

**金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）**  
**2018 年年度报告摘要**  
**2018 年 12 月 31 日**

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年三月二十六日

## §1 重要提示

### 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰量化精选股票（LOF）
场内简称	金鹰量化
基金主代码	162107
交易代码	162107
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 25 日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,918,379.35 份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用多种量化模型方法，精选股票进行投资，力争有效控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金主要采用多种量化模型进行股票的选择。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股构建投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。本基金采用的量化投资策略主要有：（1）多因子选股模型（2）事件驱动模型（3）行业轮动模型（4）评级反转策略</p> <p>本基金投资组合中股票资产占基金资产的 80%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p> <p>当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。</p>
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	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险

	的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
--	------------------------------------

### 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		金鹰基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	曾长兴	陆志俊
	联系电话	020-38898996	95559
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95559
传真		020-83282856	021-62701216

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018 年	2017 年	2016 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-4,469,548.57	-2,814,438.61	833,296.63
本期利润	-4,201,748.80	-2,933,917.85	467,433.98
加权平均基金份额本期利润	-0.2260	-0.1669	0.0263
本期基金份额净值增长率	-29.36%	-17.62%	2.05%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.9019	-0.6603	-0.5059

期末基金资产净值	11,236,155.90	17,022,616.48	17,237,386.11
期末基金份额净值	0.5939	0.8407	1.0205

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、上述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，指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的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、根据《关于准予金鹰中证 500 指数分级证券投资基金变更注册的批复》[证监许可(2016)984 号]，本基金以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会。根据持有人大会决议公告，自金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金份额转换基准日的次日起，即 2016 年 8 月 25 日，《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。上上年度可比期间为 2016 年 8 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日（下同）。

### 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
过去三个月	-7.16%	1.88%	-9.45%	1.31%	2.29%	0.57%
过去六个月	-17.24%	1.61%	-10.62%	1.20%	-6.62%	0.41%
过去一年	-29.36%	1.52%	-19.17%	1.07%	-10.19%	0.45%
自基金合同生效起至今	-40.61%	1.25%	-6.03%	0.80%	-34.58%	0.45%

注：1、本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

#### 3.2.2 自基金转型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

金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016 年 8 月 25 日至 2018 年 12 月 31 日)



