

中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 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及董事保证本报告中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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 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、财务会计报告和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 2 月 6 日起至 2018 年 6 月 30 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 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 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 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 4.8 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..... | 13 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表..... | 15 |
| 6.2 利润表..... | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 17 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 18 |
| §7 投资组合报告..... | 46 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 46 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 46 |
| 7.3 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..... | 47 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 70 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 72 |
| 7.6 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..... | 72 |
| 7.7 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..... | 72 |
| 7.8 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 |
| 7.9 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 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 73 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 73 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 73 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 75 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 75 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 75 |
| 8.3 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..... | 75 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 77 |
| §10 重大事件揭示..... | 78 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 78 |
| 10.2 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 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 78 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 78 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 78 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 78 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 78 |
| 10.8 其他重大事件..... | 79 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 81 |
| 11.1 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..... | 81 |

| | |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 82 |
| §12 备查文件目录..... | 83 |
| 12.1 备查文件目录..... | 83 |
| 12.2 存放地点..... | 83 |
| 12.3 查阅方式..... | 83 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 基金名称 | 中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中金金序量化蓝筹 | |
| 基金主代码 | 005405 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018 年 2 月 6 日 | |
| 基金管理人 | 中金基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 118,626,525.77 份 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 中金金序量化蓝筹 A | 中金金序量化蓝筹 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 005405 | 005406 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 99,596,280.42 份 | 19,030,245.35 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用数量化技术对投资策略进行优化，将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数体现在数量模型中，通过数量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制，充分发挥数量化投资的优势。一方面，在偏好大盘蓝筹的基础上，构建最小化市场波动性的投资组合；另一方面，通过量化选股等策略追求超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*75%+中债综合指数收益率*25% |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，其预期的风险和预期收益高于货币市场基金、债券证券投资基金，低于股票型证券投资基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|-------------------------------------|-------------------|
| 名称 | 中金基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李虹 |
| | 联系电话 | 010-63211122 |
| | 电子邮箱 | xxpl@ciccfund.com |
| 客户服务电话 | 400-868-1166 | 010-67595096 |
| 传真 | 010-66159121 | 010-66275853 |
| 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 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | 北京市西城区太平桥大街 | 北京市西城区闹市口大街 1 号 |

| | | |
|-------|-------------------|--------------|
| | 18 号丰融国际中心北楼 17 层 | 院 1 号楼长安兴融中心 |
| 邮政编码 | 100032 | 100033 |
| 法定代表人 | 林寿康 | 田国立 |

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》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.ciccfund.com/ |
| 基金半年度报告备置地点 | 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 |
|--------|------------|-------------------------------|
| 注册登记机构 | 中金基金管理有限公司 | 北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别 | 中金金序量化蓝筹 A | 中金金序量化蓝筹 C |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018年2月6日 - 2018年6月30日) | 报告期(2018年2月6日 - 2018年6月30日) |
| 本期已实现收益 | -1,358,330.33 | 786,656.02 |
| 本期利润 | -7,319,329.36 | -432,056.65 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0693 | -0.0186 |
| 本期加权平均净值利润率 | -7.04% | -1.81% |
| 本期基金份额净值增长率 | -7.06% | -2.84% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | -7,029,181.44 | -539,918.47 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0706 | -0.0284 |
| 期末基金资产净值 | 92,567,098.98 | 18,490,326.88 |
| 期末基金份额净值 | 0.9294 | 0.9716 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2018年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | -7.06% | -2.84% |

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金金序量化蓝筹 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | -4.86% | 1.02% | -5.63% | 0.96% | 0.77% | 0.06% |
| 过去三个月 | -5.57% | 0.84% | -7.03% | 0.85% | 1.46% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -7.06% | 0.78% | -12.86% | 0.92% | 5.80% | -0.14% |

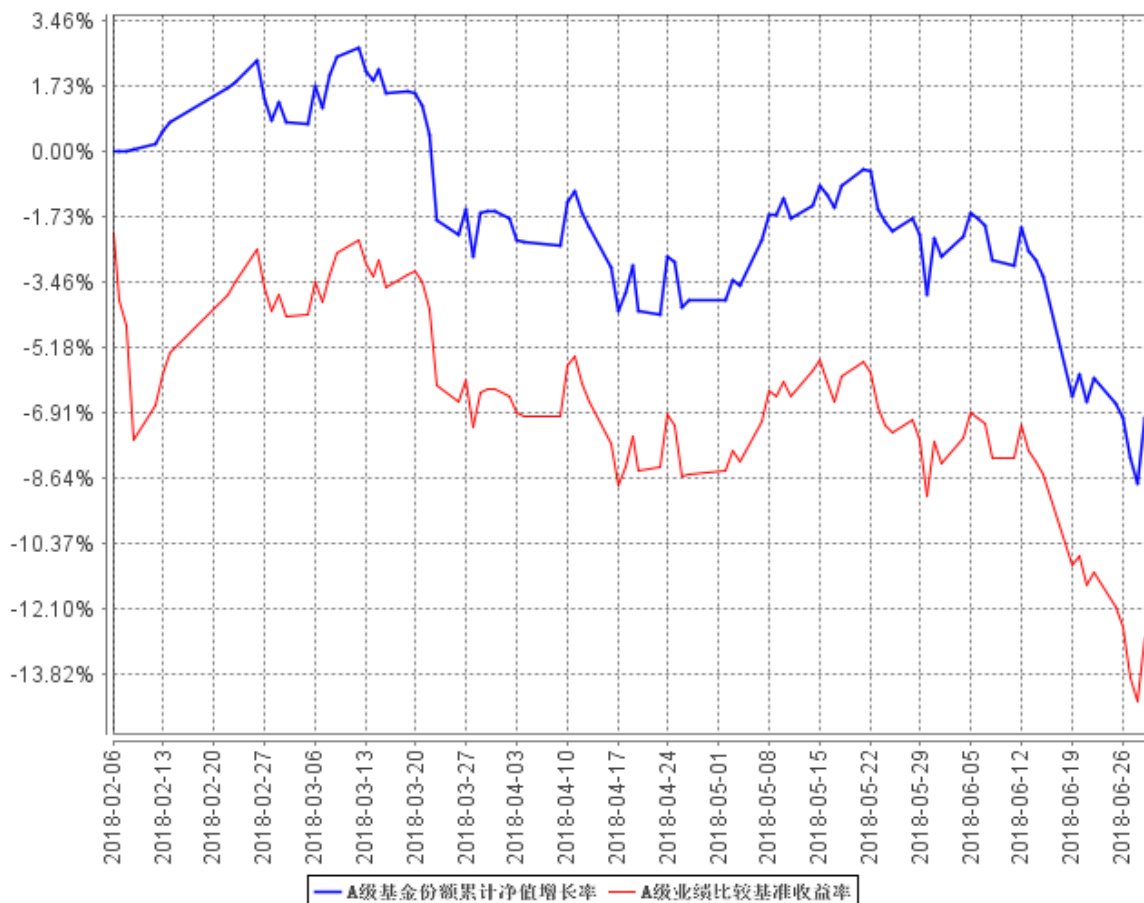
中金金序量化蓝筹 C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | -4.89% | 1.02% | -5.63% | 0.96% | 0.74% | 0.06% |

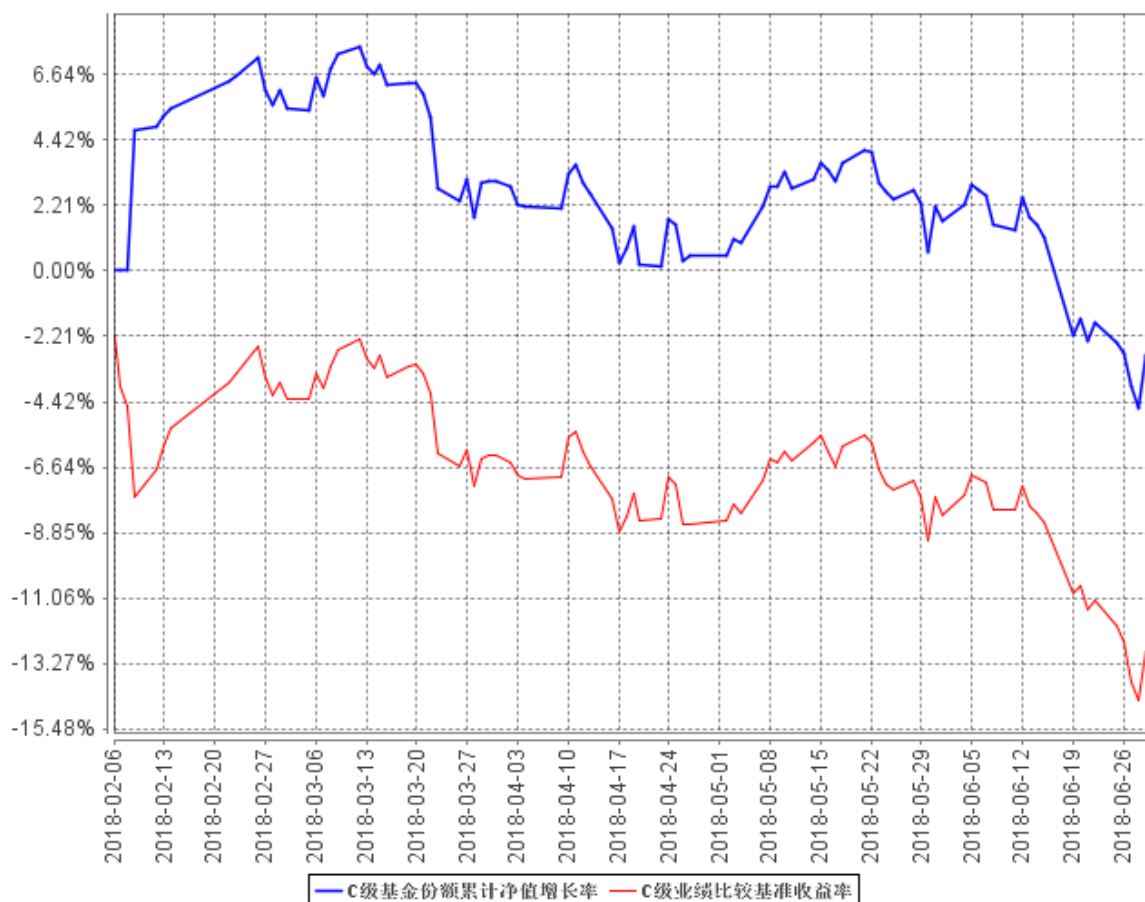
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | -5.71% | 0.85% | -7.03% | 0.85% | 1.32% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.84% | 0.93% | -12.86% | 0.92% | 10.02% | 0.01% |

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2018 年 2 月 6 日，按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

§ 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，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 3 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，办公地址为北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层。

截至 2018 年 6 月 30 日，公司共管理 14 支开放式基金，证券投资基金管理规模 145.22 亿。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 魏宇 | 本基金基金经理 | 2018 年 2 月 6 日 | - | 8 年 | 魏宇先生，香港大学统计专业博士。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 股量化策略开发工作。2014 年 11 月，加入中金基金管理有限公司，现任中金基金管理有限公司量化公募投资部基金经理、副总经理。 |

- 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，本基金采用量化选股的投资策略，运作正常。模型主要在大中盘股里进行选股，同时精选了多只债券进行配置，仓位上保持和业绩比较基准一致。我们会继续在选股模型和配置模型上进行研究和改进，力争更好的表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金金序量化蓝筹 A 基金份额净值为 0.9294 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.06%；截至本报告期末中金金序量化蓝筹 C 基金份额净值为 0.9716 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.84%；同期业绩比较基准收益率为-12.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年的宏观经济环境非常复杂。第一，名义 GDP 在高位，一些经济指标显示经济活跃度高。第二，深化供给侧改革，发展巩固新兴产业，独角兽回归引导资金流向支持实体经济。第三，以金融“去杠杆”为目的的各项政策继续推进。第四，中美贸易战逐渐升级，对我国传统产业和新

兴产业的发展都会产生重要的影响。股市受到各种因素的共同作用，呈现出震荡向下的趋势。2018 年上半年，上证 50 指数下跌 13.30%，沪深 300 指数下跌 12.90%，中证 500 指数下跌 16.53%，中证 800 指数下跌 13.85%，中证 1000 指数下跌 20.08%，创业板指下跌 8.33%。展望 2018 年下半年，国内经济发展的韧性相信能够持续，政策层面大方向依然会延续，中美贸易摩擦的变数较大，总体上我们对股市的看法并不乐观，因此在投资时会更加注重风险控制，尽量减小净值的波动。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,756,789.41 |
| 结算备付金 | | 1,251,510.89 |
| 存出保证金 | | 34,821.10 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 99,644,094.48 |
| 其中：股票投资 | | 82,200,044.48 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 17,444,050.00 |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 9,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 444,445.90 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 1,599.85 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 112,133,261.63 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 |
| 负 债： | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付证券清算款 | | 658,155.68 |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 94,140.71 |
| 应付托管费 | | 23,535.17 |
| 应付销售服务费 | | 6,278.05 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 206,685.96 |

| | | |
|---------------|----------|----------------|
| 应交税费 | | 1,175.66 |
| 应付利息 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 85,864.54 |
| 负债合计 | | 1,075,835.77 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 118,626,525.77 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -7,569,099.91 |
| 所有者权益合计 | | 111,057,425.86 |
| 负债和所有者权益总计 | | 112,133,261.63 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，中金金序量化蓝筹 A 基金份额净值 0.9294 元，基金份额总额 99596280.42 份；中金金序量化蓝筹 C 基金份额净值 0.9716 元，基金份额总额 19030245.35 份。中金金序量化蓝筹份额总额合计为 118626525.77 份。

6.2 利润表

会计主体：中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2018 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|
| 一、收入 | | -6,435,473.08 |
| 1.利息收入 | | 436,391.30 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 65,127.55 |
| 债券利息收入 | | 141,256.78 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 230,006.97 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -819,898.90 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -1,738,628.43 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 2,033.81 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 916,695.72 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -7,179,711.70 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填 | | - |

| | | |
|----------------------------|------------|----------------------|
| 列) | | |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 1,127,746.22 |
| 减：二、费用 | | 1,315,912.93 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 499,142.34 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 124,785.58 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 35,400.75 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 566,343.73 |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 税金及附加 | | 339.83 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 89,900.70 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -7,751,386.01 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -7,751,386.01 |

注：本基金合同生效日为2018年2月6日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | | |
|-----------------------------------|-------------------------------------|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 203,049,881.65 | - | 203,049,881.65 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -7,751,386.01 | -7,751,386.01 |
| 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） | -84,423,355.88 | 182,286.10 | -84,241,069.78 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,971,104.64 | 97,675.31 | 2,068,779.95 |
| 2.基金赎回款 | -86,394,460.52 | 84,610.79 | -86,309,849.73 |

| | | | |
|--|----------------|---------------|----------------|
| 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） | 118,626,525.77 | -7,569,099.91 | 111,057,425.86 |

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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2017 年 6 月 16 日证监许可[2017]936 号《关于准予中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金招募说明书》和《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金,托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台及中国银河证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司及包商银行股份有限公司等共同销售,募集期为 2017 年 12 月 5 日起至 2018 年 1 月 30 日。经向中国证监会备案,《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 203,049,881.65 份(含利息转份额 8.28 份以及于 2018 年 3 月 21 日银行结息转份额 55.87 份),发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据经中国证监会备案的《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金合同》和《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,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

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、《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金合同》和《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况、自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本财务报表期间为自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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) ”。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《中金金序量化精选混合型发起式基金基金合同》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该类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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财税 [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] 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) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(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）运营基金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。对基金在 2018 年 1 月 1 日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、债券收入免征增值税。

