000926	福星股份	15,700	112,883.00	0.10
171	600030	中信证券	6,800	112,676.00	0.10
172	001979	招商蛇口	5,860	111,633.00	0.10
173	601811	新华文轩	11,393	110,739.96	0.10
174	600062	华润双鹤	4,500	110,475.00	0.10
175	000723	美锦能源	20,200	109,686.00	0.10
176	000488	晨鸣纸业	8,400	108,528.00	0.10

177	600618	氯碱化工	12,640	107,566.40	0.10
178	600126	杭钢股份	17,900	106,863.00	0.10
179	002221	东华能源	10,600	103,562.00	0.09
180	002174	游族网络	5,100	101,490.00	0.09
181	601985	中国核电	17,700	100,005.00	0.09
182	600664	哈药股份	25,100	99,647.00	0.09
183	600050	中国联通	20,200	99,384.00	0.09
184	600332	白云山	2,600	98,930.00	0.09
185	600597	光明乳业	10,000	98,700.00	0.09
186	002508	老板电器	3,217	98,504.54	0.09
187	603858	步长制药	2,300	98,417.00	0.09
188	600177	雅戈尔	12,655	97,443.50	0.09
189	600522	中天科技	11,020	97,086.20	0.09
190	601377	兴业证券	18,260	96,230.20	0.09
191	600755	厦门国贸	13,200	96,228.00	0.09
192	300182	捷成股份	12,400	93,992.00	0.08
193	600143	金发科技	17,600	91,872.00	0.08
194	600688	上海石化	16,101	91,614.69	0.08
195	600006	东风汽车	22,300	91,207.00	0.08
196	600160	巨化股份	12,450	91,134.00	0.08
197	603198	迎驾贡酒	4,910	90,196.70	0.08
198	600011	华能国际	14,110	89,739.60	0.08
199	002056	横店东磁	12,800	89,728.00	0.08
200	000552	靖远煤电	27,400	89,598.00	0.08
201	600260	凯乐科技	3,300	88,572.00	0.08
202	002128	露天煤业	9,720	88,063.20	0.08
203	002440	闰土股份	7,500	87,675.00	0.08
204	002078	太阳纸业	9,000	87,210.00	0.08
205	300088	长信科技	14,600	84,680.00	0.08
206	600750	江中药业	4,760	84,490.00	0.08
207	600959	江苏有线	16,500	84,150.00	0.08
208	002640	跨境通	5,600	84,112.00	0.08
209	600079	人福医药	6,320	83,550.40	0.08
210	603019	中科曙光	1,800	82,566.00	0.07
211	002344	海宁皮城	16,820	81,745.20	0.07
212	002354	天神娱乐	8,800	81,488.00	0.07
213	601128	常熟银行	14,100	80,652.00	0.07
214	000830	鲁西化工	4,665	79,678.20	0.07
215	002332	仙琚制药	9,100	79,625.00	0.07

216	603025	大豪科技	4,108	79,448.72	0.07
217	002589	瑞康医药	5,700	77,748.00	0.07
218	002004	华邦健康	15,300	77,724.00	0.07
219	002410	广联达	2,800	77,644.00	0.07
220	000980	金马股份	10,900	77,499.00	0.07
221	002110	三钢闽光	4,800	76,944.00	0.07
222	000977	浪潮信息	3,200	76,320.00	0.07
223	600939	重庆建工	15,400	76,076.00	0.07
224	000975	银泰资源	7,460	75,644.40	0.07
225	002064	华峰氨纶	18,300	75,579.00	0.07
226	000538	云南白药	700	74,872.00	0.07
227	000541	佛山照明	12,364	74,060.36	0.07
228	300122	智飞生物	1,600	73,184.00	0.07
229	000060	中金岭南	15,000	72,900.00	0.07
230	000553	沙隆达 A	4,600	72,726.00	0.07
231	002277	友阿股份	15,440	71,178.40	0.06
232	002505	大康农业	33,000	70,620.00	0.06
233	600426	华鲁恒升	4,000	70,360.00	0.06
234	300287	飞利信	9,700	69,743.00	0.06
235	601000	唐山港	29,670	69,724.50	0.06
236	601200	上海环境	4,400	69,652.00	0.06
237	002407	多氟多	4,900	68,698.00	0.06
238	601225	陕西煤业	8,350	68,637.00	0.06
239	000661	长春高新	300	68,310.00	0.06
240	600808	马钢股份	18,745	67,294.55	0.06
241	300315	掌趣科技	15,700	65,626.00	0.06
242	600499	科达洁能	9,500	65,170.00	0.06
243	600908	无锡银行	11,000	64,790.00	0.06
244	600511	国药股份	2,400	64,680.00	0.06
245	600580	卧龙电气	8,309	63,314.58	0.06
246	300324	旋极信息	6,619	62,814.31	0.06
247	002191	劲嘉股份	8,400	62,748.00	0.06
248	002244	滨江集团	12,000	62,400.00	0.06
249	002491	通鼎互联	5,600	61,992.00	0.06
250	002815	崇达技术	3,800	61,180.00	0.06
251	002002	鸿达兴业	13,200	60,852.00	0.05
252	600881	亚泰集团	16,300	60,799.00	0.05
253	601800	中国交建	5,300	60,367.00	0.05
254	002608	*ST 舜船	8,700	60,030.00	0.05

