

中金衡优灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 21 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 2020 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	74
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	74
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	74

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	74
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	74
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
8.12 投资组合报告附注	75
§ 9 基金份额持有人信息	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	77
§ 10 开放式基金份额变动	78
§ 11 重大事件揭示	79
11.1 基金份额持有人大会决议	79
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
11.4 基金投资策略的改变	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
11.8 其他重大事件	80
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	83
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	83
§ 13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	84
13.2 存放地点	84
13.3 查阅方式	84

§ 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	120,313,813.29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	67,478,320.02份	52,835,493.27份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	<p>本基金主要采用专业的投资理念和严谨的分析方法，以系统化的量化模型和深入的基本面研究为基础，基于对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场政策分析等宏观基本 面研究，结合对各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等因素的评估，严格遵守各项风 险控制指标，合理确定本基金在股票、债券、 现金等金融工具上的投资比例，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例，通过对各类资产的灵活配置，在有效控制风险的基础上，获取稳定的投资收益。</p> <p>基金管理人从多个维度对各类资产的投资机会 进行深入分析，考量的维度主要包括以下因 素：（1）宏观经济因素。包括国际资本市场宏观经 济数据的变化、国内 CPI 和 PPI 的变化、货币 供给与需求水平的变化、利率水平的变化以及 市场对以上因素的预期等；（2）政策预期因素。包括财政和货币政 策以及 与证券市场密切相关的其他各种政策出台对市 场的影响及市场对这些因素的预期等；（3）市场行业因素。包括行业的盈利周期和环 境的变化、行业内主要上市企业的盈利变化以 及市场对行业变化的预测等；（4）量化指 标因素。包括统计市场截面数据时 间序列的变化特征、市场指数风险收益特征时 间序列的变化特征、市场震荡趋势强度的变化 特征、分形理论出发的市 场模式的变化、金融 物理学角度出发的金融泡沫统计指标的变化、 市场微观 结构出发的分析师一致预期分歧的变 化和趋势等。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中债综合财富(总值)指数收益率×70%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李虹	许俊
	联系电话	010-63211122	010-66594319
	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年		2018 年 6 月 8 日 (基金合同生效日)–2018 年 12 月 31 日		2017 年	
	中金衡优 A	中金衡优 C	中金衡优 A	中金衡优 C	中金衡优 A	中金衡优 C
本期已实现收益	6,757,484.13	2,504,950.84	1,297,298.78	333,709.72	-	-
本期利润	8,231,529.01	5,306,278.71	1,717,579.89	279,609.51	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.1413	0.1662	0.0193	0.0080	-	-
本期加权平均净值利润率	12.78%	15.05%	1.91%	0.80%	-	-
本期基金份额净值增长率	14.06%	13.51%	1.76%	1.20%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
期末可供分配利润	7,048,366.01	4,888,537.33	1,130,829.59	214,074.76	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.1045	0.0925	0.0162	0.0106	-	-
期末基金资产净值	75,585,588.99	58,545,865.04	70,981,294.48	20,345,406.90	-	-
期末基金份额净值	1.1201	1.1081	1.0176	1.0120	-	-
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
基金份额累计净值增长率	16.07%	14.87%	1.76%	1.20%	-	-

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

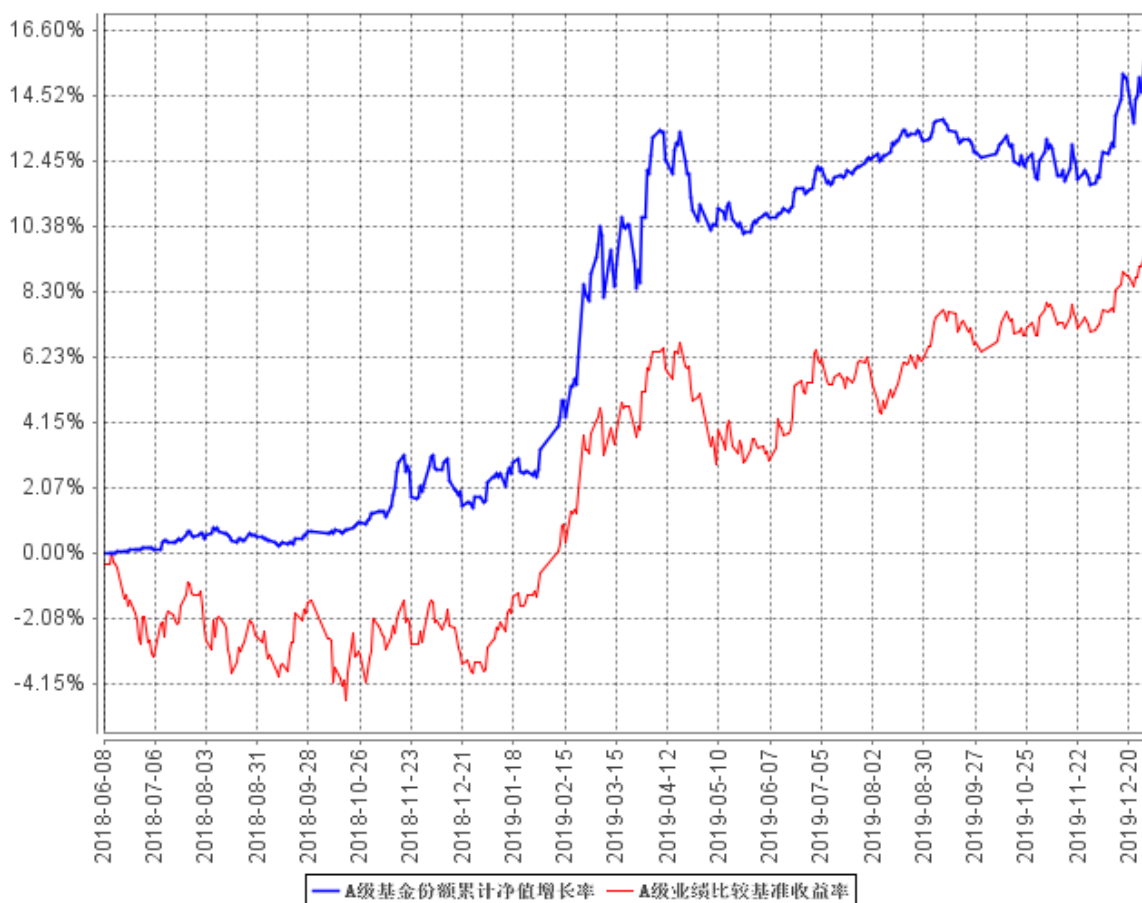
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.15%	0.36%	3.13%	0.22%	0.02%	0.14%
过去六个月	4.05%	0.27%	4.11%	0.25%	-0.06%	0.02%
过去一年	14.06%	0.40%	13.65%	0.36%	0.41%	0.04%
自基金合同生效起至今	16.07%	0.33%	9.73%	0.39%	6.34%	-0.06%

中金衡优 C

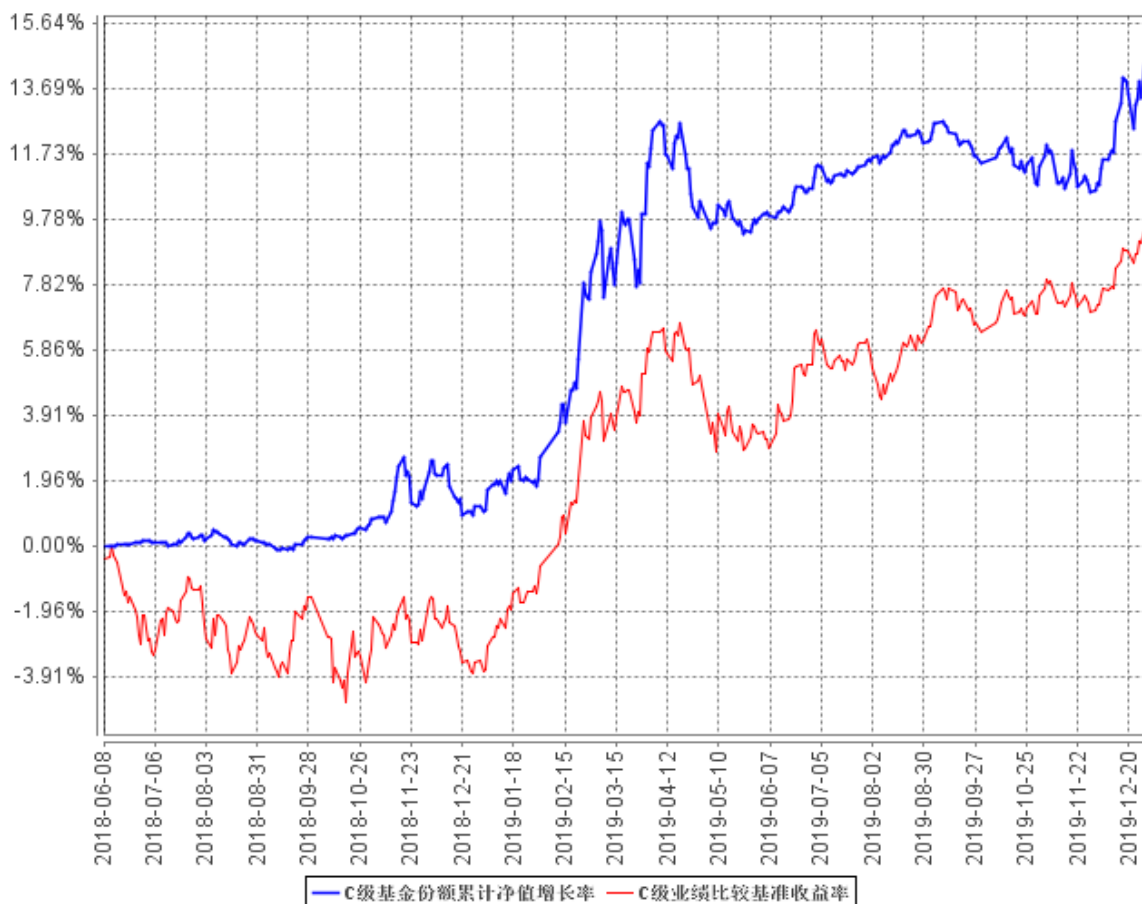
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.05%	0.36%	3.13%	0.22%	-0.08%	0.14%
过去六个月	3.76%	0.27%	4.11%	0.25%	-0.35%	0.02%
过去一年	13.51%	0.40%	13.65%	0.36%	-0.14%	0.04%
自基金合同生效起至今	14.87%	0.33%	9.73%	0.39%	5.14%	-0.06%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

