

中金量化多策略灵活配置混合型证券投资
基金
2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
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	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	70
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	70

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	70
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	70
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	73
§10 开放式基金份额变动	74
§11 重大事件揭示	75
11.1 基金份额持有人大会决议	75
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	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
11.4 基金投资策略的改变	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8 其他重大事件	78
§12 影响投资者决策的其他重要信息	82
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§13 备查文件目录	85
13.1 备查文件目录	85
13.2 存放地点	85
13.3 查阅方式	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中金量化多策略
基金主代码	003582
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 10 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	156,039,802.60 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在严格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	本基金的量化选股模型在注重基本面研究的同时，结合多种统计量化策略,主要包括多因子模型和统计套利模型等多种量化策略。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，力争基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型证券投资基金，高于债券型证券投资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		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	田青
	联系电话	010-63211122	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	tianqing1.zh@ccb.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		北京市朝阳区建国门外大	北京市西城区闹市口大街 1 号

	街 1 号国贸大厦 B 座 43 层	院 1 号楼
邮政编码	100004	100033
法定代表人	孙菁（代）	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年 11 月 10 日 (基金合同生效 日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-18,430,513.73	3,310,624.90	1,140,273.92
本期利润	-29,192,413.53	8,607,159.68	-1,003,458.72
加权平均基金份额本期利润	-0.2230	0.0455	-0.0050
本期加权平均净值利润率	-23.53%	4.54%	-0.50%
本期基金份额净值增长率	-21.22%	4.22%	-0.50%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-28,543,525.69	4,022,470.95	-1,003,454.22
期末可供分配基金份额利润	-0.1829	0.0309	-0.0050
期末基金资产净值	127,496,276.91	134,879,796.72	199,103,558.07
期末基金份额净值	0.817	1.037	0.995
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-18.30%	3.70%	-0.50%

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

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数；

4、本基金合同于 2016 年 11 月 10 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

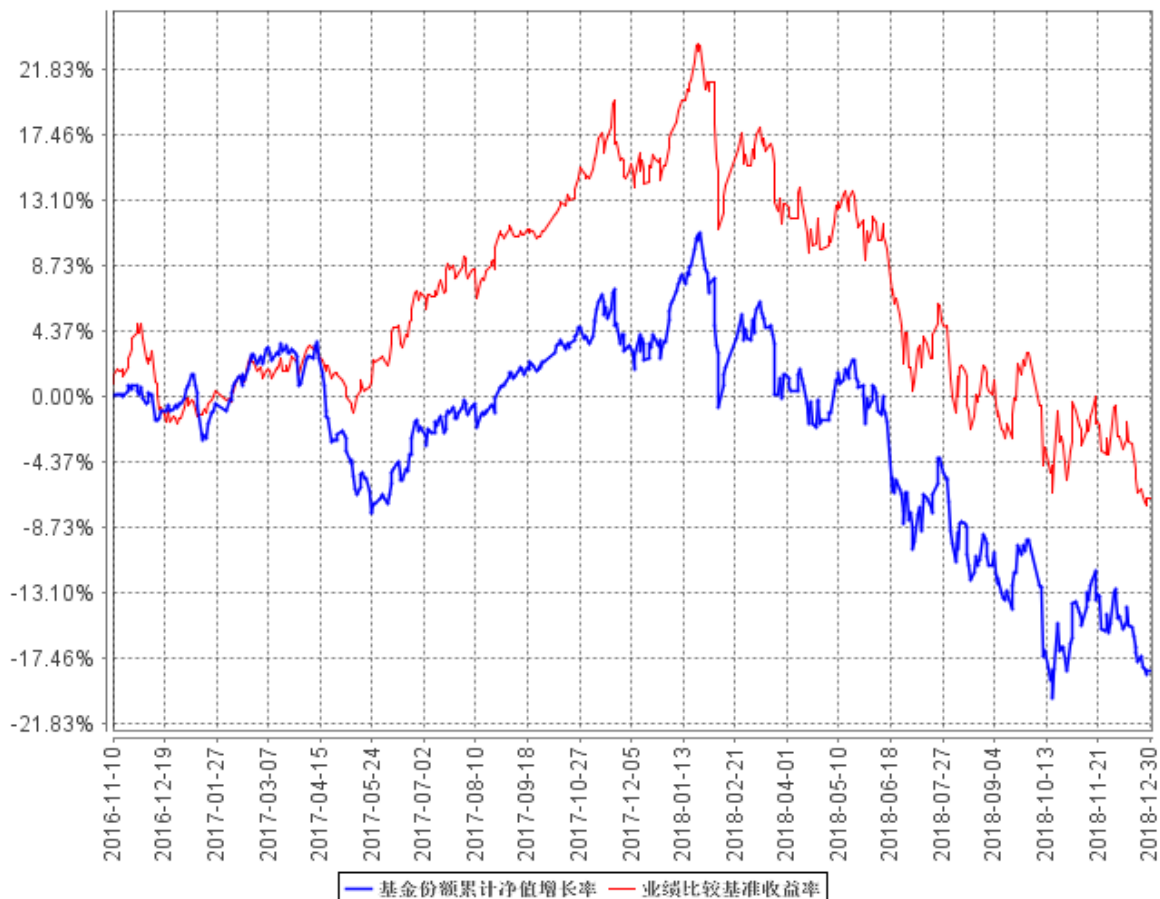
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-9.62%	1.44%	-9.45%	1.31%	-0.17%	0.13%
过去六个月	-12.71%	1.27%	-10.62%	1.20%	-2.09%	0.07%
过去一年	-21.22%	1.16%	-19.17%	1.07%	-2.05%	0.09%

自基金合同生效起至今	-18.30%	0.89%	-6.74%	0.83%	-11.56%	0.06%
------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

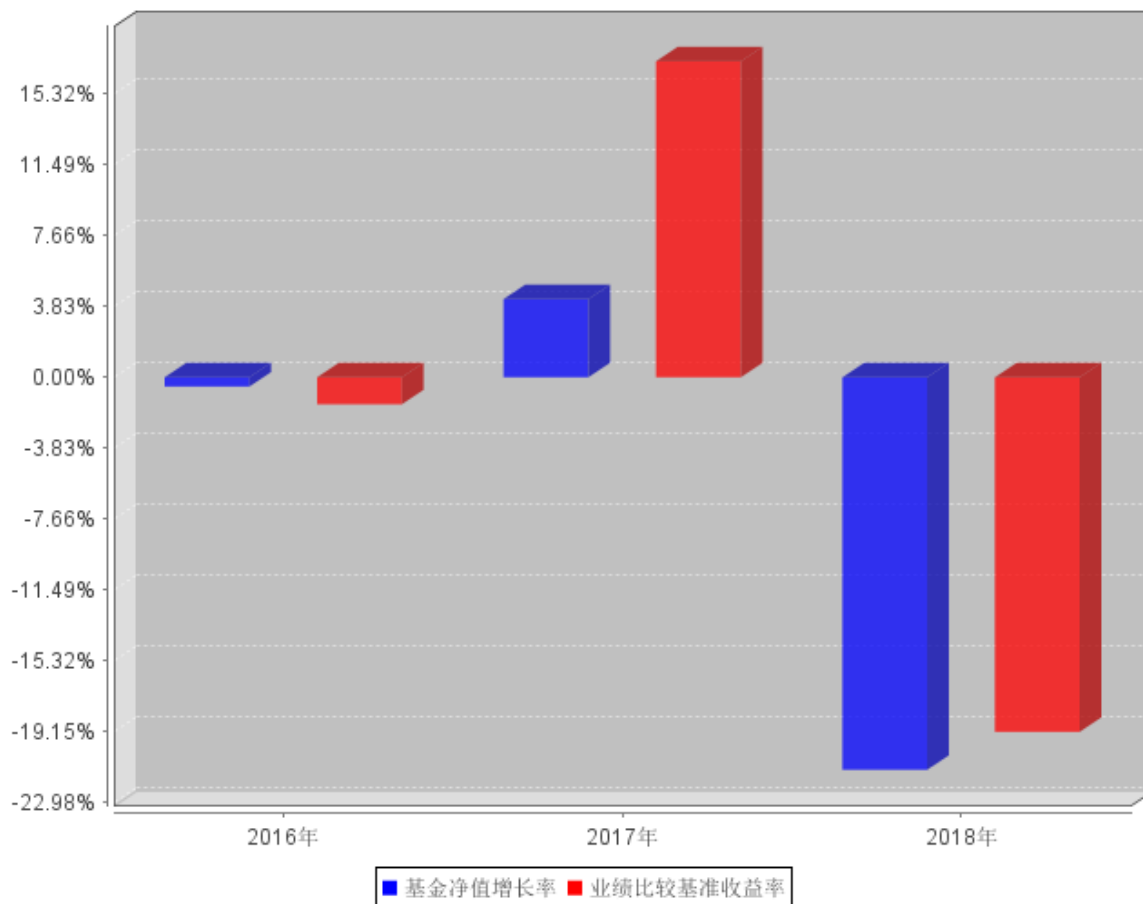
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2016 年 11 月 10 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，自成立以来本基金未进行收益分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家单一股东发起设立的基金公司，注册资本 3.5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2018 年 12 月 31 日，公司共管理 27 只开放式基金，证券投资基金管理规模 153.48 亿。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘重晋	本基金基金经理	2017 年 8 月 2 日	-	7 年	刘重晋先生，理学博士。历任松河投资咨询（深圳）有限公司副总经理、量化研究员。2017 年 4 月加入公司，现任公司量化公募投资部基金经理。
石玉	本基金的基金经理	2017 年 3 月 29 日	-	11 年	石玉女士，管理学硕士。历任中国科技证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司职员，天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员，中金公司资产管理部高级研究员、投资经理助理、投资经理。2016 年 7 月加入公司，现任公司投资管理部基金经理。
闫雯雯	本基金基金经理助理	2017 年 8 月 24 日	-	10 年	闫雯雯女士，工商管理硕士。曾任泰康资产管理有限公司国际投资

