

中金量化多策略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：中国建设银行股份有限公司

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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。

## 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>62</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	65
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>67</b>
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.....	67

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>68</b>
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	68
12.3 查阅方式.....	68

## § 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	156,053,880.93 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在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	tianqingl.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街 1 号国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100004	100033
法定代表人	楚钢	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	《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
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

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)
本期已实现收益	23,372,768.11
本期利润	29,033,596.04
加权平均基金份额本期利润	0.1861
本期加权平均净值利润率	19.16%
本期基金份额净值增长率	22.77%
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	488,344.09
期末可供分配基金份额利润	0.0031
期末基金资产净值	156,542,225.02
期末基金份额净值	1.003
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	0.30%

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；

#### 3.2 基金净值表现

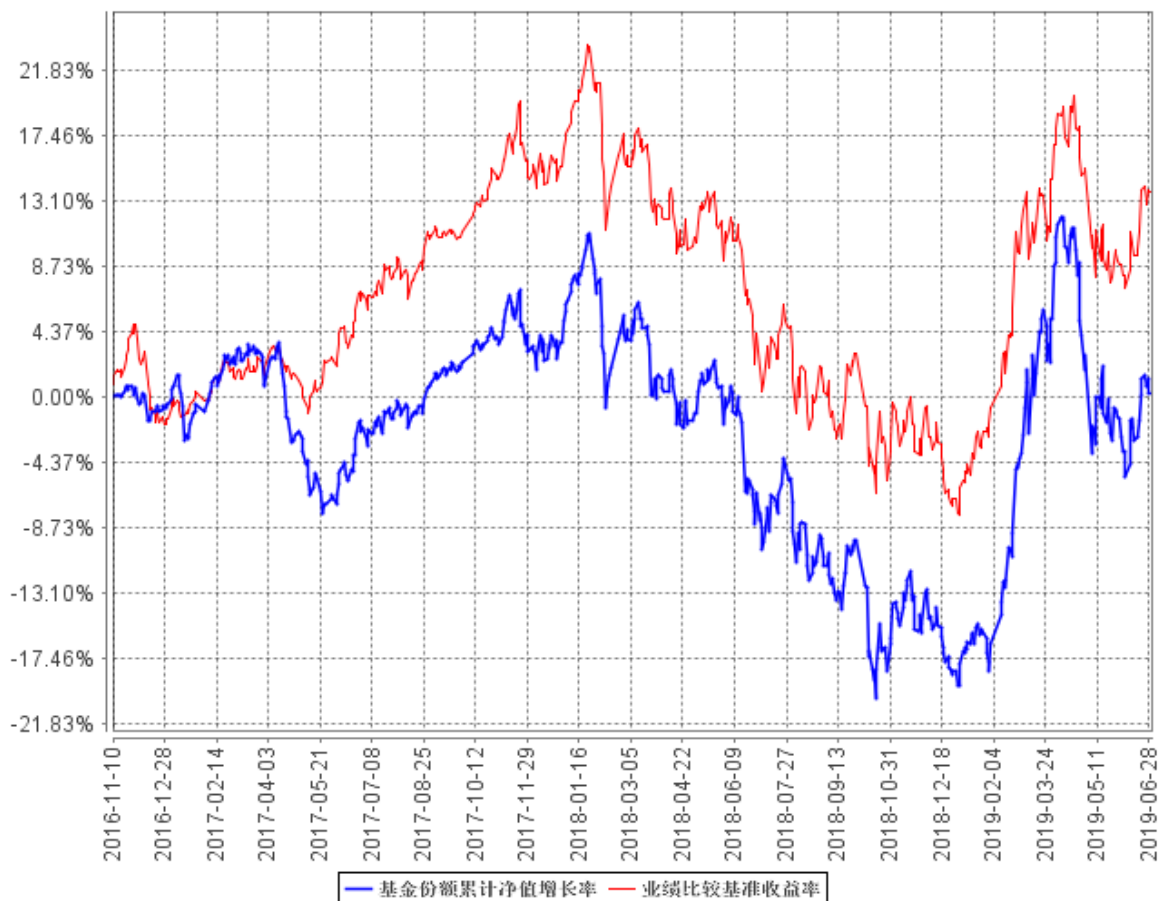
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	1.72%	1.17%	4.43%	0.93%	-2.71%	0.24%
过去三个月	-4.66%	1.60%	-0.72%	1.22%	-3.94%	0.38%
过去六个月	22.77%	1.55%	21.91%	1.24%	0.86%	0.31%
过去一年	7.16%	1.42%	8.97%	1.22%	-1.81%	0.20%
自基金合同生效起至今	0.30%	1.05%	13.69%	0.92%	-13.39%	0.13%



### 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



## § 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（以下简称“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（以下简称“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 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	本基金的基金经理	2017 年 3 月 28 日	2019 年 2 月 18 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。
石玉	本基金的基金经理	2017 年 3 月 29 日	2019 年 2 月 18 日	12 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。

刘重晋	本基金的基金经理	2017年8月2日	-	8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月加入中金基金管理有限公司，现任量化公募投资部基金经理。
闫雯雯	本基金基金经理助理	2017年8月24日	-	11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。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》等相关法律法规和基金合同约定，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

今年以来 A 股市场呈现较大的波动，年初至 4 月下旬，权益市场大幅快速上涨，4 月下旬至 5 月中旬，特别是随着中美贸易局势紧张，A 股呈现一波下跌趋势，此后 A 股市场持续波动调整。整个上半年内，沪深 300 指数由 3017 上涨 27.07%至 3825 点，中证 500 指数由 4176 点上涨 18.77%至 4950 点。

本基金仍然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。同时随着科创板的推进，本基金积极参与科创板投资，力图进一步获取收益。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 1.003 元；本报告期基金份额净值增长率为 22.77%，业绩比较基准收益率为 21.91%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一季度，随着中美贸易战态势的平缓，前期受贸易战影响较大的公司估值有望得到一定的修复。此外随着科创板的正式开板，科技类公司或将仍然会有进一步提升估值的机会。当前国内外多变的 market 环境下，盈利能力强、盈利稳定、经营质量好的公司更占优势，需要我们更加关注。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

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

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

## § 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中金量化多策略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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,165,360.79	768,585.69
结算备付金		3,818,379.08	5,868,217.35
存出保证金		1,699,729.17	13,262.41
交易性金融资产	6.4.7.2	151,067,937.48	121,262,354.21
其中：股票投资		134,326,837.48	114,432,434.21
基金投资		-	-
债券投资		16,741,100.00	6,829,920.00
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	-	-
应收证券清算款		-	141,661.24
应收利息	6.4.7.5	224,525.44	190,739.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		157,975,931.96	128,244,820.69
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		84,484.76	96,640.25
应付赎回款		944.29	-
应付管理人报酬		189,116.24	149,871.92
应付托管费		31,519.37	24,978.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,083,928.78	347,052.95

应交税费		0.13	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	43,713.37	130,000.00
负债合计		1,433,706.94	748,543.78
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	156,053,880.93	156,039,802.60
未分配利润	6.4.7.10	488,344.09	-28,543,525.69
所有者权益合计		156,542,225.02	127,496,276.91
负债和所有者权益总计		157,975,931.96	128,244,820.69