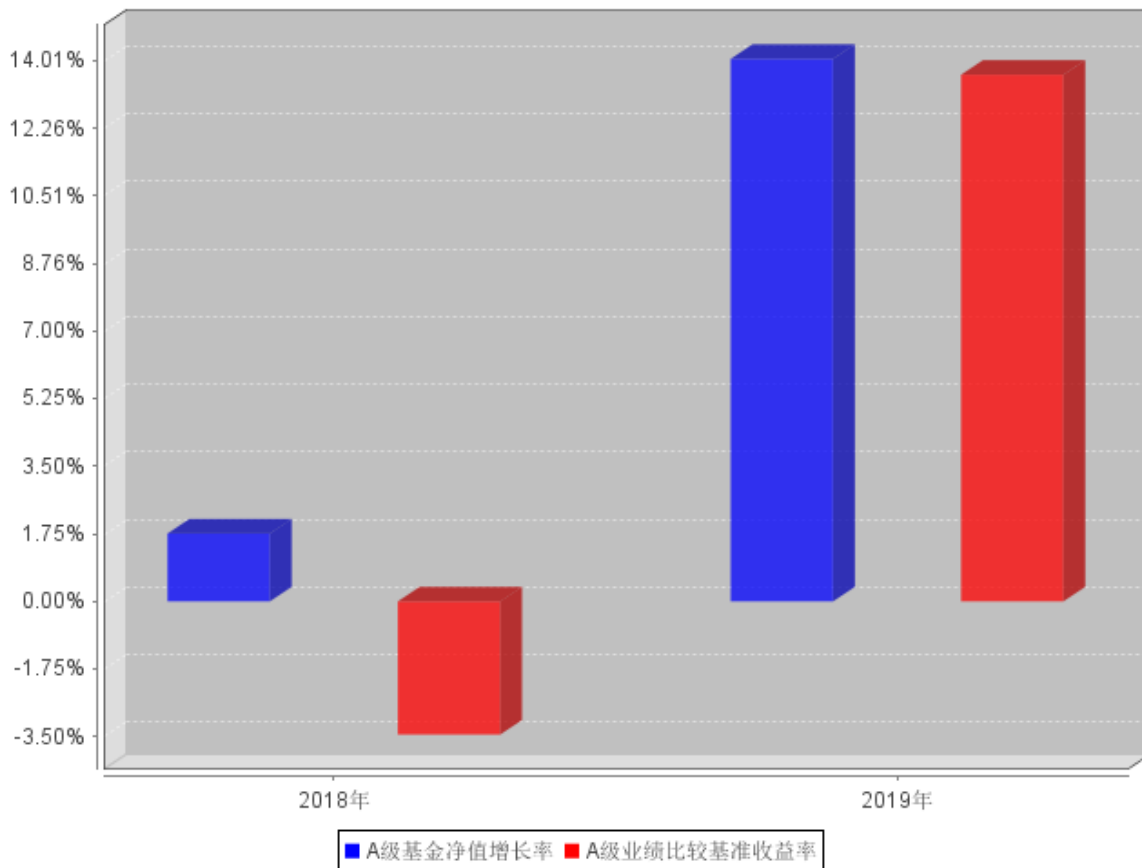


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

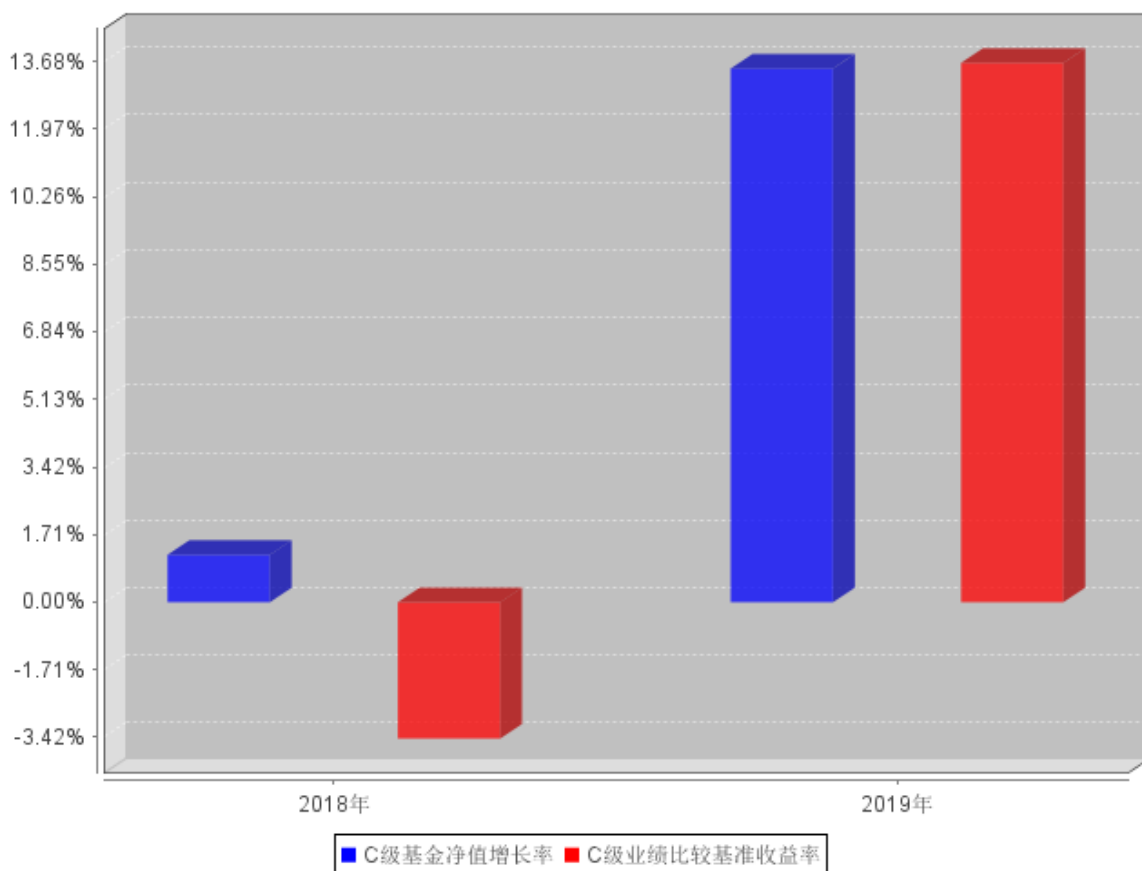


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

中金衡优 A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2019	0.4000	2,696,657.34	3,030.23	2,699,687.57	
2018	-	-	-	-	
合计	0.4000	2,696,657.34	3,030.23	2,699,687.57	

单位：人民币元

中金衡优 C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2019	0.4000	3,732,428.88	168,183.17	3,900,612.05	
2018	-	-	-	-	
合计	0.4000	3,732,428.88	168,183.17	3,900,612.05	

§ 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 4 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 12 月 31 日，公司共管理 28 只开放式基金，证券投资基金管理规模 237.84 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	2019 年 7 月 12 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。

注：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。

3、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，本基金采用大类资产配置的策略，运作正常。我们会继续深入研究，力争更好的表现。

从中长期的战略资产配置层面来看，我们认为当前全球经济增长仍然面临一定压力，但国内库存周期已转向复苏，而 2020 年的通货膨胀在高基数下预计整体平稳，难以成为影响资产价格的主要因素，因此，我们调高了组合的权益仓位水平，同时降低债券久期。在结构上，尽管短期经济周期向上，但地产政策转向的背景下，国内整体经济增速料将进一步下台阶，同时，5G 周期将引领电子、传媒等科技板块迎来新一轮的三年以上的盈利周期，科技股大概率继续引领权益风险偏好。

从短期的战术资产配置阶段来看，A 股情绪面和技术面全面转暖，经济信号出现显著改善，中美贸易摩擦进入阶段缓和。综合多方面考量，我们在短期战术层面维持中性偏多判断。

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 1.1201 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.06%；截至本报告期末中金衡优 C 基金份额净值为 1.1081 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.51%；同期业绩比较基准收益率为 13.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

12 月以来，新兴市场国家 PMI 延续回暖，增强了市场对于全球制造业复苏的信心。从中国过去一年信贷扩张的情况来看，上半年全球制造业的温和复苏可期。国内方面，专项债的前倾有望对上半年的基建投资形成支撑。全球贸易关系的缓和与国内 M1 的弱企稳都可能支持制造业于上半年开启新一轮的补库周期，进而带动制造业投资的修复。2019 年以来，主流房企销售面积与销售价格呈明显的负相关关系，表明开发商主要通过降价支撑销售面积。由于 2019 年商品房销售均价同比增速仍有 7% 以上的涨幅，以价换量可能仍有空间，在这种情况下短期地产的下行风险可能较为可控。总结而言，近期经济动能弱复苏，债券动能减弱，权益动能增强。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作，强化制度完善及对制度执行情况的监督检查，相关主要工作如下：

1) 紧密跟踪并组织落实法律法规、自律规则及监管要求，不断完善基金运作管理内部制度建设，促进依法合规展业；2) 研究、投资交易方面，围绕内幕交易、利用未公开信息交易等重点防范的违法违规行为 and 各项最新监管要求，开展合规培训，进一步提高员工合规守法意识。3) 营销

与销售方面，持续对基金宣传推介材料、销售服务协议等材料文件进行合规审查，定期开展投资者适当性培训及销售业务专项培训，加强销售行为管理。4) 基金运作保障方面，持续为注册登记、基金会计、资金清算等业务提供合规咨询，适时开展合规检查，为基金运营安全提供法律合规支持。5) 信息披露方面，严格落实《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，更新信息披露工作流程，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露内容的真实、准确、完整、及时、规范。6) 以中国证监会《季度监察稽核项目表》为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，同时有重点地开展定期不定期的合规检查、内部稽核，促进公司合规运作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施不断完善，坚持维护基金份额持有人合法权益。本基金管理人将继续从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益，提高监察稽核工作的有效性。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的基金管理人于 2019 年 12 月 23 日发布《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 2019 年第 1 次分红公告》，收益分配基准日为 2019 年 12 月 13 日，本次基金 A 类份额每 10 份基金份额发放现金红利 0.4000 元，C 类份额每 10 份基金份额发放现金红利 0.4000 元。

具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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。