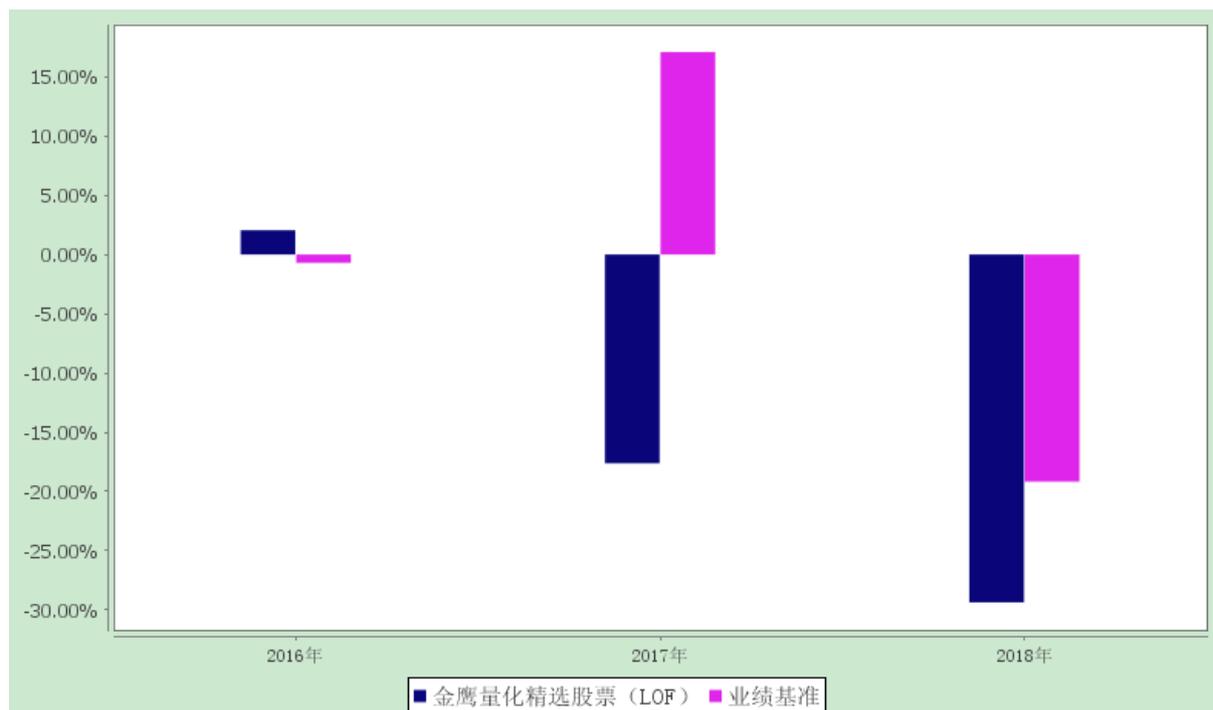
注：

- 1、截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同的约定。
- 2、本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：

- 1、本基金合同自 2016 年 8 月 25 日起生效。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金转型后及截至本报告期末未实施利润分配。

## §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

经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准，金鹰基金管理有限公司于 2002 年 12 月 25 日成立。2011 年 12 月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013 年 7 月子公司——广州金鹰资产管理有限公司成立。

“以人为本、互信协作；创新谋变、挑战超越”是金鹰人的核心价值观。公司坚持价值投资为导向，着力打造高水准的投研团队，努力为投资者创造丰厚回报。截至报告期末，公司共有 45 只公募基金，管理规模 601.09 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助	证券从业	说明

		理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
黄艳芳	基金经理	2016-08-25	-	11	黄艳芳女士，清华大学硕士研究生。历任天相投资顾问有限公司分析师，中航证券资产管理分公司投资主办，量化投资负责人，广州证券股份有限公司资产管理部投资主办。2015年5月加入金鹰基金管理有限公司，任指数及量化投资部数量策略研究员，现任金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）、金鹰科技创新股票型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会颁布的《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无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 公平交易制度和控制方法

为了保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司内控大纲的要求，制定了《金鹰基金管理有限公司公平交易管理规定》并严格执行，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。本基金管理人通过投资交易系统公平交易功能，对不同投资组合进行公平交易事前控制。同时，本基金管理人引入公平交易分析系统，定期或不定期对公司旗下投资组合在一定期间内买卖相同证券的情况进行监控和分析

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

#### 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

2018 年，沪深 300 指数跌幅 25.31%，中证 500 跌幅 33.32%，中证 1000 指数下跌 36.87%，创业板指数跌幅 28.65%，市场全面下跌。产品跌幅 29.36%，略差于大盘指数，略好于小盘指数。

在报告期内，本基金运用量化策略进行投资，主要选择市场相对低估并且偏成长个股，投资组合相对分散。基金在报告期基本保持了 90%~95% 左右仓位运作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，基金单位份额净值为 0.5939 元，本报告期份额净值增长率-29.36%，同期业绩比较基准增长率为-19.17%，较业绩基准跑输。

#### 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 年在经济下行的大背景下，叠加贸易战以及外围市场的冲击，整体较为悲观。2019 年，从目前看，政策托底效应较明显，对市场的风险偏好提升有一定的促进作用。A 股历年来均有春季躁动，1 季度资金面相对宽松，市场相对会活跃一些，全年需要观察宏观经济指标的变化趋势。如果贸易关系能够有超预期的改善，将减少对经济的负面影响，同时缓解投资者脆弱心理，并提升市场的风险偏好。风格方面，预计 1 月份中小创商誉减值风险对市场情绪有负面影响，但是期间将迎来中长期建仓的宝贵机会；价值股估值吸引力有所提升，股息率的提升对场外稳健资金的吸引力也在提升，但是大级别行情需要等待经济数据下行趋势缓解的信号出现。重点关注超跌反弹机会，以及

