

中金衡优灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 26 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| §7 投资组合报告..... | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 40 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 40 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 61 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 63 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 63 |
| 7.7 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..... | 63 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 64 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 64 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 64 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 64 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 64 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 66 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 66 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 66 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 66 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 67 |
| §10 重大事件揭示..... | 68 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 68 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 68 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 68 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 68 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 68 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 69 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 69 |
| 10.8 其他重大事件..... | 69 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 71 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 71 |

| | |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 71 |
| §12 备查文件目录..... | 72 |
| 12.1 备查文件目录..... | 72 |
| 12.2 存放地点..... | 72 |
| 12.3 查阅方式..... | 72 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 基金名称 | 中金衡优灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中金衡优 | |
| 基金主代码 | 005489 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018 年 6 月 8 日 | |
| 基金管理人 | 中金基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 51,975,715.22 份 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 中金衡优 A | 中金衡优 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 005489 | 005490 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 39,540,035.05 份 | 12,435,680.17 份 |

2.2 基金产品说明

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 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李虹 | 王永民 |
| | 联系电话 | 010-63211122 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | xxpl@ciccfund.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-868-1166 | 95566 |
| 传真 | | 010-66159121 | 010-66594942 |
| 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 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 办公地址 | | 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 邮政编码 | | 100004 | 100818 |
| 法定代表人 | | 楚钢 | 刘连舸 |

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》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.ciccfund.com/ |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-------------------------------|
| 注册登记机构 | 中金基金管理有限公司 | 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别 | 中金衡优 A | 中金衡优 C |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日) | 报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 5,370,376.05 | 1,729,145.35 |
| 本期利润 | 5,070,866.73 | 2,256,108.78 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0848 | 0.1293 |
| 本期加权平均净值利润率 | 7.83% | 12.03% |
| 本期基金份额净值增长率 | 9.62% | 9.40% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 4,449,562.17 | 1,294,354.91 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1125 | 0.1041 |
| 期末基金资产净值 | 44,106,730.62 | 13,767,210.64 |
| 期末基金份额净值 | 1.1155 | 1.1071 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2019年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 11.55% | 10.71% |

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金衡优 A

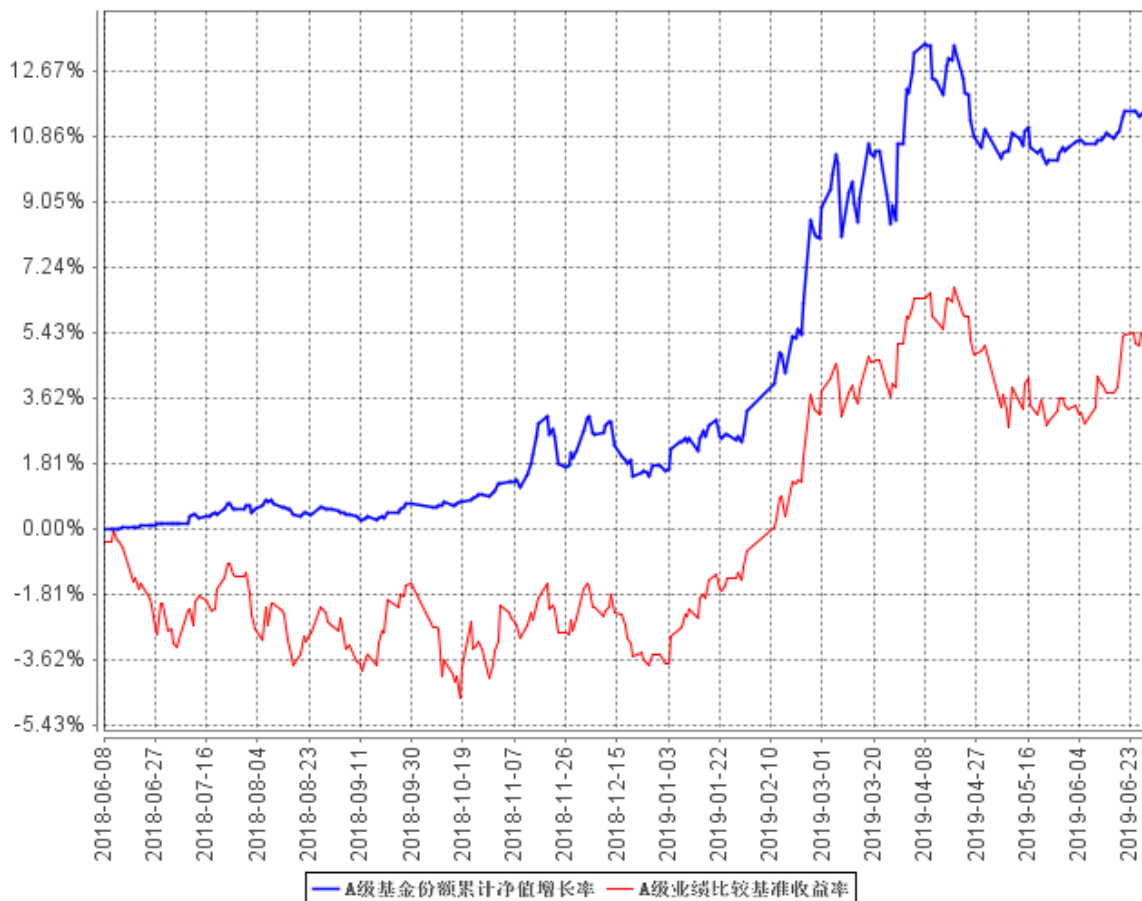
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.89% | 0.11% | 1.99% | 0.34% | -1.10% | -0.23% |
| 过去三个月 | 0.83% | 0.34% | 0.24% | 0.44% | 0.59% | -0.10% |
| 过去六个月 | 9.62% | 0.50% | 9.16% | 0.45% | 0.46% | 0.05% |
| 过去一年 | 11.37% | 0.37% | 7.60% | 0.45% | 3.77% | -0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.55% | 0.36% | 5.40% | 0.45% | 6.15% | -0.09% |

中金衡优 C

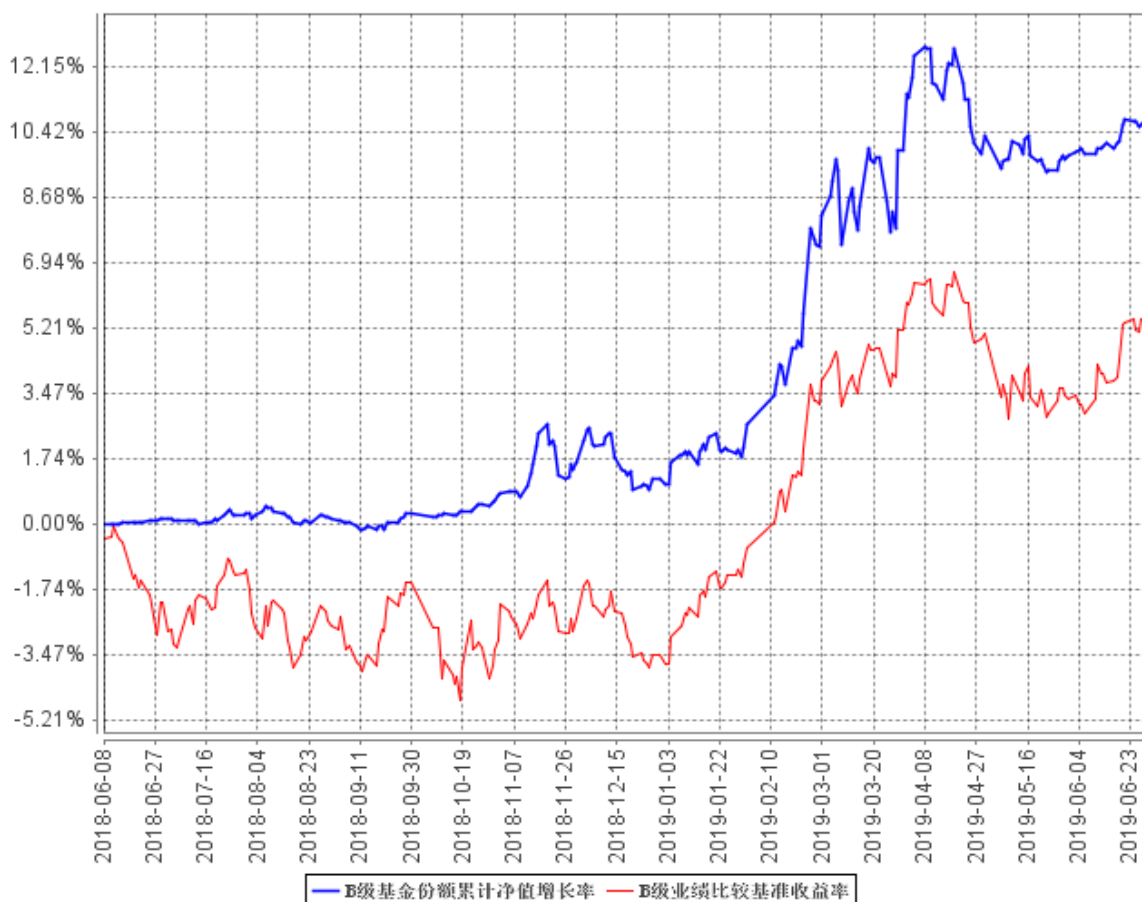
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.85% | 0.11% | 1.99% | 0.34% | -1.14% | -0.23% |
| 过去三个月 | 0.73% | 0.34% | 0.24% | 0.44% | 0.49% | -0.10% |
| 过去六个月 | 9.40% | 0.50% | 9.16% | 0.45% | 0.24% | 0.05% |
| 过去一年 | 10.57% | 0.37% | 7.60% | 0.45% | 2.97% | -0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.71% | 0.36% | 5.40% | 0.45% | 5.31% | -0.09% |

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金的基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 3.5 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 2019 年 6 月 30 日，公司共管理 27 只开放式基金，证券投资基金管理规模 166.33 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|------------------|-----------------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 魏宇 | 本基金基金经理 | 2018 年 6 月 8 日 | - | 9 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 月加入中金基金管理有限公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任量化公募投资部基金经理。 |
| 陈诗昆 | 本基金基金经理 | 2018 年 12 月 21 日 | - | 8 年 | 陈诗昆女士，金融学硕士。历任嘉实基金管理有限公司财富管理部职员；鹏扬基金管理有限公司交易员、固定收益研究员、投资经理。2018 年 10 月加入中金基金管理有限公司，现任组合投资部基金经理。 |
| 丁扬 | 本基金基金经 | 2018 年 8 月 6 日 | 2019 年 3 月 26 日 | 5 年 | 丁杨先生，北京大学经济学硕士。历任蚂蚁金融服 |

| | | | | | |
|--|-----|--|--|--|---------------------------------|
| | 理助理 | | | | 务集团资产配置部分析师；现任中金基金管理有限公司组合投资部经理 |
|--|-----|--|--|--|---------------------------------|

1、对本基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为本基金管理人对外披露的基金经理离任日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”为本基金管理人对外披露的任免日期。

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

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》和其他有关法律法规及本基金合同的约定，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，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期第一季度，本基金管理人在中期资产配置层面看好政策边际放松影响下的权益资产，同时认为债券资产在前期高估值及经济基本面短期企稳的压力下存在较大风险，基于中期判断，本基金提高了权益资产配置，降低账户债券久期。4 月中旬后，经济复苏及市场上行的动量逐步减弱，本基金降低了权益仓位，同时提高账户久期，有效降低了股票市场下调过程中的账户亏损。本基金结合中期及短期资产配置判断，有效调整权益仓位及债券久期中枢，在本报告期增长 9.62%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金衡优 A 基金份额净值为 1.1155 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.62%；截至本报告期末中金衡优 C 基金份额净值为 1.1071 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.40%；同期业绩比较基准收益率为 9.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为国内宏观经济进入筑底阶段，企业盈利有望在下半年逐步迎来复苏，但同时，美国经济下行压力巨大，欧洲深陷衰退风险，全球经济整体走弱的风险将有可能对国内宏观环境造成冲击。

对于国内主要资产而言，权益资产中期有望在盈利复苏的引导下反转，但短期面对的海外市场下行、贸易摩擦、结构性交易拥挤等压力依然较大。同时，债券资产收益与全球经济下行压力，短期仍然存在继续上涨的动力。在权益资产的行业结构上，本基金管理人相对看好科技板块在盈利见底后的反转机会，而将谨慎配置受经济因素影响较大的周期行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，

但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中金衡优灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金衡优灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 6,175,361.80 | 128,013.01 |
| 结算备付金 | | 314,613.99 | 871,877.08 |
| 存出保证金 | | 22,419.04 | 26,941.80 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 64,580,784.32 | 88,012,229.69 |
| 其中：股票投资 | | 6,004,274.32 | 23,744,429.69 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 58,576,510.00 | 64,267,800.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | 1,300,000.00 |
| 应收证券清算款 | | - | 488,333.14 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 969,573.88 | 1,477,259.26 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 3,797.00 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 72,066,550.03 | 92,304,653.98 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 10,079,784.88 | - |
| 应付证券清算款 | | 3,860,939.08 | 575,098.22 |
| 应付赎回款 | | 21.59 | 15.23 |
| 应付管理人报酬 | | 81,389.58 | 124,732.79 |
| 应付托管费 | | 15,780.91 | 20,788.81 |
| 应付销售服务费 | | 4,483.26 | 6,942.28 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 108,234.01 | 64,114.95 |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应交税费 | | 547.01 | 1,260.32 |
| 应付利息 | | 5,155.32 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 36,273.13 | 185,000.00 |
| 负债合计 | | 14,192,608.77 | 977,952.60 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 51,975,715.22 | 89,860,953.69 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 5,898,226.04 | 1,465,747.69 |
| 所有者权益合计 | | 57,873,941.26 | 91,326,701.38 |
| 负债和所有者权益总计 | | 72,066,550.03 | 92,304,653.98 |