255	000825	太钢不锈	10,000	60,000.00	0.05
256	000028	国药一致	1,200	59,880.00	0.05
257	002385	大北农	14,292	59,025.96	0.05
258	600458	时代新材	8,000	58,880.00	0.05
259	600748	上实发展	11,500	57,960.00	0.05
260	600282	南钢股份	13,000	57,460.00	0.05
261	601669	中国电建	10,700	57,352.00	0.05
262	300253	卫宁健康	4,600	56,994.00	0.05
263	600809	山西汾酒	900	56,601.00	0.05
264	600737	中粮糖业	7,320	55,192.80	0.05
265	000066	长城电脑	7,600	54,036.00	0.05
266	600545	卓郎智能	6,708	53,261.52	0.05
267	600390	五矿资本	6,700	51,925.00	0.05
268	300002	神州泰岳	12,400	51,708.00	0.05
269	002400	省广股份	15,900	51,357.00	0.05
270	600022	山东钢铁	25,200	50,904.00	0.05
271	000012	南玻 A	10,265	50,811.75	0.05
272	300055	万邦达	4,400	50,556.00	0.05
273	002176	江特电机	5,200	50,544.00	0.05
274	002268	卫士通	2,300	50,209.00	0.05
275	000766	通化金马	4,200	49,896.00	0.04
276	600643	爱建集团	5,138	48,297.20	0.04
277	002416	爱施德	8,220	48,251.40	0.04
278	300159	新研股份	6,800	48,144.00	0.04
279	002195	二三四五	11,023	47,178.44	0.04
280	600970	中材国际	7,000	46,760.00	0.04
281	002439	启明星辰	2,200	46,684.00	0.04
282	002180	艾派克	1,700	46,682.00	0.04
283	002230	科大讯飞	1,450	46,501.50	0.04
284	600325	华发股份	6,000	46,380.00	0.04
285	601179	中国西电	13,500	46,170.00	0.04
286	600703	三安光电	2,400	46,128.00	0.04
287	002583	海能达	5,500	45,925.00	0.04
288	600718	东软集团	3,497	45,670.82	0.04
289	002359	齐星铁塔	2,300	45,034.00	0.04
290	600811	东方集团	10,300	44,290.00	0.04
291	300059	东方财富	3,360	44,284.80	0.04
292	300166	东方国信	3,000	44,190.00	0.04
293	002022	科华生物	3,700	43,845.00	0.04

294	600637	东方明珠	2,900	43,674.00	0.04
295	000813	德展健康	5,300	43,672.00	0.04
296	000078	海王生物	9,000	43,290.00	0.04
297	601111	中国国航	4,800	42,672.00	0.04
298	002709	天赐材料	1,100	42,394.00	0.04
299	600614	鹏起科技	7,400	42,254.00	0.04
300	002375	亚厦股份	7,900	42,186.00	0.04
301	000703	恒逸石化	2,760	41,068.80	0.04
302	600195	中牧股份	2,110	41,039.50	0.04
303	600823	世茂股份	9,800	40,964.00	0.04
304	000009	中国宝安	8,200	40,180.00	0.04
305	600816	安信信托	5,320	38,516.80	0.03
306	600410	华胜天成	4,400	38,500.00	0.03
307	002008	大族激光	720	38,296.80	0.03
308	600863	内蒙华电	16,830	38,204.10	0.03
309	601155	新城控股	1,230	38,093.10	0.03
310	300070	碧水源	2,700	37,611.00	0.03
311	600936	广西广电	7,900	37,604.00	0.03
312	000860	顺鑫农业	1,000	37,500.00	0.03
313	002183	怡亚通	5,600	37,240.00	0.03
314	002019	亿帆医药	2,100	37,065.00	0.03
315	600582	天地科技	10,020	36,773.40	0.03
316	600068	葛洲坝	5,100	36,771.00	0.03
317	600482	中国动力	2,100	36,645.00	0.03
318	600743	华远地产	14,200	36,494.00	0.03
319	600839	四川长虹	12,700	36,322.00	0.03
320	600859	王府井	1,700	36,159.00	0.03
321	002236	大华股份	1,600	36,080.00	0.03
322	300308	中际装备	600	36,024.00	0.03
323	603328	依顿电子	3,300	35,805.00	0.03
324	600885	宏发股份	1,180	35,305.60	0.03
325	300113	顺网科技	2,000	34,820.00	0.03
326	002261	拓维信息	7,500	34,500.00	0.03
327	600277	亿利洁能	6,520	34,164.80	0.03
328	002701	奥瑞金	6,200	33,852.00	0.03
329	600777	新潮能源	15,400	33,726.00	0.03
330	601238	广汽集团	3,020	33,642.80	0.03
331	300010	立思辰	2,700	33,048.00	0.03
332	601127	小康股份	1,900	32,851.00	0.03

333	000685	中山公用	4,100	32,677.00	0.03
334	300603	立昂技术	900	32,157.00	0.03
335	601360	三六零	1,100	31,790.00	0.03
336	002475	立讯精密	1,400	31,556.00	0.03
337	600108	亚盛集团	10,800	31,212.00	0.03
338	002807	江阴银行	5,500	30,910.00	0.03
339	600380	健康元	2,600	30,836.00	0.03
340	600872	中炬高新	1,100	30,800.00	0.03
341	002456	欧菲光	1,900	30,647.00	0.03
342	603799	华友钴业	300	29,241.00	0.03
343	600196	复星医药	700	28,973.00	0.03
344	600993	马应龙	1,700	28,917.00	0.03
345	000750	国海证券	8,000	28,560.00	0.03
346	000402	金融街	3,500	28,175.00	0.03
347	600060	海信电器	2,100	28,119.00	0.03
348	600570	恒生电子	526	27,851.70	0.03
349	000418	小天鹅A	400	27,740.00	0.02
350	600395	盘江股份	4,500	27,315.00	0.02
351	000513	丽珠集团	620	27,249.00	0.02
352	600066	宇通客车	1,400	26,866.00	0.02
353	000596	古井贡酒	300	26,634.00	0.02
354	002073	软控股份	4,600	26,450.00	0.02
355	600895	张江高科	2,300	26,450.00	0.02
356	600169	太原重工	11,300	26,442.00	0.02
357	600682	南京新百	1,600	26,304.00	0.02
358	002368	太极股份	900	26,163.00	0.02
359	300003	乐普医疗	700	25,676.00	0.02
360	600521	华海药业	960	25,622.40	0.02
361	600271	航天信息	1,010	25,522.70	0.02
362	000503	海虹控股	800	25,424.00	0.02
363	002916	深南电路	400	25,404.00	0.02
364	000040	东旭蓝天	2,500	25,250.00	0.02
365	600565	迪马股份	8,400	24,780.00	0.02
366	600300	维维股份	7,600	24,776.00	0.02
367	600536	中国软件	1,140	24,658.20	0.02
368	600528	中铁工业	2,400	24,528.00	0.02
369	000671	阳光城	4,100	24,477.00	0.02
370	002707	众信旅游	2,500	24,000.00	0.02
371	600094	大名城	4,116	23,708.16	0.02

