

中金衡盈混合型证券投资基金 2019 年年度报告

2019 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 21 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 20 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 2019 年 6 月 21 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
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
§4 管理人报告	12
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.....	12
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.....	13
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.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
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.....	69
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.....	69

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	70
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	70
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
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	72
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
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	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8 其他重大事件	76
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金衡盈混合型证券投资基金	
基金简称	中金衡盈	
基金主代码	007421	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年6月21日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	182,387,172.87份	
下属分级基金的基金简称:	中金衡盈 A	中金衡盈 C
下属分级基金的交易代码:	007421	007422
报告期末下属分级基金的份额总额	172,488,867.52份	9,898,305.35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	本基金将采用“自上而下”的分析方法，综合分析宏观经济周期与形势、货币政策、财政政策、利率走势、资金供求、流动性风险、信用风险等因素，分析比较债券市场、股票市场及现金类资产的收益风险特征，动态调整各大类资产的投资比例，控制投资组合的系统性风险。本基金结合长期战略资产配置、中期周期资产配置和短期战术资产配置的模型及研判，一方面积极通过长中短期的策略相结合动态把握不同宏观及中观时点的市场收益，另一方面通过各策略间的风险预算控制，有效管理组合风险。
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×75%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×5%+金融机构人民币活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李虹	张燕
	联系电话	010-63211122	0755-83199084
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-868-1166	95555
传真		010-66159121	0755-83195201
注册地址		北京市朝阳区建国门外大	深圳市深南大道 7088 号招商银

	街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100004	518040
法定代表人	楚钢	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
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 座办公楼 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	2019年6月21日(基金合同生效日)-2019年12月31日	
	中金衡盈 A	中金衡盈 C
本期已实现收益	2,099,764.57	162,448.42
本期利润	4,507,778.97	274,985.56
加权平均基金份额本期利润	0.0180	0.0126
本期加权平均净值利润率	1.79%	1.25%
本期基金份额净值增长率	2.01%	1.73%
3.1.2 期末数据和指标	2019年末	
期末可供分配利润	1,447,664.05	55,810.06
期末可供分配基金份额利润	0.0084	0.0056
期末基金资产净值	175,949,083.24	10,069,332.29
期末基金份额净值	1.0201	1.0173
3.1.3 累计期末指标	2019年末	
基金份额累计净值增长率	2.01%	1.73%

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 2019 年 6 月 21 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

中金衡盈 A

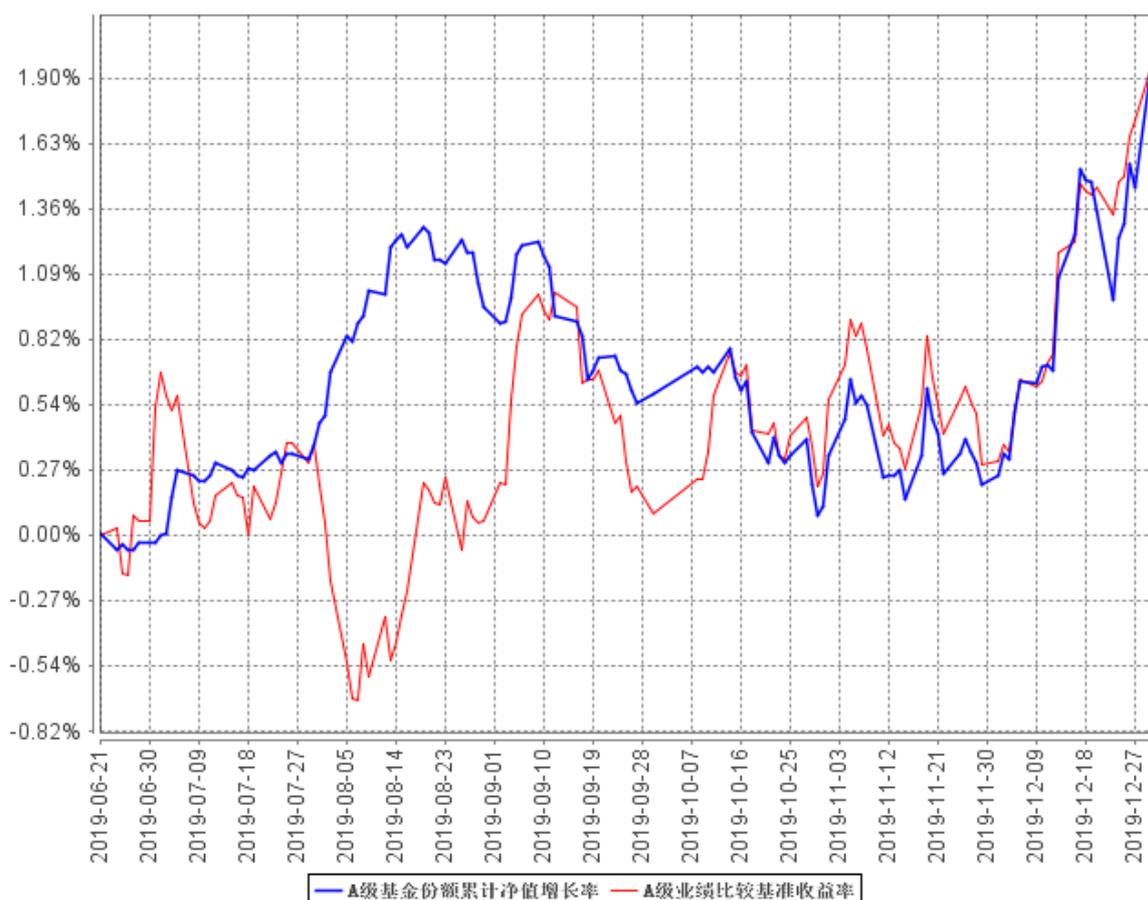
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.41%	0.15%	1.94%	0.14%	-0.53%	0.01%
过去六个月	2.04%	0.12%	1.97%	0.16%	0.07%	-0.04%
自基金合同生效起至今	2.01%	0.12%	2.03%	0.16%	-0.02%	-0.04%

中金衡盈 C

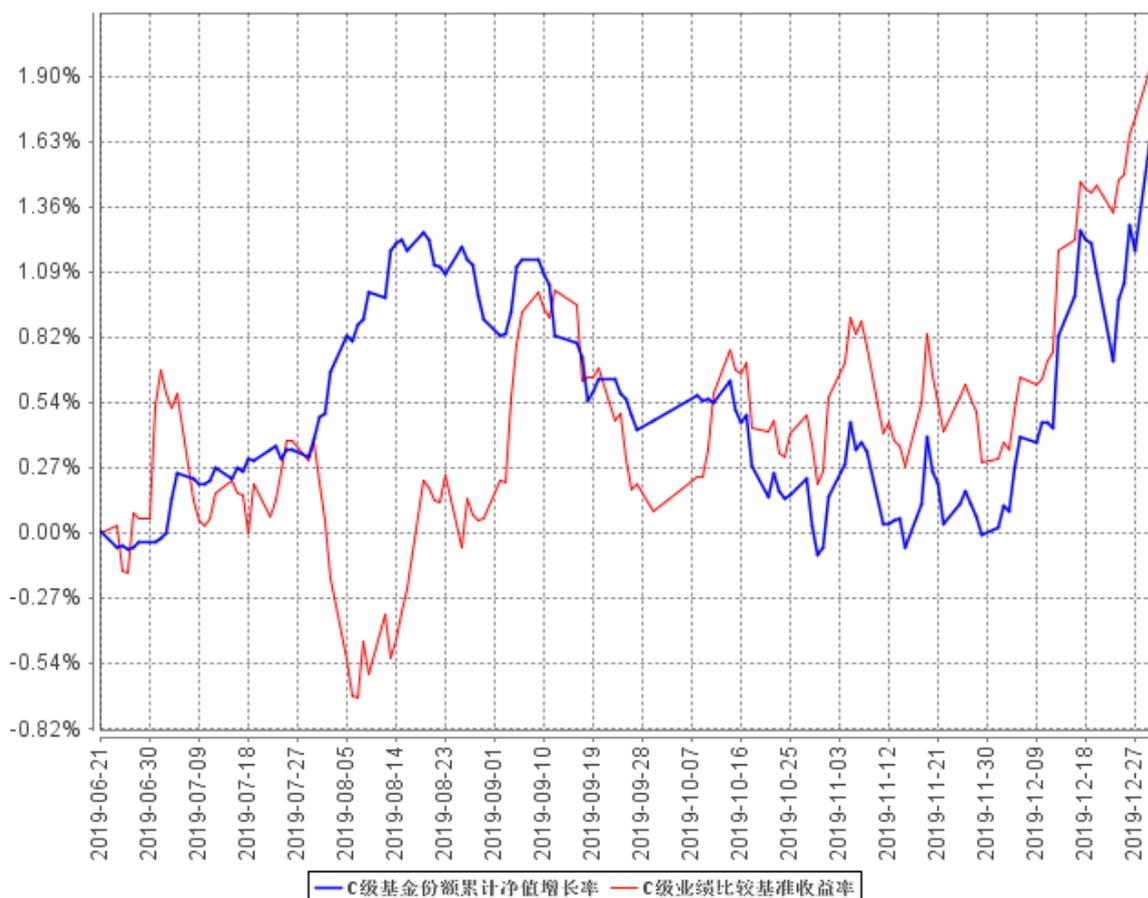
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.25%	0.15%	1.94%	0.14%	-0.69%	0.01%
过去六个月	1.77%	0.12%	1.97%	0.16%	-0.20%	-0.04%
自基金合同生效起至今	1.73%	0.12%	2.03%	0.16%	-0.30%	-0.04%

