

# 兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

## 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2019 年 03 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	11
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.....	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§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 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表.....	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告.....	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	71
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	72
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	72
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	72

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
8.12 投资组合报告附注.....	73
§9 基金份额持有人信息.....	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	75
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	75
§10 开放式基金份额变动.....	75
§11 重大事件揭示.....	76
11.1 基金份额持有人大会决议.....	76
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
11.4 基金投资策略的改变.....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
11.8 其他重大事件.....	77
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
§13 备查文件目录.....	81
13.1 备查文件目录.....	81
13.2 存放地点.....	82
13.3 查阅方式.....	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	兴业量化混合
基金主代码	005133
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月26日
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	81,105,362.95份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过计算机算法分析财务、技术因子和互联网大数据，使用多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过综合分析互联网大数据所反映的投资者行为出发，采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略。本基金所指数量化模型是建立在已为国际市场上广泛应用的多因子阿尔法模型的基础上，根据中国资本市场的实际情况，由本基金管理人的金融工程团队开发的更具针对性和实用性的多因子阿尔法选股模型。本基金在股票投资过程中将保持模型选股并构建股票投资组合的投资策略，强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险，力争实现基金资产长期稳定增值。为降低资本市场系统性风险对基金的影响，基金管理人在综合分析国内外宏观经济形势以及资本市场环境等因素的基础上，在对证券市场中长期走势判断的基础上，采取适度的资产配置策略。在投资过程中，在保持量化模型选股的前提下，基金管理人可以调整、增加、或减少所使用的量化模型。

业绩比较基准	中证800指数收益率×55%+中证综合债券指数收益率×45%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 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	兴业基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王薏
	联系电话	021-22211888
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn
客户服务电话	40000-95561	95555
传真	021-22211997	0755-83195201
注册地址	福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	卓新章	李建红

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cib-fund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市延安东路222号外滩中心30楼

注册登记机关	兴业基金管理有限公司	上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼
--------	------------	-------------------------

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年12月26日（基金合同生效日）-2017年12月31日
本期已实现收益	-14,751,521.23	37,369.08
本期利润	-21,011,551.20	37,369.08
加权平均基金份额本期利润	-0.2417	0.0004
本期加权平均净值利润率	-27.59%	0.04%
本期基金份额净值增长率	-24.29%	0.04%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末
期末可供分配利润	-19,672,788.86	37,369.08
期末可供分配基金份额利润	-0.2426	0.0004
期末基金资产净值	61,432,574.09	97,541,713.11
期末基金份额净值	0.7574	1.0004
3.1.3 累计期末指标	2018年末	2017年末
基金份额累计净值增长率	-24.26%	0.04%

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

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

#### 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

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-4.54%	1.62%	-5.88%	0.91%	1.34%	0.71%
过去六个月	-10.41%	1.41%	-7.05%	0.82%	-3.36%	0.59%
过去一年	-24.29%	1.25%	-12.65%	0.73%	-11.64%	0.52%
自基金合同 生效起至今	-24.26%	1.24%	-12.61%	0.73%	-11.65%	0.51%

注：本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×55%+中证综合债券指数收益率×45%

### 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



注：本基金基金合同于2017年12月26日生效，根据本基金基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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





注：本基金基金合同于2017年12月26日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

2013年3月，兴业基金管理有限公司获中国证监会批复。兴业基金由兴业银行股份有限公司和中海集团投资有限公司共同出资设立，公司注册资本12亿元人民币，注册地福建省福州市。兴业基金的业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至2018年12月31日，兴业基金管理了兴业定期开放债券型证券投资基金、兴业年年利定期开放债券型证券投资基金、兴业收益增强债券型证券投资基金、兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金、兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金、兴业添利债券型证券投资基金、兴业丰利债券型证券投资基金、兴业丰泰债券型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、兴业天融债券型证券投资基金、兴业天禧债券型证券投资基金、兴业增益五年定期开放债券型证券投资基金、兴业启元一年定期开放债券型证券投资基金、中证兴业中高等级信用债指数证券投资基金、兴业14天理财债券型证券投资基金、兴业裕恒债券型证券投资基金、兴业裕华债券

型证券投资基金、兴业裕丰债券型证券投资基金、兴业18个月定期开放债券型证券投资基金、兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金、兴业福鑫债券型证券投资基金、兴业增益三年定期开放债券型证券投资基金、兴业6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业安和6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业嘉润3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金、兴业机遇债券型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业添天盈货币市场基金、兴业鑫天盈货币市场基金、兴业稳天盈货币市场基金、兴业安润货币市场基金、兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业保本混合型证券投资基金、兴业国企改革灵活配置混合型证券投资基金、兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚盈灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚鑫灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚丰灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金、兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业龙腾双益平衡混合型证券投资基金、兴业安保优选混合型证券投资基金、兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金。

#### 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		
WEIDONG WU（吴卫东）	基金经理	2017-12-26	-	23年	美国籍，物理学博士，具有证券投资基金从业资格。曾在美国证券交易协会（NASD）注册。1994-1998年任德意志银行量化策略研究员 (Associate Director), 1998-2002年任摩尔(Moore) 资产管理公司资深策略研究员，2002-2006任千禧 (Millennium) 基金投资经理，2007-2010任梯度(Gradient) 资产管理公司投资经理，2010-2013任兴业银行资产管理部研究负责人，2013年7月加入兴业

					基金管理公司，现任基金经理。
--	--	--	--	--	----------------

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 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

本基金根据量化模型进行选股，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。在选股方面，基金根据量化模型进行投资，模型包括多因子选股模型，行业轮动模型，和事件驱动模型等。基金同时根据对宏观经济的判断进行仓位择时，以有效控制基金的下行风险。

基金上半年主要使用多因子模型，指数增强模型，和潜伏业绩预增模型，下半年增加行业轮动模型，高送转模型，业绩超预期模型，和指数成分股调入模型。下半年模型表现优于上半年。未来我们将会继续优化模型和开发新模型，坚持模型选股。因为中美贸易战和金融去杠杆，2018年市场整体下跌，上证综指下跌24.6%中证500指数下跌33.3%。2018年从下半年开始，金融去杠杆基本结束，货币政策开始适度放松。政策底和估值底开始显现，但市场对贸易战缓解还是比较担忧，信心底和经济底部还未突显，市场基本收在了全年的最低位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业量化混合基金份额净值为0.7574元，本报告期内，基金份额净值增长率为-24.29%，同期业绩比较基准收益率为-12.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前中国和美国的资产证券化率差距已达互联网泡沫后的最高水平，市场对A股给予的折价已处于极端区间，市场估值处于历史低位，信心的逐步修复有助于此类折价的修复。同时A股在加速引进外资，监管层鼓励保险资金提高权益类投资比例。随着中美贸易战的缓解，2019年市场大概率将会见到估值修复式上涨。随着市场信心的恢复和经济数据见底，我们认为2019年将会是布局未来的良好时机。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合法经营、规范运作、勤勉尽责、保障基金持有人利益出发，严守合规底线、完善内部控制，2018年度主要从如下几个方面落实风险控制与合规管理、强化监察稽核职能：

1、建立健全公司治理结构、完善投资决策流程：报告期内公司进一步健全公司治理架构、强化制衡机制，明确各专业委员会职责权限与议事决策规则，优化核心业务流程，调整和完善业务分级授权体系；

2、加强业务合规及信息披露审核：随着公司管理资产规模扩大以及产品线进一步丰富，公司持续加强对信息披露材料、营销材料、产品方案等开展合规审核，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性，保证各项对外营销活动和宣传推介合法合规；

3、全面实施投资监督和风险监测：公司严格遵照法律法规、基金合同和公司制度要求对日常投资运作进行管理和监控，对基金运作合规情况进行监控并跟踪分析异常指标，及时沟通及风险提示，全方位防范控制基金运作风险。

4、开展各项稽核审计工作：根据法规要求，组织开展定期稽核、特定人员离任审计，依据风险导向组织重点业务领域专项审计，根据监管要求组织各项自查，对产品运作、业务开展合规性及内控完善性进行审查，不断促进公司内控制度执行有效。

5、落实全员合规理念、加强员工合规管理：报告期内公司通过线上、线下多种方式组织开展员工合规培训，加强对员工职业操守的教育和监督，提升员工合规遵从意识；严格规范工作人员执业行为，督促员工勤勉尽责，防范利用职务便利从事违法违规、超越权限或者其他损害客户合法权益的行为；组织开展定期常规信息管制抽查，以及异常行为专项排查，加强员工行为监督，强化员工合规管理。

6、持续完善内控合规体系建设、强化合规内控管理：报告期内，积极宣导合规内控文化，有序推进各项合规内控工作，不断提升公司审慎规范经营和全面风险管理水平。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则，坚持风险控制为核心，确保管理基金的合规、安全运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