报告期内，本基金 A 级实施利润分配的金额为 2,699,687.57 元，C 级实施利润分配的金额为 3,900,612.05 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2001655 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中金衡优灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了后附的第 1 页至第 37 页的中金衡优灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“中金衡优基金”）财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表、2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了中金衡优基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中金衡优基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>中金衡优基金管理人中金基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括中金衡优基金 2019 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中金衡优基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时,中金衡优基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责评估中金衡优基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非中金衡优基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>中金衡优基金管理人中金基金管理有限公司治理层负责监督中金衡优基金的财务报告过程。</p>	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价中金衡优基金管理人中金基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对中金衡优基金管理人中金基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对中金衡优基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致中金衡优基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与中金衡优基金管理人中金基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	管祎铭	李瑞丛
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2020年4月15日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,057,394.75	128,013.01
结算备付金		2,872,800.94	871,877.08
存出保证金		40,881.54	26,941.80
交易性金融资产	7.4.7.2	121,923,730.45	88,012,229.69
其中：股票投资		92,126,722.95	23,744,429.69
基金投资		-	-
债券投资		29,797,007.50	64,267,800.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	1,300,000.00
应收证券清算款		9,698,354.01	488,333.14
应收利息	7.4.7.5	593,785.15	1,477,259.26
应收股利		-	-
应收申购款		11,009.91	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		136,197,956.75	92,304,653.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,017,893.88	575,098.22
应付赎回款		596,815.14	15.23
应付管理人报酬		135,208.38	124,732.79
应付托管费		42,252.63	20,788.81
应付销售服务费		35,235.52	6,942.28
应付交易费用	7.4.7.7	170,422.04	64,114.95
应交税费		3,967.36	1,260.32
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	64,707.77	185,000.00
负债合计		2,066,502.72	977,952.60
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	120,313,813.29	89,860,953.69
未分配利润	7.4.7.10	13,817,640.74	1,465,747.69
所有者权益合计		134,131,454.03	91,326,701.38
负债和所有者权益总计		136,197,956.75	92,304,653.98

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，A 类基金净值人民币 1.1201 元，基金份额总额 67,478,320.02 份，C 类基金净值人民币 1.1081 元，基金份额总额 52,835,493.27 份，总份额合计 120,313,813.29 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 8 日(基金 合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		15,688,098.49	3,895,051.58
1.利息收入		2,406,690.40	2,966,610.05
其中：存款利息收入	7.4.7.11	54,499.48	700,138.50
债券利息收入		2,199,994.77	2,217,585.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		152,196.15	48,885.76
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,605,260.15	333,771.90
其中：股票投资收益	7.4.7.12	6,800,663.36	-934,147.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,719,185.14	1,256,548.54
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-83,300.00	-
股利收益	7.4.7.16	168,711.65	11,370.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,275,372.75	366,180.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	400,775.19	228,488.73
减：二、费用		2,150,290.77	1,897,862.18
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,065,270.27	1,054,161.50
2. 托管费	7.4.10.2.2	245,810.86	175,693.54
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	135,975.19	77,802.04
4. 交易费用	7.4.7.19	496,542.78	152,290.50
5. 利息支出		88,039.64	234,831.95
其中：卖出回购金融资产支出		88,039.64	234,831.95
6. 税金及附加		1,504.46	4,021.31
7. 其他费用	7.4.7.20	117,147.57	199,061.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,537,807.72	1,997,189.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,537,807.72	1,997,189.40

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	13,537,807.72	13,537,807.72
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）	30,452,859.60	5,414,384.95	35,867,244.55
其中：1. 基金申购款	221,149,243.28	26,336,237.52	247,485,480.80
2. 基金赎回款	-190,696,383.68	-20,921,852.57	-211,618,236.25
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）	-	-6,600,299.62	-6,600,299.62

五、期末所有者权益（基金净值）	120,313,813.29	13,817,640.74	134,131,454.03
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12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	1,997,189.40	1,997,189.40
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）	-135,330,159.20	-531,441.71	-135,861,600.91
其中：1. 基金申购款	74,880,631.18	606,114.87	75,486,746.05
2. 基金赎回款	-210,210,790.38	-1,137,556.58	-211,348,346.96
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）	89,860,953.69	1,465,747.69	91,326,701.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

孙菁

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

7.4 报表附注

7.4.1 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”）、中国中金财富证券有限公司（以下简称“中金财富”，原“中国中投证券有限责任公司”）及包商银行股份有限公司等共同销售，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 61978.74 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）。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019

年 12 月 31 日的财务状况、2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

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

2、应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

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

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

1、收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

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

3、该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险

和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 1、所转移金融资产的账面价值
- 2、因转移而收到的对价

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本期未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

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

(a) 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。

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

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称“管理人”）运营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。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金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。

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	1,057,394.75	128,013.01
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：	1,057,394.75	128,013.01

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	87,502,939.77	92,126,722.95	4,623,783.18
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,667,628.10	9,673,007.50
	银行间市场	20,111,448.46	20,124,000.00
	合计	29,779,076.56	29,797,007.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	117,282,016.33	121,923,730.45	4,641,714.12
项目	上年度末 2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,023,200.53	23,744,429.69	-1,278,770.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	11,910,058.26	11,942,800.00
	银行间市场	50,712,790.00	52,325,000.00
	合计	62,622,848.26	64,267,800.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	87,646,048.79	88,012,229.69	366,180.90

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上期末均未持有任何衍生金融资产 / 负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-

银行间市场	-	-
合计	-	-
	上年度末 2018 年 12 月 31 日	
项目	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,300,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,300,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末及上期末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,456.00	857.00
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	967.45	431.53
应收债券利息	589,143.10	1,476,624.66
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-801.64	-667.24
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	20.24	13.31
合计	593,785.15	1,477,259.26

7.4.7.6 其他资产

本基金于本期末及上期末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	165,159.84	60,676.06
银行间市场应付交易费用	5,262.20	3,438.89
合计	170,422.04	64,114.95

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	707.77	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	64,000.00	185,000.00
合计	64,707.77	185,000.00

7.4.7.9 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12月31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	120,049,102.54	120,049,102.54
本期赎回（以“-”号填列）	-122,327,413.06	-122,327,413.06
- 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	67,478,320.02	67,478,320.02

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12月31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	101,100,140.74	101,100,140.74
本期赎回（以“-”号填列）	-68,368,970.62	-68,368,970.62
- 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	52,835,493.27	52,835,493.27

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

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	6,757,484.13	1,474,044.88	8,231,529.01
本期基金份额交易产生的变动数	1,859,739.86	-508,976.27	1,350,763.59
其中：基金申购款	14,734,255.11	221,894.00	14,956,149.11
基金赎回款	-12,874,515.25	-730,870.27	-13,605,385.52
本期已分配利润	-2,699,687.57	-	-2,699,687.57
本期末	7,048,366.01	1,058,902.96	8,107,268.97

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	2,504,950.84	2,801,327.87	5,306,278.71
本期基金份额交易产生的变动数	6,070,123.78	-2,006,502.42	4,063,621.36
其中：基金申购款	12,525,849.03	-1,145,760.62	11,380,088.41
基金赎回款	-6,455,725.25	-860,741.80	-7,316,467.05
本期已分配利润	-3,900,612.05	-	-3,900,612.05
本期末	4,888,537.33	821,834.44	5,710,371.77

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	42,811.93	43,902.67
定期存款利息收入	-	642,872.22
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	11,177.97	13,199.91
其他	509.58	163.70
合计	54,499.48	700,138.50

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年6月8日(基金合 同生效日)至2018年12月31 日
卖出股票成交总额	166,436,703.88	48,261,808.74
减：卖出股票成本总额	159,636,040.52	49,195,955.80
买卖股票差价收入	6,800,663.36	-934,147.06

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年6月8日(基金合 同生效日)至2018年12月31 日
债券投资收益——买卖债券（、债 转股及债券到期兑付）差价收入	1,719,185.14	1,256,548.54
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	1,719,185.14	1,256,548.54

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年6月8日(基金合 同生效日)至2018年12月31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	381,073,031.64	201,039,310.21
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	373,220,901.65	196,060,821.23
减：应收利息总额	6,132,944.85	3,721,940.44
买卖债券差价收入	1,719,185.14	1,256,548.54

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本期及上期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本期及上期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金在本期及上期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金在本期及上期间均无贵金属投资收益。

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

本基金在本期及上期间均无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日
国债期货投资收益	-83,300.00	-
股指期货-投资收益	-	-

7.4.7.16 股利收益

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12月31日	2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	168,711.65	11,370.42
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	168,711.65	11,370.42

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生 效日)至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	4,275,372.75	366,180.90
——股票投资	5,902,393.55	-1,278,770.84
——债券投资	-1,627,020.80	1,644,951.74
——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	4,275,372.75	366,180.90

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生效 日)至2018年12月31日
基金赎回费收入	400,775.19	223,984.91
其他	-	4,503.82
合计	400,775.19	228,488.73

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生效 日)至2018年12月31日
交易所市场交易费用	485,746.50	149,765.50
银行间市场交易费用	10,540.00	2,525.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
期货交易费用	256.28	-
合计	496,542.78	152,290.50

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生 效日)至2018年12月31日
审计费用	35,000.00	35,000.00
信息披露费	20,000.00	150,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	600.00	400.00
帐户维护费	45,600.00	3,100.00
汇划手续费	15,947.57	10,561.34
合计	117,147.57	199,061.34

7.4.7.21 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机
中国银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中金财富证券	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构
中金资本运营有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金浦成投资有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金期货有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中国国际金融（香港）有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
中金财富证券	388,508,762.67	100.00%	122,480,965.07	100.00%

7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
中金财富证券	74,503,524.78	100.00%	282,343,344.73	100.00%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
中金财富证券	1,556,760,000.00	100.00%	1,825,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金在本期及上期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中金财富证券	284,114.21	100.00%	165,159.84	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中金财富证券	89,567.69	100.00%	60,676.06	100.00%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,065,270.27	1,054,161.50
其中：支付销售机构的客户维护费	255,459.64	345,401.39

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乘以约定的年费率计提，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 × 管理费率 / 当年天数

2019年6月18日前，本基金管理费率为1.5%。本基金管理人自2019年6月19日起对本基金实施调整后的基金管理费率，调整后的基金管理费率为0.80%。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	245,810.86	175,693.54

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日

累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

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12月31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	-	23,433.01	23,433.01
中金基金	-	11,334.94	11,334.94
中金公司	-	16,027.13	16,027.13
中金财富证券	-	68,828.18	68,828.18
合计	-	119,623.26	119,623.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生效日)至2018年12月31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	-	15,478.62	15,478.62
中金基金	-	50,674.46	50,674.46
中金公司	-	4,210.91	4,210.91
中金财富证券	-	0.00	0.00
合计	-	70,363.99	70,363.99

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% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

3、本基金合同生效日为 2018 年 6 月 8 日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本期及上期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本期及上期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本期及上期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本年末及上期末未持有本基金。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2018年6月8日(基金合同生效日)至 2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,057,394.75	42,811.93	128,013.01	43,902.67

注：本基金通过“中国银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于2019年12月31日的相关余额为人民币2,913,682.48元(2018年12月31日：人民币898,818.88元)。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本期及上期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

中金衡优A

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2019年 12月25 日	-	2019年 12月25 日	0.4000	2,696,657.34	3,030.23	2,699,687.57	
合计	-	-		0.4000	2,696,657.34	3,030.23	2,699,687.57	

中金衡优 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2019 年 12 月 25 日	-	2019 年 12 月 25 日	0.4000	3,732,428.88	168,183.17	3,900,612.05	
合计	-	-	-	0.4000	3,732,428.88	168,183.17	3,900,612.05	