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



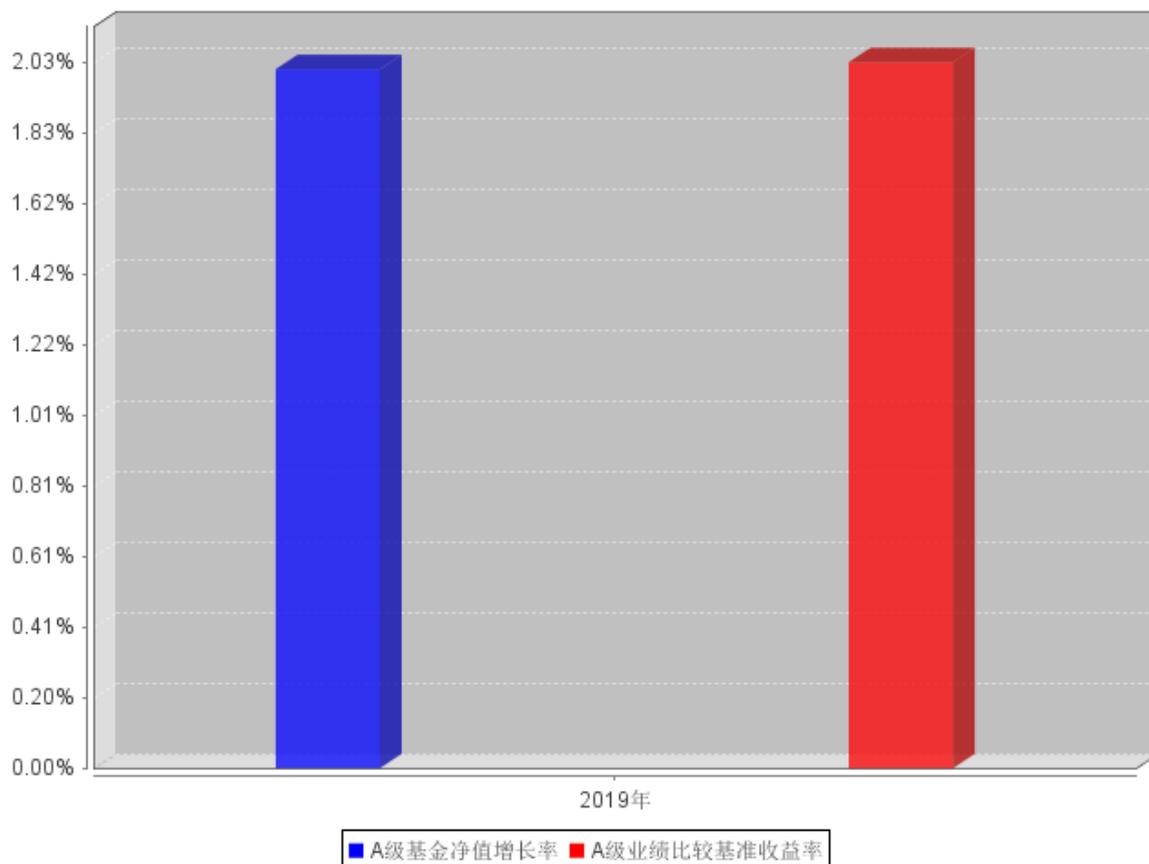
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



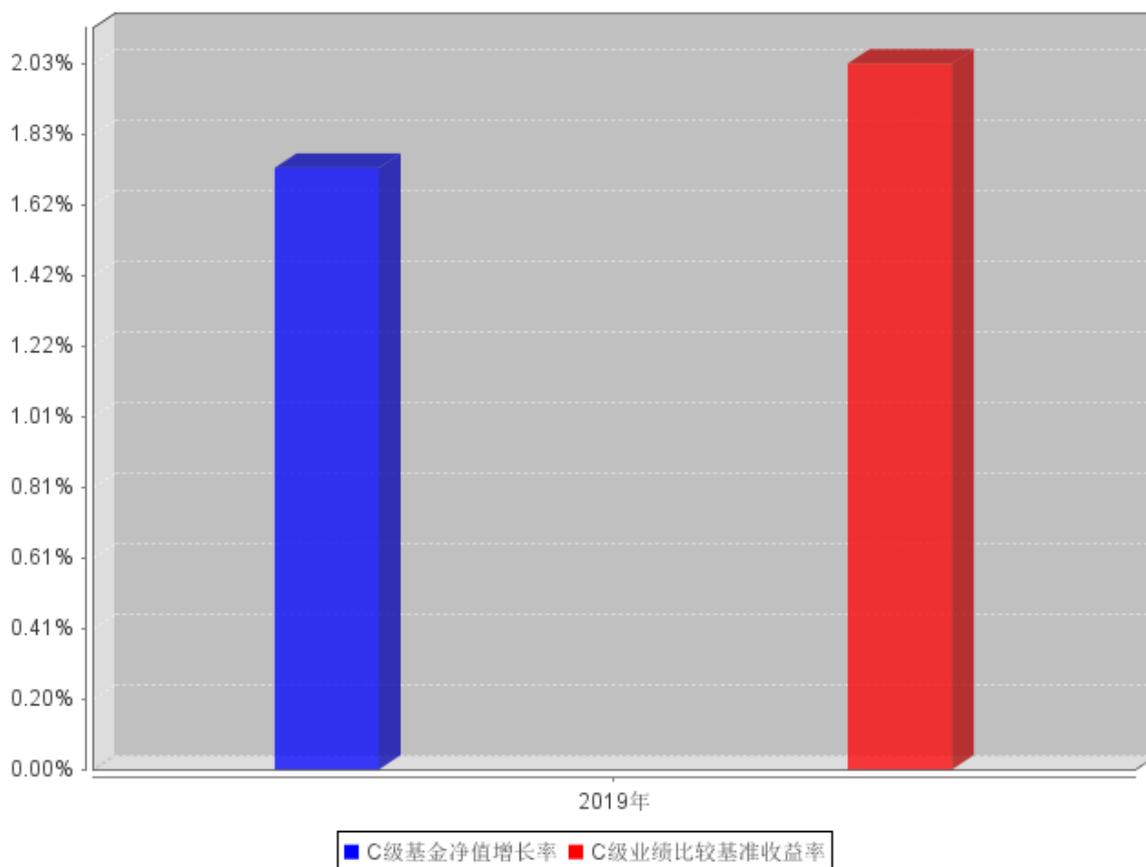
本基金的基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 日，按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

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 2019 年 6 月 21 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 4 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 2019 年 12 月 31 日，公司共管理 28 只开放式基金，证券投资基金管理规模 237.84 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		
陈诗昆	本基金基金经理	2019 年 6 月 21 日	-	8 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 月加入中金基金管理有限公司，现任组合投资部基金经理。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，

没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，本基金采用大类资产配置的策略，运作正常。我们会继续深入研究，力争更好的表现。

从中长期的战略资产配置层面来看，我们认为当前全球经济增长仍然面临一定压力，但国内库存周期已转向复苏，而 2020 年的通货膨胀在高基数下预计整体平稳，难以成为影响资产价格的主要因素，因此，我们调高了组合的权益仓位水平，同时降低债券久期。在结构上，尽管短期经济周期向上，但地产政策转向的背景下，国内整体经济增速料将进一步下台阶，同时，5G 周期将引领电子、传媒等科技板块迎来新一轮的三年以上的盈利周期，科技股大概率继续引领权益风险

偏好。

从短期的战术资产配置阶段来看，A 股情绪面和技术面全面转暖，经济信号出现显著改善，中美贸易摩擦进入阶段缓和。综合多方面考量，我们在短期战术层面维持中性偏多判断。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金衡盈 A 基金份额净值为 1.0201 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.01%；截至本报告期末中金衡盈 C 基金份额净值为 1.0173 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.73%；同期业绩比较基准收益率为 2.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

12 月以来，新兴市场国家 PMI 延续回暖，增强了市场对于全球制造业复苏的信心。从中国过去一年信贷扩张的情况来看，上半年全球制造业的温和复苏可期。国内方面，专项债的前倾有望对上半年的基建投资形成支撑。全球贸易关系的缓和与国内 M1 的弱企稳都可能支持制造业于上半年开启新一轮的补库周期，进而带动制造业投资的修复。2019 年以来，主流房企销售面积与销售价格呈明显的负相关关系，表明开发商主要通过降价支撑销售面积。由于 2019 年商品房销售均价同比增速仍有 7%以上的涨幅，以价换量可能仍有空间，在这种情况下短期地产的下行风险可能较为可控。总结而言，近期经济动能弱复苏，债券动能减弱，权益动能增强。

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，相关主要工作如下：

1) 紧密跟踪并组织落实法律法规、自律规则及监管要求，不断完善基金运作管理内部制度建设，促进依法合规展业；2) 研究、投资交易方面，围绕内幕交易、利用未公开信息交易等重点防范的违法违规行为 and 各项最新监管要求，开展合规培训，进一步提高员工合规守法意识。3) 营销与销售方面，持续对基金宣传推介材料、销售服务协议等材料文件进行合规审查，定期开展投资者适当性培训及销售业务专项培训，加强销售行为管理。4) 基金运作保障方面，持续为注册登记、基金会计、资金清算等业务提供合规咨询，适时开展合规检查，为基金运营安全提供法律合规支持。5) 信息披露方面，严格落实《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，更新信息披露工作流程，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、规范。6) 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，同时有重点地开展定期不定期的合规检查、内部稽核，促进公司合规运作。

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不断完

善，坚持维护基金份额持有人合法权益。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，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历。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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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 2001664 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	中金衡盈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 34 页的中金衡盈混合型证券投资基金（以下简称“中金衡盈基金”）财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2019 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2019 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，公允反映了中金衡盈基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2019 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2019 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，我们独立于中金衡盈基金，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>中金衡盈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盈基金 2019 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	中金衡盈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

<p>责任</p>	<p>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，中金衡盈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盈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，除非中金衡盈基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>中金衡盈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盈基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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) 评价中金衡盈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) 对中金衡盈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盈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盈基金不能持续经营。</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>我们与中金衡盈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>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>管祎铭 李瑞丛</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2020 年 4 月 15 日</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中金衡盈混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	9,322,662.47
结算备付金		4,375,682.37
存出保证金		33,212.80
交易性金融资产	7.4.7.2	177,169,730.95
其中：股票投资		56,410,980.95
基金投资		-
债券投资		120,758,750.00
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	10,058,135.09
应收证券清算款		5,149,213.52
应收利息	7.4.7.5	1,420,573.04
应收股利		-
应收申购款		2,052.80
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		207,531,263.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
负债：		
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		7,000,000.00
应付证券清算款		3,729,237.68
应付赎回款		10,250,230.95
应付管理人报酬		190,661.11
应付托管费		38,132.22
应付销售服务费		4,694.72
应付交易费用	7.4.7.7	100,564.86
应交税费		7,523.52
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	191,802.45
负债合计		21,512,847.51
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	182,387,172.87
未分配利润	7.4.7.10	3,631,242.66
所有者权益合计		186,018,415.53
负债和所有者权益总计		207,531,263.04

报告截止日2019年12月31日,中金衡盈A基金份额净值1.0201元,基金份额总额172,488,867.52份;中金衡盈C基金份额净值1.0173元,基金份额总额9,898,305.35份。中金衡盈份额总额合计为182,387,172.87份。

7.2 利润表

会计主体：中金衡盈混合型证券投资基金

本报告期：2019年6月21日(基金合同生效日)至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2019年6月21日(基金合同生效日)至2019年12月31日
一、收入		7,097,610.13
1.利息收入		4,474,570.84
其中：存款利息收入	7.4.7.11	167,012.27
债券利息收入		4,115,569.04
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		191,989.53
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-155,533.88
其中：股票投资收益	7.4.7.12	187,480.22
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-342,886.41
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-16,300.00
股利收益	7.4.7.16	16,172.31
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	2,520,551.54
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	258,021.63
减：二、费用		2,314,845.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,444,498.16