					部、信用评估部研究员，现任中金基金管理有限公司固定收益研究主管。
魏宇	本基金的基金经理	2017 年 3 月 28 日	-	8 年	魏宇先生，统计学博士，2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发。2014 年 11 月加入公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任公司量化公募投资部基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《中金基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施效果评估、信息披露与报告制度等多方面进行了规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，公司建立了科学合理的投资运作体系和规范的投资流程，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公

司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年中国宏观经济具有较大的不确定性，中美贸易战、降杠杆、资管新规等对 A 股市场造成一定的影响。全年 A 股市场整体具有较大的下跌，沪深 300 指数全年由 4045 点下跌到 3010 点，下跌 25.31%，中证 500 指数由 6263 点下跌到 4168 点下跌幅度 33.32%。

本基金股票部分采用量化选股的投资策略，在不同的维度上进行投资组合的构建，利用基本面指标、技术面指标及情绪面指标等综合确定组合权重。同时合理配置沪深两市的股票仓位进行股票打新，增厚收益。接下来，我们会密切监控市场变化以及策略表现，积极应对，在控制风险的同时尽可能获得更好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.817 元；本报告期基金份额净值增长率为-21.22%，业绩比较基准收益率为-19.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过 2018 年的较大下跌,A 股市场的估值已经达到较低水平, 2018 年底沪深 300 的市盈率为 10.23, 市净率为 1.26, 中证 500 指数的市盈率为 16.24, 市净率为 1.55, 都基本处于历史上较低的水平, 继续大幅下跌的空间有限。

随着 18 年下半年及 2019 年, 贸易战的缓和, 货币政策的调整, 减税等政策的逐步落地, 有望对 A 股市场起到支撑作用, 但是预期不会有大幅的货币宽松或盈利的快速上涨, 所以大幅上涨的动力不足, 较大概率呈现企稳并逐步回升的态势。

2019 年随着内外部市场环境的变化, 及各项政策的执行与落地, 对不同的行业及板块或带来

结构性机会。如个税调整的落实，或为大众消费品行业带来机会；落实民营企业和小微企业融资服务，或为前期被错杀的优质民营及小微企业带来机会；随着保险资金，A 股纳入 MSCI 带来的外资等进入 A 股，这类资金普遍青睐增长稳定，现金流好，竞争力强的行业龙头股票。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作，强化制度完善及对制度执行情况的监督检查，根据不同的基金特点与发展情况，及时界定新的风险点，评价风险级别，并纳入稽核计划，有效保证了基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1) 本基金管理人以中国证监会《季度监察稽核项目表》为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，及定期进行有重点的检查。2) 研究、投资交易环节，本基金管理人对投资对象建立筛选流程、对投资对象池（库）进行日常维护与更新，并对基金的投资比例进行日常监控，对关联交易进行日常维护，定期关注基金持仓流动性风险，并对公平交易执行情况进行检查等。3) 营销与销售方面，本基金管理人对本基金宣传推介材料、销售服务协议的合规性等进行检查，同时加强对基金销售部门的合规培训。4) 基金运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、资金清算业务的检查力度，保证基金运营安全、准确。5) 法律合规方面，本基金管理人对公司制度规范、合同协议、产品方案、对外文件等进行合规性审核。6) 信息披露方面，本基金管理人严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露内容的真实、准确、完整、及时。此外，本基金管理人对监察稽核工作流程进行了完善和优化，并按照既定的稽核计划开展内部稽核，对检查出来的问题及时提出改进意见并督促相关部门有效落实。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高监察稽核工作的有效性。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 托管人对本年度报告中财务信息等信息的真实、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1901213 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的第 1 页至第 35 页的中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“中金量化多策略基金”）财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了中金量化多策略基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中金量化多策略基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	中金量化多策略基金管理人中金基金管理有限公司管理层对

	<p>其他信息负责。其他信息包括中金量化多策略基金 2018 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中金量化多策略基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，中金量化多策略基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责评估中金量化多策略基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非中金量化多策略基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>中金量化多策略基金管理人中金基金管理有限公司治理层负责监督中金量化多策略基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，</p>

并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(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)评价中金量化多策略基金管理人中金基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4)对中金量化多策略基金管理人中金基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中金量化多策略基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中金量化多策略基金不能持续经营。

(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。我们与中金量化多策略基金管理人中金基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	奚霞	刘珊珊
会计师事务所的地址	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2019年3月27日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	768,585.69	270,702.03
结算备付金		5,868,217.35	1,351,204.10
存出保证金		13,262.41	15,637.15
交易性金融资产	7.4.7.2	121,262,354.21	128,368,601.63
其中：股票投资		114,432,434.21	121,264,401.63
基金投资		-	-
债券投资		6,829,920.00	7,104,200.00
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	-	5,500,000.00
应收证券清算款		141,661.24	1,366,632.07
应收利息	7.4.7.5	190,739.79	169,787.92
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		128,244,820.69	137,042,564.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		96,640.25	1,597,299.32
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		149,871.92	171,083.72
应付托管费		24,978.66	28,513.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	347,052.95	225,871.17
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	130,000.00	140,000.00
负债合计		748,543.78	2,162,768.18
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	156,039,802.60	130,075,227.36
未分配利润	7.4.7.10	-28,543,525.69	4,804,569.36
所有者权益合计		127,496,276.91	134,879,796.72
负债和所有者权益总计		128,244,820.69	137,042,564.90

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.817 元，基金份额总额 156,039,802.60 份。

7.2 利润表

会计主体：中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-25,022,182.97	14,506,584.31
1.利息收入		440,452.19	2,093,366.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	24,588.71	128,092.38
债券利息收入		327,929.56	1,373,163.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		87,933.92	592,110.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-14,700,748.41	7,025,629.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-16,701,305.34	4,636,401.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-3,208.33	39,704.81
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,003,765.26	2,349,523.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-10,761,899.80	5,296,534.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	13.05	91,053.14
减：二、费用		4,170,230.56	5,899,424.63
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,862,256.81	2,850,868.09

2. 托管费	7.4.10.2.2	310,376.10	475,144.68
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,818,831.66	2,368,183.25
5. 利息支出		4,842.24	-
其中：卖出回购金融资产支出		4,842.24	-
6. 税金及附加		324.40	-
7. 其他费用	7.4.7.20	173,599.35	205,228.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-29,192,413.53	8,607,159.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-29,192,413.53	8,607,159.68

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 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）	130,075,227.36	4,804,569.36	134,879,796.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-29,192,413.53	-29,192,413.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	25,964,575.24	-4,155,681.52	21,808,893.72
其中：1.基金申购款	25,976,534.99	-4,155,645.94	21,820,889.05
2.基金赎回款	-11,959.75	-35.58	-11,995.33
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）	156,039,802.60	-28,543,525.69	127,496,276.91
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 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）	200,107,012.29	-1,003,454.22	199,103,558.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,607,159.68	8,607,159.68
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）	-70,031,784.93	-2,799,136.10	-72,830,921.03
其中：1.基金申购款	5,757.27	16.63	5,773.90
2.基金赎回款	-70,037,542.20	-2,799,152.73	-72,836,694.93
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）	130,075,227.36	4,804,569.36	134,879,796.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

孙菁

基金管理人负责人

张纳

主管会计工作负责人

白娜

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2016 年 6 月 24 日证监许可 [2016] 1415 号《关于准予中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式混合型证券投资基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国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中心、中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）、中国中投证券有限责任公司（“中投证券”）及北京肯特瑞财富投资管理有限公司等共同销售，募集期为

2016 年 11 月 2 日起至 2016 年 11 月 7 日止。经向中国证监会备案,《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 10 日正式生效,合同生效日基金实收份额为 200,107,412.33 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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同和《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转换债券)、次级债、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、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、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

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

(2) 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

(3) 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

(1) 所转移金融资产的账面价值；

(2) 因转移而收到的对价。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 / (未弥补亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税 (如适用) 后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税 (如适用) 后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益 / (损失) 核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告 [2017] 13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发 [2017] 6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本期未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

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

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称“管理人”）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(3)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，

暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。

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

(6)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7)对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率，计算缴纳城市维护建设税。

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	768,585.69	270,702.03
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：	768,585.69	270,702.03

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	122,025,171.87	114,432,434.21	-7,592,737.66
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,846,280.00	6,829,920.00
	银行间市场	-	-

	合计	6,846,280.00	6,829,920.00	-16,360.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		128,871,451.87	121,262,354.21	-7,609,097.66
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		118,114,439.77	121,264,401.63	3,149,961.86
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	7,101,359.72	7,104,200.00	2,840.28
	银行间市场	-	-	-
	合计	7,101,359.72	7,104,200.00	2,840.28
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		125,215,799.49	128,368,601.63	3,152,802.14

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,500,000.00	-

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	164.24	160.19
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	429.77	668.80
应收债券利息	190,139.18	170,714.23
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-1,763.00
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	6.60	7.70
合计	190,739.79	169,787.92

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	347,052.95	225,271.44
银行间市场应付交易费用	-	599.73
合计	347,052.95	225,871.17

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	-	-
预提费用	130,000.00	140,000.00
合计	130,000.00	140,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	130,075,227.36	130,075,227.36
本期申购	25,976,534.99	25,976,534.99
本期赎回（以“-”号填列）	-11,959.75	-11,959.75
- 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	156,039,802.60	156,039,802.60

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,022,470.95	782,098.41	4,804,569.36
本期利润	-18,430,513.73	-10,761,899.80	-29,192,413.53
本期基金份额交易产生的变动数	-2,733,176.98	-1,422,504.54	-4,155,681.52
其中：基金申购款	-2,732,792.89	-1,422,853.05	-4,155,645.94
基金赎回款	-384.09	348.51	-35.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,141,219.76	-11,402,305.93	-28,543,525.69

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	9,996.97	83,853.68
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	14,249.52	43,710.29
其他	342.22	528.41

合计	24,588.71	128,092.38
----	-----------	------------

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
卖出股票成交总额	683,187,507.72	884,919,944.78
减：卖出股票成本总额	699,888,813.06	880,283,542.92
买卖股票差价收入	-16,701,305.34	4,636,401.86

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,208.33	39,704.81
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	-3,208.33	39,704.81