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位： 股)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
002466	天齐 锂业	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 3 日	老股东 配售未 上市	8.75	30.18	630	5,512.50	19,013.40	-

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股票名 称	停牌日 期	停牌 原因	期末 估值单价	复牌日 期	复牌 开盘单价	数量(股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
603799	华友钴 业	2019 年 12 月 31 日	重大 资产 重组	39.39	2020 年 1 月 2 日	40.43	19,200	736,440.02	756,288.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期风险和收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	10,069,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,055,000.00	-
合计	20,124,000.00	-

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

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	1,057,394.75	-	-	-	1,057,394.75
结算备付金	1,954,357.22	-	-	918,443.72	2,872,800.94
存出保证金	40,881.54	-	-	-	40,881.54
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	92,126,722.95	92,126,722.95
交易性金融资产-债券投资	29,797,007.50	-	-	-	29,797,007.50

买入返售金融资产					
应收证券清算款				9,698,354.01	9,698,354.01
应收利息				593,785.15	593,785.15
应收股利					
应收申购款				11,009.91	11,009.91
资产总计	32,849,641.01			103,348,315.74	136,197,956.75
负债					
卖出回购金融资产款					
应付证券清算款				1,017,893.88	1,017,893.88
应付赎回款				596,815.14	596,815.14
应付管理人报酬				135,208.38	135,208.38
应付托管费				42,252.63	42,252.63
应付交易费用				170,422.04	170,422.04
应付销售服务费				35,235.52	35,235.52
应交税费				3,967.36	3,967.36
应付利息					
其他负债				64,707.77	64,707.77
负债总计				2,066,502.72	2,066,502.72
利率敏感度缺口	32,849,641.01			101,281,813.02	134,131,454.03
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	19,232.38	999,874.92
	市场利率上升 25 个基点	-19,232.38	-999,874.92

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金部分投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	92,126,722.95	68.68	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	29,797,007.50	22.21	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	121,923,730.45	90.90	88,012,229.69	96.37

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	5,946,953.06	-
	业绩比较基准下降5%	-5,946,953.06	-

注：上年度末本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、以公允价值计量的金融工具

(a) 以公允价值计量的资产和负债

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

持续的公允价值 计量资产	本期末（错误！未找到引用源。12月31日）			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产				
- 股票投资	92,126,722.95	91,351,421.55	19,013.40	756,288.00
- 债券投资	29,797,007.50	-	29,797,007.50	-

持续以公允价值计量的资产总额	121,923,730.45	91,351,421.55	29,816,020.90	756,288.00
----------------	----------------	---------------	---------------	------------

持续的公允价值 计量资产	上期末 (错误!未找到引用源。12月31日)			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产				
- 股票投资	23,744,429.69	23,680,999.69	63,430.00	-
- 债券投资	64,267,800.00	-	64,267,800.00	-
持续以公允价值计量的资产总额	88,012,229.69	23,680,999.69	64,331,230.00	-

于 2019 年 12 月 31 日,本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次,账面价值为人民币 775,301.40 元 (2018 年 12 月 31 日: 63,430.00 元)。于 2019 年 12 月 31 日,本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具在三个层次之间发生了转换,由第二层次转换为第一层次,账面价值为人民币 52,935.00 元 (2018 年 12 月 31 日: 零)。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b) 第二层次及第三层次的公允价值计量

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

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

2、其他金融工具的公允价值 (期末非以公允价值计量的项目)

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

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	92,126,722.95	67.64
	其中：股票	92,126,722.95	67.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,797,007.50	21.88
	其中：债券	29,797,007.50	21.88
	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	3,930,195.69	2.89
8	其他各项资产	10,344,030.61	7.59
9	合计	136,197,956.75	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	358,853.00	0.27
B	采矿业	3,817,371.20	2.85
C	制造业	45,296,773.42	33.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,419,517.00	1.06
E	建筑业	1,280,004.00	0.95
F	批发和零售业	785,689.00	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	2,917,364.00	2.18
H	住宿和餐饮业	1,269,873.00	0.95
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,166,595.03	4.60
J	金融业	20,152,768.10	15.02
K	房地产业	5,511,254.00	4.11
L	租赁和商务服务业	859,029.00	0.64
M	科学研究和技术服务业	262,416.00	0.20

N	水利、环境和公共设施管理业	398,086.00	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	100,470.00	0.07
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,326,843.20	0.99
S	综合	203,817.00	0.15
	合计	92,126,722.95	68.68

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	38,800	3,315,848.00	2.47
2	600031	三一重工	118,100	2,013,605.00	1.50
3	000002	万科 A	47,200	1,518,896.00	1.13
4	600030	中信证券	56,600	1,431,980.00	1.07
5	300124	汇川技术	44,600	1,366,544.00	1.02
6	300408	三环集团	60,300	1,343,484.00	1.00
7	000069	华侨城 A	171,700	1,337,543.00	1.00
8	600176	中国巨石	122,700	1,337,430.00	1.00
9	600761	安徽合力	131,600	1,280,468.00	0.95
10	300059	东方财富	79,800	1,258,446.00	0.94
11	600258	首旅酒店	60,500	1,246,905.00	0.93
12	600036	招商银行	31,700	1,191,286.00	0.89
13	601601	中国太保	30,600	1,157,904.00	0.86
14	601688	华泰证券	54,400	1,104,864.00	0.82
15	600690	海尔智家	56,020	1,092,390.00	0.81
16	600741	华域汽车	41,600	1,081,184.00	0.81
17	000625	长安汽车	101,400	1,017,042.00	0.76
18	000636	风华高科	67,600	1,006,564.00	0.75
19	300750	宁德时代	9,300	989,520.00	0.74
20	601628	中国人寿	28,200	983,334.00	0.73
21	002146	荣盛发展	99,800	981,034.00	0.73
22	002508	老板电器	28,300	956,823.00	0.71
23	002035	华帝股份	70,600	947,452.00	0.71
24	000651	格力电器	14,435	946,647.30	0.71

25	000425	徐工机械	163,200	892,704.00	0.67
26	601166	兴业银行	44,800	887,040.00	0.66
27	002110	三钢闽光	94,000	879,840.00	0.66
28	600188	兖州煤业	83,200	878,592.00	0.66
29	601336	新华保险	17,800	874,870.00	0.65
30	000333	美的集团	14,617	851,440.25	0.63
31	600971	恒源煤电	140,700	841,386.00	0.63
32	000039	中集集团	84,380	828,611.60	0.62
33	603799	华友钴业	19,200	756,288.00	0.56
34	600352	浙江龙盛	51,600	746,652.00	0.56
35	601111	中国国航	74,100	718,029.00	0.54
36	600029	南方航空	99,600	715,128.00	0.53
37	600362	江西铜业	41,533	703,153.69	0.52
38	601992	金隅集团	182,000	678,860.00	0.51
39	000807	云铝股份	127,200	653,808.00	0.49
40	002092	中泰化学	94,700	643,013.00	0.48
41	601678	滨化股份	121,700	621,887.00	0.46
42	603993	洛阳钼业	129,900	566,364.00	0.42
43	300136	信维通信	12,400	562,712.00	0.42
44	600703	三安光电	30,100	552,636.00	0.41
45	002456	欧菲光	32,700	510,120.00	0.38
46	600900	长江电力	26,500	487,070.00	0.36
47	000001	平安银行	29,500	485,275.00	0.36
48	600016	民生银行	75,200	474,512.00	0.35
49	601328	交通银行	83,200	468,416.00	0.35
50	600000	浦发银行	35,900	444,083.00	0.33
51	601288	农业银行	116,000	428,040.00	0.32
52	002415	海康威视	12,200	399,428.00	0.30
53	601398	工商银行	65,600	385,728.00	0.29
54	600837	海通证券	24,200	374,132.00	0.28
55	300014	亿纬锂能	7,400	371,184.00	0.28
56	300144	宋城演艺	11,900	367,829.00	0.27
57	600584	长电科技	16,300	358,274.00	0.27
58	002475	立讯精密	9,810	358,065.00	0.27
59	601668	中国建筑	62,000	348,440.00	0.26
60	000725	京东方 A	76,000	345,040.00	0.26
61	600048	保利地产	20,800	336,544.00	0.25
62	300383	光环新网	16,700	335,169.00	0.25
63	300253	卫宁健康	21,800	326,564.00	0.24

64	300450	先导智能	7,200	323,568.00	0.24
65	600585	海螺水泥	5,900	323,320.00	0.24
66	300033	同花顺	2,900	316,419.00	0.24
67	002185	华天科技	41,200	307,764.00	0.23
68	300207	欣旺达	15,200	296,704.00	0.22
69	300017	网宿科技	30,800	293,524.00	0.22
70	300024	机器人	19,900	278,600.00	0.21
71	002156	通富微电	16,700	274,715.00	0.20
72	300088	长信科技	26,600	273,182.00	0.20
73	601888	中国国旅	3,000	266,850.00	0.20
74	300012	华测检测	17,600	262,416.00	0.20
75	601211	国泰君安	14,000	258,860.00	0.19
76	600309	万华化学	4,600	258,382.00	0.19
77	300168	万达信息	16,700	257,681.00	0.19
78	601169	北京银行	44,900	255,032.00	0.19
79	600104	上汽集团	10,600	252,810.00	0.19
80	000063	中兴通讯	7,000	247,730.00	0.18
81	002142	宁波银行	8,800	247,720.00	0.18
82	603160	汇顶科技	1,200	247,560.00	0.18
83	300315	掌趣科技	39,859	245,930.03	0.18
84	300454	深信服	2,100	240,219.00	0.18
85	600009	上海机场	3,000	236,250.00	0.18
86	000338	潍柴动力	14,300	227,084.00	0.17
87	300070	碧水源	29,600	224,960.00	0.17
88	300413	芒果超媒	6,370	222,695.20	0.17
89	300296	利亚德	28,600	219,362.00	0.16
90	601818	光大银行	48,700	214,767.00	0.16
91	002714	牧原股份	2,400	213,096.00	0.16
92	601766	中国中车	29,100	207,774.00	0.15
93	600028	中国石化	40,400	206,444.00	0.15
94	601229	上海银行	21,630	205,268.70	0.15
95	603986	兆易创新	1,000	204,890.00	0.15
96	300285	国瓷材料	8,900	203,365.00	0.15
97	002027	分众传媒	32,400	202,824.00	0.15
98	600919	江苏银行	27,900	201,996.00	0.15
99	601012	隆基股份	8,000	198,640.00	0.15
100	300271	华宇软件	7,700	195,580.00	0.15
101	000100	TCL 集团	42,500	189,975.00	0.14
102	001979	招商蛇口	9,500	188,765.00	0.14