报告截止日 2019 年 6 月 30 日，中金衡优 A 基金份额净值 1.1155 元，基金份额总额 39,540,035.05 份；中金衡优 C 基金份额净值 1.1071 元，基金份额总额 12,435,680.17 份。中金衡优份额总额合计为 51,975,715.22 份。

6.2 利润表

会计主体：中金衡优灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2018 年 6 月 8 日(基金合 同生效日)至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|--|
| 一、收入 | | 8,402,547.65 | 613,701.92 |
| 1.利息收入 | | 1,112,888.46 | 568,498.10 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 16,614.78 | 542,917.75 |
| 债券利息收入 | | 1,078,291.60 | 25,372.61 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 17,982.08 | 207.74 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 7,061,745.82 | - |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 5,483,991.93 | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 1,484,104.33 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 93,649.56 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 227,454.11 | 40,700.00 |

| | | | |
|----------------------------|------------|--------------|------------|
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 459.26 | 4,503.82 |
| 减：二、费用 | | 1,075,572.14 | 289,784.04 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 612,357.25 | 203,707.13 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 104,275.54 | 33,951.18 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 37,075.65 | 29,946.83 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 205,969.16 | 13.11 |
| 5. 利息支出 | | 55,309.63 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 55,309.63 | - |
| 6. 税金及附加 | | 353.61 | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 60,231.30 | 22,165.79 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 7,326,975.51 | 323,917.88 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 7,326,975.51 | 323,917.88 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金衡优灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | |
|-----------------------------------|----------------------------|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 89,860,953.69 | 1,465,747.69 | 91,326,701.38 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 7,326,975.51 | 7,326,975.51 |
| 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） | -37,885,238.47 | -2,894,497.16 | -40,779,735.63 |
| 其中：1. 基金申购款 | 34,244,479.34 | 4,139,526.45 | 38,384,005.79 |

| | | | |
|--|--|---------------|----------------|
| 2. 基金赎回款 | -72,129,717.81 | -7,034,023.61 | -79,163,741.42 |
| 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) | 51,975,715.22 | 5,898,226.04 | 57,873,941.26 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 225,191,112.89 | - | 225,191,112.89 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 323,917.88 | 323,917.88 |
| 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) | 225,191,112.89 | 323,917.88 | 225,515,030.77 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金衡优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 2017 年 11 月 9 日证监许可 [2017] 2022 号《关于准予中金衡优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、《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国银行、上海挖财金融信息服务有限公司、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（以下简称“中投证券”）及包商银行等共同销售，募集期为 2018 年 4 月 18 日起至 2018 年 6 月 5 日。经向中国证监会备案，《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 6 月 8 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 225,191,112.89 份（含利息转份额 61,978.74 份），发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据经中国证监会备案的《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购 / 申购时，收取认购 / 申购费用，但从本类别基金资产中不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取认购 / 申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金衡优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、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融

工具（但须符合中国证监会相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 06 月 30 日的财务状况、2019 上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 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，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 6,175,361.80 |
| 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： | 6,175,361.80 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 | | |
|-------------------|-------------------|---------------|------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 5,842,224.75 | 6,004,274.32 | 162,049.57 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 9,129,510.00 | 97,069.24 |
| | 银行间市场 | 49,447,000.00 | 334,676.67 |
| | 合计 | 58,576,510.00 | 431,745.91 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 63,986,988.84 | 64,580,784.32 | 593,795.48 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 473.80 |
| 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 | 141.60 |
| 应收债券利息 | 968,948.38 |
| 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 | 10.10 |
| 合计 | 969,573.88 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 104,648.59 |
| 银行间市场应付交易费用 | 3,585.42 |
| 合计 | 108,234.01 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 0.05 |
| 预提费用 | 36,273.08 |
| 合计 | 36,273.13 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 中金衡优 A | | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 69,756,630.54 | 69,756,630.54 |
| 本期申购 | 30,011,207.50 | 30,011,207.50 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -60,227,802.99 | -60,227,802.99 |
| - 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 | 39,540,035.05 | 39,540,035.05 |

金额单位：人民币元

| 中金衡优 C | | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 20,104,323.15 | 20,104,323.15 |
| 本期申购 | 4,233,271.84 | 4,233,271.84 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -11,901,914.82 | -11,901,914.82 |
| - 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 | 12,435,680.17 | 12,435,680.17 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 中金衡优 A | | | |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 1,130,829.59 | 93,834.35 | 1,224,663.94 |
| 本期利润 | 5,370,376.05 | -299,509.32 | 5,070,866.73 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,051,643.47 | 322,808.37 | -1,728,835.10 |

| | | | |
|----------|---------------|---------------|---------------|
| 其中：基金申购款 | 2,451,736.58 | 1,351,963.58 | 3,803,700.16 |
| 基金赎回款 | -4,503,380.05 | -1,029,155.21 | -5,532,535.26 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 4,449,562.17 | 117,133.40 | 4,566,695.57 |

单位：人民币元

| 中金衡优 C | | | |
|----------------|--------------|-------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 214,074.76 | 27,008.99 | 241,083.75 |
| 本期利润 | 1,729,145.35 | 526,963.43 | 2,256,108.78 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -648,865.20 | -516,796.86 | -1,165,662.06 |
| 其中：基金申购款 | 292,616.53 | 43,209.76 | 335,826.29 |
| 基金赎回款 | -941,481.73 | -560,006.62 | -1,501,488.35 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,294,354.91 | 37,175.56 | 1,331,530.47 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 12,525.36 |
| 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 | 3,816.56 |
| 其他 | 272.86 |
| 合计 | 16,614.78 |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 83,900,319.71 |
| 减：卖出股票成本总额 | 78,416,327.78 |
| 买卖股票差价收入 | 5,483,991.93 |

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,484,104.33 |
| 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 | 1,484,104.33 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 148,336,540.80 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 143,838,241.37 |
| 减：应收利息总额 | 3,014,195.10 |
| 买卖债券差价收入 | 1,484,104.33 |

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 93,649.56 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |

| | |
|----|-----------|
| 合计 | 93,649.56 |
|----|-----------|

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 227,454.11 |
| ——股票投资 | 1,440,659.94 |
| ——债券投资 | -1,213,205.83 |
| ——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 | 227,454.11 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 459.26 |
| 其他 | - |
| 合计 | 459.26 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 201,769.16 |
| 银行间市场交易费用 | 4,200.00 |
| 交易基金产生的费用 | - |
| 其中：申购费 | - |
| 赎回费 | - |

| | |
|----|------------|
| 合计 | 205,969.16 |
|----|------------|

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用 | 17,356.09 |
| 信息披露费 | 9,916.99 |
| 其他 | 300.00 |
| 帐户维护费 | 27,300.00 |
| 汇划手续费 | 5,358.22 |
| 合计 | 60,231.30 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|------------------------|
| 中金基金管理有限公司（“中金基金”） | 基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 基金托管人、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 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生效日)至 2018年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------------|--|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |
| 中投证券 | 143,097,463.24 | 100.00% | - | - |

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生效日)至 2018年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------------|--|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 |
| 中投证券 | 45,021,672.90 | 100.00% | 13,008,700.00 | 100.00% |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30 日 | | 上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生效日)至2018 年6月30日 | |
|-------|--------------------------------|--------------------|--|--------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 |
| 中投证券 | 272,660,000.00 | 100.00% | 2,500,000.00 | 100.00% |

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------|-------------------------------|
| | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 612,357.25 | 203,707.13 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 112,333.87 | 62,505.75 |

注：支付基金管理人中金基金管理有限公司的基本管理费按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基本管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|-------------------------------|
| | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 104,275.54 | 33,951.18 |

注：支付基金托管人中国银行的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。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|----------------------|-----------|-----------|
| | 2019年1月1日至2019年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中金衡优 A | 中金衡优 C | 合计 |
| 中国银行 | - | 10,804.27 | 10,804.27 |
| 中金基金 | - | 6,540.32 | 6,540.32 |
| 中金公司 | - | 3,922.54 | 3,922.54 |
| 合计 | - | 21,267.13 | 21,267.13 |
| 获得销售服务费的 | 上年度可比期间 | | |

| 各关联方名称 | 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日 | | |
|--------|--|-----------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中金衡优 A | 中金衡优 C | 合计 |
| 中国银行 | - | 2,370.24 | 2,370.24 |
| 中金基金 | - | 23,902.37 | 23,902.37 |
| 中金公司 | - | 2,894.30 | 2,894.30 |
| 合计 | - | 29,166.91 | 29,166.91 |

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；
2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：C 类基金份额每日应计提的销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日 | |
|-------|---------------------------------------|-----------|--|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 6,175,361.80 | 12,525.36 | 1,109,773.98 | 14,903.95 |

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金期末不存在因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|--------|----------|----------------|--------|---------|---------------|
| 190401 | 19 农发 01 | 2019 年 7 月 2 日 | 98.54 | 5,000 | 492,700.00 |
| 190204 | 19 国开 04 | 2019 年 7 月 2 日 | 98.76 | 100,000 | 9,876,000.00 |
| 合计 | | | | 105,000 | 10,368,700.00 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益低于股票型基金，高于债券型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。

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

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | 4,999,000.00 | 4,912,000.00 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 4,999,000.00 | 4,912,000.00 |

以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2019年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|---------------|------|---------------|--------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 6,175,361.80 | - | - | - | 6,175,361.80 |
| 结算备付金 | 314,613.99 | - | - | - | 314,613.99 |
| 存出保证金 | 22,419.04 | - | - | - | 22,419.04 |
| 交易性金融资产-股票 投资 | - | - | - | 6,004,274.32 | 6,004,274.32 |
| 交易性金融资产-债券 投资 | 9,129,510.00 | - | 49,447,000.00 | - | 58,576,510.00 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 969,573.88 | 969,573.88 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 3,797.00 | 3,797.00 |
| 资产总计 | 15,641,904.83 | - | 49,447,000.00 | 6,977,645.20 | 72,066,550.03 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 10,079,784.88 | - | - | - | 10,079,784.88 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 3,860,939.08 | 3,860,939.08 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 21.59 | 21.59 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 81,389.58 | 81,389.58 |
| 应付托管费 | - | - | - | 15,780.91 | 15,780.91 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 108,234.01 | 108,234.01 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 4,483.26 | 4,483.26 |
| 应交税费 | - | - | - | 547.01 | 547.01 |
| 应付利息 | - | - | - | 5,155.32 | 5,155.32 |
| 其他负债 | - | - | - | 36,273.13 | 36,273.13 |
| 负债总计 | 10,079,784.88 | - | - | 4,112,823.89 | 14,192,608.77 |
| 利率敏感度缺口 | 5,562,119.95 | - | 49,447,000.00 | 2,864,821.31 | 57,873,941.26 |
| 上年度末 2018年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |

| | | | | | |
|------------------|---------------|---|---------------|---------------|---------------|
| 银行存款 | 128,013.01 | - | - | - | 128,013.01 |
| 结算备付金 | 871,877.08 | - | - | - | 871,877.08 |
| 存出保证金 | 26,941.80 | - | - | - | 26,941.80 |
| 交易性金融资产-股票 投资 | - | - | - | 23,744,429.69 | 23,744,429.69 |
| 交易性金融资产-债券 投资 | 11,942,800.00 | - | 52,325,000.00 | - | 64,267,800.00 |
| 买入返售金融资产 | 1,300,000.00 | - | - | - | 1,300,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 488,333.14 | 488,333.14 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,477,259.26 | 1,477,259.26 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 14,269,631.89 | - | 52,325,000.00 | 25,710,022.09 | 92,304,653.98 |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 575,098.22 | 575,098.22 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 15.23 | 15.23 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 124,732.79 | 124,732.79 |
| 应付托管费 | - | - | - | 20,788.81 | 20,788.81 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 64,114.95 | 64,114.95 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 6,942.28 | 6,942.28 |
| 应交税费 | - | - | - | 1,260.32 | 1,260.32 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 185,000.00 | 185,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 977,952.60 | 977,952.60 |
| 利率敏感度缺口 | 14,269,631.89 | - | 52,325,000.00 | 24,732,069.49 | 91,326,701.38 |

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。 | | |
| | 2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。 | | |
| | 3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2019 年 6 月 30 日） | 上年度末（2018 年 12 月 31 日） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 872,066.66 | 999,874.92 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -872,066.66 | -999,874.92 |

| | | | |
|--|----|--|--|
| | 基点 | | |
|--|----|--|--|

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 | | 上年度末 2018年12月31日 | |
|---------------|-------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 6,004,274.32 | 10.37 | 23,744,429.69 | 26.00 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | 58,576,510.00 | 101.21 | 64,267,800.00 | 70.37 |
| 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 | 64,580,784.32 | 111.59 | 88,012,229.69 | 96.37 |