##### 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 公司方面

估值委员会设主任委员一名，由分管运营的公司领导担任；委员若干名，由基金运营部、风险管理总部、研究部、投资管理总部（视会议议题内容选择相关投资方向部门）部门负责人或其指定人员组成。

估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；对估值方法进行讨论并作出评价，在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用；评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性，对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定；讨论、决定其他与估值相关的重大问题。

###### (2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

###### (3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

##### 4、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

##### 5、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满3年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

基金合同生效后继续存续的，自基金合同生效满三年后的基金存续期内，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规另有规定时，从其规定。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(19)第P00214号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金全体持有人：
审计意见	我们审计了兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括2017年12月31日及2018年12月31日的资产负债表，2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间及2018年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2017年12月31日及2018年12月31日的财务状况、2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	兴业基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金201

	<p>8年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，保持职业怀疑。同时，我们也执行以</p>



	<p>下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	曾浩	吴凌志
会计师事务所的地址	上海市延安东路222号外滩中心30楼	
审计报告日期	2019-03-22	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	209,256.96	97,517,779.74
结算备付金		1,719,316.65	-
存出保证金		41,753.57	-
交易性金融资产	7.4.7.2	59,680,782.42	-
其中：股票投资		54,573,642.42	-
基金投资		-	-
债券投资		5,107,140.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	283,591.08	46,647.98
应收股利		-	-
应收申购款		4,190.42	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		61,938,891.10	97,564,427.72
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年12月31日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		116,112.85	-
应付管理人报酬		81,968.49	20,042.29
应付托管费		10,929.13	2,672.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	27,261.63	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	270,044.91	-
负债合计		506,317.01	22,714.61
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	81,105,362.95	97,504,344.03
未分配利润	7.4.7.1 0	-19,672,788.86	37,369.08
所有者权益合计		61,432,574.09	97,541,713.11
负债和所有者权益总计		61,938,891.10	97,564,427.72

注：1. 报告截止日2018年12月31日，基金份额净值0.7574元，基金份额总额81,105,362.95份。

2. 本基金合同于2017年12月26日生效，上年财务报表的实际编制期间为2017年12月26日（基金合同生效日）至2017年12月31日。

## 7.2 利润表

会计主体：兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年12月26日（基金
----	-----	---------------------------	-----------------------

		日	合同生效日) 至2017年 12月31日
一、收入		-18,615,694.93	60,483.69
1. 利息收入		546,021.25	60,483.69
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	117,057.96	51,035.68
债券利息收入		246,651.37	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		182,311.92	9,448.01
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-12,954,612.29	-
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	-13,777,549.86	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.1 3	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.1 3.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.1 4	113,359.22	-
股利收益	7.4.7.1 5	709,578.35	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 6	-6,260,029.97	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 7	52,926.08	-

<b>减：二、费用</b>		2,395,856.27	23,114.61
1. 管理人报酬	7.4.10. 2.1	1,144,212.19	20,042.29
2. 托管费	7.4.10. 2.2	152,561.67	2,672.32
3. 销售服务费	7.4.10. 2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.1 8	808,478.53	-
5. 利息支出		812.43	-
其中：卖出回购金融资产支出		812.43	-
6. 税金及附加		408.09	-
7. 其他费用	7.4.7.1 9	289,383.36	400.00
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-21,011,551.20	37,369.08
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-21,011,551.20	37,369.08

注：本基金合同于2017年12月26日生效，上年财务报表的实际编制期间为2017年12月26日（基金合同生效日）至2017年12月31日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	97,504,344.03	37,369.08	97,541,713.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动	-	-21,011,551.20	-21,011,551.20

数(本期利润)			
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)	-16,398,981.08	1,301,393.26	-15,097,587.82
其中: 1. 基金申购款	5,443,044.43	-992,394.37	4,450,650.06
2. 基金赎回款	-21,842,025.51	2,293,787.63	-19,548,237.88
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)	81,105,362.95	-19,672,788.86	61,432,574.09
项 目	上年度可比期间		
	2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	97,504,344.03	-	97,504,344.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,369.08	37,369.08
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)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	97,504,344.03	37,369.08	97,541,713.11

注：本基金合同于2017年12月26日生效，上年度可比期间不是完整报告期，按实际存续期计算。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

卓新章

庄孝强

楼怡斐

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2017]1482号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为97,504,344.03份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(17)第00599号的验资报告。基金合同于2017年12月26日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、同业存单及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%；每个交易日日终在扣

除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×55%+中证综合债券指数收益率×45%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2017年12月31日及2018年12月31日的财务状况以及2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。上年度可比期间为2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

###### 2) 金融负债的分类



根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。对于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股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3)对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4)当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### - 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

#### - 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

#### - 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 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；

2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

- 3) 每一基金份额享有同等分配权；
- 4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 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《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》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 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，根据《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》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈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〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2008]1号《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》、2008年9月18日《上海、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[2012]85号《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[2014]48号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌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《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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《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]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金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。

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日

活期存款	209,256.96	97,517,779.74
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	209,256.96	97,517,779.74

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2018年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		60,776,134.19	54,573,642.42	-6,202,491.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	5,164,678.20	5,107,140.00	-57,538.20
	合计	5,164,678.20	5,107,140.00	-57,538.20
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		65,940,812.39	59,680,782.42	-6,260,029.97
项目		上年度末2017年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-

	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期(及上年度末均)未持有衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末（及上年度末均）未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末（及上年度末均）未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	279.36	46,647.98
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	485.67	-
应收债券利息	282,805.48	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-

其他	20.57	-
合计	283,591.08	46,647.98

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末（及上年度末均）未持有其他资产

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	27,261.63	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	27,261.63	-

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	44.91	-
预提费用	270,000.00	-
合计	270,044.91	-

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	97,504,344.03	97,504,344.03
本期申购	5,443,044.43	5,443,044.43



本期赎回（以“-”号填列）	-21,842,025.51	-21,842,025.51
本期末	81,105,362.95	81,105,362.95

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	37,369.08	-	37,369.08
本期利润	-14,751,521.23	-6,260,029.97	-21,011,551.20
本期基金份额交易产生的变动数	725,873.77	575,519.49	1,301,393.26
其中：基金申购款	-770,939.65	-221,454.72	-992,394.37
基金赎回款	1,496,813.42	796,974.21	2,293,787.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,988,278.38	-5,684,510.48	-19,672,788.86

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年12月26日（基金合同生效日）至2017年12月31日
活期存款利息收入	86,292.49	51,035.68
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	29,975.64	-
其他	789.83	-
合计	117,057.96	51,035.68

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018年01月01日至 2018年12月31日	2017年12月26日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
卖出股票成交总额	476,965,581.42	-
减：卖出股票成本总额	490,743,131.28	-
买卖股票差价收入	-13,777,549.86	-

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期（及上年度可比期间）无债券投资收益——买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期（及上年度可比期间）无资产支持证券投资收益

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间收益金额 2017年12月26日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
期货投资	113,359.22	-

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	709,578.35	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	709,578.35	-

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01 月01日至2 018年12月 31日	上年度可比期间 2017年12月26日 (基金合同生效 日)至2017年12月 31日
1. 交易性金融资产	-6,260,029.97	-
——股票投资	-6,202,491.77	-
——债券投资	-57,538.20	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——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	-6,260,029.97	-

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日(基金合同生效 日)至2017年12月31日
基金赎回费收入	52,926.08	-
合计	52,926.08	-

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
交易所市场交易费用	806,089.70	-
银行间市场交易费用	162.75	-
期货市场交易费用	2,226.08	-
合计	808,478.53	-

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
审计费用	30,000.00	-
信息披露费	240,000.00	-
汇划手续费	7,383.36	-
帐户维护费	12,000.00	-
开户费	-	400.00
合计	289,383.36	400.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴业基金管理有限公司(以下简称“兴业基金”)	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东
兴业财富资产管理有限公司(以下简称“兴业财富”)	基金管理人控制的公司

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期（及上年度可比期间）未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期（及上年度可比期间）未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期（及上年度可比期间）无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日 至2018年12月31 日	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同 生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,144,212.19	20,042.29
其中：支付销售机构的客户维护费	430,951.72	7,634.17

注：支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日 至2018年12月31 日	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生 效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	152,561.67	2,672.32

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生 效日）至2017年12月31日
基金合同生效日（2017年12月26日）持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.33%	10.26%

注：关联方投资本基金采用公允费率，即按照基金法律文件条款执行。

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

本基金本报告期及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生效日） 至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	209,256.96	86,292.49	97,517,779.74	51,035.68

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生其他关联方交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018-12-25	重大事项停牌	16.01	2019-01-10	17.15	38,000	625,169.50	608,380.00	-
300080	易成新能	2018-11-05	重大事项停牌	4.35	2019-01-10	4.79	2,400	9,776.00	10,440.00	-
000987	越秀金控	2018-12-25	重大事项停牌	7.97	2019-01-10	8.77	900	6,473.84	7,173.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。本基金基金管理人建立的风险管理体系由三层风险防范等级构成：