103	300433	蓝思科技	12,900	178,278.00	0.13
104	601899	紫金矿业	38,800	178,092.00	0.13
105	601088	中国神华	9,700	177,025.00	0.13
106	300274	阳光电源	16,600	174,798.00	0.13
107	600406	国电南瑞	8,100	171,558.00	0.13
108	600183	生益科技	8,200	171,544.00	0.13
109	601857	中国石油	29,400	171,402.00	0.13
110	300058	蓝色光标	30,300	171,195.00	0.13
111	300113	顺网科技	6,600	169,554.00	0.13
112	603501	韦尔股份	1,180	169,212.00	0.13
113	600999	招商证券	9,100	166,439.00	0.12
114	300166	东方国信	12,700	165,100.00	0.12
115	600050	中国联通	28,000	164,920.00	0.12
116	300628	亿联网络	2,200	159,302.00	0.12
117	002230	科大讯飞	4,600	158,608.00	0.12
118	601009	南京银行	18,000	157,860.00	0.12
119	300115	长盈精密	8,700	154,773.00	0.12
120	600019	宝钢股份	26,700	153,258.00	0.11
121	300316	晶盛机电	9,600	150,912.00	0.11
122	300496	中科创达	3,300	148,962.00	0.11
123	601939	建设银行	20,500	148,215.00	0.11
124	600745	闻泰科技	1,600	148,000.00	0.11
125	601006	大秦铁路	18,000	147,780.00	0.11
126	600570	恒生电子	1,900	147,687.00	0.11
127	300212	易华录	4,400	147,136.00	0.11
128	601390	中国中铁	24,700	146,718.00	0.11
129	002466	天齐锂业	4,830	145,769.40	0.11
130	300418	昆仑万维	8,700	145,725.00	0.11
131	601989	中国重工	27,800	145,672.00	0.11
132	300001	特锐德	8,400	144,312.00	0.11
133	002008	大族激光	3,600	144,000.00	0.11
134	600015	华夏银行	18,600	142,662.00	0.11
135	000776	广发证券	9,400	142,598.00	0.11
136	601186	中国铁建	13,900	140,946.00	0.11
137	000166	申万宏源	27,400	140,288.00	0.10
138	002241	歌尔股份	7,000	139,440.00	0.10
139	300251	光线传媒	11,600	136,880.00	0.10
140	300027	华谊兄弟	29,400	136,122.00	0.10
141	300010	立思辰	10,400	134,264.00	0.10

142	300226	上海钢联	1,700	132,260.00	0.10
143	002594	比亚迪	2,700	128,709.00	0.10
144	002236	大华股份	6,400	127,232.00	0.09
145	300618	寒锐钴业	1,500	123,585.00	0.09
146	300699	光威复材	2,700	122,850.00	0.09
147	600958	东方证券	11,400	122,664.00	0.09
148	000876	新希望	6,100	121,695.00	0.09
149	300133	华策影视	15,700	116,180.00	0.09
150	002371	北方华创	1,300	114,400.00	0.09
151	002024	苏宁易购	11,200	113,232.00	0.08
152	002049	紫光国微	2,200	111,848.00	0.08
153	000009	中国宝安	18,000	111,420.00	0.08
154	300308	中际旭创	2,100	109,515.00	0.08
155	300073	当升科技	4,000	109,200.00	0.08
156	600588	用友网络	3,800	107,920.00	0.08
157	002202	金风科技	9,000	107,550.00	0.08
158	300182	捷成股份	30,800	107,492.00	0.08
159	601377	兴业证券	15,000	106,200.00	0.08
160	601225	陕西煤业	11,700	105,183.00	0.08
161	300180	华峰超纤	11,800	104,312.00	0.08
162	000157	中联重科	15,600	104,208.00	0.08
163	601901	方正证券	12,000	104,040.00	0.08
164	600340	华夏幸福	3,600	103,320.00	0.08
165	600547	山东黄金	3,160	103,079.20	0.08
166	601138	工业富联	5,600	102,312.00	0.08
167	002463	沪电股份	4,600	102,166.00	0.08
168	600660	福耀玻璃	4,200	100,758.00	0.08
169	002352	顺丰控股	2,700	100,413.00	0.07
170	002736	国信证券	8,000	100,400.00	0.07
171	300072	三聚环保	15,800	99,856.00	0.07
172	002916	深南电路	700	99,470.00	0.07
173	300078	思创医惠	8,100	99,468.00	0.07
174	601669	中国电建	22,800	98,952.00	0.07
175	000066	中国长城	6,200	96,472.00	0.07
176	601108	财通证券	8,400	95,256.00	0.07
177	601985	中国核电	19,000	95,000.00	0.07
178	600346	恒力石化	5,880	94,550.40	0.07
179	300188	美亚柏科	5,500	94,050.00	0.07
180	002405	四维图新	5,800	93,380.00	0.07

181	300170	汉得信息	9,600	93,024.00	0.07
182	600061	国投资本	6,100	92,354.00	0.07
183	300457	赢合科技	2,700	91,665.00	0.07
184	002555	三七互娱	3,400	91,562.00	0.07
185	600383	金地集团	6,300	91,350.00	0.07
186	300098	高新兴	15,400	91,322.00	0.07
187	600010	包钢股份	68,800	90,816.00	0.07
188	601933	永辉超市	12,000	90,480.00	0.07
189	600886	国投电力	9,800	89,964.00	0.07
190	300197	铁汉生态	28,800	88,128.00	0.07
191	300036	超图软件	4,400	87,692.00	0.07
192	000783	长江证券	12,100	86,394.00	0.06
193	300324	旋极信息	15,400	86,240.00	0.06
194	300038	数知科技	10,000	86,200.00	0.06
195	601877	正泰电器	3,200	85,760.00	0.06
196	002602	世纪华通	7,500	85,725.00	0.06
197	601788	光大证券	6,500	85,150.00	0.06
198	300002	神州泰岳	25,900	84,434.00	0.06
199	002607	中公教育	4,700	84,036.00	0.06
200	600795	国电电力	35,900	84,006.00	0.06
201	300476	胜宏科技	5,100	83,181.00	0.06
202	002311	海大集团	2,300	82,800.00	0.06
203	300747	锐科激光	700	82,460.00	0.06
204	300474	景嘉微	1,400	82,012.00	0.06
205	600018	上港集团	14,000	80,780.00	0.06
206	600201	生物股份	4,300	80,496.00	0.06
207	002460	赣锋锂业	2,300	80,109.00	0.06
208	601555	东吴证券	8,000	79,920.00	0.06
209	000938	紫光股份	2,500	79,000.00	0.06
210	600536	中国软件	1,100	78,859.00	0.06
211	600438	通威股份	5,900	77,467.00	0.06
212	600705	中航资本	15,900	77,115.00	0.06
213	600271	航天信息	3,300	76,461.00	0.06
214	600011	华能国际	13,700	76,446.00	0.06
215	600606	绿地控股	10,900	75,755.00	0.06
216	601997	贵阳银行	7,900	75,524.00	0.06
217	600089	特变电工	11,300	75,145.00	0.06
218	600115	东方航空	12,900	74,949.00	0.06
219	600109	国金证券	8,000	74,400.00	0.06

220	600177	雅戈尔	10,600	73,882.00	0.06
221	002050	三花智控	4,200	72,786.00	0.05
222	002465	海格通信	6,700	72,561.00	0.05
223	000723	美锦能源	7,600	71,668.00	0.05
224	600426	华鲁恒升	3,600	71,532.00	0.05
225	002410	广联达	2,100	71,358.00	0.05
226	300567	精测电子	1,300	71,292.00	0.05
227	002439	启明星辰	2,100	70,980.00	0.05
228	002624	完美世界	1,600	70,624.00	0.05
229	002493	荣盛石化	5,700	70,623.00	0.05
230	600111	北方稀土	6,400	69,376.00	0.05
231	603019	中科曙光	2,000	69,160.00	0.05
232	300377	赢时胜	6,000	68,940.00	0.05
233	000768	中航飞机	4,200	68,796.00	0.05
234	002841	视源股份	800	68,560.00	0.05
235	002271	东方雨虹	2,600	68,406.00	0.05
236	002384	东山精密	2,924	67,690.60	0.05
237	601600	中国铝业	19,100	67,614.00	0.05
238	300616	尚品宅配	900	67,068.00	0.05
239	600739	辽宁成大	4,400	67,012.00	0.05
240	300068	南都电源	6,200	66,836.00	0.05
241	600487	亨通光电	4,000	65,040.00	0.05
242	002157	正邦科技	4,000	64,800.00	0.05
243	300159	新研股份	16,500	64,680.00	0.05
244	601800	中国交建	7,000	64,120.00	0.05
245	002797	第一创业	7,700	63,756.00	0.05
246	000786	北新建材	2,500	63,625.00	0.05
247	002120	韵达股份	1,900	63,270.00	0.05
248	600100	同方股份	7,200	63,144.00	0.05
249	000728	国元证券	6,800	63,036.00	0.05
250	002129	中环股份	5,300	62,593.00	0.05
251	002179	中航光电	1,600	62,496.00	0.05
252	600522	中天科技	7,500	62,250.00	0.05
253	601198	东兴证券	4,700	61,758.00	0.05
254	601919	中远海控	11,600	61,132.00	0.05
255	002127	南极电商	5,600	61,096.00	0.05
256	600221	海航控股	35,200	60,896.00	0.05
257	600801	华新水泥	2,300	60,789.00	0.05
258	300203	聚光科技	3,600	60,156.00	0.04

259	601618	中国中冶	21,400	59,920.00	0.04
260	002673	西部证券	6,100	59,780.00	0.04
261	603444	吉比特	200	59,698.00	0.04
262	600516	方大炭素	4,898	59,559.68	0.04
263	002353	杰瑞股份	1,600	59,136.00	0.04
264	600848	上海临港	2,400	58,920.00	0.04
265	300459	金科文化	18,440	58,823.60	0.04
266	002506	协鑫集成	9,900	58,509.00	0.04
267	600066	宇通客车	4,100	58,425.00	0.04
268	600498	烽火通信	2,100	57,645.00	0.04
269	601998	中信银行	9,300	57,381.00	0.04
270	600637	东方明珠	6,100	57,096.00	0.04
271	600926	杭州银行	6,200	56,792.00	0.04
272	600893	航发动力	2,600	56,368.00	0.04
273	002926	华西证券	5,100	56,151.00	0.04
274	600004	白云机场	3,200	55,840.00	0.04
275	601878	浙商证券	5,000	55,650.00	0.04
276	601872	招商轮船	6,700	55,342.00	0.04
277	002273	水晶光电	3,420	55,267.20	0.04
278	000750	国海证券	10,300	55,002.00	0.04
279	000961	中南建设	5,200	54,860.00	0.04
280	000988	华工科技	2,700	54,783.00	0.04
281	601727	上海电气	11,000	54,780.00	0.04
282	002500	山西证券	6,600	54,714.00	0.04
283	601881	中国银河	4,700	54,567.00	0.04
284	000623	吉林敖东	3,300	54,549.00	0.04
285	000975	银泰资源	4,000	54,440.00	0.04
286	300145	中金环境	15,600	54,132.00	0.04
287	600068	葛洲坝	8,100	54,108.00	0.04
288	600642	申能股份	9,300	54,033.00	0.04
289	603899	晨光文具	1,100	53,614.00	0.04
290	002078	太阳纸业	5,400	53,136.00	0.04
291	000401	冀东水泥	3,100	52,731.00	0.04
292	600673	东阳光	5,100	52,224.00	0.04
293	600674	川投能源	5,300	52,205.00	0.04
294	601066	中信建投	1,700	51,680.00	0.04
295	002268	卫士通	2,000	51,580.00	0.04
296	002195	二三四五	15,900	51,357.00	0.04
297	601128	常熟银行	5,600	51,016.00	0.04

