

# 中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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：2019 年 3 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	72,968,435.83 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	59,860,654.18 份	13,107,781.65 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

## 2.4 信息披露方式

登载基金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>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## § 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 2 月 6 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日	
	中金金序量化蓝筹 A	中金金序量化蓝筹 C
本期已实现收益	-11,634,062.65	-1,513,216.99
本期利润	-14,578,881.47	-1,872,748.88
加权平均基金份额本期利润	-0.1746	-0.1012
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.1692	-0.1334
期末基金资产净值	49,733,564.26	11,359,464.26
期末基金份额净值	0.8308	0.8666

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

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

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

4、本基金合同生效日为 2018 年 2 月 6 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 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

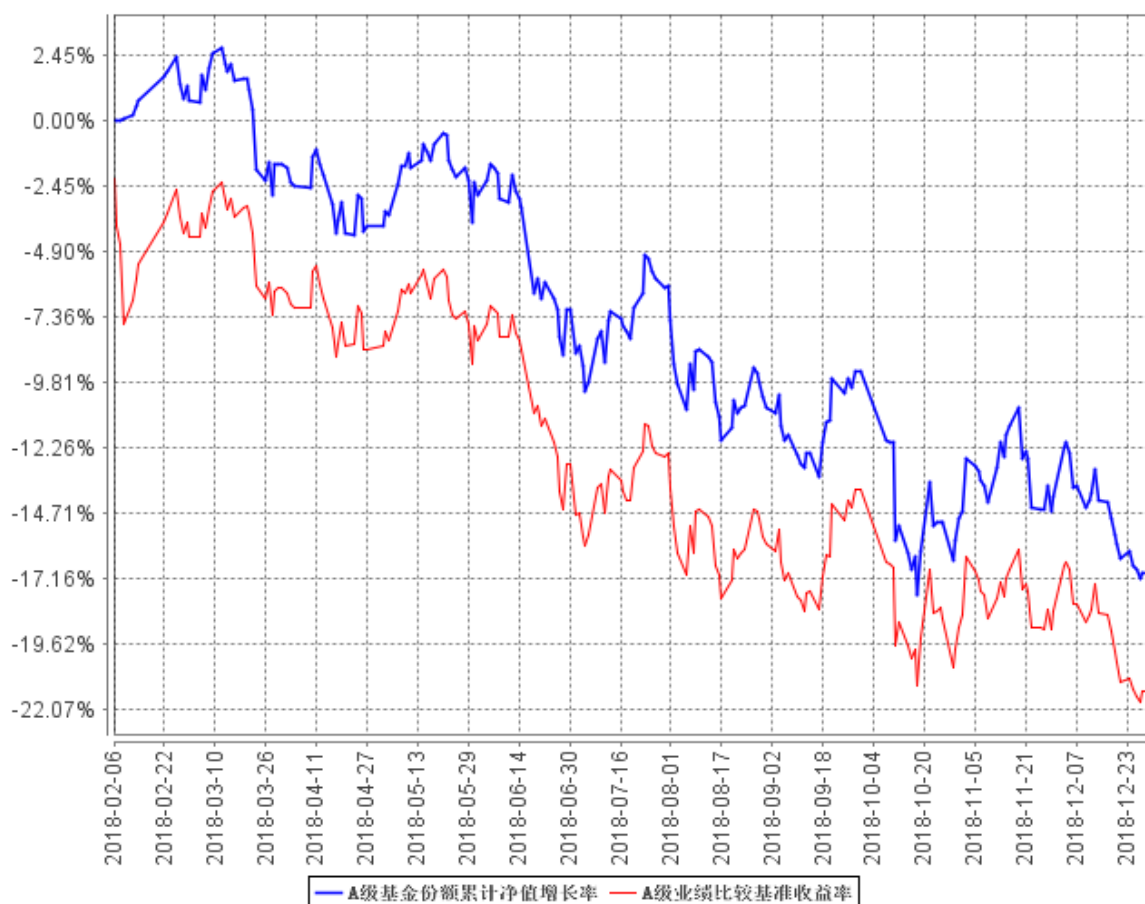
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-8.34%	1.22%	-8.75%	1.23%	0.41%	-0.01%
过去六个月	-10.61%	1.07%	-9.73%	1.12%	-0.88%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-16.92%	0.96%	-21.33%	1.04%	4.41%	-0.08%