(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) 对基金取得的股票的股息、红利收入，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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(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（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 1,756,789.41 |
| 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： | 1,756,789.41 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年6月30日 | | |
|---------------|-------------------|---------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 89,326,572.75 | 82,200,044.48 | -7,126,528.27 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 17,497,233.43 | 17,444,050.00 |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | 17,497,233.43 | 17,444,050.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 106,823,806.18 | 99,644,094.48 | -7,179,711.70 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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6月30日 | |
|------------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 买入返售证券_交易所 | 9,000,000.00 | - |
| 合计 | 9,000,000.00 | - |

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年6月30日 |
|----------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 307.03 |
| 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 | 563.20 |
| 应收债券利息 | 445,487.34 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | -1,927.37 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 15.70 |
| 合计 | 444,445.90 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 206,685.96 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 206,685.96 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 预提费用 | 85,864.54 |
| 合计 | 85,864.54 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 中金金序量化蓝筹 A | | |
|------------|-------------------------------------|----------------|
| 项目 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 110,750,932.51 | 110,750,932.51 |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期申购 | 181,352.75 | 181,352.75 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -11,336,004.84 | -11,336,004.84 |
| - 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 | 99,596,280.42 | 99,596,280.42 |

金额单位：人民币元

| 中金金序量化蓝筹 C | | |
|---------------|-------------------------------------|----------------|
| 项目 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 92,298,949.14 | 92,298,949.14 |
| 本期申购 | 1,789,751.89 | 1,789,751.89 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -75,058,455.68 | -75,058,455.68 |
| - 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 | 19,030,245.35 | 19,030,245.35 |

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 中金金序量化蓝筹 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 | -1,358,330.33 | -5,960,999.03 | -7,319,329.36 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 139,972.34 | 150,175.58 | 290,147.92 |
| 其中：基金申购款 | -1,678.43 | -2,384.59 | -4,063.02 |
| 基金赎回款 | 141,650.77 | 152,560.17 | 294,210.94 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -1,218,357.99 | -5,810,823.45 | -7,029,181.44 |

单位：人民币元

| 中金金序量化蓝筹 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 | 786,656.02 | -1,218,712.67 | -432,056.65 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -164,680.85 | 56,819.03 | -107,861.82 |
| 其中：基金申购款 | 83,728.49 | 18,009.84 | 101,738.33 |
| 基金赎回款 | -248,409.34 | 38,809.19 | -209,600.15 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 621,975.17 | -1,161,893.64 | -539,918.47 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|-----------|-------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 51,315.71 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 13,654.20 |
| 其他 | 157.64 |
| 合计 | 65,127.55 |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|------------|-------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 186,216,879.76 |
| 减：卖出股票成本总额 | 187,955,508.19 |
| 买卖股票差价收入 | -1,738,628.43 |

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30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 | 2,033.81 |
| 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 | 2,033.81 |

6.4.7.13.2 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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|-------------------------|-------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 7,325,397.20 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 7,081,845.40 |
| 减：应收利息总额 | 241,517.99 |
| 买卖债券差价收入 | 2,033.81 |

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.13.5 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无投资其他衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|-------------|-------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 916,695.72 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 916,695.72 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|----------------------------|-------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -7,179,711.70 |
| ——股票投资 | -7,126,528.27 |
| ——债券投资 | -53,183.43 |
| ——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 | -7,179,711.70 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|---------|-------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,107,441.26 |
| 其他 | 20,304.96 |
| 合计 | 1,127,746.22 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | 566,343.73 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 566,343.73 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日 |
|-------|--|
| 审计费用 | 32,977.24 |
| 信息披露费 | 52,887.30 |
| 其他 | 360.00 |
| 汇划手续费 | 3,676.16 |
| 合计 | 89,900.70 |

6.4.7.21 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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 |
| 中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”) | 基金托管人 |
| 中国国际金融股份有限公司 (“中金公司”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 中国中投证券有限责任公司 (“中投证券”) | 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | |
|-------|-------------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |
| 中金公司 | 325,104,723.11 | 70.19% |
| 中投证券 | 138,080,317.29 | 29.81% |

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | |
|-------|-------------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 |
| 中金公司 | 18,568,601.43 | 75.52% |
| 中投证券 | 6,018,379.20 | 24.48% |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | |
|-------|-------------------------------------|--------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 |
| 中金公司 | 1,081,000,000.00 | 75.41% |
| 中投证券 | 352,500,000.00 | 24.59% |

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期无关联方权证交易。

6.4.10.1.5 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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | | | |
|-------|-------------------------------------|------------|------------|--------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 中金公司 | 237,761.78 | 70.19% | 105,716.26 | 51.15% |
| 中投证券 | 100,969.70 | 29.81% | 100,969.70 | 48.85% |

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|-----------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 499,142.34 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,523.96 |

注：1、支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|----------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 124,785.58 |

注：1、支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费 =前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

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

6.4.10.2.3 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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
|----------------|---|------------|-----------|
| | 中金金序量化蓝筹 A | 中金金序量化蓝筹 C | 合计 |
| | 中金基金 | 0.00 | 33,537.92 |
| 合计 | 0.00 | 33,537.92 | 33,537.92 |

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，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末。C 类基金份额每日应计提的销售服务费 = C 类基金份额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 2 月 6 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

| 项目 | 本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | |
|---------------------------|-------------------------------------|------------|
| | 中金金序量化蓝筹 A | 中金金序量化蓝筹 C |
| 基金合同生效日（2018年2月6日）持有的基金份额 | 14,000,000.00 | - |
| 期初持有的基金份额 | 14,000,000.00 | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 14,000,000.00 | - |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 14.0567% | - |

本基金本报告期末未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方于本期末未持有本基金。

6.4.10.5 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2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | |
|--------|-------------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 1,756,789.41 | 51,315.71 |

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于2018年6月30日的相关余额为人民币1,286,331.99元，当期产生的利息收入为人民币15,513.63元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

| 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | | | | |
|----------------------------|--------|------|------|-----------|-----------|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量(单位:份) | 总金额 |
| 中金公司 | 601138 | 工业富联 | 网上发行 | 2,000 | 27,540.00 |

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期间未进行利润分配。

6.4.12 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|--------|------------|------------|----|
| 002310 | 东方园林 | 2018年5月25日 | 重大事项 | 15.03 | 2018年8月27日 | 13.47 | 37,370 | 702,462.83 | 561,671.10 | - |
| 601390 | 中国中铁 | 2018年5月7日 | 重大事项 | 7.47 | 2018年8月20日 | 7.25 | 73,120 | 543,127.06 | 546,206.40 | - |
| 002450 | 康得新 | 2018年6月4日 | 重大事项 | 17.08 | - | - | 23,200 | 478,001.35 | 396,256.00 | - |
| 000669 | 金鸿能源 | 2018年6月13日 | 重大事项 | 7.25 | 2018年8月6日 | 6.53 | 42,840 | 334,121.27 | 310,590.00 | - |
| 000008 | 神州高铁 | 2018年6月8日 | 重大事项 | 4.96 | 2018年8月7日 | 4.46 | 42,802 | 243,533.11 | 212,297.92 | - |
| 002051 | 中工国际 | 2018年6月14日 | 重大事项 | 15.27 | - | - | 12,300 | 196,371.57 | 187,821.00 | - |
| 002426 | 胜利精密 | 2018年6月19日 | 重大事项 | 3.60 | 2018年7月3日 | 3.26 | 38,700 | 151,627.00 | 139,320.00 | - |
| 002602 | 世纪华通 | 2018年6月12日 | 重大事项 | 32.50 | - | - | 3,900 | 134,093.43 | 126,750.00 | - |
| 000723 | 美锦能源 | 2018年3月27日 | 重大事项 | 5.43 | 2018年7月31日 | 4.89 | 20,200 | 122,365.00 | 109,686.00 | - |
| 600750 | 江中药业 | 2018年6月21日 | 重大事项 | 17.75 | 2018年8月1日 | 16.12 | 4,760 | 82,670.26 | 84,490.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------|-------|---|------------|--------|-----------|-----------|-----------|
| | | 日 | | | | | | | | |
| 300324 | 旋极信息 | 2018年5月30日 | 重大事项 | 9.49 | - | - | 6,619 | 68,438.00 | 62,814.31 | - |
| 000825 | 太钢不锈 | 2018年4月16日 | 重大事项 | 6.00 | - | - | 10,000 | 56,133.46 | 60,000.00 | - |
| 600022 | 山东钢铁 | 2018年3月27日 | 重大事项 | 2.02 | | 2018年8月16日 | 1.83 | 25,200 | 55,727.62 | 50,904.00 |
| 002359 | 齐星铁塔 | 2018年5月21日 | 重大事项 | 19.58 | | 2018年8月21日 | 17.62 | 2,300 | 60,519.14 | 45,034.00 |
| 600811 | 东方集团 | 2018年5月30日 | 重大事项 | 4.30 | - | - | 10,300 | 44,991.90 | 44,290.00 | - |
| 300603 | 立昂技术 | 2018年5月2日 | 重大事项 | 35.73 | | 2018年8月24日 | 32.07 | 900 | 30,844.80 | 32,157.00 |
| 002512 | 达华智能 | 2018年6月19日 | 重大事项 | 9.70 | - | - | 2,400 | 25,899.35 | 23,280.00 | - |
| 002437 | 誉衡药业 | 2018年6月11日 | 重大事项 | 6.20 | | 2018年8月13日 | 5.57 | 3,100 | 20,661.21 | 19,220.00 |
| 600678 | 四川金顶 | 2018年4月18日 | 重大事项 | 10.24 | - | - | 1,800 | 18,370.13 | 18,432.00 | - |
| 600293 | 三峡新材 | 2018年6月8日 | 重大事项 | 5.68 | | 2018年8月7日 | 5.11 | 3,100 | 20,867.87 | 17,608.00 |
| 600641 | 万业企业 | 2018年6月6日 | 重大事项 | 12.18 | | 2018年8月9日 | 10.96 | 1,300 | 16,800.00 | 15,834.00 |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------|-------|------------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | | 日 | | | 日 | | | | | |
| 300118 | 东方日升 | 2018年5月7日 | 重大事项 | 10.80 | 2018年8月7日 | 9.63 | 1,100 | 12,348.57 | 11,880.00 | - |
| 600796 | 钱江生化 | 2018年6月28日 | 重大事项 | 6.08 | - | - | 1,900 | 11,752.00 | 11,552.00 | - |
| 600850 | 华东电脑 | 2018年6月22日 | 重大事项 | 18.99 | 2018年8月15日 | 18.00 | 600 | 11,476.73 | 11,394.00 | - |
| 002011 | 盾安环境 | 2018年5月2日 | 重大事项 | 6.40 | - | - | 1,700 | 11,728.11 | 10,880.00 | - |
| 300108 | 双龙股份 | 2018年6月12日 | 重大事项 | 7.84 | - | - | 800 | 6,606.39 | 6,272.00 | - |
| 002431 | 棕榈股份 | 2018年6月12日 | 重大事项 | 6.71 | - | - | 900 | 6,514.79 | 6,039.00 | - |
| 002778 | 高科石化 | 2018年6月19日 | 重大事项 | 19.02 | 2018年7月20日 | 18.00 | 300 | 6,065.11 | 5,706.00 | - |
| 600687 | 刚泰控股 | 2018年6月11日 | 重大事项 | 9.09 | 2018年8月20日 | 8.18 | 400 | 3,906.93 | 3,636.00 | - |
| 002665 | 首航节能 | 2018年6月15日 | 重大事项 | 5.80 | - | - | 600 | 4,027.93 | 3,480.00 | - |
| 002573 | 清新环境 | 2018年6月19日 | 重大事项 | 11.55 | - | - | 300 | 4,257.51 | 3,465.00 | - |
| 600768 | 宁波富邦 | 2018年6月14日 | 重大事项 | 11.04 | - | - | 300 | 3,397.00 | 3,312.00 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|----------|--------------------------|----------|-------|---|--------------------------|-------|----------|----------|----------|---|
| | | 日 | | | | | | | | | |
| 300343 | 联创 互联 | 2018 年 6 月 19 日 | 重大 事项 | 10.00 | - | - | 300 | 3,039.00 | 3,000.00 | - | |
| 000779 | 三毛 派神 | 2018 年 3 月 21 日 | 重大 事项 | 13.47 | | 2018 年 8 月 21 日 | 12.12 | 200 | 2,439.00 | 2,694.00 | - |
| 300197 | 铁汉 生态 | 2018 年 5 月 28 日 | 重大 事项 | 5.37 | - | - | 450 | 2,912.28 | 2,416.50 | - | |
| 002171 | 楚江 新材 | 2018 年 6 月 7 日 | 重大 事项 | 6.78 | - | - | 300 | 2,086.36 | 2,034.00 | - | |
| 601727 | 上海 电气 | 2018 年 6 月 7 日 | 重大 事项 | 6.34 | | 2018 年 8 月 7 日 | 5.71 | 300 | 1,755.93 | 1,902.00 | - |
| 600122 | 宏图 高科 | 2018 年 6 月 26 日 | 重大 事项 | 7.40 | - | - | 200 | 1,766.81 | 1,480.00 | - | |
| 000426 | 兴业 矿业 | 2018 年 6 月 19 日 | 重大 事项 | 7.21 | | 2018 年 8 月 27 日 | 6.47 | 200 | 1,612.04 | 1,442.00 | - |
| 002477 | 雏鹰 农牧 | 2018 年 6 月 14 日 | 重大 事项 | 3.31 | - | - | 400 | 1,451.10 | 1,324.00 | - | |
| 002408 | 齐翔 腾达 | 2018 年 6 月 21 日 | 重大 事项 | 12.28 | - | - | 100 | 1,371.15 | 1,228.00 | - | |
| 002102 | 冠福 股份 | 2018 年 6 月 1 日 | 重大 事项 | 3.72 | - | - | 2,200 | 9,586.88 | 8,184.00 | - | |
| 002411 | 必康 股份 | 2018 年 6 月 19 日 | 重大 事项 | 27.75 | - | - | 200 | 5,205.27 | 5,550.00 | - | |

| | | | | | | | | | | |
|--------|----------|-------------------------|----------|-------|-------------------------|------|-------|----------|----------|---|
| | | 日 | | | | | | | | |
| 002270 | 华明 装备 | 2018 年 5 月 3 日 | 重大 事项 | 5.81 | 2018 年 7 月 3 日 | 5.23 | 1,050 | 6,592.00 | 6,100.50 | - |
| 600335 | 国机 汽车 | 2018 年 4 月 3 日 | 重大 事项 | 10.43 | - | - | 800 | 8,574.00 | 8,344.00 | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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余额。

6.4.12.3.2 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余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险、管理风险、估值风险、操作风险、技术风险、合规性风险等。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。

本基金的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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，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。

6.4.13.2.1 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。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 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。

6.4.13.2.4 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 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| AAA | - |
| AAA 以下 | 11,443,450.00 |
| 未评级 | - |
| 合计 | 11,443,450.00 |

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。

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 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。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，二是来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的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。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，以备支付基金份额持有人的赎回款项。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%。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。本基金所持有的大部分证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2018 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|---------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 1,756,789.41 | - | - | - | 1,756,789.41 |
| 结算备付金 | 1,251,510.89 | - | - | - | 1,251,510.89 |
| 存出保证金 | 34,821.10 | - | - | - | 34,821.10 |
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | - | 82,200,044.48 | 82,200,044.48 |
| 交易性金融资产-债券投资 | 17,444,050.00 | - | - | - | 17,444,050.00 |
| 买入返售金融资产 | 9,000,000.00 | - | - | - | 9,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 444,445.90 | 444,445.90 |

| | | | | |
|-----------|---------------|---|----------------|----------------|
| 应收股利 | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | 1,599.85 | 1,599.85 |
| 资产总计 | 29,487,171.40 | - | -82,646,090.23 | 112,133,261.63 |
| 负债 | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | 658,155.68 | 658,155.68 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | 94,140.71 | 94,140.71 |
| 应付托管费 | - | - | 23,535.17 | 23,535.17 |
| 应付交易费用 | - | - | 206,685.96 | 206,685.96 |
| 应付销售服务费 | - | - | 6,278.05 | 6,278.05 |
| 应交税费 | - | - | 1,175.66 | 1,175.66 |
| 应付利息 | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | 85,864.54 | 85,864.54 |
| 负债总计 | - | - | -1,075,835.77 | -1,075,835.77 |
| 利率敏感度缺口 | 29,487,171.40 | - | -81,570,254.46 | 111,057,425.86 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