372	002600	江粉磁材	4,500	23,355.00	0.02
373	002512	达华智能	2,400	23,280.00	0.02
374	600317	营口港	10,300	23,278.00	0.02
375	002142	宁波银行	1,420	23,131.80	0.02
376	600051	宁波联合	3,700	23,088.00	0.02
377	600875	东方电气	3,100	22,971.00	0.02
378	603369	今世缘	1,000	22,830.00	0.02
379	600329	中新药业	1,200	22,800.00	0.02
380	600436	片仔癀	200	22,386.00	0.02
381	600657	信达地产	5,200	22,100.00	0.02
382	600598	北大荒	2,400	21,984.00	0.02
383	600717	天津港	2,900	21,837.00	0.02
384	600125	铁龙物流	2,600	21,762.00	0.02
385	600708	光明地产	5,060	21,758.00	0.02
386	600588	用友网络	880	21,568.80	0.02
387	600594	益佰制药	2,400	21,504.00	0.02
388	000059	华锦股份	3,100	21,359.00	0.02
389	603766	隆鑫通用	3,900	21,177.00	0.02
390	600801	华新水泥	1,400	21,042.00	0.02
391	603568	伟明环保	830	20,999.00	0.02
392	600183	生益科技	2,290	20,976.40	0.02
393	002308	威创股份	2,520	20,916.00	0.02
394	002635	安洁科技	1,200	20,640.00	0.02
395	001696	宗申动力	4,200	20,580.00	0.02
396	601966	玲珑轮胎	1,300	20,501.00	0.02
397	000016	深康佳 A	3,900	20,475.00	0.02
398	600804	鹏博士	1,700	20,400.00	0.02
399	002241	歌尔股份	2,000	20,380.00	0.02
400	000519	江南红箭	2,600	20,202.00	0.02
401	000563	陕国投 A	5,900	20,060.00	0.02
402	601231	环旭电子	2,200	19,954.00	0.02
403	600869	智慧能源	4,200	19,824.00	0.02
404	002044	美年健康	860	19,436.00	0.02
405	000537	广宇发展	2,000	19,280.00	0.02
406	002437	誉衡药业	3,100	19,220.00	0.02
407	600350	山东高速	4,700	19,035.00	0.02
408	002657	中科金财	1,200	19,008.00	0.02
409	002038	双鹭药业	500	18,995.00	0.02
410	300015	爱尔眼科	580	18,728.20	0.02

411	600100	同方股份	2,100	18,438.00	0.02
412	603589	口子窖	300	18,435.00	0.02
413	600678	四川金顶	1,800	18,432.00	0.02
414	000918	嘉凯城	4,000	18,200.00	0.02
415	002065	东华软件	2,070	17,802.00	0.02
416	601777	力帆股份	3,400	17,782.00	0.02
417	002093	国脉科技	2,300	17,733.00	0.02
418	600293	三峡新材	3,100	17,608.00	0.02
419	002223	鱼跃医疗	900	17,541.00	0.02
420	000166	申万宏源	4,000	17,480.00	0.02
421	600184	光电股份	1,400	17,346.00	0.02
422	300272	开能环保	1,600	17,328.00	0.02
423	600157	永泰能源	9,600	17,088.00	0.02
424	300418	昆仑万维	900	16,992.00	0.02
425	002249	大洋电机	3,900	16,809.00	0.02
426	600120	浙江东方	1,230	16,666.50	0.02
427	002503	搜于特	4,710	16,485.00	0.01
428	600292	远达环保	2,800	16,436.00	0.01
429	600161	天坛生物	840	16,254.00	0.01
430	600641	万业企业	1,300	15,834.00	0.01
431	002818	富森美	600	15,828.00	0.01
432	600348	阳泉煤业	2,200	15,730.00	0.01
433	000062	深圳华强	800	15,680.00	0.01
434	002642	荣之联	1,700	15,623.00	0.01
435	002626	金达威	900	15,615.00	0.01
436	002027	分众传媒	1,612	15,426.84	0.01
437	000662	天夏智慧	2,380	15,303.40	0.01
438	000885	同力水泥	1,500	15,240.00	0.01
439	601020	华钰矿业	1,100	15,169.00	0.01
440	300017	网宿科技	1,400	14,994.00	0.01
441	600563	法拉电子	300	14,847.00	0.01
442	300657	弘信电子	500	14,800.00	0.01
443	002251	步步高	1,300	14,794.00	0.01
444	000892	星美联合	3,100	14,601.00	0.01
445	002275	桂林三金	1,000	14,600.00	0.01
446	002203	海亮股份	1,800	14,580.00	0.01
447	600180	瑞茂通	1,500	14,535.00	0.01
448	600897	厦门空港	700	14,434.00	0.01
449	000034	神州数码	900	14,382.00	0.01