中金金序量化蓝筹 C

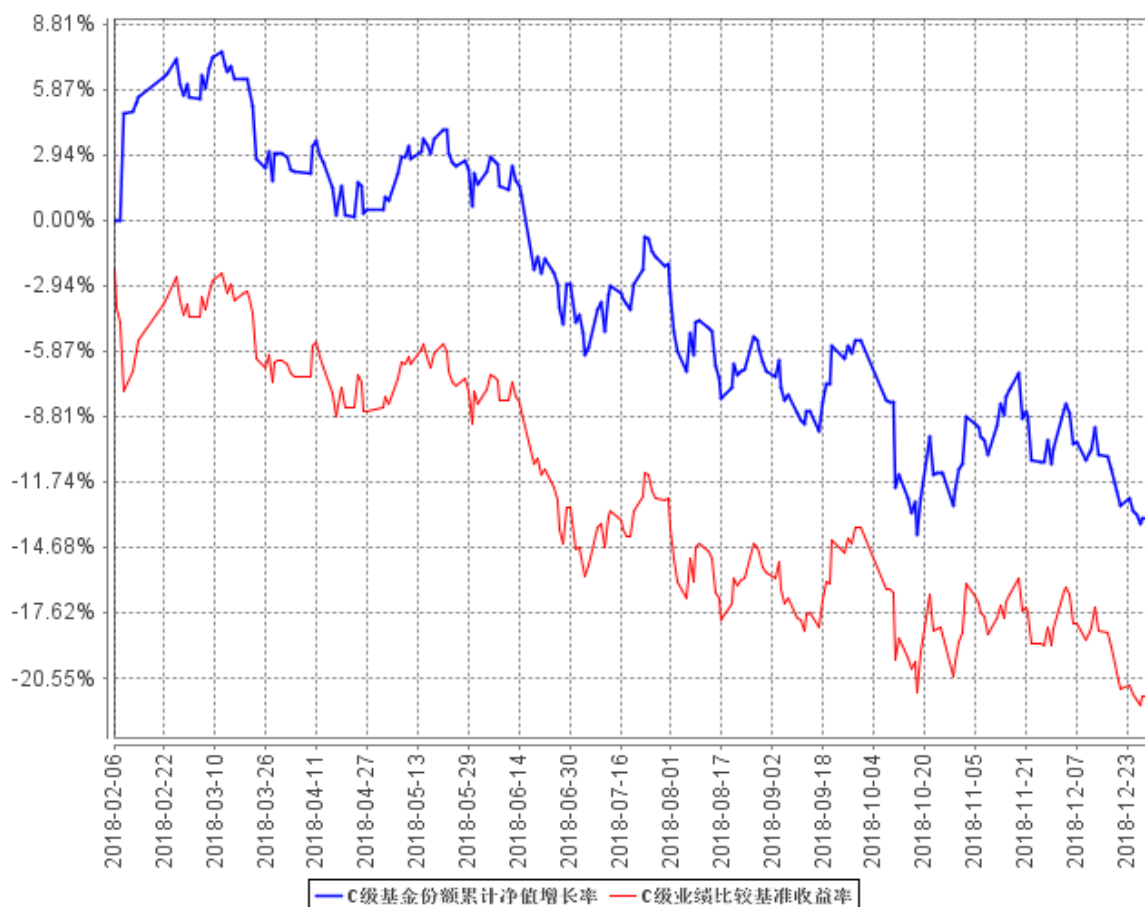
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.43%	1.22%	-8.75%	1.23%	0.32%	-0.01%
过去六个月	-10.81%	1.07%	-9.73%	1.12%	-1.08%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-13.34%	1.01%	-21.33%	1.04%	7.99%	-0.03%

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



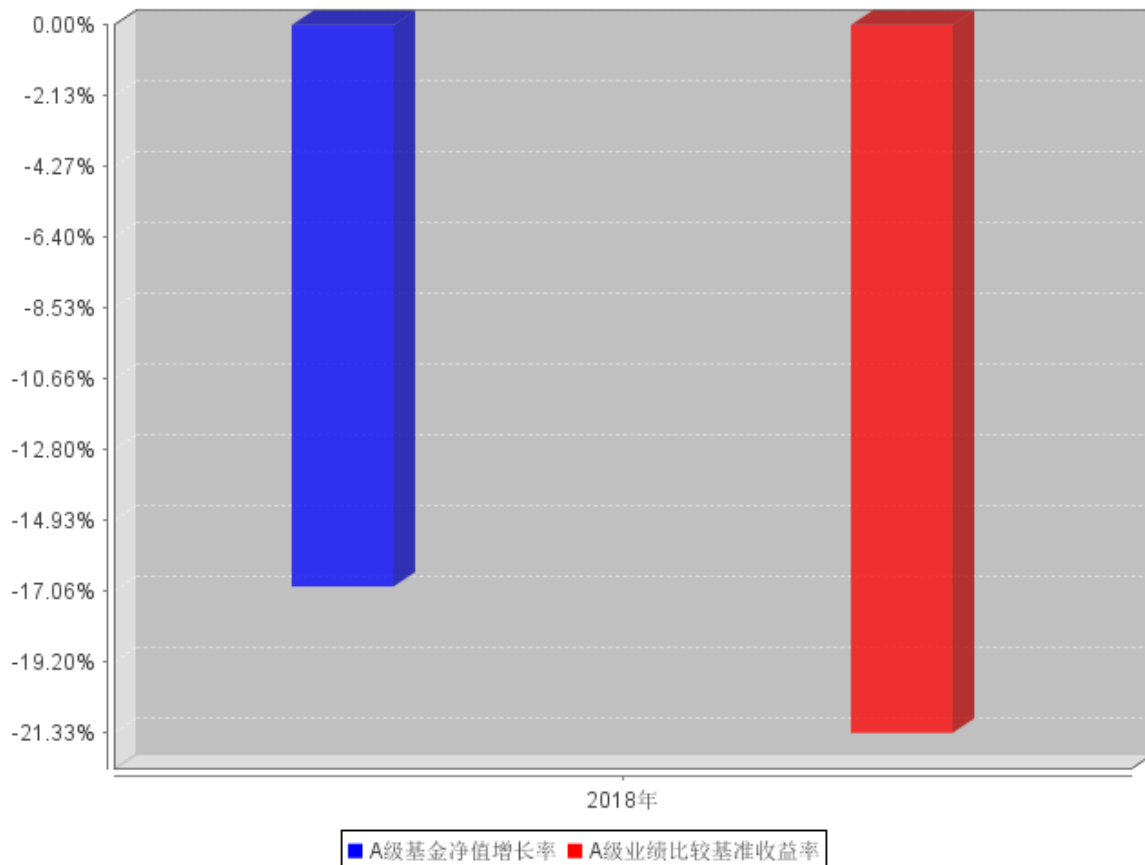
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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，建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

