

# 中金衡优灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 6 月 8 日起至 2018 年 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	72
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.....	73
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.....	73

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 .....	73
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 .....	73
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	73
8.12 投资组合报告附注 .....	74
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>76</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
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 .....	76
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>77</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>78</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	78
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 .....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
11.4 基金投资策略的改变 .....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
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 .....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	79
11.8 其他重大事件 .....	79
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>82</b>
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 .....	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	83
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>84</b>
13.1 备查文件目录 .....	84
13.2 存放地点 .....	84
13.3 查阅方式 .....	84

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金衡优灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中金衡优	
基金主代码	005489	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年6月8日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	89,860,953.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中金衡优 A	中金衡优 C
下属分级基金的交易代码:	005489	005490
报告期末下属分级基金的份额总额	69,756,630.54 份	20,104,323.15 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	<p>本基金主要采用专业的投资理念和严谨的分析方法，以系统化的量化模型和深入的基本面研究为基础，基于对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场政策分析等宏观基本面研究，结合对各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等因素的评估，严格遵守各项风险控制指标，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例，通过对各类资产的灵活配置，在有效控制风险的基础上，获取稳定的投资收益。</p> <p>基金管理人从多个维度对各类资产的投资机会进行深入分析，考量的维度主要包括以下因素：（1）宏观经济因素。包括国际资本市场宏观经济数据的变化、国内 CPI 和 PPI 的变化、货币供给与需求水平的变化、利率水平的变化以及市场对以上因素的预期等；（2）政策预期因素。包括财政和货币政策以及与证券市场密切相关的其他各种政策出台对市场的影响及市场对这些因素的预期等；（3）市场行业因素。包括行业的盈利周期和环境的变化、行业内主要上市企业的盈利变化以及市场对行业变化的预测等；（4）量化指标因素。包括统计市场截面数据时间序列的变化特征、市场指数风险收益特征时间序列的变化特征、市场震荡趋势强度的变化特征、分形理论出发的市场模式的变化、金融物理学角度出发的金融泡沫统计指标的变化、市场微观结构出发的分析师一致预期分歧的变化和趋势等。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中债综合财富(总值)指数收益率×70%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李虹	王永民
	联系电话	010-63211122	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-868-1166	95566
传真		010-66159121	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100004	100818
法定代表人		孙菁（代）	陈四清

### 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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 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 6 月 8 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日	
	中金衡优 A	中金衡优 C
本期已实现收益	1,297,298.78	333,709.72
本期利润	1,717,579.89	279,609.51
加权平均基金份额本期利润	0.0193	0.0080
本期加权平均净值利润率	1.91%	0.80%
本期基金份额净值增长率	1.76%	1.20%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	
期末可供分配利润	1,130,829.59	214,074.76
期末可供分配基金份额利润	0.0162	0.0106
期末基金资产净值	70,981,294.48	20,345,406.90
期末基金份额净值	1.0176	1.0120
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	
基金份额累计净值增长率	1.76%	1.20%

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 6 月 8 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

中金衡优 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	1.06%	0.23%	-1.95%	0.48%	3.01%	-0.25%
过去六个月	1.60%	0.17%	-1.43%	0.44%	3.03%	-0.27%
自基金合同生效起至今	1.76%	0.16%	-3.45%	0.44%	5.21%	-0.28%

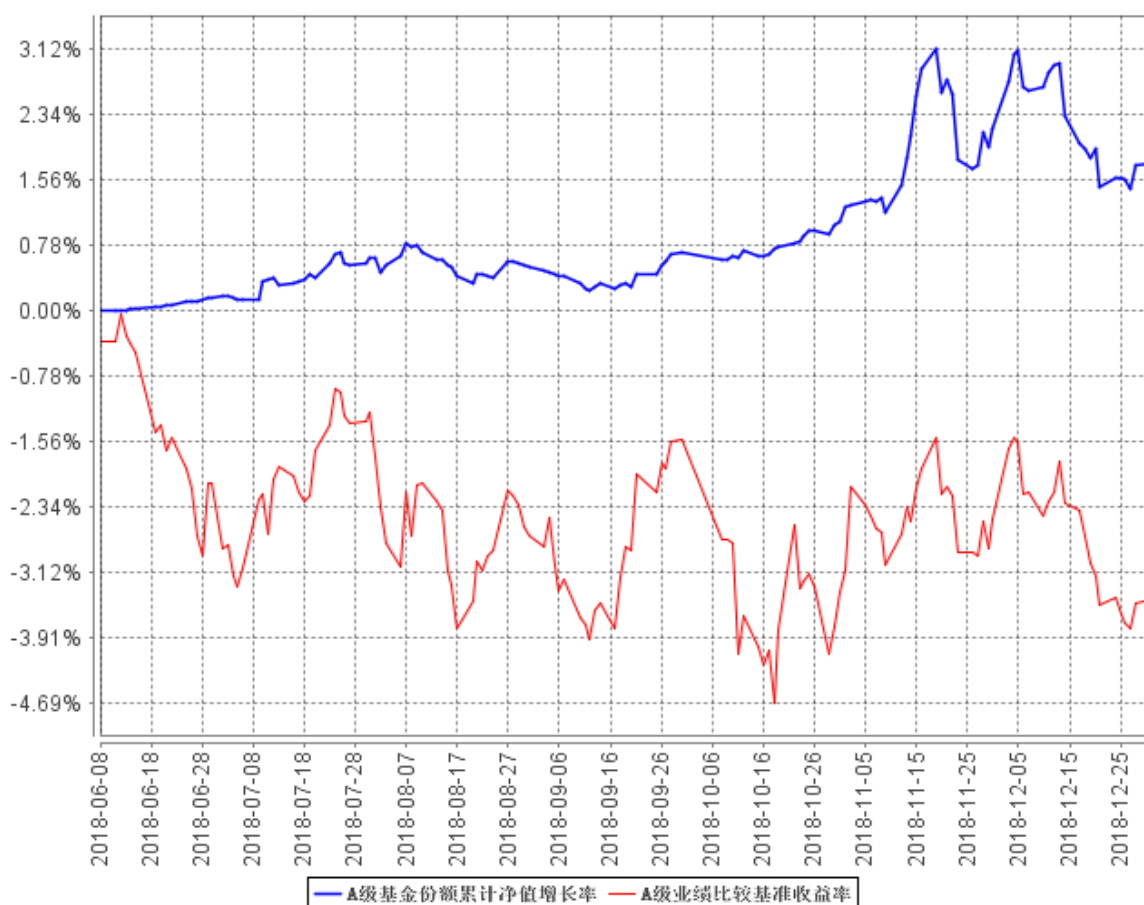
中金衡优 C

阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	0.91%	0.23%	-1.95%	0.48%	2.86%	-0.25%
过去六个月	1.07%	0.17%	-1.43%	0.44%	2.50%	-0.27%
自基金合同生效起至今	1.20%	0.16%	-3.45%	0.44%	4.65%	-0.28%

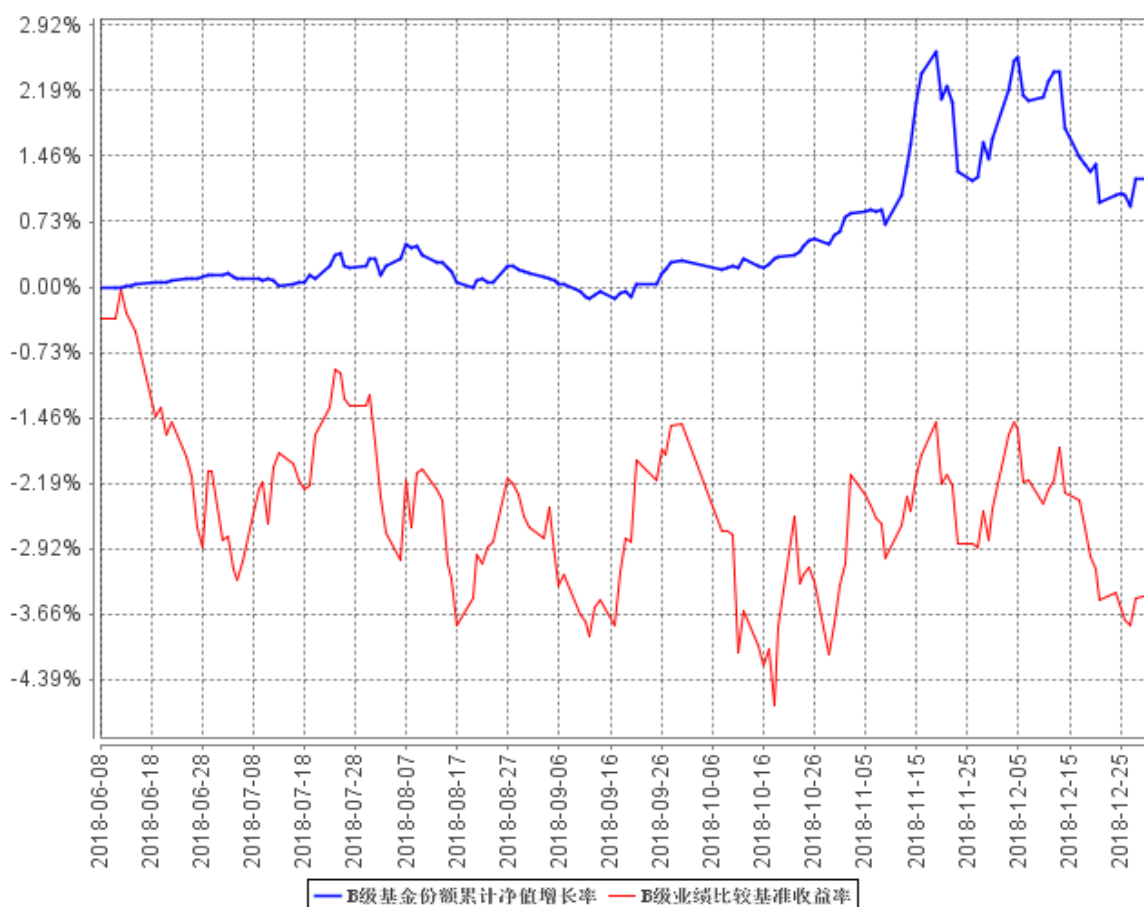
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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