2. 托管费	7.4.10.2.2	288,899.64
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	57,388.31
4. 交易费用	7.4.7.19	155,728.96
5. 利息支出		153,426.13
其中：卖出回购金融资产支出		153,426.13
6. 税金及附加		6,451.94
7. 其他费用	7.4.7.20	208,452.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,782,764.53
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,782,764.53

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金衡盈混合型证券投资基金

本报告期：2019年6月21日(基金合同生效日)至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年6月21日(基金合同生效日)至2019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）	308,830,667.90	-	308,830,667.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,782,764.53	4,782,764.53
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）	-126,443,495.03	-1,151,521.87	-127,595,016.90
其中：1. 基金申购款	24,710,685.88	150,534.73	24,861,220.61
2. 基金赎回款	-151,154,180.91	-1,302,056.60	-152,456,237.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	182,387,172.87	3,631,242.66	186,018,415.53

本基金合同生效日为2019年6月21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：

<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

中金衡盈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 2019 年 4 月 2 日证监许可 [2019] 561 号《关于准予中金衡盈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、《中金衡盈混合型证券投资基金招募说明书》和《中金衡盈混合型证券投资基金基金份额发售公告》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，托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

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（以下简称“中金公司”）、北京蛋卷基金销售有限公司、中泰证券股份有限公司及招商银行等共同销售，募集期为 2019 年 5 月 20 日起至 2019 年 6 月 17 日。经向中国证监会备案，《中金衡盈混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 6 月 21 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 308,830,667.90 份（含利息转份额 34,172.03 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《中金衡盈混合型证券投资基金基金合同》和《中金衡盈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 / 申购费用、赎回费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购 / 申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金销售费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金衡盈混合型证券投资基金基金合同》和《中金衡盈混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要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上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合

交易所上市的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、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、股票期权、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〈年度报告和中期报告〉》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的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况、自 2019 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2019 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的首份财务报表，实际编制期间为自 2019 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2019 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：

-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；

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量；

-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：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-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；

-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：

-所转移金融资产的账面价值

-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：

- 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；
- 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。

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、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、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，每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《中金衡盈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；基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，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

本基金在本期末未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期末未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期末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：

(a)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。

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

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称“管理人”）运营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。

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

(d)对基金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。

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 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 2019 年 12 月 31 日
活期存款	9,322,662.47
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：	9,322,662.47

注：本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 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 2019 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	53,993,001.83	56,410,980.95	2,417,979.12	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	11,381,163.49	11,384,750.00	3,586.51
	银行间市场	109,275,014.09	109,374,000.00	98,985.91
	合计	120,656,177.58	120,758,750.00	102,572.42
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	174,649,179.41	177,169,730.95	2,520,551.54	

注：本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末未持有任何衍生金融资产/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 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	10,058,135.09	-
合计	10,058,135.09	-

注：本基金合同生效日为2019年6月21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

本基金于本期末无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 2019年12月31日
应收活期存款利息	2,448.22
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	689.04
应收债券利息	1,401,839.04
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	15,580.35
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	16.39
合计	1,420,573.04

注：1、其他为应收结算保证金利息。

2、本基金合同生效日为2019年6月21日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.6 其他资产

本基金于本期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	93,011.94

银行间市场应付交易费用	7,552.92
合计	100,564.86

注：本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 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 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	802.45
应付证券出借违约金	-
应付信息披露费	150,000.00
应付账户维护费	6,000.00
其他	35,000.00
合计	191,802.45

注：本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 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

中金衡盈 A		
项目	本期 2019 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	271,472,979.58	271,472,979.58
本期申购	14,923,718.60	14,923,718.60
本期赎回 (以“-”号填列)	-113,907,830.66	-113,907,830.66
- 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	172,488,867.52	172,488,867.52

金额单位：人民币元

中金衡盈 C		
项目	本期 2019 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	37,357,688.32	37,357,688.32
本期申购	9,786,967.28	9,786,967.28
本期赎回 (以“-”号填列)	-37,246,350.25	-37,246,350.25
- 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	9,898,305.35	9,898,305.35

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

中金衡盈 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	2,099,764.57	2,408,014.40	4,507,778.97
本期基金份额交易产生的变动数	-652,100.52	-395,462.73	-1,047,563.25
其中：基金申购款	57,261.24	12,281.67	69,542.91
基金赎回款	-709,361.76	-407,744.40	-1,117,106.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,447,664.05	2,012,551.67	3,460,215.72

单位：人民币元

中金衡盈 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	162,448.42	112,537.14	274,985.56
本期基金份额交易产生的变动数	-106,638.36	2,679.74	-103,958.62
其中：基金申购款	36,129.86	44,861.96	80,991.82
基金赎回款	-142,768.22	-42,182.22	-184,950.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,810.06	115,216.88	171,026.94

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年6月21日(基金合同生效日)至2019年12月31日
活期存款利息收入	87,974.87
定期存款利息收入	67,083.33
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,782.85
其他	171.22

合计	167,012.27
----	------------

注：1、其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

2、本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 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 2019年6月21日(基金合同生效日) 至2019年12月31日
卖出股票成交总额	36,693,551.17
减：卖出股票成本总额	36,506,070.95
买卖股票差价收入	187,480.22

注：本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 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 2019年6月21日(基金合同生效日)至 2019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	-342,886.41
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	-342,886.41

注：本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 日，无上年度可比期间数据。

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 2019年6月21日(基金合同生效日)至 2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	728,361,354.84
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	719,470,842.00
减：应收利息总额	9,233,399.25
买卖债券差价收入	-342,886.41

注：本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 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

本基金在本期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本期间无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2019年6月21日(基金合同生效日)至2019年12月31日
国债期货投资收益	-16,300.00
股指期货-投资收益	-

注：本基金合同生效日为2019年6月21日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年6月21日(基金合同生效日)至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	16,172.31
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	16,172.31

注：本基金合同生效日为2019年6月21日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年6月21日(基金合同生效日)至2019

	年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	2,520,551.54
——股票投资	2,417,979.12
——债券投资	102,572.42
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	2,520,551.54

注：本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	258,021.63
合计	258,021.63

注：本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	141,224.96
银行间市场交易费用	14,400.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
期货交易费用	104.00
合计	155,728.96

注：本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2019
----	--------------------------------------

	年 12 月 31 日
审计费用	35,000.00
信息披露费	150,000.00
证券出借违约金	-
其他	400.00
上清所证书费用	200.00
汇划手续费	10,852.46
帐户维护费	12,000.00
合计	208,452.46

注：本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.21 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
招商银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（“中金财富证券”，原“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：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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 2019年6月21日(基金合同生效日)至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中金财富证券	127,190,261.45	100.00%

注：本基金合同生效日为2019年6月21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 2019年6月21日(基金合同生效日)至2019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	26,965,240.00	11.89%
中金财富证券	199,772,186.44	88.11%

注：本基金合同生效日为2019年6月21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 2019年6月21日(基金合同生效日)至2019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	50,000,000.00	2.96%
中金财富证券	1,636,600,000.00	97.04%

注：本基金合同生效日为2019年6月21日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年6月21日(基金合同生效日)至2019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
中金财富证券	93,011.94	100.00%	93,011.94	100.00%

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。

3、本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 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 2019 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,444,498.16
其中：支付销售机构的客户维护费	902,287.16

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 2019 年 6 月 21 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 2019 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	288,899.64

注：1、支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%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 × 0.20% / 当年天数

2、本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 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	本期

各关联方名称	2019 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金衡盈 A	中金衡盈 C	合计
中金财富证券	-	33,368.07	33,368.07
招商银行	-	23,491.24	23,491.24
合计	-	56,859.31	56,859.31

注：1、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基金资产净值 0.50% 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 × 0.50% / 当年天数

2、本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 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

本基金在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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金在本期及上期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期间未持有过本基金。

7.4.10.5.2 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在本期末未持有本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	9,322,662.47	87,974.87	-	-

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

2、本基金通过“招商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 2019 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 1,425,299.17 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 11,954.07 元。

3、本基金合同生效日为 2019 年 6 月 21 日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期间未进行过利润分配。

7.4.12 期末（2019 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

根据中国证监会相关规定，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。证券投资基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券如下：

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002466	天齐锂业	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 3 日	老股东配售未上市	8.75	30.18	270	2,362.50	8,148.60	-

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
603799	华友钴业	2019 年 12 月 31 日	重大资产重组	39.39	2020 年 1 月 2 日	40.43	10,600	362,127.45	417,534.00	-

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

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未进行银行间市场债券正回购交易。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2019 年 12 月 31 日,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 7,000,000.00 元,已于 2020 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和 / 或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2019 年 12 月 31 日,本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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,其预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金,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。本基金可投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	20,129,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	60,130,000.00	-
合计	80,259,000.00	-

注：以上按短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。

7.4.13.2.2 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	29,115,000.00	-
合计	29,115,000.00	-

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

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%，在行业和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 2019 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	9,322,662.47	-	-	-	9,322,662.47
结算备付金	1,392,086.37	-	-	2,983,596.00	4,375,682.37
存出保证金	33,212.80	-	-	-	33,212.80

交易性金融资产-股票投资				56,410,980.95	56,410,980.95
交易性金融资产-债券投资	120,758,750.00				120,758,750.00
买入返售金融资产	10,058,135.09				10,058,135.09
应收证券清算款				5,149,213.52	5,149,213.52
应收利息				1,420,573.04	1,420,573.04
应收股利					
应收申购款				2,052.80	2,052.80
资产总计	141,564,846.73			65,966,416.31	207,531,263.04
负债					
卖出回购金融资产款	7,000,000.00				7,000,000.00
应付证券清算款				3,729,237.68	3,729,237.68
应付赎回款				10,250,230.95	10,250,230.95
应付管理人报酬				190,661.11	190,661.11
应付托管费				38,132.22	38,132.22
应付交易费用				100,564.86	100,564.86
应付销售服务费				4,694.72	4,694.72
应交税费				7,523.52	7,523.52
应付利息					
其他负债				191,802.45	191,802.45
负债总计	7,000,000.00			14,512,847.51	21,512,847.51
利率敏感度缺口	134,564,846.73			51,453,568.80	186,018,415.53
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
负债					

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。		
	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（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	123,809.70	-

	市场利率上升 25 个基点	-123,809.70	
--	---------------	-------------	--

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 2019年12月31日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	56,410,980.95	30.33	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	120,758,750.00	64.92	-	-
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	177,169,730.95	95.25	-	-

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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(a) 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	56,410,980.95	55,985,298.35	8,148.60	417,534.00
-债券投资	120,758,750.00	-	120,758,750.00	-
-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	177,169,730.95	55,985,298.35	120,766,898.60	417,534.00

于2019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425,682.60元。于2019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。

(b) 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。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019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。