报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.003 元，基金份额总额 156,053,880.93 份。

## 6.2 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：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 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		32,990,863.54	-10,789,397.41
1.利息收入		144,011.08	215,323.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,810.36	14,454.07
债券利息收入		126,170.42	136,517.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		30.30	64,351.01
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		27,185,586.61	1,935,301.68
其中：股票投资收益	6.4.7.12	25,586,483.64	761,614.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,153.93	38,831.09
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	-180.00	-
股利收益	6.4.7.16	1,590,129.04	1,134,856.06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,660,827.93	-12,940,032.16
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	437.92	10.02
<b>减：二、费用</b>		3,957,267.50	2,298,552.71



1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1, 121, 714. 06	988, 545. 81
2. 托管费	6.4.10.2.2	186, 952. 37	164, 757. 69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2, 520, 569. 91	1, 045, 271. 87
5. 利息支出		62, 258. 11	-
其中：卖出回购金融资产支出		62, 258. 11	-
6. 税金及附加		0. 71	68. 65
7. 其他费用	6.4.7.20	65, 772. 34	99, 908. 69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		29, 033, 596. 04	-13, 087, 950. 12
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		29, 033, 596. 04	-13, 087, 950. 12

### 6.3 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：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）	156, 039, 802. 60	-28, 543, 525. 69	127, 496, 276. 91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29, 033, 596. 04	29, 033, 596. 04
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）	14, 078. 33	-1, 726. 26	12, 352. 07
其中：1.基金申购款	85, 089. 73	1, 200. 10	86, 289. 83
2. 基金赎回款	-71, 011. 40	-2, 926. 36	-73, 937. 76
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	156, 053, 880. 93	488, 344. 09	156, 542, 225. 02

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
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)	-	-13,087,950.12	-13,087,950.12
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)	-7,165.65	-216.42	-7,382.07
其中：1.基金申购款	1,898.14	98.86	1,997.00
2.基金赎回款	-9,063.79	-315.28	-9,379.07
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)	130,068,061.71	-8,283,597.18	121,784,464.53

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

\_\_\_\_\_  
张纳

\_\_\_\_\_  
白娜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中金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 27 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管理有限公司直销中心、中金基金网上直销平台、中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）及北京肯特瑞财富投资管理有限公司等共同销售，自 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）。

#### 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	1,165,360.79
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	1,165,360.79

### 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	136,232,537.21	134,326,837.48	-1,905,699.73

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,752,470.00	1,747,100.00	-5,370.00
	银行间市场	14,989,680.00	14,994,000.00	4,320.00
	合计	16,742,150.00	16,741,100.00	-1,050.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		152,974,687.21	151,067,937.48	-1,906,749.73

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	13,779,440.00	-	-	
合计	13,779,440.00	-	-	

注：在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金于 2019 年 6 月 30 日所有的股指期货合约产生的持仓损益金额，因此衍生金融工具项下的股指期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细为：中证 500 期货 1907 合约买入持仓量 14 手，合约市值人民币 13,737,920.00 元，公允价值变动人民币余额-41,520.00 元。

### 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

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	155.93

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	1,354.30
应收债券利息	222,992.21
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	23.00
合计	224,525.44

#### 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	1,083,741.28
银行间市场应付交易费用	187.50
合计	1,083,928.78

#### 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	1.19
预提费用	43,712.18
合计	43,713.37

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	156,039,802.60	156,039,802.60

本期申购	85,089.73	85,089.73
本期赎回(以“-”号填列)	-71,011.40	-71,011.40
- 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	156,053,880.93	156,053,880.93

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-17,141,219.76	-11,402,305.93	-28,543,525.69
本期利润	23,372,768.11	5,660,827.93	29,033,596.04
本期基金份额交易产生的变动数	-1,787.14	60.88	-1,726.26
其中：基金申购款	-296.97	1,497.07	1,200.10
基金赎回款	-1,490.17	-1,436.19	-2,926.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,229,761.21	-5,741,417.12	488,344.09

#### 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	2,845.17
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	14,678.30
其他	286.89
合计	17,810.36

#### 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	958,326,366.48



减：卖出股票成本总额	932,739,882.84
买卖股票差价收入	25,586,483.64

### 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	9,153.93
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	9,153.93

#### 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	16,743,969.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,358,482.00
减：应收利息总额	376,333.98
买卖债券差价收入	9,153.93

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019年1月1日至2019年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-180.00

**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	1,590,129.04
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,590,129.04

**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	5,702,347.93
——股票投资	5,687,037.93
——债券投资	15,310.00
——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	-41,520.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-

合计	5,660,827.93
----	--------------

#### 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	437.86
转换费收入	0.06
合计	437.92

#### 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	2,519,477.36
银行间市场交易费用	187.50
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
股指期货交易费用	905.05
合计	2,520,569.91

#### 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	19,835.79
信息披露费	14,876.39
其他	600.00
汇划手续费	3,460.16
帐户维护费	27,000.00
合计	65,772.34

## 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

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金管理有限公司（“中金基金”）	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中投证券有限责任公司（“中投证券”）	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

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。

## 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1月1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	-	-	91,085,313.40	11.51%

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

**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1月1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
中金公司	99,300.00	0.37%	52,600.00	0.48%

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1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	-	-	27,200,000.00	6.81%

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期与上年度可比期间无关联方权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中投证券	66,601.69	11.51%	66,601.69	25.39%

注：本基金本报告期无应付关联方的佣金。

**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1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,121,714.06	988,545.81
其中：支付销售机构的客户维护费	54.43	5.87

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。

#### 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1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	186,952.37	164,757.69

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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期无销售服务费。

#### 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

本报告期本基金未发生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

本基金本报告期内基金管理人无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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1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
建设银行	1,165,360.79	2,845.17	696,171.25	5,616.46

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期未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**

本基金本报告期无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未实施利润分配。

**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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113028	环境转债	2019年6月17日	2019年7月8日	新债流通受限	100.00	100.00	460	46,000.00	46,000.00	-

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600510	黑牡丹	2019年6月19日	临时停牌	6.32	-	-	1,300	8,409.83	8,216.00	-

002323	雅百特	2018年8月17日	临时停牌	1.31	-	-	1,900	10,418.60	2,489.00	-
--------	-----	------------	------	------	---	---	-------	-----------	----------	---

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。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	46,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	46,000.00	-

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

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（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	1,165,360.79	-	-	-	1,165,360.79
结算备付金	3,818,379.08	-	-	-	3,818,379.08
存出保证金	1,699,729.17	-	-	-	1,699,729.17
交易性金融资产- 股票投资	-	-	-	134,326,837.48	134,326,837.48