6.4.13.4.3.2 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（2019年6月30日） | 上年度末（2018年12月31日） |
| | 业绩比较基准上升5% | 1,652,921.42 | - |
| 业绩比较基准下降5% | -1,652,921.42 | - | |

注：于上年度末，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

6.4.14 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) 金融工具公允价值计量的方法

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。

(b) 持续的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 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 6,004,274.32 元，属于第二层次的余额为 58,576,510.00 元，无属于第三层次的余额。(2018 年 12 月 31 日，第一层次 23,680,999.69 元，第二层次 64,331,230.00 元，无属于第三层次的余额)。

(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。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。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2018 年 12 月 31 日，无）。

(d) 其他金融工具的公允价值（年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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 6,004,274.32 | 8.33 |
| | 其中：股票 | 6,004,274.32 | 8.33 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 58,576,510.00 | 81.28 |
| | 其中：债券 | 58,576,510.00 | 81.28 |
| | 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 | 6,489,975.79 | 9.01 |
| 8 | 其他各项资产 | 995,789.92 | 1.38 |
| 9 | 合计 | 72,066,550.03 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 58,126.00 | 0.10 |
| B | 采矿业 | 762,342.20 | 1.32 |
| C | 制造业 | 2,056,447.92 | 3.55 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 941,695.00 | 1.63 |
| E | 建筑业 | 106,188.40 | 0.18 |
| F | 批发和零售业 | 123,065.40 | 0.21 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 226,061.00 | 0.39 |
| H | 住宿和餐饮业 | 6,060.00 | 0.01 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 244,586.40 | 0.42 |