一级风险防范是指公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。董事会下设审计与风险管理委员会，负责公司审计风险的控制、管理、监督和评价；对公司经营的合法、合规性进行监控和检查，对经营活动进行审计。

二级风险防范是指公司风险控制委员会、投资策略委员会和风险管理总部层次对公司风险进行的预防和控制。管理层下设风险控制委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行研究、分析与评估，制定相应风险控制制度并监督其执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各类风险。



三级风险防范是指公司各部门对自身业务风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及部门具体情况，制定本部门业务流程及风险控制措施。

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。本基金通过对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，投资于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基金管理人旗下其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

除国债、央行票据、政策性金融债外，本基金报告期末及上年度末未持有按信用评级列示的债券。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理

人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金基金管理人主要通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	209,256.96	-	-	-	209,256.96
结算备付金	1,719,316.65	-	-	-	1,719,316.65
存出保证金	41,753.57	-	-	-	41,753.57
交易性金融资产	5,107,140.00	-	-	54,573,642.42	59,680,782.42
应收利息	-	-	-	283,591.08	283,591.08
应收申购款	-	-	-	4,190.42	4,190.42
资产总计	7,077,467.18	-	-	54,861,423.92	61,938,891.10
负债					

应付赎回款	-	-	-	116,112.85	116,112.85
应付管理人报酬	-	-	-	81,968.49	81,968.49
应付托管费	-	-	-	10,929.13	10,929.13
应付交易费用	-	-	-	27,261.63	27,261.63
其他负债	-	-	-	270,044.91	270,044.91
负债总计	-	-	-	506,317.01	506,317.01
利率敏感度缺口	7,077,467.18	-	-	54,355,106.91	61,432,574.09
上年度末2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	97,517,779.74	-	-	-	97,517,779.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	46,647.98	46,647.98
资产总计	97,517,779.74	-	-	46,647.98	97,564,427.72
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	20,042.29	20,042.29
应付托管费	-	-	-	2,672.32	2,672.32
负债总计	-	-	-	22,714.61	22,714.61
利率敏	97,517,779.74	-	-	23,933.37	97,541,713.11

感度缺口					
------	--	--	--	--	--

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	利率曲线平行移动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
	市场利率上升25个基点	-477.25	-
	市场利率下降25个基点	478.46	-

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险可来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项，也可来源于市场整体波动。

本基金基金管理人在构建和管理投资组合过程中，通过对宏观经济情况及政策分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金基金管理人定期结合宏观及微观环境变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行动态修正，以主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，基金管理人对本基金所持仓证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量，以测试本基金所面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
----	--------------------	---------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	54,573,642.42	88.84	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	54,573,642.42	88.84	-	-

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票价格以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
	股票价格上升5%	2,728,682.12	-
	股票价格下降5%	-2,728,682.12	-

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括买入应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相若。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币53,947,649.42元，属于第二层次的余额为人民币5,733,133.00元，无属于第三层次的余额(于2017年12月31日，无属于第一层次、第二层次及第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	54,573,642.42	88.11
	其中：股票	54,573,642.42	88.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,107,140.00	8.25
	其中：债券	5,107,140.00	8.25
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,928,573.61	3.11
8	其他各项资产	329,535.07	0.53
9	合计	61,938,891.10	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	2,719,130.00	4.43
C	制造业	26,744,306.18	43.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	649,550.00	1.06
E	建筑业	361,446.00	0.59
F	批发和零售业	1,085,782.00	1.77
G	交通运输、仓储和邮政业	2,368,206.50	3.85
H	住宿和餐饮业	31,920.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,968,951.00	8.09
J	金融业	9,250,047.92	15.06
K	房地产业	563,968.00	0.92
L	租赁和商务服务业	591,006.27	0.96
M	科学研究和技术服务业	628,306.00	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	50,904.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,944.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,497,588.55	7.32
S	综合	39,586.00	0.06
	合计	54,573,642.42	88.84

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600837	海通证券	226,600	1,994,080.00	3.25
2	000910	大亚圣象	77,600	800,056.00	1.30
3	601989	中国重工	186,200	791,350.00	1.29
4	600031	三一重工	93,600	780,624.00	1.27
5	601318	中国平安	13,800	774,180.00	1.26

6	600428	中远海特	236,278	767,903.50	1.25
7	601919	中远海控	161,500	652,460.00	1.06
8	600000	浦发银行	64,600	633,080.00	1.03
9	600030	中信证券	38,000	608,380.00	0.99
10	300251	光线传媒	77,700	590,520.00	0.96
11	300027	华谊兄弟	123,100	577,339.00	0.94
12	600028	中国石化	112,000	565,600.00	0.92
13	600715	文投控股	121,300	545,850.00	0.89
14	300426	唐德影视	73,455	500,963.10	0.82
15	002712	思美传媒	81,091	484,113.27	0.79
16	601211	国泰君安	31,400	481,048.00	0.78
17	300291	华录百纳	105,301	468,589.45	0.76
18	600760	中航沈飞	16,100	446,131.00	0.73
19	600136	当代明诚	53,300	435,461.00	0.71
20	600027	华电国际	76,700	364,325.00	0.59
21	002311	海大集团	15,300	354,501.00	0.58
22	002001	新和成	23,200	348,232.00	0.57
23	002032	苏泊尔	6,600	346,500.00	0.56
24	600004	白云机场	34,000	341,700.00	0.56
25	002120	韵达股份	11,200	339,360.00	0.55
26	000776	广发证券	26,500	336,020.00	0.55
27	600893	航发动力	15,400	334,488.00	0.54
28	600998	九州通	22,800	332,880.00	0.54
29	603156	养元饮品	8,000	332,640.00	0.54
30	000768	中航飞机	25,100	332,324.00	0.54
31	000408	藏格控股	29,200	327,624.00	0.53
32	601138	工业富联	27,300	316,407.00	0.52
33	000661	长春高新	1,800	315,000.00	0.51
34	002773	康弘药业	9,200	313,444.00	0.51
35	000703	恒逸石化	27,000	311,040.00	0.51
36	603259	药明康德	4,100	306,926.00	0.50



37	002271	东方雨虹	23,700	306,915.00	0.50
38	601066	中信建投	35,200	306,592.00	0.50
39	600566	济川药业	9,000	301,770.00	0.49
40	000553	安道麦A	32,600	297,638.00	0.48
41	600519	贵州茅台	500	295,005.00	0.48
42	002179	中航光电	8,751	294,733.68	0.48
43	002422	科伦药业	13,800	284,970.00	0.46
44	601233	桐昆股份	28,800	281,088.00	0.46
45	300059	东方财富	23,200	280,720.00	0.46
46	603986	兆易创新	4,500	280,440.00	0.46
47	000892	欢瑞世纪	57,000	271,320.00	0.44
48	300024	机器人	19,500	257,790.00	0.42
49	000157	中联重科	69,900	248,844.00	0.41
50	600109	国金证券	34,300	245,588.00	0.40
51	601555	东吴证券	35,700	239,190.00	0.39
52	601688	华泰证券	14,600	236,520.00	0.39
53	601377	兴业证券	50,700	235,248.00	0.38
54	000783	长江证券	45,600	234,840.00	0.38
55	000425	徐工机械	69,300	223,839.00	0.36
56	000686	东北证券	34,500	215,970.00	0.35
57	000738	航发控制	17,900	215,874.00	0.35
58	601788	光大证券	24,500	214,865.00	0.35
59	600879	航天电子	39,600	214,236.00	0.35
60	600369	西南证券	60,904	211,945.92	0.35
61	000728	国元证券	30,300	211,494.00	0.34
62	600118	中国卫星	12,000	207,840.00	0.34
63	002230	科大讯飞	8,000	197,120.00	0.32
64	600038	中直股份	5,000	186,800.00	0.30
65	600016	民生银行	32,300	185,079.00	0.30
66	601328	交通银行	31,200	180,648.00	0.29
67	601766	中国中车	19,700	177,694.00	0.29