6.4.13.4.1.2 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（2018 年 6 月 30 日） | 上年度末（2017 年 12 月 31 日） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 13,939.48 | - |
| 市场利率上升 25 个基点 | -13,939.48 | | |

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年6月30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 | 82,200,044.48 | 74.02 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | 17,444,050.00 | 15.71 |
| 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 | 99,644,094.48 | 89.72 |

6.4.13.4.3.2 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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 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 | 82,200,044.48 | 73.31 |
| | 其中：股票 | 82,200,044.48 | 73.31 |
| 2 | 固定收益投资 | 17,444,050.00 | 15.56 |
| | 其中：债券 | 17,444,050.00 | 15.56 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 9,000,000.00 | 8.03 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 3,008,300.30 | 2.68 |
| 7 | 其他各项资产 | 480,866.85 | 0.43 |
| 8 | 合计 | 112,133,261.63 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 168,489.00 | 0.15 |
| B | 采矿业 | 2,194,403.25 | 1.98 |
| C | 制造业 | 37,250,018.83 | 33.54 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,989,767.94 | 2.69 |
| E | 建筑业 | 4,614,197.11 | 4.15 |
| F | 批发和零售业 | 3,720,166.75 | 3.35 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,726,050.00 | 2.45 |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,570.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,664,035.05 | 2.40 |
| J | 金融业 | 15,831,502.37 | 14.26 |
| K | 房地产业 | 6,119,972.50 | 5.51 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业 | 995,581.18 | 0.90 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 34,555.00 | 0.03 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 617,148.60 | 0.56 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 51,188.20 | 0.05 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,118,042.70 | 1.91 |
| S | 综合 | 100,356.00 | 0.09 |
| | 合计 | 82,200,044.48 | 74.02 |