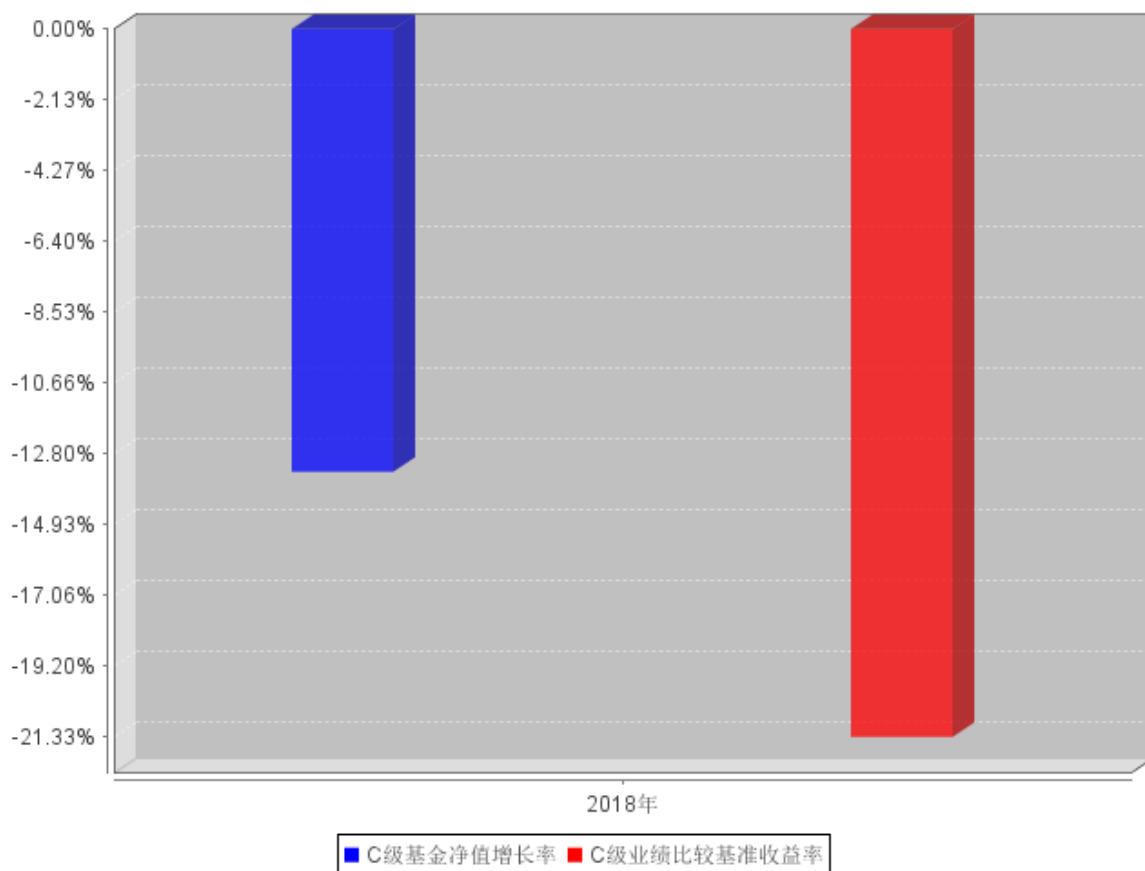
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效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对比图





C级自基金合同生效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对比图



注：本基金合同生效日为 2018 年 2 月 6 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，自成立以来本基金未进行收益分配。

## § 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

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，是首家由单一股东发起设立的基金公司，注册资本 3.5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2018 年 12 月 31 日，公司共管理 27 只开放式基金，证券投资基金管理规模 153.48 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，统计学博士，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。2014 年 11 月加入公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任公司量化公募投资部基金经理。

注：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》、《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

本基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《中金基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施效果评估、信息披露与报告制度等多方面进行了规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，公司建立了科学合理的投资运作体系和规范的投资流程，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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，本基金采用量化的方法进行选股，运作正常。股票池集中在中盘股和大盘股中，同时精选了多只债券进行配置。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 0.8308 元,本报告期基金份额净值增长率为-16.92%;截至本报告期末中金金序量化蓝筹 C 基金份额净值为 0.8666 元,本报告期基金份额净值增长率为-13.34%;同期业绩比较基准收益率为-21.33%。