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	18,417,486.11	85,873,335.13
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	17,776,382.77	83,605,210.12
减：应收利息总额	644,311.67	2,228,420.20
买卖债券差价收入	-3,208.33	39,704.81

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无其他衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,003,765.26	2,349,523.19
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,003,765.26	2,349,523.19

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
1.交易性金融资产	-10,761,899.80	5,296,534.78
——股票投资	-10,742,699.52	5,293,694.50
——债券投资	-19,200.28	2,840.28
——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	-10,761,899.80	5,296,534.78

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	12.27	91,050.71
转换费收入	0.78	2.43
合计	13.05	91,053.14

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	1,818,831.66	2,366,608.25
银行间市场交易费用	-	1,575.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,818,831.66	2,368,183.25

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
审计费用	40,000.00	80,000.00
信息披露费	90,000.00	90,000.00
帐户维护费	37,200.00	21,960.00
汇划手续费	6,399.35	12,868.61
其他	-	400.00
合计	173,599.35	205,228.61

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中金基金管理有限公司(“中金基金”)	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
中国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,基金销售机构
中金资本运营有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金浦成投资有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金期货有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中国国际金融(香港)有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司

注：1、本基金本报告期关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
中金公司	-	-	213,503,251.36	11.82%
中投证券	190,009,900.15	13.72%	263,685,528.49	14.60%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
-------	-----------------------------	----------------------------------

	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 成交总额的比 例
中金公司	-	-	10,991.20	0.04%
中投证券	6,545,500.00	36.83%	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
中金公司	-	-	840,200,000.00	30.16%
中投证券	54,000,000.00	8.43%	82,500,000.00	2.96%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期与上年度可比期间未通过关联方的交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
中投证券	138,928.31	13.72%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
中金公司	156,134.80	11.82%	-	-
中投证券	192,833.48	14.60%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还获得证券研究综合服务。

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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,862,256.81	2,850,868.09
其中：支付销售机构的客户维护费	18.54	0.40

注：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 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	310,376.10	475,144.68

注：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。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期与上年度可比期间无销售服务费。

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

本基金本报告期与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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本年末及上期末未持有本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1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
建设银行	768,585.69	9,996.97	270,702.03	83,853.68

注：本基金通过“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 12 月 31 日的相关余额为人民币 881,479.76 元（2017 年 12 月 31 日：人民币 1,366,841.25 元），当年产生的利息收入为人民币 14,591.74 元（自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日止期间：人民币 44,238.70 元）。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018年12月31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	1,000	13,770.00

注：本基金在上年度可比期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

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**

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金因认购新发或增发证券而持有的流通受限股票列示如下：

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018年12月25日	重大事项停牌	16.01	2019年1月10日	17.15	30,020	520,364.41	480,620.20	-
000708	大冶特钢	2018年12月25日	重大事项停牌	8.77	2019年1月3日	9.65	36,100	338,360.86	316,597.00	-
002323	*ST百特	2018年8月17日	重大事项停牌	1.31	-	-	1,900	10,418.60	2,489.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有因银行间债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有因交易所债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型证券投资基金，高于债券型证券投资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、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险

限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制在合理水平，保障业务稳健运行。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资（上年度末：同）。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	60,300.00
AAA 以下	-	59,300.00

未评级	-	-
合计	-	119,600.00

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，针对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性风险预警及危机的处理、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性风险指标进行监控。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在行业 and 个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	768,585.69	-	-	-	768,585.69
结算备付金	5,868,217.35	-	-	-	5,868,217.35
存出保证金	13,262.41	-	-	-	13,262.41
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	114,432,434.21	114,432,434.21
交易性金融资产-债券投资	6,829,920.00	-	-	-	6,829,920.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	141,661.24	141,661.24
应收利息	-	-	-	190,739.79	190,739.79
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	13,479,985.45	-	-	114,764,835.24	128,244,820.69
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	96,640.25	96,640.25
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	149,871.92	149,871.92
应付托管费	-	-	-	24,978.66	24,978.66
应付交易费用	-	-	-	347,052.95	347,052.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	-	-	-	748,543.78	748,543.78
利率敏感度缺口	13,479,985.45	-	-	114,016,291.46	127,496,276.91
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	270,702.03	-	-	-	270,702.03
结算备付金	1,351,204.10	-	-	-	1,351,204.10
存出保证金	15,637.15	-	-	-	15,637.15
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	121,264,401.63	121,264,401.63
交易性金融资产-债券投资	6,984,600.00	400.00	119,200.00	-	7,104,200.00
买入返售金融资产	5,500,000.00	-	-	-	5,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,366,632.07	1,366,632.07
应收利息	-	-	-	169,787.92	169,787.92
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	14,122,143.28	400.00	119,200.00	122,800,821.62	137,042,564.90
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,597,299.32	1,597,299.32
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	171,083.72	171,083.72
应付托管费	-	-	-	28,513.97	28,513.97
应付交易费用	-	-	-	225,871.17	225,871.17
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	-	-	-	2,162,768.18	2,162,768.18
利率敏感度缺口	14,122,143.28	400.00	119,200.00	120,638,053.44	134,879,796.72

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	4,461.65	5,105.74
市场利率上升 25 个基点	-4,461.65	-5,105.74	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金部分投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		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	114,432,434.21	89.75	121,264,401.63	89.91
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	6,829,920.00	5.36	7,104,200.00	5.27
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	121,262,354.21	95.11	128,368,601.63	95.17

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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）
	业绩比较基准上升5%	6,685,268.39	6,204,376.38
	业绩比较基准下降5%	-6,685,268.39	-6,204,376.38

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)以公允价值计量的金融工具

(a)以公允价值计量的资产和负债

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

持续的公允价值计量资产	本期末（错误!未找到引用源。12月31日）			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产				
-股票投资	114,432,434.21	113,582,582.21	799,706.20	50,145.80
-债券投资	6,829,920.00	-	6,829,920.00	-
-基金投资	-	-	-	-
-资产支持证券投资	-	-	-	-
持续以公允价值计量的资产总额	121,262,354.21	113,582,582.21	7,629,626.20	50,145.80

持续的公允价值计量资产	上年度末（错误!未找到引用源。12月31日）			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产				
-股票投资	121,264,401.63	117,784,622.11	3,442,883.07	36,896.45
-债券投资	7,104,200.00	-	6,984,600.00	119,600.00

- 基金投资	-	-	-	-
-资产支持证券投资	-	-	-	-
持续以公允价值计量的资产总额	128,368,601.63	117,784,622.11	10,427,483.07	156,496.45

注：于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次，账面价值为人民币 849,852.00 元 (2017 年 12 月 31 日：人民币 3,599,379.52 元)。于 2018 年 12 月 31 日及 2017 年 12 月 31 日，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的三个层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b)第二层次及第三层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃 (包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2017 年 12 月 31 日：无)。

(2)其他金融工具的公允价值 (期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	114,432,434.21	89.23
	其中：股票	114,432,434.21	89.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,829,920.00	5.33
	其中：债券	6,829,920.00	5.33
	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	6,636,803.04	5.18
8	其他各项资产	345,663.44	0.27
9	合计	128,244,820.69	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	260,878.00	0.20
B	采矿业	4,524,144.94	3.55
C	制造业	55,578,480.90	43.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,169,434.65	3.27
E	建筑业	1,667,042.85	1.31
F	批发和零售业	4,812,482.89	3.77
G	交通运输、仓储和邮政业	4,265,124.69	3.35
H	住宿和餐饮业	135,622.10	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,902,009.79	1.49
J	金融业	25,402,361.78	19.92
K	房地产业	7,950,747.30	6.24
L	租赁和商务服务业	1,590,877.60	1.25
M	科学研究和技术服务业	320,834.00	0.25

N	水利、环境和公共设施管理业	906,908.43	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,920.00	0.00
Q	卫生和社会工作	3,034.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	830,069.29	0.65
S	综合	109,461.00	0.09
	合计	114,432,434.21	89.75

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票资产。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	81,430	4,568,223.00	3.58
2	000651	格力电器	98,850	3,527,956.50	2.77
3	601166	兴业银行	184,700	2,759,418.00	2.16
4	600016	民生银行	434,903	2,491,994.19	1.95
5	600585	海螺水泥	69,000	2,020,320.00	1.58
6	601328	交通银行	307,450	1,780,135.50	1.40
7	600028	中国石化	314,000	1,585,700.00	1.24
8	000069	华侨城 A	246,740	1,566,799.00	1.23
9	600031	三一重工	183,690	1,531,974.60	1.20
10	600383	金地集团	153,670	1,478,305.40	1.16
11	601818	光大银行	391,203	1,447,451.10	1.14
12	601006	大秦铁路	167,700	1,380,171.00	1.08
13	601169	北京银行	220,280	1,235,770.80	0.97
14	600019	宝钢股份	185,640	1,206,660.00	0.95
15	600887	伊利股份	52,643	1,204,471.84	0.94
16	600104	上汽集团	44,184	1,178,387.28	0.92
17	601009	南京银行	177,575	1,147,134.50	0.90
18	000898	鞍钢股份	203,790	1,045,442.70	0.82
19	600000	浦发银行	104,357	1,022,698.60	0.80
20	600015	华夏银行	132,360	978,140.40	0.77
21	600352	浙江龙盛	100,931	973,984.15	0.76
22	000858	五粮液	18,160	923,980.80	0.72
23	601229	上海银行	78,232	875,416.08	0.69