| | | | |
|---|---------------|--------------|-------|
| J | 金融业 | 965,545.00 | 1.67 |
| K | 房地产业 | 335,574.00 | 0.58 |
| L | 租赁和商务服务业 | 60,316.00 | 0.10 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,731.00 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 18,271.00 | 0.03 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 5,647.00 | 0.01 |
| Q | 卫生和社会工作 | 26,522.00 | 0.05 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 44,182.00 | 0.08 |
| S | 综合 | 21,914.00 | 0.04 |
| | 合计 | 6,004,274.32 | 10.37 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|------------|--------------|
| 1 | 600027 | 华电国际 | 130,900 | 493,493.00 | 0.85 |
| 2 | 600547 | 山东黄金 | 11,000 | 452,870.00 | 0.78 |
| 3 | 600011 | 华能国际 | 55,100 | 343,273.00 | 0.59 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 2,200 | 194,942.00 | 0.34 |
| 5 | 601857 | 中国石油 | 26,400 | 181,632.00 | 0.31 |
| 6 | 000002 | 万科 A | 5,900 | 164,079.00 | 0.28 |
| 7 | 601766 | 中国中车 | 14,500 | 117,305.00 | 0.20 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 100 | 98,400.00 | 0.17 |
| 9 | 601006 | 大秦铁路 | 12,100 | 97,889.00 | 0.17 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 2,200 | 79,156.00 | 0.14 |
| 11 | 601166 | 兴业银行 | 3,100 | 56,699.00 | 0.10 |
| 12 | 000651 | 格力电器 | 1,000 | 55,000.00 | 0.10 |
| 13 | 000333 | 美的集团 | 915 | 47,451.90 | 0.08 |
| 14 | 000858 | 五粮液 | 400 | 47,180.00 | 0.08 |
| 15 | 600887 | 伊利股份 | 1,300 | 43,433.00 | 0.08 |
| 16 | 600276 | 恒瑞医药 | 600 | 39,600.00 | 0.07 |
| 17 | 600030 | 中信证券 | 1,600 | 38,096.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 18 | 601328 | 交通银行 | 5,800 | 35,496.00 | 0.06 |
| 19 | 600016 | 民生银行 | 5,200 | 33,020.00 | 0.06 |
| 20 | 600000 | 浦发银行 | 2,500 | 29,200.00 | 0.05 |
| 21 | 601288 | 农业银行 | 8,000 | 28,800.00 | 0.05 |
| 22 | 300498 | 温氏股份 | 800 | 28,688.00 | 0.05 |
| 23 | 601398 | 工商银行 | 4,600 | 27,094.00 | 0.05 |
| 24 | 601668 | 中国建筑 | 4,400 | 25,300.00 | 0.04 |
| 25 | 600900 | 长江电力 | 1,400 | 25,060.00 | 0.04 |
| 26 | 000001 | 平安银行 | 1,800 | 24,804.00 | 0.04 |
| 27 | 600837 | 海通证券 | 1,700 | 24,123.00 | 0.04 |
| 28 | 002415 | 海康威视 | 800 | 22,064.00 | 0.04 |
| 29 | 601601 | 中国太保 | 600 | 21,906.00 | 0.04 |
| 30 | 603288 | 海天味业 | 200 | 21,000.00 | 0.04 |
| 31 | 600048 | 保利地产 | 1,500 | 19,140.00 | 0.03 |
| 32 | 601169 | 北京银行 | 3,100 | 18,321.00 | 0.03 |
| 33 | 601688 | 华泰证券 | 800 | 17,856.00 | 0.03 |
| 34 | 600104 | 上汽集团 | 700 | 17,850.00 | 0.03 |
| 35 | 601888 | 中国国旅 | 200 | 17,730.00 | 0.03 |
| 36 | 000725 | 京东方 A | 5,000 | 17,200.00 | 0.03 |
| 37 | 600009 | 上海机场 | 200 | 16,756.00 | 0.03 |
| 38 | 600585 | 海螺水泥 | 400 | 16,600.00 | 0.03 |
| 39 | 601211 | 国泰君安 | 900 | 16,515.00 | 0.03 |
| 40 | 000063 | 中兴通讯 | 500 | 16,265.00 | 0.03 |
| 41 | 000568 | 泸州老窖 | 200 | 16,166.00 | 0.03 |
| 42 | 600028 | 中国石化 | 2,900 | 15,863.00 | 0.03 |
| 43 | 600031 | 三一重工 | 1,200 | 15,696.00 | 0.03 |
| 44 | 300059 | 东方财富 | 1,100 | 14,905.00 | 0.03 |
| 45 | 601088 | 中国神华 | 700 | 14,266.00 | 0.02 |
| 46 | 600690 | 青岛海尔 | 800 | 13,832.00 | 0.02 |
| 47 | 601229 | 上海银行 | 1,100 | 13,035.00 | 0.02 |
| 48 | 600340 | 华夏幸福 | 400 | 13,028.00 | 0.02 |
| 49 | 601818 | 光大银行 | 3,400 | 12,954.00 | 0.02 |
| 50 | 600309 | 万华化学 | 300 | 12,837.00 | 0.02 |
| 51 | 002475 | 立讯精密 | 500 | 12,395.00 | 0.02 |
| 52 | 600050 | 中国联通 | 2,000 | 12,320.00 | 0.02 |
| 53 | 000338 | 潍柴动力 | 1,000 | 12,290.00 | 0.02 |
| 54 | 002304 | 洋河股份 | 100 | 12,156.00 | 0.02 |
| 55 | 002142 | 宁波银行 | 500 | 12,120.00 | 0.02 |
| 56 | 002714 | 牧原股份 | 200 | 11,758.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|-------|-----------|------|
| 57 | 600019 | 宝钢股份 | 1,800 | 11,700.00 | 0.02 |
| 58 | 002027 | 分众传媒 | 2,200 | 11,638.00 | 0.02 |
| 59 | 601012 | 隆基股份 | 500 | 11,555.00 | 0.02 |
| 60 | 600436 | 片仔癀 | 100 | 11,520.00 | 0.02 |
| 61 | 002405 | 四维图新 | 700 | 11,270.00 | 0.02 |
| 62 | 601336 | 新华保险 | 200 | 11,006.00 | 0.02 |
| 63 | 601989 | 中国重工 | 1,900 | 10,564.00 | 0.02 |
| 64 | 001979 | 招商蛇口 | 500 | 10,450.00 | 0.02 |
| 65 | 601939 | 建设银行 | 1,400 | 10,416.00 | 0.02 |
| 66 | 600999 | 招商证券 | 600 | 10,254.00 | 0.02 |
| 67 | 601899 | 紫金矿业 | 2,700 | 10,179.00 | 0.02 |
| 68 | 600919 | 江苏银行 | 1,400 | 10,164.00 | 0.02 |
| 69 | 002594 | 比亚迪 | 200 | 10,144.00 | 0.02 |
| 70 | 600015 | 华夏银行 | 1,300 | 10,010.00 | 0.02 |
| 71 | 002230 | 科大讯飞 | 300 | 9,972.00 | 0.02 |
| 72 | 601009 | 南京银行 | 1,200 | 9,912.00 | 0.02 |
| 73 | 002821 | 凯莱英 | 100 | 9,808.00 | 0.02 |
| 74 | 601390 | 中国中铁 | 1,500 | 9,780.00 | 0.02 |
| 75 | 000100 | TCL 集团 | 2,900 | 9,657.00 | 0.02 |
| 76 | 000166 | 申万宏源 | 1,900 | 9,519.00 | 0.02 |
| 77 | 000860 | 顺鑫农业 | 200 | 9,330.00 | 0.02 |
| 78 | 300015 | 爱尔眼科 | 300 | 9,291.00 | 0.02 |
| 79 | 002024 | 苏宁易购 | 800 | 9,184.00 | 0.02 |
| 80 | 601186 | 中国铁建 | 900 | 8,955.00 | 0.02 |
| 81 | 600763 | 通策医疗 | 100 | 8,859.00 | 0.02 |
| 82 | 002049 | 紫光国芯 | 200 | 8,822.00 | 0.02 |
| 83 | 600872 | 中炬高新 | 200 | 8,566.00 | 0.01 |
| 84 | 600958 | 东方证券 | 800 | 8,544.00 | 0.01 |
| 85 | 300142 | 沃森生物 | 300 | 8,508.00 | 0.01 |
| 85 | 300253 | 卫宁健康 | 600 | 8,508.00 | 0.01 |
| 86 | 601628 | 中国人寿 | 300 | 8,496.00 | 0.01 |
| 87 | 601669 | 中国电建 | 1,600 | 8,464.00 | 0.01 |
| 88 | 000538 | 云南白药 | 100 | 8,342.00 | 0.01 |
| 89 | 002157 | 正邦科技 | 500 | 8,330.00 | 0.01 |
| 90 | 000776 | 广发证券 | 600 | 8,244.00 | 0.01 |
| 91 | 000066 | 长城电脑 | 800 | 8,224.00 | 0.01 |
| 92 | 002195 | 二三四五 | 2,100 | 8,169.00 | 0.01 |
| 93 | 601933 | 永辉超市 | 800 | 8,168.00 | 0.01 |
| 94 | 002439 | 启明星辰 | 300 | 8,070.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 95 | 600588 | 用友网络 | 300 | 8,064.00 | 0.01 |
| 96 | 601155 | 新城控股 | 200 | 7,962.00 | 0.01 |
| 97 | 600352 | 浙江龙盛 | 500 | 7,885.00 | 0.01 |
| 98 | 600201 | 生物股份 | 500 | 7,845.00 | 0.01 |
| 99 | 002129 | 中环股份 | 800 | 7,808.00 | 0.01 |
| 100 | 600183 | 生益科技 | 500 | 7,525.00 | 0.01 |
| 101 | 002202 | 金风科技 | 600 | 7,458.00 | 0.01 |
| 102 | 600406 | 国电南瑞 | 400 | 7,456.00 | 0.01 |
| 103 | 600426 | 华鲁恒升 | 500 | 7,430.00 | 0.01 |
| 104 | 601225 | 陕西煤业 | 800 | 7,392.00 | 0.01 |
| 105 | 002223 | 鱼跃医疗 | 300 | 7,386.00 | 0.01 |
| 106 | 002506 | 协鑫集成 | 1,100 | 7,348.00 | 0.01 |
| 107 | 002268 | 卫士通 | 300 | 7,335.00 | 0.01 |
| 107 | 300136 | 信维通信 | 300 | 7,335.00 | 0.01 |
| 108 | 600739 | 辽宁成大 | 500 | 7,270.00 | 0.01 |
| 109 | 600642 | 申能股份 | 1,200 | 7,212.00 | 0.01 |
| 110 | 002340 | 格林美 | 1,500 | 7,065.00 | 0.01 |
| 111 | 000401 | 冀东水泥 | 400 | 7,044.00 | 0.01 |
| 112 | 603019 | 中科曙光 | 200 | 7,020.00 | 0.01 |
| 113 | 603939 | 益丰药房 | 100 | 6,999.00 | 0.01 |
| 114 | 000876 | 新希望 | 400 | 6,948.00 | 0.01 |
| 115 | 002371 | 七星电子 | 100 | 6,925.00 | 0.01 |
| 116 | 600809 | 山西汾酒 | 100 | 6,905.00 | 0.01 |
| 117 | 002008 | 大族激光 | 200 | 6,876.00 | 0.01 |
| 118 | 600660 | 福耀玻璃 | 300 | 6,819.00 | 0.01 |
| 119 | 600570 | 恒生电子 | 100 | 6,815.00 | 0.01 |
| 120 | 002463 | 沪电股份 | 500 | 6,810.00 | 0.01 |
| 121 | 002127 | 南极电商 | 600 | 6,744.00 | 0.01 |
| 122 | 601377 | 兴业证券 | 1,000 | 6,740.00 | 0.01 |
| 123 | 300450 | 先导智能 | 200 | 6,720.00 | 0.01 |
| 124 | 300383 | 光环新网 | 400 | 6,708.00 | 0.01 |
| 125 | 002465 | 海格通信 | 700 | 6,678.00 | 0.01 |
| 126 | 600745 | 闻泰科技 | 200 | 6,644.00 | 0.01 |
| 127 | 000157 | 中联重科 | 1,100 | 6,611.00 | 0.01 |
| 128 | 000975 | 银泰资源 | 500 | 6,595.00 | 0.01 |
| 129 | 600010 | 宝钢股份 | 3,900 | 6,591.00 | 0.01 |
| 130 | 002736 | 国信证券 | 500 | 6,580.00 | 0.01 |
| 131 | 000623 | 吉林敖东 | 400 | 6,556.00 | 0.01 |
| 132 | 000750 | 国海证券 | 1,300 | 6,539.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 133 | 002500 | 山西证券 | 800 | 6,480.00 | 0.01 |
| 133 | 600741 | 华域汽车 | 300 | 6,480.00 | 0.01 |
| 134 | 600111 | 北方稀土 | 500 | 6,420.00 | 0.01 |
| 135 | 601901 | 方正证券 | 900 | 6,399.00 | 0.01 |
| 136 | 600795 | 国电电力 | 2,500 | 6,350.00 | 0.01 |
| 137 | 002385 | 大北农 | 1,200 | 6,348.00 | 0.01 |
| 138 | 002797 | 第一创业 | 1,000 | 6,340.00 | 0.01 |
| 139 | 000988 | 华工科技 | 400 | 6,328.00 | 0.01 |
| 140 | 600298 | 安琪酵母 | 200 | 6,326.00 | 0.01 |
| 141 | 002926 | 华西证券 | 600 | 6,300.00 | 0.01 |
| 142 | 002075 | 沙钢股份 | 800 | 6,272.00 | 0.01 |
| 143 | 000783 | 长江证券 | 800 | 6,248.00 | 0.01 |
| 144 | 600848 | 上海临港 | 200 | 6,226.00 | 0.01 |
| 145 | 002311 | 海大集团 | 200 | 6,180.00 | 0.01 |
| 146 | 600879 | 航天电子 | 1,000 | 6,160.00 | 0.01 |
| 147 | 600895 | 张江高科 | 300 | 6,156.00 | 0.01 |
| 148 | 002507 | 涪陵榨菜 | 200 | 6,100.00 | 0.01 |
| 149 | 002007 | 华兰生物 | 200 | 6,098.00 | 0.01 |
| 150 | 600801 | 华新水泥 | 300 | 6,075.00 | 0.01 |
| 151 | 600383 | 金地集团 | 500 | 5,965.00 | 0.01 |
| 152 | 600705 | 中航资本 | 1,100 | 5,962.00 | 0.01 |
| 153 | 002422 | 科伦药业 | 200 | 5,946.00 | 0.01 |
| 154 | 603993 | 洛阳钼业 | 1,500 | 5,940.00 | 0.01 |
| 155 | 000999 | 华润三九 | 200 | 5,868.00 | 0.01 |
| 156 | 603883 | 老百姓 | 100 | 5,848.00 | 0.01 |
| 157 | 002384 | 东山精密 | 400 | 5,828.00 | 0.01 |
| 158 | 002236 | 大华股份 | 400 | 5,808.00 | 0.01 |
| 159 | 600089 | 特变电工 | 800 | 5,800.00 | 0.01 |
| 160 | 000998 | 隆平高科 | 400 | 5,792.00 | 0.01 |
| 161 | 002001 | 新和成 | 300 | 5,787.00 | 0.01 |
| 162 | 600528 | 中铁工业 | 500 | 5,785.00 | 0.01 |
| 163 | 601111 | 中国国航 | 600 | 5,742.00 | 0.01 |
| 164 | 600549 | 厦门钨业 | 400 | 5,724.00 | 0.01 |
| 165 | 601800 | 中国交建 | 500 | 5,660.00 | 0.01 |
| 166 | 600703 | 三安光电 | 500 | 5,640.00 | 0.01 |
| 167 | 000060 | 中金岭南 | 1,200 | 5,628.00 | 0.01 |
| 168 | 600438 | 通威股份 | 400 | 5,624.00 | 0.01 |
| 169 | 600061 | 国投资本 | 400 | 5,604.00 | 0.01 |
| 170 | 600497 | 驰宏锌锗 | 1,100 | 5,588.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|----------|------|
| 171 | 603369 | 今世缘 | 200 | 5,578.00 | 0.01 |
| 172 | 002092 | 中泰化学 | 700 | 5,572.00 | 0.01 |
| 173 | 000581 | 威孚高科 | 300 | 5,568.00 | 0.01 |
| 173 | 002572 | 索菲亚 | 300 | 5,568.00 | 0.01 |
| 174 | 000069 | 华侨城 A | 800 | 5,560.00 | 0.01 |
| 174 | 601985 | 中国核电 | 1,000 | 5,560.00 | 0.01 |
| 175 | 600392 | 盛和资源 | 500 | 5,530.00 | 0.01 |
| 176 | 600673 | 东阳光 | 700 | 5,495.00 | 0.01 |
| 177 | 603501 | 韦尔股份 | 100 | 5,491.00 | 0.01 |
| 178 | 601108 | 财通证券 | 500 | 5,490.00 | 0.01 |
| 179 | 601600 | 中国铝业 | 1,400 | 5,488.00 | 0.01 |
| 180 | 600486 | 扬农化工 | 100 | 5,470.00 | 0.01 |
| 181 | 600325 | 华发股份 | 700 | 5,467.00 | 0.01 |
| 182 | 600606 | 绿地控股 | 800 | 5,464.00 | 0.01 |
| 183 | 000830 | 鲁西化工 | 500 | 5,440.00 | 0.01 |
| 184 | 600886 | 国投电力 | 700 | 5,439.00 | 0.01 |
| 185 | 300294 | 博雅生物 | 200 | 5,430.00 | 0.01 |
| 186 | 600029 | 南方航空 | 700 | 5,404.00 | 0.01 |
| 186 | 601128 | 常熟银行 | 700 | 5,404.00 | 0.01 |
| 187 | 600536 | 中国软件 | 100 | 5,367.00 | 0.01 |
| 188 | 600410 | 华胜天成 | 500 | 5,365.00 | 0.01 |
| 189 | 600376 | 首开股份 | 600 | 5,358.00 | 0.01 |
| 190 | 000778 | 新兴铸管 | 1,200 | 5,328.00 | 0.01 |
| 191 | 600875 | 东方电气 | 500 | 5,310.00 | 0.01 |
| 192 | 002281 | 光迅科技 | 200 | 5,296.00 | 0.01 |
| 193 | 000686 | 东北证券 | 600 | 5,286.00 | 0.01 |
| 194 | 600909 | 华安证券 | 800 | 5,232.00 | 0.01 |
| 195 | 601005 | 重庆钢铁 | 2,600 | 5,226.00 | 0.01 |
| 196 | 000723 | 美锦能源 | 500 | 5,225.00 | 0.01 |
| 197 | 002372 | 伟星新材 | 300 | 5,220.00 | 0.01 |
| 197 | 002387 | 黑牛食品 | 400 | 5,220.00 | 0.01 |
| 198 | 600166 | 福田汽车 | 2,200 | 5,214.00 | 0.01 |
| 199 | 300168 | 万达信息 | 400 | 5,188.00 | 0.01 |
| 200 | 600755 | 厦门国贸 | 600 | 5,178.00 | 0.01 |
| 201 | 000690 | 宝新能源 | 800 | 5,152.00 | 0.01 |
| 202 | 600584 | 长电科技 | 400 | 5,140.00 | 0.01 |
| 203 | 000009 | 中国宝安 | 900 | 5,139.00 | 0.01 |
| 204 | 002373 | 千方科技 | 300 | 5,130.00 | 0.01 |
| 205 | 600718 | 东软集团 | 400 | 5,128.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 206 | 000039 | 中集集团 | 480 | 5,126.40 | 0.01 |
| 207 | 601555 | 东吴证券 | 500 | 5,125.00 | 0.01 |
| 208 | 600572 | 康恩贝 | 800 | 5,120.00 | 0.01 |
| 209 | 601168 | 西部矿业 | 800 | 5,104.00 | 0.01 |
| 210 | 600779 | 水井坊 | 100 | 5,082.00 | 0.01 |
| 211 | 600221 | 海航控股 | 2,500 | 5,075.00 | 0.01 |
| 212 | 000997 | 新大陆 | 300 | 5,067.00 | 0.01 |
| 213 | 002299 | 圣农发展 | 200 | 5,064.00 | 0.01 |
| 214 | 600196 | 复星医药 | 200 | 5,060.00 | 0.01 |
| 215 | 600820 | 隧道股份 | 800 | 5,048.00 | 0.01 |
| 216 | 002670 | 国盛金控 | 400 | 5,040.00 | 0.01 |
| 217 | 600487 | 亨通光电 | 300 | 5,028.00 | 0.01 |
| 218 | 600115 | 东方航空 | 800 | 5,016.00 | 0.01 |
| 219 | 600022 | 山东钢铁 | 3,000 | 5,010.00 | 0.01 |
| 220 | 600460 | 士兰微 | 300 | 4,980.00 | 0.01 |
| 221 | 000895 | 双汇发展 | 200 | 4,978.00 | 0.01 |
| 222 | 002044 | 美年健康 | 400 | 4,976.00 | 0.01 |
| 223 | 002191 | 劲嘉股份 | 400 | 4,964.00 | 0.01 |
| 224 | 300027 | 华谊兄弟 | 1,000 | 4,910.00 | 0.01 |
| 225 | 601866 | 中远海发 | 1,800 | 4,896.00 | 0.01 |
| 226 | 600959 | 江苏有线 | 1,100 | 4,895.00 | 0.01 |
| 227 | 600109 | 国金证券 | 500 | 4,860.00 | 0.01 |
| 227 | 600885 | 宏发股份 | 200 | 4,860.00 | 0.01 |
| 228 | 601333 | 广深铁路 | 1,500 | 4,845.00 | 0.01 |
| 229 | 600811 | 东方集团 | 1,300 | 4,836.00 | 0.01 |
| 230 | 601872 | 招商轮船 | 1,100 | 4,796.00 | 0.01 |
| 231 | 000547 | 航天发展 | 500 | 4,780.00 | 0.01 |
| 232 | 600018 | 上港集团 | 700 | 4,774.00 | 0.01 |
| 233 | 300009 | 安科生物 | 300 | 4,770.00 | 0.01 |
| 234 | 002078 | 太阳纸业 | 700 | 4,767.00 | 0.01 |
| 235 | 000768 | 中航飞机 | 300 | 4,725.00 | 0.01 |
| 236 | 600839 | 四川长虹 | 1,600 | 4,720.00 | 0.01 |
| 237 | 600567 | 山鹰纸业 | 1,400 | 4,718.00 | 0.01 |
| 238 | 002038 | 双鹭药业 | 200 | 4,712.00 | 0.01 |
| 239 | 603659 | 璞泰来 | 100 | 4,702.00 | 0.01 |
| 240 | 002460 | 赣锋锂业 | 200 | 4,686.00 | 0.01 |
| 241 | 002812 | 创新股份 | 100 | 4,675.00 | 0.01 |
| 242 | 002273 | 水晶光电 | 400 | 4,632.00 | 0.01 |
| 243 | 000413 | 东旭光电 | 900 | 4,626.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 244 | 002353 | 杰瑞股份 | 200 | 4,620.00 | 0.01 |