68	600887	伊利股份	7,100	162,448.00	0.26
69	002013	中航机电	24,900	162,099.00	0.26
70	002174	游族网络	8,700	161,733.00	0.26
71	600282	南钢股份	45,600	155,952.00	0.25
72	601288	农业银行	43,300	155,880.00	0.25
73	600967	内蒙一机	14,900	154,960.00	0.25
74	000039	中集集团	14,400	152,352.00	0.25
75	000681	视觉中国	6,500	151,580.00	0.25
76	300450	先导智能	5,200	150,488.00	0.24
77	000008	神州高铁	38,600	150,154.00	0.24
78	600570	恒生电子	2,800	145,544.00	0.24
79	601005	重庆钢铁	73,500	142,590.00	0.23
80	002738	中矿资源	9,800	142,492.00	0.23
81	000547	航天发展	18,700	141,372.00	0.23
82	002353	杰瑞股份	9,300	139,500.00	0.23
83	600276	恒瑞医药	2,600	137,150.00	0.22
84	300170	汉得信息	13,700	133,986.00	0.22
85	601668	中国建筑	23,300	132,810.00	0.22
86	300036	超图软件	7,200	131,976.00	0.21
87	002318	久立特材	20,600	130,604.00	0.21
88	600637	东方明珠	12,700	130,048.00	0.21
89	600999	招商证券	9,700	129,980.00	0.21
90	601398	工商银行	24,300	128,547.00	0.21
91	600126	杭钢股份	28,000	126,280.00	0.21
92	002023	海特高新	12,200	126,270.00	0.21
93	600271	航天信息	5,500	125,895.00	0.20
94	000778	新兴铸管	28,900	124,559.00	0.20
95	000959	首钢股份	33,000	123,090.00	0.20
96	600307	酒钢宏兴	63,800	121,858.00	0.20
97	600010	包钢股份	82,300	121,804.00	0.20
98	600022	山东钢铁	77,500	121,675.00	0.20

99	600435	北方导航	16,300	120,783.00	0.20
100	000709	河钢股份	42,500	120,700.00	0.20
101	002756	永兴特钢	10,000	119,200.00	0.19
102	300523	辰安科技	2,000	119,000.00	0.19
103	603878	武进不锈	10,400	117,832.00	0.19
104	601006	大秦铁路	14,200	116,866.00	0.19
105	002443	金洲管道	22,000	116,820.00	0.19
106	000581	威孚高科	6,600	116,556.00	0.19
107	601106	中国一重	43,400	115,878.00	0.19
108	601169	北京银行	20,600	115,566.00	0.19
109	600372	中航电子	8,900	115,522.00	0.19
110	600388	龙净环保	11,300	114,695.00	0.19
111	002244	滨江集团	28,800	114,624.00	0.19
112	000761	本钢板材	34,100	114,576.00	0.19
113	600160	巨化股份	17,200	114,036.00	0.19
114	603328	依顿电子	11,500	113,850.00	0.19
115	600588	用友网络	5,300	112,890.00	0.18
116	600958	东方证券	14,000	111,580.00	0.18
117	600585	海螺水泥	3,800	111,264.00	0.18
118	600100	同方股份	11,400	110,922.00	0.18
119	600376	首开股份	15,400	110,726.00	0.18
120	600827	百联股份	13,100	110,695.00	0.18
121	600117	西宁特钢	32,400	109,836.00	0.18
122	601717	郑煤机	19,700	108,941.00	0.18
123	600195	中牧股份	10,100	107,464.00	0.17
124	002151	北斗星通	5,050	106,555.00	0.17
125	600323	瀚蓝环境	7,500	105,225.00	0.17
126	600779	水井坊	3,300	104,511.00	0.17
127	000528	柳工	17,170	104,221.90	0.17
128	600580	卧龙电气	16,500	103,950.00	0.17
129	601969	海南矿业	23,200	103,936.00	0.17

130	600403	大有能源	28,300	103,861.00	0.17
131	603979	金诚信	13,800	103,362.00	0.17
132	601918	新集能源	34,300	103,243.00	0.17
133	000301	东方盛虹	18,900	103,194.00	0.17
134	000673	当代东方	21,900	102,711.00	0.17
135	601601	中国太保	3,600	102,348.00	0.17
136	600985	淮北矿业	11,000	102,300.00	0.17
137	002589	瑞康医药	14,500	101,065.00	0.16
138	000088	盐田港	20,100	100,500.00	0.16
139	002739	万达电影	4,600	100,418.00	0.16
140	603727	博迈科	8,100	99,954.00	0.16
141	000552	靖远煤电	39,000	99,840.00	0.16
142	603113	金能科技	9,100	99,827.00	0.16
143	600583	海油工程	20,300	99,470.00	0.16
144	600339	中油工程	27,400	99,462.00	0.16
145	002629	仁智股份	25,300	99,176.00	0.16
146	601808	中海油服	11,600	99,064.00	0.16
147	600048	保利地产	8,400	99,036.00	0.16
148	600320	振华重工	31,200	98,904.00	0.16
149	600121	郑州煤电	34,100	98,890.00	0.16
150	601001	大同煤业	23,000	98,210.00	0.16
151	000780	平庄能源	32,700	98,100.00	0.16
152	300207	欣旺达	11,400	97,926.00	0.16
153	002554	惠博普	36,000	97,560.00	0.16
154	300191	潜能恒信	6,600	97,152.00	0.16
155	600546	山煤国际	29,200	96,944.00	0.16
156	002610	爱康科技	61,700	96,869.00	0.16
157	601015	陕西黑猫	18,100	96,111.00	0.16
158	600792	云煤能源	35,800	95,944.00	0.16
159	600681	百川能源	8,100	95,904.00	0.16
160	002099	海翔药业	21,200	95,824.00	0.16

161	600771	广誉远	3,300	95,271.00	0.16
162	600758	红阳能源	29,200	94,900.00	0.15
163	000723	美锦能源	29,500	94,695.00	0.15
164	600219	南山铝业	44,800	94,528.00	0.15
165	000762	西藏矿业	14,000	94,360.00	0.15
166	002373	千方科技	8,400	93,408.00	0.15
167	603019	中科曙光	2,600	93,288.00	0.15
168	000166	申万宏源	22,800	92,796.00	0.15
169	600759	洲际油气	39,100	92,276.00	0.15
170	601633	长城汽车	16,400	91,840.00	0.15
171	300529	健帆生物	2,200	91,300.00	0.15
172	002537	海联金汇	8,900	91,225.00	0.15
173	601901	方正证券	16,900	89,739.00	0.15
174	603716	塞力斯	4,700	89,441.00	0.15
175	000620	新华联	22,500	87,975.00	0.14
176	600562	国睿科技	6,800	87,516.00	0.14
177	300467	迅游科技	3,800	87,134.00	0.14
178	601988	中国银行	24,000	86,640.00	0.14
179	002025	航天电器	4,000	85,720.00	0.14
180	000519	中兵红箭	13,600	85,544.00	0.14
181	601100	恒立液压	4,300	85,183.00	0.14
182	002595	豪迈科技	5,100	81,600.00	0.13
183	300500	启迪设计	3,600	80,208.00	0.13
184	300101	振芯科技	8,100	80,190.00	0.13
185	601231	环旭电子	8,900	80,100.00	0.13
186	002796	世嘉科技	2,300	79,672.00	0.13
187	603939	益丰药房	1,900	79,230.00	0.13
188	300438	鹏辉能源	4,900	79,184.00	0.13
189	002413	雷科防务	14,700	78,645.00	0.13
190	600499	科达洁能	19,300	77,972.00	0.13
191	002303	美盈森	16,700	77,655.00	0.13

192	601186	中国铁建	7,100	77,177.00	0.13
193	600835	上海机电	5,300	77,115.00	0.13
194	600582	天地科技	22,500	76,950.00	0.13
195	002757	南兴装备	2,700	76,680.00	0.12
196	600050	中国联通	14,800	76,516.00	0.12
197	603808	歌力思	4,700	76,328.00	0.12
198	600316	洪都航空	7,700	76,153.00	0.12
199	300253	卫宁健康	6,100	76,006.00	0.12
200	300486	东杰智能	5,700	75,981.00	0.12
201	002444	巨星科技	7,900	74,892.00	0.12
202	002690	美亚光电	3,500	74,480.00	0.12
203	300159	新研股份	16,000	73,760.00	0.12
204	002798	帝欧家居	5,500	73,755.00	0.12
205	300222	科大智能	4,700	72,850.00	0.12
206	002426	胜利精密	31,400	72,848.00	0.12
207	002410	广联达	3,500	72,835.00	0.12
208	600577	精达股份	24,500	72,765.00	0.12
209	603936	博敏电子	5,100	72,522.00	0.12
210	002097	山河智能	13,000	72,150.00	0.12
211	002065	东华软件	10,300	71,585.00	0.12
212	002685	华东重机	14,500	71,340.00	0.12
213	300047	天源迪科	6,400	71,104.00	0.12
214	300513	恒实科技	3,100	70,525.00	0.11
215	603599	广信股份	6,700	70,350.00	0.11
216	000977	浪潮信息	4,400	70,048.00	0.11
217	601229	上海银行	6,200	69,378.00	0.11
218	603518	维格娜丝	4,900	69,090.00	0.11
219	002195	二三四五	18,700	69,003.00	0.11
220	600811	东方集团	18,600	68,076.00	0.11
221	300449	汉邦高科	4,400	67,848.00	0.11
222	000651	格力电器	1,900	67,811.00	0.11