#### 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 年中国经济的形势较为严峻。第一 A 股上市公司盈利同比增速在 2018 年上半年见顶后开始向下,短期的经济下行压力较大。第二经济结构性调整和升级,在短期对市场造成一定的压力。第三中美贸易摩擦带来国际政治经济环境的不稳定性上升,中国经济发展的外部环境形势不容乐观。2018 年 A 股市场惨淡收官,全年上证 50 指数下跌 19.83%,沪深 300 指数下跌 25.31%,中证 500 指数下跌 33.32%,创业板指下跌 28.65%。展望 2019 年,中国经济增长在国际周期及国内因素共同作用下可能继续下行,尽管 2018 年下半年至今市场预期已经在调低,但是考虑到增长下行风险仍未体现充分,2019 年股票资产仍可能承受较大压力。在 2019 年最初的 1 个多月里,A 股各大指数都有较大幅度的反弹,这主要是因为中美贸易谈判呈现出乐观的预期以及 2018 年的下跌已经使多个指数的估值处于历史低位。这就更加说明了以中美关系为代表的国际政治经济环境是影响中国经济以及 A 股市场的重要因素,2019 年必须密切关注并迅速反应。如果中美谈判取得阶段性成果,那么必须认真分析其对各个行业的影响。而对个股而言,其自身的业绩以及随之而来的估值、成长预期等指标将成为影响其股价在行业中相对表现的重要指标。2019 年风险和机遇共存。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作,强化制度完善及对制度执行情况的监督检查,根据不同的基金特点与发展情况,及时界定新的风险点,评价风险级别,并纳入稽核计划,有效保证了基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。本报告期内,本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下:

1) 本基金管理人以中国证监会《季度监察稽核项目表》为基础,对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查,及定期进行有重点的检查。2) 研究、投资交易环节,本基金管理人对投资对象建立筛选流程、对投资对象池(库)进行日常维护与更新,并对基金的投资比例进行日常监控,对关联交易进行日常维护,定期关注基金持仓流动性风险,并对公平交易执行情况进行检查等。3) 营销与销售方面,本基金管理人对本基金宣传推介材料、销售服务协议的合规性等进行检查,同时加强对基金销售部门的合规培训。

4) 基金运作保障方面, 本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、资金清算业务的检查力度, 保证基金运营安全、准确。5) 法律合规方面, 本基金管理人对公司制度规范、合同协议、产品方案、对外文件等进行合规性审核。6) 信息披露方面, 本基金管理人严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定, 认真做好本基金的信息披露工作, 确保信息披露内容的真实、准确、完整、及时。此外, 本基金管理人对监察稽核工作流程进行了完善和优化, 并按照既定的稽核计划开展内部稽核, 对检查出来的问题及时提出改进意见并督促相关部门有效落实。

报告期内, 本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规, 内部控制和风险防范措施逐步完善, 保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发, 提高监察稽核工作的有效性。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内, 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和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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1901217 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了后附的第 1 页至第 35 页的中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金（以下简称“中金金序量化蓝筹基金”）财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2018 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了中金金序量化蓝筹基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2018 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中金金序量化蓝筹基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无

其他事项	无
其他信息	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中金金序量化蓝筹基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中金金序量化蓝筹基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，中金金序量化蓝筹基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责评估中金金序量化蓝筹基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非中金金序量化蓝筹基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>中金金序量化蓝筹基金管理人中金基金管理有限公司治理层负责监督中金金序量化蓝筹基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合</p>



理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价中金金序量化蓝筹基金管理人中金基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对中金金序量化蓝筹基金管理人中金基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对中金金序量化蓝筹基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致中金金序量化蓝筹基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与中金金序量化蓝筹基金管理人中金基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟

	通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	奚霞	刘珊珊
会计师事务所的地址	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层	
审计报告日期	2019 年 3 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款		272,663.85
结算备付金		411,559.46
存出保证金		20,991.34
交易性金融资产		58,887,635.54
其中：股票投资		48,580,815.54
基金投资		-
债券投资		10,306,820.00
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		1,500,000.00
应收证券清算款		241,078.66
应收利息		293,259.82
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		61,627,188.67
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		47,131.22
应付赎回款		-
应付管理人报酬		47,714.50
应付托管费		11,928.63
应付销售服务费		3,959.34
应付交易费用		237,808.44
应交税费		618.02

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		185,000.00
负债合计		534,160.15
<b>所有者权益：</b>		
实收基金		72,968,435.83
未分配利润		-11,875,407.31
所有者权益合计		61,093,028.52
负债和所有者权益总计		61,627,188.67

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，中金金序量化蓝筹 A 基金份额净值 0.8308 元，基金份额总额 59,860,654.18 份；中金金序量化蓝筹 C 基金份额净值 0.8666 元，基金份额总额 13,107,781.65 份。中金金序量化蓝筹份额总额合计为 72,968,435.83 份。

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。

## 7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-14,105,738.55
1.利息收入		766,875.01
其中：存款利息收入		75,343.20
债券利息收入		423,204.17
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		268,327.64
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-12,713,449.80
其中：股票投资收益		-14,239,432.14
基金投资收益		-
债券投资收益		-60,313.21
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		1,586,295.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-3,304,350.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-