| 244 | 600867 | 通化东宝 | 300 | 4,620.00 | 0.01 |
| 245 | 601877 | 正泰电器 | 200 | 4,618.00 | 0.01 |
| 246 | 600271 | 航天信息 | 200 | 4,610.00 | 0.01 |
| 247 | 300003 | 乐普医疗 | 200 | 4,604.00 | 0.01 |
| 248 | 600522 | 中天科技 | 500 | 4,585.00 | 0.01 |
| 249 | 300124 | 汇川技术 | 200 | 4,582.00 | 0.01 |
| 250 | 601788 | 光大证券 | 400 | 4,568.00 | 0.01 |
| 251 | 601618 | 中国中冶 | 1,500 | 4,560.00 | 0.01 |
| 251 | 603077 | 和邦生物 | 2,400 | 4,560.00 | 0.01 |
| 252 | 600881 | 亚泰集团 | 1,400 | 4,550.00 | 0.01 |
| 253 | 600161 | 天坛生物 | 180 | 4,545.00 | 0.01 |
| 254 | 600893 | 航发动力 | 200 | 4,542.00 | 0.01 |
| 255 | 000970 | 中科三环 | 400 | 4,540.00 | 0.01 |
| 256 | 002271 | 东方雨虹 | 200 | 4,532.00 | 0.01 |
| 257 | 600100 | 同方股份 | 500 | 4,525.00 | 0.01 |
| 258 | 600804 | 鹏博士 | 600 | 4,512.00 | 0.01 |
| 259 | 601021 | 春秋航空 | 100 | 4,500.00 | 0.01 |
| 260 | 600435 | 北方导航 | 500 | 4,495.00 | 0.01 |
| 261 | 600967 | 内蒙一机 | 400 | 4,480.00 | 0.01 |
| 262 | 000960 | 锡业股份 | 400 | 4,468.00 | 0.01 |
| 263 | 000425 | 徐工机械 | 1,000 | 4,460.00 | 0.01 |
| 264 | 600177 | 雅戈尔 | 700 | 4,445.00 | 0.01 |
| 265 | 600808 | 马钢股份 | 1,300 | 4,433.00 | 0.01 |
| 266 | 002217 | 合力泰 | 800 | 4,424.00 | 0.01 |
| 267 | 600094 | 大名城 | 700 | 4,403.00 | 0.01 |
| 268 | 002085 | 万丰奥威 | 600 | 4,368.00 | 0.01 |
| 269 | 600466 | 蓝光发展 | 700 | 4,354.00 | 0.01 |
| 270 | 600021 | 上海电力 | 500 | 4,340.00 | 0.01 |
| 270 | 600737 | 中粮糖业 | 500 | 4,340.00 | 0.01 |
| 271 | 002002 | 鸿达兴业 | 700 | 4,333.00 | 0.01 |
| 272 | 300017 | 网宿科技 | 400 | 4,312.00 | 0.01 |
| 273 | 300122 | 智飞生物 | 100 | 4,310.00 | 0.01 |
| 274 | 002221 | 东华能源 | 500 | 4,305.00 | 0.01 |
| 275 | 600064 | 南京高科 | 400 | 4,284.00 | 0.01 |
| 276 | 600699 | 均胜电子 | 200 | 4,272.00 | 0.01 |
| 277 | 600160 | 巨化股份 | 600 | 4,266.00 | 0.01 |
| 278 | 000878 | 云南铜业 | 400 | 4,252.00 | 0.01 |
| 279 | 000983 | 西山煤电 | 700 | 4,242.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 280 | 600521 | 华海药业 | 300 | 4,230.00 | 0.01 |
| 281 | 600637 | 东方明珠 | 400 | 4,216.00 | 0.01 |
| 282 | 600079 | 人福医药 | 400 | 4,200.00 | 0.01 |
| 282 | 600282 | 南钢股份 | 1,200 | 4,200.00 | 0.01 |
| 283 | 002399 | 海普瑞 | 200 | 4,198.00 | 0.01 |
| 284 | 600648 | 外高桥 | 200 | 4,196.00 | 0.01 |
| 285 | 603866 | 桃李面包 | 100 | 4,165.00 | 0.01 |
| 286 | 300315 | 掌趣科技 | 1,200 | 4,140.00 | 0.01 |
| 287 | 002607 | 亚夏汽车 | 300 | 4,119.00 | 0.01 |
| 288 | 600563 | 法拉电子 | 100 | 4,117.00 | 0.01 |
| 289 | 600489 | 中金黄金 | 400 | 4,108.00 | 0.01 |
| 290 | 600038 | 中直股份 | 100 | 4,102.00 | 0.01 |
| 291 | 600037 | 歌华有线 | 400 | 4,100.00 | 0.01 |
| 292 | 600332 | 白云山 | 100 | 4,097.00 | 0.01 |
| 293 | 600158 | 中体产业 | 400 | 4,092.00 | 0.01 |
| 294 | 600863 | 内蒙华电 | 1,300 | 4,082.00 | 0.01 |
| 295 | 300088 | 长信科技 | 800 | 4,048.00 | 0.01 |
| 296 | 002673 | 西部证券 | 400 | 4,032.00 | 0.01 |
| 297 | 600259 | 广晟有色 | 100 | 4,030.00 | 0.01 |
| 297 | 600266 | 北京城建 | 500 | 4,030.00 | 0.01 |
| 298 | 002155 | 湖南黄金 | 400 | 4,028.00 | 0.01 |
| 299 | 601919 | 中远海控 | 800 | 4,016.00 | 0.01 |
| 300 | 002131 | 利欧股份 | 2,100 | 4,011.00 | 0.01 |
| 301 | 603228 | 景旺电子 | 100 | 4,001.00 | 0.01 |
| 302 | 000563 | 陕国投A | 900 | 3,996.00 | 0.01 |
| 302 | 600260 | 凯乐科技 | 200 | 3,996.00 | 0.01 |
| 303 | 000729 | 燕京啤酒 | 600 | 3,984.00 | 0.01 |
| 304 | 000423 | 东阿阿胶 | 100 | 3,982.00 | 0.01 |
| 305 | 601699 | 潞安环能 | 500 | 3,970.00 | 0.01 |
| 306 | 002074 | 国轩高科 | 300 | 3,933.00 | 0.01 |
| 307 | 600143 | 金发科技 | 800 | 3,920.00 | 0.01 |
| 308 | 601718 | 际华集团 | 1,000 | 3,910.00 | 0.01 |
| 309 | 000883 | 湖北能源 | 900 | 3,906.00 | 0.01 |
| 309 | 600066 | 宇通客车 | 300 | 3,906.00 | 0.01 |
| 310 | 600026 | 中远海能 | 600 | 3,894.00 | 0.01 |
| 311 | 603517 | 绝味食品 | 100 | 3,891.00 | 0.01 |
| 312 | 300408 | 三环集团 | 200 | 3,890.00 | 0.01 |
| 313 | 600649 | 城投控股 | 600 | 3,882.00 | 0.01 |
| 314 | 300418 | 昆仑万维 | 300 | 3,861.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 315 | 002414 | 高德红外 | 200 | 3,840.00 | 0.01 |
| 316 | 600643 | 爱建集团 | 400 | 3,832.00 | 0.01 |
| 317 | 600176 | 中国巨石 | 400 | 3,812.00 | 0.01 |
| 318 | 300316 | 晶盛机电 | 300 | 3,807.00 | 0.01 |
| 318 | 600138 | 中青旅 | 300 | 3,807.00 | 0.01 |
| 319 | 002589 | 瑞康医药 | 500 | 3,795.00 | 0.01 |
| 320 | 601098 | 中南传媒 | 300 | 3,792.00 | 0.01 |
| 321 | 600373 | 中文传媒 | 300 | 3,768.00 | 0.01 |
| 321 | 601106 | 中国一重 | 1,200 | 3,768.00 | 0.01 |
| 322 | 601727 | 上海电气 | 700 | 3,766.00 | 0.01 |
| 323 | 000930 | 中粮生化 | 500 | 3,760.00 | 0.01 |
| 324 | 002146 | 荣盛发展 | 400 | 3,756.00 | 0.01 |
| 325 | 300274 | 阳光电源 | 400 | 3,740.00 | 0.01 |
| 326 | 002440 | 闰土股份 | 300 | 3,738.00 | 0.01 |
| 326 | 600068 | 葛洲坝 | 600 | 3,738.00 | 0.01 |
| 327 | 600500 | 中化国际 | 500 | 3,735.00 | 0.01 |
| 328 | 002110 | 三钢闽光 | 400 | 3,720.00 | 0.01 |
| 329 | 600388 | 龙净环保 | 300 | 3,717.00 | 0.01 |
| 330 | 603156 | 养元饮品 | 100 | 3,708.00 | 0.01 |
| 331 | 600845 | 宝信软件 | 130 | 3,702.40 | 0.01 |
| 332 | 002739 | 万达电影 | 200 | 3,688.00 | 0.01 |
| 333 | 300166 | 东方国信 | 300 | 3,687.00 | 0.01 |
| 334 | 002019 | 亿帆医药 | 300 | 3,675.00 | 0.01 |
| 334 | 601881 | 中国银河 | 300 | 3,675.00 | 0.01 |
| 335 | 603806 | 福斯特 | 100 | 3,673.00 | 0.01 |
| 336 | 000728 | 国元证券 | 400 | 3,668.00 | 0.01 |
| 337 | 600516 | 方大炭素 | 298 | 3,662.42 | 0.01 |
| 338 | 000598 | 兴蓉环境 | 800 | 3,640.00 | 0.01 |
| 338 | 600004 | 白云机场 | 200 | 3,640.00 | 0.01 |
| 338 | 600039 | 四川路桥 | 1,000 | 3,640.00 | 0.01 |
| 339 | 000963 | 华东医药 | 140 | 3,634.40 | 0.01 |
| 340 | 000636 | 风华高科 | 300 | 3,630.00 | 0.01 |
| 340 | 601607 | 上海医药 | 200 | 3,630.00 | 0.01 |
| 341 | 600398 | 海澜之家 | 400 | 3,628.00 | 0.01 |
| 342 | 000786 | 北新建材 | 200 | 3,626.00 | 0.01 |
| 343 | 002153 | 石基信息 | 100 | 3,619.00 | 0.01 |
| 344 | 002493 | 荣盛石化 | 300 | 3,618.00 | 0.01 |
| 345 | 601231 | 环旭电子 | 300 | 3,615.00 | 0.01 |
| 346 | 601118 | 海南橡胶 | 700 | 3,605.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 347 | 300001 | 特锐德 | 200 | 3,604.00 | 0.01 |
| 348 | 600258 | 首旅酒店 | 200 | 3,596.00 | 0.01 |
| 349 | 000559 | 万向钱潮 | 600 | 3,588.00 | 0.01 |
| 350 | 601998 | 中信银行 | 600 | 3,582.00 | 0.01 |
| 351 | 601000 | 唐山港 | 1,300 | 3,575.00 | 0.01 |
| 352 | 603000 | 人民网 | 200 | 3,566.00 | 0.01 |
| 353 | 601198 | 东兴证券 | 300 | 3,564.00 | 0.01 |
| 354 | 600674 | 川投能源 | 400 | 3,560.00 | 0.01 |
| 355 | 000089 | 深圳机场 | 400 | 3,556.00 | 0.01 |
| 355 | 002241 | 歌尔股份 | 400 | 3,556.00 | 0.01 |
| 356 | 000826 | 启迪桑德 | 300 | 3,537.00 | 0.01 |
| 357 | 600023 | 浙能电力 | 800 | 3,536.00 | 0.01 |
| 358 | 601838 | 成都银行 | 400 | 3,532.00 | 0.01 |
| 359 | 300182 | 捷成股份 | 800 | 3,528.00 | 0.01 |
| 360 | 600008 | 首创股份 | 1,000 | 3,520.00 | 0.01 |
| 361 | 601018 | 宁波港 | 800 | 3,512.00 | 0.01 |
| 362 | 002233 | 塔牌集团 | 300 | 3,504.00 | 0.01 |
| 363 | 600782 | 新钢股份 | 700 | 3,500.00 | 0.01 |
| 364 | 000877 | 天山股份 | 300 | 3,486.00 | 0.01 |
| 365 | 002603 | 以岭药业 | 300 | 3,474.00 | 0.01 |
| 366 | 600515 | 海航基础 | 700 | 3,465.00 | 0.01 |
| 367 | 000961 | 中南建设 | 400 | 3,464.00 | 0.01 |
| 368 | 600380 | 健康元 | 400 | 3,460.00 | 0.01 |
| 368 | 601997 | 贵阳银行 | 400 | 3,460.00 | 0.01 |
| 369 | 300207 | 欣旺达 | 300 | 3,456.00 | 0.01 |
| 369 | 601608 | 中信重工 | 800 | 3,456.00 | 0.01 |
| 370 | 002152 | 广电运通 | 500 | 3,425.00 | 0.01 |
| 371 | 000685 | 中山公用 | 400 | 3,416.00 | 0.01 |
| 371 | 300058 | 蓝色光标 | 800 | 3,416.00 | 0.01 |
| 372 | 600346 | 恒力石化 | 280 | 3,404.80 | 0.01 |
| 373 | 002004 | 华邦健康 | 700 | 3,402.00 | 0.01 |
| 374 | 601966 | 玲珑轮胎 | 200 | 3,400.00 | 0.01 |
| 375 | 300308 | 中际装备 | 100 | 3,399.00 | 0.01 |
| 376 | 002352 | 顺风控股 | 100 | 3,396.00 | 0.01 |
| 376 | 300244 | 迪安诊断 | 200 | 3,396.00 | 0.01 |
| 377 | 600219 | 南山铝业 | 1,500 | 3,390.00 | 0.01 |
| 378 | 600170 | 上海建工 | 900 | 3,384.00 | 0.01 |
| 379 | 601678 | 滨化股份 | 500 | 3,380.00 | 0.01 |
| 380 | 002174 | 游族网络 | 200 | 3,376.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 381 | 300133 | 华策影视 | 500 | 3,365.00 | 0.01 |
| 382 | 002583 | 海能达 | 400 | 3,356.00 | 0.01 |
| 383 | 002179 | 中航光电 | 100 | 3,346.00 | 0.01 |
| 384 | 000932 | 华菱钢铁 | 700 | 3,339.00 | 0.01 |
| 384 | 002183 | 怡亚通 | 700 | 3,339.00 | 0.01 |
| 385 | 600926 | 杭州银行 | 400 | 3,332.00 | 0.01 |
| 386 | 000528 | 柳工 | 500 | 3,330.00 | 0.01 |
| 386 | 601179 | 中国西电 | 900 | 3,330.00 | 0.01 |
| 387 | 002250 | 联化科技 | 300 | 3,327.00 | 0.01 |
| 388 | 002266 | 浙富控股 | 700 | 3,325.00 | 0.01 |
| 389 | 000513 | 丽珠集团 | 100 | 3,323.00 | 0.01 |
| 390 | 600748 | 上实发展 | 400 | 3,316.00 | 0.01 |
| 391 | 600535 | 天士力 | 200 | 3,310.00 | 0.01 |
| 392 | 000156 | 华数传媒 | 300 | 3,303.00 | 0.01 |
| 393 | 000732 | 泰禾集团 | 200 | 3,300.00 | 0.01 |
| 394 | 000758 | 中色股份 | 600 | 3,294.00 | 0.01 |
| 395 | 002773 | 康弘药业 | 100 | 3,292.00 | 0.01 |
| 396 | 002410 | 广联达 | 100 | 3,289.00 | 0.01 |
| 397 | 000807 | 云铝股份 | 700 | 3,283.00 | 0.01 |
| 398 | 002602 | 世纪华通 | 300 | 3,276.00 | 0.01 |
| 399 | 002690 | 美亚光电 | 100 | 3,260.00 | 0.01 |
| 400 | 600171 | 上海贝岭 | 200 | 3,250.00 | 0.01 |
| 401 | 600823 | 世茂股份 | 700 | 3,227.00 | 0.01 |
| 402 | 600597 | 光明乳业 | 300 | 3,225.00 | 0.01 |
| 402 | 603515 | 欧普照明 | 100 | 3,225.00 | 0.01 |
| 403 | 600598 | 北大荒 | 300 | 3,219.00 | 0.01 |
| 404 | 000488 | 晨鸣纸业 | 600 | 3,216.00 | 0.01 |
| 405 | 600970 | 中材国际 | 500 | 3,215.00 | 0.01 |
| 406 | 000869 | 张裕A | 100 | 3,212.00 | 0.01 |
| 407 | 000031 | 中粮地产 | 500 | 3,210.00 | 0.01 |
| 408 | 000630 | 铜陵有色 | 1,300 | 3,198.00 | 0.01 |
| 409 | 603816 | 顾家家居 | 100 | 3,192.00 | 0.01 |
| 410 | 600167 | 联美控股 | 300 | 3,174.00 | 0.01 |
| 411 | 002050 | 三花智控 | 300 | 3,165.00 | 0.01 |
| 412 | 600525 | 长园集团 | 500 | 3,160.00 | 0.01 |
| 413 | 600362 | 江西铜业 | 200 | 3,148.00 | 0.01 |
| 414 | 601100 | 恒立液压 | 100 | 3,138.00 | 0.01 |
| 415 | 002456 | 欧菲科技 | 400 | 3,136.00 | 0.01 |
| 415 | 300113 | 顺网科技 | 200 | 3,136.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|-------|----------|------|
| 416 | 300296 | 利亚德 | 400 | 3,132.00 | 0.01 |
| 416 | 600977 | 中国电影 | 200 | 3,132.00 | 0.01 |
| 417 | 600297 | 广汇汽车 | 700 | 3,122.00 | 0.01 |
| 418 | 600777 | 新潮能源 | 1,500 | 3,120.00 | 0.01 |
| 419 | 300070 | 碧水源 | 400 | 3,116.00 | 0.01 |
| 420 | 600315 | 上海家化 | 100 | 3,115.00 | 0.01 |
| 421 | 300134 | 大富科技 | 200 | 3,106.00 | 0.01 |
| 422 | 000027 | 深圳能源 | 500 | 3,100.00 | 0.01 |
| 422 | 002408 | 齐翔腾达 | 400 | 3,100.00 | 0.01 |
| 422 | 600663 | 陆家嘴 | 200 | 3,100.00 | 0.01 |
| 423 | 600418 | 江淮汽车 | 600 | 3,096.00 | 0.01 |
| 424 | 002081 | 金螳螂 | 300 | 3,093.00 | 0.01 |
| 425 | 002120 | 新海股份 | 100 | 3,082.00 | 0.01 |
| 426 | 600312 | 平高电气 | 400 | 3,076.00 | 0.01 |
| 427 | 600216 | 浙江医药 | 300 | 3,072.00 | 0.01 |
| 428 | 000629 | *ST 钒钛 | 900 | 3,051.00 | 0.01 |
| 429 | 000813 | 德展健康 | 400 | 3,048.00 | 0.01 |
| 430 | 300024 | 机器人 | 200 | 3,046.00 | 0.01 |
| 431 | 002056 | 横店东磁 | 400 | 3,040.00 | 0.01 |
| 432 | 600859 | 王府井 | 200 | 3,038.00 | 0.01 |
| 433 | 002368 | 太极股份 | 100 | 3,030.00 | 0.01 |
| 434 | 600729 | 重庆百货 | 100 | 3,024.00 | 0.01 |
| 435 | 000008 | 神州高铁 | 800 | 3,016.00 | 0.01 |
| 436 | 000090 | 天健集团 | 610 | 3,013.40 | 0.01 |
| 437 | 002064 | 华峰氨纶 | 600 | 3,012.00 | 0.01 |
| 438 | 600566 | 济川药业 | 100 | 3,011.00 | 0.01 |
| 439 | 600267 | 海正药业 | 300 | 3,000.00 | 0.01 |
| 440 | 601880 | 大连港 | 1,400 | 2,982.00 | 0.01 |
| 441 | 600557 | 康缘药业 | 200 | 2,972.00 | 0.01 |
| 442 | 600369 | 西南证券 | 600 | 2,964.00 | 0.01 |
| 443 | 600827 | 百联股份 | 300 | 2,943.00 | 0.01 |
| 444 | 002938 | 鹏鼎控股 | 100 | 2,936.00 | 0.01 |
| 445 | 600507 | 方大特钢 | 300 | 2,934.00 | 0.01 |
| 446 | 600277 | 亿利洁能 | 600 | 2,922.00 | 0.01 |
| 447 | 002244 | 滨江集团 | 700 | 2,905.00 | 0.01 |
| 447 | 600348 | 阳泉煤业 | 500 | 2,905.00 | 0.01 |
| 448 | 600760 | 中航沈飞 | 100 | 2,903.00 | 0.01 |
| 449 | 600085 | 同仁堂 | 100 | 2,900.00 | 0.01 |
| 450 | 600664 | 哈药股份 | 700 | 2,898.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 451 | 000887 | 中鼎股份 | 300 | 2,877.00 | 0.00 |
| 452 | 600316 | 洪都航空 | 200 | 2,862.00 | 0.00 |
| 453 | 601717 | 郑煤机 | 500 | 2,855.00 | 0.00 |
| 454 | 600307 | 酒钢宏兴 | 1,400 | 2,842.00 | 0.00 |
| 455 | 600409 | 三友化工 | 500 | 2,830.00 | 0.00 |
| 456 | 600208 | 新湖中宝 | 900 | 2,826.00 | 0.00 |
| 457 | 300010 | 立思辰 | 300 | 2,817.00 | 0.00 |
| 458 | 002426 | 胜利精密 | 1,100 | 2,816.00 | 0.00 |
| 459 | 600633 | 浙数文化 | 300 | 2,805.00 | 0.00 |
| 460 | 002701 | 奥瑞金 | 600 | 2,802.00 | 0.00 |
| 461 | 600583 | 海油工程 | 500 | 2,800.00 | 0.00 |
| 462 | 002065 | 东华软件 | 400 | 2,796.00 | 0.00 |
| 463 | 600478 | 科力远 | 500 | 2,795.00 | 0.00 |
| 464 | 600694 | 大商股份 | 100 | 2,791.00 | 0.00 |
| 465 | 601878 | 浙商证券 | 300 | 2,790.00 | 0.00 |
| 466 | 300002 | 神州泰岳 | 700 | 2,786.00 | 0.00 |
| 466 | 600498 | 烽火通信 | 100 | 2,786.00 | 0.00 |
| 467 | 300026 | 红日药业 | 800 | 2,760.00 | 0.00 |
| 467 | 600073 | 上海梅林 | 300 | 2,760.00 | 0.00 |
| 468 | 000301 | 东方市场 | 500 | 2,745.00 | 0.00 |
| 469 | 002212 | 南洋股份 | 200 | 2,740.00 | 0.00 |
| 470 | 000703 | 恒逸石化 | 200 | 2,732.00 | 0.00 |
| 471 | 000938 | 紫光股份 | 100 | 2,725.00 | 0.00 |
| 472 | 601200 | 上海环境 | 200 | 2,722.00 | 0.00 |
| 473 | 000400 | 许继电气 | 300 | 2,718.00 | 0.00 |
| 474 | 002508 | 老板电器 | 100 | 2,714.00 | 0.00 |
| 475 | 002665 | 首航节能 | 800 | 2,712.00 | 0.00 |
| 476 | 000158 | 常山股份 | 500 | 2,710.00 | 0.00 |
| 476 | 002555 | 三七互娱 | 200 | 2,710.00 | 0.00 |
| 477 | 600759 | 洲际油气 | 700 | 2,702.00 | 0.00 |
| 478 | 600056 | 中国医药 | 200 | 2,698.00 | 0.00 |
| 479 | 000709 | 河钢股份 | 900 | 2,691.00 | 0.00 |
| 480 | 600155 | 华创阳安 | 200 | 2,686.00 | 0.00 |
| 481 | 000738 | 航发控制 | 200 | 2,680.00 | 0.00 |
| 481 | 601958 | 金钼股份 | 400 | 2,680.00 | 0.00 |
| 482 | 600153 | 建发股份 | 300 | 2,664.00 | 0.00 |