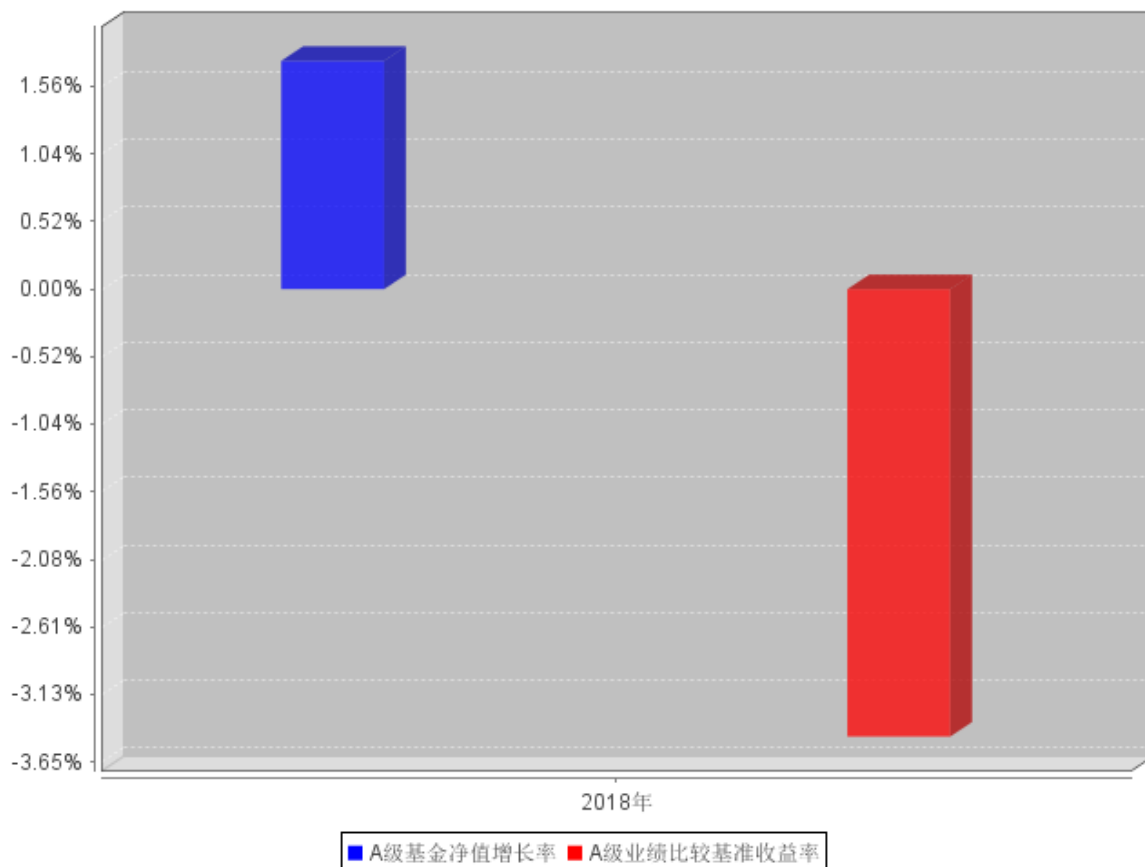
B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



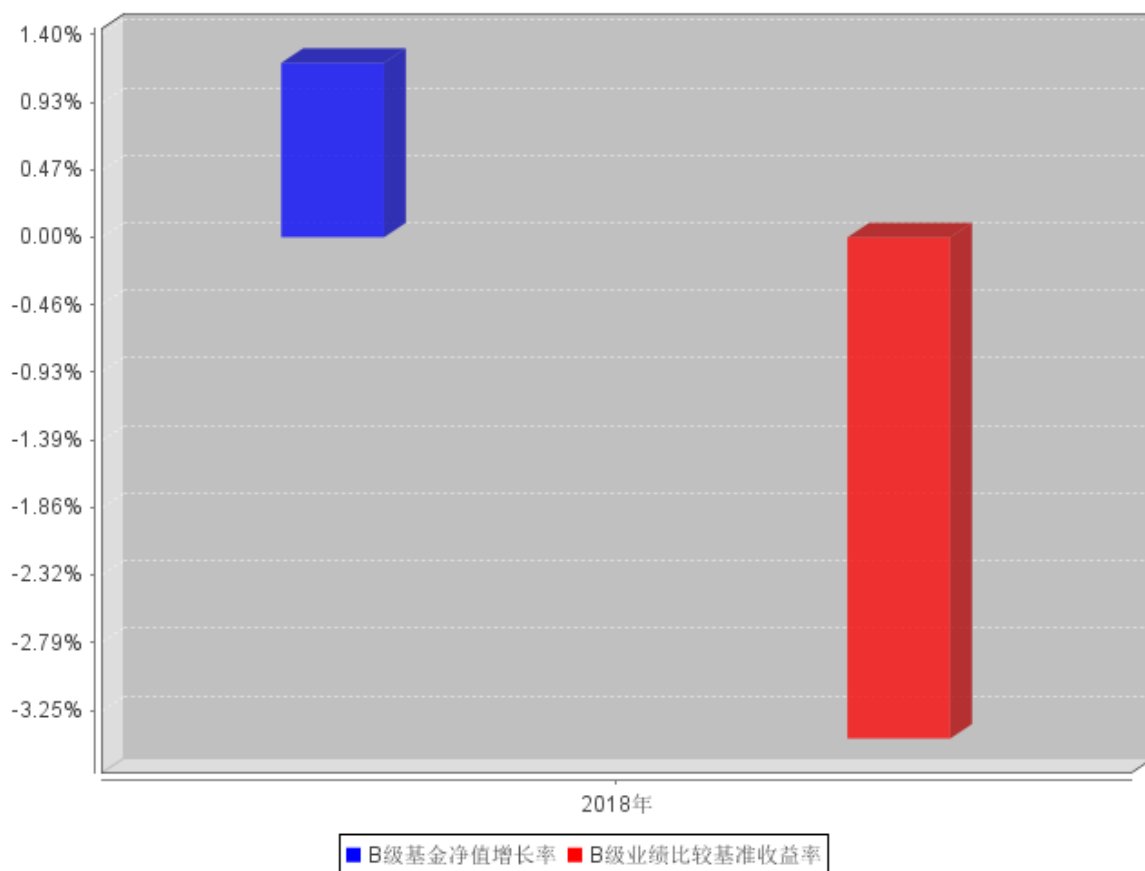
注：本基金的基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

### 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



**B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 6 月 8 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 6 月 8 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。
陈诗昆	本基金基金经理	2018 年 12 月 21 日	-	7 年	陈诗昆女士，金融学硕士。历任嘉实基金管理有限公司财富管理部职员；鹏扬基金管理有限公司交易员、固定收益研究员、投资经理。2018 年 10 月加入公司，现任公司组合投资部基金经理。
丁杨	本基金基金经理助理	2018 年 8 月 6 日	-	4 年	丁杨先生，北京大学经济学硕士。历任蚂

	理				蚁金融服务集团资产配置部分分析师；现任中金基金管理有限公司组合投资部经理。
--	---	--	--	--	---------------------------------------

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

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

3、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

报告期内本基金采用资产配置策略运作，通过中长期战略资产配置与短期战术资产配置相结合的方法，动态配置股票、债券资产，同时运用股票和债券战术配置模型，在股票资产内实现行业、风格的轮动，在债券资产内部调整组合的信用持仓、期限结构等。

报告期内本基金根据战略资产配置上经济处于减速期的判断，低配权益资产，高配债券资产，整体取得了较好的效果，期间收益和最大回撤显著领先于同期基准水平。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金衡优 A 基金份额净值为 1.0176 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.76%；截至本报告期末中金衡优 C 基金份额净值为 1.0120 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.20%；同期业绩比较基准收益率为-3.45%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在 1-3 个月的短期操作窗口，本基金管理人对 A 股和国内债券保持中性观点。股票方面，中美贸易摩擦缓和预期叠加联储鸽派信号，全球风险偏好有所回升。A 股价值、海外、情绪等因素全面向好，处于外部力量推动下的价值修复阶段。但是考虑到市场乐观预期面临重新修正且基本面拐点尚未到来，在战术上对 A 股短期维持中性观点。债券方面，债券和商品走势出现了持续背离，社融增速的拐点可能提前到来，M1 增速的拐点正在临近，会对债券资产带来一定的负面冲击。

## 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

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。

#### **4.8 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**

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



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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 1901218 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	中金衡优灵活配置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 33 页的中金衡优灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“中金衡优基金”）财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2018 年 6 月 8 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，公允反映了中金衡优基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2018 年 6 月 8 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，我们独立于中金衡优基金，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>中金衡优基金管理人中金基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括中金衡优基金 2018 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</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>中金衡优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，中金衡优基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责评估中金衡优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，除非中金衡优基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>中金衡优基金管理人中金基金管理有限公司治理层负责监督中金衡优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。</p> <p>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：</p> <p>(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</p>

	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(3)评价中金衡优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。</p> <p>(4)对中金衡优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，就可能导致对中金衡优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衡优基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>我们与中金衡优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。</p>	
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：中金衡优灵活配置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	7.4.7.1	128,013.01
结算备付金		871,877.08
存出保证金		26,941.80
交易性金融资产	7.4.7.2	88,012,229.69
其中：股票投资		23,744,429.69
基金投资		-
债券投资		64,267,800.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,300,000.00
应收证券清算款		488,333.14
应收利息	7.4.7.5	1,477,259.26
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		92,304,653.98
<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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		575,098.22
应付赎回款		15.23
应付管理人报酬		124,732.79
应付托管费		20,788.81
应付销售服务费		6,942.28
应付交易费用	7.4.7.7	64,114.95
应交税费		1,260.32

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	185,000.00
负债合计		977,952.60
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	89,860,953.69
未分配利润	7.4.7.10	1,465,747.69
所有者权益合计		91,326,701.38
负债和所有者权益总计		92,304,653.98

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，中金衡优 A 基金份额净值 1.0176 元，基金份额总额 69,756,630.54 份；中金衡优 C 基金份额净值 1.0120 元，基金份额总额 20,104,323.15 份。中金衡优份额总额合计为 89,860,953.69 份。

2、本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

## 7.2 利润表

会计主体：中金衡优灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 8 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 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		3,895,051.58
1.利息收入		2,966,610.05
其中：存款利息收入	7.4.7.11	700,138.50
债券利息收入		2,217,585.79
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		48,885.76
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		333,771.90
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-934,147.06
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	1,256,548.54
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	11,370.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	366,180.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	228,488.73
<b>减：二、费用</b>		1,897,862.18
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,054,161.50
2. 托管费	7.4.10.2.2	175,693.54
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	77,802.04
4. 交易费用	7.4.7.18	152,290.50
5. 利息支出		234,831.95
其中：卖出回购金融资产支出		234,831.95
6. 税金及附加		4,021.31
7. 其他费用	7.4.7.19	199,061.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,997,189.40
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,997,189.40

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 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：中金衡优灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 8 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 6 月 8 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）	225,191,112.89	-	225,191,112.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,997,189.40	1,997,189.40
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）	-135,330,159.20	-531,441.71	-135,861,600.91
其中：1.基金申购款	74,880,631.18	606,114.87	75,486,746.05
2.基金赎回款	-210,210,790.38	-1,137,556.58	-211,348,346.96
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	89,860,953.69	1,465,747.69	91,326,701.38

金净值)			
------	--	--	--

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 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 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 孙菁	_____ 张纳	_____ 白娜
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

中金衡优灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2017 年 11 月 9 日证监许可 [2017] 2022 号《关于准予中金衡优灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《中金衡优灵活配置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，托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国银行、上海挖财金融信息服务有限公司、中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）、中国中投证券有限责任公司（以下简称“中投证券”）及包商银行等共同销售，募集期为 2018 年 4 月 18 日起至 2018 年 6 月 5 日。经向中国证监会备案，《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 6 月 8 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 225,191,112.89 份（含利息转份额 61978.74 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《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购 / 申购时，收取认购 / 申购费用，但从本类别基金资产中不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取认购 / 申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金衡优灵活配置混合型证券投资