7.2.2 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。

7.3 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 | 43,300 | 2,536,514.00 | 2.28 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 3,110 | 2,274,840.60 | 2.05 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 211,910 | 1,483,370.00 | 1.34 |
| 4 | 600015 | 华夏银行 | 137,250 | 1,022,512.50 | 0.92 |
| 5 | 002304 | 洋河股份 | 7,650 | 1,006,740.00 | 0.91 |
| 6 | 601006 | 大秦铁路 | 120,250 | 987,252.50 | 0.89 |
| 7 | 000425 | 徐工机械 | 232,700 | 986,648.00 | 0.89 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 34,860 | 972,594.00 | 0.88 |
| 9 | 000157 | 中联重科 | 235,100 | 966,261.00 | 0.87 |
| 10 | 600369 | 西南证券 | 230,700 | 888,195.00 | 0.80 |
| 11 | 000858 | 五粮液 | 11,400 | 866,400.00 | 0.78 |
| 12 | 601169 | 北京银行 | 141,856 | 855,391.68 | 0.77 |
| 13 | 600208 | 新湖中宝 | 220,900 | 843,838.00 | 0.76 |
| 14 | 600170 | 上海建工 | 277,100 | 842,384.00 | 0.76 |
| 15 | 000651 | 格力电器 | 17,210 | 811,451.50 | 0.73 |
| 16 | 600376 | 首开股份 | 113,807 | 800,063.21 | 0.72 |
| 17 | 600585 | 海螺水泥 | 23,790 | 796,489.20 | 0.72 |
| 18 | 600104 | 上汽集团 | 22,620 | 791,473.80 | 0.71 |
| 19 | 601166 | 兴业银行 | 54,560 | 785,664.00 | 0.71 |
| 20 | 600919 | 江苏银行 | 117,900 | 755,739.00 | 0.68 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|---------|------------|------|
| 21 | 300027 | 华谊兄弟 | 122,300 | 753,368.00 | 0.68 |
| 22 | 601888 | 中国国旅 | 11,200 | 721,392.00 | 0.65 |
| 23 | 000333 | 美的集团 | 13,730 | 716,980.60 | 0.65 |
| 24 | 600741 | 华域汽车 | 29,815 | 707,211.80 | 0.64 |
| 25 | 600153 | 建发股份 | 78,285 | 703,782.15 | 0.63 |
| 26 | 000069 | 华侨城 A | 96,810 | 699,936.30 | 0.63 |
| 27 | 000338 | 潍柴动力 | 79,290 | 693,787.50 | 0.62 |
| 28 | 600089 | 特变电工 | 94,200 | 652,806.00 | 0.59 |
| 29 | 600383 | 金地集团 | 55,934 | 569,967.46 | 0.51 |
| 30 | 601668 | 中国建筑 | 102,980 | 562,270.80 | 0.51 |
| 31 | 002310 | 东方园林 | 37,370 | 561,671.10 | 0.51 |
| 32 | 601328 | 交通银行 | 95,900 | 550,466.00 | 0.50 |
| 33 | 000895 | 双汇发展 | 20,790 | 549,063.90 | 0.49 |
| 34 | 601390 | 中国中铁 | 73,120 | 546,206.40 | 0.49 |
| 35 | 600674 | 川投能源 | 62,212 | 542,488.64 | 0.49 |
| 36 | 600309 | 万华化学 | 11,900 | 540,498.00 | 0.49 |
| 37 | 601009 | 南京银行 | 68,560 | 529,968.80 | 0.48 |
| 38 | 000623 | 吉林敖东 | 29,300 | 526,814.00 | 0.47 |
| 39 | 601601 | 中国太保 | 16,412 | 522,722.20 | 0.47 |
| 40 | 600219 | 南山铝业 | 192,400 | 521,404.00 | 0.47 |
| 41 | 601211 | 国泰君安 | 33,500 | 493,790.00 | 0.44 |
| 42 | 000100 | TCL 集团 | 163,900 | 475,310.00 | 0.43 |
| 43 | 600036 | 招商银行 | 17,780 | 470,103.20 | 0.42 |
| 44 | 002294 | 信立泰 | 12,310 | 457,562.70 | 0.41 |
| 45 | 000826 | 启迪桑德 | 25,870 | 452,207.60 | 0.41 |
| 46 | 601229 | 上海银行 | 28,600 | 450,736.00 | 0.41 |
| 47 | 600820 | 隧道股份 | 76,181 | 450,229.71 | 0.41 |
| 48 | 000625 | 长安汽车 | 49,608 | 446,472.00 | 0.40 |
| 49 | 601168 | 西部矿业 | 70,900 | 445,252.00 | 0.40 |
| 50 | 603288 | 海天味业 | 6,000 | 441,840.00 | 0.40 |
| 51 | 601818 | 光大银行 | 120,140 | 439,712.40 | 0.40 |
| 52 | 002603 | 以岭药业 | 31,300 | 437,574.00 | 0.39 |
| 53 | 601997 | 贵阳银行 | 35,100 | 433,836.00 | 0.39 |
| 54 | 600795 | 国电电力 | 161,300 | 422,606.00 | 0.38 |
| 55 | 601607 | 上海医药 | 17,160 | 410,124.00 | 0.37 |
| 56 | 601717 | 郑煤机 | 69,800 | 405,538.00 | 0.37 |
| 57 | 600028 | 中国石化 | 62,100 | 403,029.00 | 0.36 |
| 58 | 601288 | 农业银行 | 116,700 | 401,448.00 | 0.36 |
| 59 | 300039 | 上海凯宝 | 69,110 | 400,838.00 | 0.36 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 60 | 600516 | 方大炭素 | 16,300 | 397,394.00 | 0.36 |
| 61 | 002450 | 康得新 | 23,200 | 396,256.00 | 0.36 |
| 62 | 002572 | 索菲亚 | 12,250 | 394,205.00 | 0.35 |
| 63 | 601186 | 中国铁建 | 45,315 | 390,615.30 | 0.35 |
| 64 | 000568 | 泸州老窖 | 6,400 | 389,504.00 | 0.35 |
| 65 | 600557 | 康缘药业 | 31,000 | 382,850.00 | 0.34 |
| 66 | 000718 | 苏宁环球 | 104,200 | 382,414.00 | 0.34 |
| 67 | 600398 | 海澜之家 | 29,010 | 369,587.40 | 0.33 |
| 68 | 600705 | 中航资本 | 78,900 | 368,463.00 | 0.33 |
| 69 | 600867 | 通化东宝 | 15,000 | 359,550.00 | 0.32 |
| 70 | 601333 | 广深铁路 | 82,800 | 351,900.00 | 0.32 |
| 71 | 603188 | 亚邦股份 | 33,534 | 342,046.80 | 0.31 |
| 72 | 601021 | 春秋航空 | 9,600 | 336,288.00 | 0.30 |
| 73 | 600978 | 宜华生活 | 46,940 | 320,600.20 | 0.29 |
| 74 | 600276 | 恒瑞医药 | 4,210 | 318,949.60 | 0.29 |
| 75 | 600611 | 大众交通 | 79,710 | 317,245.80 | 0.29 |
| 76 | 600216 | 浙江医药 | 24,400 | 311,588.00 | 0.28 |
| 77 | 000669 | 金鸿能源 | 42,840 | 310,590.00 | 0.28 |
| 78 | 000528 | 柳工 | 28,720 | 307,591.20 | 0.28 |
| 79 | 600518 | 康美药业 | 12,999 | 297,417.12 | 0.27 |
| 80 | 600655 | 豫园股份 | 31,300 | 295,785.00 | 0.27 |
| 81 | 002233 | 塔牌集团 | 25,800 | 295,152.00 | 0.27 |
| 82 | 600031 | 三一重工 | 32,830 | 294,485.10 | 0.27 |
| 83 | 000581 | 威孚高科 | 13,300 | 294,063.00 | 0.26 |
| 84 | 603444 | 吉比特 | 2,300 | 293,917.00 | 0.26 |
| 85 | 600886 | 国投电力 | 40,300 | 292,981.00 | 0.26 |
| 86 | 600837 | 海通证券 | 30,700 | 290,729.00 | 0.26 |
| 87 | 600500 | 中化国际 | 41,100 | 280,302.00 | 0.25 |
| 88 | 600373 | 中文传媒 | 21,630 | 277,945.50 | 0.25 |
| 89 | 000876 | 新希望 | 43,300 | 274,522.00 | 0.25 |
| 90 | 600729 | 重庆百货 | 8,300 | 273,485.00 | 0.25 |
| 91 | 601311 | 骆驼股份 | 23,710 | 271,953.70 | 0.24 |
| 92 | 600757 | 长江传媒 | 47,077 | 267,868.13 | 0.24 |
| 93 | 601099 | 太平洋 | 112,730 | 263,788.20 | 0.24 |
| 94 | 002415 | 海康威视 | 7,000 | 259,910.00 | 0.23 |
| 95 | 600064 | 南京高科 | 34,728 | 254,903.52 | 0.23 |
| 96 | 600694 | 大商股份 | 7,729 | 251,269.79 | 0.23 |
| 97 | 000002 | 万科 A | 10,079 | 247,943.40 | 0.22 |
| 98 | 000887 | 中鼎股份 | 16,900 | 243,529.00 | 0.22 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 99 | 600648 | 外高桥 | 13,200 | 241,296.00 | 0.22 |
| 100 | 000423 | 东阿阿胶 | 4,434 | 238,593.54 | 0.21 |
| 101 | 601016 | 节能风电 | 83,000 | 238,210.00 | 0.21 |
| 102 | 000031 | 中粮地产 | 40,900 | 236,402.00 | 0.21 |
| 103 | 601788 | 光大证券 | 21,230 | 233,105.40 | 0.21 |
| 104 | 601898 | 中煤能源 | 47,011 | 227,063.13 | 0.20 |
| 105 | 601991 | 大唐发电 | 74,900 | 226,947.00 | 0.20 |
| 106 | 600000 | 浦发银行 | 23,590 | 225,520.40 | 0.20 |
| 107 | 002317 | 众生药业 | 21,200 | 224,084.00 | 0.20 |
| 108 | 600649 | 城投控股 | 36,160 | 221,299.20 | 0.20 |
| 109 | 600422 | 昆药集团 | 28,374 | 219,898.50 | 0.20 |
| 110 | 601336 | 新华保险 | 5,100 | 218,688.00 | 0.20 |
| 111 | 600167 | 联美控股 | 21,700 | 217,000.00 | 0.20 |
| 112 | 002463 | 沪电股份 | 57,400 | 214,676.00 | 0.19 |
| 113 | 600926 | 杭州银行 | 19,200 | 212,928.00 | 0.19 |
| 114 | 600017 | 日照港 | 66,300 | 212,823.00 | 0.19 |
| 115 | 600009 | 上海机场 | 3,830 | 212,488.40 | 0.19 |
| 116 | 000008 | 神州高铁 | 42,802 | 212,297.92 | 0.19 |
| 117 | 000961 | 中南建设 | 33,600 | 212,016.00 | 0.19 |
| 118 | 601088 | 中国神华 | 10,550 | 210,367.00 | 0.19 |
| 119 | 600073 | 上海梅林 | 31,430 | 208,695.20 | 0.19 |
| 120 | 000963 | 华东医药 | 4,245 | 204,821.25 | 0.18 |
| 121 | 601117 | 中国化学 | 30,110 | 202,640.30 | 0.18 |
| 122 | 601928 | 凤凰传媒 | 32,900 | 200,032.00 | 0.18 |
| 123 | 300251 | 光线传媒 | 19,500 | 198,510.00 | 0.18 |
| 124 | 000627 | 天茂集团 | 28,161 | 197,690.22 | 0.18 |
| 125 | 600352 | 浙江龙盛 | 16,426 | 196,290.70 | 0.18 |
| 126 | 601618 | 中国中冶 | 58,800 | 195,804.00 | 0.18 |
| 127 | 601678 | 滨化股份 | 31,265 | 193,217.70 | 0.17 |
| 128 | 600340 | 华夏幸福 | 7,500 | 193,125.00 | 0.17 |
| 129 | 000848 | 承德露露 | 17,967 | 190,270.53 | 0.17 |
| 130 | 600572 | 康恩贝 | 26,400 | 189,288.00 | 0.17 |
| 131 | 002051 | 中工国际 | 12,300 | 187,821.00 | 0.17 |
| 132 | 000999 | 华润三九 | 6,600 | 183,678.00 | 0.17 |
| 133 | 600256 | 广汇能源 | 42,840 | 175,215.60 | 0.16 |
| 134 | 002146 | 荣盛发展 | 19,400 | 169,362.00 | 0.15 |
| 135 | 000898 | 鞍钢股份 | 29,850 | 166,264.50 | 0.15 |
| 136 | 000598 | 兴蓉环境 | 40,600 | 164,836.00 | 0.15 |
| 137 | 601801 | 皖新传媒 | 21,400 | 162,854.00 | 0.15 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 138 | 000725 | 京东方 A | 45,800 | 162,132.00 | 0.15 |
| 139 | 600704 | 物产中大 | 30,906 | 161,638.38 | 0.15 |
| 140 | 600639 | 浦东金桥 | 12,510 | 156,124.80 | 0.14 |
| 141 | 000001 | 平安银行 | 16,630 | 151,166.70 | 0.14 |
| 142 | 600535 | 天士力 | 5,834 | 150,633.88 | 0.14 |
| 143 | 600606 | 绿地控股 | 22,700 | 148,458.00 | 0.13 |
| 144 | 601988 | 中国银行 | 41,000 | 148,010.00 | 0.13 |
| 145 | 000006 | 深振业 A | 25,000 | 146,500.00 | 0.13 |
| 146 | 601689 | 拓普集团 | 7,500 | 145,800.00 | 0.13 |
| 147 | 000997 | 新大陆 | 9,200 | 144,900.00 | 0.13 |
| 148 | 002280 | 联络互动 | 25,200 | 144,144.00 | 0.13 |
| 149 | 601001 | 大同煤业 | 28,812 | 142,907.52 | 0.13 |
| 150 | 000758 | 中色股份 | 31,000 | 139,500.00 | 0.13 |
| 151 | 002426 | 胜利精密 | 38,700 | 139,320.00 | 0.13 |
| 152 | 000049 | 德赛电池 | 4,850 | 136,867.00 | 0.12 |
| 153 | 000778 | 新兴铸管 | 31,900 | 136,532.00 | 0.12 |
| 154 | 000501 | 鄂武商 A | 10,900 | 133,961.00 | 0.12 |
| 155 | 600690 | 青岛海尔 | 6,840 | 131,738.40 | 0.12 |
| 156 | 600023 | 浙能电力 | 28,110 | 130,992.60 | 0.12 |
| 157 | 002152 | 广电运通 | 22,200 | 130,536.00 | 0.12 |
| 158 | 002602 | 世纪华通 | 3,900 | 126,750.00 | 0.11 |
| 159 | 600201 | 生物股份 | 7,370 | 125,953.30 | 0.11 |
| 160 | 600061 | 国投资本 | 13,220 | 122,681.60 | 0.11 |
| 161 | 300297 | 蓝盾股份 | 15,110 | 122,542.10 | 0.11 |
| 162 | 600056 | 中国医药 | 6,600 | 120,582.00 | 0.11 |
| 163 | 000413 | 东旭光电 | 19,800 | 119,988.00 | 0.11 |
| 164 | 600048 | 保利地产 | 9,820 | 119,804.00 | 0.11 |
| 165 | 000783 | 长江证券 | 21,800 | 118,374.00 | 0.11 |
| 166 | 000547 | 航天发展 | 15,100 | 117,931.00 | 0.11 |
| 167 | 002373 | 千方科技 | 8,900 | 116,145.00 | 0.10 |
| 168 | 600019 | 宝钢股份 | 14,800 | 115,292.00 | 0.10 |
| 169 | 300026 | 红日药业 | 31,000 | 113,150.00 | 0.10 |
| 170 | 000926 | 福星股份 | 15,700 | 112,883.00 | 0.10 |
| 171 | 600030 | 中信证券 | 6,800 | 112,676.00 | 0.10 |
| 172 | 001979 | 招商蛇口 | 5,860 | 111,633.00 | 0.10 |
| 173 | 601811 | 新华文轩 | 11,393 | 110,739.96 | 0.10 |
| 174 | 600062 | 华润双鹤 | 4,500 | 110,475.00 | 0.10 |
| 175 | 000723 | 美锦能源 | 20,200 | 109,686.00 | 0.10 |
| 176 | 000488 | 晨鸣纸业 | 8,400 | 108,528.00 | 0.10 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 177 | 600618 | 氯碱化工 | 12,640 | 107,566.40 | 0.10 |
| 178 | 600126 | 杭钢股份 | 17,900 | 106,863.00 | 0.10 |
| 179 | 002221 | 东华能源 | 10,600 | 103,562.00 | 0.09 |
| 180 | 002174 | 游族网络 | 5,100 | 101,490.00 | 0.09 |
| 181 | 601985 | 中国核电 | 17,700 | 100,005.00 | 0.09 |
| 182 | 600664 | 哈药股份 | 25,100 | 99,647.00 | 0.09 |
| 183 | 600050 | 中国联通 | 20,200 | 99,384.00 | 0.09 |
| 184 | 600332 | 白云山 | 2,600 | 98,930.00 | 0.09 |
| 185 | 600597 | 光明乳业 | 10,000 | 98,700.00 | 0.09 |
| 186 | 002508 | 老板电器 | 3,217 | 98,504.54 | 0.09 |
| 187 | 603858 | 步长制药 | 2,300 | 98,417.00 | 0.09 |
| 188 | 600177 | 雅戈尔 | 12,655 | 97,443.50 | 0.09 |
| 189 | 600522 | 中天科技 | 11,020 | 97,086.20 | 0.09 |
| 190 | 601377 | 兴业证券 | 18,260 | 96,230.20 | 0.09 |
| 191 | 600755 | 厦门国贸 | 13,200 | 96,228.00 | 0.09 |
| 192 | 300182 | 捷成股份 | 12,400 | 93,992.00 | 0.08 |
| 193 | 600143 | 金发科技 | 17,600 | 91,872.00 | 0.08 |
| 194 | 600688 | 上海石化 | 16,101 | 91,614.69 | 0.08 |
| 195 | 600006 | 东风汽车 | 22,300 | 91,207.00 | 0.08 |
| 196 | 600160 | 巨化股份 | 12,450 | 91,134.00 | 0.08 |
| 197 | 603198 | 迎驾贡酒 | 4,910 | 90,196.70 | 0.08 |
| 198 | 600011 | 华能国际 | 14,110 | 89,739.60 | 0.08 |
| 199 | 002056 | 横店东磁 | 12,800 | 89,728.00 | 0.08 |
| 200 | 000552 | 靖远煤电 | 27,400 | 89,598.00 | 0.08 |
| 201 | 600260 | 凯乐科技 | 3,300 | 88,572.00 | 0.08 |
| 202 | 002128 | 露天煤业 | 9,720 | 88,063.20 | 0.08 |
| 203 | 002440 | 闰土股份 | 7,500 | 87,675.00 | 0.08 |
| 204 | 002078 | 太阳纸业 | 9,000 | 87,210.00 | 0.08 |
| 205 | 300088 | 长信科技 | 14,600 | 84,680.00 | 0.08 |
| 206 | 600750 | 江中药业 | 4,760 | 84,490.00 | 0.08 |
| 207 | 600959 | 江苏有线 | 16,500 | 84,150.00 | 0.08 |
| 208 | 002640 | 跨境通 | 5,600 | 84,112.00 | 0.08 |
| 209 | 600079 | 人福医药 | 6,320 | 83,550.40 | 0.08 |
| 210 | 603019 | 中科曙光 | 1,800 | 82,566.00 | 0.07 |
| 211 | 002344 | 海宁皮城 | 16,820 | 81,745.20 | 0.07 |
| 212 | 002354 | 天神娱乐 | 8,800 | 81,488.00 | 0.07 |
| 213 | 601128 | 常熟银行 | 14,100 | 80,652.00 | 0.07 |
| 214 | 000830 | 鲁西化工 | 4,665 | 79,678.20 | 0.07 |
| 215 | 002332 | 仙琚制药 | 9,100 | 79,625.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|--------|-----------|------|
| 216 | 603025 | 大豪科技 | 4,108 | 79,448.72 | 0.07 |
| 217 | 002589 | 瑞康医药 | 5,700 | 77,748.00 | 0.07 |
| 218 | 002004 | 华邦健康 | 15,300 | 77,724.00 | 0.07 |
| 219 | 002410 | 广联达 | 2,800 | 77,644.00 | 0.07 |
| 220 | 000980 | 金马股份 | 10,900 | 77,499.00 | 0.07 |
| 221 | 002110 | 三钢闽光 | 4,800 | 76,944.00 | 0.07 |
| 222 | 000977 | 浪潮信息 | 3,200 | 76,320.00 | 0.07 |
| 223 | 600939 | 重庆建工 | 15,400 | 76,076.00 | 0.07 |
| 224 | 000975 | 银泰资源 | 7,460 | 75,644.40 | 0.07 |
| 225 | 002064 | 华峰氨纶 | 18,300 | 75,579.00 | 0.07 |
| 226 | 000538 | 云南白药 | 700 | 74,872.00 | 0.07 |
| 227 | 000541 | 佛山照明 | 12,364 | 74,060.36 | 0.07 |
| 228 | 300122 | 智飞生物 | 1,600 | 73,184.00 | 0.07 |
| 229 | 000060 | 中金岭南 | 15,000 | 72,900.00 | 0.07 |
| 230 | 000553 | 沙隆达 A | 4,600 | 72,726.00 | 0.07 |
| 231 | 002277 | 友阿股份 | 15,440 | 71,178.40 | 0.06 |
| 232 | 002505 | 大康农业 | 33,000 | 70,620.00 | 0.06 |
| 233 | 600426 | 华鲁恒升 | 4,000 | 70,360.00 | 0.06 |
| 234 | 300287 | 飞利信 | 9,700 | 69,743.00 | 0.06 |
| 235 | 601000 | 唐山港 | 29,670 | 69,724.50 | 0.06 |
| 236 | 601200 | 上海环境 | 4,400 | 69,652.00 | 0.06 |
| 237 | 002407 | 多氟多 | 4,900 | 68,698.00 | 0.06 |
| 238 | 601225 | 陕西煤业 | 8,350 | 68,637.00 | 0.06 |
| 239 | 000661 | 长春高新 | 300 | 68,310.00 | 0.06 |
| 240 | 600808 | 马钢股份 | 18,745 | 67,294.55 | 0.06 |
| 241 | 300315 | 掌趣科技 | 15,700 | 65,626.00 | 0.06 |
| 242 | 600499 | 科达洁能 | 9,500 | 65,170.00 | 0.06 |
| 243 | 600908 | 无锡银行 | 11,000 | 64,790.00 | 0.06 |
| 244 | 600511 | 国药股份 | 2,400 | 64,680.00 | 0.06 |
| 245 | 600580 | 卧龙电气 | 8,309 | 63,314.58 | 0.06 |
| 246 | 300324 | 旋极信息 | 6,619 | 62,814.31 | 0.06 |
| 247 | 002191 | 劲嘉股份 | 8,400 | 62,748.00 | 0.06 |
| 248 | 002244 | 滨江集团 | 12,000 | 62,400.00 | 0.06 |
| 249 | 002491 | 通鼎互联 | 5,600 | 61,992.00 | 0.06 |
| 250 | 002815 | 崇达技术 | 3,800 | 61,180.00 | 0.06 |
| 251 | 002002 | 鸿达兴业 | 13,200 | 60,852.00 | 0.05 |
| 252 | 600881 | 亚泰集团 | 16,300 | 60,799.00 | 0.05 |
| 253 | 601800 | 中国交建 | 5,300 | 60,367.00 | 0.05 |
| 254 | 002608 | *ST 舜船 | 8,700 | 60,030.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 255 | 000825 | 太钢不锈 | 10,000 | 60,000.00 | 0.05 |
| 256 | 000028 | 国药一致 | 1,200 | 59,880.00 | 0.05 |
| 257 | 002385 | 大北农 | 14,292 | 59,025.96 | 0.05 |
| 258 | 600458 | 时代新材 | 8,000 | 58,880.00 | 0.05 |
| 259 | 600748 | 上实发展 | 11,500 | 57,960.00 | 0.05 |
| 260 | 600282 | 南钢股份 | 13,000 | 57,460.00 | 0.05 |
| 261 | 601669 | 中国电建 | 10,700 | 57,352.00 | 0.05 |
| 262 | 300253 | 卫宁健康 | 4,600 | 56,994.00 | 0.05 |
| 263 | 600809 | 山西汾酒 | 900 | 56,601.00 | 0.05 |
| 264 | 600737 | 中粮糖业 | 7,320 | 55,192.80 | 0.05 |
| 265 | 000066 | 长城电脑 | 7,600 | 54,036.00 | 0.05 |
| 266 | 600545 | 卓郎智能 | 6,708 | 53,261.52 | 0.05 |
| 267 | 600390 | 五矿资本 | 6,700 | 51,925.00 | 0.05 |
| 268 | 300002 | 神州泰岳 | 12,400 | 51,708.00 | 0.05 |
| 269 | 002400 | 省广股份 | 15,900 | 51,357.00 | 0.05 |
| 270 | 600022 | 山东钢铁 | 25,200 | 50,904.00 | 0.05 |
| 271 | 000012 | 南玻 A | 10,265 | 50,811.75 | 0.05 |
| 272 | 300055 | 万邦达 | 4,400 | 50,556.00 | 0.05 |
| 273 | 002176 | 江特电机 | 5,200 | 50,544.00 | 0.05 |
| 274 | 002268 | 卫士通 | 2,300 | 50,209.00 | 0.05 |
| 275 | 000766 | 通化金马 | 4,200 | 49,896.00 | 0.04 |
| 276 | 600643 | 爱建集团 | 5,138 | 48,297.20 | 0.04 |
| 277 | 002416 | 爱施德 | 8,220 | 48,251.40 | 0.04 |
| 278 | 300159 | 新研股份 | 6,800 | 48,144.00 | 0.04 |
| 279 | 002195 | 二三四五 | 11,023 | 47,178.44 | 0.04 |
| 280 | 600970 | 中材国际 | 7,000 | 46,760.00 | 0.04 |
| 281 | 002439 | 启明星辰 | 2,200 | 46,684.00 | 0.04 |
| 282 | 002180 | 艾派克 | 1,700 | 46,682.00 | 0.04 |
| 283 | 002230 | 科大讯飞 | 1,450 | 46,501.50 | 0.04 |
| 284 | 600325 | 华发股份 | 6,000 | 46,380.00 | 0.04 |
| 285 | 601179 | 中国西电 | 13,500 | 46,170.00 | 0.04 |
| 286 | 600703 | 三安光电 | 2,400 | 46,128.00 | 0.04 |
| 287 | 002583 | 海能达 | 5,500 | 45,925.00 | 0.04 |
| 288 | 600718 | 东软集团 | 3,497 | 45,670.82 | 0.04 |
| 289 | 002359 | 齐星铁塔 | 2,300 | 45,034.00 | 0.04 |
| 290 | 600811 | 东方集团 | 10,300 | 44,290.00 | 0.04 |
| 291 | 300059 | 东方财富 | 3,360 | 44,284.80 | 0.04 |
| 292 | 300166 | 东方国信 | 3,000 | 44,190.00 | 0.04 |