24	000157	中联重科	230,310	819,903.60	0.64
25	601601	中国太保	28,583	812,614.69	0.64
26	000568	泸州老窖	19,368	787,502.88	0.62
27	600886	国投电力	92,729	746,468.45	0.59
28	600919	江苏银行	119,900	715,803.00	0.56
29	601888	中国国旅	11,820	711,564.00	0.56
30	600795	国电电力	271,400	694,784.00	0.54
31	601211	国泰君安	44,900	687,868.00	0.54
32	002304	洋河股份	7,103	672,796.16	0.53
33	600153	建发股份	86,416	609,232.80	0.48
34	000415	渤海租赁	164,800	593,280.00	0.47
35	002081	金螳螂	72,900	590,490.00	0.46
36	601607	上海医药	34,710	590,070.00	0.46
37	600837	海通证券	64,230	565,224.00	0.44
38	600741	华域汽车	29,131	536,010.40	0.42
39	600900	长江电力	32,900	522,452.00	0.41
40	600219	南山铝业	245,985	519,028.35	0.41
41	002422	科伦药业	24,700	510,055.00	0.40
42	601678	滨化股份	120,333	507,805.26	0.40
43	600030	中信证券	30,020	480,620.20	0.38
44	600690	青岛海尔	34,100	472,285.00	0.37
45	601997	贵阳银行	43,286	462,294.48	0.36
46	000100	TCL 集团	183,800	450,310.00	0.35
47	002004	华邦健康	97,224	448,202.64	0.35
48	000778	新兴铸管	99,700	429,707.00	0.34
49	600276	恒瑞医药	8,111	427,855.25	0.34
50	600674	川投能源	47,900	415,293.00	0.33
51	600637	东方明珠	39,760	407,142.40	0.32
52	000425	徐工机械	125,000	403,750.00	0.32
53	600170	上海建工	131,884	399,608.52	0.31
54	600089	特变电工	56,032	380,457.28	0.30
55	002233	塔牌集团	36,800	370,208.00	0.29
56	000876	新希望	50,464	367,377.92	0.29
57	600566	济川药业	10,600	355,418.00	0.28
58	000036	华联控股	64,300	354,293.00	0.28
59	002394	联发股份	35,120	354,009.60	0.28
60	600308	华泰股份	81,100	352,785.00	0.28
61	002146	荣盛发展	44,310	352,264.50	0.28
62	600739	辽宁成大	33,300	348,318.00	0.27

63	000001	平安银行	36,700	344,246.00	0.27
64	600048	保利地产	29,100	343,089.00	0.27
65	600668	尖峰集团	28,900	341,020.00	0.27
66	603225	新凤鸣	18,077	338,943.75	0.27
67	603858	步长制药	13,360	337,740.80	0.26
68	000900	现代投资	83,500	324,815.00	0.25
69	603980	吉华集团	27,000	317,790.00	0.25
70	000708	大冶特钢	36,100	316,597.00	0.25
71	002087	新野纺织	89,400	315,582.00	0.25
72	000965	天保基建	81,700	314,545.00	0.25
73	600382	广东明珠	40,100	309,572.00	0.24
74	600035	楚天高速	104,300	307,685.00	0.24
75	601588	北辰实业	113,500	307,585.00	0.24
76	600067	冠城大通	82,600	307,272.00	0.24
77	002398	建研集团	68,200	306,218.00	0.24
78	002391	长青股份	29,000	305,950.00	0.24
79	601717	郑煤机	55,150	304,979.50	0.24
80	300121	阳谷华泰	35,610	304,109.40	0.24
81	000672	上峰水泥	36,000	303,840.00	0.24
82	600873	梅花生物	71,300	300,886.00	0.24
83	002091	江苏国泰	52,100	291,760.00	0.23
84	000620	新华联	74,200	290,122.00	0.23
85	600535	天士力	15,100	289,920.00	0.23
86	000776	广发证券	22,700	287,836.00	0.23
87	000709	河钢股份	101,200	287,408.00	0.23
88	601001	大同煤业	66,200	282,674.00	0.22
89	000789	万年青	25,900	282,051.00	0.22
90	000828	东莞控股	37,600	280,872.00	0.22
91	600580	卧龙电驱	43,989	277,130.70	0.22
92	601857	中国石油	37,400	269,654.00	0.21
93	601225	陕西煤业	35,940	267,393.60	0.21
94	000423	东阿阿胶	6,720	265,776.00	0.21
95	002083	孚日股份	53,800	265,234.00	0.21
96	600173	卧龙地产	69,700	262,769.00	0.21
97	002685	华东重机	53,300	262,236.00	0.21
98	000791	甘肃电投	51,700	261,602.00	0.21
99	002294	信立泰	12,310	257,155.90	0.20
100	603766	隆鑫通用	62,822	256,941.98	0.20
101	601126	四方股份	50,100	255,009.00	0.20

102	300082	奥克股份	42,500	255,000.00	0.20
103	002142	宁波银行	15,562	252,415.64	0.20
104	002048	宁波华翔	24,200	252,406.00	0.20
105	600022	山东钢铁	159,300	250,101.00	0.20
106	002092	中泰化学	35,286	248,766.30	0.20
107	600782	新钢股份	48,700	247,883.00	0.19
108	600023	浙能电力	52,330	247,520.90	0.19
109	600808	马钢股份	71,299	246,694.54	0.19
110	002456	欧菲科技	26,800	246,292.00	0.19
111	603669	灵康药业	24,700	244,530.00	0.19
112	601988	中国银行	67,100	242,231.00	0.19
113	600033	福建高速	79,700	236,709.00	0.19
114	002640	跨境通	21,600	233,280.00	0.18
115	600606	绿地控股	38,140	233,035.40	0.18
116	600611	大众交通	58,275	232,517.25	0.18
117	002435	长江润发	43,400	229,586.00	0.18
118	600115	东方航空	48,300	229,425.00	0.18
119	603968	醋化股份	17,900	226,256.00	0.18
120	000625	长安汽车	34,080	224,587.20	0.18
121	000598	兴蓉环境	55,600	224,068.00	0.18
122	002099	海翔药业	49,500	223,740.00	0.18
123	600068	葛洲坝	35,400	223,728.00	0.18
124	600596	新安股份	20,900	223,421.00	0.18
125	600252	中恒集团	86,900	223,333.00	0.18
126	002392	北京利尔	69,700	223,040.00	0.17
127	600337	美克家居	56,400	222,780.00	0.17
128	002128	露天煤业	31,059	222,382.44	0.17
129	600295	鄂尔多斯	29,600	222,000.00	0.17
130	600123	兰花科创	34,000	221,680.00	0.17
131	600987	航民股份	27,100	221,678.00	0.17
132	002478	常宝股份	48,100	221,260.00	0.17
133	000301	东方盛虹	40,500	221,130.00	0.17
134	603113	金能科技	19,900	218,303.00	0.17
135	603599	广信股份	20,700	217,350.00	0.17
136	600660	福耀玻璃	9,500	216,410.00	0.17
137	002572	索菲亚	12,820	214,735.00	0.17
138	600160	巨化股份	32,290	214,082.70	0.17
139	603808	歌力思	12,900	209,496.00	0.16
140	300338	开元股份	30,300	209,373.00	0.16

141	601677	明泰铝业	23,700	208,323.00	0.16
142	600332	白云山	5,801	207,443.76	0.16
143	002555	三七互娱	21,900	206,736.00	0.16
144	002589	瑞康医药	29,610	206,381.70	0.16
145	002314	南山控股	71,700	205,779.00	0.16
146	601688	华泰证券	12,700	205,740.00	0.16
147	600522	中天科技	24,864	202,641.60	0.16
148	600997	开滦股份	35,400	200,718.00	0.16
149	000731	四川美丰	39,700	199,294.00	0.16
150	002541	鸿路钢构	28,200	197,964.00	0.16
151	300088	长信科技	47,700	197,955.00	0.16
152	601899	紫金矿业	59,100	197,394.00	0.15
153	002088	鲁阳节能	23,000	194,810.00	0.15
154	601828	美凯龙	17,600	194,304.00	0.15
155	603855	华荣股份	24,600	193,848.00	0.15
156	300276	三丰智能	18,800	193,828.00	0.15
157	600195	中牧股份	18,184	193,477.76	0.15
158	600469	风神股份	54,783	193,383.99	0.15
159	603869	新智认知	12,800	192,512.00	0.15
160	601101	昊华能源	31,900	191,719.00	0.15
161	600487	亨通光电	11,200	190,960.00	0.15
162	600926	杭州银行	25,524	188,877.60	0.15
163	000726	鲁泰 A	19,400	188,374.00	0.15
164	002322	理工环科	20,700	187,956.00	0.15
165	601233	桐昆股份	19,006	185,498.56	0.15
166	600515	海航基础	39,300	185,103.00	0.15
167	002024	苏宁易购	18,700	184,195.00	0.14
168	600348	阳泉煤业	36,400	183,456.00	0.14
169	600985	淮北矿业	19,600	182,280.00	0.14
170	600282	南钢股份	53,220	182,012.40	0.14
171	000826	启迪桑德	17,270	179,435.30	0.14
172	300217	东方电热	76,000	177,080.00	0.14
173	002833	弘亚数控	5,200	176,800.00	0.14
174	601088	中国神华	9,800	176,008.00	0.14
175	000661	长春高新	1,000	175,000.00	0.14
176	600657	信达地产	44,100	173,313.00	0.14
177	600977	中国电影	12,000	171,840.00	0.13
178	300437	清水源	14,700	171,696.00	0.13
179	603609	禾丰牧业	22,100	171,275.00	0.13