列)		
5.其他收入（损失以“-”号填列）		1,145,186.95
<b>减：二、费用</b>		<b>2,345,891.80</b>
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	863,728.36
2. 托管费	7.4.8.2.2	215,932.09
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	63,076.77
4. 交易费用		1,008,255.84
5. 利息支出		2,262.52
其中：卖出回购金融资产支出		2,262.52
6. 税金及附加		1,061.94
7. 其他费用		191,574.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-16,451,630.35</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-16,451,630.35</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。

### 7.3 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 12 月 31 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 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）	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）	-	-16,451,630.35	-16,451,630.35
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）	-130,081,445.82	4,576,223.04	-125,505,222.78
其中：1. 基金申购款	14,259,449.73	-1,725,072.42	12,534,377.31
2. 基金赎回款	-144,340,895.55	6,301,295.46	-138,039,600.09
五、期末所有者权益（基金净值）	72,968,435.83	-11,875,407.31	61,093,028.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金,托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国国际金融股份有限公司(“中金公司”)、中国中投证券有限责任公司(“中投证券”)、中国银河证券股份有限公司、太平洋证券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,但从本类别基金资产中不计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;不收取认购/申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金金序量化蓝筹混合型证券投资

基金基金合同》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）。

#### **7.4.2 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。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、自 2018 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、自 2018 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

##### **7.4.4.2 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。

#### 7.4.4.3 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。

本基金目前持有的股票投资和债券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。

#### 7.4.4.4 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。



#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)”。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款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。

#### 7.4.4.11 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《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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。

## 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

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(2) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称“营改增”）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称“管理人”）运营资管产品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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

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

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

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

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
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	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构
中金资本运营有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金浦成投资有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金期货有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中国国际金融（香港）有限公司	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。

## 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

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12月31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	41.24%
中投证券	312,260,789.92	39.61%

#### 7.4.8.1.2 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12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
中金公司	19,568,600.43	57.66%
中投证券	11,056,379.20	32.58%

#### 7.4.8.1.3 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12月31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	59.54%
中投证券	698,300,000.00	38.46%

#### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金在本期间没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

#### 7.4.8.1.5 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12月31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	41.24%	-	-
中投证券	228,342.30	39.61%	127,372.60	53.56%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还获得证券研究综合服务。

## 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2月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	当期发生的基金应支付的管理费	863,728.36
其中：支付销售机构的客户维护费	6,231.81	

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。

### 7.4.8.2.2 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12月31日	
	当期发生的基金应支付的托管费	215,932.09

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

日基金托管费=前一日基金资产净值× 0.25% / 当年天数。

### 7.4.8.2.3 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 12 月 31 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	-	60,038.65	60,038.65
合计	-	60,038.65	60,038.65

注：本基金仅针对 C 类基金份额收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日该类基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：C 类基金日基金销售服务费=前一日基金资产净值× 0.40% / 当年天数

### 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

本基金于本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 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	23.3900%	-

#### 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

除基金管理人之外的其他关联方于本期末未持有本基金。

### 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 2018 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入



中国建设银行	272,663.85	55,479.22
--------	------------	-----------

注：1、本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计提。

2、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 12 月 31 日的相关余额为人民币 432,550.80 元，当年产生的利息收入（保证金和备付金利息收入）为人民币 19,863.98 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

金额单位：人民币元

本期 2018 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 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

#### 7.4.8.7 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。

#### 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 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 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
600030	中信证券	2018 年 12 月 25 日	重大事项	16.01	2019 年 1 月 10 日	16.80	14,200	245,723.45	227,342.00	-

000708	大冶特钢	2018 年 12 月 25 日	重大 资产 重组	8.77	2019 年 1 月 3 日	9.10	9,900	92,012.36	86,823.00	-
--------	------	------------------------	----------------	------	-------------------	------	-------	-----------	-----------	---

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

### 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、以公允价值计量的资产和负债

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

持续的公允价值 计量资产	本期末（错误!未找到引用源。12月31日）			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产				
- 股票投资	48,580,815.54	48,266,650.54	314,165.00	-
- 债券投资	10,306,820.00	-	10,306,820.00	-
- 基金投资	-	-	-	-
- 资产支持证券投资	-	-	-	-
持续以公允价值计量的 资产总额	58,887,635.54	48,266,650.54	10,620,985.00	-

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次，账面价值为人民币 314,165.00 元。于 2018 年 12 月 31 日，本基金上述持续以

公允价值计量的资产和负债金融工具的三个层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(1) 第二层次及第三层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、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一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(2) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

2、其他金融工具的公允价值（年末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 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	48,580,815.54	78.83
	其中：股票	48,580,815.54	78.83
3	固定收益投资	10,306,820.00	16.72
	其中：债券	10,306,820.00	16.72
6	买入返售金融资产	1,500,000.00	2.43
7	银行存款和结算备付金合计	684,223.31	1.11
8	其他各项资产	555,329.82	0.90
9	合计	61,627,188.67	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	144,589.00	0.24
B	采矿业	1,766,242.14	2.89
C	制造业	22,342,631.33	36.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,827,053.60	2.99
E	建筑业	713,953.86	1.17
F	批发和零售业	1,989,473.17	3.26
G	交通运输、仓储和邮政业	1,749,719.00	2.86
H	住宿和餐饮业	30,092.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,011,130.01	1.66
J	金融业	11,922,985.48	19.52
K	房地产业	3,413,182.41	5.59
L	租赁和商务服务业	735,118.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	89,647.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	282,960.20	0.46
P	教育	11,736.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	473,165.34	0.77
S	综合	77,137.00	0.13