经过长期调整，估值处于历史低位，且预期基本面有所改善的行业，如传媒、军工、证券等。

产品 2019 年投资风格将发生较大调整，在保持股票型基金高仓位（目标仓位 90-95%）的基础上，整体按照追踪沪深 300 指数并适当增强进行配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金估值核算负责人、基金会计、合规风控部人员及相关投研人员等组成。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，估值委员会集体决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，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及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

#### 4.9 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

报告期内，本基金资产净值发生过连续超过 60 个工作日低于 5000 万元的情形，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。

## §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

2018 年度，基金托管人在金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2018 年度，金鹰基金管理有限公司在金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2018 年度，由金鹰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师 王兵 董晓敏签字出具了众环审字（2019）050104 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日

资 产:	-	-
银行存款	849,549.00	1,571,266.52
结算备付金	75,269.37	84,870.35
存出保证金	5,539.58	12,322.63
交易性金融资产	10,527,437.16	15,766,857.50
其中: 股票投资	10,527,437.16	15,766,857.50
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	90,831.58
应收利息	202.98	356.58
应收股利	-	-
应收申购款	20,977.87	73,182.30
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>11,478,975.96</b>	<b>17,599,687.46</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>2017 年 12 月 31 日</b>
负 债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	24,559.34	175,232.00
应付赎回款	22,560.76	152,323.44
应付管理人报酬	14,602.08	20,777.64

应付托管费	2,433.67	3,462.96
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	33,582.94	64,730.20
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	145,081.27	160,544.74
<b>负债合计</b>	<b>242,820.06</b>	<b>577,070.98</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	18,918,379.35	20,247,733.08
未分配利润	-7,682,223.45	-3,225,116.60
<b>所有者权益合计</b>	<b>11,236,155.90</b>	<b>17,022,616.48</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>11,478,975.96</b>	<b>17,599,687.46</b>

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 18,918,379.35 份。

## 7.2 利润表

会计主体：金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

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 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-3,610,777.90</b>	<b>-2,056,831.51</b>
1.利息收入	9,046.64	22,301.04
其中：存款利息收入	9,046.64	22,301.04
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）	-3,903,893.38	-1,978,442.23
其中：股票投资收益	-3,991,307.83	-2,081,558.01
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	87,414.45	103,115.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	267,799.77	-119,479.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	16,269.07	18,788.92
<b>减：二、费用</b>	<b>590,970.90</b>	<b>877,086.34</b>
1. 管理人报酬	202,358.22	248,455.94
2. 托管费	33,726.39	41,409.33
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	319,106.29	551,381.07
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	35,780.00	35,840.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-4,201,748.80</b>	<b>-2,933,917.85</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-4,201,748.80</b>	<b>-2,933,917.85</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018年1月1日至2018年12月31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）	20,247,733.08	-3,225,116.60	17,022,616.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,201,748.80	-4,201,748.80
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）	-1,329,353.73	-255,358.05	-1,584,711.78
其中：1.基金申购款	14,899,102.11	-3,696,513.55	11,202,588.56
2.基金赎回款	-16,228,455.84	3,441,155.50	-12,787,300.34
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）	18,918,379.35	-7,682,223.45	11,236,155.90
项目	上年度可比期间		
	2017年1月1日至2017年12月31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）	16,890,846.57	346,539.54	17,237,386.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,933,917.85	-2,933,917.85
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）	3,356,886.51	-637,738.29	2,719,148.22

列)			
其中：1.基金申购款	21,392,087.80	-1,803,653.31	19,588,434.49
2.基金赎回款	-18,035,201.29	1,165,915.02	-16,869,286.27
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）	20,247,733.08	-3,225,116.60	17,022,616.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李兆廷，主管会计工作负责人：王亮，会计机构负责人：谢文君