| 483 | 000625 | 长安汽车 | 400 | 2,652.00 | 0.00 |
| 484 | 600575 | 皖江物流 | 900 | 2,637.00 | 0.00 |
| 485 | 601992 | 金隅集团 | 700 | 2,632.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 486 | 603885 | 吉祥航空 | 200 | 2,620.00 | 0.00 |
| 487 | 002419 | 天虹商场 | 200 | 2,612.00 | 0.00 |
| 488 | 002544 | 杰赛科技 | 200 | 2,600.00 | 0.00 |
| 489 | 000627 | 天茂集团 | 400 | 2,596.00 | 0.00 |
| 490 | 002128 | 露天煤业 | 300 | 2,595.00 | 0.00 |
| 491 | 600060 | 海信电器 | 300 | 2,586.00 | 0.00 |
| 492 | 002624 | 完美世界 | 100 | 2,581.00 | 0.00 |
| 493 | 600125 | 铁龙物流 | 400 | 2,580.00 | 0.00 |
| 493 | 600688 | 上海石化 | 500 | 2,580.00 | 0.00 |
| 494 | 603858 | 步长制药 | 100 | 2,577.00 | 0.00 |
| 495 | 000712 | 锦龙股份 | 200 | 2,568.00 | 0.00 |
| 495 | 600717 | 天津港 | 400 | 2,568.00 | 0.00 |
| 496 | 002280 | 联络互动 | 700 | 2,562.00 | 0.00 |
| 497 | 002317 | 众生药业 | 300 | 2,553.00 | 0.00 |
| 498 | 002470 | 金正大 | 700 | 2,548.00 | 0.00 |
| 498 | 600120 | 浙江东方 | 200 | 2,548.00 | 0.00 |
| 499 | 600751 | 海航科技 | 800 | 2,544.00 | 0.00 |
| 500 | 002466 | 天齐锂业 | 100 | 2,528.00 | 0.00 |
| 501 | 600816 | 安信信托 | 500 | 2,525.00 | 0.00 |
| 502 | 600580 | 卧龙电驱 | 300 | 2,523.00 | 0.00 |
| 503 | 600062 | 华润双鹤 | 200 | 2,522.00 | 0.00 |
| 504 | 600017 | 日照港 | 800 | 2,520.00 | 0.00 |
| 505 | 300197 | 铁汉生态 | 700 | 2,513.00 | 0.00 |
| 506 | 000727 | 华东科技 | 1,200 | 2,508.00 | 0.00 |
| 507 | 000848 | 承德露露 | 300 | 2,499.00 | 0.00 |
| 507 | 002640 | 跨境通 | 300 | 2,499.00 | 0.00 |
| 508 | 002468 | 艾迪西 | 100 | 2,494.00 | 0.00 |
| 509 | 600317 | 营口港 | 900 | 2,484.00 | 0.00 |
| 510 | 601633 | 长城汽车 | 300 | 2,481.00 | 0.00 |
| 511 | 600415 | 小商品城 | 600 | 2,472.00 | 0.00 |
| 512 | 000959 | 首钢股份 | 700 | 2,464.00 | 0.00 |
| 512 | 600754 | 锦江股份 | 100 | 2,464.00 | 0.00 |
| 513 | 600338 | 西藏珠峰 | 140 | 2,447.20 | 0.00 |
| 514 | 000021 | 深科技 | 300 | 2,439.00 | 0.00 |
| 515 | 000078 | 海王生物 | 700 | 2,436.00 | 0.00 |
| 515 | 600901 | 江苏租赁 | 400 | 2,436.00 | 0.00 |
| 516 | 002176 | 江特电机 | 500 | 2,435.00 | 0.00 |
| 517 | 002491 | 通鼎互联 | 300 | 2,427.00 | 0.00 |
| 518 | 000718 | 苏宁环球 | 700 | 2,422.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|-------|----------|------|
| 519 | 601928 | 凤凰传媒 | 300 | 2,421.00 | 0.00 |
| 520 | 002709 | 天赐材料 | 100 | 2,420.00 | 0.00 |
| 521 | 002573 | 清新环境 | 300 | 2,415.00 | 0.00 |
| 521 | 600582 | 天地科技 | 700 | 2,415.00 | 0.00 |
| 522 | 000656 | 金科股份 | 400 | 2,412.00 | 0.00 |
| 523 | 601138 | 工业富联 | 200 | 2,410.00 | 0.00 |
| 524 | 601117 | 中国化学 | 400 | 2,408.00 | 0.00 |
| 525 | 002407 | 多氟多 | 200 | 2,368.00 | 0.00 |
| 526 | 002505 | 大康农业 | 1,200 | 2,364.00 | 0.00 |
| 527 | 600482 | 中国动力 | 100 | 2,362.00 | 0.00 |
| 528 | 000543 | 皖能电力 | 500 | 2,355.00 | 0.00 |
| 529 | 002745 | 木林森 | 200 | 2,344.00 | 0.00 |
| 530 | 002807 | 江阴银行 | 500 | 2,340.00 | 0.00 |
| 531 | 601019 | 山东出版 | 300 | 2,334.00 | 0.00 |
| 531 | 601611 | 中国核建 | 300 | 2,334.00 | 0.00 |
| 532 | 600053 | 九鼎投资 | 100 | 2,330.00 | 0.00 |
| 533 | 000012 | 南玻 A | 560 | 2,329.60 | 0.00 |
| 534 | 600611 | 大众交通 | 500 | 2,325.00 | 0.00 |
| 535 | 000519 | 江南红箭 | 300 | 2,319.00 | 0.00 |
| 536 | 300324 | 旋极信息 | 400 | 2,316.00 | 0.00 |
| 537 | 300144 | 宋城演艺 | 100 | 2,314.00 | 0.00 |
| 538 | 601216 | 君正集团 | 700 | 2,303.00 | 0.00 |
| 539 | 600511 | 国药股份 | 100 | 2,297.00 | 0.00 |
| 540 | 002051 | 中工国际 | 200 | 2,294.00 | 0.00 |
| 541 | 600787 | 中储股份 | 400 | 2,292.00 | 0.00 |
| 542 | 002672 | 东江环保 | 200 | 2,268.00 | 0.00 |
| 543 | 002010 | 传化智联 | 300 | 2,259.00 | 0.00 |
| 544 | 600908 | 无锡银行 | 400 | 2,256.00 | 0.00 |
| 545 | 002285 | 世联行 | 500 | 2,255.00 | 0.00 |
| 545 | 600118 | 中国卫星 | 100 | 2,255.00 | 0.00 |
| 546 | 002839 | 张家港行 | 400 | 2,252.00 | 0.00 |
| 547 | 002920 | 德赛西威 | 100 | 2,240.00 | 0.00 |
| 548 | 002294 | 信立泰 | 100 | 2,238.00 | 0.00 |
| 548 | 600565 | 迪马股份 | 600 | 2,238.00 | 0.00 |
| 549 | 002302 | 西部建设 | 200 | 2,228.00 | 0.00 |
| 550 | 300257 | 开山股份 | 200 | 2,216.00 | 0.00 |
| 551 | 000717 | *ST 韶钢 | 500 | 2,215.00 | 0.00 |
| 552 | 600499 | 科达洁能 | 500 | 2,190.00 | 0.00 |
| 553 | 601238 | 广汽集团 | 200 | 2,186.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-----|----------|------|
| 554 | 000006 | 深振业 A | 400 | 2,180.00 | 0.00 |
| 555 | 601326 | 秦港股份 | 600 | 2,178.00 | 0.00 |
| 556 | 600188 | 兖州煤业 | 200 | 2,174.00 | 0.00 |
| 557 | 002249 | 大洋电机 | 500 | 2,170.00 | 0.00 |
| 557 | 601311 | 骆驼股份 | 200 | 2,170.00 | 0.00 |
| 558 | 600704 | 物产中大 | 400 | 2,168.00 | 0.00 |
| 559 | 002048 | 宁波华翔 | 200 | 2,164.00 | 0.00 |
| 560 | 603568 | 伟明环保 | 100 | 2,152.00 | 0.00 |
| 561 | 000501 | 鄂武商 A | 200 | 2,150.00 | 0.00 |
| 562 | 002030 | 达安基因 | 200 | 2,146.00 | 0.00 |
| 563 | 300055 | 万邦达 | 300 | 2,139.00 | 0.00 |
| 564 | 601360 | 三六零 | 100 | 2,138.00 | 0.00 |
| 565 | 600169 | 太原重工 | 800 | 2,136.00 | 0.00 |
| 566 | 600006 | 东风汽车 | 400 | 2,132.00 | 0.00 |
| 567 | 603799 | 华友钴业 | 100 | 2,131.00 | 0.00 |
| 568 | 600884 | 杉杉股份 | 200 | 2,130.00 | 0.00 |
| 569 | 603712 | 七一二 | 100 | 2,123.00 | 0.00 |
| 570 | 002254 | 泰和新材 | 200 | 2,116.00 | 0.00 |
| 571 | 002390 | 信邦制药 | 400 | 2,108.00 | 0.00 |
| 571 | 601066 | 中信建投 | 100 | 2,108.00 | 0.00 |
| 572 | 000980 | 金马股份 | 500 | 2,105.00 | 0.00 |
| 573 | 300115 | 长盈精密 | 200 | 2,098.00 | 0.00 |
| 574 | 603766 | 隆鑫通用 | 500 | 2,095.00 | 0.00 |
| 575 | 000564 | 西安民生 | 800 | 2,088.00 | 0.00 |
| 576 | 002252 | 上海莱士 | 300 | 2,085.00 | 0.00 |
| 577 | 002242 | 九阳股份 | 100 | 2,081.00 | 0.00 |
| 578 | 600458 | 时代新材 | 200 | 2,078.00 | 0.00 |
| 579 | 000926 | 福星股份 | 300 | 2,076.00 | 0.00 |
| 580 | 600151 | 航天机电 | 400 | 2,060.00 | 0.00 |
| 581 | 600141 | 兴发集团 | 200 | 2,056.00 | 0.00 |
| 582 | 600757 | 长江传媒 | 300 | 2,043.00 | 0.00 |
| 583 | 002358 | 森源电气 | 200 | 2,030.00 | 0.00 |
| 584 | 002332 | 仙琚制药 | 300 | 2,028.00 | 0.00 |
| 585 | 000025 | 特力 A | 100 | 2,022.00 | 0.00 |
| 586 | 600291 | 西水股份 | 200 | 2,012.00 | 0.00 |
| 587 | 000600 | 建投能源 | 300 | 2,010.00 | 0.00 |
| 588 | 600770 | 综艺股份 | 300 | 2,004.00 | 0.00 |
| 589 | 002444 | 巨星科技 | 200 | 1,996.00 | 0.00 |
| 589 | 603888 | 新华网 | 100 | 1,996.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 590 | 002028 | 思源电气 | 200 | 1,992.00 | 0.00 |
| 590 | 300159 | 新研股份 | 400 | 1,992.00 | 0.00 |
| 591 | 300287 | 飞利信 | 500 | 1,985.00 | 0.00 |
| 592 | 002424 | 贵州百灵 | 200 | 1,976.00 | 0.00 |
| 593 | 002431 | 棕榈股份 | 500 | 1,975.00 | 0.00 |
| 594 | 300376 | 易事特 | 400 | 1,972.00 | 0.00 |
| 595 | 000898 | 鞍钢股份 | 520 | 1,970.80 | 0.00 |
| 596 | 000671 | 阳光城 | 300 | 1,944.00 | 0.00 |
| 597 | 000937 | 冀中能源 | 500 | 1,930.00 | 0.00 |
| 598 | 002503 | 搜于特 | 700 | 1,925.00 | 0.00 |
| 599 | 600350 | 山东高速 | 400 | 1,920.00 | 0.00 |
| 599 | 601898 | 中煤能源 | 400 | 1,920.00 | 0.00 |
| 600 | 002831 | 裕同科技 | 100 | 1,917.00 | 0.00 |
| 601 | 601319 | 中国人保 | 200 | 1,898.00 | 0.00 |
| 602 | 600978 | 宜华生活 | 500 | 1,880.00 | 0.00 |
| 603 | 002366 | 台海核电 | 200 | 1,872.00 | 0.00 |
| 604 | 601016 | 节能风电 | 700 | 1,862.00 | 0.00 |
| 605 | 600393 | 粤泰股份 | 400 | 1,860.00 | 0.00 |
| 606 | 002093 | 国脉科技 | 200 | 1,858.00 | 0.00 |
| 607 | 002945 | 华林证券 | 100 | 1,850.00 | 0.00 |
| 608 | 600765 | 中航重机 | 200 | 1,846.00 | 0.00 |
| 609 | 300199 | 翰宇药业 | 200 | 1,834.00 | 0.00 |
| 610 | 601001 | 大同煤业 | 400 | 1,828.00 | 0.00 |
| 611 | 002707 | 众信旅游 | 300 | 1,821.00 | 0.00 |
| 612 | 002558 | 世纪游轮 | 100 | 1,817.00 | 0.00 |
| 613 | 300266 | 兴源环境 | 400 | 1,816.00 | 0.00 |
| 614 | 300297 | 蓝盾股份 | 300 | 1,809.00 | 0.00 |
| 615 | 600869 | 智慧能源 | 400 | 1,808.00 | 0.00 |
| 616 | 600416 | 湘电股份 | 300 | 1,806.00 | 0.00 |
| 617 | 601801 | 皖新传媒 | 300 | 1,803.00 | 0.00 |
| 618 | 002310 | 东方园林 | 300 | 1,800.00 | 0.00 |
| 619 | 600862 | 中航高科 | 200 | 1,798.00 | 0.00 |
| 620 | 603198 | 迎驾贡酒 | 100 | 1,791.00 | 0.00 |
| 621 | 002375 | 亚厦股份 | 300 | 1,773.00 | 0.00 |
| 622 | 600993 | 马应龙 | 100 | 1,765.00 | 0.00 |
| 623 | 600971 | 恒源煤电 | 300 | 1,755.00 | 0.00 |
| 624 | 000829 | 天音控股 | 300 | 1,746.00 | 0.00 |
| 625 | 002411 | 延安必康 | 100 | 1,740.00 | 0.00 |
| 626 | 600645 | 中源协和 | 100 | 1,731.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-----|----------|------|
| 627 | 300459 | 金科娱乐 | 300 | 1,707.00 | 0.00 |
| 628 | 002681 | 奋达科技 | 400 | 1,696.00 | 0.00 |
| 629 | 600058 | 五矿发展 | 200 | 1,690.00 | 0.00 |
| 630 | 601228 | 广州港 | 400 | 1,672.00 | 0.00 |
| 631 | 002489 | 浙江永强 | 500 | 1,670.00 | 0.00 |
| 632 | 002939 | 长城证券 | 100 | 1,669.00 | 0.00 |
| 633 | 600835 | 上海机电 | 100 | 1,660.00 | 0.00 |
| 634 | 600874 | 创业环保 | 200 | 1,658.00 | 0.00 |
| 635 | 002509 | 天广中茂 | 800 | 1,648.00 | 0.00 |
| 635 | 600657 | 信达地产 | 400 | 1,648.00 | 0.00 |
| 636 | 000990 | 诚志股份 | 100 | 1,641.00 | 0.00 |
| 637 | 600025 | 华能水电 | 400 | 1,628.00 | 0.00 |
| 638 | 000061 | 农产品 | 300 | 1,626.00 | 0.00 |
| 639 | 600639 | 浦东金桥 | 100 | 1,617.00 | 0.00 |
| 640 | 000426 | 兴业矿业 | 300 | 1,611.00 | 0.00 |
| 641 | 002517 | 恺英网络 | 500 | 1,595.00 | 0.00 |
| 642 | 002251 | 步步高 | 200 | 1,594.00 | 0.00 |
| 643 | 300072 | 三聚环保 | 200 | 1,586.00 | 0.00 |
| 644 | 002437 | 誉衡药业 | 400 | 1,580.00 | 0.00 |
| 645 | 000541 | 佛山照明 | 300 | 1,572.00 | 0.00 |
| 646 | 000402 | 金融街 | 200 | 1,568.00 | 0.00 |
| 646 | 000415 | 渤海金控 | 400 | 1,568.00 | 0.00 |
| 647 | 002815 | 崇达技术 | 100 | 1,559.00 | 0.00 |
| 648 | 000587 | 金洲慈航 | 600 | 1,548.00 | 0.00 |
| 649 | 601689 | 拓普集团 | 100 | 1,532.00 | 0.00 |
| 650 | 600623 | 华谊集团 | 200 | 1,528.00 | 0.00 |
| 650 | 603377 | 东方时尚 | 100 | 1,528.00 | 0.00 |
| 651 | 002936 | 郑州银行 | 300 | 1,524.00 | 0.00 |
| 652 | 000536 | 华映科技 | 600 | 1,512.00 | 0.00 |
| 653 | 600707 | 彩虹股份 | 300 | 1,503.00 | 0.00 |
| 654 | 600372 | 中航电子 | 100 | 1,484.00 | 0.00 |
| 655 | 002601 | 佰利联 | 100 | 1,483.00 | 0.00 |
| 656 | 600428 | 中远海特 | 400 | 1,480.00 | 0.00 |
| 657 | 600939 | 重庆建工 | 300 | 1,467.00 | 0.00 |
| 658 | 600179 | ST 安通 | 500 | 1,465.00 | 0.00 |
| 659 | 002482 | 广田集团 | 300 | 1,458.00 | 0.00 |
| 660 | 600329 | 中新药业 | 100 | 1,429.00 | 0.00 |
| 661 | 600545 | 卓郎智能 | 200 | 1,422.00 | 0.00 |
| 662 | 603056 | 德邦股份 | 100 | 1,408.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 663 | 002344 | 海宁皮城 | 300 | 1,398.00 | 0.00 |
| 664 | 300433 | 蓝思科技 | 200 | 1,394.00 | 0.00 |
| 665 | 600195 | 中牧股份 | 100 | 1,385.00 | 0.00 |
| 666 | 000537 | 广宇发展 | 200 | 1,384.00 | 0.00 |
| 666 | 600335 | 国机汽车 | 200 | 1,384.00 | 0.00 |
| 667 | 002382 | 蓝帆医疗 | 100 | 1,382.00 | 0.00 |
| 667 | 603556 | 海兴电力 | 100 | 1,382.00 | 0.00 |
| 668 | 000766 | 通化金马 | 200 | 1,360.00 | 0.00 |
| 668 | 300251 | 光线传媒 | 200 | 1,360.00 | 0.00 |
| 669 | 002434 | 万里扬 | 200 | 1,358.00 | 0.00 |
| 670 | 002512 | 达华智能 | 300 | 1,356.00 | 0.00 |
| 671 | 000552 | 靖远煤电 | 500 | 1,355.00 | 0.00 |
| 672 | 002635 | 安洁科技 | 100 | 1,349.00 | 0.00 |
| 673 | 002118 | 紫鑫药业 | 200 | 1,348.00 | 0.00 |
| 674 | 600640 | 号百控股 | 100 | 1,338.00 | 0.00 |
| 675 | 000062 | 深圳华强 | 100 | 1,329.00 | 0.00 |
| 676 | 601127 | 小康股份 | 100 | 1,310.00 | 0.00 |
| 677 | 600903 | 贵州燃气 | 100 | 1,303.00 | 0.00 |
| 678 | 600750 | 江中药业 | 100 | 1,301.00 | 0.00 |
| 679 | 601777 | 力帆股份 | 300 | 1,287.00 | 0.00 |
| 680 | 002948 | 青岛银行 | 200 | 1,286.00 | 0.00 |
| 681 | 002818 | 富森美 | 100 | 1,283.00 | 0.00 |
| 682 | 600339 | 中油工程 | 300 | 1,266.00 | 0.00 |
| 683 | 002416 | 爱施德 | 200 | 1,250.00 | 0.00 |
| 684 | 603225 | 新凤鸣 | 100 | 1,249.00 | 0.00 |
| 685 | 600998 | 九州通 | 100 | 1,236.00 | 0.00 |
| 686 | 600233 | 圆通速递 | 100 | 1,233.00 | 0.00 |
| 687 | 600098 | 广州发展 | 200 | 1,232.00 | 0.00 |
| 688 | 601811 | 新华文轩 | 100 | 1,221.00 | 0.00 |
| 689 | 601828 | 美凯龙 | 100 | 1,215.00 | 0.00 |
| 690 | 002147 | 新光圆成 | 600 | 1,212.00 | 0.00 |
| 691 | 002699 | 美盛文化 | 200 | 1,200.00 | 0.00 |
| 692 | 601969 | 海南矿业 | 200 | 1,176.00 | 0.00 |
| 693 | 601003 | 柳钢股份 | 200 | 1,158.00 | 0.00 |
| 694 | 601139 | 深圳燃气 | 200 | 1,138.00 | 0.00 |
| 695 | 600985 | 淮北矿业 | 100 | 1,134.00 | 0.00 |
| 696 | 601162 | 天风证券 | 100 | 1,084.00 | 0.00 |
| 696 | 601615 | 明阳智能 | 100 | 1,084.00 | 0.00 |
| 697 | 600996 | 贵广网络 | 100 | 1,078.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|-----|----------|------|
| 698 | 000553 | 沙隆达 A | 100 | 1,072.00 | 0.00 |
| 699 | 600299 | 安迪苏 | 100 | 1,037.00 | 0.00 |
| 700 | 603328 | 依顿电子 | 100 | 1,027.00 | 0.00 |
| 701 | 601808 | 中海油服 | 100 | 963.00 | 0.00 |
| 702 | 601577 | 长沙银行 | 100 | 954.00 | 0.00 |
| 703 | 600390 | 五矿资本 | 100 | 943.00 | 0.00 |
| 704 | 002625 | 龙生股份 | 100 | 929.00 | 0.00 |
| 705 | 600126 | 杭钢股份 | 200 | 912.00 | 0.00 |
| 706 | 000987 | 越秀金控 | 100 | 902.00 | 0.00 |
| 707 | 601212 | 白银有色 | 200 | 878.00 | 0.00 |
| 708 | 000761 | 本钢板材 | 200 | 860.00 | 0.00 |
| 709 | 601298 | 青岛港 | 100 | 839.00 | 0.00 |
| 710 | 000408 | *ST 金源 | 100 | 827.00 | 0.00 |
| 711 | 600733 | 北汽蓝谷 | 100 | 826.00 | 0.00 |
| 712 | 600280 | 中央商场 | 200 | 718.00 | 0.00 |
| 713 | 600917 | 重庆燃气 | 100 | 696.00 | 0.00 |
| 714 | 601068 | 中铝国际 | 100 | 690.00 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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 | 600547 | 山东黄金 | 2,608,130.00 | 2.86 |
| 2 | 600027 | 华电国际 | 2,564,864.00 | 2.81 |
| 3 | 600011 | 华能国际 | 2,273,535.00 | 2.49 |
| 4 | 601857 | 中国石油 | 1,729,361.00 | 1.89 |
| 5 | 601600 | 中国铝业 | 1,521,830.00 | 1.67 |
| 6 | 600362 | 江西铜业 | 1,500,079.30 | 1.64 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 1,482,822.00 | 1.62 |
| 8 | 601006 | 大秦铁路 | 1,328,988.00 | 1.46 |
| 9 | 601628 | 中国人寿 | 1,112,429.00 | 1.22 |
| 10 | 000786 | 北新建材 | 977,923.00 | 1.07 |
| 11 | 600104 | 上汽集团 | 964,763.00 | 1.06 |
| 12 | 002041 | 登海种业 | 960,198.00 | 1.05 |
| 13 | 600036 | 招商银行 | 899,081.00 | 0.98 |