450	000878	云南铜业	1,500	14,310.00	0.01
451	600966	博汇纸业	3,300	14,223.00	0.01
452	002007	华兰生物	430	13,828.80	0.01
453	600179	安通控股	1,360	13,776.80	0.01
454	600230	沧州大化	620	13,739.20	0.01
455	601579	会稽山	1,400	13,706.00	0.01
456	000046	泛海控股	2,400	13,656.00	0.01
457	000400	许继电气	1,740	13,589.40	0.01
458	000921	海信科龙	1,300	13,468.00	0.01
459	002080	中材科技	1,580	13,430.00	0.01
460	002493	荣盛石化	1,300	13,416.00	0.01
461	600873	梅花生物	3,200	13,376.00	0.01
462	600835	上海机电	700	13,202.00	0.01
463	002247	帝龙文化	1,600	13,120.00	0.01
464	000070	特发信息	1,800	13,050.00	0.01
465	603160	汇顶科技	200	12,978.00	0.01
466	600623	华谊集团	1,300	12,974.00	0.01
467	300546	雄帝科技	600	12,924.00	0.01
468	600039	四川路桥	3,900	12,792.00	0.01
469	601003	柳钢股份	1,600	12,672.00	0.01
470	002061	*ST江化	1,200	12,564.00	0.01
471	002314	南山控股	3,100	12,493.00	0.01
472	600338	西藏珠峰	600	12,432.00	0.01
473	600782	新钢股份	2,200	12,276.00	0.01
474	600713	南京医药	2,500	12,225.00	0.01
475	600602	云赛智联	2,100	12,180.00	0.01
476	603355	莱克电气	400	12,020.00	0.01
477	000736	中房地产	1,085	11,989.25	0.01
478	600279	重庆港九	2,700	11,988.00	0.01
479	002558	世纪游轮	500	11,890.00	0.01
480	300118	东方日升	1,100	11,880.00	0.01
481	002736	国信证券	1,300	11,830.00	0.01
482	600372	中航电子	900	11,754.00	0.01
483	002470	金正大	1,700	11,696.00	0.01
484	600796	钱江生化	1,900	11,552.00	0.01
485	603225	新风鸣	577	11,522.69	0.01
486	300202	聚龙股份	1,100	11,473.00	0.01
487	601908	京运通	2,500	11,450.00	0.01
488	600850	华东电脑	600	11,394.00	0.01

489	600018	上港集团	1,900	11,324.00	0.01
490	300194	福安药业	2,400	11,280.00	0.01
491	002528	英飞拓	2,700	11,259.00	0.01
492	002345	潮宏基	1,300	11,180.00	0.01
493	601877	正泰电器	500	11,160.00	0.01
494	002399	海普瑞	500	11,070.00	0.01
495	300498	温氏股份	500	11,010.00	0.01
496	600240	华业资本	1,500	10,995.00	0.01
497	600781	辅仁药业	700	10,990.00	0.01
498	000631	顺发恒业	3,200	10,976.00	0.01
499	600827	百联股份	1,070	10,914.00	0.01
500	002011	盾安环境	1,700	10,880.00	0.01
501	603986	兆易创新	100	10,852.00	0.01
502	601515	东风股份	1,400	10,808.00	0.01
503	002479	富春环保	1,900	10,735.00	0.01
504	002841	视源股份	200	10,682.00	0.01
505	000039	中集集团	800	10,624.00	0.01
506	600085	同仁堂	300	10,584.00	0.01
507	600525	长园集团	1,000	10,570.00	0.01
508	601998	中信银行	1,700	10,557.00	0.01
509	300604	长川科技	290	10,547.30	0.01
510	000063	中兴通讯	800	10,424.00	0.01
511	002567	唐人神	2,300	10,419.00	0.01
512	600765	中航重机	1,400	10,416.00	0.01
513	600488	天药股份	2,500	10,275.00	0.01
514	600828	茂业商业	2,000	10,200.00	0.01
515	600267	海正药业	700	10,178.00	0.01
516	300273	和佳股份	1,500	10,170.00	0.01
517	600658	电子城	1,940	10,146.20	0.01
518	300406	九强生物	700	10,080.00	0.01
519	002118	紫鑫药业	1,400	10,010.00	0.01
520	002454	松芝股份	1,700	9,979.00	0.01
521	600105	永鼎股份	2,740	9,973.60	0.01
522	002624	完美世界	320	9,923.20	0.01
523	600459	贵研铂业	910	9,828.00	0.01
524	600829	人民同泰	1,368	9,794.88	0.01
525	600773	西藏城投	1,400	9,688.00	0.01
526	300676	华大基因	100	9,681.00	0.01
527	300219	鸿利智汇	1,000	9,680.00	0.01

528	600575	皖江物流	2,600	9,646.00	0.01
529	002092	中泰化学	1,000	9,640.00	0.01
530	600566	济川药业	200	9,638.00	0.01
531	002422	科伦药业	300	9,630.00	0.01
532	601666	平煤股份	2,300	9,614.00	0.01
533	002581	未名医药	900	9,585.00	0.01
534	002041	登海种业	1,400	9,548.00	0.01
535	600642	申能股份	1,900	9,538.00	0.01
536	603660	苏州科达	420	9,513.00	0.01
537	601958	金钼股份	1,500	9,405.00	0.01
538	300346	南大光电	720	9,381.60	0.01
539	603567	珍宝岛	700	9,380.00	0.01
540	600420	现代制药	900	9,360.00	0.01
541	002501	利源精制	1,500	9,300.00	0.01
542	000785	武汉中商	1,200	9,240.00	0.01
543	600640	号百控股	900	9,153.00	0.01
544	600894	广日股份	1,540	9,132.20	0.01
545	300492	山鼎设计	400	9,116.00	0.01
546	002081	金螳螂	900	9,090.00	0.01
547	002424	贵州百灵	800	9,088.00	0.01
548	600723	首商股份	1,300	9,087.00	0.01
549	601677	明泰铝业	900	9,036.00	0.01
550	002880	卫光生物	200	8,992.00	0.01
551	600438	通威股份	1,300	8,970.00	0.01
552	002482	广田集团	1,500	8,955.00	0.01
553	000908	景峰医药	1,900	8,949.00	0.01
554	002127	南极电商	950	8,920.50	0.01
555	002336	*ST 人乐	800	8,912.00	0.01
556	300221	银禧科技	900	8,910.00	0.01
557	002057	中钢天源	1,300	8,905.00	0.01
558	002091	江苏国泰	1,400	8,890.00	0.01
559	000021	深科技	1,300	8,866.00	0.01
560	002242	九阳股份	500	8,845.00	0.01
561	603806	福斯特	400	8,804.00	0.01
562	002534	杭锅股份	1,300	8,801.00	0.01
563	002705	新宝股份	900	8,793.00	0.01
564	000862	银星能源	2,800	8,764.00	0.01
565	601567	三星医疗	1,200	8,736.00	0.01
566	002153	石基信息	300	8,700.00	0.01