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金(简称"本基金")，经中国证券监督管理委员会（简称"中国证监会"）证监许可[2012]247 号文《关于核准金鹰中证 500 指数分级证券投资基金募集的批复》、基金部函[2012]458 号文《关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金备案确认的函》批准，于 2012 年 6 月 5 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次设立募集规模为 393,471,186.50 份，根据《基金合同》约定，其中场外募集资金及其利息确认金鹰 500 份额 341,051,468.50 份，场内募集资金及其利息按 1: 1 的比例确认金鹰 500A 份额 26,209,859.00 份和金鹰 500B 份额 26,209,859.00 份。

根据《关于准予金鹰中证 500 指数分级证券投资基金变更注册的批复》[证监许可(2016)984 号]，本基金以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会。依据持有人大会决议公告，自金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金份额转换基准日的次日起，即 2016 年 8 月 25 日，《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《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》、2008 年 9 月 18 日《上海、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[2012]85 号《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《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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《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]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券

免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金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。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东旭集团有限公司	基金管理人股东
广州证券股份有限公司	基金管理人股东
广州白云山医药集团股份有限公司	基金管理人股东
广州金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司
金鹰基金管理有限公司	基金管理人
交通银行股份有限公司	基金托管人
美的集团股份有限公司	原基金管理人股东
东亚联丰投资管理有限公司	原基金管理人股东

注：经基金管理人 2016 年第三次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准（证监许可[2017]2135），公司原股东美的集团股份有限公司、东亚联丰投资管理有限公司分别将其持有的本公司 20% 和 11% 股权转让给东旭集团有限公司。公司股东东旭集团有限公司向本公司增资人民币 260,200,000 元。本次股权转让及增资后，公司股权结构变更为：东旭集团有限公司 66.19%，广州证券股份有限公司 24.01%，广州白云山医药集团股份有限公司 9.80%，本公司注册资本由人民币 250,000,000 元增加至人民币 510,200,000 元。公司《公司章程》的有关条款已根据本次股权变更情况进行了相应修改。本公司已完成注册资本及股权变更事项的工商变更登记。上述事项已于 2018 年 1 月 30 日在证监会指定媒体披露。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

1、本基金本报告期内及上年可比期间未通过关联方交易单元进行任何交易，无应支付关联方交易佣金。

2、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	202,358.22	248,455.94
其中：支付销售机构的客户维护费	81,511.87	84,111.31

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	33,726.39	41,409.33

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.8.5 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12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	849,549.00	7,308.92	1,571,266.52	7,102.82

注：本基金本报告期末清算备付金余额 75,269.37 元，本期清算备付金利息收入 1,612.07 元；上年度可比期间清算备付金余额 84,870.35 元，清算备付金利息收入 14,961.14 元。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

##### 7.4.8.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间未投资基金。

#### 7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000693	*ST 华泽	2018-05-02	重大事项	3.31	-	-	1,200.00	30,482.52	3,972.00	重大事项

##### 7.4.9.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.2.1 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。

###### 7.4.9.2.2 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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 公允价值

###### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

###### (2) 以公允价值计量的金融工具

###### (i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

###### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 10,527,437.16 元。无属于第二层级和第三层级的金额。

###### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本报告期内无公允价值所属层级间的重大变动。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	10,527,437.16	91.71
	其中：股票	10,527,437.16	91.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	924,818.37	8.06
8	其他各项资产	26,720.43	0.23
9	合计	11,478,975.96	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	99,012.00	0.88
C	制造业	7,959,022.00	70.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	93,952.00	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	101,750.00	0.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,242,329.16	11.06
J	金融业	144,795.00	1.29
K	房地产业	172,047.00	1.53
L	租赁和商务服务业	190,030.00	1.69
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	524,500.00	4.67
S	综合	-	-
	合计	10,527,437.16	93.69

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过沪港通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300098	高新兴	98,000	662,480.00	5.90
2	300146	汤臣倍健	38,000	645,620.00	5.75
3	300207	欣旺达	67,900	583,261.00	5.19
4	300450	先导智能	19,600	567,224.00	5.05
5	300059	东方财富	45,160	546,436.00	4.86
6	300144	宋城演艺	23,700	505,995.00	4.50
7	300476	胜宏科技	42,400	496,080.00	4.42
8	300122	智飞生物	12,000	465,120.00	4.14
9	300203	聚光科技	14,200	364,230.00	3.24
10	300136	信维通信	16,500	356,565.00	3.17