基金基金合同》和《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、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、银行存款、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 6 月 8 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

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表是本基金首份财务报表，实际编制期间为自 2018 年 6 月 8 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止。

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

#### **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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	128,013.01
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：	128,013.01

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,023,200.53	23,744,429.69	-1,278,770.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	11,910,058.26	11,942,800.00
	银行间市场	50,712,790.00	52,325,000.00

	合计	62,622,848.26	64,267,800.00	1,644,951.74
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	87,646,048.79	88,012,229.69	366,180.90

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,300,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,300,000.00	-

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	857.00
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	431.53
应收债券利息	1,476,624.66
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-667.24
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	13.31
合计	1,477,259.26

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。



#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	60,676.06
银行间市场应付交易费用	3,438.89
合计	64,114.95

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	185,000.00
合计	185,000.00

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金衡优 A		
项目	本期 2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	101,040,333.79	101,040,333.79
本期申购	51,883,491.26	51,883,491.26
本期赎回(以“-”号填列)	-83,167,194.51	-83,167,194.51
- 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	69,756,630.54	69,756,630.54

金额单位：人民币元

中金衡优 C		
项目	本期 2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日	124,150,779.10	124,150,779.10
本期申购	22,997,139.92	22,997,139.92
本期赎回（以“-”号填列）	-127,043,595.87	-127,043,595.87
- 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	20,104,323.15	20,104,323.15

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金衡优 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	1,297,298.78	420,281.11	1,717,579.89
本期基金份额交易产生的变动数	-166,469.19	-326,446.76	-492,915.95
其中：基金申购款	301,884.47	45,788.96	347,673.43
基金赎回款	-468,353.66	-372,235.72	-840,589.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,130,829.59	93,834.35	1,224,663.94

单位：人民币元

中金衡优 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	333,709.72	-54,100.21	279,609.51
本期基金份额交易产生的变动数	-119,634.96	81,109.20	-38,525.76
其中：基金申购款	60,688.55	197,752.89	258,441.44
基金赎回款	-180,323.51	-116,643.69	-296,967.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	214,074.76	27,008.99	241,083.75

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	43,902.67
定期存款利息收入	642,872.22
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	13,199.91
其他	163.70
合计	700,138.50

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日
卖出股票成交总额	48,261,808.74
减：卖出股票成本总额	49,195,955.80
买卖股票差价收入	-934,147.06

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31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	1,256,548.54
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	1,256,548.54

##### 7.4.7.13.2 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6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	201,039,310.21
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	196,060,821.23
减：应收利息总额	3,721,940.44
买卖债券差价收入	1,256,548.54

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无申购差价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 衍生工具收益****7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	11,370.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,370.42

注：本基金合同生效日为2018年6月8日，无上年度可比期间数据。

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日
1.交易性金融资产	366,180.90
——股票投资	-1,278,770.84
——债券投资	1,644,951.74
——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 的预估增值税	-
合计	366,180.90

注：本基金合同生效日为2018年6月8日，无上年度可比期间数据。

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日
基金赎回费收入	223,984.91
其他	4,503.82
合计	228,488.73

注：本基金合同生效日为2018年6月8日，无上年度可比期间数据。

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日
交易所市场交易费用	149,765.50
银行间市场交易费用	2,525.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	152,290.50

注：本基金合同生效日为2018年6月8日，无上年度可比期间数据。

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日
审计费用	35,000.00
信息披露费	150,000.00
其他	400.00
汇划手续费	10,561.34
帐户维护费	3,100.00
合计	199,061.34

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 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。

**7.4.8.2 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。

### 7.4.9 关联方关系

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
中国银行	基金托管人、基金销售机构
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、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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月8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
中投证券	122,480,965.07	100.00%

注：本基金合同生效日为2018年6月8日，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月8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
中投证券	282,343,344.73	100.00%

注：本基金合同生效日为2018年6月8日，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月8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
中投证券	1,825,000,000.00	100.00%

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 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6月8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
中投证券	89,567.69	100.00%	60,676.06	100.00%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险金后的净额列示。

2、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服务信息。

3、本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月8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
其中：支付销售机构的客户维护费	345,401.39

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

2、注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 6 月 8 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	175,693.54

注：1、支付基金托管人中国银行的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。其计算公式为：日托管费=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 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.2.3 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 6 月 8 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		
	中金衡优 A	中金衡优 C	合计
中金基金	-	50,674.46	50,674.46
中国银行	-	15,478.62	15,478.62
中金公司	-	4,210.91	4,210.91
合计	-	70,363.99	70,363.99

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，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日销售服务费=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 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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 6 月 8 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
中国银行	128,013.01	48,406.49

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

2、本基金通过“中国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 898,818.88 元，本期间产生的利息收入为人民币 13,363.61 元。

3、本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金期末不存在因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 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
600030	中信证券	2018 年 12 月 25 日	重大资产重组	16.01	2019 年 1 月 10 日	17.15	2,800	49,222.00	44,828.00	-
600270	外运发展	2018 年 12 月 13 日	退市	20.99	-	-	500	10,655.47	10,495.00	-
002183	怡亚通	2018 年 12 月 25 日	控制权变更	5.01	2019 年 1 月 2 日	4.96	1,300	6,913.39	6,513.00	-

000987	越秀金控	2018 年 12 月 25 日	重大 资产 重组	7.97	2019 年 1 月 10 日	8.77	200	1,589.00	1,594.00	-
--------	------	------------------------	----------------	------	-----------------------	------	-----	----------	----------	---

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 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中作为抵押的债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期风险和收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。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在合理水平，保障业务稳健运行。

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，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。

#### 7.4.13.2.1 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。

#### 7.4.13.2.2 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。

#### 7.4.13.2.3 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。

#### 7.4.13.2.4 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12月31日
AAA	-
AAA 以下	4,912,000.00
未评级	-
合计	4,912,000.00

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。

#### 7.4.13.2.5 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。

#### 7.4.13.2.6 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。

### 7.4.13.3 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。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，针对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性风险预警及危机的处理、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性风险指标进行监控。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成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。首先，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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，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%，在行业 and 个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	128,013.01	-	-	-	128,013.01
结算备付金	871,877.08	-	-	-	871,877.08
存出保证金	26,941.80	-	-	-	26,941.80
交易性金融资产- 股票投资	-	-	-	23,744,429.69	23,744,429.69
交易性金融资产- 债券投资	11,942,800.00	-	52,325,000.00	-	64,267,800.00
买入返售金融资产	1,300,000.00	-	-	-	1,300,000.00
应收证券清算款	-	-	-	488,333.14	488,333.14
应收利息	-	-	-	1,477,259.26	1,477,259.26
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	14,269,631.89	-	52,325,000.00	25,710,022.09	92,304,653.98
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	575,098.22	575,098.22
应付赎回款	-	-	-	15.23	15.23
应付管理人报酬	-	-	-	124,732.79	124,732.79
应付托管费	-	-	-	20,788.81	20,788.81
应付交易费用	-	-	-	64,114.95	64,114.95
应付销售服务费	-	-	-	6,942.28	6,942.28
应交税费	-	-	-	1,260.32	1,260.32
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	185,000.00	185,000.00
负债总计	-	-	-	977,952.60	977,952.60
利率敏感度缺口	14,269,631.89	-	52,325,000.00	24,732,069.49	91,326,701.38

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。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 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	999,874.92 -
	市场利率上升 25 个基点	-999,874.92

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31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	23,744,429.69	26.00
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	64,267,800.00	70.37
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	88,012,229.69	96.37

#### 7.4.13.4.3.2 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。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

#### 7.4.14 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

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 23,680,999.69 元，属于第二层次的余额为 64,331,230.00 元，无属于第三层次的余额(本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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。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。

(c)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(本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日,无上年度可比期间数据)。

(d)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	23,744,429.69	25.72
	其中：股票	23,744,429.69	25.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	64,267,800.00	69.63
	其中：债券	64,267,800.00	69.63
	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	1,300,000.00	1.41
	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	999,890.09	1.08
8	其他各项资产	1,992,534.20	2.16
9	合计	92,304,653.98	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	353,435.00	0.39
B	采矿业	1,956,125.00	2.14
C	制造业	9,259,929.09	10.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	369,259.00	0.40
E	建筑业	1,359,955.00	1.49
F	批发和零售业	1,173,342.00	1.28
G	交通运输、仓储和邮政业	413,217.00	0.45
H	住宿和餐饮业	17,028.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,218,055.68	1.33
J	金融业	3,230,007.00	3.54
K	房地产业	2,230,477.00	2.44
L	租赁和商务服务业	148,422.00	0.16



M	科学研究和技术服务业	1,447,902.76	1.59
N	水利、环境和公共设施管理业	81,646.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,840.00	0.01
Q	卫生和社会工作	143,678.10	0.16
R	文化、体育和娱乐业	288,925.06	0.32
S	综合	47,186.00	0.05
	合计	23,744,429.69	26.00

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

### 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	000002	万科 A	41,000	976,620.00	1.07
2	603018	中设集团	44,838	781,077.96	0.86
3	601318	中国平安	13,900	779,790.00	0.85
4	600048	保利地产	65,500	772,245.00	0.85
5	600085	同仁堂	26,800	737,000.00	0.81
6	002422	科伦药业	32,700	675,255.00	0.74
7	600998	九州通	45,600	665,760.00	0.73
8	600276	恒瑞医药	10,900	574,975.00	0.63
9	600547	山东黄金	19,000	574,750.00	0.63
10	002675	东诚药业	70,000	550,900.00	0.60
11	601899	紫金矿业	164,100	548,094.00	0.60
12	603707	健友股份	28,200	529,314.00	0.58
13	601069	西部黄金	34,600	514,502.00	0.56
14	601601	中国太保	15,900	452,037.00	0.49
15	601336	新华保险	10,700	451,968.00	0.49
16	000333	美的集团	10,500	387,030.00	0.42
17	601186	中国铁建	32,300	351,101.00	0.38
18	600039	四川路桥	103,100	338,168.00	0.37
19	600068	葛洲坝	52,700	333,064.00	0.36
20	300284	苏交科	31,740	329,143.80	0.36
21	603357	设计总院	16,300	325,185.00	0.36
22	600519	贵州茅台	400	236,004.00	0.26