567	000719	大地传媒	1,300	8,697.00	0.01
568	600131	岷江水电	1,500	8,685.00	0.01
569	601158	重庆水务	1,600	8,672.00	0.01
570	002287	奇正藏药	300	8,637.00	0.01
571	600173	卧龙地产	2,000	8,600.00	0.01
572	600780	通宝能源	2,300	8,579.00	0.01
573	601599	鹿港文化	2,100	8,547.00	0.01
574	002613	北玻股份	2,700	8,505.00	0.01
575	002030	达安基因	550	8,481.00	0.01
576	600998	九州通	500	8,480.00	0.01
577	600136	当代明诚	700	8,470.00	0.01
578	600312	平高电气	1,500	8,460.00	0.01
579	002305	南国置业	2,800	8,456.00	0.01
580	000970	中科三环	900	8,415.00	0.01
581	002653	海思科	700	8,400.00	0.01
582	300415	伊之密	900	8,388.00	0.01
583	000543	皖能电力	1,900	8,379.00	0.01
584	002599	盛通股份	800	8,344.00	0.01
585	600335	国机汽车	800	8,344.00	0.01
586	601628	中国人寿	370	8,332.40	0.01
587	601999	出版传媒	1,500	8,325.00	0.01
588	000902	新洋丰	900	8,280.00	0.01
589	002383	合众思壮	500	8,275.00	0.01
590	000850	华茂股份	2,200	8,272.00	0.01
591	600037	歌华有线	800	8,256.00	0.01
592	002777	久远银海	300	8,241.00	0.01
593	000883	湖北能源	2,000	8,220.00	0.01
594	000937	冀中能源	2,000	8,220.00	0.01
595	603603	博天环境	400	8,196.00	0.01
596	002102	冠福股份	2,200	8,184.00	0.01
597	002568	百润股份	600	8,106.00	0.01
598	000829	天音控股	1,100	8,063.00	0.01
599	300384	三联虹普	200	8,054.00	0.01
600	300058	蓝色光标	1,400	7,980.00	0.01
601	000869	张裕A	200	7,972.00	0.01
602	601866	中远海发	3,200	7,968.00	0.01
603	002209	达意隆	1,100	7,964.00	0.01
604	002001	新和成	420	7,963.20	0.01
605	600315	上海家化	200	7,926.00	0.01

606	000900	现代投资	1,900	7,904.00	0.01
607	002340	格林美	1,300	7,865.00	0.01
608	600812	华北制药	1,800	7,812.00	0.01
609	600645	中源协和	400	7,704.00	0.01
610	000880	潍柴重机	1,000	7,690.00	0.01
611	000521	美菱电器	2,000	7,680.00	0.01
612	601126	四方股份	1,500	7,635.00	0.01
613	300244	迪安诊断	400	7,604.00	0.01
614	300204	舒泰神	700	7,574.00	0.01
615	002483	润邦股份	1,800	7,560.00	0.01
616	600262	北方股份	400	7,560.00	0.01
617	002517	恺英网络	1,050	7,549.50	0.01
618	300511	雪榕生物	850	7,548.00	0.01
619	002164	宁波东力	1,300	7,514.00	0.01
620	300199	翰宇药业	520	7,425.60	0.01
621	002390	信邦制药	1,000	7,320.00	0.01
622	002555	三七互娱	600	7,290.00	0.01
623	601137	博威合金	900	7,272.00	0.01
624	300274	阳光电源	810	7,265.70	0.01
625	002636	金安国纪	900	7,263.00	0.01
626	000606	*ST 易桥	1,100	7,260.00	0.01
627	300150	世纪瑞尔	1,500	7,245.00	0.01
628	300083	劲胜精密	1,500	7,230.00	0.01
629	000539	粤电力 A	1,700	7,208.00	0.01
630	600612	老凤祥	200	7,188.00	0.01
631	600261	阳光照明	1,900	7,144.00	0.01
632	600569	安阳钢铁	1,800	7,092.00	0.01
633	600081	东风科技	700	7,070.00	0.01
634	300410	正业科技	300	7,053.00	0.01
635	002349	精华制药	1,200	7,008.00	0.01
636	600466	蓝光发展	1,122	6,956.40	0.01
637	002595	豪迈科技	400	6,956.00	0.01
638	300677	英科医疗	300	6,897.00	0.01
639	300448	浩云科技	600	6,870.00	0.01
640	600053	九鼎投资	400	6,868.00	0.01
641	002878	元隆雅图	300	6,774.00	0.01
642	000557	西部创业	2,100	6,762.00	0.01
643	300130	新国都	500	6,745.00	0.01
644	002238	天威视讯	1,000	6,730.00	0.01

645	600893	航发动力	300	6,696.00	0.01
646	002099	海翔药业	1,300	6,669.00	0.01
647	603679	华体科技	300	6,615.00	0.01
648	002217	合力泰	800	6,600.00	0.01
649	000601	韶能股份	1,500	6,585.00	0.01
650	002361	神剑股份	1,600	6,576.00	0.01
651	600176	中国巨石	640	6,547.20	0.01
652	002380	科远股份	500	6,500.00	0.01
653	600308	华泰股份	1,300	6,474.00	0.01
654	600297	广汇汽车	1,100	6,446.00	0.01
655	300376	易事特	1,200	6,444.00	0.01
656	600691	阳煤化工	2,100	6,426.00	0.01
657	600697	欧亚集团	300	6,387.00	0.01
658	300174	元力股份	300	6,354.00	0.01
659	002374	丽鹏股份	1,300	6,331.00	0.01
660	603566	普莱柯	400	6,324.00	0.01
661	601098	中南传媒	500	6,320.00	0.01
662	300108	双龙股份	800	6,272.00	0.01
663	002588	史丹利	1,200	6,216.00	0.01
664	600483	福能股份	900	6,183.00	0.01
665	002048	宁波华翔	500	6,165.00	0.01
666	002270	华明装备	1,050	6,100.50	0.01
667	002405	四维图新	300	6,075.00	0.01
668	002295	精艺股份	900	6,048.00	0.01
669	002431	棕榈股份	900	6,039.00	0.01
670	300043	星辉娱乐	1,500	6,000.00	0.01
671	000919	金陵药业	800	5,992.00	0.01
672	603305	旭升股份	200	5,986.00	0.01
673	601222	林洋能源	1,200	5,976.00	0.01
674	300559	佳发安泰	200	5,946.00	0.01
675	300082	奥克股份	1,200	5,856.00	0.01
676	600075	新疆天业	900	5,850.00	0.01
677	600973	宝胜股份	1,600	5,840.00	0.01
678	600058	五矿发展	700	5,817.00	0.01
679	600971	恒源煤电	810	5,783.40	0.01
680	002688	金河生物	1,100	5,764.00	0.01
681	603612	索通发展	200	5,720.00	0.01
682	002778	高科石化	300	5,706.00	0.01
683	000761	本钢板材	1,410	5,696.40	0.01