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	300450	先导智能	1,856,350.39	10.91
2	300296	利亚德	1,843,697.50	10.83
3	300122	智飞生物	1,291,235.00	7.59
4	300182	捷成股份	1,279,485.00	7.52
5	300203	聚光科技	1,274,323.00	7.49
6	300136	信维通信	1,257,259.00	7.39
7	300294	博雅生物	1,255,185.50	7.37

8	300070	碧水源	1,253,651.00	7.36
9	300459	金科文化	1,224,327.00	7.19
10	300207	欣旺达	1,137,977.00	6.69
11	300408	三环集团	1,125,296.00	6.61
12	300146	汤臣倍健	1,047,874.00	6.16
13	300144	宋城演艺	1,042,027.85	6.12
14	300287	飞利信	815,366.00	4.79
15	300308	中际旭创	789,501.00	4.64
16	300498	温氏股份	764,843.60	4.49
17	300059	东方财富	753,738.00	4.43
18	300027	华谊兄弟	749,003.00	4.40
19	300463	迈克生物	714,403.00	4.20
20	300476	胜宏科技	711,145.00	4.18
21	300174	元力股份	707,213.52	4.15
22	300180	华峰超纤	683,572.50	4.02
23	300342	天银机电	681,341.60	4.00
24	603600	永艺股份	678,779.19	3.99
25	300072	三聚环保	678,336.00	3.98
26	300261	雅本化学	676,405.40	3.97
27	002014	永新股份	666,572.53	3.92
28	300601	康泰生物	663,770.00	3.90
29	300098	高新兴	662,498.00	3.89
30	300323	华灿光电	654,896.00	3.85
31	300257	开山股份	636,790.00	3.74
32	300058	蓝色光标	629,872.00	3.70
33	300026	红日药业	604,694.99	3.55
34	300315	掌趣科技	600,490.00	3.53
35	300355	蒙草生态	561,997.00	3.30
36	300038	数知科技	548,824.80	3.22
37	300024	机器人	529,334.40	3.11
38	300383	光环新网	518,081.00	3.04
39	300293	蓝英装备	507,318.79	2.98
40	600035	楚天高速	502,740.00	2.95
41	300265	通光线缆	501,791.00	2.95
42	300316	晶盛机电	492,029.00	2.89
43	002150	通润装备	484,084.00	2.84
44	300237	美晨生态	479,275.00	2.82
45	300001	特锐德	473,172.11	2.78
46	300393	中来股份	470,699.00	2.77
47	300409	道氏技术	464,031.75	2.73
48	300285	国瓷材料	462,460.00	2.72
49	300082	奥克股份	459,926.00	2.70
50	300034	钢研高纳	455,259.00	2.67
51	300418	昆仑万维	445,338.00	2.62

52	300496	中科创达	441,570.00	2.59
53	603518	维格娜丝	437,858.00	2.57
54	600665	天地源	428,444.00	2.52
55	300068	南都电源	426,410.00	2.50
56	300154	瑞凌股份	420,063.00	2.47
57	002238	天威视讯	411,129.00	2.42
58	603223	恒通股份	409,816.20	2.41
59	600012	皖通高速	402,047.45	2.36
60	300145	中金环境	395,710.05	2.32
61	300260	新莱应材	394,628.00	2.32
62	300433	蓝思科技	392,594.86	2.31
63	300413	芒果超媒	392,500.92	2.31
64	600793	宜宾纸业	383,001.00	2.25
65	603166	福达股份	382,420.00	2.25
66	300201	海伦哲	379,606.00	2.23
67	002478	常宝股份	373,827.00	2.20
68	300020	银江股份	372,443.00	2.19
69	300391	康跃科技	367,654.00	2.16
70	300061	康旗股份	366,422.00	2.15
71	002750	龙津药业	363,796.00	2.14
72	300088	长信科技	361,433.00	2.12
73	300376	易事特	356,223.00	2.09
74	300124	汇川技术	354,964.00	2.09
75	300435	中泰股份	352,863.00	2.07
76	002295	精艺股份	347,936.00	2.04
77	600271	航天信息	341,056.00	2.00