| 293 | 002022 | 科华生物 | 3,700 | 43,845.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 294 | 600637 | 东方明珠 | 2,900 | 43,674.00 | 0.04 |
| 295 | 000813 | 德展健康 | 5,300 | 43,672.00 | 0.04 |
| 296 | 000078 | 海王生物 | 9,000 | 43,290.00 | 0.04 |
| 297 | 601111 | 中国国航 | 4,800 | 42,672.00 | 0.04 |
| 298 | 002709 | 天赐材料 | 1,100 | 42,394.00 | 0.04 |
| 299 | 600614 | 鹏起科技 | 7,400 | 42,254.00 | 0.04 |
| 300 | 002375 | 亚厦股份 | 7,900 | 42,186.00 | 0.04 |
| 301 | 000703 | 恒逸石化 | 2,760 | 41,068.80 | 0.04 |
| 302 | 600195 | 中牧股份 | 2,110 | 41,039.50 | 0.04 |
| 303 | 600823 | 世茂股份 | 9,800 | 40,964.00 | 0.04 |
| 304 | 000009 | 中国宝安 | 8,200 | 40,180.00 | 0.04 |
| 305 | 600816 | 安信信托 | 5,320 | 38,516.80 | 0.03 |
| 306 | 600410 | 华胜天成 | 4,400 | 38,500.00 | 0.03 |
| 307 | 002008 | 大族激光 | 720 | 38,296.80 | 0.03 |
| 308 | 600863 | 内蒙华电 | 16,830 | 38,204.10 | 0.03 |
| 309 | 601155 | 新城控股 | 1,230 | 38,093.10 | 0.03 |
| 310 | 300070 | 碧水源 | 2,700 | 37,611.00 | 0.03 |
| 311 | 600936 | 广西广电 | 7,900 | 37,604.00 | 0.03 |
| 312 | 000860 | 顺鑫农业 | 1,000 | 37,500.00 | 0.03 |
| 313 | 002183 | 怡亚通 | 5,600 | 37,240.00 | 0.03 |
| 314 | 002019 | 亿帆医药 | 2,100 | 37,065.00 | 0.03 |
| 315 | 600582 | 天地科技 | 10,020 | 36,773.40 | 0.03 |
| 316 | 600068 | 葛洲坝 | 5,100 | 36,771.00 | 0.03 |
| 317 | 600482 | 中国动力 | 2,100 | 36,645.00 | 0.03 |
| 318 | 600743 | 华远地产 | 14,200 | 36,494.00 | 0.03 |
| 319 | 600839 | 四川长虹 | 12,700 | 36,322.00 | 0.03 |
| 320 | 600859 | 王府井 | 1,700 | 36,159.00 | 0.03 |
| 321 | 002236 | 大华股份 | 1,600 | 36,080.00 | 0.03 |
| 322 | 300308 | 中际装备 | 600 | 36,024.00 | 0.03 |
| 323 | 603328 | 依顿电子 | 3,300 | 35,805.00 | 0.03 |
| 324 | 600885 | 宏发股份 | 1,180 | 35,305.60 | 0.03 |
| 325 | 300113 | 顺网科技 | 2,000 | 34,820.00 | 0.03 |
| 326 | 002261 | 拓维信息 | 7,500 | 34,500.00 | 0.03 |
| 327 | 600277 | 亿利洁能 | 6,520 | 34,164.80 | 0.03 |
| 328 | 002701 | 奥瑞金 | 6,200 | 33,852.00 | 0.03 |
| 329 | 600777 | 新潮能源 | 15,400 | 33,726.00 | 0.03 |
| 330 | 601238 | 广汽集团 | 3,020 | 33,642.80 | 0.03 |
| 331 | 300010 | 立思辰 | 2,700 | 33,048.00 | 0.03 |
| 332 | 601127 | 小康股份 | 1,900 | 32,851.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 333 | 000685 | 中山公用 | 4,100 | 32,677.00 | 0.03 |
| 334 | 300603 | 立昂技术 | 900 | 32,157.00 | 0.03 |
| 335 | 601360 | 三六零 | 1,100 | 31,790.00 | 0.03 |
| 336 | 002475 | 立讯精密 | 1,400 | 31,556.00 | 0.03 |
| 337 | 600108 | 亚盛集团 | 10,800 | 31,212.00 | 0.03 |
| 338 | 002807 | 江阴银行 | 5,500 | 30,910.00 | 0.03 |
| 339 | 600380 | 健康元 | 2,600 | 30,836.00 | 0.03 |
| 340 | 600872 | 中炬高新 | 1,100 | 30,800.00 | 0.03 |
| 341 | 002456 | 欧菲光 | 1,900 | 30,647.00 | 0.03 |
| 342 | 603799 | 华友钴业 | 300 | 29,241.00 | 0.03 |
| 343 | 600196 | 复星医药 | 700 | 28,973.00 | 0.03 |
| 344 | 600993 | 马应龙 | 1,700 | 28,917.00 | 0.03 |
| 345 | 000750 | 国海证券 | 8,000 | 28,560.00 | 0.03 |
| 346 | 000402 | 金融街 | 3,500 | 28,175.00 | 0.03 |
| 347 | 600060 | 海信电器 | 2,100 | 28,119.00 | 0.03 |
| 348 | 600570 | 恒生电子 | 526 | 27,851.70 | 0.03 |
| 349 | 000418 | 小天鹅A | 400 | 27,740.00 | 0.02 |
| 350 | 600395 | 盘江股份 | 4,500 | 27,315.00 | 0.02 |
| 351 | 000513 | 丽珠集团 | 620 | 27,249.00 | 0.02 |
| 352 | 600066 | 宇通客车 | 1,400 | 26,866.00 | 0.02 |
| 353 | 000596 | 古井贡酒 | 300 | 26,634.00 | 0.02 |
| 354 | 002073 | 软控股份 | 4,600 | 26,450.00 | 0.02 |
| 355 | 600895 | 张江高科 | 2,300 | 26,450.00 | 0.02 |
| 356 | 600169 | 太原重工 | 11,300 | 26,442.00 | 0.02 |
| 357 | 600682 | 南京新百 | 1,600 | 26,304.00 | 0.02 |
| 358 | 002368 | 太极股份 | 900 | 26,163.00 | 0.02 |
| 359 | 300003 | 乐普医疗 | 700 | 25,676.00 | 0.02 |
| 360 | 600521 | 华海药业 | 960 | 25,622.40 | 0.02 |
| 361 | 600271 | 航天信息 | 1,010 | 25,522.70 | 0.02 |
| 362 | 000503 | 海虹控股 | 800 | 25,424.00 | 0.02 |
| 363 | 002916 | 深南电路 | 400 | 25,404.00 | 0.02 |
| 364 | 000040 | 东旭蓝天 | 2,500 | 25,250.00 | 0.02 |
| 365 | 600565 | 迪马股份 | 8,400 | 24,780.00 | 0.02 |
| 366 | 600300 | 维维股份 | 7,600 | 24,776.00 | 0.02 |
| 367 | 600536 | 中国软件 | 1,140 | 24,658.20 | 0.02 |
| 368 | 600528 | 中铁工业 | 2,400 | 24,528.00 | 0.02 |
| 369 | 000671 | 阳光城 | 4,100 | 24,477.00 | 0.02 |
| 370 | 002707 | 众信旅游 | 2,500 | 24,000.00 | 0.02 |
| 371 | 600094 | 大名城 | 4,116 | 23,708.16 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 372 | 002600 | 江粉磁材 | 4,500 | 23,355.00 | 0.02 |
| 373 | 002512 | 达华智能 | 2,400 | 23,280.00 | 0.02 |
| 374 | 600317 | 营口港 | 10,300 | 23,278.00 | 0.02 |
| 375 | 002142 | 宁波银行 | 1,420 | 23,131.80 | 0.02 |
| 376 | 600051 | 宁波联合 | 3,700 | 23,088.00 | 0.02 |
| 377 | 600875 | 东方电气 | 3,100 | 22,971.00 | 0.02 |
| 378 | 603369 | 今世缘 | 1,000 | 22,830.00 | 0.02 |
| 379 | 600329 | 中新药业 | 1,200 | 22,800.00 | 0.02 |
| 380 | 600436 | 片仔癀 | 200 | 22,386.00 | 0.02 |
| 381 | 600657 | 信达地产 | 5,200 | 22,100.00 | 0.02 |
| 382 | 600598 | 北大荒 | 2,400 | 21,984.00 | 0.02 |
| 383 | 600717 | 天津港 | 2,900 | 21,837.00 | 0.02 |
| 384 | 600125 | 铁龙物流 | 2,600 | 21,762.00 | 0.02 |
| 385 | 600708 | 光明地产 | 5,060 | 21,758.00 | 0.02 |
| 386 | 600588 | 用友网络 | 880 | 21,568.80 | 0.02 |
| 387 | 600594 | 益佰制药 | 2,400 | 21,504.00 | 0.02 |
| 388 | 000059 | 华锦股份 | 3,100 | 21,359.00 | 0.02 |
| 389 | 603766 | 隆鑫通用 | 3,900 | 21,177.00 | 0.02 |
| 390 | 600801 | 华新水泥 | 1,400 | 21,042.00 | 0.02 |
| 391 | 603568 | 伟明环保 | 830 | 20,999.00 | 0.02 |
| 392 | 600183 | 生益科技 | 2,290 | 20,976.40 | 0.02 |
| 393 | 002308 | 威创股份 | 2,520 | 20,916.00 | 0.02 |
| 394 | 002635 | 安洁科技 | 1,200 | 20,640.00 | 0.02 |
| 395 | 001696 | 宗申动力 | 4,200 | 20,580.00 | 0.02 |
| 396 | 601966 | 玲珑轮胎 | 1,300 | 20,501.00 | 0.02 |
| 397 | 000016 | 深康佳 A | 3,900 | 20,475.00 | 0.02 |
| 398 | 600804 | 鹏博士 | 1,700 | 20,400.00 | 0.02 |
| 399 | 002241 | 歌尔股份 | 2,000 | 20,380.00 | 0.02 |
| 400 | 000519 | 江南红箭 | 2,600 | 20,202.00 | 0.02 |
| 401 | 000563 | 陕国投 A | 5,900 | 20,060.00 | 0.02 |
| 402 | 601231 | 环旭电子 | 2,200 | 19,954.00 | 0.02 |
| 403 | 600869 | 智慧能源 | 4,200 | 19,824.00 | 0.02 |
| 404 | 002044 | 美年健康 | 860 | 19,436.00 | 0.02 |
| 405 | 000537 | 广宇发展 | 2,000 | 19,280.00 | 0.02 |
| 406 | 002437 | 誉衡药业 | 3,100 | 19,220.00 | 0.02 |
| 407 | 600350 | 山东高速 | 4,700 | 19,035.00 | 0.02 |
| 408 | 002657 | 中科金财 | 1,200 | 19,008.00 | 0.02 |
| 409 | 002038 | 双鹭药业 | 500 | 18,995.00 | 0.02 |
| 410 | 300015 | 爱尔眼科 | 580 | 18,728.20 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 411 | 600100 | 同方股份 | 2,100 | 18,438.00 | 0.02 |
| 412 | 603589 | 口子窖 | 300 | 18,435.00 | 0.02 |
| 413 | 600678 | 四川金顶 | 1,800 | 18,432.00 | 0.02 |
| 414 | 000918 | 嘉凯城 | 4,000 | 18,200.00 | 0.02 |
| 415 | 002065 | 东华软件 | 2,070 | 17,802.00 | 0.02 |
| 416 | 601777 | 力帆股份 | 3,400 | 17,782.00 | 0.02 |
| 417 | 002093 | 国脉科技 | 2,300 | 17,733.00 | 0.02 |
| 418 | 600293 | 三峡新材 | 3,100 | 17,608.00 | 0.02 |
| 419 | 002223 | 鱼跃医疗 | 900 | 17,541.00 | 0.02 |
| 420 | 000166 | 申万宏源 | 4,000 | 17,480.00 | 0.02 |
| 421 | 600184 | 光电股份 | 1,400 | 17,346.00 | 0.02 |
| 422 | 300272 | 开能环保 | 1,600 | 17,328.00 | 0.02 |
| 423 | 600157 | 永泰能源 | 9,600 | 17,088.00 | 0.02 |
| 424 | 300418 | 昆仑万维 | 900 | 16,992.00 | 0.02 |
| 425 | 002249 | 大洋电机 | 3,900 | 16,809.00 | 0.02 |
| 426 | 600120 | 浙江东方 | 1,230 | 16,666.50 | 0.02 |
| 427 | 002503 | 搜于特 | 4,710 | 16,485.00 | 0.01 |
| 428 | 600292 | 远达环保 | 2,800 | 16,436.00 | 0.01 |
| 429 | 600161 | 天坛生物 | 840 | 16,254.00 | 0.01 |
| 430 | 600641 | 万业企业 | 1,300 | 15,834.00 | 0.01 |
| 431 | 002818 | 富森美 | 600 | 15,828.00 | 0.01 |
| 432 | 600348 | 阳泉煤业 | 2,200 | 15,730.00 | 0.01 |
| 433 | 000062 | 深圳华强 | 800 | 15,680.00 | 0.01 |
| 434 | 002642 | 荣之联 | 1,700 | 15,623.00 | 0.01 |
| 435 | 002626 | 金达威 | 900 | 15,615.00 | 0.01 |
| 436 | 002027 | 分众传媒 | 1,612 | 15,426.84 | 0.01 |
| 437 | 000662 | 天夏智慧 | 2,380 | 15,303.40 | 0.01 |
| 438 | 000885 | 同力水泥 | 1,500 | 15,240.00 | 0.01 |
| 439 | 601020 | 华钰矿业 | 1,100 | 15,169.00 | 0.01 |
| 440 | 300017 | 网宿科技 | 1,400 | 14,994.00 | 0.01 |
| 441 | 600563 | 法拉电子 | 300 | 14,847.00 | 0.01 |
| 442 | 300657 | 弘信电子 | 500 | 14,800.00 | 0.01 |
| 443 | 002251 | 步步高 | 1,300 | 14,794.00 | 0.01 |
| 444 | 000892 | 星美联合 | 3,100 | 14,601.00 | 0.01 |
| 445 | 002275 | 桂林三金 | 1,000 | 14,600.00 | 0.01 |
| 446 | 002203 | 海亮股份 | 1,800 | 14,580.00 | 0.01 |
| 447 | 600180 | 瑞茂通 | 1,500 | 14,535.00 | 0.01 |
| 448 | 600897 | 厦门空港 | 700 | 14,434.00 | 0.01 |
| 449 | 000034 | 神州数码 | 900 | 14,382.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 450 | 000878 | 云南铜业 | 1,500 | 14,310.00 | 0.01 |
| 451 | 600966 | 博汇纸业 | 3,300 | 14,223.00 | 0.01 |
| 452 | 002007 | 华兰生物 | 430 | 13,828.80 | 0.01 |
| 453 | 600179 | 安通控股 | 1,360 | 13,776.80 | 0.01 |
| 454 | 600230 | 沧州大化 | 620 | 13,739.20 | 0.01 |
| 455 | 601579 | 会稽山 | 1,400 | 13,706.00 | 0.01 |
| 456 | 000046 | 泛海控股 | 2,400 | 13,656.00 | 0.01 |
| 457 | 000400 | 许继电气 | 1,740 | 13,589.40 | 0.01 |
| 458 | 000921 | 海信科龙 | 1,300 | 13,468.00 | 0.01 |
| 459 | 002080 | 中材科技 | 1,580 | 13,430.00 | 0.01 |
| 460 | 002493 | 荣盛石化 | 1,300 | 13,416.00 | 0.01 |
| 461 | 600873 | 梅花生物 | 3,200 | 13,376.00 | 0.01 |
| 462 | 600835 | 上海机电 | 700 | 13,202.00 | 0.01 |
| 463 | 002247 | 帝龙文化 | 1,600 | 13,120.00 | 0.01 |
| 464 | 000070 | 特发信息 | 1,800 | 13,050.00 | 0.01 |
| 465 | 603160 | 汇顶科技 | 200 | 12,978.00 | 0.01 |
| 466 | 600623 | 华谊集团 | 1,300 | 12,974.00 | 0.01 |
| 467 | 300546 | 雄帝科技 | 600 | 12,924.00 | 0.01 |
| 468 | 600039 | 四川路桥 | 3,900 | 12,792.00 | 0.01 |
| 469 | 601003 | 柳钢股份 | 1,600 | 12,672.00 | 0.01 |
| 470 | 002061 | *ST江化 | 1,200 | 12,564.00 | 0.01 |
| 471 | 002314 | 南山控股 | 3,100 | 12,493.00 | 0.01 |
| 472 | 600338 | 西藏珠峰 | 600 | 12,432.00 | 0.01 |
| 473 | 600782 | 新钢股份 | 2,200 | 12,276.00 | 0.01 |
| 474 | 600713 | 南京医药 | 2,500 | 12,225.00 | 0.01 |
| 475 | 600602 | 云赛智联 | 2,100 | 12,180.00 | 0.01 |
| 476 | 603355 | 莱克电气 | 400 | 12,020.00 | 0.01 |
| 477 | 000736 | 中房地产 | 1,085 | 11,989.25 | 0.01 |
| 478 | 600279 | 重庆港九 | 2,700 | 11,988.00 | 0.01 |
| 479 | 002558 | 世纪游轮 | 500 | 11,890.00 | 0.01 |
| 480 | 300118 | 东方日升 | 1,100 | 11,880.00 | 0.01 |
| 481 | 002736 | 国信证券 | 1,300 | 11,830.00 | 0.01 |
| 482 | 600372 | 中航电子 | 900 | 11,754.00 | 0.01 |
| 483 | 002470 | 金正大 | 1,700 | 11,696.00 | 0.01 |
| 484 | 600796 | 钱江生化 | 1,900 | 11,552.00 | 0.01 |
| 485 | 603225 | 新风鸣 | 577 | 11,522.69 | 0.01 |
| 486 | 300202 | 聚龙股份 | 1,100 | 11,473.00 | 0.01 |
| 487 | 601908 | 京运通 | 2,500 | 11,450.00 | 0.01 |
| 488 | 600850 | 华东电脑 | 600 | 11,394.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 489 | 600018 | 上港集团 | 1,900 | 11,324.00 | 0.01 |
| 490 | 300194 | 福安药业 | 2,400 | 11,280.00 | 0.01 |
| 491 | 002528 | 英飞拓 | 2,700 | 11,259.00 | 0.01 |
| 492 | 002345 | 潮宏基 | 1,300 | 11,180.00 | 0.01 |
| 493 | 601877 | 正泰电器 | 500 | 11,160.00 | 0.01 |
| 494 | 002399 | 海普瑞 | 500 | 11,070.00 | 0.01 |
| 495 | 300498 | 温氏股份 | 500 | 11,010.00 | 0.01 |
| 496 | 600240 | 华业资本 | 1,500 | 10,995.00 | 0.01 |
| 497 | 600781 | 辅仁药业 | 700 | 10,990.00 | 0.01 |
| 498 | 000631 | 顺发恒业 | 3,200 | 10,976.00 | 0.01 |
| 499 | 600827 | 百联股份 | 1,070 | 10,914.00 | 0.01 |
| 500 | 002011 | 盾安环境 | 1,700 | 10,880.00 | 0.01 |
| 501 | 603986 | 兆易创新 | 100 | 10,852.00 | 0.01 |
| 502 | 601515 | 东风股份 | 1,400 | 10,808.00 | 0.01 |
| 503 | 002479 | 富春环保 | 1,900 | 10,735.00 | 0.01 |
| 504 | 002841 | 视源股份 | 200 | 10,682.00 | 0.01 |
| 505 | 000039 | 中集集团 | 800 | 10,624.00 | 0.01 |
| 506 | 600085 | 同仁堂 | 300 | 10,584.00 | 0.01 |
| 507 | 600525 | 长园集团 | 1,000 | 10,570.00 | 0.01 |
| 508 | 601998 | 中信银行 | 1,700 | 10,557.00 | 0.01 |
| 509 | 300604 | 长川科技 | 290 | 10,547.30 | 0.01 |
| 510 | 000063 | 中兴通讯 | 800 | 10,424.00 | 0.01 |
| 511 | 002567 | 唐人神 | 2,300 | 10,419.00 | 0.01 |
| 512 | 600765 | 中航重机 | 1,400 | 10,416.00 | 0.01 |
| 513 | 600488 | 天药股份 | 2,500 | 10,275.00 | 0.01 |
| 514 | 600828 | 茂业商业 | 2,000 | 10,200.00 | 0.01 |
| 515 | 600267 | 海正药业 | 700 | 10,178.00 | 0.01 |
| 516 | 300273 | 和佳股份 | 1,500 | 10,170.00 | 0.01 |
| 517 | 600658 | 电子城 | 1,940 | 10,146.20 | 0.01 |
| 518 | 300406 | 九强生物 | 700 | 10,080.00 | 0.01 |
| 519 | 002118 | 紫鑫药业 | 1,400 | 10,010.00 | 0.01 |
| 520 | 002454 | 松芝股份 | 1,700 | 9,979.00 | 0.01 |
| 521 | 600105 | 永鼎股份 | 2,740 | 9,973.60 | 0.01 |
| 522 | 002624 | 完美世界 | 320 | 9,923.20 | 0.01 |
| 523 | 600459 | 贵研铂业 | 910 | 9,828.00 | 0.01 |
| 524 | 600829 | 人民同泰 | 1,368 | 9,794.88 | 0.01 |
| 525 | 600773 | 西藏城投 | 1,400 | 9,688.00 | 0.01 |
| 526 | 300676 | 华大基因 | 100 | 9,681.00 | 0.01 |
| 527 | 300219 | 鸿利智汇 | 1,000 | 9,680.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|-------|----------|------|
| 528 | 600575 | 皖江物流 | 2,600 | 9,646.00 | 0.01 |
| 529 | 002092 | 中泰化学 | 1,000 | 9,640.00 | 0.01 |
| 530 | 600566 | 济川药业 | 200 | 9,638.00 | 0.01 |
| 531 | 002422 | 科伦药业 | 300 | 9,630.00 | 0.01 |
| 532 | 601666 | 平煤股份 | 2,300 | 9,614.00 | 0.01 |
| 533 | 002581 | 未名医药 | 900 | 9,585.00 | 0.01 |
| 534 | 002041 | 登海种业 | 1,400 | 9,548.00 | 0.01 |
| 535 | 600642 | 申能股份 | 1,900 | 9,538.00 | 0.01 |
| 536 | 603660 | 苏州科达 | 420 | 9,513.00 | 0.01 |
| 537 | 601958 | 金钼股份 | 1,500 | 9,405.00 | 0.01 |
| 538 | 300346 | 南大光电 | 720 | 9,381.60 | 0.01 |
| 539 | 603567 | 珍宝岛 | 700 | 9,380.00 | 0.01 |
| 540 | 600420 | 现代制药 | 900 | 9,360.00 | 0.01 |
| 541 | 002501 | 利源精制 | 1,500 | 9,300.00 | 0.01 |
| 542 | 000785 | 武汉中商 | 1,200 | 9,240.00 | 0.01 |
| 543 | 600640 | 号百控股 | 900 | 9,153.00 | 0.01 |
| 544 | 600894 | 广日股份 | 1,540 | 9,132.20 | 0.01 |
| 545 | 300492 | 山鼎设计 | 400 | 9,116.00 | 0.01 |
| 546 | 002081 | 金螳螂 | 900 | 9,090.00 | 0.01 |
| 547 | 002424 | 贵州百灵 | 800 | 9,088.00 | 0.01 |
| 548 | 600723 | 首商股份 | 1,300 | 9,087.00 | 0.01 |
| 549 | 601677 | 明泰铝业 | 900 | 9,036.00 | 0.01 |
| 550 | 002880 | 卫光生物 | 200 | 8,992.00 | 0.01 |
| 551 | 600438 | 通威股份 | 1,300 | 8,970.00 | 0.01 |
| 552 | 002482 | 广田集团 | 1,500 | 8,955.00 | 0.01 |
| 553 | 000908 | 景峰医药 | 1,900 | 8,949.00 | 0.01 |
| 554 | 002127 | 南极电商 | 950 | 8,920.50 | 0.01 |
| 555 | 002336 | *ST 人乐 | 800 | 8,912.00 | 0.01 |
| 556 | 300221 | 银禧科技 | 900 | 8,910.00 | 0.01 |
| 557 | 002057 | 中钢天源 | 1,300 | 8,905.00 | 0.01 |
| 558 | 002091 | 江苏国泰 | 1,400 | 8,890.00 | 0.01 |
| 559 | 000021 | 深科技 | 1,300 | 8,866.00 | 0.01 |
| 560 | 002242 | 九阳股份 | 500 | 8,845.00 | 0.01 |
| 561 | 603806 | 福斯特 | 400 | 8,804.00 | 0.01 |
| 562 | 002534 | 杭锅股份 | 1,300 | 8,801.00 | 0.01 |
| 563 | 002705 | 新宝股份 | 900 | 8,793.00 | 0.01 |
| 564 | 000862 | 银星能源 | 2,800 | 8,764.00 | 0.01 |
| 565 | 601567 | 三星医疗 | 1,200 | 8,736.00 | 0.01 |
| 566 | 002153 | 石基信息 | 300 | 8,700.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 567 | 000719 | 大地传媒 | 1,300 | 8,697.00 | 0.01 |
| 568 | 600131 | 岷江水电 | 1,500 | 8,685.00 | 0.01 |
| 569 | 601158 | 重庆水务 | 1,600 | 8,672.00 | 0.01 |
| 570 | 002287 | 奇正藏药 | 300 | 8,637.00 | 0.01 |
| 571 | 600173 | 卧龙地产 | 2,000 | 8,600.00 | 0.01 |
| 572 | 600780 | 通宝能源 | 2,300 | 8,579.00 | 0.01 |
| 573 | 601599 | 鹿港文化 | 2,100 | 8,547.00 | 0.01 |
| 574 | 002613 | 北玻股份 | 2,700 | 8,505.00 | 0.01 |
| 575 | 002030 | 达安基因 | 550 | 8,481.00 | 0.01 |
| 576 | 600998 | 九州通 | 500 | 8,480.00 | 0.01 |
| 577 | 600136 | 当代明诚 | 700 | 8,470.00 | 0.01 |
| 578 | 600312 | 平高电气 | 1,500 | 8,460.00 | 0.01 |
| 579 | 002305 | 南国置业 | 2,800 | 8,456.00 | 0.01 |
| 580 | 000970 | 中科三环 | 900 | 8,415.00 | 0.01 |
| 581 | 002653 | 海思科 | 700 | 8,400.00 | 0.01 |
| 582 | 300415 | 伊之密 | 900 | 8,388.00 | 0.01 |
| 583 | 000543 | 皖能电力 | 1,900 | 8,379.00 | 0.01 |
| 584 | 002599 | 盛通股份 | 800 | 8,344.00 | 0.01 |
| 585 | 600335 | 国机汽车 | 800 | 8,344.00 | 0.01 |
| 586 | 601628 | 中国人寿 | 370 | 8,332.40 | 0.01 |
| 587 | 601999 | 出版传媒 | 1,500 | 8,325.00 | 0.01 |
| 588 | 000902 | 新洋丰 | 900 | 8,280.00 | 0.01 |
| 589 | 002383 | 合众思壮 | 500 | 8,275.00 | 0.01 |
| 590 | 000850 | 华茂股份 | 2,200 | 8,272.00 | 0.01 |
| 591 | 600037 | 歌华有线 | 800 | 8,256.00 | 0.01 |
| 592 | 002777 | 久远银海 | 300 | 8,241.00 | 0.01 |
| 593 | 000883 | 湖北能源 | 2,000 | 8,220.00 | 0.01 |
| 594 | 000937 | 冀中能源 | 2,000 | 8,220.00 | 0.01 |
| 595 | 603603 | 博天环境 | 400 | 8,196.00 | 0.01 |
| 596 | 002102 | 冠福股份 | 2,200 | 8,184.00 | 0.01 |
| 597 | 002568 | 百润股份 | 600 | 8,106.00 | 0.01 |
| 598 | 000829 | 天音控股 | 1,100 | 8,063.00 | 0.01 |
| 599 | 300384 | 三联虹普 | 200 | 8,054.00 | 0.01 |
| 600 | 300058 | 蓝色光标 | 1,400 | 7,980.00 | 0.01 |