23	002415	海康威视	7,900	203,504.00	0.22
24	600036	招商银行	8,000	201,600.00	0.22
25	300498	温氏股份	7,700	201,586.00	0.22
26	600570	恒生电子	3,300	171,534.00	0.19
27	601668	中国建筑	24,400	139,080.00	0.15
28	300059	东方财富	9,900	119,790.00	0.13
29	000651	格力电器	2,800	99,932.00	0.11
30	002696	百洋股份	10,600	94,976.00	0.10
31	601166	兴业银行	6,300	94,122.00	0.10
32	600887	伊利股份	3,700	84,656.00	0.09
33	600309	万华化学	3,000	83,970.00	0.09
34	601288	农业银行	23,100	83,160.00	0.09
35	000963	华东医药	3,100	82,026.00	0.09
36	601328	交通银行	13,900	80,481.00	0.09
37	000062	深圳华强	4,800	79,968.00	0.09
38	601021	春秋航空	2,300	73,163.00	0.08
39	600016	民生银行	12,600	72,198.00	0.08
40	300418	昆仑万维	5,400	69,444.00	0.08
41	601398	工商银行	13,000	68,770.00	0.08
42	300298	三诺生物	6,420	68,052.00	0.07
43	300003	乐普医疗	3,200	66,592.00	0.07
44	600900	长江电力	4,000	63,520.00	0.07
45	300146	汤臣倍健	3,491	59,312.09	0.06
46	000538	云南白药	800	59,168.00	0.06
47	001979	招商蛇口	3,400	58,990.00	0.06
48	600886	国投电力	7,300	58,765.00	0.06
49	600104	上汽集团	2,200	58,674.00	0.06
50	600000	浦发银行	5,900	57,820.00	0.06
51	300015	爱尔眼科	2,147	56,466.10	0.06
52	000858	五粮液	1,100	55,968.00	0.06
53	300347	泰格医药	1,300	55,575.00	0.06
54	300142	沃森生物	2,900	55,390.00	0.06
55	601766	中国中车	5,900	53,218.00	0.06
56	000418	小天鹅 A	1,200	51,900.00	0.06
57	300253	卫宁健康	4,100	51,086.00	0.06
58	300122	智飞生物	1,300	50,388.00	0.06
59	300124	汇川技术	2,500	50,350.00	0.06
60	601169	北京银行	8,900	49,929.00	0.05
61	300408	三环集团	2,900	49,068.00	0.05

62	000001	平安银行	5,200	48,776.00	0.05
63	300136	信维通信	2,200	47,542.00	0.05
64	300144	宋城演艺	2,100	44,835.00	0.05
65	600030	中信证券	2,800	44,828.00	0.05
66	600837	海通证券	4,900	43,120.00	0.05
67	300383	光环新网	3,400	43,078.00	0.05
68	601155	新城控股	1,800	42,642.00	0.05
69	600373	中文传媒	3,200	41,632.00	0.05
70	601211	国泰君安	2,700	41,364.00	0.05
71	300024	机器人	3,100	40,982.00	0.04
72	300450	先导智能	1,400	40,516.00	0.04
73	600028	中国石化	7,600	38,380.00	0.04
74	002304	洋河股份	400	37,888.00	0.04
75	000725	京东方 A	14,200	37,346.00	0.04
76	601229	上海银行	3,300	36,927.00	0.04
77	300750	宁德时代	500	36,900.00	0.04
78	600729	重庆百货	1,300	36,790.00	0.04
79	601888	中国国旅	600	36,120.00	0.04
80	601857	中国石油	4,900	35,329.00	0.04
81	600585	海螺水泥	1,200	35,136.00	0.04
82	600019	宝钢股份	5,400	35,100.00	0.04
83	300315	掌趣科技	9,800	34,594.00	0.04
84	603288	海天味业	500	34,400.00	0.04
85	601688	华泰证券	2,000	32,400.00	0.04
86	300017	网宿科技	4,100	32,103.00	0.04
87	300070	碧水源	4,100	31,980.00	0.04
88	600201	生物股份	1,900	31,540.00	0.03
89	601390	中国中铁	4,500	31,455.00	0.03
90	300168	万达信息	2,600	31,174.00	0.03
91	300274	阳光电源	3,400	30,328.00	0.03
92	300027	华谊兄弟	6,400	30,016.00	0.03
93	601006	大秦铁路	3,600	29,628.00	0.03
94	300413	芒果超媒	800	29,608.00	0.03
95	601818	光大银行	8,000	29,600.00	0.03
96	300072	三聚环保	3,000	29,520.00	0.03
97	600872	中炬高新	1,000	29,460.00	0.03
98	300088	长信科技	7,000	29,050.00	0.03
99	300166	东方国信	2,800	29,008.00	0.03
100	600050	中国联通	5,600	28,952.00	0.03

101	600015	华夏银行	3,800	28,082.00	0.03
102	600340	华夏幸福	1,100	27,995.00	0.03
103	300296	利亚德	3,600	27,684.00	0.03
104	601939	建设银行	4,100	26,117.00	0.03
105	002142	宁波银行	1,600	25,952.00	0.03
106	002594	比亚迪	500	25,500.00	0.03
107	000063	中兴通讯	1,300	25,467.00	0.03
108	600009	上海机场	500	25,380.00	0.03
109	600919	江苏银行	4,200	25,074.00	0.03
110	600690	青岛海尔	1,800	24,930.00	0.03
111	600256	广汇能源	6,400	24,064.00	0.03
112	601989	中国重工	5,500	23,375.00	0.03
113	600699	均胜电子	1,000	23,360.00	0.03
114	600031	三一重工	2,800	23,352.00	0.03
115	600426	华鲁恒升	1,900	22,933.00	0.03
116	002410	广联达	1,100	22,891.00	0.03
117	300001	特锐德	1,300	22,789.00	0.02
118	600999	招商证券	1,700	22,780.00	0.02
119	002027	分众传媒	4,300	22,532.00	0.02
120	300133	华策影视	2,500	22,400.00	0.02
121	600406	国电南瑞	1,200	22,236.00	0.02
122	300316	晶盛机电	2,200	22,044.00	0.02
123	300182	捷成股份	5,100	21,879.00	0.02
124	000656	金科股份	3,500	21,665.00	0.02
125	000623	吉林敖东	1,500	21,645.00	0.02
126	300113	顺网科技	1,700	21,607.00	0.02
127	000338	潍柴动力	2,800	21,560.00	0.02
128	000776	广发证券	1,700	21,556.00	0.02
129	601088	中国神华	1,200	21,552.00	0.02
130	300601	康泰生物	600	21,468.00	0.02
131	002475	立讯精密	1,500	21,090.00	0.02
132	600642	申能股份	4,300	20,984.00	0.02
133	601005	重庆钢铁	10,800	20,952.00	0.02
134	601012	隆基股份	1,200	20,928.00	0.02
135	600600	青岛啤酒	600	20,916.00	0.02
136	002024	苏宁易购	2,100	20,685.00	0.02
137	000750	国海证券	4,700	20,492.00	0.02
138	000568	泸州老窖	500	20,330.00	0.02
139	002465	海格通信	2,600	20,280.00	0.02

140	300026	红日药业	6,500	19,825.00	0.02
141	002230	科大讯飞	800	19,712.00	0.02
142	600879	航天电子	3,600	19,476.00	0.02
143	600895	张江高科	1,300	19,435.00	0.02
144	600820	隧道股份	3,100	19,406.00	0.02
145	601009	南京银行	3,000	19,380.00	0.02
146	600011	华能国际	2,600	19,188.00	0.02
147	000860	顺鑫农业	600	19,134.00	0.02
148	300033	同花顺	500	19,100.00	0.02
149	300324	旋极信息	3,400	19,074.00	0.02
150	600779	水井坊	600	19,002.00	0.02
151	601933	永辉超市	2,400	18,888.00	0.02
152	000690	宝新能源	2,800	18,844.00	0.02
153	002195	二三四五	5,100	18,819.00	0.02
154	002129	中环股份	2,600	18,798.00	0.02
155	300058	蓝色光标	4,300	18,662.00	0.02
156	000401	冀东水泥	1,500	18,570.00	0.02
157	300055	万邦达	2,400	18,408.00	0.02
158	600741	华域汽车	1,000	18,400.00	0.02
159	600660	福耀玻璃	800	18,224.00	0.02
160	600673	东阳光科	2,500	18,200.00	0.02
161	600795	国电电力	7,100	18,176.00	0.02
162	600703	三安光电	1,600	18,096.00	0.02
163	601168	西部矿业	3,100	18,042.00	0.02
164	601669	中国电建	3,700	17,982.00	0.02
165	002268	卫士通	1,000	17,860.00	0.02
166	601225	陕西煤业	2,400	17,856.00	0.02
167	600528	中铁工业	1,700	17,850.00	0.02
168	000581	威孚高科	1,000	17,660.00	0.02
169	600881	亚泰集团	5,300	17,543.00	0.02
170	300251	光线传媒	2,300	17,480.00	0.02
171	300009	安科生物	1,300	17,368.00	0.02
172	002049	紫光国微	600	17,340.00	0.02
173	600811	东方集团	4,700	17,202.00	0.02
174	600183	生益科技	1,700	17,102.00	0.02
175	002384	东山精密	1,500	16,935.00	0.02
176	000039	中集集团	1,600	16,928.00	0.02
177	300459	金科文化	2,300	16,905.00	0.02
178	600325	华发股份	2,700	16,740.00	0.02

179	300010	立思辰	2,300	16,698.00	0.02
180	300244	迪安诊断	1,100	16,687.00	0.02
181	000830	鲁西化工	1,700	16,660.00	0.02
182	600022	山东钢铁	10,600	16,642.00	0.02
183	600518	康美药业	1,800	16,578.00	0.02
184	300002	神州泰岳	5,000	16,500.00	0.02
185	300115	长盈精密	2,000	16,380.00	0.02
185	600315	上海家化	600	16,380.00	0.02
186	601628	中国人寿	800	16,312.00	0.02
187	000975	银泰资源	1,600	16,304.00	0.02
188	000166	申万宏源	4,000	16,280.00	0.02
188	000998	隆平高科	1,100	16,280.00	0.02
189	600808	马钢股份	4,700	16,262.00	0.02
190	000060	中金岭南	4,100	16,236.00	0.02
191	600718	东软集团	1,400	16,170.00	0.02
192	000997	新大陆	1,100	16,104.00	0.02
193	600271	航天信息	700	16,023.00	0.02
194	002500	山西证券	2,700	15,984.00	0.02
195	000778	新兴铸管	3,700	15,947.00	0.02
196	000100	TCL 集团	6,500	15,925.00	0.02
197	000069	华侨城 A	2,500	15,875.00	0.02
198	600885	宏发股份	700	15,792.00	0.02
198	603993	洛阳钼业	4,200	15,792.00	0.02
199	002223	鱼跃医疗	800	15,688.00	0.02
200	300159	新研股份	3,400	15,674.00	0.02
201	600089	特变电工	2,300	15,617.00	0.02
202	000009	中国宝安	3,600	15,516.00	0.02
203	600352	浙江龙盛	1,600	15,440.00	0.02
204	600572	康恩贝	2,600	15,418.00	0.02
205	300203	聚光科技	600	15,390.00	0.02
206	600143	金发科技	3,100	15,345.00	0.02
207	002221	东华能源	1,900	15,314.00	0.02
208	601985	中国核电	2,900	15,283.00	0.02
209	000960	锡业股份	1,600	15,264.00	0.02
210	002008	大族激光	500	15,180.00	0.02
211	600298	安琪酵母	600	15,138.00	0.02
212	002507	涪陵榨菜	700	15,120.00	0.02
213	002371	北方华创	400	15,104.00	0.02
214	600376	首开股份	2,100	15,099.00	0.02