| | | | | |
|----|--------|-------|------------|------|
| 14 | 000002 | 万 科 A | 813,752.00 | 0.89 |
| 15 | 600519 | 贵州茅台 | 794,204.00 | 0.87 |
| 16 | 601601 | 中国太保 | 735,901.92 | 0.81 |
| 17 | 601766 | 中国中车 | 686,502.00 | 0.75 |
| 18 | 000651 | 格力电器 | 558,750.00 | 0.61 |
| 19 | 000333 | 美的集团 | 557,446.00 | 0.61 |
| 20 | 601166 | 兴业银行 | 530,909.00 | 0.58 |

7.4.2 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 | 600547 | 山东黄金 | 2,859,188.00 | 3.13 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 2,520,848.00 | 2.76 |
| 3 | 600011 | 华能国际 | 1,963,681.13 | 2.15 |
| 4 | 000002 | 万 科 A | 1,743,935.00 | 1.91 |
| 5 | 600027 | 华电国际 | 1,729,730.00 | 1.89 |
| 6 | 601600 | 中国铝业 | 1,539,242.00 | 1.69 |
| 7 | 600362 | 江西铜业 | 1,533,242.32 | 1.68 |
| 8 | 601628 | 中国人寿 | 1,510,566.00 | 1.65 |
| 9 | 601857 | 中国石油 | 1,486,344.00 | 1.63 |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 1,383,355.42 | 1.51 |
| 11 | 601006 | 大秦铁路 | 1,235,709.00 | 1.35 |
| 12 | 600519 | 贵州茅台 | 1,201,904.00 | 1.32 |
| 13 | 600036 | 招商银行 | 1,162,931.00 | 1.27 |
| 14 | 000333 | 美的集团 | 1,052,101.00 | 1.15 |
| 15 | 002041 | 登海种业 | 1,041,448.62 | 1.14 |
| 16 | 000786 | 北新建材 | 1,031,946.00 | 1.13 |
| 17 | 600104 | 上汽集团 | 1,018,221.64 | 1.11 |
| 18 | 600048 | 保利地产 | 970,933.00 | 1.06 |
| 19 | 600276 | 恒瑞医药 | 961,403.02 | 1.05 |
| 20 | 002422 | 科伦药业 | 889,447.00 | 0.97 |