合计	48,580,815.54	79.52
----	---------------	-------

## 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	38,300	2,148,630.00	3.52
2	000651	格力电器	46,510	1,659,941.90	2.72
3	601166	兴业银行	86,580	1,293,505.20	2.12
4	600016	民生银行	204,332	1,170,822.36	1.92
5	600585	海螺水泥	31,793	930,899.04	1.52
6	601328	交通银行	144,200	834,918.00	1.37
7	600028	中国石化	148,500	749,925.00	1.23
8	600031	三一重工	86,330	719,992.20	1.18
9	000069	华侨城 A	109,120	692,912.00	1.13
10	601818	光大银行	183,340	678,358.00	1.11

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

## 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	7,564,103.91	12.38
2	601166	兴业银行	5,202,145.00	8.52
3	600519	贵州茅台	5,157,668.80	8.44
4	600887	伊利股份	4,702,379.50	7.70
5	000651	格力电器	4,668,690.00	7.64
6	000338	潍柴动力	4,023,226.00	6.59
7	600016	民生银行	3,887,919.00	6.36
8	002304	洋河股份	3,714,708.00	6.08
9	600104	上汽集团	3,595,867.20	5.89
10	600585	海螺水泥	3,442,520.06	5.63

11	000858	五 粮 液	3,280,533.00	5.37
12	600031	三一重工	3,258,489.00	5.33
13	601006	大秦铁路	3,174,441.00	5.20
14	000333	美的集团	3,101,181.41	5.08
15	600000	浦发银行	2,986,265.00	4.89
16	600015	华夏银行	2,953,264.00	4.83
17	601818	光大银行	2,950,802.00	4.83
18	601009	南京银行	2,890,958.00	4.73
19	601328	交通银行	2,883,345.00	4.72
20	600383	金地集团	2,631,374.00	4.31
21	000069	华侨城 A	2,565,977.00	4.20
22	000898	鞍钢股份	2,545,847.00	4.17
23	601169	北京银行	2,484,285.78	4.07
24	000568	泸州老窖	2,478,186.32	4.06
25	601601	中国太保	2,437,975.00	3.99
26	600919	江苏银行	2,418,289.00	3.96
27	000625	长安汽车	2,376,592.00	3.89
28	600170	上海建工	2,367,863.00	3.88
29	601888	中国国旅	2,271,002.00	3.72
30	600089	特变电工	2,256,154.00	3.69
31	600741	华域汽车	2,239,922.24	3.67
32	600036	招商银行	2,210,681.83	3.62
33	600028	中国石化	2,208,714.00	3.62
34	600688	上海石化	2,197,710.00	3.60
35	000423	东阿阿胶	2,119,645.96	3.47
36	600820	隧道股份	2,066,914.00	3.38
37	600153	建发股份	2,006,010.00	3.28
38	600674	川投能源	1,980,455.08	3.24
39	600376	首开股份	1,977,857.00	3.24
40	000157	中联重科	1,938,163.00	3.17
41	002024	苏宁易购	1,896,097.00	3.10
42	601607	上海医药	1,849,585.00	3.03
43	601668	中国建筑	1,834,438.00	3.00
44	000002	万科 A	1,829,724.90	2.99
45	601988	中国银行	1,794,400.00	2.94
46	600019	宝钢股份	1,789,599.61	2.93

47	600208	新湖中宝	1,780,292.80	2.91
48	000100	TCL 集团	1,756,721.00	2.88
49	002508	老板电器	1,744,704.00	2.86
50	600219	南山铝业	1,737,060.00	2.84
51	000425	徐工机械	1,732,453.00	2.84
52	600660	福耀玻璃	1,732,302.00	2.84
53	600066	宇通客车	1,731,007.32	2.83
54	600352	浙江龙盛	1,673,918.00	2.74
55	002294	信立泰	1,657,849.31	2.71
56	601628	中国人寿	1,645,311.18	2.69
57	002385	大北农	1,640,543.00	2.69
58	000402	金融街	1,631,184.00	2.67
59	601997	贵阳银行	1,629,916.00	2.67
60	600690	青岛海尔	1,627,434.00	2.66
61	601088	中国神华	1,610,073.00	2.64
62	600886	国投电力	1,589,870.00	2.60
63	601229	上海银行	1,574,219.00	2.58
64	600795	国电电力	1,561,709.00	2.56
65	601288	农业银行	1,516,889.00	2.48
66	000826	启迪桑德	1,468,313.00	2.40
67	002572	索菲亚	1,468,304.52	2.40
68	000895	双汇发展	1,463,451.00	2.40
69	002146	荣盛发展	1,450,473.00	2.37
70	601898	中煤能源	1,410,732.08	2.31
71	000627	天茂集团	1,401,996.00	2.29
72	600177	雅戈尔	1,392,030.00	2.28
73	000876	新希望	1,385,022.00	2.27
74	600705	中航资本	1,384,543.00	2.27
75	601211	国泰君安	1,349,876.00	2.21
76	601966	玲珑轮胎	1,343,153.40	2.20
77	601155	新城控股	1,343,011.00	2.20
78	600340	华夏幸福	1,331,554.00	2.18
79	600369	西南证券	1,331,233.00	2.18
80	600030	中信证券	1,328,614.00	2.17
81	002142	宁波银行	1,325,166.00	2.17
82	600309	万华化学	1,318,043.62	2.16