215	002044	美年健康	1,000	14,950.00	0.02
216	000999	华润三九	600	14,916.00	0.02
217	002038	双鹭药业	600	14,886.00	0.02
218	600161	天坛生物	700	14,875.00	0.02
219	600282	南钢股份	4,300	14,706.00	0.02
220	600755	厦门国贸	2,100	14,658.00	0.02
221	601800	中国交建	1,300	14,638.00	0.02
222	600392	盛和资源	1,700	14,637.00	0.02
223	002340	格林美	3,800	14,592.00	0.02
223	601866	中远海发	6,400	14,592.00	0.02
224	600160	巨化股份	2,200	14,586.00	0.02
225	600967	内蒙一机	1,400	14,560.00	0.02
226	601600	中国铝业	4,100	14,555.00	0.02
227	300271	华宇软件	968	14,529.68	0.02
228	601111	中国国航	1,900	14,516.00	0.02
229	002439	启明星辰	700	14,392.00	0.02
230	601872	招商轮船	3,900	14,391.00	0.02
231	300287	飞利信	3,800	14,364.00	0.02
232	600958	东方证券	1,800	14,346.00	0.02
233	002013	中航机电	2,200	14,322.00	0.02
234	600332	白云山	400	14,304.00	0.02
235	002127	南极电商	1,900	14,288.00	0.02
236	002078	太阳纸业	2,500	14,250.00	0.02
237	002358	森源电气	800	14,240.00	0.02
238	600498	烽火通信	500	14,235.00	0.02
239	000895	双汇发展	600	14,154.00	0.02
240	300014	亿纬锂能	900	14,148.00	0.02
241	002092	中泰化学	2,000	14,100.00	0.02
242	600655	豫园股份	1,900	14,060.00	0.02
243	000089	深圳机场	1,800	14,022.00	0.02
244	300199	翰宇药业	1,500	14,010.00	0.02
245	000681	视觉中国	600	13,992.00	0.02
246	600196	复星医药	600	13,962.00	0.02
247	300073	当升科技	500	13,845.00	0.02
248	000686	东北证券	2,200	13,772.00	0.02
249	000813	德展健康	1,500	13,770.00	0.02
249	600021	上海电力	1,700	13,770.00	0.02
249	603077	和邦生物	8,500	13,770.00	0.02
250	601098	中南传媒	1,100	13,750.00	0.02

251	000066	中国长城	2,900	13,746.00	0.02
252	300170	汉得信息	1,400	13,692.00	0.01
253	300433	蓝思科技	2,100	13,671.00	0.01
254	600487	亨通光电	800	13,640.00	0.01
255	600839	四川长虹	5,900	13,629.00	0.01
256	002463	沪电股份	1,900	13,623.00	0.01
257	600010	宝钢股份	9,200	13,616.00	0.01
258	000547	航天发展	1,800	13,608.00	0.01
259	600260	凯乐科技	800	13,576.00	0.01
260	002176	江特电机	2,300	13,501.00	0.01
261	601377	兴业证券	2,900	13,456.00	0.01
262	600466	蓝光发展	2,500	13,450.00	0.01
263	600606	绿地控股	2,200	13,442.00	0.01
264	002281	光迅科技	500	13,430.00	0.01
265	600875	东方电气	1,700	13,413.00	0.01
266	601618	中国中冶	4,300	13,373.00	0.01
267	600029	南方航空	2,000	13,280.00	0.01
268	002470	金正大	2,100	13,272.00	0.01
269	002299	圣农发展	800	13,232.00	0.01
270	600959	江苏有线	3,200	13,184.00	0.01
271	002007	华兰生物	400	13,120.00	0.01
272	002174	游族网络	700	13,013.00	0.01
273	002506	协鑫集成	2,600	13,000.00	0.01
274	002202	金风科技	1,300	12,987.00	0.01
275	600221	海航控股	6,900	12,972.00	0.01
276	600884	杉杉股份	1,000	12,920.00	0.01
277	600138	中青旅	1,000	12,890.00	0.01
278	300036	超图软件	700	12,831.00	0.01
279	300068	南都电源	900	12,798.00	0.01
280	600567	山鹰纸业	4,100	12,792.00	0.01
281	300558	贝达药业	400	12,788.00	0.01
282	600258	首旅酒店	800	12,768.00	0.01
283	600643	爱建集团	1,500	12,735.00	0.01
284	002074	国轩高科	1,100	12,716.00	0.01
285	600804	鹏博士	1,800	12,654.00	0.01
286	002236	大华股份	1,100	12,606.00	0.01
287	600176	中国巨石	1,300	12,571.00	0.01
288	600737	中粮糖业	1,700	12,512.00	0.01
289	600383	金地集团	1,300	12,506.00	0.01



290	600277	亿利洁能	2,200	12,452.00	0.01
291	000729	燕京啤酒	2,200	12,408.00	0.01
291	002372	伟星新材	800	12,408.00	0.01
292	600584	长电科技	1,500	12,360.00	0.01
293	600008	首创股份	3,600	12,348.00	0.01
294	600637	东方明珠	1,200	12,288.00	0.01
295	002373	千方科技	1,100	12,232.00	0.01
296	600522	中天科技	1,500	12,225.00	0.01
297	300134	大富科技	1,300	12,220.00	0.01
298	300308	中际旭创	300	12,207.00	0.01
299	600079	人福医药	1,200	12,168.00	0.01
300	601877	正泰电器	500	12,120.00	0.01
301	603899	晨光文具	400	12,100.00	0.01
302	002670	国盛金控	1,200	12,096.00	0.01
303	000738	航发控制	1,000	12,060.00	0.01
304	603799	华友钴业	400	12,044.00	0.01
305	002831	裕同科技	300	12,018.00	0.01
306	600409	三友化工	2,100	12,012.00	0.01
307	000988	华工科技	1,000	11,940.00	0.01
308	601607	上海医药	700	11,900.00	0.01
309	600266	北京城建	1,500	11,880.00	0.01
310	000930	中粮生化	1,600	11,872.00	0.01
311	000423	东阿阿胶	300	11,865.00	0.01
312	002589	瑞康医药	1,700	11,849.00	0.01
313	002583	海能达	1,500	11,835.00	0.01
314	600023	浙能电力	2,500	11,825.00	0.01
315	000488	晨鸣纸业	2,100	11,781.00	0.01
316	002466	天齐锂业	400	11,728.00	0.01
317	600801	华新水泥	700	11,704.00	0.01
318	600516	方大炭素	700	11,697.00	0.01
319	600100	同方股份	1,200	11,676.00	0.01
320	000008	神州高铁	3,000	11,670.00	0.01
321	300285	国瓷材料	700	11,669.00	0.01
322	300266	兴源环境	3,300	11,649.00	0.01
323	600500	中化国际	1,700	11,628.00	0.01
324	600511	国药股份	500	11,625.00	0.01
325	603369	今世缘	800	11,592.00	0.01
326	002311	海大集团	500	11,585.00	0.01
327	002399	海普瑞	500	11,525.00	0.01

328	000932	华菱钢铁	1,900	11,514.00	0.01
329	002110	三钢闽光	900	11,511.00	0.01
330	002714	牧原股份	400	11,500.00	0.01
331	600649	城投控股	2,100	11,487.00	0.01
332	601106	中国一重	4,300	11,481.00	0.01
333	600115	东方航空	2,400	11,400.00	0.01
334	600056	中国医药	900	11,313.00	0.01
335	600312	平高电气	1,400	11,312.00	0.01
336	000598	兴蓉环境	2,800	11,284.00	0.01
336	600060	海信电器	1,300	11,284.00	0.01
337	603885	吉祥航空	900	11,277.00	0.01
338	000559	万向钱潮	2,200	11,264.00	0.01
339	000732	泰禾集团	800	11,216.00	0.01
340	601000	唐山港	4,700	11,186.00	0.01
341	600388	龙净环保	1,100	11,165.00	0.01
342	601901	方正证券	2,100	11,151.00	0.01
343	300180	华峰超纤	1,000	11,150.00	0.01
344	000887	中鼎股份	1,100	11,132.00	0.01
345	600867	通化东宝	800	11,120.00	0.01
346	600435	北方导航	1,500	11,115.00	0.01
347	600166	福田汽车	6,100	11,102.00	0.01
348	002051	中工国际	1,000	11,080.00	0.01
349	002460	赣锋锂业	500	11,040.00	0.01
350	600064	南京高科	1,400	11,032.00	0.01
351	002155	湖南黄金	1,400	10,990.00	0.01
352	600507	方大特钢	1,100	10,989.00	0.01
353	600827	百联股份	1,300	10,985.00	0.01
354	002407	多氟多	1,000	10,960.00	0.01
355	300078	思创医惠	1,100	10,934.00	0.01
356	002736	国信证券	1,300	10,881.00	0.01
357	600893	航发动力	500	10,860.00	0.01
358	600863	内蒙华电	4,700	10,857.00	0.01
359	300098	高新兴	1,600	10,816.00	0.01
360	300294	博雅生物	400	10,796.00	0.01
361	000596	古井贡酒	200	10,792.00	0.01
362	600177	雅戈尔	1,500	10,785.00	0.01
363	601179	中国西电	3,200	10,752.00	0.01
364	600782	新钢股份	2,100	10,689.00	0.01
365	002152	广电运通	1,900	10,659.00	0.01

366	600588	用友网络	500	10,650.00	0.01
367	000768	中航飞机	800	10,592.00	0.01
368	002385	大北农	3,300	10,560.00	0.01
369	600460	士兰微	1,300	10,556.00	0.01
370	601788	光大证券	1,200	10,524.00	0.01
371	002273	水晶光电	1,100	10,516.00	0.01
372	000027	深圳能源	2,000	10,500.00	0.01
372	000667	美好置业	4,200	10,500.00	0.01
372	000685	中山公用	1,500	10,500.00	0.01
372	002353	杰瑞股份	700	10,500.00	0.01
372	600125	铁龙物流	1,500	10,500.00	0.01
373	600270	外运发展	500	10,495.00	0.01
374	600536	中国软件	500	10,465.00	0.01
375	002603	以岭药业	1,000	10,460.00	0.01
376	601128	常熟银行	1,700	10,438.00	0.01
377	300188	美亚柏科	800	10,416.00	0.01
378	601727	上海电气	2,100	10,374.00	0.01
379	300212	易华录	500	10,360.00	0.01
379	600018	上港集团	2,000	10,360.00	0.01
380	000413	东旭光电	2,300	10,350.00	0.01
381	600848	上海临港	500	10,340.00	0.01
382	000528	柳 工	1,700	10,319.00	0.01
383	601928	凤凰传媒	1,299	10,314.06	0.01
384	300207	欣旺达	1,200	10,308.00	0.01
385	000783	长江证券	2,000	10,300.00	0.01
386	002266	浙富控股	2,500	10,175.00	0.01
387	002004	华邦健康	2,200	10,142.00	0.01
388	600418	江淮汽车	2,100	10,101.00	0.01
389	000513	丽珠集团	400	10,060.00	0.01
390	601555	东吴证券	1,500	10,050.00	0.01
391	600380	健康元	1,500	10,005.00	0.01
392	600410	华胜天成	1,700	9,962.00	0.01
393	002244	滨江集团	2,500	9,950.00	0.01
394	600167	联美控股	1,100	9,944.00	0.01
395	300377	赢时胜	900	9,936.00	0.01
395	600438	通威股份	1,200	9,936.00	0.01
396	601231	环旭电子	1,100	9,900.00	0.01
397	600717	天津港	1,400	9,898.00	0.01
398	600664	哈药股份	2,500	9,875.00	0.01