180	603385	惠达卫浴	21,300	170,613.00	0.13
181	000983	西山煤电	31,000	170,190.00	0.13
182	000552	靖远煤电	66,370	169,907.20	0.13
183	600743	华远地产	70,200	169,884.00	0.13
184	600097	开创国际	16,500	169,785.00	0.13
185	600792	云煤能源	63,000	168,840.00	0.13
186	000413	东旭光电	37,200	167,400.00	0.13
187	600694	大商股份	6,900	166,911.00	0.13
188	300485	赛升药业	16,900	165,789.00	0.13
189	002202	金风科技	16,400	163,836.00	0.13
190	000703	恒逸石化	14,100	162,432.00	0.13
191	600017	日照港	58,809	162,312.84	0.13
192	600704	物产中大	35,100	160,758.00	0.13
193	002444	巨星科技	16,900	160,212.00	0.13
194	002728	特一药业	12,100	158,752.00	0.12
195	601016	节能风电	67,100	155,672.00	0.12
196	000895	双汇发展	6,564	154,844.76	0.12
197	000630	铜陵有色	78,300	154,251.00	0.12
198	600518	康美药业	16,700	153,807.00	0.12
199	601618	中国中冶	49,323	153,394.53	0.12
200	300107	建新股份	16,100	151,823.00	0.12
201	000888	峨眉山 A	26,700	151,122.00	0.12
202	300089	文化长城	28,300	150,273.00	0.12
203	000892	欢瑞世纪	31,500	149,940.00	0.12
204	600999	招商证券	11,118	148,981.20	0.12
205	002150	通润装备	24,000	148,800.00	0.12
206	000877	天山股份	20,900	148,599.00	0.12
207	600449	宁夏建材	20,100	148,137.00	0.12
208	000538	云南白药	2,000	147,920.00	0.12
209	600356	恒丰纸业	26,900	147,681.00	0.12
210	600177	雅戈尔	20,460	147,107.40	0.12
211	600618	氯碱化工	22,637	146,914.13	0.12
212	600705	中航资本	34,600	146,704.00	0.12
213	601018	宁波港	43,900	146,626.00	0.12
214	603898	好莱客	9,500	145,635.00	0.11
215	000059	华锦股份	24,300	144,342.00	0.11
216	600261	阳光照明	42,200	143,902.00	0.11
217	600221	海航控股	76,500	143,820.00	0.11
218	000961	中南建设	25,500	143,055.00	0.11

219	002753	永东股份	15,800	142,516.00	0.11
220	601985	中国核电	26,600	140,182.00	0.11
221	300219	鸿利智汇	18,000	137,880.00	0.11
222	600395	盘江股份	27,300	136,773.00	0.11
223	002641	永高股份	41,700	135,942.00	0.11
224	002068	黑猫股份	22,900	135,110.00	0.11
225	002449	国星光电	13,000	134,940.00	0.11
226	600513	联环药业	22,300	132,685.00	0.10
227	002406	远东传动	24,500	129,605.00	0.10
228	601005	重庆钢铁	65,900	127,846.00	0.10
229	600307	酒钢宏兴	66,200	126,442.00	0.10
230	600297	广汇汽车	30,700	124,642.00	0.10
231	600269	赣粤高速	31,800	124,020.00	0.10
232	600623	华谊集团	15,330	123,866.40	0.10
233	002648	卫星石化	12,800	123,776.00	0.10
234	600811	东方集团	33,700	123,342.00	0.10
235	300233	金城医药	9,000	122,850.00	0.10
236	600546	山煤国际	36,500	121,180.00	0.10
237	601111	中国国航	15,800	120,712.00	0.09
238	601555	东吴证券	17,800	119,260.00	0.09
239	603886	元祖股份	6,800	119,000.00	0.09
240	603116	红蜻蜓	16,900	117,793.00	0.09
241	600565	迪马股份	44,800	116,480.00	0.09
242	000039	中集集团	10,909	115,417.22	0.09
243	002033	丽江旅游	20,200	114,534.00	0.09
244	600567	山鹰纸业	36,200	112,944.00	0.09
245	300120	经纬辉开	18,600	112,902.00	0.09
246	600958	东方证券	14,000	111,580.00	0.09
247	601877	正泰电器	4,600	111,504.00	0.09
248	000501	鄂武商 A	11,734	111,238.32	0.09
249	300026	红日药业	36,408	111,044.40	0.09
250	002274	华昌化工	21,900	111,033.00	0.09
251	600697	欧亚集团	6,000	110,340.00	0.09
252	601898	中煤能源	23,410	108,856.50	0.09
253	600516	方大炭素	6,500	108,615.00	0.09
254	600720	祁连山	16,800	108,360.00	0.08
255	603801	志邦家居	4,500	108,045.00	0.08
256	600597	光明乳业	12,900	107,844.00	0.08
257	000166	申万宏源	26,400	107,448.00	0.08

258	600051	宁波联合	19,900	107,261.00	0.08
259	002332	仙琚制药	17,450	106,968.50	0.08
260	300423	鲁亿通	6,000	105,780.00	0.08
261	000419	通程控股	25,900	105,672.00	0.08
262	000937	冀中能源	28,000	105,560.00	0.08
263	002433	太安堂	22,400	105,056.00	0.08
264	000049	德赛电池	3,636	104,280.48	0.08
265	600479	千金药业	13,400	103,984.00	0.08
266	000623	吉林敖东	7,180	103,607.40	0.08
267	601928	凤凰传媒	13,006	103,267.64	0.08
268	600971	恒源煤电	18,300	103,029.00	0.08
269	600426	华鲁恒升	8,510	102,715.70	0.08
270	601788	光大证券	11,700	102,609.00	0.08
271	603298	杭叉集团	8,600	101,652.00	0.08
272	000887	中鼎股份	10,010	101,301.20	0.08
273	002186	全聚德	8,900	101,282.00	0.08
274	601998	中信银行	18,500	100,825.00	0.08
275	600881	亚泰集团	30,373	100,534.63	0.08
276	601901	方正证券	18,700	99,297.00	0.08
277	603878	武进不锈	8,700	98,571.00	0.08
278	600438	通威股份	11,900	98,532.00	0.08
279	300461	田中精机	5,500	98,010.00	0.08
280	600665	天地源	28,400	97,696.00	0.08
281	600029	南方航空	14,700	97,608.00	0.08
282	600557	康缘药业	9,400	96,632.00	0.08
283	000560	我爱我家	20,680	96,575.60	0.08
284	002082	万邦德	13,000	95,940.00	0.08
285	002101	广东鸿图	11,800	95,462.00	0.07
286	600196	复星医药	4,100	95,407.00	0.07
287	601900	南方传媒	11,300	95,146.00	0.07
288	002316	亚联发展	13,600	95,064.00	0.07
289	000910	大亚圣象	9,200	94,852.00	0.07
290	600765	中航重机	12,400	92,256.00	0.07
291	601992	金隅集团	26,300	92,050.00	0.07
292	600340	华夏幸福	3,600	91,620.00	0.07
293	600737	中粮糖业	12,400	91,264.00	0.07
294	600893	航发动力	4,200	91,224.00	0.07
295	600894	广日股份	16,600	90,470.00	0.07
296	600731	湖南海利	21,400	90,308.00	0.07

297	300296	利亚德	11,700	89,973.00	0.07
298	600143	金发科技	18,146	89,822.70	0.07
299	002100	天康生物	21,300	89,460.00	0.07
300	002533	金杯电工	20,100	88,641.00	0.07
301	300250	初灵信息	7,900	87,690.00	0.07
302	000043	中航善达	11,700	87,516.00	0.07
303	000537	广宇发展	11,600	86,884.00	0.07
304	601058	赛轮轮胎	38,900	86,747.00	0.07
305	600422	昆药集团	14,015	86,612.70	0.07
306	002798	帝欧家居	6,400	85,824.00	0.07
307	300132	青松股份	8,300	85,822.00	0.07
308	601377	兴业证券	18,300	84,912.00	0.07
309	002440	闰土股份	9,333	83,997.00	0.07
310	000716	黑芝麻	30,000	83,700.00	0.07
311	601137	博威合金	12,200	83,204.00	0.07
312	002335	科华恒盛	5,500	82,885.00	0.07
313	000153	丰原药业	15,900	81,885.00	0.06
314	601616	广电电气	25,800	81,786.00	0.06
315	600054	黄山旅游	8,700	81,606.00	0.06
316	600266	北京城建	10,300	81,576.00	0.06
317	002736	国信证券	9,700	81,189.00	0.06
318	600239	云南城投	28,100	80,928.00	0.06
319	000589	黔轮胎 A	24,100	80,735.00	0.06
320	600777	新潮能源	42,100	80,411.00	0.06
321	002241	歌尔股份	11,600	79,808.00	0.06
322	601999	出版传媒	15,700	79,599.00	0.06
323	603020	爱普股份	10,700	79,501.00	0.06
324	000719	中原传媒	10,100	79,487.00	0.06
325	601567	三星医疗	14,100	79,383.00	0.06
326	601689	拓普集团	5,350	79,073.00	0.06
327	600279	重庆港九	20,200	78,982.00	0.06
328	300447	全信股份	8,500	78,880.00	0.06
329	603260	合盛硅业	1,800	78,840.00	0.06
330	300446	乐凯新材	5,100	78,234.00	0.06
331	000951	中国重汽	7,000	77,980.00	0.06
332	601966	玲珑轮胎	5,700	77,805.00	0.06
333	000783	长江证券	15,000	77,250.00	0.06
334	002039	黔源电力	5,900	76,700.00	0.06
335	600863	内蒙华电	33,200	76,692.00	0.06

336	002717	岭南股份	8,600	76,626.00	0.06
337	600361	华联综超	22,600	76,614.00	0.06
338	000999	华润三九	3,078	76,519.08	0.06
339	000948	南天信息	8,000	76,320.00	0.06
340	603360	百傲化学	6,160	76,137.60	0.06
341	002171	楚江新材	16,400	75,932.00	0.06
342	600188	兖州煤业	8,640	75,859.20	0.06
343	002637	赞宇科技	10,600	75,684.00	0.06
344	600012	皖通高速	12,500	75,375.00	0.06
345	000671	阳光城	14,400	74,736.00	0.06
346	002487	大金重工	22,100	73,814.00	0.06
347	603100	川仪股份	9,800	73,696.00	0.06
348	002315	焦点科技	6,200	73,222.00	0.06
349	600461	洪城水业	13,300	73,150.00	0.06
350	002318	久立特材	11,500	72,910.00	0.06
351	603809	豪能股份	4,900	72,814.00	0.06
352	002111	威海广泰	7,400	72,076.00	0.06
353	600780	通宝能源	22,200	71,706.00	0.06
354	000529	广弘控股	16,000	71,680.00	0.06
355	603811	诚意药业	4,400	71,412.00	0.06
356	600006	东风汽车	19,784	71,222.40	0.06
357	002772	众兴菌业	11,000	71,170.00	0.06
358	000921	海信家电	10,000	70,700.00	0.06
359	002713	东易日盛	4,500	70,560.00	0.06
360	002538	司尔特	14,600	70,518.00	0.06
361	000963	华东医药	2,665	70,515.90	0.06
362	002334	英威腾	16,400	70,192.00	0.06
363	002483	润邦股份	19,200	70,080.00	0.05
364	603611	诺力股份	5,700	69,996.00	0.05
365	000863	三湘印象	17,900	69,989.00	0.05
366	603556	海兴电力	5,377	69,901.00	0.05
367	300122	智飞生物	1,800	69,768.00	0.05
368	300200	高盟新材	9,800	69,090.00	0.05
369	300218	安利股份	11,300	68,817.00	0.05
370	600398	海澜之家	8,060	68,348.80	0.05
371	600109	国金证券	9,500	68,020.00	0.05
372	600100	同方股份	6,900	67,137.00	0.05
373	002303	美盈森	14,400	66,960.00	0.05
374	600970	中材国际	12,200	66,734.00	0.05