交易性金融资产- 债券投资	16,695,100.00	-	46,000.00	-	16,741,100.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	224,525.44	224,525.44
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	23,378,569.04	-	46,000.00	134,551,362.92	157,975,931.96
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产 款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	84,484.76	84,484.76
应付赎回款	-	-	-	944.29	944.29
应付管理人报酬	-	-	-	189,116.24	189,116.24
应付托管费	-	-	-	31,519.37	31,519.37
应付交易费用	-	-	-	1,083,928.78	1,083,928.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.13	0.13
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	43,713.37	43,713.37
负债总计	-	-	-	1,433,706.94	1,433,706.94
利率敏感度缺口	23,378,569.04	-	46,000.00	133,117,655.98	156,542,225.02
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	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

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	20,466.72	4,461.65
市场利率上升 25 个基点	-20,466.72	-4,461.65	

#### 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	134,326,837.48	85.81	114,432,434.21	89.75
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	16,741,100.00	10.69	6,829,920.00	5.36
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	151,067,937.48	96.50	121,262,354.21	95.11

## 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%	8,336,991.42	6,685,268.39
	业绩比较基准下降5%	-8,336,991.42	-6,685,268.39

## 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 134,259,155.94 元，属于第二层次的余额为 16,751,805.00 元，第三层次的余额为 56,976.54 元。(2018 年 12 月 31 日，第一层次 113,582,582.21 元，第二层次 7629,626.20 元，第三层次 50,145.80 元)。

(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	134,326,837.48	85.03
	其中：股票	134,326,837.48	85.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,741,100.00	10.60
	其中：债券	16,741,100.00	10.60
	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	4,983,739.87	3.15
8	其他各项资产	1,924,254.61	1.22
9	合计	157,975,931.96	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	2,539,474.39	1.62
B	采矿业	4,215,438.74	2.69
C	制造业	74,103,717.92	47.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,325,940.87	4.04
E	建筑业	2,132,380.47	1.36
F	批发和零售业	15,074,491.53	9.63

G	交通运输、仓储和邮政业	3,225,538.78	2.06
H	住宿和餐饮业	821,927.28	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,251,444.47	3.35
J	金融业	1,550,415.25	0.99
K	房地产业	10,114,672.97	6.46
L	租赁和商务服务业	1,550,828.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	477,283.00	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	1,348,515.00	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,177,911.31	2.67
S	综合	1,416,857.50	0.91
	合计	134,326,837.48	85.81

### 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	601717	郑煤机	238,950	1,364,404.50	0.87
2	002406	远东传动	181,800	1,090,800.00	0.70
3	600269	赣粤高速	243,700	1,082,028.00	0.69
4	002462	嘉事堂	72,010	1,080,150.00	0.69
5	603319	湘油泵	57,120	991,603.20	0.63
6	601677	明泰铝业	95,100	980,481.00	0.63
7	300031	宝通科技	78,500	970,260.00	0.62
8	600461	洪城水业	153,026	964,063.80	0.62
9	600551	时代出版	106,100	962,327.00	0.61
10	600694	大商股份	34,266	956,364.06	0.61
11	600173	卧龙地产	223,136	955,022.08	0.61
12	000573	粤宏远A	282,700	947,045.00	0.60
13	600757	长江传媒	137,936	939,344.16	0.60



14	600785	新华百货	56,300	935,706.00	0.60
15	603199	九华旅游	42,000	933,660.00	0.60
16	002441	众业达	116,100	921,834.00	0.59
17	002454	松芝股份	177,603	921,759.57	0.59
18	600997	开滦股份	149,200	913,104.00	0.58
19	000059	华锦股份	141,900	908,160.00	0.58
20	300200	高盟新材	94,800	895,860.00	0.57
21	300428	四通新材	82,400	892,392.00	0.57
22	000623	吉林敖东	54,180	888,010.20	0.57
23	600673	东阳光	112,000	879,200.00	0.56
24	000417	合肥百货	168,000	871,920.00	0.56
25	600328	兰太实业	104,200	853,398.00	0.55
26	600780	通宝能源	234,895	845,622.00	0.54
27	002283	天润曲轴	212,400	834,732.00	0.53
28	000528	柳工	123,800	824,508.00	0.53
29	600971	恒源煤电	140,384	821,246.40	0.52
30	600062	华润双鹤	65,100	820,911.00	0.52
31	600858	银座股份	160,200	818,622.00	0.52
32	603878	武进不锈	76,109	818,171.75	0.52
33	600261	阳光照明	219,100	804,097.00	0.51
34	002048	宁波华翔	74,301	803,936.82	0.51
35	002394	联发股份	82,620	803,892.60	0.51
36	601588	北辰实业	213,900	802,125.00	0.51
37	002763	汇洁股份	94,035	801,178.20	0.51
38	002746	仙坛股份	51,600	798,252.00	0.51
39	601567	三星医疗	137,200	795,760.00	0.51
40	002087	新野纺织	199,800	775,224.00	0.50
41	000524	岭南控股	92,600	775,062.00	0.50
42	600053	九鼎投资	33,200	773,560.00	0.49
43	600727	鲁北化工	116,100	773,226.00	0.49
44	603600	永艺股份	78,500	772,440.00	0.49
45	600704	物产中大	140,415	761,049.30	0.49
46	603100	川仪股份	82,400	757,256.00	0.48
47	603118	共进股份	81,635	755,940.10	0.48
48	002543	万和电气	56,001	751,533.42	0.48
49	603298	杭叉集团	58,799	744,395.34	0.48
50	000900	现代投资	159,400	742,804.00	0.47
51	600322	天房发展	202,500	735,075.00	0.47
52	600699	均胜电子	33,900	724,104.00	0.46

53	002150	通润装备	129,850	719,369.00	0.46
54	000672	上峰水泥	57,400	704,298.00	0.45
55	600469	风神股份	143,400	702,660.00	0.45
56	603689	皖天然气	63,800	702,438.00	0.45
57	601900	南方传媒	73,600	699,200.00	0.45
58	002533	金杯电工	135,300	694,089.00	0.44
59	002082	万邦德	74,100	692,835.00	0.44
60	002478	常宝股份	113,500	686,675.00	0.44
61	600351	亚宝药业	111,600	686,340.00	0.44
62	002208	合肥城建	84,840	677,871.60	0.43
63	300464	星徽精密	84,500	675,155.00	0.43
64	603926	铁流股份	54,530	673,445.50	0.43
65	600533	栖霞建设	185,600	671,872.00	0.43
66	000732	泰禾集团	40,100	661,650.00	0.42
67	000983	西山煤电	108,700	658,722.00	0.42
68	000153	丰原药业	103,600	647,500.00	0.41
69	002712	思美传媒	93,200	646,808.00	0.41
70	000756	新华制药	89,600	640,640.00	0.41
71	600633	浙数文化	68,471	640,203.85	0.41
72	601699	潞安环能	80,291	637,510.54	0.41
73	603129	春风动力	30,600	637,398.00	0.41
74	600993	马应龙	36,000	635,400.00	0.41
75	002315	焦点科技	37,600	628,296.00	0.40
76	000951	中国重汽	38,900	624,345.00	0.40
77	000726	鲁泰A	64,900	620,444.00	0.40
78	600675	中华企业	119,440	619,893.60	0.40
79	601666	平煤股份	145,300	607,354.00	0.39
80	600731	湖南海利	81,900	585,585.00	0.37
81	000906	浙商中拓	90,900	585,396.00	0.37
82	000666	经纬纺机	45,700	568,965.00	0.36
83	000026	飞亚达A	73,100	567,987.00	0.36
84	603444	吉比特	2,700	566,892.00	0.36
85	603661	恒林股份	17,000	558,790.00	0.36
86	600310	桂东电力	110,200	558,714.00	0.36
87	600070	浙江富润	68,000	552,160.00	0.35
88	002605	姚记扑克	51,600	541,800.00	0.35
89	300533	冰川网络	14,900	540,572.00	0.35
90	600695	绿庭投资	85,300	539,949.00	0.34
91	600755	厦门国贸	62,300	537,649.00	0.34