## 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	300296	利亚德	1,581,407.00	9.29
2	300450	先导智能	1,273,306.86	7.48
3	300070	碧水源	1,049,178.00	6.16
4	300182	捷成股份	1,038,879.00	6.10
5	300294	博雅生物	1,015,790.00	5.97
6	300203	聚光科技	923,388.00	5.42
7	300136	信维通信	920,109.00	5.41
8	300122	智飞生物	832,095.00	4.89
9	300498	温氏股份	754,667.52	4.43

10	300287	飞利信	712,552.00	4.19
11	300408	三环集团	708,849.00	4.16
12	300180	华峰超纤	690,052.40	4.05
13	300257	开山股份	674,793.00	3.96
14	300261	雅本化学	674,178.34	3.96
15	300459	金科文化	671,588.50	3.95
16	300308	中际旭创	652,692.30	3.83
17	300342	天银机电	652,334.00	3.83
18	002014	永新股份	641,849.00	3.77
19	300293	蓝英装备	638,779.62	3.75
20	600035	楚天高速	634,867.00	3.73
21	300601	康泰生物	633,425.00	3.72
22	603600	永艺股份	630,992.00	3.71
23	300072	三聚环保	622,486.80	3.66
24	300061	康旗股份	612,357.00	3.60
25	300323	华灿光电	600,484.00	3.53
26	300026	红日药业	599,222.00	3.52
27	300058	蓝色光标	597,763.00	3.51
28	300144	宋城演艺	582,454.00	3.42
29	300265	通光线缆	568,987.00	3.34
30	300174	元力股份	559,968.22	3.29
31	300315	掌趣科技	559,796.00	3.29
32	600012	皖通高速	557,415.19	3.27
33	300207	欣旺达	555,841.00	3.27
34	300027	华谊兄弟	547,071.00	3.21
35	300316	晶盛机电	543,581.00	3.19
36	600180	瑞茂通	541,889.00	3.18
37	300024	机器人	539,586.94	3.17
38	300038	数知科技	536,908.00	3.15
39	603518	维格娜丝	521,565.00	3.06
40	300383	光环新网	508,870.00	2.99
41	300200	高盟新材	493,531.00	2.90
42	300393	中来股份	483,464.00	2.84
43	300218	安利股份	481,330.00	2.83
44	300418	昆仑万维	473,503.00	2.78
45	300034	钢研高纳	473,240.00	2.78
46	002150	通润装备	465,197.92	2.73
47	300001	特锐德	457,509.00	2.69
48	300355	蒙草生态	450,931.00	2.65
49	300237	美晨生态	445,982.20	2.62
50	300496	中科创达	439,572.00	2.58
51	300413	芒果超媒	432,085.00	2.54
52	300260	新莱应材	431,988.00	2.54
53	603223	恒通股份	429,590.59	2.52

54	603366	日出东方	428,702.00	2.52
55	300068	南都电源	425,739.00	2.50
56	300082	奥克股份	417,885.20	2.45
57	300281	金明精机	406,096.00	2.39
58	300154	瑞凌股份	402,684.00	2.37
59	600665	天地源	400,615.00	2.35
60	000517	荣安地产	398,997.00	2.34
61	300433	蓝思科技	396,249.00	2.33
62	603166	福达股份	386,119.00	2.27
63	300146	汤臣倍健	381,340.00	2.24
64	002238	天威视讯	381,182.12	2.24
65	600883	博闻科技	376,488.00	2.21
66	300391	康跃科技	375,118.00	2.20
67	300463	迈克生物	374,591.00	2.20
68	000151	中成股份	373,797.00	2.20
69	600743	华远地产	370,708.50	2.18
70	300201	海伦哲	369,966.00	2.17
71	300145	中金环境	365,002.80	2.14
72	002478	常宝股份	364,906.00	2.14
73	300124	汇川技术	361,835.00	2.13
74	300435	中泰股份	358,994.40	2.11
75	300020	银江股份	355,521.00	2.09
76	600683	京投发展	354,826.00	2.08
77	002295	精艺股份	348,133.00	2.05
78	600793	宜宾纸业	344,292.00	2.02