223	603898	好莱客	4,400	67,452.00	0.11
224	600761	安徽合力	7,700	67,375.00	0.11
225	002768	国恩股份	3,000	66,900.00	0.11
226	300472	新元科技	4,900	66,689.00	0.11
227	600545	卓郎智能	9,000	66,600.00	0.11
228	601818	光大银行	17,900	66,230.00	0.11
229	300567	精测电子	1,300	65,624.00	0.11
230	600153	建发股份	9,300	65,565.00	0.11
231	600677	航天通信	6,900	65,343.00	0.11
232	600059	古越龙山	9,900	65,340.00	0.11
233	002405	四维图新	4,600	64,906.00	0.11
234	300457	赢合科技	2,300	64,055.00	0.10
235	002624	完美世界	2,300	64,055.00	0.10
236	600685	中船防务	6,700	64,052.00	0.10
237	600019	宝钢股份	9,800	63,700.00	0.10
238	600169	太原重工	28,500	63,555.00	0.10
239	300423	鲁亿通	3,600	63,468.00	0.10
240	600072	中船科技	9,100	63,427.00	0.10
241	002439	启明星辰	3,000	61,680.00	0.10
242	300434	金石东方	7,000	61,600.00	0.10
243	300145	中金环境	18,900	61,425.00	0.10
244	002073	软控股份	13,100	59,343.00	0.10
245	000410	沈阳机床	9,400	59,314.00	0.10
246	603444	吉比特	400	59,200.00	0.10
247	600765	中航重机	7,900	58,776.00	0.10
248	000997	新大陆	4,000	58,560.00	0.10
249	600343	航天动力	7,700	58,520.00	0.10
250	601608	中信重工	22,500	58,500.00	0.10
251	000901	航天科技	6,600	58,344.00	0.09
252	600990	四创电子	1,700	58,293.00	0.09
253	002366	台海核电	6,100	57,218.00	0.09

254	601360	三六零	2,800	57,036.00	0.09
255	300315	掌趣科技	16,100	56,833.00	0.09
256	600690	青岛海尔	4,100	56,785.00	0.09
257	600718	东软集团	4,900	56,595.00	0.09
258	603338	浙江鼎力	1,000	56,320.00	0.09
259	600873	梅花生物	13,300	56,126.00	0.09
260	600495	晋西车轴	13,500	55,485.00	0.09
261	601369	陕鼓动力	9,100	55,055.00	0.09
262	601098	中南传媒	4,400	55,000.00	0.09
263	002558	巨人网络	2,800	54,236.00	0.09
264	600348	阳泉煤业	10,600	53,424.00	0.09
265	601857	中国石油	7,400	53,354.00	0.09
266	002736	国信证券	6,300	52,731.00	0.09
267	600764	中国海防	2,200	52,448.00	0.09
268	002478	常宝股份	11,400	52,440.00	0.09
269	002430	杭氧股份	5,600	52,360.00	0.09
270	300474	景嘉微	1,400	50,624.00	0.08
271	002031	巨轮智能	26,700	50,196.00	0.08
272	600977	中国电影	3,500	50,120.00	0.08
273	002268	卫士通	2,800	50,008.00	0.08
274	300257	开山股份	5,000	49,950.00	0.08
275	603096	新经典	800	49,376.00	0.08
276	600481	双良节能	14,800	49,284.00	0.08
277	000066	中国长城	10,300	48,822.00	0.08
278	000680	山推股份	14,800	48,396.00	0.08
279	002314	南山控股	16,800	48,216.00	0.08
280	002564	天沃科技	9,600	48,192.00	0.08
281	600862	中航高科	8,600	48,160.00	0.08
282	600373	中文传媒	3,700	48,137.00	0.08
283	600391	航发科技	4,400	48,092.00	0.08
284	600309	万华化学	1,700	47,583.00	0.08



285	600984	建设机械	9,300	47,151.00	0.08
286	000584	哈工智能	7,500	47,100.00	0.08
287	300271	华宇软件	3,100	46,531.00	0.08
288	300456	耐威科技	2,100	46,452.00	0.08
289	601099	太平洋	18,600	46,314.00	0.08
290	002673	西部证券	6,000	46,020.00	0.07
291	002509	天广中茂	19,400	45,978.00	0.07
292	600023	浙能电力	9,600	45,408.00	0.07
293	000777	中核科技	4,500	45,135.00	0.07
294	002523	天桥起重	15,200	44,840.00	0.07
295	601390	中国中铁	6,400	44,736.00	0.07
296	300470	日机密封	2,000	44,500.00	0.07
297	601958	金钼股份	7,500	44,400.00	0.07
298	600172	黄河旋风	14,500	44,225.00	0.07
299	002153	石基信息	1,700	44,132.00	0.07
300	603337	杰克股份	1,200	44,028.00	0.07
301	601890	亚星锚链	12,500	44,000.00	0.07
302	300349	金卡智能	2,700	43,470.00	0.07
303	600039	四川路桥	13,200	43,296.00	0.07
304	300168	万达信息	3,600	43,164.00	0.07
305	300166	东方国信	4,100	42,476.00	0.07
306	601336	新华保险	1,000	42,240.00	0.07
307	300033	同花顺	1,100	42,020.00	0.07
308	300400	劲拓股份	2,800	41,720.00	0.07
309	002797	第一创业	7,600	41,192.00	0.07
310	603012	创力集团	5,100	40,953.00	0.07
311	300034	钢研高纳	4,700	40,420.00	0.07
312	300418	昆仑万维	3,100	39,866.00	0.06
313	601881	中国银河	5,800	39,556.00	0.06
314	600037	歌华有线	4,600	39,514.00	0.06
315	601088	中国神华	2,200	39,512.00	0.06

316	300193	佳士科技	5,500	39,490.00	0.06
317	002132	恒星科技	14,500	39,440.00	0.06
318	300383	光环新网	3,100	39,277.00	0.06
319	603686	龙马环卫	3,600	39,096.00	0.06
320	300572	安车检测	900	39,015.00	0.06
321	600500	中化国际	5,700	38,988.00	0.06
322	601628	中国人寿	1,900	38,741.00	0.06
323	002526	山东矿机	20,600	38,728.00	0.06
324	000598	兴蓉环境	9,600	38,688.00	0.06
325	300182	捷成股份	9,000	38,610.00	0.06
326	300280	紫天科技	1,200	38,472.00	0.06
327	000821	京山轻机	5,000	38,300.00	0.06
328	601198	东兴证券	4,000	38,240.00	0.06
329	002698	博实股份	4,300	38,227.00	0.06
330	300091	金通灵	11,300	38,081.00	0.06
331	300133	华策影视	4,200	37,632.00	0.06
332	603111	康尼机电	9,500	37,620.00	0.06
333	600158	中体产业	4,200	37,338.00	0.06
334	002621	三垒股份	2,200	37,268.00	0.06
335	600782	新钢股份	7,300	37,157.00	0.06
336	601002	晋亿实业	6,900	36,915.00	0.06
337	002500	山西证券	6,200	36,704.00	0.06
338	600728	佳都科技	5,300	36,517.00	0.06
339	002192	融捷股份	2,000	36,480.00	0.06
340	002240	威华股份	5,000	36,450.00	0.06
341	300226	上海钢联	800	36,424.00	0.06
342	603638	艾迪精密	1,500	36,315.00	0.06
343	300527	中国应急	5,500	36,300.00	0.06
344	300424	航新科技	2,600	36,244.00	0.06
345	300276	三丰智能	3,500	36,085.00	0.06
346	300058	蓝色光标	8,300	36,022.00	0.06

347	300195	长荣股份	4,500	35,820.00	0.06
348	000852	石化机械	5,000	35,800.00	0.06
349	002480	新筑股份	7,300	35,624.00	0.06
350	300113	顺网科技	2,800	35,588.00	0.06
351	000976	华铁股份	7,700	35,266.00	0.06
352	002297	博云新材	5,900	35,164.00	0.06
353	603556	海兴电力	2,700	35,100.00	0.06
354	300130	新国都	3,100	35,092.00	0.06
355	601928	凤凰传媒	4,400	34,936.00	0.06
356	002248	华东数控	4,000	34,800.00	0.06
357	000938	紫光股份	1,100	34,386.00	0.06
358	300201	海伦哲	8,500	34,340.00	0.06
359	603298	杭叉集团	2,900	34,278.00	0.06
360	002111	威海广泰	3,500	34,090.00	0.06
361	002555	三七互娱	3,600	33,984.00	0.06
362	601606	长城军工	2,800	33,768.00	0.05
363	601028	玉龙股份	7,200	33,624.00	0.05
364	600410	华胜天成	5,700	33,402.00	0.05
365	600894	广日股份	6,100	33,245.00	0.05
366	300066	三川智慧	10,000	33,200.00	0.05
367	600558	大西洋	10,500	33,180.00	0.05
368	600797	浙大网新	4,600	33,166.00	0.05
369	002152	广电运通	5,900	33,099.00	0.05
370	600340	华夏幸福	1,300	33,085.00	0.05
371	300123	亚光科技	3,600	32,868.00	0.05
372	002367	康力电梯	5,900	32,863.00	0.05
373	300339	润和软件	3,600	32,832.00	0.05
374	600426	华鲁恒升	2,700	32,589.00	0.05
375	002912	中新赛克	400	32,424.00	0.05
376	600959	江苏有线	7,800	32,136.00	0.05
377	601878	浙商证券	4,400	31,944.00	0.05