92	000019	深粮控股	73,300	524,095.00	0.33
93	600455	博通股份	18,550	519,956.50	0.33
94	002803	吉宏股份	25,170	513,719.70	0.33
95	600512	腾达建设	178,800	509,580.00	0.33
96	603883	老百姓	8,700	508,776.00	0.33
97	002893	华通热力	33,900	507,822.00	0.32
98	000926	福星股份	73,300	507,236.00	0.32
99	601002	晋亿实业	70,400	497,024.00	0.32
100	603299	苏盐井神	73,600	496,800.00	0.32
101	002234	民和股份	17,500	489,825.00	0.31
102	603313	梦百合	28,174	487,128.46	0.31
103	603368	柳药股份	14,800	486,624.00	0.31
104	600327	大东方	126,900	480,951.00	0.31
105	002458	益生股份	24,500	477,995.00	0.31
106	300575	中旗股份	16,640	475,238.40	0.30
107	603538	美诺华	22,100	473,603.00	0.30
108	002318	久立特材	64,600	472,226.00	0.30
109	000999	华润三九	15,978	468,794.52	0.30
110	300686	智动力	32,240	468,447.20	0.30
111	000517	荣安地产	151,200	464,184.00	0.30
112	002443	金洲管道	64,200	461,598.00	0.29
113	300118	东方日升	45,300	461,154.00	0.29
114	002728	特一药业	27,200	452,608.00	0.29
115	300569	天能重工	38,300	446,578.00	0.29
116	300683	海特生物	14,697	444,143.34	0.28
117	600215	长春经开	58,500	443,430.00	0.28
118	600739	辽宁成大	30,300	440,562.00	0.28
119	300702	天宇股份	12,200	439,688.00	0.28
120	600810	神马股份	35,300	435,955.00	0.28
121	002790	瑞尔特	64,220	434,127.20	0.28
122	300543	朗科智能	20,500	433,575.00	0.28
123	603889	新澳股份	63,370	430,916.00	0.28
124	603198	迎驾贡酒	23,800	426,258.00	0.27
125	000023	深天地A	33,400	426,184.00	0.27
126	000779	甘咨询	40,092	425,376.12	0.27
127	000601	韶能股份	88,700	424,873.00	0.27
128	600681	百川能源	57,000	424,080.00	0.27
129	600057	厦门象屿	95,100	423,195.00	0.27
130	002381	双箭股份	53,200	422,940.00	0.27

131	603800	道森股份	31,883	421,812.09	0.27
132	000036	华联控股	82,520	421,677.20	0.27
133	600170	上海建工	111,900	420,744.00	0.27
134	300130	新国都	26,359	419,108.10	0.27
135	002755	奥赛康	35,810	415,754.10	0.27
136	300697	电工合金	31,189	415,125.59	0.27
137	603200	上海洗霸	15,750	414,855.00	0.27
138	300443	金雷股份	28,600	414,128.00	0.26
139	300546	雄帝科技	16,150	406,818.50	0.26
140	600475	华光股份	37,200	404,736.00	0.26
141	000501	鄂武商 A	37,634	404,565.50	0.26
142	000919	金陵药业	51,800	404,558.00	0.26
143	300690	双一科技	18,000	403,200.00	0.26
144	002083	孚日股份	71,300	402,845.00	0.26
145	002738	中矿资源	22,800	402,192.00	0.26
146	601801	皖新传媒	66,830	401,648.30	0.26
147	002020	京新药业	34,800	400,896.00	0.26
148	002299	圣农发展	15,800	400,056.00	0.26
149	300047	天源迪科	47,600	398,412.00	0.25
150	603089	正裕工业	27,300	396,669.00	0.25
151	600865	百大集团	64,100	391,010.00	0.25
152	600368	五洲交通	83,000	388,440.00	0.25
153	600587	新华医疗	24,300	387,585.00	0.25
154	603586	金麒麟	24,000	384,000.00	0.25
155	300175	朗源股份	65,400	381,936.00	0.24
156	002225	濮耐股份	83,200	381,888.00	0.24
156	300038	数知科技	40,800	381,888.00	0.24
157	603855	华荣股份	43,300	380,174.00	0.24
158	002097	山河智能	60,400	376,896.00	0.24
159	300417	南华仪器	17,700	375,063.00	0.24
160	002918	蒙娜丽莎	31,900	373,549.00	0.24
161	002846	英联股份	29,300	370,938.00	0.24
162	600761	安徽合力	38,600	370,560.00	0.24
163	002392	北京利尔	105,642	369,747.00	0.24
164	600668	尖峰集团	28,400	363,520.00	0.23
165	300219	鸿利智汇	49,100	362,358.00	0.23
166	600828	茂业商业	72,004	361,460.08	0.23
167	600229	城市传媒	48,100	361,231.00	0.23
168	600697	欧亚集团	19,200	360,960.00	0.23

169	000863	三湘印象	68,100	358,206.00	0.23
170	002541	鸿路钢构	45,250	357,927.50	0.23
171	002403	爱仕达	41,600	355,264.00	0.23
172	600873	梅花生物	73,600	352,544.00	0.23
173	002620	瑞和股份	55,900	349,375.00	0.22
174	600665	天地源	86,800	341,124.00	0.22
175	300511	雪榕生物	42,200	339,710.00	0.22
176	603037	凯众股份	17,400	331,122.00	0.21
177	600985	淮北矿业	29,100	329,994.00	0.21
178	603393	新天然气	14,100	329,940.00	0.21
179	603585	苏利股份	13,800	329,544.00	0.21
180	601566	九牧王	26,618	327,933.76	0.21
181	300196	长海股份	35,500	323,760.00	0.21
182	002335	科华恒盛	18,300	322,995.00	0.21
183	000042	中洲控股	32,500	322,725.00	0.21
184	603979	金诚信	38,190	321,559.80	0.21
185	000419	通程控股	67,800	314,592.00	0.20
186	000415	渤海租赁	79,400	311,248.00	0.20
187	600995	文山电力	37,900	304,716.00	0.19
188	300150	世纪瑞尔	66,700	304,152.00	0.19
189	300599	雄塑科技	27,200	297,568.00	0.19
190	603001	奥康国际	29,100	295,074.00	0.19
191	600260	凯乐科技	14,500	289,710.00	0.19
192	002088	鲁阳节能	23,600	289,100.00	0.18
193	002425	凯撒文化	44,124	285,482.28	0.18
194	600076	康欣新材	63,400	285,300.00	0.18
195	000034	神州数码	22,100	285,090.00	0.18
196	000822	山东海化	55,700	282,956.00	0.18
197	002884	凌霄泵业	19,220	282,149.60	0.18
198	000903	云内动力	99,600	281,868.00	0.18
199	300434	金石东方	32,200	281,428.00	0.18
200	002540	亚太科技	59,200	280,608.00	0.18
201	600978	宜华生活	73,500	276,360.00	0.18
202	002233	塔牌集团	23,500	274,480.00	0.18
203	002272	川润股份	49,840	274,120.00	0.18
204	600479	千金药业	29,400	274,008.00	0.18
205	002101	广东鸿图	35,700	273,105.00	0.17
206	603385	惠达卫浴	29,890	270,504.50	0.17
207	603630	拉芳家化	19,000	269,230.00	0.17