684	600366	宁波韵升	932	5,685.20	0.01
685	002686	亿利达	800	5,640.00	0.01
686	002411	必康股份	200	5,550.00	0.00
687	600132	重庆啤酒	200	5,538.00	0.00
688	300396	迪瑞医疗	300	5,520.00	0.00
689	600613	神奇制药	900	5,517.00	0.00
690	601233	桐昆股份	320	5,510.40	0.00
691	002444	巨星科技	500	5,505.00	0.00
692	002206	海利得	1,100	5,489.00	0.00
693	603676	卫信康	300	5,472.00	0.00
694	600676	交运股份	1,100	5,467.00	0.00
695	000150	宜华健康	200	5,420.00	0.00
696	300513	恒泰实达	200	5,398.00	0.00
697	600295	鄂尔多斯	600	5,394.00	0.00
698	603556	海兴电力	295	5,360.15	0.00
699	300248	新开普	869	5,318.28	0.00
700	603380	易德龙	300	5,289.00	0.00
701	000861	海印股份	2,100	5,271.00	0.00
702	300381	溢多利	600	5,226.00	0.00
703	600188	兖州煤业	400	5,216.00	0.00
704	300158	振东制药	1,000	5,120.00	0.00
705	601058	赛轮金宇	2,100	5,103.00	0.00
706	600967	内蒙一机	400	5,096.00	0.00
707	600775	南京熊猫	900	5,094.00	0.00
708	000525	红太阳	300	5,085.00	0.00
709	600155	宝硕股份	700	5,033.00	0.00
710	600665	天地源	1,400	4,970.00	0.00
711	002376	新北洋	300	4,962.00	0.00
712	603869	北部湾旅	300	4,947.00	0.00
713	600586	金晶科技	1,500	4,905.00	0.00
714	002839	张家港行	800	4,872.00	0.00
715	603569	长久物流	334	4,769.52	0.00
716	002119	康强电子	420	4,746.00	0.00
717	603609	禾丰牧业	500	4,720.00	0.00
718	300129	泰胜风能	1,300	4,693.00	0.00
719	600299	安迪苏	400	4,656.00	0.00
720	600444	国机通用	400	4,612.00	0.00
721	600683	京投发展	1,000	4,590.00	0.00
722	000524	岭南控股	500	4,570.00	0.00

723	000617	*ST 济柴	400	4,496.00	0.00
724	002679	福建金森	200	4,482.00	0.00
725	600057	厦门象屿	888	4,431.12	0.00
726	002090	金智科技	300	4,338.00	0.00
727	000811	烟台冰轮	900	4,275.00	0.00
728	002425	凯撒文化	900	4,275.00	0.00
729	601010	文峰股份	1,400	4,242.00	0.00
730	600385	山东金泰	400	4,176.00	0.00
731	000949	新乡化纤	1,400	4,130.00	0.00
732	000756	新华制药	400	4,128.00	0.00
733	600851	海欣股份	500	4,110.00	0.00
734	300196	长海股份	400	4,076.00	0.00
735	002421	达实智能	1,000	4,050.00	0.00
736	300608	思特奇	200	4,050.00	0.00
737	601368	绿城水务	600	4,050.00	0.00
738	600677	航天通信	500	4,035.00	0.00
739	603688	石英股份	300	4,032.00	0.00
740	002465	海格通信	500	4,015.00	0.00
741	600236	桂冠电力	700	3,997.00	0.00
742	600114	东睦股份	408	3,986.16	0.00
743	300358	楚天科技	400	3,964.00	0.00
744	601608	中信重工	1,500	3,900.00	0.00
745	600118	中国卫星	200	3,820.00	0.00
746	601933	永辉超市	500	3,820.00	0.00
747	600617	国新能源	700	3,801.00	0.00
748	002509	天广中茂	1,300	3,783.00	0.00
749	002107	沃华医药	400	3,684.00	0.00
750	603123	翠微股份	600	3,660.00	0.00
751	002791	坚朗五金	300	3,657.00	0.00
752	600166	福田汽车	1,800	3,654.00	0.00
753	600687	刚泰控股	400	3,636.00	0.00
754	002033	丽江旅游	500	3,635.00	0.00
755	000672	上峰水泥	400	3,604.00	0.00
756	603663	三祥新材	200	3,584.00	0.00
757	002323	雅百特	700	3,556.00	0.00
758	600428	中远海特	1,000	3,550.00	0.00
759	002250	联化科技	400	3,528.00	0.00
760	600879	航天电子	500	3,515.00	0.00
761	002665	首航节能	600	3,480.00	0.00