| 601 | 000869 | 张裕A | 200 | 7,972.00 | 0.01 |
| 602 | 601866 | 中远海发 | 3,200 | 7,968.00 | 0.01 |
| 603 | 002209 | 达意隆 | 1,100 | 7,964.00 | 0.01 |
| 604 | 002001 | 新和成 | 420 | 7,963.20 | 0.01 |
| 605 | 600315 | 上海家化 | 200 | 7,926.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|-------|----------|------|
| 606 | 000900 | 现代投资 | 1,900 | 7,904.00 | 0.01 |
| 607 | 002340 | 格林美 | 1,300 | 7,865.00 | 0.01 |
| 608 | 600812 | 华北制药 | 1,800 | 7,812.00 | 0.01 |
| 609 | 600645 | 中源协和 | 400 | 7,704.00 | 0.01 |
| 610 | 000880 | 潍柴重机 | 1,000 | 7,690.00 | 0.01 |
| 611 | 000521 | 美菱电器 | 2,000 | 7,680.00 | 0.01 |
| 612 | 601126 | 四方股份 | 1,500 | 7,635.00 | 0.01 |
| 613 | 300244 | 迪安诊断 | 400 | 7,604.00 | 0.01 |
| 614 | 300204 | 舒泰神 | 700 | 7,574.00 | 0.01 |
| 615 | 002483 | 润邦股份 | 1,800 | 7,560.00 | 0.01 |
| 616 | 600262 | 北方股份 | 400 | 7,560.00 | 0.01 |
| 617 | 002517 | 恺英网络 | 1,050 | 7,549.50 | 0.01 |
| 618 | 300511 | 雪榕生物 | 850 | 7,548.00 | 0.01 |
| 619 | 002164 | 宁波东力 | 1,300 | 7,514.00 | 0.01 |
| 620 | 300199 | 翰宇药业 | 520 | 7,425.60 | 0.01 |
| 621 | 002390 | 信邦制药 | 1,000 | 7,320.00 | 0.01 |
| 622 | 002555 | 三七互娱 | 600 | 7,290.00 | 0.01 |
| 623 | 601137 | 博威合金 | 900 | 7,272.00 | 0.01 |
| 624 | 300274 | 阳光电源 | 810 | 7,265.70 | 0.01 |
| 625 | 002636 | 金安国纪 | 900 | 7,263.00 | 0.01 |
| 626 | 000606 | *ST 易桥 | 1,100 | 7,260.00 | 0.01 |
| 627 | 300150 | 世纪瑞尔 | 1,500 | 7,245.00 | 0.01 |
| 628 | 300083 | 劲胜精密 | 1,500 | 7,230.00 | 0.01 |
| 629 | 000539 | 粤电力 A | 1,700 | 7,208.00 | 0.01 |
| 630 | 600612 | 老凤祥 | 200 | 7,188.00 | 0.01 |
| 631 | 600261 | 阳光照明 | 1,900 | 7,144.00 | 0.01 |
| 632 | 600569 | 安阳钢铁 | 1,800 | 7,092.00 | 0.01 |
| 633 | 600081 | 东风科技 | 700 | 7,070.00 | 0.01 |
| 634 | 300410 | 正业科技 | 300 | 7,053.00 | 0.01 |
| 635 | 002349 | 精华制药 | 1,200 | 7,008.00 | 0.01 |
| 636 | 600466 | 蓝光发展 | 1,122 | 6,956.40 | 0.01 |
| 637 | 002595 | 豪迈科技 | 400 | 6,956.00 | 0.01 |
| 638 | 300677 | 英科医疗 | 300 | 6,897.00 | 0.01 |
| 639 | 300448 | 浩云科技 | 600 | 6,870.00 | 0.01 |
| 640 | 600053 | 九鼎投资 | 400 | 6,868.00 | 0.01 |
| 641 | 002878 | 元隆雅图 | 300 | 6,774.00 | 0.01 |
| 642 | 000557 | 西部创业 | 2,100 | 6,762.00 | 0.01 |
| 643 | 300130 | 新国都 | 500 | 6,745.00 | 0.01 |
| 644 | 002238 | 天威视讯 | 1,000 | 6,730.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 645 | 600893 | 航发动力 | 300 | 6,696.00 | 0.01 |
| 646 | 002099 | 海翔药业 | 1,300 | 6,669.00 | 0.01 |
| 647 | 603679 | 华体科技 | 300 | 6,615.00 | 0.01 |
| 648 | 002217 | 合力泰 | 800 | 6,600.00 | 0.01 |
| 649 | 000601 | 韶能股份 | 1,500 | 6,585.00 | 0.01 |
| 650 | 002361 | 神剑股份 | 1,600 | 6,576.00 | 0.01 |
| 651 | 600176 | 中国巨石 | 640 | 6,547.20 | 0.01 |
| 652 | 002380 | 科远股份 | 500 | 6,500.00 | 0.01 |
| 653 | 600308 | 华泰股份 | 1,300 | 6,474.00 | 0.01 |
| 654 | 600297 | 广汇汽车 | 1,100 | 6,446.00 | 0.01 |
| 655 | 300376 | 易事特 | 1,200 | 6,444.00 | 0.01 |
| 656 | 600691 | 阳煤化工 | 2,100 | 6,426.00 | 0.01 |
| 657 | 600697 | 欧亚集团 | 300 | 6,387.00 | 0.01 |
| 658 | 300174 | 元力股份 | 300 | 6,354.00 | 0.01 |
| 659 | 002374 | 丽鹏股份 | 1,300 | 6,331.00 | 0.01 |
| 660 | 603566 | 普莱柯 | 400 | 6,324.00 | 0.01 |
| 661 | 601098 | 中南传媒 | 500 | 6,320.00 | 0.01 |
| 662 | 300108 | 双龙股份 | 800 | 6,272.00 | 0.01 |
| 663 | 002588 | 史丹利 | 1,200 | 6,216.00 | 0.01 |
| 664 | 600483 | 福能股份 | 900 | 6,183.00 | 0.01 |
| 665 | 002048 | 宁波华翔 | 500 | 6,165.00 | 0.01 |
| 666 | 002270 | 华明装备 | 1,050 | 6,100.50 | 0.01 |
| 667 | 002405 | 四维图新 | 300 | 6,075.00 | 0.01 |
| 668 | 002295 | 精艺股份 | 900 | 6,048.00 | 0.01 |
| 669 | 002431 | 棕榈股份 | 900 | 6,039.00 | 0.01 |
| 670 | 300043 | 星辉娱乐 | 1,500 | 6,000.00 | 0.01 |
| 671 | 000919 | 金陵药业 | 800 | 5,992.00 | 0.01 |
| 672 | 603305 | 旭升股份 | 200 | 5,986.00 | 0.01 |
| 673 | 601222 | 林洋能源 | 1,200 | 5,976.00 | 0.01 |
| 674 | 300559 | 佳发安泰 | 200 | 5,946.00 | 0.01 |
| 675 | 300082 | 奥克股份 | 1,200 | 5,856.00 | 0.01 |
| 676 | 600075 | 新疆天业 | 900 | 5,850.00 | 0.01 |
| 677 | 600973 | 宝胜股份 | 1,600 | 5,840.00 | 0.01 |
| 678 | 600058 | 五矿发展 | 700 | 5,817.00 | 0.01 |
| 679 | 600971 | 恒源煤电 | 810 | 5,783.40 | 0.01 |
| 680 | 002688 | 金河生物 | 1,100 | 5,764.00 | 0.01 |
| 681 | 603612 | 索通发展 | 200 | 5,720.00 | 0.01 |
| 682 | 002778 | 高科石化 | 300 | 5,706.00 | 0.01 |
| 683 | 000761 | 本钢板材 | 1,410 | 5,696.40 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 684 | 600366 | 宁波韵升 | 932 | 5,685.20 | 0.01 |
| 685 | 002686 | 亿利达 | 800 | 5,640.00 | 0.01 |
| 686 | 002411 | 必康股份 | 200 | 5,550.00 | 0.00 |
| 687 | 600132 | 重庆啤酒 | 200 | 5,538.00 | 0.00 |
| 688 | 300396 | 迪瑞医疗 | 300 | 5,520.00 | 0.00 |
| 689 | 600613 | 神奇制药 | 900 | 5,517.00 | 0.00 |
| 690 | 601233 | 桐昆股份 | 320 | 5,510.40 | 0.00 |
| 691 | 002444 | 巨星科技 | 500 | 5,505.00 | 0.00 |
| 692 | 002206 | 海利得 | 1,100 | 5,489.00 | 0.00 |
| 693 | 603676 | 卫信康 | 300 | 5,472.00 | 0.00 |
| 694 | 600676 | 交运股份 | 1,100 | 5,467.00 | 0.00 |
| 695 | 000150 | 宜华健康 | 200 | 5,420.00 | 0.00 |
| 696 | 300513 | 恒泰实达 | 200 | 5,398.00 | 0.00 |
| 697 | 600295 | 鄂尔多斯 | 600 | 5,394.00 | 0.00 |
| 698 | 603556 | 海兴电力 | 295 | 5,360.15 | 0.00 |
| 699 | 300248 | 新开普 | 869 | 5,318.28 | 0.00 |
| 700 | 603380 | 易德龙 | 300 | 5,289.00 | 0.00 |
| 701 | 000861 | 海印股份 | 2,100 | 5,271.00 | 0.00 |
| 702 | 300381 | 溢多利 | 600 | 5,226.00 | 0.00 |
| 703 | 600188 | 兖州煤业 | 400 | 5,216.00 | 0.00 |
| 704 | 300158 | 振东制药 | 1,000 | 5,120.00 | 0.00 |
| 705 | 601058 | 赛轮金宇 | 2,100 | 5,103.00 | 0.00 |
| 706 | 600967 | 内蒙一机 | 400 | 5,096.00 | 0.00 |
| 707 | 600775 | 南京熊猫 | 900 | 5,094.00 | 0.00 |
| 708 | 000525 | 红太阳 | 300 | 5,085.00 | 0.00 |
| 709 | 600155 | 宝硕股份 | 700 | 5,033.00 | 0.00 |
| 710 | 600665 | 天地源 | 1,400 | 4,970.00 | 0.00 |
| 711 | 002376 | 新北洋 | 300 | 4,962.00 | 0.00 |
| 712 | 603869 | 北部湾旅 | 300 | 4,947.00 | 0.00 |
| 713 | 600586 | 金晶科技 | 1,500 | 4,905.00 | 0.00 |
| 714 | 002839 | 张家港行 | 800 | 4,872.00 | 0.00 |
| 715 | 603569 | 长久物流 | 334 | 4,769.52 | 0.00 |
| 716 | 002119 | 康强电子 | 420 | 4,746.00 | 0.00 |
| 717 | 603609 | 禾丰牧业 | 500 | 4,720.00 | 0.00 |
| 718 | 300129 | 泰胜风能 | 1,300 | 4,693.00 | 0.00 |
| 719 | 600299 | 安迪苏 | 400 | 4,656.00 | 0.00 |
| 720 | 600444 | 国机通用 | 400 | 4,612.00 | 0.00 |
| 721 | 600683 | 京投发展 | 1,000 | 4,590.00 | 0.00 |
| 722 | 000524 | 岭南控股 | 500 | 4,570.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|-------|----------|------|
| 723 | 000617 | *ST 济柴 | 400 | 4,496.00 | 0.00 |
| 724 | 002679 | 福建金森 | 200 | 4,482.00 | 0.00 |
| 725 | 600057 | 厦门象屿 | 888 | 4,431.12 | 0.00 |
| 726 | 002090 | 金智科技 | 300 | 4,338.00 | 0.00 |
| 727 | 000811 | 烟台冰轮 | 900 | 4,275.00 | 0.00 |
| 728 | 002425 | 凯撒文化 | 900 | 4,275.00 | 0.00 |
| 729 | 601010 | 文峰股份 | 1,400 | 4,242.00 | 0.00 |
| 730 | 600385 | 山东金泰 | 400 | 4,176.00 | 0.00 |
| 731 | 000949 | 新乡化纤 | 1,400 | 4,130.00 | 0.00 |
| 732 | 000756 | 新华制药 | 400 | 4,128.00 | 0.00 |
| 733 | 600851 | 海欣股份 | 500 | 4,110.00 | 0.00 |
| 734 | 300196 | 长海股份 | 400 | 4,076.00 | 0.00 |
| 735 | 002421 | 达实智能 | 1,000 | 4,050.00 | 0.00 |
| 736 | 300608 | 思特奇 | 200 | 4,050.00 | 0.00 |
| 737 | 601368 | 绿城水务 | 600 | 4,050.00 | 0.00 |
| 738 | 600677 | 航天通信 | 500 | 4,035.00 | 0.00 |
| 739 | 603688 | 石英股份 | 300 | 4,032.00 | 0.00 |
| 740 | 002465 | 海格通信 | 500 | 4,015.00 | 0.00 |
| 741 | 600236 | 桂冠电力 | 700 | 3,997.00 | 0.00 |
| 742 | 600114 | 东睦股份 | 408 | 3,986.16 | 0.00 |
| 743 | 300358 | 楚天科技 | 400 | 3,964.00 | 0.00 |
| 744 | 601608 | 中信重工 | 1,500 | 3,900.00 | 0.00 |
| 745 | 600118 | 中国卫星 | 200 | 3,820.00 | 0.00 |
| 746 | 601933 | 永辉超市 | 500 | 3,820.00 | 0.00 |
| 747 | 600617 | 国新能源 | 700 | 3,801.00 | 0.00 |
| 748 | 002509 | 天广中茂 | 1,300 | 3,783.00 | 0.00 |
| 749 | 002107 | 沃华医药 | 400 | 3,684.00 | 0.00 |
| 750 | 603123 | 翠微股份 | 600 | 3,660.00 | 0.00 |
| 751 | 002791 | 坚朗五金 | 300 | 3,657.00 | 0.00 |
| 752 | 600166 | 福田汽车 | 1,800 | 3,654.00 | 0.00 |
| 753 | 600687 | 刚泰控股 | 400 | 3,636.00 | 0.00 |
| 754 | 002033 | 丽江旅游 | 500 | 3,635.00 | 0.00 |
| 755 | 000672 | 上峰水泥 | 400 | 3,604.00 | 0.00 |
| 756 | 603663 | 三祥新材 | 200 | 3,584.00 | 0.00 |
| 757 | 002323 | 雅百特 | 700 | 3,556.00 | 0.00 |
| 758 | 600428 | 中远海特 | 1,000 | 3,550.00 | 0.00 |
| 759 | 002250 | 联化科技 | 400 | 3,528.00 | 0.00 |
| 760 | 600879 | 航天电子 | 500 | 3,515.00 | 0.00 |
| 761 | 002665 | 首航节能 | 600 | 3,480.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|-------|----------|------|
| 762 | 002573 | 清新环境 | 300 | 3,465.00 | 0.00 |
| 763 | 300119 | 瑞普生物 | 400 | 3,420.00 | 0.00 |
| 764 | 002678 | 珠江钢琴 | 400 | 3,408.00 | 0.00 |
| 765 | 600917 | 重庆燃气 | 500 | 3,405.00 | 0.00 |
| 766 | 002533 | 金杯电工 | 700 | 3,395.00 | 0.00 |
| 767 | 000959 | 首钢股份 | 817 | 3,357.87 | 0.00 |
| 768 | 002724 | 海洋王 | 600 | 3,354.00 | 0.00 |
| 769 | 600961 | 株冶集团 | 500 | 3,340.00 | 0.00 |
| 770 | 000903 | 云内动力 | 1,300 | 3,328.00 | 0.00 |
| 771 | 600768 | 宁波富邦 | 300 | 3,312.00 | 0.00 |
| 772 | 300389 | 艾比森 | 200 | 3,306.00 | 0.00 |
| 773 | 002187 | 广百股份 | 400 | 3,296.00 | 0.00 |
| 774 | 002150 | 通润装备 | 500 | 3,280.00 | 0.00 |
| 775 | 600418 | 江淮汽车 | 500 | 3,255.00 | 0.00 |
| 776 | 600475 | 华光股份 | 300 | 3,207.00 | 0.00 |
| 777 | 300267 | 尔康制药 | 700 | 3,164.00 | 0.00 |
| 778 | 002232 | 启明信息 | 400 | 3,124.00 | 0.00 |
| 779 | 600578 | 京能电力 | 1,000 | 3,120.00 | 0.00 |
| 780 | 300294 | 博雅生物 | 100 | 3,099.00 | 0.00 |
| 781 | 002299 | 圣农发展 | 200 | 3,098.00 | 0.00 |
| 782 | 002829 | 星网宇达 | 100 | 3,059.00 | 0.00 |
| 783 | 300527 | 华舟应急 | 300 | 3,018.00 | 0.00 |
| 784 | 300343 | 联创互联 | 300 | 3,000.00 | 0.00 |
| 785 | 000667 | 美好置业 | 1,400 | 2,982.00 | 0.00 |
| 786 | 300189 | 神农基因 | 800 | 2,968.00 | 0.00 |
| 787 | 600996 | 贵广网络 | 400 | 2,968.00 | 0.00 |
| 788 | 002196 | 方正电机 | 400 | 2,940.00 | 0.00 |
| 789 | 002851 | 麦格米特 | 100 | 2,928.00 | 0.00 |
| 790 | 000421 | 南京公用 | 600 | 2,916.00 | 0.00 |
| 791 | 600250 | 南纺股份 | 400 | 2,908.00 | 0.00 |
| 792 | 000156 | 华数传媒 | 300 | 2,892.00 | 0.00 |
| 793 | 000988 | 华工科技 | 200 | 2,890.00 | 0.00 |
| 794 | 002672 | 东江环保 | 220 | 2,879.80 | 0.00 |
| 795 | 300237 | 美晨科技 | 400 | 2,872.00 | 0.00 |
| 796 | 002199 | *ST 东晶 | 300 | 2,841.00 | 0.00 |
| 797 | 002372 | 伟星新材 | 160 | 2,830.40 | 0.00 |
| 798 | 300034 | 钢研高纳 | 300 | 2,808.00 | 0.00 |
| 799 | 300045 | 华力创通 | 300 | 2,781.00 | 0.00 |
| 800 | 002641 | 永高股份 | 800 | 2,760.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|----------|------|
| 801 | 002496 | 辉丰股份 | 1,000 | 2,730.00 | 0.00 |
| 802 | 300395 | 菲利华 | 200 | 2,720.00 | 0.00 |
| 803 | 600273 | 嘉化能源 | 300 | 2,718.00 | 0.00 |
| 804 | 300218 | 安利股份 | 400 | 2,716.00 | 0.00 |
| 805 | 000877 | 天山股份 | 400 | 2,700.00 | 0.00 |
| 806 | 000779 | 三毛派神 | 200 | 2,694.00 | 0.00 |
| 807 | 300366 | 创意信息 | 300 | 2,694.00 | 0.00 |
| 808 | 603208 | 江山欧派 | 100 | 2,689.00 | 0.00 |
| 809 | 002671 | 龙泉股份 | 600 | 2,676.00 | 0.00 |
| 810 | 000411 | 英特集团 | 200 | 2,670.00 | 0.00 |
| 811 | 600615 | 丰华股份 | 300 | 2,601.00 | 0.00 |
| 812 | 002601 | 佰利联 | 200 | 2,586.00 | 0.00 |
| 813 | 300296 | 利亚德 | 200 | 2,576.00 | 0.00 |
| 814 | 000639 | 西王食品 | 200 | 2,566.00 | 0.00 |
| 815 | 600843 | 上工申贝 | 300 | 2,517.00 | 0.00 |
| 816 | 002772 | 众兴菌业 | 300 | 2,511.00 | 0.00 |
| 817 | 603678 | 火炬电子 | 100 | 2,492.00 | 0.00 |
| 818 | 300197 | 铁汉生态 | 450 | 2,416.50 | 0.00 |
| 819 | 300042 | 朗科科技 | 100 | 2,394.00 | 0.00 |
| 820 | 002084 | 海鸥卫浴 | 500 | 2,380.00 | 0.00 |
| 821 | 000565 | 渝三峡 A | 500 | 2,375.00 | 0.00 |
| 822 | 002013 | 中航机电 | 300 | 2,271.00 | 0.00 |
| 823 | 600864 | 哈投股份 | 500 | 2,250.00 | 0.00 |
| 824 | 603606 | 东方电缆 | 300 | 2,232.00 | 0.00 |
| 825 | 000030 | 富奥股份 | 300 | 2,226.00 | 0.00 |
| 826 | 600589 | 广东榕泰 | 500 | 2,210.00 | 0.00 |
| 827 | 000591 | 太阳能 | 600 | 2,196.00 | 0.00 |
| 828 | 002166 | 莱茵生物 | 300 | 2,196.00 | 0.00 |
| 829 | 002487 | 大金重工 | 600 | 2,196.00 | 0.00 |
| 830 | 002531 | 天顺风能 | 500 | 2,175.00 | 0.00 |
| 831 | 000739 | 普洛药业 | 300 | 2,148.00 | 0.00 |
| 832 | 300184 | 力源信息 | 200 | 2,144.00 | 0.00 |
| 833 | 300061 | 康耐特 | 200 | 2,140.00 | 0.00 |
| 834 | 600976 | 健民集团 | 100 | 2,099.00 | 0.00 |
| 835 | 002171 | 楚江新材 | 300 | 2,034.00 | 0.00 |
| 836 | 600785 | 新华百货 | 100 | 2,018.00 | 0.00 |
| 837 | 603012 | 创力集团 | 300 | 2,016.00 | 0.00 |
| 838 | 002014 | 永新股份 | 300 | 1,995.00 | 0.00 |
| 839 | 002279 | 久其软件 | 200 | 1,982.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 840 | 600386 | 北巴传媒 | 500 | 1,945.00 | 0.00 |
| 841 | 000656 | 金科股份 | 400 | 1,920.00 | 0.00 |
| 842 | 601727 | 上海电气 | 300 | 1,902.00 | 0.00 |
| 843 | 600862 | 中航高科 | 300 | 1,845.00 | 0.00 |
| 844 | 000686 | 东北证券 | 287 | 1,839.67 | 0.00 |
| 845 | 300449 | 汉邦高科 | 100 | 1,829.00 | 0.00 |
| 846 | 600761 | 安徽合力 | 200 | 1,816.00 | 0.00 |
| 847 | 002663 | 普邦股份 | 600 | 1,782.00 | 0.00 |
| 848 | 600551 | 时代出版 | 200 | 1,768.00 | 0.00 |
| 849 | 000404 | 华意压缩 | 400 | 1,732.00 | 0.00 |
| 850 | 600409 | 三友化工 | 200 | 1,722.00 | 0.00 |
| 851 | 601018 | 宁波港 | 400 | 1,684.00 | 0.00 |
| 852 | 000600 | 建投能源 | 300 | 1,671.00 | 0.00 |
| 853 | 000851 | 高鸿股份 | 300 | 1,614.00 | 0.00 |
| 854 | 600663 | 陆家嘴 | 100 | 1,579.00 | 0.00 |
| 855 | 002429 | 兆驰股份 | 600 | 1,488.00 | 0.00 |
| 856 | 600122 | 宏图高科 | 200 | 1,480.00 | 0.00 |
| 857 | 000426 | 兴业矿业 | 200 | 1,442.00 | 0.00 |
| 858 | 002366 | 台海核电 | 100 | 1,426.00 | 0.00 |
| 859 | 000690 | 宝新能源 | 200 | 1,392.00 | 0.00 |
| 860 | 000555 | 神州信息 | 100 | 1,328.00 | 0.00 |
| 861 | 002477 | 雏鹰农牧 | 400 | 1,324.00 | 0.00 |
| 862 | 002484 | 江海股份 | 200 | 1,308.00 | 0.00 |
| 863 | 300440 | 运达科技 | 200 | 1,306.00 | 0.00 |
| 864 | 300127 | 银河磁体 | 100 | 1,299.00 | 0.00 |
| 865 | 600415 | 小商品城 | 300 | 1,293.00 | 0.00 |
| 866 | 300323 | 华灿光电 | 100 | 1,292.00 | 0.00 |
| 867 | 000153 | 丰原药业 | 200 | 1,274.00 | 0.00 |
| 868 | 002408 | 齐翔腾达 | 100 | 1,228.00 | 0.00 |
| 869 | 000899 | 赣能股份 | 300 | 1,227.00 | 0.00 |
| 870 | 603669 | 灵康药业 | 100 | 1,182.00 | 0.00 |
| 871 | 002684 | 猛狮科技 | 100 | 1,178.00 | 0.00 |
| 872 | 000592 | 平潭发展 | 400 | 1,136.00 | 0.00 |
| 873 | 002266 | 浙富控股 | 300 | 1,125.00 | 0.00 |
| 874 | 601899 | 紫金矿业 | 300 | 1,083.00 | 0.00 |
| 875 | 300087 | 荃银高科 | 100 | 1,048.00 | 0.00 |
| 876 | 000906 | 物产中拓 | 200 | 1,028.00 | 0.00 |
| 877 | 600986 | 科达股份 | 100 | 936.00 | 0.00 |
| 878 | 601139 | 深圳燃气 | 160 | 888.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|--------|------|
| 879 | 300239 | 东宝生物 | 200 | 846.00 | 0.00 |
| 880 | 600633 | 浙数文化 | 100 | 834.00 | 0.00 |
| 881 | 000607 | 华媒控股 | 201 | 826.11 | 0.00 |
| 882 | 601886 | 江河集团 | 100 | 823.00 | 0.00 |
| 883 | 600567 | 山鹰纸业 | 200 | 772.00 | 0.00 |
| 884 | 603993 | 洛阳钼业 | 100 | 629.00 | 0.00 |
| 885 | 600010 | 宝钢股份 | 400 | 620.00 | 0.00 |
| 886 | 300307 | 慈星股份 | 100 | 613.00 | 0.00 |
| 887 | 300032 | 金龙机电 | 100 | 561.00 | 0.00 |
| 888 | 600331 | 宏达股份 | 200 | 518.00 | 0.00 |
| 889 | 002556 | 辉隆股份 | 100 | 500.00 | 0.00 |
| 890 | 300261 | 雅本化学 | 100 | 479.00 | 0.00 |
| 891 | 000518 | 四环生物 | 100 | 413.00 | 0.00 |
| 892 | 000979 | 中弘股份 | 400 | 404.00 | 0.00 |
| 893 | 600252 | 中恒集团 | 100 | 324.00 | 0.00 |
| 894 | 300303 | 聚飞光电 | 100 | 274.00 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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 | 5,548,284.00 | 5.00 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 4,742,691.80 | 4.27 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 3,157,136.00 | 2.84 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 2,893,270.41 | 2.61 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 2,821,285.50 | 2.54 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 2,815,959.00 | 2.54 |
| 7 | 600016 | 民生银行 | 2,787,845.00 | 2.51 |
| 8 | 000338 | 潍柴动力 | 2,350,223.00 | 2.12 |
| 9 | 600015 | 华夏银行 | 2,309,142.00 | 2.08 |
| 10 | 600000 | 浦发银行 | 2,196,349.00 | 1.98 |
| 11 | 600104 | 上汽集团 | 2,162,692.20 | 1.95 |
| 12 | 600585 | 海螺水泥 | 2,142,556.97 | 1.93 |
| 13 | 600036 | 招商银行 | 2,108,710.83 | 1.90 |
| 14 | 600170 | 上海建工 | 2,100,697.00 | 1.89 |
| 15 | 002304 | 洋河股份 | 2,073,646.00 | 1.87 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 16 | 601169 | 北京银行 | 1,911,765.78 | 1.72 |
| 17 | 601328 | 交通银行 | 1,907,716.00 | 1.72 |
| 18 | 000625 | 长安汽车 | 1,885,429.00 | 1.70 |
| 19 | 600383 | 金地集团 | 1,883,438.00 | 1.70 |
| 20 | 601006 | 大秦铁路 | 1,875,041.00 | 1.69 |