208	000719	中原传媒	37,800	268,380.00	0.17
209	603811	诚意药业	13,400	268,000.00	0.17
210	002745	木林森	22,700	266,044.00	0.17
211	600051	宁波联合	42,800	264,932.00	0.17
212	603167	渤海轮渡	26,769	264,210.03	0.17
213	603179	新泉股份	20,100	260,295.00	0.17
214	600719	大连热电	48,200	259,798.00	0.17
215	603766	隆鑫通用	61,322	256,939.18	0.16
216	600382	广东明珠	33,090	254,462.10	0.16
217	000581	威孚高科	13,700	254,272.00	0.16
218	002743	富煌钢构	41,300	253,995.00	0.16
219	600325	华发股份	32,500	253,825.00	0.16
220	600781	辅仁药业	23,000	253,690.00	0.16
221	600683	京投发展	53,900	253,330.00	0.16
222	002724	海洋王	42,500	248,200.00	0.16
223	002286	保龄宝	41,400	244,674.00	0.16
224	600282	南钢股份	69,900	244,650.00	0.16
225	300389	艾比森	19,700	244,280.00	0.16
226	601368	绿城水务	39,100	243,593.00	0.16
227	600742	一汽富维	22,800	243,276.00	0.16
228	603667	五洲新春	29,100	242,985.00	0.16
229	600976	健民集团	14,700	242,403.00	0.15
230	601996	丰林集团	78,700	242,396.00	0.15
231	300415	伊之密	34,800	242,208.00	0.15
232	002351	漫步者	42,000	240,660.00	0.15
233	600373	中文传媒	19,100	239,896.00	0.15
234	002110	三钢闽光	25,600	238,080.00	0.15
235	300446	乐凯新材	11,100	236,652.00	0.15
236	603197	保隆科技	12,300	236,529.00	0.15
237	300360	炬华科技	28,700	234,479.00	0.15
238	300082	奥克股份	35,300	232,627.00	0.15
239	002206	海利得	56,150	231,899.50	0.15
240	002637	赞宇科技	33,000	231,330.00	0.15
241	002251	步步高	21,300	169,761.00	0.11
242	000031	大悦城	25,500	163,710.00	0.10
243	601000	唐山港	59,400	163,350.00	0.10
244	002489	浙江永强	47,500	158,650.00	0.10
245	600056	中国医药	11,300	152,437.00	0.10
246	000543	皖能电力	30,017	141,380.07	0.09

247	600750	江中药业	10,144	131,973.44	0.08
248	002444	巨星科技	12,500	124,750.00	0.08
249	600395	盘江股份	20,700	122,337.00	0.08
250	600123	兰花科创	16,600	121,512.00	0.08
251	002128	露天煤业	13,259	114,690.35	0.07
252	002154	报喜鸟	32,300	107,559.00	0.07
253	600827	百联股份	10,929	107,213.49	0.07
254	002029	七匹狼	16,300	105,298.00	0.07
255	600723	首商股份	15,300	104,958.00	0.07
256	000902	新洋丰	9,700	104,081.00	0.07
257	600012	皖通高速	16,200	102,546.00	0.07
258	601928	凤凰传媒	12,675	102,287.25	0.07
259	600252	中恒集团	34,700	101,671.00	0.06
260	000425	徐工机械	22,200	99,012.00	0.06
261	600143	金发科技	20,146	98,715.40	0.06
262	600350	山东高速	20,500	98,400.00	0.06
263	600557	康缘药业	6,600	98,076.00	0.06
264	603355	莱克电气	4,546	97,829.92	0.06
265	601898	中煤能源	19,700	94,560.00	0.06
266	600420	现代制药	10,442	93,142.64	0.06
267	002091	江苏国泰	16,000	91,360.00	0.06
268	600380	健康元	10,500	90,825.00	0.06
269	601918	新集能源	29,400	90,552.00	0.06
270	002187	广百股份	10,400	86,632.00	0.06
271	002062	宏润建设	22,040	85,074.40	0.05
272	600285	羚锐制药	9,900	83,457.00	0.05
273	601001	大同煤业	17,700	80,889.00	0.05
274	603806	福斯特	2,200	80,806.00	0.05
275	600496	精工钢构	24,800	78,616.00	0.05
276	600814	杭州解百	14,500	76,270.00	0.05
277	000600	建投能源	11,300	75,710.00	0.05
278	600167	联美控股	7,050	74,589.00	0.05
279	600064	南京高科	6,800	72,828.00	0.05
280	000061	农产品	13,400	72,628.00	0.05
281	600037	歌华有线	7,000	71,750.00	0.05
282	000899	赣能股份	13,500	71,010.00	0.05
283	002152	广电运通	10,350	70,897.50	0.05
284	000552	靖远煤电	26,015	70,500.65	0.05
285	600580	卧龙电驱	8,289	69,710.49	0.04

286	601811	新华文轩	5,700	69,597.00	0.04
287	002332	仙琚制药	10,250	69,290.00	0.04
288	002028	思源电气	6,900	68,724.00	0.04
289	603558	健盛集团	7,900	68,335.00	0.04
290	002561	徐家汇	7,700	67,683.00	0.04
291	600169	太原重工	25,300	67,551.00	0.04
292	002195	二三四五	17,080	66,441.20	0.04
293	600643	爱建集团	6,900	66,102.00	0.04
294	300058	蓝色光标	15,200	64,904.00	0.04
295	002635	安洁科技	4,800	64,752.00	0.04
296	600159	大龙地产	22,800	64,524.00	0.04
297	000828	东莞控股	6,900	63,273.00	0.04
298	600657	信达地产	14,915	61,449.80	0.04
299	601311	骆驼股份	5,600	60,760.00	0.04
300	002603	以岭药业	5,240	60,679.20	0.04
301	600033	福建高速	18,400	60,168.00	0.04
302	000027	深圳能源	9,700	60,140.00	0.04
303	600611	大众交通	12,775	59,403.75	0.04
304	300418	昆仑万维	4,600	59,202.00	0.04
305	600007	中国国贸	3,900	56,901.00	0.04
306	000301	东方盛虹	10,300	56,547.00	0.04
307	600312	平高电气	7,300	56,137.00	0.04
308	601098	中南传媒	4,400	55,616.00	0.04
309	603328	依顿电子	5,410	55,560.70	0.04
310	603556	海兴电力	4,000	55,280.00	0.04
311	600582	天地科技	16,000	55,200.00	0.04
312	300026	红日药业	15,900	54,855.00	0.04
313	002632	道明光学	7,700	53,130.00	0.03
314	600642	申能股份	8,800	52,888.00	0.03
315	300315	掌趣科技	14,900	51,405.00	0.03
316	000848	承德露露	6,127	51,037.91	0.03
317	002737	葵花药业	3,300	50,787.00	0.03
318	000156	华数传媒	4,500	49,545.00	0.03
319	603839	安正时尚	4,000	49,200.00	0.03
320	603233	大参林	1,090	49,050.00	0.03
321	603939	益丰药房	700	48,993.00	0.03
322	600428	中远海特	13,200	48,840.00	0.03
323	000877	天山股份	4,200	48,804.00	0.03
324	000402	金融街	6,200	48,608.00	0.03