399	002352	顺丰控股	300	9,825.00	0.01
400	000400	许继电气	1,100	9,779.00	0.01
400	600158	中体产业	1,100	9,779.00	0.01
401	600026	中远海能	2,200	9,768.00	0.01
402	600705	中航资本	2,300	9,752.00	0.01
403	600307	酒钢宏兴	5,100	9,741.00	0.01
404	601718	际华集团	2,900	9,715.00	0.01
405	000807	云铝股份	2,500	9,700.00	0.01
406	601919	中远海控	2,400	9,696.00	0.01
407	600694	大商股份	400	9,676.00	0.01
408	600062	华润双鹤	800	9,672.00	0.01
409	000636	风华高科	900	9,666.00	0.01
410	002285	世联行	1,900	9,652.00	0.01
411	600111	北方稀土	1,100	9,647.00	0.01
412	002019	亿帆医药	900	9,630.00	0.01
413	002701	奥瑞金	1,900	9,614.00	0.01
414	600535	天士力	500	9,600.00	0.01
415	600348	阳泉煤业	1,900	9,576.00	0.01
416	601966	玲珑轮胎	700	9,555.00	0.01
417	600216	浙江医药	1,100	9,548.00	0.01
418	600674	川投能源	1,100	9,537.00	0.01
419	600027	华电国际	2,000	9,500.00	0.01
420	600094	大名城	2,600	9,490.00	0.01
421	600066	宇通客车	800	9,480.00	0.01
422	603883	老百姓	200	9,442.00	0.01
423	600489	中金黄金	1,100	9,438.00	0.01
424	600598	北大荒	1,100	9,416.00	0.01
425	600823	世茂股份	2,500	9,400.00	0.01
426	002191	劲嘉股份	1,200	9,372.00	0.01
427	600171	上海贝岭	1,000	9,340.00	0.01
428	600398	海澜之家	1,100	9,328.00	0.01
429	600109	国金证券	1,300	9,308.00	0.01
430	300222	科大智能	600	9,300.00	0.01
431	600970	中材国际	1,700	9,299.00	0.01
432	600291	西水股份	900	9,261.00	0.01
433	000157	中联重科	2,600	9,256.00	0.01
434	600362	江西铜业	700	9,212.00	0.01
435	600525	长园集团	2,100	9,198.00	0.01
436	002456	欧菲科技	1,000	9,190.00	0.01

437	002030	达安基因	900	9,144.00	0.01
438	300226	上海钢联	200	9,106.00	0.01
439	600219	南山铝业	4,300	9,073.00	0.01
440	601880	大连港	4,900	9,065.00	0.01
441	000425	徐工机械	2,800	9,044.00	0.01
442	603816	顾家家居	200	9,000.00	0.01
443	600633	浙数文化	1,100	8,965.00	0.01
444	300101	振芯科技	900	8,910.00	0.01
445	600582	天地科技	2,600	8,892.00	0.01
446	002050	三花智控	700	8,883.00	0.01
447	600926	杭州银行	1,200	8,880.00	0.01
448	300367	东方网力	1,000	8,870.00	0.01
449	600901	江苏租赁	1,500	8,865.00	0.01
450	300496	中科创达	400	8,840.00	0.01
451	000006	深振业 A	1,700	8,806.00	0.01
452	600120	浙江东方	700	8,792.00	0.01
453	000031	中粮地产	1,800	8,784.00	0.01
454	300463	迈克生物	600	8,760.00	0.01
455	002146	荣盛发展	1,100	8,745.00	0.01
456	000876	新希望	1,200	8,736.00	0.01
457	000156	华数传媒	1,100	8,723.00	0.01
457	000878	云南铜业	1,100	8,723.00	0.01
458	601998	中信银行	1,600	8,720.00	0.01
459	002491	通鼎互联	1,100	8,668.00	0.01
460	600436	片仔癀	100	8,665.00	0.01
461	002640	跨境通	800	8,640.00	0.01
462	002414	高德红外	400	8,620.00	0.01
463	000563	陕国投 A	3,200	8,576.00	0.01
464	300355	蒙草生态	2,200	8,558.00	0.01
465	601997	贵阳银行	800	8,544.00	0.01
466	002444	巨星科技	900	8,532.00	0.01
467	002690	美亚光电	400	8,512.00	0.01
468	002250	联化科技	900	8,487.00	0.01
469	600499	科达洁能	2,100	8,484.00	0.01
470	002673	西部证券	1,100	8,437.00	0.01
471	600563	法拉电子	200	8,428.00	0.01
472	002450	康得新	1,100	8,404.00	0.01
473	300038	梅泰诺	900	8,397.00	0.01
474	600597	光明乳业	1,000	8,360.00	0.01

475	600760	中航沈飞	300	8,313.00	0.01
476	601717	郑煤机	1,500	8,295.00	0.01
477	000028	国药一致	200	8,288.00	0.01
478	600017	日照港	3,000	8,280.00	0.01
479	300666	江丰电子	200	8,264.00	0.01
480	002241	歌尔股份	1,200	8,256.00	0.01
481	600648	外高桥	600	8,244.00	0.01
482	002408	齐翔腾达	1,200	8,208.00	0.01
483	600073	上海梅林	1,100	8,195.00	0.01
484	300476	胜宏科技	700	8,190.00	0.01
485	600170	上海建工	2,700	8,181.00	0.01
486	300053	欧比特	1,000	8,160.00	0.01
487	000543	皖能电力	1,700	8,143.00	0.01
488	002280	联络互动	2,100	8,127.00	0.01
489	601138	工业富联	700	8,113.00	0.01
490	002081	金螳螂	1,000	8,100.00	0.01
490	002440	闰土股份	900	8,100.00	0.01
491	002131	利欧股份	5,500	8,085.00	0.01
492	600623	华谊集团	1,000	8,080.00	0.01
493	002493	荣盛石化	800	8,072.00	0.01
494	000703	恒逸石化	700	8,064.00	0.01
495	000970	中科三环	1,100	8,063.00	0.01
496	000078	海王生物	2,700	8,046.00	0.01
497	000848	承德露露	1,000	8,040.00	0.01
498	002563	森马服饰	900	8,028.00	0.01
499	002839	张家港行	1,500	8,025.00	0.01
500	002916	深南电路	100	8,017.00	0.01
501	601018	宁波港	2,400	8,016.00	0.01
502	002242	九阳股份	500	8,005.00	0.01
503	601200	上海环境	600	7,962.00	0.01
504	002064	华峰氨纶	1,900	7,961.00	0.01
505	000718	苏宁环球	2,500	7,950.00	0.01
506	002573	清新环境	1,100	7,942.00	0.01
507	600503	华丽家族	2,600	7,930.00	0.01
508	600098	广州发展	1,400	7,924.00	0.01
508	601100	恒立液压	400	7,924.00	0.01
509	600908	无锡银行	1,500	7,860.00	0.01
510	600978	宜华生活	1,900	7,790.00	0.01
511	002212	南洋股份	700	7,784.00	0.01

512	600338	西藏珠峰	400	7,772.00	0.01
513	300628	亿联网络	100	7,766.00	0.01
514	600153	建发股份	1,100	7,755.00	0.01
515	002056	横店东磁	1,400	7,742.00	0.01
516	600037	歌华有线	900	7,731.00	0.01
517	601198	东兴证券	800	7,648.00	0.01
518	300156	神雾环保	2,100	7,623.00	0.01
519	002807	江阴银行	1,500	7,620.00	0.01
520	002254	泰和新材	700	7,588.00	0.01
521	603858	步长制药	300	7,584.00	0.01
522	002317	众生药业	900	7,515.00	0.01
523	002001	新 和 成	500	7,505.00	0.01
524	600787	中储股份	1,500	7,500.00	0.01
525	300618	寒锐钴业	100	7,408.00	0.01
526	600545	卓郎智能	1,000	7,400.00	0.01
527	002359	北讯集团	900	7,389.00	0.01
528	000980	众泰汽车	1,700	7,361.00	0.01
529	000926	福星股份	1,200	7,344.00	0.01
530	600739	辽宁成大	700	7,322.00	0.01
531	600179	安通控股	1,100	7,315.00	0.01
532	000630	铜陵有色	3,700	7,289.00	0.01
533	601608	中信重工	2,800	7,280.00	0.01
534	600835	上海机电	500	7,275.00	0.01
534	600869	智慧能源	1,500	7,275.00	0.01
535	600208	新湖中宝	2,500	7,250.00	0.01
536	000625	长安汽车	1,100	7,249.00	0.01
537	600141	兴发集团	700	7,203.00	0.01
538	600557	康缘药业	700	7,196.00	0.01
539	000012	南玻 A	1,800	7,182.00	0.01
540	601678	滨化股份	1,700	7,174.00	0.01
541	300699	光威复材	200	7,160.00	0.01
541	600977	中国电影	500	7,160.00	0.01
542	300145	中金环境	2,200	7,150.00	0.01
543	000877	天山股份	1,000	7,110.00	0.01
544	601958	金钼股份	1,200	7,104.00	0.01
545	002797	第一创业	1,300	7,046.00	0.01
546	600004	白云机场	700	7,035.00	0.01
547	601992	金隅集团	2,000	7,000.00	0.01
548	000728	国元证券	1,000	6,980.00	0.01

549	002368	太极股份	300	6,960.00	0.01
550	002065	东华软件	1,000	6,950.00	0.01
551	600580	卧龙电气	1,100	6,930.00	0.01
552	600118	中国卫星	400	6,928.00	0.01
553	002028	思源电气	700	6,909.00	0.01
554	601326	秦港股份	2,200	6,908.00	0.01
555	000021	深科技	1,200	6,900.00	0.01
556	000786	北新建材	500	6,880.00	0.01
557	002672	东江环保	600	6,864.00	0.01
558	601127	小康股份	400	6,856.00	0.01
559	000717	韶钢松山	1,500	6,825.00	0.01
560	000709	河钢股份	2,400	6,816.00	0.01
560	600575	皖江物流	3,200	6,816.00	0.01
561	002400	省广集团	2,300	6,808.00	0.01
562	002431	棕榈股份	1,900	6,783.00	0.01
562	600611	大众交通	1,700	6,783.00	0.01
563	600750	江中药业	400	6,772.00	0.01
564	000537	广宇发展	900	6,741.00	0.01
565	002179	中航光电	200	6,736.00	0.01
566	600267	海正药业	800	6,712.00	0.01
567	600993	马应龙	500	6,710.00	0.01
568	002572	索菲亚	400	6,700.00	0.01
569	600765	中航重机	900	6,696.00	0.01
570	600482	中国动力	300	6,681.00	0.01
571	601801	皖新传媒	1,000	6,680.00	0.01
572	600478	科力远	1,700	6,630.00	0.01
573	600346	恒力股份	500	6,625.00	0.01
574	000758	中色股份	1,800	6,570.00	0.01
574	603000	人民网	900	6,570.00	0.01
575	002183	怡亚通	1,300	6,513.00	0.01
576	002709	天赐材料	300	6,498.00	0.01
577	600645	中源协和	400	6,496.00	0.01
578	600688	上海石化	1,300	6,487.00	0.01
579	002271	东方雨虹	500	6,475.00	0.01
580	002128	露天煤业	900	6,444.00	0.01
581	601117	中国化学	1,200	6,432.00	0.01
582	000723	美锦能源	2,000	6,420.00	0.01
583	000937	冀中能源	1,700	6,409.00	0.01
584	002252	上海莱士	800	6,408.00	0.01