762	002573	清新环境	300	3,465.00	0.00
763	300119	瑞普生物	400	3,420.00	0.00
764	002678	珠江钢琴	400	3,408.00	0.00
765	600917	重庆燃气	500	3,405.00	0.00
766	002533	金杯电工	700	3,395.00	0.00
767	000959	首钢股份	817	3,357.87	0.00
768	002724	海洋王	600	3,354.00	0.00
769	600961	株冶集团	500	3,340.00	0.00
770	000903	云内动力	1,300	3,328.00	0.00
771	600768	宁波富邦	300	3,312.00	0.00
772	300389	艾比森	200	3,306.00	0.00
773	002187	广百股份	400	3,296.00	0.00
774	002150	通润装备	500	3,280.00	0.00
775	600418	江淮汽车	500	3,255.00	0.00
776	600475	华光股份	300	3,207.00	0.00
777	300267	尔康制药	700	3,164.00	0.00
778	002232	启明信息	400	3,124.00	0.00
779	600578	京能电力	1,000	3,120.00	0.00
780	300294	博雅生物	100	3,099.00	0.00
781	002299	圣农发展	200	3,098.00	0.00
782	002829	星网宇达	100	3,059.00	0.00
783	300527	华舟应急	300	3,018.00	0.00
784	300343	联创互联	300	3,000.00	0.00
785	000667	美好置业	1,400	2,982.00	0.00
786	300189	神农基因	800	2,968.00	0.00
787	600996	贵广网络	400	2,968.00	0.00
788	002196	方正电机	400	2,940.00	0.00
789	002851	麦格米特	100	2,928.00	0.00
790	000421	南京公用	600	2,916.00	0.00
791	600250	南纺股份	400	2,908.00	0.00
792	000156	华数传媒	300	2,892.00	0.00
793	000988	华工科技	200	2,890.00	0.00
794	002672	东江环保	220	2,879.80	0.00
795	300237	美晨科技	400	2,872.00	0.00
796	002199	*ST 东晶	300	2,841.00	0.00
797	002372	伟星新材	160	2,830.40	0.00
798	300034	钢研高纳	300	2,808.00	0.00
799	300045	华力创通	300	2,781.00	0.00
800	002641	永高股份	800	2,760.00	0.00

801	002496	辉丰股份	1,000	2,730.00	0.00
802	300395	菲利华	200	2,720.00	0.00
803	600273	嘉化能源	300	2,718.00	0.00
804	300218	安利股份	400	2,716.00	0.00
805	000877	天山股份	400	2,700.00	0.00
806	000779	三毛派神	200	2,694.00	0.00
807	300366	创意信息	300	2,694.00	0.00
808	603208	江山欧派	100	2,689.00	0.00
809	002671	龙泉股份	600	2,676.00	0.00
810	000411	英特集团	200	2,670.00	0.00
811	600615	丰华股份	300	2,601.00	0.00
812	002601	佰利联	200	2,586.00	0.00
813	300296	利亚德	200	2,576.00	0.00
814	000639	西王食品	200	2,566.00	0.00
815	600843	上工申贝	300	2,517.00	0.00
816	002772	众兴菌业	300	2,511.00	0.00
817	603678	火炬电子	100	2,492.00	0.00
818	300197	铁汉生态	450	2,416.50	0.00
819	300042	朗科科技	100	2,394.00	0.00
820	002084	海鸥卫浴	500	2,380.00	0.00
821	000565	渝三峡 A	500	2,375.00	0.00
822	002013	中航机电	300	2,271.00	0.00
823	600864	哈投股份	500	2,250.00	0.00
824	603606	东方电缆	300	2,232.00	0.00
825	000030	富奥股份	300	2,226.00	0.00
826	600589	广东榕泰	500	2,210.00	0.00
827	000591	太阳能	600	2,196.00	0.00
828	002166	莱茵生物	300	2,196.00	0.00
829	002487	大金重工	600	2,196.00	0.00
830	002531	天顺风能	500	2,175.00	0.00
831	000739	普洛药业	300	2,148.00	0.00
832	300184	力源信息	200	2,144.00	0.00
833	300061	康耐特	200	2,140.00	0.00
834	600976	健民集团	100	2,099.00	0.00
835	002171	楚江新材	300	2,034.00	0.00
836	600785	新华百货	100	2,018.00	0.00
837	603012	创力集团	300	2,016.00	0.00
838	002014	永新股份	300	1,995.00	0.00
839	002279	久其软件	200	1,982.00	0.00

840	600386	北巴传媒	500	1,945.00	0.00
841	000656	金科股份	400	1,920.00	0.00
842	601727	上海电气	300	1,902.00	0.00
843	600862	中航高科	300	1,845.00	0.00
844	000686	东北证券	287	1,839.67	0.00
845	300449	汉邦高科	100	1,829.00	0.00
846	600761	安徽合力	200	1,816.00	0.00
847	002663	普邦股份	600	1,782.00	0.00
848	600551	时代出版	200	1,768.00	0.00
849	000404	华意压缩	400	1,732.00	0.00
850	600409	三友化工	200	1,722.00	0.00
851	601018	宁波港	400	1,684.00	0.00
852	000600	建投能源	300	1,671.00	0.00
853	000851	高鸿股份	300	1,614.00	0.00
854	600663	陆家嘴	100	1,579.00	0.00
855	002429	兆驰股份	600	1,488.00	0.00
856	600122	宏图高科	200	1,480.00	0.00
857	000426	兴业矿业	200	1,442.00	0.00
858	002366	台海核电	100	1,426.00	0.00
859	000690	宝新能源	200	1,392.00	0.00
860	000555	神州信息	100	1,328.00	0.00
861	002477	雏鹰农牧	400	1,324.00	0.00
862	002484	江海股份	200	1,308.00	0.00
863	300440	运达科技	200	1,306.00	0.00
864	300127	银河磁体	100	1,299.00	0.00
865	600415	小商品城	300	1,293.00	0.00
866	300323	华灿光电	100	1,292.00	0.00
867	000153	丰原药业	200	1,274.00	0.00
868	002408	齐翔腾达	100	1,228.00	0.00
869	000899	赣能股份	300	1,227.00	0.00
870	603669	灵康药业	100	1,182.00	0.00
871	002684	猛狮科技	100	1,178.00	0.00
872	000592	平潭发展	400	1,136.00	0.00
873	002266	浙富控股	300	1,125.00	0.00
874	601899	紫金矿业	300	1,083.00	0.00
875	300087	荃银高科	100	1,048.00	0.00
876	000906	物产中拓	200	1,028.00	0.00
877	600986	科达股份	100	936.00	0.00
878	601139	深圳燃气	160	888.00	0.00