325	600026	中远海能	7,400	48,026.00	0.03
326	601100	恒立液压	1,500	47,070.00	0.03
327	300296	利亚德	6,000	46,980.00	0.03
328	600754	锦江股份	1,902	46,865.28	0.03
329	000030	富奥股份	10,000	46,700.00	0.03
330	002126	银轮股份	6,200	46,128.00	0.03
331	601366	利群股份	7,100	44,517.00	0.03
332	002398	建研集团	6,900	44,298.00	0.03
333	600073	上海梅林	4,800	44,160.00	0.03
334	002325	洪涛股份	14,000	43,680.00	0.03
335	000513	丽珠集团	1,300	43,199.00	0.03
336	002399	海普瑞	2,000	41,980.00	0.03
337	600329	中新药业	2,900	41,441.00	0.03
338	000821	京山轻机	5,100	41,361.00	0.03
339	600578	京能电力	12,700	41,148.00	0.03
340	002250	联化科技	3,700	41,033.00	0.03
341	300115	长盈精密	3,900	40,911.00	0.03
342	600779	水井坊	800	40,656.00	0.03
343	000738	航发控制	3,000	40,200.00	0.03
344	000685	中山公用	4,700	40,138.00	0.03
345	600597	光明乳业	3,701	39,785.75	0.03
346	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.03
347	000606	顺利办	6,500	39,455.00	0.03
348	601966	玲珑轮胎	2,300	39,100.00	0.02
349	300326	凯利泰	4,300	38,915.00	0.02
350	300088	长信科技	7,600	38,456.00	0.02
351	600508	上海能源	3,900	37,791.00	0.02
352	600863	内蒙华电	11,900	37,366.00	0.02
353	000158	常山北阴	6,700	36,314.00	0.02
354	600713	南京医药	7,900	35,866.00	0.02
355	002277	友阿股份	10,600	35,828.00	0.02
356	002244	滨江集团	8,530	35,399.50	0.02
357	000690	宝新能源	5,400	34,776.00	0.02
358	300166	东方国信	2,800	34,412.00	0.02
359	601179	中国西电	9,300	34,410.00	0.02
360	600017	日照港	10,900	34,335.00	0.02
361	600315	上海家化	1,100	34,265.00	0.02
362	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
363	000997	新大陆	2,000	33,780.00	0.02

364	600606	绿地控股	4,900	33,467.00	0.02
365	600970	中材国际	5,200	33,436.00	0.02
366	600765	中航重机	3,600	33,228.00	0.02
367	300214	日科化学	5,400	33,048.00	0.02
368	600266	北京城建	4,100	33,046.00	0.02
369	603359	东珠生态	1,900	32,205.00	0.02
370	600511	国药股份	1,400	32,158.00	0.02
371	600039	四川路桥	8,800	32,032.00	0.02
372	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
373	600098	广州发展	5,100	31,416.00	0.02
374	600410	华胜天成	2,900	31,117.00	0.02
375	601872	招商轮船	7,100	30,956.00	0.02
376	002831	裕同科技	1,600	30,672.00	0.02
377	603808	歌力思	2,000	30,540.00	0.02
378	000008	神州高铁	8,100	30,537.00	0.02
379	601611	中国核建	3,900	30,342.00	0.02
380	002463	沪电股份	2,200	29,964.00	0.02
381	601607	上海医药	1,600	29,040.00	0.02
382	600563	法拉电子	700	28,819.00	0.02
383	600787	中储股份	5,000	28,650.00	0.02
384	002706	良信电器	5,000	28,200.00	0.02
385	603863	松炆资源	1,217	28,088.36	0.02
386	600820	隧道股份	4,387	27,681.97	0.02
387	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.02
388	000598	兴蓉环境	5,900	26,845.00	0.02
389	601958	金钼股份	4,000	26,800.00	0.02
390	002416	爱施德	4,200	26,250.00	0.02
391	600629	华建集团	2,720	26,248.00	0.02
392	002375	亚厦股份	4,400	26,004.00	0.02
393	300483	沃施股份	700	25,704.00	0.02
394	002344	海宁皮城	5,500	25,630.00	0.02
395	601969	海南矿业	4,300	25,284.00	0.02
396	600869	智慧能源	5,500	24,860.00	0.02
397	300320	海达股份	5,200	24,752.00	0.02
398	600718	东软集团	1,900	24,358.00	0.02
399	600801	华新水泥	1,200	24,300.00	0.02
400	600120	浙江东方	1,900	24,206.00	0.02
401	600079	人福医药	2,300	24,150.00	0.02
402	600376	首开股份	2,700	24,111.00	0.02

403	002004	华邦健康	4,924	23,930.64	0.02
404	002701	奥瑞金	5,100	23,817.00	0.02
405	601118	海南橡胶	4,600	23,690.00	0.02
406	600908	无锡银行	4,200	23,688.00	0.02
407	000021	深科技	2,900	23,577.00	0.02
408	000627	天茂集团	3,600	23,364.00	0.01
409	300257	开山股份	2,100	23,268.00	0.01
410	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
411	000560	我爱我家	4,800	22,944.00	0.01
412	000875	吉电股份	7,200	22,896.00	0.01
413	000987	越秀金控	2,500	22,550.00	0.01
414	002317	众生药业	2,600	22,126.00	0.01
415	300055	万邦达	3,100	22,103.00	0.01
416	600528	中铁工业	1,900	21,983.00	0.01
417	002267	陕天然气	2,600	21,294.00	0.01
418	600881	亚泰集团	6,473	21,037.25	0.01
419	000028	国药一致	500	20,915.00	0.01
420	000090	天健集团	4,100	20,254.00	0.01
421	600177	雅戈尔	3,140	19,939.00	0.01
422	600348	阳泉煤业	3,300	19,173.00	0.01
423	002266	浙富控股	4,000	19,000.00	0.01
424	002242	九阳股份	900	18,729.00	0.01
425	600466	蓝光发展	2,900	18,038.00	0.01
426	002022	科华生物	1,800	18,018.00	0.01
427	603123	翠微股份	3,000	17,910.00	0.01
428	600171	上海贝岭	1,100	17,875.00	0.01
429	000009	中国宝安	3,100	17,701.00	0.01
430	300035	中科电气	2,900	16,414.00	0.01
431	600063	皖维高新	5,800	16,240.00	0.01
432	601101	昊华能源	2,500	15,525.00	0.01
433	002838	道恩股份	1,240	13,888.00	0.01
434	600211	西藏药业	400	12,664.00	0.01
435	002555	三七互娱	900	12,195.00	0.01
436	002304	洋河股份	100	12,156.00	0.01
437	002393	力生制药	500	12,040.00	0.01
438	600185	格力地产	2,300	11,201.00	0.01
439	601222	林洋能源	2,100	9,849.00	0.01
440	000778	新兴铸管	2,200	9,768.00	0.01
441	000776	广发证券	700	9,618.00	0.01