585	600583	海油工程	1,300	6,370.00	0.01
586	000712	锦龙股份	700	6,356.00	0.01
587	000503	国新健康	400	6,352.00	0.01
588	600151	航天机电	1,600	6,336.00	0.01
589	000727	华东科技	4,300	6,321.00	0.01
590	601333	广深铁路	2,000	6,320.00	0.01
591	002249	大洋电机	1,900	6,270.00	0.01
592	002294	信立泰	300	6,267.00	0.01
593	002426	胜利精密	2,700	6,264.00	0.01
594	002048	宁波华翔	600	6,258.00	0.01
595	600169	太原重工	2,800	6,244.00	0.01
596	600751	海航科技	2,300	6,233.00	0.01
597	603986	兆易创新	100	6,232.00	0.01
598	002602	世纪华通	300	6,195.00	0.01
599	002424	贵州百灵	700	6,125.00	0.01
600	600770	综艺股份	1,300	6,123.00	0.01
601	600777	新潮能源	3,200	6,112.00	0.01
602	300616	尚品宅配	100	6,077.00	0.01
603	002508	老板电器	300	6,057.00	0.01
604	002002	鸿达兴业	2,100	6,048.00	0.01
605	002233	塔牌集团	600	6,036.00	0.01
606	601016	节能风电	2,600	6,032.00	0.01
607	600155	华创阳安	800	6,024.00	0.01
608	300676	华大基因	100	6,000.00	0.01
609	300257	开山股份	600	5,994.00	0.01
610	601001	大同煤业	1,400	5,978.00	0.01
611	000612	焦作万方	1,500	5,940.00	0.01
612	600316	洪都航空	600	5,934.00	0.01
613	002434	万里扬	900	5,931.00	0.01
614	600369	西南证券	1,700	5,916.00	0.01
615	601689	拓普集团	400	5,912.00	0.01
616	002665	首航节能	2,100	5,901.00	0.01
617	002815	崇达技术	400	5,844.00	0.01
618	603377	东方时尚	400	5,840.00	0.01
619	002093	国脉科技	800	5,832.00	0.01
620	000061	农产品	1,200	5,820.00	0.01
621	000564	供销大集	2,300	5,819.00	0.01
622	002558	巨人网络	300	5,811.00	0.01
623	601878	浙商证券	800	5,808.00	0.01

624	002482	广田集团	1,000	5,790.00	0.01
625	300323	华灿光电	800	5,784.00	0.01
626	300373	扬杰科技	400	5,776.00	0.01
627	600874	创业环保	700	5,775.00	0.01
628	000158	常山北明	1,100	5,742.00	0.01
629	000049	德赛电池	200	5,736.00	0.01
630	002390	信邦制药	1,400	5,726.00	0.01
630	603766	隆鑫通用	1,400	5,726.00	0.01
631	600565	迪马股份	2,200	5,720.00	0.01
632	000541	佛山照明	1,100	5,698.00	0.01
633	000501	鄂武商 A	600	5,688.00	0.01
633	002509	天广中茂	2,400	5,688.00	0.01
634	600816	安信信托	1,300	5,681.00	0.01
635	600416	湘电股份	1,100	5,676.00	0.01
636	002505	大康农业	3,500	5,670.00	0.01
637	000519	中兵红箭	900	5,661.00	0.01
638	002745	木林森	500	5,645.00	0.01
639	603198	迎驾贡酒	400	5,644.00	0.01
640	000898	鞍钢股份	1,100	5,643.00	0.01
641	002366	台海核电	600	5,628.00	0.01
642	000961	中南建设	1,000	5,610.00	0.01
643	000792	盐湖股份	800	5,584.00	0.01
644	601898	中煤能源	1,200	5,580.00	0.01
645	603515	欧普照明	200	5,574.00	0.01
646	002624	完美世界	200	5,570.00	0.01
647	002375	亚厦股份	1,100	5,544.00	0.01
648	000600	建投能源	1,100	5,522.00	0.01
649	000090	天健集团	1,200	5,520.00	0.01
649	600594	益佰制药	1,000	5,520.00	0.01
650	600366	宁波韵升	1,100	5,511.00	0.01
651	600657	信达地产	1,400	5,502.00	0.01
652	600122	宏图高科	1,500	5,445.00	0.01
653	002085	万丰奥威	700	5,425.00	0.01
654	600859	王府井	400	5,424.00	0.01
655	002544	杰赛科技	500	5,410.00	0.01
656	000839	中信国安	1,600	5,392.00	0.01
657	600195	中牧股份	500	5,320.00	0.01
658	601311	骆驼股份	600	5,298.00	0.01
659	600297	广汇汽车	1,300	5,278.00	0.01

660	601003	柳钢股份	800	5,256.00	0.01
661	002032	苏泊尔	100	5,250.00	0.01
662	300409	道氏技术	400	5,244.00	0.01
663	600757	长江传媒	800	5,216.00	0.01
664	603556	海兴电力	400	5,200.00	0.01
665	000826	启迪桑德	500	5,195.00	0.01
666	002517	恺英网络	1,400	5,194.00	0.01
667	600372	中航电子	400	5,192.00	0.01
667	600759	洲际油气	2,200	5,192.00	0.01
667	600909	华安证券	1,100	5,192.00	0.01
668	002663	普邦股份	2,100	5,187.00	0.01
669	601238	广汽集团	500	5,145.00	0.01
670	603888	新华网	400	5,136.00	0.01
671	002707	众信旅游	800	5,056.00	0.01
672	300376	易事特	1,200	5,052.00	0.01
673	600704	物产中大	1,100	5,038.00	0.01
674	600614	鹏起科技	1,400	5,026.00	0.01
675	600350	山东高速	1,100	5,016.00	0.01
676	300297	蓝盾股份	1,000	5,000.00	0.01
677	603228	景旺电子	100	4,999.00	0.01
678	600329	中新药业	400	4,976.00	0.01
679	600157	永泰能源	3,700	4,958.00	0.01
680	603328	依顿电子	500	4,950.00	0.01
681	000983	西山煤电	900	4,941.00	0.01
682	600640	号百控股	500	4,905.00	0.01
683	002332	仙琚制药	800	4,904.00	0.01
684	603658	安图生物	100	4,889.00	0.01
685	600415	小商品城	1,400	4,886.00	0.01
686	002310	东方园林	700	4,872.00	0.01
687	000552	靖远煤电	1,900	4,864.00	0.01
688	300364	中文在线	1,000	4,840.00	0.01
689	600549	厦门钨业	400	4,832.00	0.01
690	600748	上实发展	900	4,806.00	0.01
691	000766	通化金马	700	4,802.00	0.01
692	600773	西藏城投	800	4,800.00	0.01
693	002512	达华智能	900	4,779.00	0.01
694	300085	银之杰	600	4,776.00	0.01
695	601881	中国银河	700	4,774.00	0.01
696	601228	广州港	1,200	4,752.00	0.01

697	002277	友阿股份	1,500	4,740.00	0.01
697	603659	璞泰来	100	4,740.00	0.01
698	601991	大唐发电	1,500	4,725.00	0.01
699	600053	九鼎投资	200	4,708.00	0.01
700	002503	搜于特	2,000	4,700.00	0.01
701	000671	阳光城	900	4,671.00	0.01
702	600240	华业资本	1,800	4,662.00	0.01
703	603568	伟明环保	200	4,570.00	0.01
704	002344	海宁皮城	1,000	4,550.00	0.00
704	600428	中远海特	1,400	4,550.00	0.00
705	002276	万马股份	900	4,536.00	0.00
706	002635	安洁科技	400	4,532.00	0.00
707	603866	桃李面包	100	4,516.00	0.00
708	600639	浦东金桥	400	4,504.00	0.00
708	600971	恒源煤电	800	4,504.00	0.00
709	600061	国投资本	500	4,495.00	0.00
710	000627	天茂集团	800	4,488.00	0.00
710	000829	天音控股	800	4,488.00	0.00
710	002489	浙江永强	1,700	4,488.00	0.00
711	300083	劲胜智能	1,900	4,484.00	0.00
712	000426	兴业矿业	900	4,482.00	0.00
713	600259	广晟有色	200	4,472.00	0.00
714	601216	君正集团	1,700	4,454.00	0.00
715	002251	步步高	600	4,452.00	0.00
716	002302	西部建设	500	4,420.00	0.00
717	600188	兖州煤业	500	4,390.00	0.00
718	601990	南京证券	500	4,350.00	0.00
719	000536	华映科技	2,300	4,301.00	0.00
720	600754	锦江股份	200	4,260.00	0.00
721	002354	天神娱乐	800	4,192.00	0.00
722	300431	暴风集团	500	4,170.00	0.00
723	002818	富森美	200	4,158.00	0.00
724	600086	东方金钰	900	4,149.00	0.00
725	601360	三六零	200	4,074.00	0.00
726	600458	时代新材	600	4,068.00	0.00
727	002308	威创股份	900	4,005.00	0.00
728	603233	大参林	100	3,986.00	0.00
729	601869	长飞光纤	100	3,977.00	0.00
730	000415	渤海金控	1,100	3,960.00	0.00