83	600606	绿地控股	1,309,218.00	2.14
84	600276	恒瑞医药	1,304,354.00	2.14
85	600048	保利地产	1,299,427.00	2.13
86	601225	陕西煤业	1,294,289.00	2.12
87	600535	天士力	1,278,183.00	2.09
88	000623	吉林敖东	1,272,223.00	2.08
89	001979	招商蛇口	1,249,866.00	2.05

#### 8.4.2 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	600519	贵州茅台	4,906,072.90	8.03
2	601318	中国平安	4,853,101.75	7.94
3	000338	潍柴动力	4,015,858.30	6.57
4	600887	伊利股份	3,821,658.78	6.26
5	601166	兴业银行	3,698,956.60	6.05
6	002304	洋河股份	3,085,421.90	5.05
7	600104	上汽集团	2,961,590.00	4.85
8	000333	美的集团	2,917,445.60	4.78
9	600585	海螺水泥	2,532,713.80	4.15
10	000651	格力电器	2,513,608.90	4.11
11	000858	五粮液	2,497,412.76	4.09
12	600031	三一重工	2,488,910.70	4.07
13	600016	民生银行	2,419,653.90	3.96
14	601006	大秦铁路	2,408,477.70	3.94
15	600000	浦发银行	2,294,531.60	3.76
16	600015	华夏银行	2,282,485.60	3.74
17	600688	上海石化	2,209,343.16	3.62
18	601009	南京银行	2,175,695.20	3.56
19	601818	光大银行	2,165,170.20	3.54
20	601888	中国国旅	2,113,067.00	3.46
21	600036	招商银行	2,108,666.40	3.45
22	000898	鞍钢股份	2,057,838.50	3.37
23	000625	长安汽车	2,039,272.18	3.34
24	600170	上海建工	2,002,044.00	3.28
25	600919	江苏银行	1,977,971.86	3.24



26	600820	隧道股份	1,933,768.11	3.17
27	601328	交通银行	1,929,537.00	3.16
28	600089	特变电工	1,923,576.89	3.15
29	002024	苏宁易购	1,871,718.00	3.06
30	000423	东阿阿胶	1,868,304.60	3.06
31	601601	中国太保	1,828,610.18	2.99
32	600741	华域汽车	1,786,405.19	2.92
33	600674	川投能源	1,771,358.22	2.90
34	600376	首开股份	1,766,543.96	2.89
35	600383	金地集团	1,763,577.32	2.89
36	000568	泸州老窖	1,762,248.00	2.88
37	601668	中国建筑	1,760,000.20	2.88
38	000002	万科 A	1,695,950.56	2.78
39	000069	华侨城 A	1,665,266.60	2.73
40	601169	北京银行	1,664,566.16	2.72
41	601988	中国银行	1,645,091.00	2.69
42	601628	中国人寿	1,633,823.20	2.67
43	600066	宇通客车	1,624,403.70	2.66
44	600660	福耀玻璃	1,596,924.00	2.61
45	600208	新湖中宝	1,566,595.00	2.56
46	000402	金融街	1,538,100.40	2.52
47	002385	大北农	1,508,729.58	2.47
48	601607	上海医药	1,502,632.00	2.46
49	000100	TCL 集团	1,490,955.00	2.44
50	000425	徐工机械	1,472,198.00	2.41
51	002508	老板电器	1,471,088.17	2.41
52	601288	农业银行	1,461,084.00	2.39
53	002294	信立泰	1,453,866.81	2.38
54	000157	中联重科	1,429,768.00	2.34
55	601155	新城控股	1,416,573.30	2.32
56	601088	中国神华	1,411,053.10	2.31
57	000627	天茂集团	1,401,118.81	2.29
58	600153	建发股份	1,392,680.40	2.28
59	600219	南山铝业	1,387,608.00	2.27
60	600690	青岛海尔	1,369,652.80	2.24
61	000895	双汇发展	1,324,742.50	2.17
62	601898	中煤能源	1,320,306.30	2.16
63	600535	天士力	1,295,949.20	2.12

64	600886	国投电力	1,288,473.00	2.11
65	000963	华东医药	1,267,981.40	2.08
66	600177	雅戈尔	1,267,779.66	2.08
67	601966	玲珑轮胎	1,264,774.80	2.07
68	600028	中国石化	1,258,606.00	2.06
69	601997	贵阳银行	1,257,947.00	2.06
70	001979	招商蛇口	1,244,555.90	2.04
71	600309	万华化学	1,244,539.48	2.04
72	600705	中航资本	1,237,366.00	2.03