7.4.14.1.2 其他金融工具的公允价值（期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、卖出回购金融资产款和其他金融负债，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	56,410,980.95	27.18
	其中：股票	56,410,980.95	27.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	120,758,750.00	58.19
	其中：债券	120,758,750.00	58.19
	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	10,058,135.09	4.85
	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	13,698,344.84	6.60
8	其他各项资产	6,605,052.16	3.18
9	合计	207,531,263.04	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	201,799.00	0.11
B	采矿业	2,138,300.00	1.15
C	制造业	29,842,951.42	16.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	788,489.00	0.42
E	建筑业	935,578.00	0.50
F	批发和零售业	429,415.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	1,582,292.00	0.85
H	住宿和餐饮业	673,065.00	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,334,679.00	1.79
J	金融业	11,851,293.33	6.37
K	房地产业	2,963,499.00	1.59
L	租赁和商务服务业	476,354.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	140,154.00	0.08

N	水利、环境和公共设施管理业	211,179.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	55,618.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	713,204.20	0.38
S	综合	73,111.00	0.04
	合计	56,410,980.95	30.33

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	601318	中国平安	26,500	2,264,690.00	1.22
2	600031	三一重工	72,600	1,237,830.00	0.67
3	300408	三环集团	53,100	1,183,068.00	0.64
4	000636	风华高科	66,500	990,185.00	0.53
5	601601	中国太保	24,500	927,080.00	0.50
6	601628	中国人寿	23,999	836,845.13	0.45
7	000002	万科 A	25,500	820,590.00	0.44
8	600030	中信证券	30,600	774,180.00	0.42
9	600176	中国巨石	70,600	769,540.00	0.41
10	600690	海尔智家	39,400	768,300.00	0.41
11	601336	新华保险	15,200	747,080.00	0.40
12	300124	汇川技术	23,700	726,168.00	0.39
13	000069	华侨城 A	90,500	704,995.00	0.38
14	002508	老板电器	20,824	704,059.44	0.38
15	000401	冀东水泥	41,200	700,812.00	0.38
16	300059	东方财富	43,000	678,110.00	0.36
17	600258	首旅酒店	32,100	661,581.00	0.36
18	601636	旗滨集团	120,200	659,898.00	0.35
19	600761	安徽合力	64,600	628,558.00	0.34
20	600703	三安光电	31,700	582,012.00	0.31
21	601688	华泰证券	28,500	578,835.00	0.31
22	600741	华域汽车	22,000	571,780.00	0.31
23	002456	欧菲光	35,300	550,680.00	0.30
24	000651	格力电器	8,100	531,198.00	0.29

25	000625	长安汽车	52,800	529,584.00	0.28
26	002146	荣盛发展	52,300	514,109.00	0.28
27	300750	宁德时代	4,800	510,720.00	0.27
28	601166	兴业银行	25,200	498,960.00	0.27
29	000333	美的集团	8,200	477,650.00	0.26
30	000425	徐工机械	86,100	470,967.00	0.25
31	600584	长电科技	20,900	459,382.00	0.25
32	601668	中国建筑	80,900	454,658.00	0.24
33	002110	三钢闽光	48,000	449,280.00	0.24
34	600188	兖州煤业	42,300	446,688.00	0.24
35	600971	恒源煤电	73,800	441,324.00	0.24
36	000039	中集集团	44,000	432,080.00	0.23
37	002185	华天科技	56,700	423,549.00	0.23
38	002156	通富微电	25,700	422,765.00	0.23
39	603799	华友钴业	10,600	417,534.00	0.22
40	002035	华帝股份	29,800	399,916.00	0.21
41	600352	浙江龙盛	26,700	386,349.00	0.21
42	600362	江西铜业	22,800	386,004.00	0.21
43	600029	南方航空	52,800	379,104.00	0.20
44	601111	中国国航	39,000	377,910.00	0.20
45	601992	金隅集团	93,900	350,247.00	0.19
46	000807	云铝股份	67,900	349,006.00	0.19
47	002092	中泰化学	49,000	332,710.00	0.18
48	601678	滨化股份	62,900	321,419.00	0.17
49	603993	洛阳钼业	71,000	309,560.00	0.17
50	300136	信维通信	6,700	304,046.00	0.16
51	002466	天齐锂业	9,870	297,876.60	0.16
52	603737	三棵树	3,400	274,210.00	0.15
53	600900	长江电力	14,900	273,862.00	0.15
54	000001	平安银行	16,600	273,070.00	0.15
55	600016	民生银行	42,400	267,544.00	0.14
56	000789	万年青	21,800	266,178.00	0.14
57	601328	交通银行	46,900	264,047.00	0.14
58	600000	浦发银行	20,200	249,874.00	0.13
59	601288	农业银行	65,500	241,695.00	0.13
60	601398	工商银行	37,000	217,560.00	0.12
61	002415	海康威视	6,600	216,084.00	0.12
62	600837	海通证券	13,900	214,894.00	0.12
63	300618	寒锐钴业	2,600	214,214.00	0.12

64	002475	立讯精密	5,500	200,750.00	0.11
65	300144	宋城演艺	6,400	197,824.00	0.11
66	300014	亿纬锂能	3,900	195,624.00	0.11
67	000725	京东方 A	42,300	192,042.00	0.10
68	600048	保利地产	11,700	189,306.00	0.10
69	601899	紫金矿业	41,100	188,649.00	0.10
70	600585	海螺水泥	3,300	180,840.00	0.10
71	300383	光环新网	8,900	178,623.00	0.10
72	603833	欧派家居	1,500	175,500.00	0.09
73	300450	先导智能	3,900	175,266.00	0.09
74	300033	同花顺	1,600	174,576.00	0.09
75	300253	卫宁健康	11,600	173,768.00	0.09
76	300017	网宿科技	16,600	158,198.00	0.09
77	300207	欣旺达	8,100	158,112.00	0.08
78	002572	索菲亚	7,500	157,125.00	0.08
79	603816	顾家家居	3,400	155,482.00	0.08
80	601211	国泰君安	8,200	151,618.00	0.08
81	601888	中国国旅	1,700	151,215.00	0.08
82	300024	机器人	10,700	149,800.00	0.08
83	600309	万华化学	2,600	146,042.00	0.08
84	300088	长信科技	14,200	145,834.00	0.08
85	601169	北京银行	25,300	143,704.00	0.08
86	600104	上汽集团	6,000	143,100.00	0.08
87	603208	江山欧派	2,800	142,688.00	0.08
88	000063	中兴通讯	4,000	141,560.00	0.08
89	300012	华测检测	9,400	140,154.00	0.08
90	002142	宁波银行	4,900	137,935.00	0.07
91	300168	万达信息	8,900	137,327.00	0.07
92	600009	上海机场	1,700	133,875.00	0.07
93	601988	中国银行	36,200	133,578.00	0.07
94	300315	掌趣科技	21,400	132,038.00	0.07
95	000910	大亚圣象	9,400	131,506.00	0.07
96	000338	潍柴动力	8,100	128,628.00	0.07
97	300454	深信服	1,100	125,829.00	0.07
98	002714	牧原股份	1,400	124,306.00	0.07
99	300413	芒果超媒	3,470	121,311.20	0.07
100	601818	光大银行	27,500	121,275.00	0.07
101	300070	碧水源	15,900	120,840.00	0.06
102	601766	中国中车	16,400	117,096.00	0.06

103	600028	中国石化	22,800	116,508.00	0.06
104	601229	上海银行	12,200	115,778.00	0.06
105	002027	分众传媒	18,300	114,558.00	0.06
106	600919	江苏银行	15,800	114,392.00	0.06
107	601012	隆基股份	4,500	111,735.00	0.06
108	000100	TCL 集团	24,200	108,174.00	0.06
109	300285	国瓷材料	4,700	107,395.00	0.06
110	001979	招商蛇口	5,400	107,298.00	0.06
111	300271	华宇软件	4,100	104,140.00	0.06
112	601088	中国神华	5,500	100,375.00	0.05
113	300433	蓝思科技	7,000	96,740.00	0.05
114	601857	中国石油	16,500	96,195.00	0.05
115	600406	国电南瑞	4,500	95,310.00	0.05
116	600183	生益科技	4,500	94,140.00	0.05
117	300274	阳光电源	8,900	93,717.00	0.05
118	600050	中国联通	15,800	93,062.00	0.05
119	300058	蓝色光标	16,200	91,530.00	0.05
120	300113	顺网科技	3,500	89,915.00	0.05
121	002230	科大讯飞	2,600	89,648.00	0.05
122	600999	招商证券	4,900	89,621.00	0.05
123	601009	南京银行	10,100	88,577.00	0.05
124	300166	东方国信	6,800	88,400.00	0.05
125	300628	亿联网络	1,200	86,892.00	0.05
126	600019	宝钢股份	15,000	86,100.00	0.05
127	603501	韦尔股份	600	86,040.00	0.05
128	600570	恒生电子	1,100	85,503.00	0.05
129	300296	利亚德	11,100	85,137.00	0.05
130	601006	大秦铁路	10,200	83,742.00	0.05
131	300115	长盈精密	4,700	83,613.00	0.04
132	600745	闻泰科技	900	83,250.00	0.04
133	601939	建设银行	11,500	83,145.00	0.04
134	601390	中国中铁	13,900	82,566.00	0.04
135	603160	汇顶科技	400	82,520.00	0.04
136	601989	中国重工	15,700	82,268.00	0.04
137	603986	兆易创新	400	81,956.00	0.04
138	000776	广发证券	5,400	81,918.00	0.04
139	300496	中科创达	1,800	81,252.00	0.04
140	600015	华夏银行	10,500	80,535.00	0.04
141	000166	申万宏源	15,700	80,384.00	0.04

142	300212	易华录	2,400	80,256.00	0.04
143	300316	晶盛机电	5,100	80,172.00	0.04
144	002241	歌尔股份	4,000	79,680.00	0.04
145	601186	中国铁建	7,800	79,092.00	0.04
146	002236	大华股份	3,900	77,532.00	0.04
147	300001	特锐德	4,491	77,155.38	0.04
148	300418	昆仑万维	4,600	77,050.00	0.04
149	300251	光线传媒	6,200	73,160.00	0.04
150	300027	华谊兄弟	15,700	72,691.00	0.04
151	002594	比亚迪	1,500	71,505.00	0.04
152	300010	立思辰	5,500	71,005.00	0.04
153	300226	上海钢联	900	70,020.00	0.04
154	600958	东方证券	6,400	68,864.00	0.04
155	000876	新希望	3,400	67,830.00	0.04
156	002008	大族激光	1,600	64,000.00	0.03
157	300699	光威复材	1,400	63,700.00	0.03
158	002024	苏宁易购	6,300	63,693.00	0.03
159	002202	金风科技	5,300	63,335.00	0.03
160	600588	用友网络	2,200	62,480.00	0.03
161	300133	华策影视	8,400	62,160.00	0.03
162	601377	兴业证券	8,500	60,180.00	0.03
163	601225	陕西煤业	6,600	59,334.00	0.03
164	000157	中联重科	8,800	58,784.00	0.03
165	600547	山东黄金	1,800	58,716.00	0.03
166	600660	福耀玻璃	2,400	57,576.00	0.03
167	600340	华夏幸福	2,000	57,400.00	0.03
168	300308	中际旭创	1,100	57,365.00	0.03
169	300073	当升科技	2,100	57,330.00	0.03
170	300182	捷成股份	16,400	57,236.00	0.03
171	601901	方正证券	6,600	57,222.00	0.03
172	002916	深南电路	400	56,840.00	0.03
173	601138	工业富联	3,100	56,637.00	0.03
174	601669	中国电建	12,900	55,986.00	0.03
175	002352	顺丰控股	1,500	55,785.00	0.03
176	300180	华峰超纤	6,300	55,692.00	0.03
177	002463	沪电股份	2,500	55,525.00	0.03
178	601985	中国核电	10,700	53,500.00	0.03
179	300072	三聚环保	8,400	53,088.00	0.03
180	600346	恒力石化	3,300	53,064.00	0.03