7.4.2 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 | 2,551,115.50 | 2.30 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 2,450,774.90 | 2.21 |
| 3 | 000333 | 美的集团 | 2,131,185.20 | 1.92 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 2,104,017.20 | 1.89 |
| 5 | 000651 | 格力电器 | 1,795,428.90 | 1.62 |
| 6 | 600000 | 浦发银行 | 1,790,091.60 | 1.61 |
| 7 | 000338 | 潍柴动力 | 1,761,710.30 | 1.59 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 1,686,828.10 | 1.52 |
| 9 | 601628 | 中国人寿 | 1,616,561.20 | 1.46 |
| 10 | 000423 | 东阿阿胶 | 1,554,821.40 | 1.40 |
| 11 | 600036 | 招商银行 | 1,508,270.20 | 1.36 |
| 12 | 600104 | 上汽集团 | 1,502,481.40 | 1.35 |
| 13 | 600688 | 上海石化 | 1,453,306.94 | 1.31 |
| 14 | 600585 | 海螺水泥 | 1,451,277.80 | 1.31 |
| 15 | 000402 | 金融街 | 1,396,229.40 | 1.26 |
| 16 | 600066 | 宇通客车 | 1,381,815.70 | 1.24 |
| 17 | 000625 | 长安汽车 | 1,330,764.18 | 1.20 |
| 18 | 601155 | 新城控股 | 1,313,233.30 | 1.18 |
| 19 | 000898 | 鞍钢股份 | 1,283,761.50 | 1.16 |
| 20 | 600820 | 隧道股份 | 1,264,459.01 | 1.14 |