### 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

买入股票成本（成交）总额	427,553,988.51
卖出股票收入（成交）总额	361,386,536.53

### 8.5 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（%）
3	金融债券	3,314,520.00	5.43
	其中：政策性金融债	3,314,520.00	5.43
4	企业债券	6,992,300.00	11.45
10	合计	10,306,820.00	16.87

### 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

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	112328	16 曲文 01	50,000	4,995,500.00	8.18
2	018005	国开 1701	33,000	3,314,520.00	5.43
3	136247	16 华综 01	20,000	1,996,800.00	3.27

### 8.7 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。

## 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投资。

## 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

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 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

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 8.10.2 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。

## 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

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除兴业银行（601166）、民生银行（600016）、交通银行（601328）、光大银行（601818）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018年5月4日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监银罚决字（2018）1号），对兴业银行重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；非真实转让信贷资产；无授信额度或超授信额度办理同业业务；内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返

售业务项下基础资产不合规；同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；债券卖出回购业务违规出表；个人理财资金违规投资；提供日期倒签的材料；部分非现场监管统计数据与事实不符；个别董事未经任职资格核准即履职；变相批量转让个人贷款；向四证不全的房地产项目提供融资等违法违规事实进行处罚。

2018 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监银罚决字（2018）12 号），对交通银行不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权；未尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产；档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞；理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；违规向土地储备机构提供融资；信贷资金违规承接本行表外理财资产；理财资金违规投资项目资本金；部分理财产品信息披露不合规；现场检查配合不力等违法违规事实进行处罚。同日，（银保监银罚决字（2018）13 号）对交通银行并购贷款占并购交易价款比例不合规；并购贷款尽职调查和风险评估不到位等违法违规事实进行处罚。

2018 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监银罚决字（2018）5 号），对民生银行贷款业务严重违反审慎经营规则等违法违规事实进行处罚。同日，（银保监银罚决字（2018）8 号）对民生银行内控管理严重违反审慎经营规则；同业投资违规接受担保；同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；本行理财产品之间风险隔离不到位；个人理财资金违规投资；票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；为非保本理财产品提供保本承诺等违法违规事实进行处罚。

2018 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监银罚决字（2018）10 号），对光大银行内控管理严重违反审慎经营规则；以误导方式违规销售理财产品；以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品；违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务；同业投资违规接受担保；通过同业投资或贷款虚增存款规模等违法违规事实进行处罚。

本基金采用量化选股的策略，基金特点是大盘蓝筹，因此较多仓位集中于沪深 300 成分股内，而银行业在沪深 300 指数中占很大权重，所以不可避免的选入多家银行，同时我们认为兴业银行（601166）、民生银行（600016）、交通银行（601328）、光大银行（601818）所受处罚并未对其投资价值产生实质性的负面影响，所以依然按照模型选股的结果而没有进行专门的减仓操作。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	20,991.34
2	应收证券清算款	241,078.66
4	应收利息	293,259.82
9	合计	555,329.82

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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

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	189	316,723.04	57,206,525.44	95.57%	2,654,128.74	4.43%
中金金序量化蓝筹 C	56	234,067.53	12,700,000.00	96.89%	407,781.65	3.11%
合计	245	297,830.35	69,906,525.44	95.80%	3,061,910.39	4.20%

### 9.2 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	52,299.92	0.0874%
	中金金序量化蓝筹 C	1,200.04	0.0092%
	合计	53,499.96	0.0733%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金金序量化蓝筹 A	0~10
	中金金序量化蓝筹 C	0
	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

## § 10 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	12,431,537.21	1,827,912.52
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	63,321,815.54	81,019,080.01
本报告期末基金份额总额	59,860,654.18	13,107,781.65

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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

本报告期内，基金管理人中金基金原董事长林寿康先生离职，2018 年 10 月 18 日起总经理孙菁女士代为履行中金基金董事长（法定代表人）职务。2019 年 1 月 18 日起，楚钢先生担任中金基金董事长（法定代表人）。

2018 年 9 月 3 日起，汤琰女士担任基金管理人中金基金副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已按照相关规定向监管部门报告并履行信息披露程序。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，基金管理人与股东中金公司就侵犯商标权及不正当竞争事项，联合向南京市中级人民法院起诉，截至报告期末本案尚无判决。

本报告期内无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 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。本基金本报告期内应支付审计费用 65,000.00 元。

### 11.6 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。



## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	325,104,723.11	41.24%	237,761.78	41.24%	-
中投证券	2	312,260,789.92	39.61%	228,342.30	39.61%	-
西藏东财	2	129,726,910.92	16.45%	94,854.46	16.45%	-
银河证券	2	21,308,664.49	2.70%	15,581.38	2.70%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

### 11.7.2 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
中金公司	19,568,600.43	57.66%	1,081,000,000.00	59.54%	-	-
中投证券	11,056,379.20	32.58%	698,300,000.00	38.46%	-	-
西藏东财	3,313,080.00	9.76%	36,400,000.00	2.00%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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 9 日至 2018 年 12 月 31 日	40,000,000.00	-	17,533,000.00	22,467,000.00	30.79%

#### 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。

## 12.2 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。

中金基金管理有限公司

2019 年 3 月 28 日