879	300239	东宝生物	200	846.00	0.00
880	600633	浙数文化	100	834.00	0.00
881	000607	华媒控股	201	826.11	0.00
882	601886	江河集团	100	823.00	0.00
883	600567	山鹰纸业	200	772.00	0.00
884	603993	洛阳钼业	100	629.00	0.00
885	600010	宝钢股份	400	620.00	0.00
886	300307	慈星股份	100	613.00	0.00
887	300032	金龙机电	100	561.00	0.00
888	600331	宏达股份	200	518.00	0.00
889	002556	辉隆股份	100	500.00	0.00
890	300261	雅本化学	100	479.00	0.00
891	000518	四环生物	100	413.00	0.00
892	000979	中弘股份	400	404.00	0.00
893	600252	中恒集团	100	324.00	0.00
894	300303	聚飞光电	100	274.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	5,548,284.00	5.00
2	600519	贵州茅台	4,742,691.80	4.27
3	601166	兴业银行	3,157,136.00	2.84
4	000333	美的集团	2,893,270.41	2.61
5	600887	伊利股份	2,821,285.50	2.54
6	000651	格力电器	2,815,959.00	2.54
7	600016	民生银行	2,787,845.00	2.51
8	000338	潍柴动力	2,350,223.00	2.12
9	600015	华夏银行	2,309,142.00	2.08
10	600000	浦发银行	2,196,349.00	1.98
11	600104	上汽集团	2,162,692.20	1.95
12	600585	海螺水泥	2,142,556.97	1.93
13	600036	招商银行	2,108,710.83	1.90
14	600170	上海建工	2,100,697.00	1.89
15	002304	洋河股份	2,073,646.00	1.87

16	601169	北京银行	1,911,765.78	1.72
17	601328	交通银行	1,907,716.00	1.72
18	000625	长安汽车	1,885,429.00	1.70
19	600383	金地集团	1,883,438.00	1.70
20	601006	大秦铁路	1,875,041.00	1.69

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	2,551,115.50	2.30
2	600519	贵州茅台	2,450,774.90	2.21
3	000333	美的集团	2,131,185.20	1.92
4	601166	兴业银行	2,104,017.20	1.89
5	000651	格力电器	1,795,428.90	1.62
6	600000	浦发银行	1,790,091.60	1.61
7	000338	潍柴动力	1,761,710.30	1.59
8	600887	伊利股份	1,686,828.10	1.52
9	601628	中国人寿	1,616,561.20	1.46
10	000423	东阿阿胶	1,554,821.40	1.40
11	600036	招商银行	1,508,270.20	1.36
12	600104	上汽集团	1,502,481.40	1.35
13	600688	上海石化	1,453,306.94	1.31
14	600585	海螺水泥	1,451,277.80	1.31
15	000402	金融街	1,396,229.40	1.26
16	600066	宇通客车	1,381,815.70	1.24
17	000625	长安汽车	1,330,764.18	1.20
18	601155	新城控股	1,313,233.30	1.18
19	000898	鞍钢股份	1,283,761.50	1.16
20	600820	隧道股份	1,264,459.01	1.14

#### 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	277,282,080.94
卖出股票收入（成交）总额	186,216,879.76

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	6,000,600.00	5.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	11,443,450.00	10.30
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	17,444,050.00	15.71

## 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	60,000	6,000,600.00	5.40
2	112328	16 曲文 01	50,000	4,965,500.00	4.47
3	112041	11 冀东 01	35,000	3,505,950.00	3.16
4	136247	16 华综 01	20,000	1,974,400.00	1.78
5	122486	15 旭辉 01	10,000	997,600.00	0.90

## 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

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 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

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

## 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	34,821.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	444,445.90
5	应收申购款	1,599.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	480,866.85

**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。

## § 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 金 序 量 化 蓝 筹 A	229	434,918.26	96,900,000.00	97.29%	2,696,280.42	2.71%
中 金 金 序 量 化 蓝 筹 C	68	279,856.55	18,000,000.00	94.59%	1,030,245.35	5.41%
合计	297	399,415.91	114,900,000.00	96.86%	3,726,525.77	3.14%

### 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	中金金序 量化蓝筹 A	54,500.00	0.0547%
	中金金序 量化蓝筹 C	1,200.04	0.0063%
	合计	55,700.04	0.0470%

### 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	中金金序量化蓝筹 A	0~10
	中金金序量化蓝筹 C	0

有本开放式基金	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中金金序量化蓝筹 A	0
	中金金序量化蓝筹 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金金序量化蓝筹 A	中金金序量化蓝筹 C
基金合同生效日（2018 年 2 月 6 日）基金份额总额	110,750,932.51	92,298,949.14
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	181,352.75	1,789,751.89
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	11,336,004.84	75,058,455.68
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	99,596,280.42	19,030,245.35

## § 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

本基金本报告期内基金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
中金	2	325,104,723.11	70.19%	237,761.78	70.19%	-
中投证券	2	138,080,317.29	29.81%	100,969.70	29.81%	-

### 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
中金	18,568,601.43	75.52%	1,081,000,000.00	75.41%	-	-
中投证券	6,018,379.20	24.48%	352,500,000.00	24.59%	-	-

### 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	中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同生效公告	《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
2	关于中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金开放申购、赎回（转换、定期定额投资）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
3	中金基金管理有限公司关于中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金开展赎回费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018年2月8日
4	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
5	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
6	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
7	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

		报》及/或公司网站	
8	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
9	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
10	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 2 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日	38,000,000.00	0.00	11,100,000.00	26,900,000.00	22.68%
	2	2018 年 2 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日	40,000,000.00	0.00	0.00	40,000,000.00	33.72%

#### 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。此外，由于存在投资市场波动的影响，可能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。

##### (3) 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。

##### (4) 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。

#### (5) 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，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，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。

#### (6) 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。

#### (7) 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根据相关法律法规由非上市中小企业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。

## 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、中国证监会准予中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金金序量化蓝筹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、报告期内中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告
- 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