730	600006	东风汽车	1,100	3,960.00	0.00
731	600862	中航高科	700	3,920.00	0.00
731	601633	长城汽车	700	3,920.00	0.00
732	600184	光电股份	400	3,908.00	0.00
733	600058	五矿发展	600	3,906.00	0.00
734	002588	史丹利	1,000	3,890.00	0.00
735	000402	金融街	600	3,864.00	0.00
735	002642	荣之联	600	3,864.00	0.00
736	300197	铁汉生态	1,000	3,790.00	0.00
737	002555	三七互娱	400	3,776.00	0.00
738	002477	雏鹰农牧	2,500	3,750.00	0.00
738	603225	新凤鸣	200	3,750.00	0.00
739	600038	中直股份	100	3,736.00	0.00
740	002601	龙蟠佰利	300	3,690.00	0.00
741	002681	奋达科技	1,000	3,660.00	0.00
742	000969	安泰科技	800	3,640.00	0.00
743	600339	中油工程	1,000	3,630.00	0.00
743	600743	华远地产	1,500	3,630.00	0.00
744	300474	景嘉微	100	3,616.00	0.00
745	600126	杭钢股份	800	3,608.00	0.00
746	000990	诚志股份	300	3,603.00	0.00
747	002416	爱施德	600	3,528.00	0.00
748	600809	山西汾酒	100	3,505.00	0.00
749	002118	紫鑫药业	800	3,488.00	0.00
750	002920	德赛西威	200	3,470.00	0.00
751	600025	华能水电	1,100	3,465.00	0.00
752	601777	力帆股份	900	3,429.00	0.00
753	601808	中海油服	400	3,416.00	0.00
754	002147	新光圆成	1,100	3,410.00	0.00
755	000408	藏格控股	300	3,366.00	0.00
756	002437	誉衡药业	1,200	3,360.00	0.00
757	000959	首钢股份	900	3,357.00	0.00
758	600566	济川药业	100	3,353.00	0.00
759	000587	金洲慈航	1,400	3,290.00	0.00
760	601611	中国核建	500	3,265.00	0.00
761	600280	中央商场	1,000	3,250.00	0.00
762	600939	重庆建工	700	3,227.00	0.00
763	001965	招商公路	400	3,212.00	0.00
764	600996	贵广网络	500	3,180.00	0.00

765	002345	潮宏基	700	3,129.00	0.00
766	601019	山东出版	400	3,128.00	0.00
767	000938	紫光股份	100	3,126.00	0.00
768	600335	国机汽车	500	3,120.00	0.00
769	300741	华宝股份	100	3,107.00	0.00
770	002625	光启技术	300	2,970.00	0.00
771	600393	粤泰股份	1,400	2,968.00	0.00
772	600687	刚泰控股	700	2,905.00	0.00
773	600917	重庆燃气	400	2,848.00	0.00
774	600390	五矿资本	400	2,784.00	0.00
775	002699	美盛文化	500	2,740.00	0.00
776	002041	登海种业	500	2,695.00	0.00
777	601969	海南矿业	600	2,688.00	0.00
778	603806	福斯特	100	2,680.00	0.00
779	300291	华录百纳	600	2,670.00	0.00
780	000025	特力A	100	2,652.00	0.00
781	601066	中信建投	300	2,613.00	0.00
782	002153	石基信息	100	2,596.00	0.00
782	600618	氯碱化工	400	2,596.00	0.00
783	300202	聚龙股份	400	2,576.00	0.00
784	300634	彩讯股份	100	2,387.00	0.00
785	603355	莱克电气	100	2,150.00	0.00
786	000761	本钢板材	600	2,016.00	0.00
787	600233	圆通速递	200	2,000.00	0.00
788	603650	彤程新材	100	1,983.00	0.00
789	601811	新华文轩	200	1,862.00	0.00
790	603712	七一二	100	1,781.00	0.00
791	603169	兰石重装	400	1,708.00	0.00
792	601020	华钰矿业	200	1,692.00	0.00
793	603056	德邦股份	100	1,655.00	0.00
794	002468	申通快递	100	1,645.00	0.00
795	601838	成都银行	200	1,610.00	0.00
796	000987	越秀金控	200	1,594.00	0.00
797	601212	白银有色	500	1,475.00	0.00
798	601108	财通证券	200	1,444.00	0.00
799	603025	大豪科技	100	1,115.00	0.00
800	601828	美凯龙	100	1,104.00	0.00
801	603569	长久物流	100	1,075.00	0.00
802	000553	沙隆达 A	100	913.00	0.00

## 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	3,247,944.00	3.56
2	000002	万科 A	1,436,156.00	1.57
3	600036	招商银行	1,330,665.00	1.46
4	600519	贵州茅台	1,267,184.00	1.39
5	600048	保利地产	1,158,252.00	1.27
6	600085	同仁堂	1,143,820.00	1.25
7	600276	恒瑞医药	1,104,101.60	1.21
8	002422	科伦药业	1,059,256.00	1.16
9	000333	美的集团	1,002,503.18	1.10
10	600068	葛洲坝	1,001,356.00	1.10
11	601186	中国铁建	967,821.00	1.06
12	002675	东诚药业	842,052.00	0.92
13	601398	工商银行	822,668.00	0.90
14	601601	中国太保	817,328.32	0.89
15	300284	苏交科	803,082.57	0.88
16	603707	健友股份	801,662.00	0.88
17	603018	中设集团	769,579.22	0.84
18	600547	山东黄金	764,287.00	0.84
19	601166	兴业银行	718,672.00	0.79
20	000651	格力电器	714,051.00	0.78

### 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	601318	中国平安	2,358,872.00	2.58
2	600036	招商银行	1,103,639.00	1.21
3	600519	贵州茅台	1,004,738.00	1.10
4	601398	工商银行	746,280.00	0.82

5	601186	中国铁建	669,107.00	0.73
6	600068	葛洲坝	651,111.00	0.71
7	601166	兴业银行	611,419.00	0.67
8	000651	格力电器	599,671.00	0.66
9	601939	建设银行	577,749.00	0.63
10	600016	民生银行	551,197.00	0.60
11	300284	苏交科	531,456.00	0.58
12	000333	美的集团	529,601.00	0.58
13	601328	交通银行	498,546.00	0.55
14	600887	伊利股份	478,971.00	0.52
15	000002	万科 A	474,493.00	0.52
16	601288	农业银行	440,588.00	0.48
17	600030	中信证券	415,291.00	0.45
18	600276	恒瑞医药	415,123.00	0.45
19	600000	浦发银行	385,730.00	0.42
20	601668	中国建筑	365,622.00	0.40

#### 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	74,219,156.33
卖出股票收入（成交）总额	48,261,808.74

#### 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（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,355,800.00	64.99
	其中：政策性金融债	59,355,800.00	64.99
4	企业债券	4,912,000.00	5.38
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	64,267,800.00	70.37



**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	180210	18 国开 10	300,000	30,939,000.00	33.88
2	180406	18 农发 06	200,000	21,386,000.00	23.42
3	018005	国开 1701	70,000	7,030,800.00	7.70
4	112257	15 荣盛 02	50,000	4,912,000.00	5.38

**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**

本基金报告期末未持有权证。

**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**

本基金报告期末未持有股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金报告期末未持有股指期货。

**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**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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，除东诚药业（002675）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 6 月 11 日，深圳证券交易所对东诚药业公司股东 PACIFIC RAINBOW INTERNATIONAL INC（美国太平洋彩虹）未及时披露公司重大事项给予公开谴责的处分。

本基金基于基本面优选策略对东诚药业（002675）进行投资，投资原因主要是东诚药业基本面稳健，近两年在业务调整中快速成长，而主营业务核药房业务可替代性低，在国内竞争中处于领先地位，后期存在着广阔的市场前景。同时我们认为这家公司受到的处罚并未对其投资价值产生实质性的负面影响，所以依旧按照策略观点进行投资。

### 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	26,941.80
2	应收证券清算款	488,333.14
3	应收股利	-
4	应收利息	1,477,259.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,992,534.20

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### **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不存在流通受限的情况。

### **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
中金衡优 A	197	354,094.57	35,829,887.77	51.36%	33,926,742.77	48.64%
中金衡优 C	11	1,827,665.74	14,941,985.93	74.32%	5,162,337.22	25.68%
合计	208	432,023.82	50,771,873.70	56.50%	39,089,079.99	43.50%

### 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	中金衡优 A	99,356.67	0.1424%
	中金衡优 C	0.00	0.0000%
	合计	99,356.67	0.1106%

### 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	中金衡优 A	0
	中金衡优 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中金衡优 A	0
	中金衡优 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金衡优 A	中金衡优 C
基金合同生效日（2018 年 6 月 8 日）基金份额总额	101,040,333.79	124,150,779.10
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	51,883,491.26	22,997,139.92
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	83,167,194.51	127,043,595.87
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	69,756,630.54	20,104,323.15

## § 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。

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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 35,000.00 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到任何稽查或处罚。

## 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	
中投证券	2	122,480,965.07	100.00%	89,567.69	100.00%	-
中银证券	2	-	-	-	-	-

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

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

2、基金交易单元的选择程序如下：

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

### 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
中投证券	282,343,344.73	100.00%	1,825,000,000.00	100.00%	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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	中金衡优灵活配置混合型证	《中国证券报》、《上	2018年6月9日

	券投资基金合同生效公告	海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	
2	中金基金管理有限公司关于中金衡优灵活配置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 7 月 3 日
3	关于新增济安财富（北京）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 7 月 21 日
4	关于中金金利、中金衡优新增渤海银行为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 7 月 27 日
5	中金基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 8 月 3 日
6	中金基金管理有限公司关于公司独立董事变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 8 月 17 日
7	中金基金管理有限公司副总经理任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 9 月 4 日
8	关于新增泰诚财富基金销售（大连）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 9 月 28 日
9	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 10 月 12 日
10	关于新增中信建投证券股份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 10 月 18 日
11	中金基金管理有限公司关于孙菁代为履行董事长职务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 10 月 19 日
12	中金衡优灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 10 月 24 日
13	关于中金衡优新增北京虹点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 10 月 31 日
14	关于旗下部分基金新增唐鼎耀华为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 11 月 10 日
15	关于新增珠海盈米基金销售	《中国证券报》、《上	2018 年 12 月 17 日



	有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	
16	关于新增平安银行股份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 12 月 17 日
17	中金衡优灵活配置混合型证券投资基金增聘基金经理公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 12 月 21 日
18	关于新增阳光人寿保险股份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 12 月 21 日
19	关于新增上海长量基金销售投资顾问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 12 月 27 日
20	关于中金衡优新增苏宁基金为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 12 月 28 日

## § 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 7 月 30 日-2018 年 12 月 31 日	-	29,838,870.10	-	29,838,870.10	33.21%

#### 产品特有风险

##### (1) 投资风险

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

##### (2) 期货投资风险

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

2) 基差风险：在使用期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为现货价格与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：期货合约到期时，基金财产如持有未平仓合约，交易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) 期货保证金不足风险：由于期货价格朝不利方向变动，导致期货账户的资金低于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，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：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，或因其他原因导致交易所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。

##### 9) 连带风险

为基金财产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致交易所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，基金财产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

##### 10) 基金资产投资特定投资对象的其他风险

如期货经纪公司违反法律法规或交易所交易、结算等规则，可能会导致基金财产受到损失。由于国家

法律、法规、政策的变化、交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，基金财产持有的未平仓合约可能无法继续持有，基金财产必须承担由此导致的损失。

### （3）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。

### （4）中小企业私募债券投资风险

本基金投资品种包含中小企业私募债券，中小企业私募债券是由非上市公司采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

### （5）流通受限证券投资风险

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

## 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金衡优灵活配置混合型证券投资基金募集注册文件
- 2、《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金衡优灵活配置混合型证券投资基金法律意见书
- 5、《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、报告期内中金衡优灵活配置证券投资基金在指定媒介上发布的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

### 13.2 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。

### 13.3 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

2019年3月28日