378	600258	首旅酒店	2,000	31,920.00	0.05
379	600633	浙数文化	3,900	31,785.00	0.05
380	600703	三安光电	2,800	31,668.00	0.05
381	300410	正业科技	1,400	31,570.00	0.05
382	603699	纽威股份	2,600	31,070.00	0.05
383	002376	新北洋	2,000	30,680.00	0.05
384	300451	创业慧康	1,600	30,640.00	0.05
385	000925	众合科技	5,200	30,420.00	0.05
386	002009	天奇股份	4,000	30,240.00	0.05
387	002368	太极股份	1,300	30,160.00	0.05
388	300097	智云股份	2,700	30,159.00	0.05
389	000837	秦川机床	7,600	29,868.00	0.05
390	002131	利欧股份	20,300	29,841.00	0.05
391	002438	江苏神通	5,200	29,796.00	0.05
392	600601	方正科技	11,800	29,736.00	0.05
393	000750	国海证券	6,800	29,648.00	0.05
394	300007	汉威科技	3,000	29,430.00	0.05
395	600184	光电股份	3,000	29,310.00	0.05
396	600536	中国软件	1,400	29,302.00	0.05
397	603169	兰石重装	6,800	29,036.00	0.05
398	300212	易华录	1,400	29,008.00	0.05
399	300064	豫金刚石	6,400	28,544.00	0.05
400	300724	捷佳伟创	1,000	28,480.00	0.05
401	300533	冰川网络	900	28,431.00	0.05
402	002383	合众思壮	2,400	28,392.00	0.05
403	002559	亚威股份	4,300	28,251.00	0.05
404	002520	日发精机	3,900	28,197.00	0.05
405	300459	金科文化	3,800	27,930.00	0.05
406	002400	省广集团	9,400	27,824.00	0.05
407	300604	长川科技	900	27,540.00	0.04
408	300747	锐科激光	200	27,520.00	0.04

409	002280	联络互动	7,100	27,477.00	0.04
410	603200	上海洗霸	800	27,440.00	0.04
411	300188	美亚柏科	2,100	27,342.00	0.04
412	000793	华闻传媒	9,200	27,324.00	0.04
413	300035	中科电气	6,000	27,000.00	0.04
414	000811	冰轮环境	5,200	26,884.00	0.04
415	002535	林州重机	8,300	26,726.00	0.04
416	300496	中科创达	1,200	26,520.00	0.04
417	300377	赢时胜	2,400	26,496.00	0.04
418	300008	天海防务	10,200	26,418.00	0.04
419	300420	五洋停车	5,300	26,394.00	0.04
420	603368	柳药股份	1,000	26,200.00	0.04
421	002233	塔牌集团	2,600	26,156.00	0.04
422	600375	华菱星马	7,400	26,048.00	0.04
423	000856	冀东装备	1,800	25,920.00	0.04
424	002421	达实智能	6,600	25,872.00	0.04
425	603690	至纯科技	1,700	25,806.00	0.04
426	300548	博创科技	700	25,795.00	0.04
427	603611	诺力股份	2,100	25,788.00	0.04
428	600815	厦工股份	8,600	25,714.00	0.04
429	300278	华昌达	4,500	25,695.00	0.04
430	300575	中旗股份	600	25,680.00	0.04
431	603308	应流股份	3,200	25,664.00	0.04
432	300228	富瑞特装	5,300	25,652.00	0.04
433	600446	金证股份	2,700	25,650.00	0.04
434	300114	中航电测	3,600	25,632.00	0.04
435	002876	三利谱	800	25,568.00	0.04
436	600909	华安证券	5,400	25,488.00	0.04
437	002006	精功科技	4,600	25,484.00	0.04
438	300397	天和防务	2,700	25,461.00	0.04
439	600029	南方航空	3,800	25,232.00	0.04

440	300259	新天科技	9,100	25,116.00	0.04
441	600606	绿地控股	4,100	25,051.00	0.04
442	600845	宝信软件	1,200	25,020.00	0.04
443	603318	派思股份	2,000	24,920.00	0.04
444	002884	凌霄泵业	1,200	24,876.00	0.04
445	300644	南京聚隆	700	24,780.00	0.04
446	300010	立思辰	3,400	24,684.00	0.04
447	000156	华数传媒	3,100	24,583.00	0.04
448	002278	神开股份	3,700	24,568.00	0.04
449	002689	远大智能	7,500	24,525.00	0.04
450	600756	浪潮软件	1,600	24,464.00	0.04
451	600089	特变电工	3,600	24,444.00	0.04
452	002338	奥普光电	2,200	24,442.00	0.04
453	300616	尚品宅配	400	24,308.00	0.04
454	600501	航天晨光	4,000	24,280.00	0.04
455	000726	鲁泰A	2,500	24,275.00	0.04
456	300038	数知科技	2,600	24,258.00	0.04
457	600547	山东黄金	800	24,200.00	0.04
458	603871	嘉友国际	700	24,185.00	0.04
459	002880	卫光生物	600	24,114.00	0.04
460	603810	丰山集团	600	24,084.00	0.04
461	603860	中公高科	1,000	24,070.00	0.04
462	300370	安控科技	9,100	24,024.00	0.04
463	300367	东方网力	2,700	23,949.00	0.04
464	603396	金辰股份	900	23,904.00	0.04
465	603040	新坐标	900	23,895.00	0.04
466	000551	创元科技	4,100	23,821.00	0.04
467	002833	弘亚数控	700	23,800.00	0.04
468	603969	银龙股份	5,100	23,766.00	0.04
469	300473	德尔股份	700	23,583.00	0.04
470	000021	深科技	4,100	23,575.00	0.04

471	600757	长江传媒	3,600	23,472.00	0.04
472	603136	天目湖	800	23,464.00	0.04
473	002829	星网宇达	1,300	23,400.00	0.04
474	300079	数码科技	7,100	23,359.00	0.04
475	603822	嘉澳环保	1,000	23,290.00	0.04
476	300583	赛托生物	700	23,205.00	0.04
477	300002	神州泰岳	7,000	23,100.00	0.04
478	603078	江化微	800	23,080.00	0.04
479	300710	万隆光电	1,000	23,060.00	0.04
480	300415	伊之密	3,800	23,028.00	0.04
481	600526	菲达环保	5,200	22,984.00	0.04
482	000158	常山北明	4,400	22,968.00	0.04
483	601929	吉视传媒	11,200	22,960.00	0.04
484	300600	瑞特股份	1,420	22,904.60	0.04
485	603666	亿嘉和	500	22,900.00	0.04
486	002658	雪迪龙	3,200	22,720.00	0.04
487	300287	飞利信	6,000	22,680.00	0.04
488	300695	兆丰股份	400	22,560.00	0.04
489	000530	大冷股份	6,800	22,508.00	0.04
490	300307	慈星股份	4,700	22,466.00	0.04
491	002158	汉钟精机	3,100	22,227.00	0.04
492	603301	振德医疗	700	22,225.00	0.04
493	603960	克来机电	800	22,224.00	0.04
494	300618	寒锐钴业	300	22,224.00	0.04
495	603214	爱婴室	600	22,200.00	0.04
496	603059	倍加洁	700	22,141.00	0.04
497	300689	澄天伟业	700	22,085.00	0.04
498	002718	友邦吊顶	800	22,080.00	0.04
499	600850	华东电脑	1,400	22,078.00	0.04
500	603076	乐惠国际	900	22,023.00	0.04
501	300084	海默科技	4,600	21,988.00	0.04

502	002517	恺英网络	5,900	21,889.00	0.04
503	300683	海特生物	800	21,800.00	0.04
504	000923	河北宣工	1,600	21,760.00	0.04
505	300745	欣锐科技	600	21,726.00	0.04
506	300161	华中数控	2,200	21,692.00	0.04
507	300651	金陵体育	500	21,690.00	0.04
508	300624	万兴科技	400	21,624.00	0.04
509	300607	拓斯达	700	21,525.00	0.04
510	601801	皖新传媒	3,200	21,376.00	0.03
511	603208	江山欧派	800	21,288.00	0.03
512	300709	精研科技	800	21,112.00	0.03
513	600111	北方稀土	2,400	21,048.00	0.03
514	002292	奥飞娱乐	3,700	20,942.00	0.03
515	300369	绿盟科技	2,400	20,784.00	0.03
516	603661	恒林股份	700	20,762.00	0.03
517	300681	英搏尔	600	20,754.00	0.03
518	002921	联诚精密	800	20,672.00	0.03
519	300661	圣邦股份	300	20,580.00	0.03
520	300351	永贵电器	2,500	20,475.00	0.03
521	603000	人民网	2,800	20,440.00	0.03
522	002821	凯莱英	300	20,355.00	0.03
523	300738	奥飞数据	500	20,275.00	0.03
524	002514	宝馨科技	3,800	20,254.00	0.03
525	000034	神州数码	1,500	20,175.00	0.03
526	002063	远光软件	3,700	20,054.00	0.03
527	002425	凯撒文化	3,400	19,992.00	0.03
528	300031	宝通科技	1,500	19,785.00	0.03
529	300742	越博动力	500	19,640.00	0.03
530	600936	广西广电	5,200	19,448.00	0.03
531	002123	梦网集团	2,700	19,251.00	0.03
532	002282	博深工具	2,300	19,228.00	0.03