375	002152	广电运通	11,850	66,478.50	0.05
376	601117	中国化学	12,300	65,928.00	0.05
377	002410	广联达	3,100	64,511.00	0.05
378	000021	深科技	11,200	64,400.00	0.05
379	300371	汇中股份	5,200	64,324.00	0.05
380	600478	科力远	16,400	63,960.00	0.05
381	600141	兴发集团	6,200	63,798.00	0.05
382	603328	依顿电子	6,410	63,459.00	0.05
383	601866	中远海发	27,600	62,928.00	0.05
384	002154	报喜鸟	20,700	62,721.00	0.05
385	002206	海利得	16,400	62,484.00	0.05
386	601200	上海环境	4,700	62,369.00	0.05
387	603355	莱克电气	2,900	62,350.00	0.05
388	002195	二三四五	16,759	61,840.71	0.05
389	002317	众生药业	7,400	61,790.00	0.05
390	002600	领益智造	24,600	61,500.00	0.05
391	300253	卫宁健康	4,900	61,054.00	0.05
392	000848	承德露露	7,536	60,589.44	0.05
393	600085	同仁堂	2,200	60,500.00	0.05
394	000636	风华高科	5,600	60,144.00	0.05
395	002240	威华股份	8,200	59,778.00	0.05
396	002601	龙蟠佰利	4,800	59,040.00	0.05
397	002430	杭氧股份	6,300	58,905.00	0.05
398	002462	嘉事堂	4,000	57,800.00	0.05
399	000786	北新建材	4,200	57,792.00	0.05
400	002296	辉煌科技	11,300	57,630.00	0.05
401	000723	美锦能源	17,800	57,138.00	0.04
402	002831	裕同科技	1,400	56,084.00	0.04
403	000591	太阳能	18,900	55,944.00	0.04
404	000728	国元证券	8,000	55,840.00	0.04
405	300408	三环集团	3,300	55,836.00	0.04
406	600582	天地科技	16,300	55,746.00	0.04
407	600708	光明地产	15,900	55,491.00	0.04
408	002396	星网锐捷	3,200	55,104.00	0.04
409	000906	浙商中拓	11,200	54,768.00	0.04
410	600908	无锡银行	10,400	54,496.00	0.04
411	300010	立思辰	7,500	54,450.00	0.04
412	601198	东兴证券	5,500	52,580.00	0.04
413	002756	永兴特钢	4,400	52,448.00	0.04

414	002673	西部证券	6,800	52,156.00	0.04
415	600507	方大特钢	5,200	51,948.00	0.04
416	600801	华新水泥	3,100	51,832.00	0.04
417	600655	豫园股份	7,000	51,800.00	0.04
418	600062	华润双鹤	4,260	51,503.40	0.04
419	002439	启明星辰	2,500	51,400.00	0.04
420	603185	上机数控	1,042	51,162.20	0.04
421	002345	潮宏基	11,400	50,958.00	0.04
422	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.04
423	600388	龙净环保	4,940	50,141.00	0.04
424	000997	新大陆	3,400	49,776.00	0.04
425	002001	新和成	3,300	49,533.00	0.04
426	601333	广深铁路	15,400	48,664.00	0.04
427	002268	卫士通	2,700	48,222.00	0.04
428	300168	万达信息	3,900	46,761.00	0.04
429	000729	燕京啤酒	8,252	46,541.28	0.04
430	600633	浙数文化	5,684	46,324.60	0.04
431	000338	潍柴动力	6,000	46,200.00	0.04
432	002797	第一创业	8,500	46,070.00	0.04
433	000026	飞亚达 A	6,300	45,927.00	0.04
434	002065	东华软件	6,600	45,870.00	0.04
435	002818	富森美	2,200	45,738.00	0.04
436	600420	现代制药	4,900	44,786.00	0.04
437	600718	东软集团	3,850	44,467.50	0.03
438	600211	西藏药业	1,500	44,265.00	0.03
439	603198	迎驾贡酒	3,100	43,741.00	0.03
440	002884	凌霄泵业	2,100	43,533.00	0.03
441	002225	濮耐股份	9,700	42,874.00	0.03
442	000959	首钢股份	11,470	42,783.10	0.03
443	603686	龙马环卫	3,900	42,354.00	0.03
444	600027	华电国际	8,900	42,275.00	0.03
445	600594	益佰制药	7,610	42,007.20	0.03
446	000685	中山公用	6,000	42,000.00	0.03
447	600802	福建水泥	5,700	41,952.00	0.03
448	002724	海洋王	8,000	41,680.00	0.03
449	002283	天润曲轴	12,300	41,205.00	0.03
450	600589	广东榕泰	10,000	40,800.00	0.03
451	603833	欧派家居	500	39,860.00	0.03
452	002468	申通快递	2,400	39,480.00	0.03

453	600998	九州通	2,700	39,420.00	0.03
454	600369	西南证券	11,100	38,628.00	0.03
455	600827	百联股份	4,549	38,439.05	0.03
456	300182	捷成股份	8,900	38,181.00	0.03
457	001696	宗申动力	8,700	37,932.00	0.03
458	002251	步步高	5,100	37,842.00	0.03
459	601801	皖新传媒	5,630	37,608.40	0.03
460	300061	康旗股份	6,300	37,485.00	0.03
461	000066	中国长城	7,900	37,446.00	0.03
462	000930	中粮生化	5,000	37,100.00	0.03
463	601878	浙商证券	5,100	37,026.00	0.03
464	002373	千方科技	3,300	36,696.00	0.03
465	600549	厦门钨业	3,000	36,240.00	0.03
466	603866	桃李面包	800	36,128.00	0.03
467	000656	金科股份	5,800	35,902.00	0.03
468	600060	海信电器	4,095	35,544.60	0.03
469	002244	滨江集团	8,930	35,541.40	0.03
470	300166	东方国信	3,400	35,224.00	0.03
471	600809	山西汾酒	1,000	35,050.00	0.03
472	600750	江中药业	2,066	34,977.38	0.03
473	300433	蓝思科技	5,300	34,503.00	0.03
474	600058	五矿发展	5,200	33,852.00	0.03
475	600909	华安证券	7,100	33,512.00	0.03
476	601881	中国银河	4,900	33,418.00	0.03
477	600820	隧道股份	5,330	33,365.80	0.03
478	000541	佛山照明	6,364	32,965.52	0.03
479	600859	王府井	2,427	32,910.12	0.03
480	002603	以岭药业	3,140	32,844.40	0.03
481	600757	长江传媒	4,936	32,182.72	0.03
482	600835	上海机电	2,200	32,010.00	0.03
483	002276	万马股份	6,300	31,752.00	0.02
484	601919	中远海控	7,800	31,512.00	0.02
485	300002	神州泰岳	9,300	30,690.00	0.02
486	601199	江南水务	8,500	30,260.00	0.02
487	002187	广百股份	3,700	30,155.00	0.02
488	600061	国投资本	3,300	29,667.00	0.02
489	600056	中国医药	2,340	29,413.80	0.02
490	600410	华胜天成	5,000	29,300.00	0.02
491	002308	威创股份	6,530	29,058.50	0.02

492	000551	创元科技	5,000	29,050.00	0.02
493	600572	康恩贝	4,895	29,027.35	0.02
494	600162	香江控股	13,300	28,994.00	0.02
495	601231	环旭电子	3,200	28,800.00	0.02
496	300142	沃森生物	1,500	28,650.00	0.02
497	601608	中信重工	11,000	28,600.00	0.02
498	600101	明星电力	4,300	28,595.00	0.02
499	000503	国新健康	1,800	28,584.00	0.02
500	002788	鹭燕医药	2,200	27,764.00	0.02
501	002561	徐家汇	3,600	27,720.00	0.02
502	002791	坚朗五金	2,800	27,608.00	0.02
503	002773	康弘药业	800	27,256.00	0.02
504	600390	五矿资本	3,900	27,144.00	0.02
505	002064	华峰氨纶	6,420	26,899.80	0.02
506	600536	中国软件	1,261	26,392.73	0.02
507	300324	旋极信息	4,681	26,260.41	0.02
508	000978	桂林旅游	5,000	26,150.00	0.02
509	300055	万邦达	3,400	26,078.00	0.02
510	002368	太极股份	1,110	25,752.00	0.02
511	600466	蓝光发展	4,780	25,716.40	0.02
512	600428	中远海特	7,900	25,675.00	0.02
513	603037	凯众股份	1,400	25,060.00	0.02
514	603228	景旺电子	500	24,995.00	0.02
515	603000	人民网	3,300	24,090.00	0.02
516	002426	胜利精密	10,300	23,896.00	0.02
517	002003	伟星股份	3,400	23,868.00	0.02
518	002311	海大集团	1,000	23,170.00	0.02
519	002280	联络互动	5,920	22,910.40	0.02
520	000528	柳工	3,773	22,902.11	0.02
521	002377	国创高新	5,400	22,626.00	0.02
522	600346	恒力股份	1,700	22,525.00	0.02
523	002503	搜于特	9,400	22,090.00	0.02
524	002139	拓邦股份	5,600	21,952.00	0.02
525	601019	山东出版	2,800	21,896.00	0.02
526	002375	亚厦股份	4,300	21,672.00	0.02
527	600053	九鼎投资	900	21,186.00	0.02
528	300297	蓝盾股份	4,230	21,150.00	0.02
529	002221	东华能源	2,600	20,956.00	0.02
530	000926	福星股份	3,410	20,869.20	0.02