7.4.3 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 | 277,282,080.94 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 186,216,879.76 |

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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 | 6,000,600.00 | 5.40 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 11,443,450.00 | 10.30 |
| 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 | 17,444,050.00 | 15.71 |

7.6 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 | 019571 | 17 国债 17 | 60,000 | 6,000,600.00 | 5.40 |
| 2 | 112328 | 16 曲文 01 | 50,000 | 4,965,500.00 | 4.47 |
| 3 | 112041 | 11 冀东 01 | 35,000 | 3,505,950.00 | 3.16 |
| 4 | 136247 | 16 华综 01 | 20,000 | 1,974,400.00 | 1.78 |
| 5 | 122486 | 15 旭辉 01 | 10,000 | 997,600.00 | 0.90 |

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

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。

7.12.3 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 | 34,821.10 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 444,445.90 |
| 5 | 应收申购款 | 1,599.85 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 480,866.85 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|------------|-----------|------------|----------------|--------|--------------|--------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 中金金序量化蓝筹 A | 229 | 434,918.26 | 96,900,000.00 | 97.29% | 2,696,280.42 | 2.71% |
| 中金金序量化蓝筹 C | 68 | 279,856.55 | 18,000,000.00 | 94.59% | 1,030,245.35 | 5.41% |
| 合计 | 297 | 399,415.91 | 114,900,000.00 | 96.86% | 3,726,525.77 | 3.14% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 中金金序量化蓝筹 A | 54,500.00 | 0.0547% |
| | 中金金序量化蓝筹 C | 1,200.04 | 0.0063% |
| | 合计 | 55,700.04 | 0.0470% |

8.3 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 | 中金金序量化蓝筹 A | 0~10 |
| | 中金金序量化蓝筹 C | 0 |

| | | |
|-----------------|------------|------|
| 有本开放式基金 | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中金金序量化蓝筹 A | 0 |
| | 中金金序量化蓝筹 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中金金序量化蓝筹 A | 中金金序量化蓝筹 C |
|------------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2018 年 2 月 6 日）基金份额总额 | 110,750,932.51 | 92,298,949.14 |
| 本报告期期初基金份额总额 | - | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 181,352.75 | 1,789,751.89 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 11,336,004.84 | 75,058,455.68 |
| 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 | 99,596,280.42 | 19,030,245.35 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本基金本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，基金管理人与股东中国国际金融股份有限公司就侵犯商标权及不正当竞争事项，联合向北京市朝阳区人民法院起诉南京中金基金管理有限公司。截至 2018 年 6 月 30 日，该案已获法院受理，尚未开庭。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。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | |
|------|------|------|-------|-----------|-------|
| | | 成交金额 | 占当期股票 | 佣金 | 占当期佣金 |
| | | | | | |

| | 数量 | | 成交总额的比 例 | | 总量的比例 | 备注 |
|------|----|----------------|-------------|------------|--------|----|
| 中金 | 2 | 325,104,723.11 | 70.19% | 237,761.78 | 70.19% | - |
| 中投证券 | 2 | 138,080,317.29 | 29.81% | 100,969.70 | 29.81% | - |

10.7.2 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 | 18,568,601.43 | 75.52% | 1,081,000,000.00 | 75.41% | - | - |
| 中投证券 | 6,018,379.20 | 24.48% | 352,500,000.00 | 24.59% | - | - |

10.8 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 | 中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同生效公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站 | 2018年2月7日 |
| 2 | 关于中金金序量化蓝筹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2月7日 |
| 3 | 中金基金管理有限公司关于中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金开展赎回费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站 | 2018年2月8日 |
| 4 | 中金基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽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3月7日 |
| 5 | 中金基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蚂蚁（杭州）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3月16日 |
| 6 | 关于新增北京植信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3月22日 |
| 7 | 关于新增南京苏宁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4月11日 |

| | | 报》及/或公司网站 | |
|----|---|-------------------------------|-----------------|
| 8 | 中金基金管理有限公司关于旗下部分基金网上申购富士康工业互联网股份有限公司首次公开发行 A 股股票的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站 | 2018 年 5 月 30 日 |
| 9 | 关于新增浙江同花顺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 5 月 31 日 |
| 10 | 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 6 月 20 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|---------------------------------|---------------|------|---------------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2018 年 2 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日 | 38,000,000.00 | 0.00 | 11,100,000.00 | 26,900,000.00 | 22.68% |
| | 2 | 2018 年 2 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日 | 40,000,000.00 | 0.00 | 0.00 | 40,000,000.00 | 33.72% |

产品特有风险

(1) 规模风险

规模风险是指管理资产规模过大导致的获利空间缩窄、投资回报下降的风险。若相似策略的产品规模过于庞大，各产品的交易单量大又相对集中，可能导致较大的滑点，从而影响本基金表现。所有的量化选股策略对资产规模都有一定的限制，过大的规模会对投资收益有影响。

(2) 模型有效性及策略失败风险

模型有效性风险主要是模型捕捉的机会消失可能导致获利能力下降甚至丧失，所有的模型均有失效的可能，从而影响基金的表现；本基金的投资策略主要包括量化选股策略和其他策略，力求实现基金资产的稳定增值，但有可能因投资策略的失败而导致基金损失。此外，由于存在投资市场波动的影响，可能导致投资本基金的投资者遭受本金损失，存在本金损失的风险。

(3) 金融数据的风险

本基金应用量化模型和外部提供商的金融数据协助进行量化选股。数据通常来源于不同的数据提供商，且在进行数据清洗、加工后作为量化模型的输入变量。采集到的原始金融数据的错误或不完整、预处理过程中的缺陷都可能直接影响量化模型的输出结果，形成数据风险，对基金的业绩产生不利的影响。

(4) 股指期货投资风险

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

2) 基差风险：在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股票指数现货价格与股指期货合约价格波动不一致而遭受基差风险。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本基金投资产生影响。

3) 合约展期风险：本基金所投资的期货合约主要包括股指期货当月和近月合约。当基金所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

4) 到期日风险：股指期货合约到期时，基金财产如持有为平仓合约，中金所将按照交割结算价将基金持有的合约进行现金交割，导致基金无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

5) 股指期货保证金不足风险：由于股指期货价格朝不利方向变动，导致期货账户的资金低于金融期

货交易所或者期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，股指期货头寸将被强行平仓，导致无法规避对冲系统性风险，直接影响本基金收益水平，从而产生风险。

6) 杠杆风险：股指期货作为金融衍生品，其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，基金可能承受超出保证金甚至基金资产本金的损失。

7) 对手方风险：基金管理人运用基金财产投资于股指期货时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金财产遭受损失。

8) 平仓风险：期货经纪公司或其客户保证金不足，又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所以对期货经纪公司的经纪账户强行平仓，资产管理计划财产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

(5) 国债期货投资风险

本基金对国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

(6) 资产支持证券投资风险

本基金投资品种包含资产支持证券品种，由于资产支持证券一般都针对特定机构投资人发行，且仅在特定机构投资人范围内流通转让，该品种的流动性较差，且抵押资产的流动性较差，因此，持有资产支持证券可能给组合资产净值带来一定的风险。另外，资产支持证券还面临提前偿还和延期支付的风险。

(7) 中小企业私募债券投资风险

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

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金托管协议》
- 4、本基金申请募集注册的法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 7、报告期内中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

12.2 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。

12.3 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

2018年8月28日