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 59,235,352.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 83,900,319.71 |

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 999,200.00 | 1.73 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 52,578,310.00 | 90.85 |
| | 其中：政策性金融债 | 52,578,310.00 | 90.85 |
| 4 | 企业债券 | 4,999,000.00 | 8.64 |
| 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 | 58,576,510.00 | 101.21 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 190204 | 19 国开 04 | 200,000 | 19,928,000.00 | 34.43 |
| 2 | 190205 | 19 国开 05 | 200,000 | 19,590,000.00 | 33.85 |
| 3 | 190401 | 19 农发 01 | 100,000 | 9,929,000.00 | 17.16 |
| 4 | 112257 | 15 荣盛 02 | 50,000 | 4,999,000.00 | 8.64 |
| 5 | 108602 | 国开 1704 | 31,000 | 3,131,310.00 | 5.41 |

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 22,419.04 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 969,573.88 |
| 5 | 应收申购款 | 3,797.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 995,789.92 |

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------|-----------|------------|---------------|--------|---------------|--------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 中金衡优 A | 201 | 196,716.59 | 18,708,302.52 | 47.31% | 20,831,732.53 | 52.69% |
| 中金衡优 C | 22 | 565,258.19 | 3,060,183.34 | 24.61% | 9,375,496.83 | 75.39% |
| 合计 | 223 | 233,074.96 | 21,768,485.86 | 41.88% | 30,207,229.36 | 58.12% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 中金衡优 A | 6,425,025.85 | 16.2494% |
| | 中金衡优 C | 0.00 | 0.0000% |
| | 合计 | 6,425,025.85 | 12.3616% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|--------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 中金衡优 A | 0~10 |
| | 中金衡优 C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中金衡优 A | 0 |
| | 中金衡优 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中金衡优 A | 中金衡优 C |
|-------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2018 年 6 月 8 日）基金份额总额 | 101,040,333.79 | 124,150,779.10 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 69,756,630.54 | 20,104,323.15 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 30,011,207.50 | 4,233,271.84 |
| 减：本报告期期间基金总赎回份额 | 60,227,802.99 | 11,901,914.82 |
| 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 | 39,540,035.05 | 12,435,680.17 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

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

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

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

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

本报告期无涉及本基金基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中投证券 | 2 | 143,097,463.24 | 100.00% | 104,648.59 | 100.00% | - |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银证券 | 2 | - | - | - | - | - |

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|---------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中投证券 | 45,021,672.90 | 100.00% | 272,660,000.00 | 100.00% | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|----------------------------|----------------|------------|
| 1 | 中金基金管理有限公司董事长任职公告 | 《中国证券报》及/或公司网站 | 2019年1月19日 |
| 2 | 中金衡优灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要 | 《中国证券报》及/或公司网站 | 2019年1月21日 |

| | | | |
|----|--|--------------------------------------|-----------------|
| 3 | 中金衡优灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告 | 《中国证券报》及/或公司网站 | 2019 年 1 月 22 日 |
| 4 | 中金基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及/或公司网站 | 2019 年 3 月 12 日 |
| 5 | 中金基金管理有限公司关于基金经理助理离任的公告 | 《中国证券报》及/或公司网站 | 2019 年 3 月 26 日 |
| 6 | 中金衡优灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告及其摘要 | 《中国证券报》及/或公司网站 | 2019 年 3 月 28 日 |
| 7 | 中金衡优灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告 | 《中国证券报》及/或公司网站 | 2019 年 4 月 19 日 |
| 8 | 中金基金管理有限公司关于公司独立董事变更的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及/或公司网站 | 2019 年 5 月 6 日 |
| 9 | 关于新增西藏东方财富证券股份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 | 2019 年 5 月 8 日 |
| 10 | 中金基金管理有限公司首席信息官任职公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及/或公司网站 | 2019 年 6 月 18 日 |
| 11 | 中金基金管理有限公司关于中金衡优灵活配置混合型证券投资基金调整管理费率并修改基金合同等事项的公告 | 《中国证券报》及/或公司网站 | 2019 年 6 月 19 日 |
| 12 | 中金衡优灵活配置混合型证券投资基金基金合同、中金衡优灵活配置混合型证券投资基金托管协议 | 《中国证券报》及/或公司网站 | 2019 年 6 月 19 日 |
| 13 | 关于中金衡优、中金新医药新增国金证券为销售机构的公告 | 《中国证券报》及/或公司网站 | 2019 年 6 月 26 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|---------------------------------|------|---------------|------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2019 年 4 月 22 日-2019 年 6 月 30 日 | - | 17,641,351.33 | - | 17,641,351.33 | 33.94% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形。如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，从而可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2019年8月26日