181	300078	思创医惠	4,300	52,804.00	0.03
182	002736	国信证券	4,200	52,710.00	0.03
183	600383	金地集团	3,600	52,200.00	0.03
184	000066	中国长城	3,300	51,348.00	0.03
185	300188	美亚柏科	3,000	51,300.00	0.03
186	601933	永辉超市	6,800	51,272.00	0.03
187	002555	三七互娱	1,900	51,167.00	0.03
188	600010	宝钢股份	38,700	51,084.00	0.03
189	601108	财通证券	4,500	51,030.00	0.03
190	002049	紫光国微	1,000	50,840.00	0.03
191	600886	国投电力	5,500	50,490.00	0.03
192	000783	长江证券	7,000	49,980.00	0.03
193	002405	四维图新	3,100	49,910.00	0.03
194	300170	汉得信息	5,100	49,419.00	0.03
195	002602	世纪华通	4,300	49,149.00	0.03
196	300098	高新兴	8,200	48,626.00	0.03
197	601877	正泰电器	1,800	48,240.00	0.03
198	300036	超图软件	2,400	47,832.00	0.03
199	300457	赢合科技	1,400	47,530.00	0.03
200	600795	国电电力	20,300	47,502.00	0.03
201	300197	铁汉生态	15,400	47,124.00	0.03
202	002311	海大集团	1,300	46,800.00	0.03
203	002607	中公教育	2,600	46,488.00	0.02
204	300324	旋极信息	8,200	45,920.00	0.02
205	601788	光大证券	3,500	45,850.00	0.02
206	300038	数知科技	5,300	45,686.00	0.02
207	600018	上港集团	7,900	45,583.00	0.02
208	002460	赣锋锂业	1,300	45,279.00	0.02
209	300002	神州泰岳	13,800	44,988.00	0.02
210	600438	通威股份	3,400	44,642.00	0.02
211	000938	紫光股份	1,400	44,240.00	0.02
212	300476	胜宏科技	2,700	44,037.00	0.02
213	002371	北方华创	500	44,000.00	0.02
214	600705	中航资本	8,900	43,165.00	0.02
215	600201	生物股份	2,300	43,056.00	0.02
216	600536	中国软件	600	43,014.00	0.02
217	600011	华能国际	7,700	42,966.00	0.02
218	601555	东吴证券	4,300	42,957.00	0.02
219	600115	东方航空	7,300	42,413.00	0.02

220	600606	绿地控股	6,100	42,395.00	0.02
221	600061	国投资本	2,800	42,392.00	0.02
222	002465	海格通信	3,900	42,237.00	0.02
223	601997	贵阳银行	4,400	42,064.00	0.02
224	600089	特变电工	6,300	41,895.00	0.02
225	600271	航天信息	1,800	41,706.00	0.02
226	002050	三花智控	2,400	41,592.00	0.02
227	600177	雅戈尔	5,900	41,123.00	0.02
228	300474	景嘉微	700	41,006.00	0.02
229	002410	广联达	1,200	40,776.00	0.02
230	600109	国金证券	4,300	39,990.00	0.02
231	600426	华鲁恒升	2,000	39,740.00	0.02
232	002624	完美世界	900	39,726.00	0.02
233	002493	荣盛石化	3,200	39,648.00	0.02
234	000723	美锦能源	4,200	39,606.00	0.02
235	000768	中航飞机	2,400	39,312.00	0.02
236	600111	北方稀土	3,600	39,024.00	0.02
237	300567	精测电子	700	38,388.00	0.02
238	601600	中国铝业	10,800	38,232.00	0.02
239	603019	中科曙光	1,100	38,038.00	0.02
240	300616	尚品宅配	500	37,260.00	0.02
241	002439	启明星辰	1,100	37,180.00	0.02
242	002271	东方雨虹	1,400	36,834.00	0.02
243	300377	赢时胜	3,200	36,768.00	0.02
244	002120	韵达股份	1,100	36,630.00	0.02
245	600487	亨通光电	2,200	35,772.00	0.02
246	000786	北新建材	1,400	35,630.00	0.02
247	300068	南都电源	3,300	35,574.00	0.02
248	300747	锐科激光	300	35,340.00	0.02
249	002179	中航光电	900	35,154.00	0.02
250	600100	同方股份	4,000	35,080.00	0.02
251	600739	辽宁成大	2,300	35,029.00	0.02
252	600522	中天科技	4,200	34,860.00	0.02
253	002797	第一创业	4,200	34,776.00	0.02
254	002384	东山精密	1,500	34,725.00	0.02
255	300159	新研股份	8,800	34,496.00	0.02
256	600221	海航控股	19,900	34,427.00	0.02
257	601919	中远海控	6,500	34,255.00	0.02
258	002129	中环股份	2,900	34,249.00	0.02

259	600516	方大炭素	2,800	34,048.00	0.02
260	002157	正邦科技	2,100	34,020.00	0.02
261	601618	中国中冶	12,100	33,880.00	0.02
262	600498	烽火通信	1,200	32,940.00	0.02
263	600066	宇通客车	2,300	32,775.00	0.02
264	600637	东方明珠	3,500	32,760.00	0.02
265	002127	南极电商	3,000	32,730.00	0.02
266	601998	中信银行	5,300	32,701.00	0.02
267	600926	杭州银行	3,500	32,060.00	0.02
268	600848	上海临港	1,300	31,915.00	0.02
269	002506	协鑫集成	5,400	31,914.00	0.02
270	300203	聚光科技	1,900	31,749.00	0.02
271	600801	华新水泥	1,200	31,716.00	0.02
272	000961	中南建设	3,000	31,650.00	0.02
273	000728	国元证券	3,400	31,518.00	0.02
274	000750	国海证券	5,900	31,506.00	0.02
275	002414	高德红外	1,500	31,500.00	0.02
276	600004	白云机场	1,800	31,410.00	0.02
277	002673	西部证券	3,200	31,360.00	0.02
278	300459	金科文化	9,800	31,262.00	0.02
279	601727	上海电气	6,200	30,876.00	0.02
280	002273	水晶光电	1,900	30,704.00	0.02
281	000988	华工科技	1,500	30,435.00	0.02
282	600893	航发动力	1,400	30,352.00	0.02
283	601198	东兴证券	2,300	30,222.00	0.02
284	600068	葛洲坝	4,500	30,060.00	0.02
285	603444	吉比特	100	29,849.00	0.02
286	000623	吉林敖东	1,800	29,754.00	0.02
287	601872	招商轮船	3,600	29,736.00	0.02
288	000547	航天发展	2,900	29,638.00	0.02
289	002353	杰瑞股份	800	29,568.00	0.02
290	600674	川投能源	3,000	29,550.00	0.02
291	603899	晨光文具	600	29,244.00	0.02
292	600642	申能股份	5,000	29,050.00	0.02
293	002500	山西证券	3,500	29,015.00	0.02
294	600816	安信信托	6,500	28,860.00	0.02
295	300145	中金环境	8,300	28,801.00	0.02
296	600673	东阳光	2,800	28,672.00	0.02
297	000975	银泰资源	2,100	28,581.00	0.02

298	002268	卫士通	1,100	28,369.00	0.02
299	601838	成都银行	3,100	28,117.00	0.02
300	601878	浙商证券	2,500	27,825.00	0.01
301	002195	二三四五	8,600	27,778.00	0.01
302	600023	浙能电力	7,000	27,720.00	0.01
303	000656	金科股份	3,600	27,648.00	0.01
304	600208	新湖中宝	7,300	27,594.00	0.01
305	600885	宏发股份	800	27,560.00	0.01
306	002078	太阳纸业	2,800	27,552.00	0.01
307	002926	华西证券	2,500	27,525.00	0.01
308	600369	西南证券	5,300	27,507.00	0.01
309	601128	常熟银行	3,000	27,330.00	0.01
310	600219	南山铝业	12,100	27,104.00	0.01
311	601117	中国化学	4,200	27,048.00	0.01
312	002387	维信诺	1,700	27,030.00	0.01
313	600170	上海建工	7,600	26,904.00	0.01
314	002340	格林美	5,500	26,785.00	0.01
315	601881	中国银河	2,300	26,703.00	0.01
316	600583	海油工程	3,600	26,568.00	0.01
317	601021	春秋航空	600	26,334.00	0.01
318	000686	东北证券	2,800	26,040.00	0.01
319	300666	江丰电子	600	25,740.00	0.01
320	002841	视源股份	300	25,710.00	0.01
321	601018	宁波港	6,700	25,460.00	0.01
322	002739	万达电影	1,400	25,410.00	0.01
323	002373	千方科技	1,400	25,256.00	0.01
324	600879	航天电子	4,200	25,116.00	0.01
325	000703	恒逸石化	1,800	25,056.00	0.01
326	000998	隆平高科	1,700	25,007.00	0.01
327	601100	恒立液压	500	24,875.00	0.01
328	002601	龙鳞佰利	1,600	24,624.00	0.01
329	600489	中金黄金	2,900	24,592.00	0.01
330	000630	铜陵有色	10,400	24,232.00	0.01
331	002299	圣农发展	1,000	24,080.00	0.01
332	600482	中国动力	1,200	24,000.00	0.01
333	002385	大北农	4,800	23,904.00	0.01
334	600038	中直股份	500	23,855.00	0.01
335	002281	光迅科技	800	23,824.00	0.01
336	600325	华发股份	3,000	23,490.00	0.01