533	300352	北信源	5,800	19,082.00	0.03
534	002343	慈文传媒	2,100	18,942.00	0.03
535	300642	透景生命	500	18,930.00	0.03
536	000802	北京文化	1,700	18,819.00	0.03
537	300365	恒华科技	900	18,810.00	0.03
538	603660	苏州科达	1,100	18,337.00	0.03
539	600880	博瑞传播	4,900	18,179.00	0.03
540	600986	科达股份	4,300	18,017.00	0.03
541	300613	富瀚微	200	17,996.00	0.03
542	300454	深信服	200	17,920.00	0.03
543	300300	汉鼎宇佑	1,600	17,920.00	0.03
544	000555	神州信息	1,900	17,746.00	0.03
545	002926	华西证券	2,100	17,577.00	0.03
546	002619	艾格拉斯	5,200	17,524.00	0.03
547	300020	银江股份	2,700	17,496.00	0.03
548	300075	数字政通	1,600	17,440.00	0.03
549	603180	金牌厨柜	300	17,406.00	0.03
550	300148	天舟文化	3,900	17,355.00	0.03
551	603773	沃格光电	400	17,312.00	0.03
552	002354	天神娱乐	3,300	17,292.00	0.03
553	002312	三泰控股	5,500	17,215.00	0.03
554	600825	新华传媒	3,500	17,150.00	0.03
555	002670	国盛金控	1,700	17,136.00	0.03
556	000676	智度股份	1,800	17,082.00	0.03
557	002148	北纬科技	2,800	16,716.00	0.03
558	600640	号百控股	1,700	16,677.00	0.03
559	300177	中海达	1,600	16,368.00	0.03
560	600831	广电网络	2,400	16,248.00	0.03
561	600242	中昌数据	1,000	16,160.00	0.03
562	002649	博彦科技	2,200	16,126.00	0.03
563	300085	银之杰	2,000	15,920.00	0.03

564	002095	生意宝	800	15,744.00	0.03
565	600661	昂立教育	800	15,648.00	0.03
566	300645	正元智慧	500	15,585.00	0.03
567	002474	榕基软件	2,500	15,500.00	0.03
568	300297	蓝盾股份	3,100	15,500.00	0.03
569	300364	中文在线	3,200	15,488.00	0.03
570	600602	云赛智联	3,100	15,438.00	0.03
571	002113	天润数娱	4,100	15,375.00	0.03
572	300343	联创互联	2,300	15,364.00	0.03
573	300336	新文化	3,400	14,960.00	0.02
574	300096	易联众	1,800	14,868.00	0.02
575	600579	天华院	1,800	14,832.00	0.02
576	300348	长亮科技	900	14,787.00	0.02
577	601519	大智慧	4,400	14,696.00	0.02
578	002387	维信诺	1,900	14,478.00	0.02
579	603039	泛微网络	200	14,460.00	0.02
580	002331	皖通科技	1,600	14,336.00	0.02
581	002308	威创股份	3,200	14,240.00	0.02
582	002642	荣之联	2,200	14,168.00	0.02
583	601019	山东出版	1,800	14,076.00	0.02
584	300045	华力创通	1,800	13,644.00	0.02
585	300043	星辉娱乐	4,100	13,612.00	0.02
586	002502	骅威文化	3,400	13,396.00	0.02
587	300696	爱乐达	600	13,380.00	0.02
588	300719	安达维尔	1,300	13,364.00	0.02
589	300581	晨曦航空	1,100	13,354.00	0.02
590	300431	暴风集团	1,600	13,344.00	0.02
591	300044	赛为智能	2,200	13,310.00	0.02
592	300065	海兰信	1,300	13,286.00	0.02
593	300465	高伟达	2,200	13,222.00	0.02
594	300589	江龙船艇	1,200	13,200.00	0.02

595	002638	勤上股份	5,100	13,107.00	0.02
596	000606	顺利办	2,200	13,090.00	0.02
597	300231	银信科技	2,000	13,000.00	0.02
598	601108	财通证券	1,800	12,996.00	0.02
599	300359	全通教育	2,200	12,870.00	0.02
600	603888	新华网	1,000	12,840.00	0.02
601	600229	城市传媒	1,900	12,768.00	0.02
602	000712	锦龙股份	1,400	12,712.00	0.02
603	000719	中原传媒	1,600	12,592.00	0.02
604	603636	南威软件	1,300	12,480.00	0.02
605	601375	中原证券	2,900	12,354.00	0.02
606	300722	新余国科	400	12,336.00	0.02
607	002279	久其软件	1,700	12,087.00	0.02
608	002699	美盛文化	2,200	12,056.00	0.02
609	600892	大晟文化	1,400	11,970.00	0.02
610	002253	川大智胜	900	11,898.00	0.02
611	600855	航天长峰	1,300	11,739.00	0.02
612	300288	朗玛信息	900	11,610.00	0.02
613	300245	天玑科技	1,300	11,154.00	0.02
614	000662	天夏智慧	1,800	11,124.00	0.02
615	002654	万润科技	2,800	11,060.00	0.02
616	601949	中国出版	2,500	10,975.00	0.02
617	000607	华媒控股	2,700	10,935.00	0.02
618	300242	佳云科技	2,500	10,750.00	0.02
619	000665	湖北广电	1,500	10,740.00	0.02
620	300295	三六五网	900	10,485.00	0.02
621	300080	易成新能	2,400	10,440.00	0.02
622	600551	时代出版	1,200	10,344.00	0.02
623	002137	麦达数字	1,500	10,170.00	0.02
624	300052	中青宝	1,000	10,100.00	0.02
625	002530	金财互联	1,500	9,885.00	0.02

626	002247	聚力文化	2,100	9,786.00	0.02
627	603993	洛阳钼业	2,600	9,776.00	0.02
628	002464	众应互联	1,100	9,570.00	0.02
629	601811	新华文轩	1,000	9,310.00	0.02
630	601900	南方传媒	1,100	9,262.00	0.02
631	002445	ST中南	4,700	9,212.00	0.01
632	600777	新潮能源	4,800	9,168.00	0.01
633	600088	中视传媒	1,100	9,163.00	0.01
634	603103	横店影视	400	8,920.00	0.01
635	600996	贵广网络	1,400	8,904.00	0.01
636	002181	粤传媒	2,400	8,664.00	0.01
637	002071	长城影视	1,900	8,645.00	0.01
638	603825	华扬联众	600	8,322.00	0.01
639	002315	焦点科技	700	8,267.00	0.01
640	600386	北巴传媒	2,400	7,968.00	0.01
641	600173	卧龙地产	2,100	7,917.00	0.01
642	601858	中国科传	900	7,866.00	0.01
643	601990	南京证券	900	7,830.00	0.01
644	300051	三五互联	1,300	7,657.00	0.01
645	000038	深大通	600	7,656.00	0.01
646	300528	幸福蓝海	900	7,560.00	0.01
647	600576	祥源文化	1,800	7,560.00	0.01
648	601595	上海电影	600	7,338.00	0.01
649	000526	紫光学大	400	7,296.00	0.01
650	000987	越秀金控	900	7,173.00	0.01
651	002238	天威视讯	1,100	7,150.00	0.01
652	300061	康旗股份	1,200	7,140.00	0.01
653	000835	长城动漫	1,700	7,072.00	0.01
654	300338	开元股份	1,000	6,910.00	0.01
655	603258	电魂网络	400	6,804.00	0.01
656	600455	博通股份	300	6,597.00	0.01