442	600909	华安证券	1,464	9,574.56	0.01
443	000709	河钢股份	3,200	9,568.00	0.01
444	600488	天药股份	2,200	9,372.00	0.01
445	000959	首钢股份	2,600	9,152.00	0.01
446	600862	中航高科	1,000	8,990.00	0.01
447	601168	西部矿业	1,400	8,932.00	0.01
448	000630	铜陵有色	3,600	8,856.00	0.01
449	002111	威海广泰	700	8,785.00	0.01
450	000547	航天发展	900	8,604.00	0.01
451	603369	今世缘	300	8,367.00	0.01
452	600510	黑牡丹	1,300	8,216.00	0.01
453	600126	杭钢股份	1,800	8,208.00	0.01
454	600999	招商证券	475	8,117.75	0.01
455	002649	博彦科技	900	8,019.00	0.01
456	600782	新钢股份	1,600	8,000.00	0.01
457	002449	国星光电	600	7,968.00	0.01
458	603869	新智认知	434	7,898.80	0.01
459	000960	锡业股份	700	7,819.00	0.00
460	600295	鄂尔多斯	900	7,461.00	0.00
461	601377	兴业证券	1,100	7,414.00	0.00
462	600795	国电电力	2,900	7,366.00	0.00
463	002025	航天电器	300	7,314.00	0.00
464	000155	川能动力	1,700	7,225.00	0.00
465	000686	东北证券	800	7,048.00	0.00
466	300303	聚飞光电	2,100	6,951.00	0.00
467	300207	欣旺达	600	6,912.00	0.00
468	000761	本钢板材	1,600	6,880.00	0.00
469	603660	苏州科达	440	6,859.60	0.00
470	601005	重庆钢铁	3,400	6,834.00	0.00
471	603528	多伦科技	900	6,750.00	0.00
472	300383	光环新网	400	6,708.00	0.00
473	300020	银江股份	800	6,448.00	0.00
474	002818	富森美	500	6,415.00	0.00
475	600958	东方证券	600	6,408.00	0.00
476	601992	金隅集团	1,700	6,392.00	0.00
477	600497	驰宏锌锗	1,200	6,096.00	0.00
478	002484	江海股份	1,000	6,060.00	0.00
479	000636	风华高科	500	6,050.00	0.00
480	603678	火炬电子	300	6,045.00	0.00

481	600097	开创国际	583	6,022.39	0.00
482	000930	中粮生化	800	6,016.00	0.00
483	000166	申万宏源	1,200	6,012.00	0.00
484	300513	恒实科技	218	5,844.58	0.00
485	300182	捷成股份	1,300	5,733.00	0.00
486	000060	中金岭南	1,200	5,628.00	0.00
487	002736	国信证券	400	5,264.00	0.00
488	600317	营口港	1,900	5,244.00	0.00
489	002664	长鹰信质	400	5,236.00	0.00
490	600031	三一重工	400	5,232.00	0.00
491	300300	汉鼎宇佑	500	5,190.00	0.00
492	000032	深桑达 A	500	4,965.00	0.00
493	002654	万润科技	1,200	4,956.00	0.00
494	600982	宁波热电	1,400	4,760.00	0.00
495	601198	东兴证券	400	4,752.00	0.00
496	600189	吉林森工	1,100	4,697.00	0.00
497	300114	中航电测	500	4,655.00	0.00
498	300324	旋极信息	800	4,632.00	0.00
499	300532	今天国际	300	4,560.00	0.00
500	300149	量子生物	300	4,545.00	0.00
501	600011	华能国际	700	4,361.00	0.00
502	002221	东华能源	500	4,305.00	0.00
503	000878	云南铜业	400	4,252.00	0.00
504	002528	英飞拓	1,000	4,090.00	0.00
505	300232	洲明科技	420	4,065.60	0.00
506	002139	拓邦股份	700	4,060.00	0.00
507	000767	漳泽电力	1,400	4,018.00	0.00
508	000100	TCL 集团	1,200	3,996.00	0.00
509	300271	华宇软件	200	3,800.00	0.00
510	603989	艾华集团	200	3,776.00	0.00
511	000898	鞍钢股份	990	3,752.10	0.00
512	002546	新联电子	800	3,664.00	0.00
513	600724	宁波富达	937	3,626.19	0.00
514	002376	新北洋	300	3,585.00	0.00
515	002518	科士达	400	3,584.00	0.00
516	601333	广深铁路	1,100	3,553.00	0.00
517	600023	浙能电力	800	3,536.00	0.00
518	600452	涪陵电力	200	3,532.00	0.00
519	300075	数字政通	300	3,360.00	0.00

520	300438	鹏辉能源	200	3,236.00	0.00
521	000869	张裕A	100	3,212.00	0.00
522	600618	氯碱化工	400	3,144.00	0.00
523	000783	长江证券	400	3,124.00	0.00
524	600050	中国联通	500	3,080.00	0.00
525	601117	中国化学	500	3,010.00	0.00
526	002065	东华软件	400	2,796.00	0.00
527	300381	溢多利	300	2,727.00	0.00
528	601579	会稽山	300	2,649.00	0.00
529	002624	完美世界	100	2,581.00	0.00
530	002323	ST百特	1,900	2,489.00	0.00
531	300212	易华录	100	2,450.00	0.00
532	300248	新开普	300	2,340.00	0.00
533	600271	航天信息	100	2,305.00	0.00
534	000603	盛达矿业	200	2,236.00	0.00
535	000932	华菱钢铁	460	2,194.20	0.00
536	600188	兖州煤业	200	2,174.00	0.00
537	600965	福成股份	200	2,120.00	0.00
538	600219	南山铝业	900	2,034.00	0.00
539	600307	酒钢宏兴	1,000	2,030.00	0.00
540	300367	东方网力	200	1,974.00	0.00
541	000887	中鼎股份	200	1,918.00	0.00
542	002402	和而泰	200	1,894.00	0.00
543	300233	金城医药	100	1,892.00	0.00
544	000662	天夏智慧	400	1,860.00	0.00
545	600429	三元股份	300	1,812.00	0.00
546	600100	同方股份	200	1,810.00	0.00
547	300094	国联水产	400	1,804.00	0.00
548	002092	中泰化学	200	1,592.00	0.00
549	600362	江西铜业	100	1,574.00	0.00
550	300439	美康生物	100	1,471.00	0.00
551	600335	国机汽车	200	1,384.00	0.00
552	601058	赛轮轮胎	400	1,188.00	0.00
553	000829	天音控股	200	1,164.00	0.00
554	601985	中国核电	200	1,112.00	0.00
555	002203	海亮股份	100	1,082.00	0.00
556	002014	永新股份	100	815.00	0.00
557	601107	四川成渝	200	810.00	0.00
558	002788	鹭燕医药	100	796.00	0.00