531	000949	新乡化纤	7,500	20,100.00	0.02
532	603885	吉祥航空	1,600	20,048.00	0.02
533	000830	鲁西化工	2,000	19,600.00	0.02
534	300287	飞利信	5,100	19,278.00	0.02
535	600584	长电科技	2,200	18,128.00	0.01
536	300196	长海股份	2,000	17,660.00	0.01
537	600291	西水股份	1,700	17,493.00	0.01
538	000524	岭南控股	2,509	17,312.10	0.01
539	002563	森马服饰	1,900	16,948.00	0.01
540	600563	法拉电子	400	16,856.00	0.01
541	603888	新华网	1,300	16,692.00	0.01
542	601326	秦港股份	5,300	16,642.00	0.01
543	000028	国药一致	400	16,576.00	0.01
544	603588	高能环境	2,100	16,485.00	0.01
545	002344	海宁皮城	3,600	16,380.00	0.01
546	600037	歌华有线	1,900	16,321.00	0.01
547	600329	中新药业	1,300	16,172.00	0.01
548	000612	焦作万方	4,000	15,840.00	0.01
549	601163	三角轮胎	1,400	15,596.00	0.01
550	600673	东阳光科	2,140	15,579.20	0.01
551	600169	太原重工	6,929	15,451.67	0.01
552	002512	达华智能	2,900	15,399.00	0.01
553	601066	中信建投	1,700	14,807.00	0.01
554	600642	申能股份	3,000	14,640.00	0.01
555	600645	中源协和	900	14,616.00	0.01
556	600787	中储股份	2,900	14,500.00	0.01
557	601179	中国西电	4,300	14,448.00	0.01
558	600371	万向德农	2,300	14,375.00	0.01
559	600256	广汇能源	3,800	14,288.00	0.01
560	000060	中金岭南	3,600	14,256.00	0.01
561	600138	中青旅	1,100	14,179.00	0.01
562	600759	洲际油气	6,000	14,160.00	0.01
563	000990	诚志股份	1,100	13,211.00	0.01
564	002106	莱宝高科	2,138	12,956.28	0.01
565	000488	晨鸣纸业	2,300	12,903.00	0.01
566	002642	荣之联	2,000	12,880.00	0.01
567	600258	首旅酒店	800	12,768.00	0.01
568	600409	三友化工	2,220	12,698.40	0.01
569	002635	安洁科技	1,100	12,463.00	0.01

570	002273	水晶光电	1,300	12,428.00	0.01
571	603585	苏利股份	600	12,342.00	0.01
572	601880	大连港	6,600	12,210.00	0.01
573	600125	铁龙物流	1,700	11,900.00	0.01
574	600879	航天电子	2,100	11,361.00	0.01
575	002832	比音勒芬	340	11,356.00	0.01
576	600717	天津港	1,600	11,312.00	0.01
577	002475	立讯精密	800	11,248.00	0.01
578	600482	中国动力	500	11,135.00	0.01
579	000089	深圳机场	1,400	10,906.00	0.01
580	601108	财通证券	1,500	10,830.00	0.01
581	600488	天药股份	2,900	10,817.00	0.01
582	000581	威孚高科	610	10,772.60	0.01
583	600098	广州发展	1,900	10,754.00	0.01
584	002690	美亚光电	500	10,640.00	0.01
585	601168	西部矿业	1,800	10,476.00	0.01
586	000563	陕国投 A	3,900	10,452.00	0.01
587	000878	云南铜业	1,300	10,309.00	0.01
588	300149	量子生物	700	10,241.00	0.01
589	000061	农产品	2,100	10,185.00	0.01
590	600373	中文传媒	749	9,744.49	0.01
591	603877	太平鸟	500	9,395.00	0.01
592	002385	大北农	2,900	9,280.00	0.01
593	000553	安道麦 A	1,000	9,130.00	0.01
594	000758	中色股份	2,500	9,125.00	0.01
595	000980	众泰汽车	2,100	9,093.00	0.01
596	000519	中兵红箭	1,400	8,806.00	0.01
597	600978	宜华生活	2,000	8,200.00	0.01
598	300115	长盈精密	1,000	8,190.00	0.01
599	000564	供销大集	3,200	8,096.00	0.01
600	300159	新研股份	1,700	7,837.00	0.01
601	300202	聚龙股份	1,200	7,728.00	0.01
602	002437	誉衡药业	2,700	7,560.00	0.01
603	000600	建投能源	1,500	7,530.00	0.01
604	603589	口子窖	200	7,014.00	0.01
605	600233	圆通速递	700	7,000.00	0.01
606	000546	金圆股份	800	6,928.00	0.01
607	600823	世茂股份	1,800	6,768.00	0.01
608	601958	金钼股份	1,100	6,512.00	0.01

609	300349	金卡智能	400	6,440.00	0.01
610	000158	常山北明	1,200	6,264.00	0.00
611	600079	人福医药	608	6,165.12	0.00
612	600183	生益科技	600	6,036.00	0.00
613	600901	江苏租赁	1,000	5,910.00	0.00
614	600323	瀚蓝环境	400	5,612.00	0.00
615	601811	新华文轩	584	5,437.04	0.00
616	600751	海航科技	2,000	5,420.00	0.00
617	603025	大豪科技	480	5,352.00	0.00
618	000761	本钢板材	1,520	5,107.20	0.00
619	600862	中航高科	900	5,040.00	0.00
620	300316	晶盛机电	500	5,010.00	0.00
621	601000	唐山港	2,020	4,807.60	0.00
622	300058	蓝色光标	1,100	4,774.00	0.00
623	601398	工商银行	900	4,761.00	0.00
624	603169	兰石重装	1,100	4,697.00	0.00
625	601003	柳钢股份	700	4,599.00	0.00
626	600350	山东高速	1,000	4,560.00	0.00
627	600481	双良节能	1,300	4,329.00	0.00
628	600754	锦江股份	200	4,260.00	0.00
629	600161	天坛生物	200	4,250.00	0.00
630	000932	华菱钢铁	700	4,242.00	0.00
631	000012	南玻 A	1,060	4,229.40	0.00
632	002078	太阳纸业	720	4,104.00	0.00
633	002588	史丹利	1,000	3,890.00	0.00
634	002110	三钢闽光	300	3,837.00	0.00
635	000717	韶钢松山	800	3,640.00	0.00
635	000969	安泰科技	800	3,640.00	0.00
636	000559	万向钱潮	700	3,584.00	0.00
637	002807	江阴银行	700	3,556.00	0.00
638	002482	广田集团	600	3,474.00	0.00
639	600458	时代新材	500	3,390.00	0.00
640	002051	中工国际	300	3,324.00	0.00
641	300427	红相股份	300	3,312.00	0.00
642	002299	圣农发展	200	3,308.00	0.00
643	002505	大康农业	2,000	3,240.00	0.00
644	600335	国机汽车	500	3,120.00	0.00
645	300291	华录百纳	700	3,115.00	0.00
646	300244	迪安诊断	200	3,034.00	0.00

647	603899	晨光文具	100	3,025.00	0.00
648	002815	崇达技术	200	2,922.00	0.00
649	603377	东方时尚	200	2,920.00	0.00
650	300197	铁汉生态	750	2,842.50	0.00
651	002056	横店东磁	500	2,765.00	0.00
652	002663	普邦股份	1,100	2,717.00	0.00
653	600126	杭钢股份	600	2,706.00	0.00
654	601098	中南传媒	210	2,625.00	0.00
655	002323	*ST 百特	1,900	2,489.00	0.00
656	601128	常熟银行	400	2,456.00	0.00
657	600021	上海电力	300	2,430.00	0.00
657	603077	和邦生物	1,500	2,430.00	0.00
658	002583	海能达	300	2,367.00	0.00
659	601718	际华集团	700	2,345.00	0.00
660	603568	伟明环保	100	2,285.00	0.00
661	600885	宏发股份	100	2,256.00	0.00
662	600525	长园集团	500	2,190.00	0.00
663	600500	中化国际	319	2,181.96	0.00
664	601100	恒立液压	100	1,981.00	0.00
665	000090	天健集团	400	1,840.00	0.00
666	300315	掌趣科技	500	1,765.00	0.00
667	601311	骆驼股份	198	1,748.34	0.00
668	600598	北大荒	200	1,712.00	0.00
669	000062	深圳华强	100	1,666.00	0.00
670	002249	大洋电机	500	1,650.00	0.00
671	600039	四川路桥	500	1,640.00	0.00
672	002614	奥佳华	100	1,595.00	0.00
673	000823	超声电子	200	1,560.00	0.00
674	002701	奥瑞金	300	1,518.00	0.00
675	000970	中科三环	200	1,466.00	0.00
676	603369	今世缘	100	1,449.00	0.00
677	000762	西藏矿业	200	1,348.00	0.00
678	601106	中国一重	500	1,335.00	0.00
679	600179	安通控股	200	1,330.00	0.00
680	002489	浙江永强	500	1,320.00	0.00
681	002266	浙富控股	300	1,221.00	0.00
682	600499	科达洁能	300	1,212.00	0.00
683	002626	金达威	100	1,202.00	0.00
684	002672	东江环保	100	1,144.00	0.00

685	000566	海南海药	200	1,024.00	0.00
686	002277	友阿股份	300	948.00	0.00
687	600292	远达环保	191	941.63	0.00
688	300273	和佳股份	200	920.00	0.00
689	002479	富春环保	210	909.30	0.00
690	600936	广西广电	196	733.04	0.00
691	002463	沪电股份	100	717.00	0.00
692	600578	京能电力	200	586.00	0.00
693	600108	亚盛集团	200	528.00	0.00
694	000006	深振业 A	100	518.00	0.00
695	600416	湘电股份	100	516.00	0.00
696	000543	皖能电力	100	479.00	0.00
697	002400	省广集团	160	473.60	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	6,836,884.00	5.07
2	000651	格力电器	6,384,199.00	4.73
3	601166	兴业银行	5,429,173.00	4.03
4	000338	潍柴动力	5,425,338.00	4.02
5	600031	三一重工	5,329,712.00	3.95
6	600887	伊利股份	5,191,521.00	3.85
7	601009	南京银行	4,867,544.26	3.61
8	600016	民生银行	4,610,893.00	3.42
9	601006	大秦铁路	4,563,376.00	3.38
10	600585	海螺水泥	4,262,119.46	3.16
11	601818	光大银行	4,020,723.00	2.98
12	600104	上汽集团	3,989,223.55	2.96
13	600015	华夏银行	3,885,288.16	2.88
14	601328	交通银行	3,802,891.54	2.82
15	000858	五粮液	3,728,237.88	2.76
16	600519	贵州茅台	3,653,209.00	2.71
17	000898	鞍钢股份	3,631,330.00	2.69