298	002387	维信诺	3,200	50,880.00	0.04
299	000686	东北证券	5,400	50,220.00	0.04
300	002340	格林美	10,200	49,674.00	0.04
301	000656	金科股份	6,400	49,152.00	0.04
302	600208	新湖中宝	13,000	49,140.00	0.04
303	600023	浙能电力	12,400	49,104.00	0.04
304	000547	航天发展	4,800	49,056.00	0.04
305	601838	成都银行	5,400	48,978.00	0.04
306	000998	隆平高科	3,300	48,543.00	0.04
307	601021	春秋航空	1,100	48,279.00	0.04
308	600369	西南证券	9,300	48,267.00	0.04
309	600885	宏发股份	1,400	48,230.00	0.04
310	600219	南山铝业	21,500	48,160.00	0.04
311	600583	海油工程	6,500	47,970.00	0.04
312	600879	航天电子	8,000	47,840.00	0.04
313	600170	上海建工	13,500	47,790.00	0.04
314	601117	中国化学	7,400	47,656.00	0.04
315	600909	华安证券	6,500	47,450.00	0.04
316	002385	大北农	9,500	47,310.00	0.04
317	300666	江丰电子	1,100	47,190.00	0.04
318	603833	欧派家居	400	46,800.00	0.03
319	002414	高德红外	2,200	46,200.00	0.03
320	002739	万达电影	2,500	45,375.00	0.03
321	601018	宁波港	11,900	45,220.00	0.03
322	002373	千方科技	2,500	45,100.00	0.03
323	601100	恒立液压	900	44,775.00	0.03
324	002601	龙麟佰利	2,900	44,631.00	0.03
324	600325	华发股份	5,700	44,631.00	0.03
325	000703	恒逸石化	3,200	44,544.00	0.03
326	300367	东方网力	10,200	44,166.00	0.03
327	600489	中金黄金	5,200	44,096.00	0.03
328	600845	宝信软件	1,330	43,757.00	0.03
329	600528	中铁工业	3,800	43,700.00	0.03
330	002299	圣农发展	1,800	43,344.00	0.03
331	600699	均胜电子	2,420	43,318.00	0.03
332	600460	士兰微	2,800	43,316.00	0.03
333	000630	铜陵有色	18,500	43,105.00	0.03
334	300373	扬杰科技	2,500	43,000.00	0.03
335	600038	中直股份	900	42,939.00	0.03

336	600143	金发科技	5,800	42,224.00	0.03
337	600482	中国动力	2,100	42,000.00	0.03
338	000581	威孚高科	2,200	41,910.00	0.03
339	002572	索菲亚	2,000	41,900.00	0.03
340	002281	光迅科技	1,400	41,692.00	0.03
341	300724	捷佳伟创	1,100	41,679.00	0.03
342	600820	隧道股份	6,900	41,676.00	0.03
343	000627	天茂集团	5,900	41,536.00	0.03
344	002081	金螳螂	4,700	41,454.00	0.03
345	600895	张江高科	2,700	41,337.00	0.03
346	000997	新大陆	2,600	41,288.00	0.03
347	000778	新兴铸管	9,900	41,283.00	0.03
348	600410	华胜天成	4,000	41,240.00	0.03
349	600486	扬农化工	600	41,178.00	0.03
350	002075	沙钢股份	6,600	41,118.00	0.03
351	600760	中航沈飞	1,300	41,080.00	0.03
352	601005	重庆钢铁	22,200	41,070.00	0.03
353	600315	上海家化	1,300	40,222.00	0.03
354	002250	联化科技	2,300	39,399.00	0.03
355	600549	厦门钨业	3,000	39,120.00	0.03
356	000671	阳光城	4,600	39,100.00	0.03
356	002690	美亚光电	1,000	39,100.00	0.03
357	002153	石基信息	1,000	39,000.00	0.03
358	600497	驰宏锌锗	8,900	38,982.00	0.03
359	002812	恩捷股份	770	38,885.00	0.03
360	600567	山鹰纸业	10,300	38,831.00	0.03
361	600094	大名城	6,600	38,610.00	0.03
362	600118	中国卫星	1,800	38,466.00	0.03
363	601231	环旭电子	2,000	38,460.00	0.03
364	601168	西部矿业	5,800	38,396.00	0.03
365	002032	苏泊尔	500	38,390.00	0.03
366	600466	蓝光发展	5,200	38,324.00	0.03
367	000629	攀钢钒钛	13,000	37,960.00	0.03
368	600153	建发股份	4,200	37,758.00	0.03
369	002131	利欧股份	12,700	37,719.00	0.03
370	002191	劲嘉股份	3,300	37,653.00	0.03
371	603000	人民网	1,900	37,601.00	0.03
372	600376	首开股份	4,700	37,459.00	0.03
373	601333	广深铁路	12,200	37,332.00	0.03

374	600839	四川长虹	12,800	37,248.00	0.03
375	601866	中远海发	14,300	37,037.00	0.03
376	000060	中金岭南	8,600	36,980.00	0.03
377	600655	豫园股份	4,700	36,848.00	0.03
378	600875	东方电气	4,000	36,760.00	0.03
379	000690	宝新能源	6,500	36,725.00	0.03
380	600027	华电国际	10,000	36,700.00	0.03
381	601966	玲珑轮胎	1,600	36,688.00	0.03
382	600881	亚泰集团	11,500	36,685.00	0.03
383	000960	锡业股份	3,500	36,540.00	0.03
384	000089	深圳机场	3,700	36,149.00	0.03
385	600811	东方集团	10,700	35,952.00	0.03
386	002938	鹏鼎控股	800	35,920.00	0.03
387	000830	鲁西化工	3,400	35,734.00	0.03
388	002670	国盛金控	2,800	35,588.00	0.03
389	000878	云南铜业	2,600	35,516.00	0.03
390	600959	江苏有线	8,900	35,422.00	0.03
391	600718	东软集团	3,100	35,185.00	0.03
392	600663	陆家嘴	2,600	35,126.00	0.03
393	002368	太极股份	900	35,028.00	0.03
394	600977	中国电影	2,300	35,006.00	0.03
395	002074	国轩高科	2,400	34,920.00	0.03
395	002221	东华能源	4,500	34,920.00	0.03
396	002152	广电运通	3,600	34,596.00	0.03
397	601808	中海油服	1,800	34,560.00	0.03
398	000983	西山煤电	5,600	34,328.00	0.03
399	002558	巨人网络	1,900	34,314.00	0.03
400	600160	巨化股份	4,700	34,216.00	0.03
401	603659	璞泰来	400	34,060.00	0.03
402	600022	山东钢铁	23,800	34,034.00	0.03
403	601238	广汽集团	2,900	33,901.00	0.03
404	600166	福田汽车	16,200	33,858.00	0.03
405	002217	合力泰	6,100	33,855.00	0.03
406	002085	万丰奥威	4,800	33,600.00	0.03
407	300222	科大智能	3,600	33,588.00	0.03
408	600266	城建发展	4,100	33,210.00	0.02
409	600755	厦门国贸	4,500	33,030.00	0.02
410	000709	河钢股份	12,800	33,024.00	0.02
411	600737	中粮糖业	3,900	32,994.00	0.02

412	600297	广汇汽车	10,100	32,926.00	0.02
413	600260	凯乐科技	2,420	32,839.40	0.02
414	600282	南钢股份	9,500	32,775.00	0.02
415	601633	长城汽车	3,700	32,745.00	0.02
416	002174	游族网络	1,400	32,578.00	0.02
417	600155	华创阳安	2,300	32,269.00	0.02
418	601098	中南传媒	2,700	32,238.00	0.02
419	601699	潞安环能	4,400	31,944.00	0.02
420	600967	内蒙一机	3,000	31,890.00	0.02
421	600392	盛和资源	3,500	31,745.00	0.02
422	600643	爱建集团	3,300	31,680.00	0.02
423	601216	君正集团	10,100	31,613.00	0.02
424	600167	联美控股	2,400	31,584.00	0.02
425	600037	歌华有线	3,500	31,535.00	0.02
426	600398	海澜之家	4,100	31,488.00	0.02
427	600373	中文传媒	2,300	31,303.00	0.02
428	600804	鹏博士	5,100	31,212.00	0.02
429	002583	海能达	3,700	31,117.00	0.02
430	600808	马钢股份	10,100	31,007.00	0.02
431	600435	北方导航	3,700	30,784.00	0.02
432	603228	景旺电子	700	30,674.00	0.02
433	000598	兴蓉环境	6,600	30,558.00	0.02
434	000031	大悦城	4,200	30,156.00	0.02
435	600580	卧龙电驱	2,500	30,050.00	0.02
436	000883	湖北能源	7,200	30,024.00	0.02
437	603885	吉祥航空	2,000	30,000.00	0.02
438	600026	中远海能	4,700	29,986.00	0.02
439	600171	上海贝岭	1,900	29,925.00	0.02
440	600021	上海电力	3,700	29,785.00	0.02
441	002411	延安必康	1,900	29,697.00	0.02
442	000563	陕国投 A	6,700	29,681.00	0.02
443	601118	海南橡胶	6,000	29,520.00	0.02
444	300323	华灿光电	4,200	29,400.00	0.02
445	600064	南京高科	3,000	29,250.00	0.02
446	603077	和邦生物	19,700	29,156.00	0.02
447	002233	塔牌集团	2,300	28,980.00	0.02
448	002372	伟星新材	2,200	28,974.00	0.02
449	000712	锦龙股份	1,900	28,880.00	0.02
450	300458	全志科技	900	28,791.00	0.02