559	600829	人民同泰	100	707.00	0.00
560	002106	莱宝高科	100	704.00	0.00
561	601919	中远海控	100	502.00	0.00
562	002641	永高股份	100	406.00	0.00
563	600565	迪马股份	100	373.00	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	600704	物产中大	4,471,952.00	3.51
2	002345	潮宏基	4,345,442.87	3.41
3	002416	爱施德	4,013,515.00	3.15
4	300130	新国都	3,282,535.69	2.57
5	600469	风神股份	3,267,705.00	2.56
6	002478	常宝股份	3,217,728.00	2.52
7	600985	淮北矿业	3,128,874.00	2.45
8	002048	宁波华翔	3,066,945.76	2.41
9	600827	百联股份	3,029,348.00	2.38
10	603520	司太立	3,016,955.00	2.37
11	600580	卧龙电驱	2,998,379.00	2.35
12	600062	华润双鹤	2,965,526.80	2.33
13	600971	恒源煤电	2,907,260.81	2.28
14	000623	吉林敖东	2,892,969.52	2.27
15	600565	迪马股份	2,891,477.00	2.27
16	603855	华荣股份	2,861,641.00	2.24
17	002233	塔牌集团	2,836,349.94	2.22
18	000059	华锦股份	2,795,881.00	2.19
19	603298	杭叉集团	2,780,245.00	2.18
20	300196	长海股份	2,746,342.00	2.15
21	603766	隆鑫通用	2,722,398.00	2.14
22	600694	大商股份	2,718,647.02	2.13

23	601717	郑煤机	2,704,334.29	2.12
24	600567	山鹰纸业	2,698,006.00	2.12
25	002020	京新药业	2,677,464.00	2.10
26	000672	上峰水泥	2,676,992.00	2.10
27	600754	锦江股份	2,658,779.08	2.09
28	002272	川润股份	2,626,238.38	2.06
29	000900	现代投资	2,624,107.95	2.06
30	601588	北辰实业	2,612,253.00	2.05
31	002381	双箭股份	2,599,031.00	2.04
32	603444	吉比特	2,570,418.00	2.02
33	002299	圣农发展	2,564,552.90	2.01
34	603368	柳药股份	2,552,702.00	2.00

#### 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	601318	中国平安	4,796,077.50	3.76
2	002345	潮宏基	4,511,244.74	3.54
3	002416	爱施德	4,129,195.80	3.24
4	600704	物产中大	3,926,263.90	3.08
5	600580	卧龙电驱	3,735,487.99	2.93
6	000651	格力电器	3,649,715.50	2.86
7	600565	迪马股份	3,481,525.00	2.73
8	000778	新兴铸管	3,237,536.00	2.54
9	002233	塔牌集团	3,109,756.00	2.44
10	600985	淮北矿业	3,027,662.00	2.37
11	603520	司太立	3,024,954.20	2.37
12	603766	隆鑫通用	2,990,020.00	2.35
13	600469	风神股份	2,964,799.88	2.33
14	600827	百联股份	2,948,423.20	2.31
15	600567	山鹰纸业	2,934,555.00	2.30
16	300130	新国都	2,923,237.40	2.29
17	600782	新钢股份	2,913,522.00	2.29
18	002478	常宝股份	2,824,638.00	2.22



19	600801	华新水泥	2,817,791.00	2.21
20	601166	兴业银行	2,817,183.00	2.21
21	600383	金地集团	2,759,753.70	2.16
22	601678	滨化股份	2,739,371.32	2.15
23	002004	华邦健康	2,715,871.52	2.13
24	002048	宁波华翔	2,703,718.93	2.12
25	603855	华荣股份	2,683,062.00	2.10
26	600585	海螺水泥	2,673,123.00	2.10
27	600754	锦江股份	2,644,089.45	2.07
28	002332	仙琚制药	2,638,541.00	2.07
29	600035	楚天高速	2,623,352.71	2.06
30	300088	长信科技	2,563,951.00	2.01

### 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	946,947,248.18
卖出股票收入（成交）总额	958,326,366.48

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	16,695,100.00	10.66
	其中：政策性金融债	16,695,100.00	10.66
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）	46,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,741,100.00	10.69

**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	190201	19 国开 01	150,000	14,994,000.00	9.58
2	108603	国开 1804	15,000	1,500,900.00	0.96
3	108901	农发 1801	2,000	200,200.00	0.13
4	113028	环境转债	460	46,000.00	0.03

**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投资。

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1907	中证 500 期货 1907 合约	14	13,737,920.00	-41,520.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-41,520.00
股指期货投资本期收益（元）					-180.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-41,520.00

## 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金通过做多股指期货增加部分杠杆，在保证基金权益仓位满足基金策略需求的前提下，释放出部分资金进行新股申购等操作，力争为投资者获取更多的收益。

## 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

本报告期末，本基金无国债期货投资。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末，本基金无国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期末，本基金无国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,699,729.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	224,525.44
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,924,254.61

#### **7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### **7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

#### **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

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
211	739, 591. 85	155, 968, 696. 43	99. 95%	85, 184. 50	0. 05%

### 8.2 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	6, 905. 50	0. 0044%

### 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	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

## § 9 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	156,039,802.60
本报告期期间基金总申购份额	85,089.73
减：本报告期期间基金总赎回份额	71,011.40
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	156,053,880.93

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金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

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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	
长江证券	2	21,219,767,990.42	64.08%	892,000.20	64.08%	-
天风证券	2	588,511,403.43	30.92%	430,350.68	30.92%	-
东兴证券	2	95,293,384.63	5.01%	69,685.89	5.01%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

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；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。

**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
长江证券	25,483,637.90	94.00%	419,140,000.00	75.12%	-	-
天风证券	806,382.81	2.97%	93,200,000.00	16.70%	-	-
东兴证券	721,176.00	2.66%	45,600,000.00	8.17%	-	-
中金公司	99,300.00	0.37%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

## 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	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金2018年第4季度报告	《证券日报》及/或公司网站	2019年1月22日
3	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《证券日报》及/或公司网站	2019年2月20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》及/或公司网站	2019年3月12日
5	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	《证券日报》及/或公司网站	2019年3月28日
6	中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金2019年第1季度报告	《证券日报》及/或公司网站	2019年4月19日
7	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
8	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
9	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（2019年第1号）	《证券日报》及/或公司网站	2019年6月22日

10	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险揭示的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及/或公司网站	2019 年 6 月 25 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 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日	110,000,000.00	-	-	110,000,000.00	70.49%
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、中国证监会准予本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、本基金申请募集注册的法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 7、报告期内本基金在指定媒介上发布的各项公告
- 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