18	002304	洋河股份	3,603,464.00	2.67
19	600177	雅戈尔	3,560,280.00	2.64
20	600383	金地集团	3,528,042.00	2.62
21	600674	川投能源	3,497,786.60	2.59
22	601668	中国建筑	3,390,285.00	2.51
23	600000	浦发银行	3,379,635.73	2.51
24	600919	江苏银行	3,317,029.00	2.46
25	600028	中国石化	3,310,448.00	2.45
26	601169	北京银行	3,281,154.00	2.43
27	601888	中国国旅	3,276,352.16	2.43
28	600688	上海石化	3,247,036.00	2.41
29	600066	宇通客车	3,065,086.78	2.27
30	000069	华侨城 A	3,042,106.00	2.26
31	000568	泸州老窖	2,980,524.10	2.21
32	600741	华域汽车	2,949,209.43	2.19
33	601601	中国太保	2,909,714.86	2.16
34	601988	中国银行	2,865,302.00	2.12
35	600019	宝钢股份	2,844,838.56	2.11
36	600153	建发股份	2,814,997.00	2.09
37	600170	上海建工	2,744,862.00	2.04

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	7,029,750.30	5.21
2	000338	潍柴动力	5,892,040.80	4.37
3	600519	贵州茅台	5,763,687.40	4.27
4	600887	伊利股份	4,970,583.85	3.69
5	000333	美的集团	4,855,913.63	3.60
6	601668	中国建筑	4,296,506.06	3.19
7	601166	兴业银行	4,241,134.00	3.14
8	000651	格力电器	4,124,676.40	3.06
9	601009	南京银行	3,962,239.00	2.94
10	000858	五粮液	3,936,632.68	2.92
11	600036	招商银行	3,751,927.30	2.78

12	600104	上汽集团	3,652,641.85	2.71
13	600031	三一重工	3,614,525.00	2.68
14	002304	洋河股份	3,572,612.97	2.65
15	601006	大秦铁路	3,467,853.00	2.57
16	601328	交通银行	3,328,192.00	2.47
17	600016	民生银行	3,320,415.04	2.46
18	601988	中国银行	3,314,247.00	2.46
19	000002	万科 A	3,302,510.35	2.45
20	600000	浦发银行	3,283,372.22	2.43
21	600177	雅戈尔	3,271,615.20	2.43
22	600015	华夏银行	3,234,369.00	2.40
23	601288	农业银行	3,234,228.00	2.40
24	600688	上海石化	3,112,932.00	2.31
25	601818	光大银行	3,085,683.00	2.29
26	600674	川投能源	2,961,884.90	2.20
27	600066	宇通客车	2,928,389.27	2.17
28	601888	中国国旅	2,785,305.17	2.07
29	601601	中国太保	2,739,790.96	2.03
30	601398	工商银行	2,721,918.55	2.02

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	703,799,545.16
卖出股票收入（成交）总额	683,187,507.72

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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。

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	6,829,920.00	5.36
	其中：政策性金融债	6,829,920.00	5.36
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	6,829,920.00	5.36

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	018005	国开 1701	68,000	6,829,920.00	5.36

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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投资。

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投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除兴业银行（601166）、民生银行（600016）、

交通银行（601328）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018年5月4日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监银罚决字（2018）1号），对兴业银行重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；非真实转让信贷资产；无授信额度或超授信额度办理同业业务；内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；债券卖出回购业务违规出表；个人理财资金违规投资；提供日期倒签的材料；部分非现场监管统计数据与事实不符；个别董事未经任职资格核准即履职；变相批量转让个人贷款；向四证不全的房地产项目提供融资等违法违规事实进行处罚。

2018年12月7日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监银罚决字（2018）12号），对交通银行不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权；未尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产；档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞；理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；违规向土地储备机构提供融资；信贷资金违规承接本行表外理财资产；理财资金违规投资项目资本金；部分理财产品信息披露不合规；现场检查配合不力等违法违规事实进行处罚。同日，（银保监银罚决字（2018）13号）对交通银行并购贷款占并购交易价款比例不合规；并购贷款尽职调查和风险评估不到位等违法违规事实进行处罚。

2018年12月7日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监银罚决字（2018）5号），对民生银行贷款业务严重违反审慎经营规则等违法违规事实进行处罚。同日，（银保监银罚决字（2018）8号）对民生银行内控管理严重违反审慎经营规则；同业投资违规接受担保；同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；本行理财产品之间风险隔离不到位；个人理财资金违规投资；票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；为非保本理财产品提供保本承诺等违法违规事实进行处罚。

本基金基于量化选股模型进行投资，策略基于股票的基本面，技术面及情绪面数据进行建模并量化投资，兴业银行（601166）、民生银行（600016）、交通银行（601328）作为估值较低盈利情况较好的公司被模型选出进行配置，同时我们认为这几家公司受到的处罚并未对其投资价值产生实质性的负面影响，所以依旧按照模型结果进行投资。

8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,262.41
2	应收证券清算款	141,661.24
3	应收股利	-
4	应收利息	190,739.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	345,663.44

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
235	663,999.16	155,968,696.43	99.95%	71,106.17	0.05%

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	10,457.66	0.0067%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年11月10日）基金份额总额	200,107,412.33
本报告期期初基金份额总额	130,075,227.36
本报告期期间基金总申购份额	25,976,534.99
减：本报告期期间基金总赎回份额	11,959.75
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	156,039,802.60

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金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

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人中金基金原董事长林寿康先生离职，2018 年 10 月 18 日起总经理孙菁女士代为履行中金基金董事长（法定代表人）职务。2019 年 1 月 18 日起，楚钢先生担任中金基金董事长（法定代表人）。

2018 年 9 月 3 日起，汤琰女士担任基金管理人中金基金副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已按照相关规定向监管部门报告并履行信息披露程序。本报告期内本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

1、本报告期内，基金管理人与股东中金公司就侵犯商标权及不正当竞争事项，联合向南京市中级人民法院起诉，截至报告期末本案尚无判决。

2、本报告期内无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。本基金本报告期内应支付审计费用 40,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查和处罚。

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	
东兴证券	2	700,069,592.98	50.56%	511,932.39	50.56%	-
长江证券	2	320,123,035.05	23.12%	234,041.25	23.12%	-
中投证券	2	190,009,900.15	13.72%	138,928.31	13.72%	-
天风证券	2	174,490,873.32	12.60%	127,602.96	12.60%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

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

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

的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东兴证券	10,921,767.61	61.46%	372,300,000.00	58.10%	-	-
长江证券	302,866.50	1.70%	168,300,000.00	26.26%	-	-
中投证券	6,545,500.00	36.83%	54,000,000.00	8.43%	-	-
天风证券	-	-	46,200,000.00	7.21%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司关于调整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1月18日
2	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金2017年第4季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018年1月19日
3	关于中金基金管理有限公司旗下基金新增中国中投证券有限责任公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018年1月20日
4	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2月7日
5	中金基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职责的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018年2月10日
6	中金基金管理有限公司更正基金经理恢复履行职责的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018年2月10日
7	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2月10日
8	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
9	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

10	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
11	中金基金管理有限公司关于网上直销通联支付农业银行渠道暂停服务的通知	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 27 日
12	关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》对短期投资行为收取短期赎回费的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 30 日
13	中金基金管理有限公司关于修改旗下部分开放式基金《基金合同》、《托管协议》等法律文件的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 30 日
14	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2017 年度报告及摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 30 日
15	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
16	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 4 月 23 日
17	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
18	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

		报》及/或公司网站	
19	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
20	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书及其摘要（2018第1号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018年6月23日
21	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
22	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
23	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
24	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书及其摘要（2018第1号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018年6月23日
25	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金2018年第2季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018年7月19日
26	关于新增济安财富(北京)基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018年7月21日
27	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8月21日

28	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金半年报及其摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 8 月 28 日
29	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 9 月 4 日
30	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 9 月 6 日
31	中金基金管理有限公司关于调整旗下基金所持长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 10 月 12 日
32	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 10 月 24 日
33	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书及其摘要（2018 第 2 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 12 月 22 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018 年 1 月 1 日-2018 年 12 月 31 日	110,000,000.00	0.00	0.00	110,000,000.00	70.49%

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。

(3) 股票选择风险

本基金的量化选股模型在注重基本面研究的同时，结合多种统计量化策略，主要包括多因子模型和统计套利模型等，期望筛选出对比做空的股指或个股有超额收益的股票。但有可能在某区间本基金买入的股票收益率低于做空的股指收益率，从而导致基金损失。

(4) 本金损失风险

本基金灵活应用各种收益策略来对冲基金的系统性风险或进行投资个股的筛选，但投资策略的失败和投资市场的波动可能会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。

(5) 卖空风险

本基金适时采用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险，但可以不完全对冲，根据合同本基金可以持有净多头或净空头头寸，将来亦有可能会优选做空个股、做空其他衍生工具的方式来实现投资目标。如果基金管理人判断失误可能导致本基金在某些市场情况下无法跑赢普通偏股型基金，也有可能特殊情况下发生比普通偏股型基金更大的损失。

(6) 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。

(7) 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请募集中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书；
- 5、《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 6、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批复、营业执照；
- 8、本报告期内在指定媒介上披露的有关本基金的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件和复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：（86）010-63211122 400-868-1166

传真：（86）010-66159121

中金基金管理有限公司

2019年3月28日