337	300367	东方网力	5,400	23,382.00	0.01
338	600909	华安证券	3,200	23,360.00	0.01
339	600143	金发科技	3,200	23,296.00	0.01
340	600699	均胜电子	1,300	23,270.00	0.01
341	000627	天茂集团	3,300	23,232.00	0.01
342	600460	士兰微	1,500	23,205.00	0.01
343	002032	苏泊尔	300	23,034.00	0.01
344	600845	宝信软件	700	23,030.00	0.01
345	600528	中铁工业	2,000	23,000.00	0.01
346	002081	金螳螂	2,600	22,932.00	0.01
347	000581	威孚高科	1,200	22,860.00	0.01
348	300724	捷佳伟创	600	22,734.00	0.01
349	600410	华胜天成	2,200	22,682.00	0.01
350	000778	新兴铸管	5,400	22,518.00	0.01
351	300373	扬杰科技	1,300	22,360.00	0.01
352	600820	隧道股份	3,700	22,348.00	0.01
353	000009	中国宝安	3,600	22,284.00	0.01
354	000997	新大陆	1,400	22,232.00	0.01
355	601005	重庆钢铁	12,000	22,200.00	0.01
356	600760	中航沈飞	700	22,120.00	0.01
357	000671	阳光城	2,600	22,100.00	0.01
358	002075	沙钢股份	3,500	21,805.00	0.01
359	600315	上海家化	700	21,658.00	0.01
360	600153	建发股份	2,400	21,576.00	0.01
361	600895	张江高科	1,400	21,434.00	0.01
362	600118	中国卫星	1,000	21,370.00	0.01
363	000629	攀钢钒钛	7,300	21,316.00	0.01
364	601066	中信建投	700	21,280.00	0.01
365	600655	豫园股份	2,700	21,168.00	0.01
366	601231	环旭电子	1,100	21,153.00	0.01
367	600549	厦门钨业	1,600	20,864.00	0.01
368	600567	山鹰纸业	5,500	20,735.00	0.01
369	601966	玲珑轮胎	900	20,637.00	0.01
370	600466	蓝光发展	2,800	20,636.00	0.01
371	600486	扬农化工	300	20,589.00	0.01
372	600497	驰宏锌锗	4,700	20,586.00	0.01
373	002250	联化科技	1,200	20,556.00	0.01
374	600027	华电国际	5,600	20,552.00	0.01
375	601168	西部矿业	3,100	20,522.00	0.01

376	601333	广深铁路	6,700	20,502.00	0.01
377	002131	利欧股份	6,900	20,493.00	0.01
378	600094	大名城	3,500	20,475.00	0.01
379	600839	四川长虹	7,000	20,370.00	0.01
380	600663	陆家嘴	1,500	20,265.00	0.01
381	601866	中远海发	7,800	20,202.00	0.01
382	002812	恩捷股份	400	20,200.00	0.01
383	600376	首开股份	2,500	19,925.00	0.01
384	603000	人民网	1,000	19,790.00	0.01
385	600977	中国电影	1,300	19,786.00	0.01
386	000060	中金岭南	4,600	19,780.00	0.01
387	600881	亚泰集团	6,200	19,778.00	0.01
388	000690	宝新能源	3,500	19,775.00	0.01
389	002690	美亚光电	500	19,550.00	0.01
390	000089	深圳机场	2,000	19,540.00	0.01
391	002153	石基信息	500	19,500.00	0.01
392	002191	劲嘉股份	1,700	19,397.00	0.01
393	600875	东方电气	2,100	19,299.00	0.01
394	600718	东软集团	1,700	19,295.00	0.01
395	601808	中海油服	1,000	19,200.00	0.01
396	600811	东方集团	5,700	19,152.00	0.01
397	000878	云南铜业	1,400	19,124.00	0.01
398	600959	江苏有线	4,800	19,104.00	0.01
399	002670	国盛金控	1,500	19,065.00	0.01
400	000830	鲁西化工	1,800	18,918.00	0.01
401	002074	国轩高科	1,300	18,915.00	0.01
402	000960	锡业股份	1,800	18,792.00	0.01
403	601238	广汽集团	1,600	18,704.00	0.01
404	002221	东华能源	2,400	18,624.00	0.01
405	601633	长城汽车	2,100	18,585.00	0.01
406	000709	河钢股份	7,200	18,576.00	0.01
407	600166	福田汽车	8,800	18,392.00	0.01
408	000983	西山煤电	3,000	18,390.00	0.01
409	600022	山东钢铁	12,800	18,304.00	0.01
410	002152	广电运通	1,900	18,259.00	0.01
411	600297	广汇汽车	5,600	18,256.00	0.01
412	600160	巨化股份	2,500	18,200.00	0.01
413	002558	巨人网络	1,000	18,060.00	0.01
414	002938	鹏鼎控股	400	17,960.00	0.01

415	601216	君正集团	5,700	17,841.00	0.01
416	600266	城建发展	2,200	17,820.00	0.01
417	600737	中粮糖业	2,100	17,766.00	0.01
418	002217	合力泰	3,200	17,760.00	0.01
419	300222	科大智能	1,900	17,727.00	0.01
420	600398	海澜之家	2,300	17,664.00	0.01
421	600260	凯乐科技	1,300	17,641.00	0.01
422	002085	万丰奥威	2,520	17,640.00	0.01
423	600755	厦门国贸	2,400	17,616.00	0.01
424	600282	南钢股份	5,100	17,595.00	0.01
425	600392	盛和资源	1,900	17,233.00	0.01
426	002411	延安必康	1,100	17,193.00	0.01
427	600804	鹏博士	2,800	17,136.00	0.01
428	600037	歌华有线	1,900	17,119.00	0.01
429	600167	联美控股	1,300	17,108.00	0.01
430	603659	璞泰来	200	17,030.00	0.01
431	600967	内蒙一机	1,600	17,008.00	0.01
432	600580	卧龙电驱	1,400	16,828.00	0.01
433	002583	海能达	2,000	16,820.00	0.01
434	601098	中南传媒	1,400	16,716.00	0.01
435	601699	潞安环能	2,300	16,698.00	0.01
436	600435	北方导航	2,000	16,640.00	0.01
437	600808	马钢股份	5,400	16,578.00	0.01
438	000031	大悦城	2,300	16,514.00	0.01
439	603885	吉祥航空	1,100	16,500.00	0.01
440	601360	三六零	700	16,457.00	0.01
441	600373	中文传媒	1,200	16,332.00	0.01
442	600643	爱建集团	1,700	16,320.00	0.01
443	002174	游族网络	700	16,289.00	0.01
444	000883	湖北能源	3,900	16,263.00	0.01
445	000598	兴蓉环境	3,500	16,205.00	0.01
446	300323	华灿光电	2,300	16,100.00	0.01
447	600026	中远海能	2,500	15,950.00	0.01
448	002372	伟星新材	1,200	15,804.00	0.01
449	600171	上海贝岭	1,000	15,750.00	0.01
450	601118	海南橡胶	3,200	15,744.00	0.01
451	603077	和邦生物	10,600	15,688.00	0.01
452	600064	南京高科	1,600	15,600.00	0.01
453	002368	太极股份	400	15,568.00	0.01

454	000563	陕国投 A	3,500	15,505.00	0.01
455	600155	华创阳安	1,100	15,433.00	0.01
456	601106	中国一重	5,300	15,423.00	0.01
457	601577	长沙银行	1,700	15,419.00	0.01
458	600782	新钢股份	3,000	15,390.00	0.01
459	000932	华菱钢铁	3,200	15,296.00	0.01
460	600021	上海电力	1,900	15,295.00	0.01
461	002212	南洋股份	800	15,208.00	0.01
462	600060	海信视像	1,400	15,190.00	0.01
463	002028	思源电气	1,100	15,147.00	0.01
464	600008	首创股份	4,600	15,134.00	0.01
465	600863	内蒙华电	5,500	15,125.00	0.01
466	002233	塔牌集团	1,200	15,120.00	0.01
467	002242	九阳股份	600	15,096.00	0.01
468	601000	唐山港	5,800	15,080.00	0.01
469	601898	中煤能源	3,000	15,060.00	0.01
470	000970	中科三环	1,400	15,050.00	0.01
471	600729	重庆百货	500	14,925.00	0.01
472	002004	华邦健康	3,000	14,820.00	0.01
473	002010	传化智联	2,100	14,658.00	0.01
474	600388	龙净环保	1,500	14,625.00	0.01
475	002440	闰土股份	1,300	14,560.00	0.01
475	601179	中国西电	4,000	14,560.00	0.01
476	300634	彩讯股份	800	14,448.00	0.01
477	601958	金钼股份	1,800	14,418.00	0.01
478	000738	航发控制	1,100	14,377.00	0.01
479	600827	百联股份	1,600	14,368.00	0.01
480	000027	深圳能源	2,300	14,283.00	0.01
481	600039	四川路桥	4,200	14,112.00	0.01
482	600777	新潮能源	6,700	14,070.00	0.01
483	601718	际华集团	4,300	14,018.00	0.01
484	600733	北汽蓝谷	2,400	14,016.00	0.01
485	000685	中山公用	1,700	14,008.00	0.01
486	000559	万向钱潮	2,600	13,962.00	0.01
487	600409	三友化工	2,200	13,904.00	0.01
488	000930	中粮生化	2,100	13,860.00	0.01
488	600138	中青旅	1,100	13,860.00	0.01
489	600500	中化国际	2,600	13,780.00	0.01
490	600649	城投控股	2,400	13,728.00	0.01

491	000712	锦龙股份	900	13,680.00	0.01
492	601319	中国人保	1,800	13,662.00	0.01
493	000008	神州高铁	3,700	13,431.00	0.01
494	000898	鞍钢股份	4,000	13,400.00	0.01
495	000021	深科技	1,100	13,398.00	0.01
496	600989	宝丰能源	1,400	13,314.00	0.01
497	002244	滨江集团	2,700	13,284.00	0.01
498	002831	裕同科技	500	13,275.00	0.01
499	000090	天健集团	2,500	13,250.00	0.01
500	600970	中材国际	1,900	13,243.00	0.01
501	000528	柳工	1,900	13,186.00	0.01
502	002266	浙富控股	3,200	13,184.00	0.01
502	600307	酒钢宏兴	6,400	13,184.00	0.01
503	603228	景旺电子	300	13,146.00	0.01
504	002064	华峰氨纶	2,100	13,125.00	0.01
505	002407	多氟多	1,000	13,110.00	0.01
506	600025	华能水电	3,100	13,082.00	0.01
507	600507	方大特钢	1,300	13,078.00	0.01
508	000877	天山股份	1,100	13,035.00	0.01
509	601717	郑煤机	2,000	12,940.00	0.01
510	600640	号百控股	500	12,905.00	0.01
511	002408	齐翔腾达	1,800	12,870.00	0.01
512	600372	中航电子	900	12,816.00	0.01
513	600633	浙数文化	1,400	12,810.00	0.01
514	000488	晨鸣纸业	2,500	12,725.00	0.01
515	600348	阳泉煤业	2,300	12,719.00	0.01
516	600598	北大荒	1,300	12,662.00	0.01
517	002155	湖南黄金	1,600	12,624.00	0.01
518	601880	大连港	6,200	12,586.00	0.01
519	600120	浙江东方	1,440	12,571.20	0.01
520	600717	天津港	2,000	12,560.00	0.01
521	600418	江淮汽车	2,500	12,550.00	0.01
522	600525	长园集团	2,100	12,453.00	0.01
523	002665	首航节能	3,700	12,432.00	0.01
524	002048	宁波华翔	800	12,368.00	0.01
525	002701	奥瑞金	2,800	12,348.00	0.01
526	601608	中信重工	3,300	12,276.00	0.01
527	002183	怡亚通	2,900	12,209.00	0.01
528	601689	拓普集团	700	12,201.00	0.01