#### 8.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	109,258,537.28
卖出股票的收入（成交）总额	110,774,449.56

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未投资债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期内未投资债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

**8.8 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。

**8.9 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**

本基金本报告期内未投资权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期内未投资股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**8.12 本报告期投资基金情况****8.12.1 投资政策及风险说明**

本基金本报告期内未投资基金。

**8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细**

本基金本报告期内未投资基金。

**8.13 投资组合报告附注**

8.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

8.13.2 本基金报告期末基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**8.13.3 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	5,539.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	202.98
5	应收申购款	20,977.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,720.43

#### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期内未投资可转换债券。

#### 8.13.5 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情况。

#### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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
3,573	5,294.82	0.00	0.00%	18,918,379.35	100.00%

**9.2 期末上市基金前十名持有人**

本基金非上市基金。

**9.3 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	135,049.44	0.71%

**9.4 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
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

**9.5 发起式基金发起资金持有份额情况**

本基金非发起式基金。

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2016年8月25日)基金份额总额	19,288,947.39
本报告期期初基金份额总额	20,247,733.08
本报告期基金总申购份额	14,899,102.11
减：本报告期基金总赎回份额	16,228,455.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	18,918,379.35

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

**11.2 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**

1、经本基金管理人股东会或董事会审议通过，报中国证券监督管理委员会广东监管局备案：

2018 年 1 月 18 日在中国证监会指定媒体披露，聘请李兆廷先生担任公司董事长，凌富华先生不再担任公司董事长。

2018 年 8 月 25 日在中国证监会指定媒体披露，聘请曾长兴先生担任公司督察长，聘请满黎先生担任公司副总经理，李云亮先生不再担任公司督察长，曾长兴先生不再担任公司副总经理。

2018 年 9 月 22 日在中国证监会指定媒体披露，免去陈瀚先生副总经理职务。

自 2018 年 11 月 5 日起免去李兆廷先生公司董事职务，自 2018 年 11 月 16 日起聘请李兆廷先生担任公司董事、董事长，上述事项已在中国证监会指定媒体披露。

2018 年 12 月 5 日在中国证监会指定媒体披露，公司董事长李兆廷先生代行总经理（法定代表人）职务。

2018 年 12 月 22 日在中国证监会指定媒体披露，聘请刘志刚先生担任公司副总经理。

2018 年 12 月 29 日在中国证监会指定媒体披露，免去刘岩先生总经理职务，免去满黎先生副总经理职务。

2、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内没有改变基金投资策略。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 17500 元。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
海通证券	2	63,793,730.98	29.00%	58,247.00	30.85%	-
东兴证券	1	36,073,208.30	16.40%	32,873.91	17.41%	-
国泰君安证券	1	34,442,445.01	15.66%	31,388.05	16.62%	-
湘财证券	1	33,692,785.95	15.31%	23,965.40	12.69%	-
华林证券	1	26,205,925.06	11.91%	18,640.72	9.87%	-
财通证券	1	9,256,441.69	4.21%	8,620.34	4.57%	-
中信证券	1	7,300,404.42	3.32%	6,652.93	3.52%	-
华创证券	2	5,204,170.50	2.37%	4,742.47	2.51%	-
国海证券	1	3,893,177.93	1.77%	3,547.62	1.88%	-
中银国际证券	1	143,172.00	0.07%	130.49	0.07%	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单位作为本基金的专用交易单位。本基金专用交易单位的选择标准如下：

- （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、全面地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。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

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

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

经本基金管理人董事会审议通过，报中国证券监督管理委员会广东监管局备案，并于2019年3月5日在中国证监会指定媒体披露，聘请刘志刚先生担任公司总经理。

金鹰基金管理有限公司

二〇一九年三月二十六日