

重要提示

基金管理人承诺以诚实信用为原则，勤勉尽责地为基金份额持有人提供服务。基金管理人承诺以诚实信用为原则，勤勉尽责地为基金份额持有人提供服务。基金管理人承诺以诚实信用为原则，勤勉尽责地为基金份额持有人提供服务。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes information on fund type (国金量化多因子), investment strategy (量化选股), and management details.

注：无

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (Reporting Period). Shows performance metrics for 2019-01-01 to 2019-03-31.

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（不含公允价值变动损益）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、期末基金净值指标均以持有从国金量化多因子的高净值客户为基准，计入费用后实际收益水平采用四舍五入。

基金业绩表现

Table comparing performance metrics: 本报告期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. Includes columns for 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Value Growth Rate), etc.

自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
基金业绩表现图



注：1、图示日期为2018年10月31日至2019年3月31日；
2、本基金合同生效日为2018年10月31日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年；
3、本基金合同约定的业绩比较基准为：中证500指数收益率*80%+中证国债收益率*20%。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (Reporting Period). Shows various performance metrics for 2019-01-01 to 2019-03-31.

注：无

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 在任基金名称 (Funds Managed), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date), 证券从业年限 (Years of Experience), 说明 (Remarks).

注：（1）任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金经理人在本报告期间严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》和其他有关法律法规的规定，以及基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资管理符合有关法规和基金合同的约定。

公平交易制度的执行情况

公平交易制度的执行情况
报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和技术等方式在各环节严格落实公平交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合，在投资决策内部控制环节，采取投资指令投资授权和流程控制决策，并在获得投资指令、投资指令和满投资决策发布前享有公平的机会；在交易执行控制环节，通过完善交易规则内各类交易的公平执行机制，严格的流程控制、稽核技术措施，确保公平交易原则的实现；在执行监控环节分析环节，通过建立系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和防范。

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。
报告期内，本基金管理人所有的投资组合与交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的3%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和技术等方式在各环节严格落实公平交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合，在投资决策内部控制环节，采取投资指令投资授权和流程控制决策，并在获得投资指令、投资指令和满投资决策发布前享有公平的机会；在交易执行控制环节，通过完善交易规则内各类交易的公平执行机制，严格的流程控制、稽核技术措施，确保公平交易原则的实现；在执行监控环节分析环节，通过建立系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和防范。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金单位净值1.288元，累计单位净值1.289元，本报告期基金份额净值增长率为25.39%，同期业绩比较基准增长率为21.83%。

报告期内基金持有人或资金资产净值预警说明

本报告期，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情况。截止本报告期末，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本基金经理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

投资组合报告

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Shows the top 10 stock holdings as of the reporting period.

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 行业类别 (Industry Category). Shows the top 10 industry categories for the reporting period.

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 行业类别 (Industry Category). Shows the top 10 industry categories for the reporting period.

注：以上行业分类按2018年9月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 行业类别 (Industry Category). Shows the top 10 industry categories for the reporting period.

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末持有债券投资。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有基金。