529	600648	外高桥	700	12,159.00	0.01
529	600884	杉杉股份	900	12,159.00	0.01
530	002002	鸿达兴业	2,900	12,064.00	0.01
531	600515	海航基础	2,700	12,042.00	0.01
532	600158	中体产业	1,200	12,036.00	0.01
533	002280	联络互动	3,100	11,997.00	0.01
534	000826	启迪桑德	1,300	11,934.00	0.01
535	000301	东方盛虹	2,300	11,914.00	0.01
536	000400	许继电气	1,100	11,847.00	0.01
537	000415	渤海租赁	3,100	11,780.00	0.01
538	000887	中鼎股份	1,300	11,765.00	0.01
539	601236	红塔证券	700	11,739.00	0.01
540	600316	洪都航空	900	11,727.00	0.01
541	600823	世茂股份	2,600	11,700.00	0.01
542	300748	金力永磁	300	11,688.00	0.01
543	000158	常山北明	1,700	11,594.00	0.01
544	600754	锦江酒店	400	11,484.00	0.01
545	601928	凤凰传媒	1,500	11,415.00	0.01
546	601611	中国核建	1,600	11,408.00	0.01
547	600233	圆通速递	900	11,385.00	0.01
548	002302	西部建设	1,000	11,290.00	0.01
549	000727	华东科技	5,400	11,286.00	0.01
550	000718	苏宁环球	2,900	11,078.00	0.01
551	000732	泰禾集团	1,800	11,070.00	0.01
552	000012	南玻 A	2,200	11,022.00	0.01
553	600862	中航高科	1,000	11,020.00	0.01
554	000758	中色股份	2,500	10,950.00	0.01
555	000959	首钢股份	3,100	10,943.00	0.01
556	000717	韶钢松山	2,300	10,902.00	0.01
557	002426	胜利精密	4,600	10,856.00	0.01
558	002640	跨境通	1,400	10,808.00	0.01
559	300134	大富科技	700	10,794.00	0.01
560	600901	江苏租赁	1,700	10,744.00	0.01
561	002444	巨星科技	1,000	10,740.00	0.01
562	600748	上实发展	1,800	10,692.00	0.01
563	000543	皖能电力	2,300	10,672.00	0.01
564	002056	横店东磁	1,300	10,660.00	0.01
565	600277	亿利洁能	2,300	10,488.00	0.01
566	600017	日照港	3,600	10,476.00	0.01

567	600259	广晟有色	300	10,431.00	0.01
568	600195	中牧股份	900	10,395.00	0.01
569	600499	科达洁能	2,400	10,392.00	0.01
570	002709	天赐材料	500	10,350.00	0.01
571	600312	平高电气	1,600	10,336.00	0.01
572	600141	兴发集团	1,000	10,280.00	0.01
573	600751	海航科技	3,500	10,255.00	0.01
573	600968	海油发展	3,500	10,255.00	0.01
574	600765	中航重机	1,000	10,230.00	0.01
575	600125	铁龙物流	1,700	10,166.00	0.01
576	002839	张家港行	1,700	10,098.00	0.01
577	600575	淮河能源	3,900	10,023.00	0.01
578	002635	安洁科技	600	10,002.00	0.01
579	600908	无锡银行	1,800	9,990.00	0.01
579	601200	上海环境	900	9,990.00	0.01
580	600835	上海机电	600	9,942.00	0.01
581	002491	通鼎互联	1,500	9,915.00	0.01
582	000519	中兵红箭	1,300	9,906.00	0.01
583	600563	法拉电子	200	9,890.00	0.01
584	600582	天地科技	3,100	9,889.00	0.01
585	600859	王府井	700	9,793.00	0.01
586	000926	福星股份	1,500	9,750.00	0.01
586	002468	申通快递	500	9,750.00	0.01
587	603806	福斯特	200	9,720.00	0.01
588	002939	长城证券	700	9,702.00	0.01
589	600317	营口港	3,800	9,690.00	0.01
590	603712	七一二	400	9,672.00	0.01
591	000006	深振业 A	1,800	9,648.00	0.01
592	300458	全志科技	300	9,597.00	0.01
593	002745	木林森	700	9,527.00	0.01
594	002128	露天煤业	1,100	9,526.00	0.01
595	002419	天虹股份	900	9,495.00	0.01
596	002434	万里扬	1,000	9,480.00	0.01
597	000156	华数传媒	900	9,396.00	0.01
598	300055	万邦达	1,400	9,338.00	0.01
599	002807	江阴银行	2,000	9,320.00	0.01
600	600869	智慧能源	1,900	9,310.00	0.01
601	600565	迪马股份	2,600	9,308.00	0.01
602	000501	鄂武商 A	700	9,296.00	0.00

603	002505	大康农业	5,300	9,275.00	0.00
604	002489	浙江永强	2,200	9,218.00	0.00
605	601212	白银有色	2,500	9,200.00	0.00
606	603377	东方时尚	500	9,130.00	0.00
607	002920	德赛西威	300	9,099.00	0.00
608	600151	航天机电	1,900	9,006.00	0.00
609	600291	西水股份	1,000	8,990.00	0.00
610	601326	秦港股份	2,800	8,932.00	0.00
611	600787	中储股份	1,700	8,857.00	0.00
612	600478	科力远	2,000	8,800.00	0.00
613	002051	中工国际	900	8,748.00	0.00
614	002815	崇达技术	500	8,645.00	0.00
615	600759	洲际油气	3,100	8,587.00	0.00
616	000062	深圳华强	600	8,544.00	0.00
617	600611	大众交通	2,100	8,526.00	0.00
618	300287	飞利信	2,200	8,448.00	0.00
619	603888	新华网	400	8,440.00	0.00
620	603515	欧普照明	300	8,433.00	0.00
621	002681	奋达科技	1,500	8,370.00	0.00
622	002254	泰和新材	800	8,360.00	0.00
623	601019	山东出版	1,200	8,340.00	0.00
624	002470	金正大	3,100	8,246.00	0.00
625	600694	大商股份	300	8,217.00	0.00
626	002251	步步高	900	8,190.00	0.00
627	002544	杰赛科技	600	8,172.00	0.00
628	600169	太原重工	3,500	8,155.00	0.00
629	002249	大洋电机	2,100	8,106.00	0.00
630	002672	东江环保	900	8,100.00	0.00
631	600770	综艺股份	1,500	8,085.00	0.00
632	002093	国脉科技	1,000	8,060.00	0.00
633	601828	美凯龙	700	7,931.00	0.00
634	601698	中国卫通	700	7,924.00	0.00
635	002176	江特电机	2,100	7,896.00	0.00
635	300297	蓝盾股份	1,400	7,896.00	0.00
636	000564	供销大集	3,300	7,887.00	0.00
637	600416	湘电股份	1,100	7,854.00	0.00
638	601139	深圳燃气	1,000	7,830.00	0.00
639	300376	易事特	1,700	7,786.00	0.00
640	000537	广宇发展	1,000	7,770.00	0.00

641	002573	清新环境	1,200	7,740.00	0.00
642	601016	节能风电	3,200	7,712.00	0.00
643	002358	森源电气	1,100	7,689.00	0.00
644	000937	冀中能源	2,100	7,686.00	0.00
645	002375	亚厦股份	1,300	7,540.00	0.00
646	601311	骆驼股份	800	7,504.00	0.00
647	002285	世联行	2,000	7,500.00	0.00
648	002945	华林证券	500	7,470.00	0.00
649	603766	隆鑫通用	2,000	7,460.00	0.00
650	000990	诚志股份	500	7,410.00	0.00
651	600757	长江传媒	1,200	7,392.00	0.00
652	600903	贵州燃气	500	7,390.00	0.00
653	601162	天风证券	1,000	7,360.00	0.00
654	600006	东风汽车	1,600	7,328.00	0.00
655	002431	棕榈股份	2,400	7,320.00	0.00
656	600623	华谊集团	1,100	7,315.00	0.00
657	000536	华映科技	2,700	7,290.00	0.00
658	000061	农产品	1,300	7,267.00	0.00
659	600098	广州发展	1,100	7,194.00	0.00
660	600978	宜华生活	2,400	7,128.00	0.00
661	002512	达华智能	1,100	7,095.00	0.00
662	601001	大同煤业	1,600	7,040.00	0.00
663	002366	台海核电	1,000	6,960.00	0.00
664	000829	天音控股	1,100	6,897.00	0.00
665	603568	伟明环保	300	6,882.00	0.00
666	000600	建投能源	1,400	6,846.00	0.00
667	601127	小康股份	600	6,840.00	0.00
668	600639	浦东金桥	500	6,750.00	0.00
669	002503	搜于特	2,800	6,692.00	0.00
670	600545	卓郎智能	1,100	6,677.00	0.00
671	300266	兴源环境	1,900	6,669.00	0.00
672	603056	德邦股份	600	6,666.00	0.00
673	600390	五矿资本	800	6,608.00	0.00
674	601869	长飞光纤	200	6,606.00	0.00
675	300257	开山股份	600	6,528.00	0.00
676	603556	海兴电力	400	6,520.00	0.00
677	600874	创业环保	900	6,471.00	0.00
678	002958	青农商行	1,000	6,470.00	0.00
679	000980	众泰汽车	2,200	6,446.00	0.00

680	600058	五矿发展	800	6,416.00	0.00
681	600657	信达地产	1,600	6,384.00	0.00
682	600350	山东高速	1,300	6,383.00	0.00
683	000541	佛山照明	1,300	6,370.00	0.00
684	600428	中远海特	1,700	6,358.00	0.00
685	600458	时代新材	900	6,345.00	0.00
686	600338	西藏珠峰	500	6,250.00	0.00
687	002707	众信旅游	1,000	6,240.00	0.00
688	600928	西安银行	800	6,216.00	0.00
689	601615	明阳智能	500	6,150.00	0.00
690	601801	皖新传媒	1,100	6,028.00	0.00
691	000426	兴业矿业	1,200	5,964.00	0.00
692	002948	青岛银行	1,000	5,940.00	0.00
693	603260	合盛硅业	200	5,894.00	0.00
694	000552	靖远煤电	2,200	5,676.00	0.00
694	002517	恺英网络	2,200	5,676.00	0.00
695	603328	依顿电子	500	5,660.00	0.00
696	002936	郑州银行	1,200	5,580.00	0.00
697	601298	青岛港	800	5,496.00	0.00
698	600707	彩虹股份	1,300	5,460.00	0.00
699	600393	粤泰股份	2,000	5,400.00	0.00
700	002482	广田集团	1,200	5,256.00	0.00
701	002344	海宁皮城	1,200	5,232.00	0.00
702	600053	九鼎投资	200	5,086.00	0.00
703	601003	柳钢股份	900	5,085.00	0.00
704	002818	富森美	400	5,060.00	0.00
705	002509	天广中茂	3,500	4,970.00	0.00
706	600126	杭钢股份	1,000	4,890.00	0.00
707	000050	深天马 A	300	4,887.00	0.00
708	000987	越秀金控	500	4,835.00	0.00
709	600996	贵广网络	600	4,830.00	0.00
710	600939	重庆建工	1,000	4,810.00	0.00
711	600335	国机汽车	800	4,640.00	0.00
712	601969	海南矿业	800	4,632.00	0.00
713	002416	爱施德	600	4,566.00	0.00
714	000025	特力 A	200	4,240.00	0.00
715	002699	美盛文化	600	4,050.00	0.00
716	601777	力帆股份	1,300	4,004.00	0.00
717	600985	淮北矿业	400	3,996.00	0.00