657	002905	金逸影视	500	6,515.00	0.01
658	002143	印纪传媒	2,200	6,292.00	0.01
659	603999	读者传媒	1,300	6,292.00	0.01
660	603598	引力传媒	700	6,251.00	0.01
661	601999	出版传媒	1,200	6,084.00	0.01
662	300494	盛天网络	600	5,976.00	0.01
663	603533	掌阅科技	300	5,334.00	0.01
664	002878	元隆雅图	200	5,076.00	0.01
665	002591	恒大高新	700	4,760.00	0.01
666	300518	盛讯达	200	4,640.00	0.01
667	603729	龙韵股份	300	4,632.00	0.01
668	300612	宣亚国际	300	4,476.00	0.01
669	002858	力盛赛车	300	4,125.00	0.01
670	603721	中广天择	200	2,860.00	0.00
671	300654	世纪天鸿	200	2,784.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	5,775,487.04	5.92
2	600837	海通证券	4,589,762.00	4.71
3	601288	农业银行	3,364,103.72	3.45
4	600029	南方航空	3,332,079.32	3.42
5	601006	大秦铁路	2,980,893.00	3.06
6	600409	三友化工	2,871,249.00	2.94
7	600115	东方航空	2,823,860.00	2.90
8	600519	贵州茅台	2,820,443.00	2.89
9	600061	国投资本	2,676,486.00	2.74
10	600887	伊利股份	2,651,888.00	2.72
11	600000	浦发银行	2,649,432.70	2.72

12	601111	中国国航	2,648,559.53	2.72
13	601601	中国太保	2,647,961.00	2.71
14	300027	华谊兄弟	2,607,580.00	2.67
15	601988	中国银行	2,491,700.50	2.55
16	000338	潍柴动力	2,363,861.00	2.42
17	600030	中信证券	2,288,637.00	2.35
18	600028	中国石化	2,192,206.00	2.25
19	000818	航锦科技	2,189,064.00	2.24
20	000776	广发证券	2,048,393.00	2.10
21	601211	国泰君安	2,012,722.00	2.06

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	4,570,359.36	4.69
2	600029	南方航空	3,336,406.24	3.42
3	601288	农业银行	2,935,608.86	3.01
4	600409	三友化工	2,875,908.00	2.95
5	601006	大秦铁路	2,788,427.24	2.86
6	601111	中国国航	2,744,415.00	2.81
7	600115	东方航空	2,595,591.00	2.66
8	600887	伊利股份	2,544,112.00	2.61
9	600061	国投资本	2,527,518.20	2.59
10	600519	贵州茅台	2,409,899.00	2.47
11	000338	潍柴动力	2,403,339.00	2.46
12	600837	海通证券	2,347,368.80	2.41
13	601601	中国太保	2,281,850.70	2.34
14	601988	中国银行	2,257,563.00	2.31
15	000818	航锦科技	2,251,450.00	2.31
16	600000	浦发银行	1,727,134.00	1.77

17	600026	中远海能	1,692,250.78	1.73
18	600030	中信证券	1,658,335.00	1.70
19	002245	澳洋顺昌	1,654,665.00	1.70
20	600079	人福医药	1,650,011.00	1.69

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	551,519,265.47
卖出股票收入（成交）总额	476,965,581.42

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,107,140.00	8.31
	其中：政策性金融债	5,107,140.00	8.31
4	企业债券	-	-
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	5,107,140.00	8.31

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	140202	14国开02	51,000	5,107,140.0	8.31

				0	
--	--	--	--	---	--

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					116,760.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为目的，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货。



## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资前十名证券的发行主体中，海通证券(600837.SH)的发行主体海通证券股份有限公司，2018年2月7日收到中国证监会安徽监管局行政监管措施决定书(2018)2号《关于对海通证券股份有限公司阜阳清河东路证券营业部采取责令增加内部合规检查次数并提交合规检查报告措施的决定》。行政监管措施决定书主要内容为“海通证券股份有限公司阜阳清河东路证券营业部存在经纪人使用客户交易区电脑代客户交易股票的情况，现责令营业部在2018年2月1日至2019年1月31日期间，每三个月开展一次内部合规检查，并向我局报送经公司合规总监签字确认的合规检查报告”。

报告期内，本基金投资前十名证券的发行主体中，浦发银行(600000.SH)的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司2018年1月19日公告，浦发银行成都分行收到中国银行业监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书，行政处罚的主要内容为“银监会四川监管局对公司成都分行作出行政处罚决定，对成都分行内控管理严重失效，授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，执行罚款46,175万元人民币”。公司坚决支持和接受监管机构的上述处罚决定，并深表歉意。公司高度重视上述事项，在监管机构和地方政府的指导和帮助下，及时调整了成都分行经营班子。上述处罚金额已全额计入2017年度公司损益，对公司的业务开展及持续经营无重大不利影响。

对海通证券与浦发银行投资决策程序的说明：兴业量化精选基金的投资策略为根据多因子模型模型进行投资。该两只证券根据模型选出，基金管理人经过研究判断，按照相关投资决策流程投资了该两只证券。除此以外，本基金投资决策程序也均符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	41,753.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	283,591.08
5	应收申购款	4,190.42

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	329,535.07

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	608,380.00	0.99	重大事项停牌

本基金本报告期末前十名其他股票中不存在流通受限情况。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
3,005	26,990.14	10,000,000.00	12.33%	71,105,362.95	87.67%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	610,532.57	0.7528%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额占基 金总份 额比例	发起份 额总数	发起份 额占基 金总份 额比例	发起份额承诺 持有期限
基金管理 人固有资 金	10,000,000.00	12.33%	10,000,000.00	12.33%	三年
基金管理 人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理 等人员	-	-	-	-	-
基金管理 人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	12.33%	10,000,000.00	12.33%	-

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年12月26日)基金份额总额	97,504,344.03
本报告期期初基金份额总额	97,504,344.03
本报告期基金总申购份额	5,443,044.43
减：本报告期基金总赎回份额	21,842,025.51
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	81,105,362.95

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未产生基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的报酬为3万元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为1年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人和托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	1,028,432,978.05	100.00%	237,881.32	100.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于3 亿元人民币。
- ii 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机构处罚。
- iii 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需  
要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- iv 投研交综合实力较强。
- v 其他因素(综合能力一般，但在某些特色领域或行业，研究能力、深度和质量在行业  
领先)。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③在上述租用的券商交易单元中，本期未新增及剔除券商交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	1,572,200,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴业基金管理有限公司2017年12月31日基金净值(收益)	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-01-02
2	关于不法分子冒用“兴业财	中国证券报、上海证券报、	2018-01-06

	富”发行银行消费卡的澄清公告	证券时报、www.cib-fund.com.cn	
3	关于兴业基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国国际金融股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-01-12
4	郑重声明	中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-01-17
5	兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在华信证券开通基金转换业务并参加转换申购补差费用优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-02-12
6	兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-03-06
7	兴业基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-03-06
8	兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增宜信普泽为代销机构并开通定期定额投资以及参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-04-18
9	兴业基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中兴通讯”股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-04-19
10	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金新增扬州国信嘉利为代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-04-21
11	兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2018	中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-04-23

	年第一季度报告	om. cn	
12	兴业基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中兴通讯”股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.c om. cn	2018-04-24
13	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金产品新增兴业银行钱大掌柜为销售平台的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.c om. cn	2018-05-12
14	关于兴业基金管理有限公司旗下部分基金参加中国银河证券股份有限公司公募基金申购、定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.c om. cn	2018-05-19
15	兴业基金管理有限公司2018年6月29日旗下基金净值(收益)	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.c om. cn	2018-06-30
16	兴业基金管理有限公司2018年6月30日旗下基金净值(收益)	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.c om. cn	2018-06-30
17	兴业基金管理有限公司关于深圳分公司变更营业经营场所的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.c om. cn	2018-07-10
18	兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年第二季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.c om. cn	2018-07-19
19	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金新增代销机构以及参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.c om. cn	2018-07-20
20	兴业基金管理有限公司关于在兴业银行股份有限公司开通旗下部分基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.c om. cn	2018-07-26

21	兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2018年第1号)	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-08-09
22	兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(2018年第1号)	www.cib-fund.com.cn	2018-08-09
23	兴业基金管理有限公司关于太原分公司办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-08-09
24	兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整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、www.cib-fund.com.cn	2018-08-17
25	兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年半年度报告	www.cib-fund.com.cn	2018-08-28
26	兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年半年度报告(摘要)	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2018-08-28
27	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金新增代销机构以及参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-09-18
28	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金新增代销机构以及参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-10-18
29	兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年第三季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-10-24
30	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金新增代销机构	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.com.cn	2018-11-23



	以及参加费率优惠活动的公告	om. cn	
31	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金新增代销机构以及参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.c om. cn	2018-11-27
32	关于暂停兴业基金直销渠道及相关合作渠道服务的通知	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.c om. cn	2018-12-14
33	兴业基金管理有限公司2018年12月28日旗下基金净值（收益）	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.c om. cn	2018-12-29
34	郑重声明	中国证券报、上海证券报、 证券时报、www.cib-fund.c om. cn	2018-12-29

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录.

（一）中国证监会准予兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件

（二）《兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

（三）《兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

（四）法律意见书

(五) 基金管理人业务资格批件和营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件和营业执照

(七) 中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

除上述第(六)项文件存放于基金托管人处外,其他备查文件等文本存放于基金管理人处,投资人在办公时间内可供免费查阅。

### 13.3 查阅方式

网站: <http://www.cib-fund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话: 4000095561

兴业基金管理有限公司  
二〇一九年三月二十八日