451	600782	新钢股份	5,600	28,728.00	0.02
452	000932	华菱钢铁	6,000	28,680.00	0.02
453	601106	中国一重	9,800	28,518.00	0.02
454	601360	三六零	1,200	28,212.00	0.02
455	600060	海信视像	2,600	28,210.00	0.02
456	002004	华邦健康	5,700	28,158.00	0.02
457	601577	长沙银行	3,100	28,117.00	0.02
458	601000	唐山港	10,800	28,080.00	0.02
459	600863	内蒙华电	10,200	28,050.00	0.02
460	002440	闰土股份	2,500	28,000.00	0.02
461	000970	中科三环	2,600	27,950.00	0.02
462	002242	九阳股份	1,100	27,676.00	0.02
463	600008	首创股份	8,400	27,636.00	0.02
464	002028	思源电气	2,000	27,540.00	0.02
465	600816	安信信托	6,200	27,528.00	0.02
466	000738	航发控制	2,100	27,447.00	0.02
467	603816	顾家家居	600	27,438.00	0.02
468	000027	深圳能源	4,400	27,324.00	0.02
469	600388	龙净环保	2,800	27,300.00	0.02
469	601179	中国西电	7,500	27,300.00	0.02
470	601898	中煤能源	5,400	27,108.00	0.02
471	600827	百联股份	3,000	26,940.00	0.02
472	600729	重庆百货	900	26,865.00	0.02
473	002212	南洋股份	1,400	26,614.00	0.02
474	600039	四川路桥	7,900	26,544.00	0.02
474	600409	三友化工	4,200	26,544.00	0.02
475	002010	传化智联	3,800	26,524.00	0.02
476	601718	际华集团	8,100	26,406.00	0.02
477	000930	中粮生化	4,000	26,400.00	0.02
478	000559	万向钱潮	4,900	26,313.00	0.02
479	600649	城投控股	4,600	26,312.00	0.02
480	600500	中化国际	4,880	25,864.00	0.02
481	601958	金钼股份	3,200	25,632.00	0.02
482	600777	新潮能源	12,200	25,620.00	0.02
483	000021	深科技	2,100	25,578.00	0.02
484	000685	中山公用	3,100	25,544.00	0.02
485	000008	神州高铁	7,000	25,410.00	0.02
486	300634	彩讯股份	1,400	25,284.00	0.02
487	600138	中青旅	2,000	25,200.00	0.02

488	002244	滨江集团	5,100	25,092.00	0.02
489	002064	华峰氨纶	4,000	25,000.00	0.02
490	000090	天健集团	4,710	24,963.00	0.02
491	002407	多氟多	1,900	24,909.00	0.02
492	000877	天山股份	2,100	24,885.00	0.02
493	601717	郑煤机	3,800	24,586.00	0.02
494	600733	北汽蓝谷	4,200	24,528.00	0.02
495	600970	中材国际	3,500	24,395.00	0.02
496	600598	北大荒	2,500	24,350.00	0.02
497	600884	杉杉股份	1,800	24,318.00	0.02
498	002408	齐翔腾达	3,400	24,310.00	0.02
499	000528	柳工	3,500	24,290.00	0.02
500	601319	中国人保	3,200	24,288.00	0.02
501	600507	方大特钢	2,400	24,144.00	0.02
502	600307	酒钢宏兴	11,700	24,102.00	0.02
503	000488	晨鸣纸业	4,700	23,923.00	0.02
504	600120	浙江东方	2,740	23,920.20	0.02
505	002266	浙富控股	5,800	23,896.00	0.02
506	002831	裕同科技	900	23,895.00	0.02
507	000898	鞍钢股份	7,120	23,852.00	0.02
508	600633	浙数文化	2,600	23,790.00	0.02
509	600989	宝丰能源	2,500	23,775.00	0.02
510	600418	江淮汽车	4,700	23,594.00	0.02
511	601236	红塔证券	1,400	23,478.00	0.02
512	300748	金力永磁	600	23,376.00	0.02
513	600717	天津港	3,700	23,236.00	0.02
514	600348	阳泉煤业	4,200	23,226.00	0.02
515	002048	宁波华翔	1,500	23,190.00	0.02
516	002665	首航节能	6,900	23,184.00	0.02
517	600525	长园集团	3,900	23,127.00	0.02
518	600158	中体产业	2,300	23,069.00	0.02
519	601608	中信重工	6,200	23,064.00	0.02
520	600754	锦江酒店	800	22,968.00	0.02
521	000826	启迪桑德	2,500	22,950.00	0.02
522	601880	大连港	11,300	22,939.00	0.02
523	002155	湖南黄金	2,900	22,881.00	0.02
524	002002	鸿达兴业	5,500	22,880.00	0.02
525	000301	东方盛虹	4,400	22,792.00	0.02
526	600025	华能水电	5,400	22,788.00	0.02

527	600372	中航电子	1,600	22,784.00	0.02
528	002183	怡亚通	5,400	22,734.00	0.02
529	000887	中鼎股份	2,500	22,625.00	0.02
530	600648	外高桥	1,300	22,581.00	0.02
531	002701	奥瑞金	5,100	22,491.00	0.02
532	601689	拓普集团	1,290	22,484.70	0.02
533	002280	联络互动	5,800	22,446.00	0.02
534	600515	海航基础	5,000	22,300.00	0.02
535	000158	常山北明	3,200	21,824.00	0.02
536	600823	世茂股份	4,800	21,600.00	0.02
537	000400	许继电气	2,000	21,540.00	0.02
538	600233	圆通速递	1,700	21,505.00	0.02
539	002302	西部建设	1,900	21,451.00	0.02
540	000758	中色股份	4,800	21,024.00	0.02
541	600862	中航高科	1,900	20,938.00	0.02
542	000732	泰禾集团	3,400	20,910.00	0.02
543	000415	渤海租赁	5,500	20,900.00	0.02
544	600316	洪都航空	1,600	20,848.00	0.02
545	002640	跨境通	2,700	20,844.00	0.02
546	000959	首钢股份	5,900	20,827.00	0.02
547	000727	华东科技	9,900	20,691.00	0.02
548	601611	中国核建	2,900	20,677.00	0.02
549	600640	号百控股	800	20,648.00	0.02
550	000718	苏宁环球	5,400	20,628.00	0.02
551	601928	凤凰传媒	2,700	20,547.00	0.02
552	002056	横店东磁	2,500	20,500.00	0.02
553	002444	巨星科技	1,900	20,406.00	0.02
554	000717	韶钢松山	4,300	20,382.00	0.02
555	002426	胜利精密	8,600	20,296.00	0.02
556	600748	上实发展	3,400	20,196.00	0.02
557	600312	平高电气	3,100	20,026.00	0.01
558	000543	皖能电力	4,300	19,952.00	0.01
559	000012	南玻 A	3,960	19,839.60	0.01
560	600563	法拉电子	400	19,780.00	0.01
561	600277	亿利洁能	4,300	19,608.00	0.01
562	600901	江苏租赁	3,100	19,592.00	0.01
563	600859	王府井	1,400	19,586.00	0.01
564	600141	兴发集团	1,900	19,532.00	0.01
565	600017	日照港	6,700	19,497.00	0.01

566	600195	中牧股份	1,680	19,404.00	0.01
567	600751	海航科技	6,600	19,338.00	0.01
568	600125	铁龙物流	3,200	19,136.00	0.01
569	600499	科达洁能	4,400	19,052.00	0.01
570	000519	中兵红箭	2,500	19,050.00	0.01
571	002839	张家港行	3,200	19,008.00	0.01
572	601200	上海环境	1,700	18,870.00	0.01
573	600582	天地科技	5,900	18,821.00	0.01
574	000156	华数传媒	1,800	18,792.00	0.01
575	002491	通鼎互联	2,800	18,508.00	0.01
576	300134	大富科技	1,200	18,504.00	0.01
576	600575	淮河能源	7,200	18,504.00	0.01
577	600765	中航重机	1,800	18,414.00	0.01
578	002635	安洁科技	1,100	18,337.00	0.01
579	600908	无锡银行	3,300	18,315.00	0.01
580	600835	上海机电	1,100	18,227.00	0.01
581	000006	深振业 A	3,400	18,224.00	0.01
582	000926	福星股份	2,800	18,200.00	0.01
583	002128	露天煤业	2,100	18,186.00	0.01
584	600968	海油发展	6,200	18,166.00	0.01
585	600317	营口港	7,100	18,105.00	0.01
586	002939	长城证券	1,300	18,018.00	0.01
587	002434	万里扬	1,900	18,012.00	0.01
588	002419	天虹股份	1,700	17,935.00	0.01
589	600565	迪马股份	5,000	17,900.00	0.01
590	002709	天赐材料	860	17,802.00	0.01
591	002807	江阴银行	3,800	17,708.00	0.01
592	002745	木林森	1,300	17,693.00	0.01
593	002468	申通快递	900	17,550.00	0.01
594	600259	广晟有色	500	17,385.00	0.01
595	300055	万邦达	2,600	17,342.00	0.01
596	002505	大康农业	9,900	17,325.00	0.01
597	002489	浙江永强	4,100	17,179.00	0.01
598	600869	智慧能源	3,500	17,150.00	0.01
599	600291	西水股份	1,900	17,081.00	0.01
600	600151	航天机电	3,600	17,064.00	0.01
601	603712	七一二	700	16,926.00	0.01
602	002254	泰和新材	1,600	16,720.00	0.01
602	600478	科力远	3,800	16,720.00	0.01

603	601326	秦港股份	5,200	16,588.00	0.01
604	002051	中工国际	1,700	16,524.00	0.01
605	002945	华林证券	1,100	16,434.00	0.01
605	603377	东方时尚	900	16,434.00	0.01
606	002544	杰赛科技	1,200	16,344.00	0.01
607	600611	大众交通	4,000	16,240.00	0.01
608	601212	白银有色	4,400	16,192.00	0.01
609	600787	中储股份	3,100	16,151.00	0.01
610	300287	飞利信	4,200	16,128.00	0.01
611	600759	洲际油气	5,800	16,066.00	0.01
612	603568	伟明环保	700	16,058.00	0.01
613	601019	山东出版	2,300	15,985.00	0.01
614	000501	鄂武商 A	1,200	15,936.00	0.01
615	000062	深圳华强	1,100	15,664.00	0.01
616	600169	太原重工	6,700	15,611.00	0.01
617	002815	崇达技术	900	15,561.00	0.01
618	601162	天风证券	2,100	15,456.00	0.01
619	002249	大洋电机	4,000	15,440.00	0.01
620	002470	金正大	5,800	15,428.00	0.01
621	002920	德赛西威	500	15,165.00	0.01
622	300376	易事特	3,300	15,114.00	0.01
623	002681	奋达科技	2,700	15,066.00	0.01
624	600416	湘电股份	2,100	14,994.00	0.01
625	601139	深圳燃气	1,900	14,877.00	0.01
626	002573	清新环境	2,300	14,835.00	0.01
627	000564	供销大集	6,200	14,818.00	0.01
628	603888	新华网	700	14,770.00	0.01
629	300297	蓝盾股份	2,600	14,664.00	0.01
630	000050	深天马 A	900	14,661.00	0.01
631	002285	世联行	3,900	14,625.00	0.01
632	603806	福斯特	300	14,580.00	0.01
633	002251	步步高	1,600	14,560.00	0.01
634	600770	综艺股份	2,700	14,553.00	0.01
635	002093	国脉科技	1,800	14,508.00	0.01
636	601016	节能风电	6,000	14,460.00	0.01
637	002672	东江环保	1,600	14,400.00	0.01
638	002176	江特电机	3,800	14,288.00	0.01
639	601311	骆驼股份	1,500	14,070.00	0.01
640	603515	欧普照明	500	14,055.00	0.01