718	601811	新华文轩	300	3,957.00	0.00
719	601990	南京证券	300	3,873.00	0.00
720	000587	金洲慈航	2,100	3,822.00	0.00
721	603868	飞科电器	100	3,768.00	0.00
722	603225	新凤鸣	300	3,705.00	0.00
723	601068	中铝国际	600	3,324.00	0.00
724	600280	中央商场	1,100	3,058.00	0.00
725	600917	重庆燃气	400	2,904.00	0.00
726	000761	本钢板材	700	2,758.00	0.00
727	603355	莱克电气	100	2,367.00	0.00
728	603569	长久物流	200	2,084.00	0.00
729	603486	科沃斯	100	2,029.00	0.00
730	603025	大豪科技	200	1,894.00	0.00
731	002941	新疆交建	100	1,755.00	0.00
732	600590	泰豪科技	300	1,746.00	0.00
733	603650	彤程新材	100	1,742.00	0.00
734	002139	拓邦股份	300	1,668.00	0.00
735	601126	四方股份	300	1,662.00	0.00
736	600864	哈投股份	200	1,612.00	0.00
737	600621	华鑫股份	100	1,531.00	0.00
738	603877	太平鸟	100	1,527.00	0.00
739	002334	英威腾	300	1,296.00	0.00
740	601099	太平洋	300	1,137.00	0.00
741	601375	中原证券	200	1,072.00	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	3,076,177.00	1.65
2	601111	中国国航	1,706,168.00	0.92
3	600031	三一重工	1,451,674.00	0.78
4	600028	中国石化	1,410,449.00	0.76
5	601601	中国太保	1,330,187.00	0.72
6	300408	三环集团	1,250,144.00	0.67
7	300498	温氏股份	1,206,038.00	0.65

8	601336	新华保险	1,204,478.00	0.65
9	600519	贵州茅台	1,146,589.00	0.62
10	000636	风华高科	1,017,051.01	0.55
11	600258	首旅酒店	983,459.00	0.53
12	600761	安徽合力	892,423.00	0.48
13	600176	中国巨石	870,044.00	0.47
14	600030	中信证券	858,997.00	0.46
15	600029	南方航空	840,052.00	0.45
16	300059	东方财富	809,986.00	0.44
17	000002	万科 A	805,796.00	0.43
18	601678	滨化股份	805,431.00	0.43
19	002110	三钢闽光	800,281.00	0.43
20	600690	海尔智家	783,975.00	0.42

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	601111	中国国航	1,535,416.00	0.83
2	600028	中国石化	1,302,172.00	0.70
3	300498	温氏股份	1,164,151.00	0.63
4	600519	贵州茅台	1,144,559.00	0.62
5	601318	中国平安	687,072.00	0.37
6	600276	恒瑞医药	540,855.00	0.29
7	000858	五粮液	522,808.00	0.28
8	601678	滨化股份	486,165.00	0.26
9	600029	南方航空	454,667.00	0.24
10	601601	中国太保	447,195.00	0.24
11	300015	爱尔眼科	444,164.00	0.24
12	601336	新华保险	435,011.00	0.23
13	002110	三钢闽光	385,094.00	0.21
14	600887	伊利股份	383,261.00	0.21
15	300142	沃森生物	377,535.00	0.20
16	600258	首旅酒店	318,582.00	0.17
17	300347	泰格医药	317,507.00	0.17
18	300003	乐普医疗	308,526.00	0.17
19	600761	安徽合力	291,132.00	0.16

20	002035	华帝股份	285,246.00	0.15
----	--------	------	------------	------

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	90,499,072.78
卖出股票收入（成交）总额	36,693,551.17

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	11,384,750.00	6.12
	其中：政策性金融债	11,384,750.00	6.12
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	80,259,000.00	43.15
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	29,115,000.00	15.65
9	其他	-	-
10	合计	120,758,750.00	64.92

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	111909282	19 浦发银行 CD282	300,000	29,115,000.00	15.65
2	018007	国开 1801	113,000	11,384,750.00	6.12
3	041900004	19 南京公路 CP001	100,000	10,069,000.00	5.41
4	041900110	19 潞安 CP001	100,000	10,060,000.00	5.41
5	011901316	19 大同煤矿 SCP013	100,000	10,055,000.00	5.41

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。

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。

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

本基金本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

根据风险管理原则，本基金以套期保值为主要目的，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。制定国债期货套期保值策略时，基金管理人通过分析宏观基本面对债券市场的定价影响，结合国债期货基差特征，对国债期货合约价格进行公允定价。同时充分考虑国债期货收益性、流动性及风险性特征，严格遵守基金债券资产对国债期货套期保值仓位的比例要求，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-16,300.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：1、本基金本报告期末未持有国债期货。

2、本期国债期货投资本期收益为未扣手续费收益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期国债期货投资操作整体谨慎，在一定程度上对冲了利率波动的风险，符合既定的投资政策和投资目标。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除上海浦东发展银行股份有限公司（19 浦发

银行 CD282) 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。

2019 年 10 月 12 日, 中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书(银保监罚决字(2019)7 号), 对上海浦东发展银行股份有限公司授信业务及整改情况严重失察、重大审计发现未向监管部门报告、轮岗制度执行不力等违法违规事实进行处罚。

从此主体基本面考虑, 本基金认为中国银行保险监督管理委员会对浦发银行的上述处罚, 不影响中长期经营情况、盈利水平。本基金从流动性管理需求出发, 配置了此标的。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	33,212.80
2	应收证券清算款	5,149,213.52
3	应收股利	-
4	应收利息	1,420,573.04
5	应收申购款	2,052.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,605,052.16

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
中金衡盈 A	995	173,355.65	4,968,102.07	2.88%	167,520,765.45	97.12%
中金衡盈 C	122	81,133.65	-	0.00%	9,898,305.35	100.00%
合计	1,117	163,283.06	4,968,102.07	2.72%	177,419,070.80	97.28%

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	中金衡盈 A	200.00	0.0001%
	中金衡盈 C	0.00	0.0000%
	合计	200.00	0.0001%

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	中金衡盈 A	0~10
	中金衡盈 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中金衡盈 A	0
	中金衡盈 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金衡盈 A	中金衡盈 C
基金合同生效日（2019 年 6 月 21 日）基金份额总额	271,472,979.58	37,357,688.32
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	14,923,718.60	9,786,967.28
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	113,907,830.66	37,246,350.25
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	172,488,867.52	9,898,305.35

§ 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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2019 年 1 月 19 日，本基金管理人发布公告，楚钢先生自 2019 年 1 月 18 日起担任公司董事长，同日起总经理孙菁不再代为履行董事长职务。

2019 年 5 月 6 日，本基金管理人发布公告，王元先生自 2019 年 5 月 5 日起接替颜羽女士担任公司独立董事。

2019 年 6 月 18 日，本基金管理人发布公告，夏静女士自 2019 年 6 月 17 日起担任公司首席信息官，分管信息技术及风险管理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

自 2019 年 12 月 18 日起，姜然女士不再担任招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理职务。

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南京中金基金管理有限公司（以下简称“南京中金基金”）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（以下简称“南京中院”）起诉，南京中院于 2018 年 10 月 22 日立案。2019 年 5 月 20 日，南京中院出具（2018）苏 01 民初 2710 号民事调解书，确认基金管理人及股东中金公司与南京中金基金 2019 年 5 月 17 日签署的调解协议内容。截至本报告期末，南京中金基金已根据调解协议完成更名并支付赔偿款项。除前述事项外，本报告期无涉及基金管理人的其他诉讼事项。

本报告期无涉及本基金基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

本报告期内，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	
中金财富证券	2	127,190,261.45	100.00%	93,011.94	100.00%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金报告期内新增交易单元：中金公司 2 个，中金财富证券 2 个。

2、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、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特殊要求，提供专门研究报告，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。

3、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
中金财富证券	199,772,186.44	88.11%	1,636,600,000.00	97.04%	-	-
中金公司	26,965,240.00	11.89%	50,000,000.00	2.96%	-	-

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	中金衡盈混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2019年5月11日
2	中金衡盈混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2019年5月11日
3	中金衡盈混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定媒介	2019年5月11日
4	中金衡盈混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定媒介	2019年5月11日
5	关于中金衡盈新增中国中投证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019年5月15日
6	关于中金衡盈新增中国银行、唐鼎耀华为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019年5月18日
7	中金基金管理有限公司首席信息官任职公告	中国证监会指定媒介	2019年6月18日
8	中金衡盈混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定媒介	2019年6月22日
9	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险揭示的公告	中国证监会指定媒介	2019年6月25日
10	关于中金衡盈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	中国证监会指定媒介	2019年7月10日
11	关于旗下部分基金新增通华财富（上海）基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019年7月10日
12	关于旗下部分基金新增上海长量基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019年7月30日
13	关于中金衡盈新增上海天天基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019年8月9日
14	关于旗下部分基金新增蚂蚁基金为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019年8月28日
15	关于新增中银国际证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019年9月17日
16	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2019年10月24日
17	中金衡盈混合型证券投资基	中国证监会指定媒介	2019年10月24日

	金 2019 年第 3 季度报告		
18	关于旗下部分基金新增中信证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 11 月 12 日
19	关于旗下部分基金新增北京肯特瑞基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 11 月 12 日
20	关于旗下部分基金新增中信证券（山东）有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 11 月 21 日
21	中金基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金估值调整情况的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 6 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

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人于 2019 年 6 月组织了监事换届选举工作。根据选举结果，由公司基金运营部负责人白娜女士自 2019 年 6 月 17 日起接替夏静女士担任执行监事。

§ 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盈混合型证券投资基金募集注册文件
- 2、《中金衡盈混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金衡盈混合型证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金衡盈混合型证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金衡盈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、报告期内中金衡盈混合型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

2020年4月21日