641	000537	广宇发展	1,800	13,986.00	0.01
642	002358	森源电气	2,000	13,980.00	0.01
643	600623	华谊集团	2,100	13,965.00	0.01
644	002366	台海核电	2,000	13,920.00	0.01
644	002375	亚厦股份	2,400	13,920.00	0.01
645	000937	冀中能源	3,800	13,908.00	0.01
646	603766	隆鑫通用	3,700	13,801.00	0.01
647	002431	棕榈股份	4,500	13,725.00	0.01
648	600694	大商股份	500	13,695.00	0.01
649	601127	小康股份	1,200	13,680.00	0.01
650	601001	大同煤业	3,100	13,640.00	0.01
651	601828	美凯龙	1,200	13,596.00	0.01
652	601698	中国卫通	1,200	13,584.00	0.01
653	600757	长江传媒	2,200	13,552.00	0.01
654	002512	达华智能	2,100	13,545.00	0.01
655	000536	华映科技	5,000	13,500.00	0.01
655	600639	浦东金桥	1,000	13,500.00	0.01
656	000061	农产品	2,400	13,416.00	0.01
657	000990	诚志股份	900	13,338.00	0.01
658	600903	贵州燃气	900	13,302.00	0.01
659	600006	东风汽车	2,900	13,282.00	0.01
660	000829	天音控股	2,100	13,167.00	0.01
661	600098	广州发展	2,000	13,080.00	0.01
662	600978	宜华生活	4,400	13,068.00	0.01
663	600545	卓郎智能	2,100	12,747.00	0.01
664	000600	建投能源	2,600	12,714.00	0.01
665	002503	搜于特	5,200	12,428.00	0.01
666	601615	明阳智能	1,000	12,300.00	0.01
667	300266	兴源环境	3,500	12,285.00	0.01
668	600350	山东高速	2,500	12,275.00	0.01
669	603056	德邦股份	1,100	12,221.00	0.01
670	600058	五矿发展	1,500	12,030.00	0.01
671	000980	众泰汽车	4,100	12,013.00	0.01
672	600458	时代新材	1,700	11,985.00	0.01
673	600657	信达地产	3,000	11,970.00	0.01
674	300257	开山股份	1,100	11,968.00	0.01
675	002948	青岛银行	2,000	11,880.00	0.01
676	002707	众信旅游	1,900	11,856.00	0.01
677	603260	合盛硅业	400	11,788.00	0.01

678	000541	佛山照明	2,400	11,760.00	0.01
679	600390	五矿资本	1,420	11,729.20	0.01
680	002958	青农商行	1,800	11,646.00	0.01
681	601990	南京证券	900	11,619.00	0.01
682	601801	皖新传媒	2,100	11,508.00	0.01
683	600874	创业环保	1,600	11,504.00	0.01
684	000426	兴业矿业	2,300	11,431.00	0.01
685	603556	海兴电力	700	11,410.00	0.01
686	603328	依顿电子	1,000	11,320.00	0.01
687	600428	中远海特	3,000	11,220.00	0.01
688	600928	西安银行	1,400	10,878.00	0.01
689	000552	靖远煤电	4,200	10,836.00	0.01
690	002517	恺英网络	4,100	10,578.00	0.01
691	600338	西藏珠峰	840	10,500.00	0.01
692	601298	青岛港	1,500	10,305.00	0.01
693	600393	粤泰股份	3,800	10,260.00	0.01
694	002936	郑州银行	2,200	10,230.00	0.01
695	600053	九鼎投资	400	10,172.00	0.01
696	002818	富森美	800	10,120.00	0.01
697	600707	彩虹股份	2,400	10,080.00	0.01
698	601869	长飞光纤	300	9,909.00	0.01
699	600996	贵广网络	1,200	9,660.00	0.01
700	002482	广田集团	2,200	9,636.00	0.01
701	601003	柳钢股份	1,700	9,605.00	0.01
702	002344	海宁皮城	2,200	9,592.00	0.01
703	002509	天广中茂	6,600	9,372.00	0.01
704	600126	杭钢股份	1,900	9,291.00	0.01
705	600335	国机汽车	1,600	9,280.00	0.01
706	600939	重庆建工	1,900	9,139.00	0.01
707	000987	越秀金控	900	8,703.00	0.01
708	000025	特力 A	400	8,480.00	0.01
709	002416	爱施德	1,100	8,371.00	0.01
710	601969	海南矿业	1,400	8,106.00	0.01
711	601811	新华文轩	600	7,914.00	0.01
712	603868	飞科电器	200	7,536.00	0.01
713	002699	美盛文化	1,100	7,425.00	0.01
714	603225	新凤鸣	600	7,410.00	0.01
715	603355	莱克电气	300	7,101.00	0.01
716	000587	金洲慈航	3,900	7,098.00	0.01

717	601777	力帆股份	2,300	7,084.00	0.01
718	600985	淮北矿业	700	6,993.00	0.01
719	600280	中央商场	2,200	6,116.00	0.00
720	601068	中铝国际	1,100	6,094.00	0.00
721	000761	本钢板材	1,400	5,516.00	0.00
722	002941	新疆交建	300	5,265.00	0.00
723	600590	泰豪科技	900	5,238.00	0.00
724	600917	重庆燃气	700	5,082.00	0.00
725	002139	拓邦股份	900	5,004.00	0.00
726	601126	四方股份	900	4,986.00	0.00
727	603486	科沃斯	200	4,058.00	0.00
728	600864	哈投股份	500	4,030.00	0.00
729	002334	英威腾	900	3,888.00	0.00
730	603025	大豪科技	400	3,788.00	0.00
731	601375	中原证券	700	3,752.00	0.00
732	603650	彤程新材	200	3,484.00	0.00
733	601099	太平洋	900	3,411.00	0.00
734	603569	长久物流	300	3,126.00	0.00
735	600621	华鑫股份	200	3,062.00	0.00
736	603877	太平鸟	200	3,054.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	6,714,431.00	7.35
2	600519	贵州茅台	3,250,125.00	3.56
3	601601	中国太保	3,122,282.92	3.42
4	600547	山东黄金	2,857,873.00	3.13
5	600362	江西铜业	2,793,991.22	3.06
6	300498	温氏股份	2,761,920.00	3.02
7	600027	华电国际	2,618,483.00	2.87
8	600036	招商银行	2,594,203.00	2.84
9	600030	中信证券	2,548,705.00	2.79
10	600011	华能国际	2,396,810.00	2.62
11	000002	万科 A	2,349,858.00	2.57

12	600031	三一重工	2,305,504.00	2.52
13	601336	新华保险	2,232,831.00	2.44
14	002110	三钢闽光	2,194,977.00	2.40
15	601678	滨化股份	2,155,255.00	2.36
16	601111	中国国航	2,075,289.00	2.27
17	601628	中国人寿	2,069,470.00	2.27
18	300059	东方财富	2,046,336.01	2.24
19	601857	中国石油	1,973,921.00	2.16
20	000069	华侨城 A	1,941,534.00	2.13
21	600258	首旅酒店	1,937,584.36	2.12

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	4,455,536.98	4.88
2	600519	贵州茅台	3,707,466.00	4.06
3	600547	山东黄金	3,524,208.00	3.86
4	300498	温氏股份	2,819,552.80	3.09
5	601601	中国太保	2,717,593.42	2.98
6	600011	华能国际	2,334,099.13	2.56
7	600276	恒瑞医药	2,246,480.02	2.46
8	600027	华电国际	2,226,586.00	2.44
9	600362	江西铜业	2,164,423.32	2.37
10	000002	万科 A	2,137,126.00	2.34
11	601336	新华保险	1,786,245.00	1.96
12	600036	招商银行	1,777,443.00	1.95
13	601857	中国石油	1,718,272.00	1.88
14	000858	五粮液	1,685,222.00	1.85
15	601628	中国人寿	1,606,446.00	1.76
16	601600	中国铝业	1,581,140.00	1.73
17	601678	滨化股份	1,559,382.00	1.71
18	000333	美的集团	1,525,818.00	1.67
19	601111	中国国航	1,464,260.00	1.60
20	002110	三钢闽光	1,426,854.00	1.56

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	222,115,779.76
卖出股票收入（成交）总额	166,436,703.88

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,673,007.50	7.21
	其中：政策性金融债	9,673,007.50	7.21
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,124,000.00	15.00
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,797,007.50	22.21

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	041900004	19 南京公路 CP001	100,000	10,069,000.00	7.51
2	011901316	19 大同煤矿 SCP013	100,000	10,055,000.00	7.50
3	018007	国开 1801	96,010	9,673,007.50	7.21

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	-
国债期货投资本期收益（元）	-83,300.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）	-

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	40,881.54
2	应收证券清算款	9,698,354.01
3	应收股利	-
4	应收利息	593,785.15
5	应收申购款	11,009.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,344,030.61

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	371	181,882.26	11,408,302.52	16.91%	56,070,017.50	83.09%
中金衡优 C	41	1,288,670.57	46,277,351.10	87.59%	6,558,142.17	12.41%
合计	412	292,023.82	57,685,653.62	47.95%	62,628,159.67	52.05%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	6,420,350.40	9.5147%
	中金衡优 C	0.00	0.0000%
	合计	6,420,350.40	5.3363%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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

§ 10 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
本报告期基金总申购份额	120,049,102.54	101,100,140.74
减:本报告期基金总赎回份额	122,327,413.06	68,368,970.62
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	67,478,320.02	52,835,493.27

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(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。

2019 年 6 月，刘连舸先生任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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。本基金本报告期内应支付审计费用 35,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金财富证券	2	388,508,762.67	100.00%	284,114.21	100.00%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中银证券	2	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金财富证券	74,503,524.78	100.00%	1,556,760,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司董事长任职公告	中国证监会指定媒介	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及其摘要（2019年第1号）	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	2019年6月19日
12	中金基金管理有限公司中金衡优灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2019年6月19日
13	中金基金管理有限公司中金衡优灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2019年6月19日
14	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	中国证监会指定媒介	2019年6月25日
15	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	中国证监会指定媒介	2019年6月26日
16	关于旗下部分基金新增通华财富（上海）基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019年7月10日
17	中金衡优灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2019年7月12日
18	中金衡优灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2019年7月19日
19	中金衡优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2号）	中国证监会指定媒介	2019年7月23日
20	中金衡优灵活配置混合型证	中国证监会指定媒介	2019年8月26日

	券投资基金 2019 年半年度报告及其摘要		
21	关于旗下部分基金新增蚂蚁基金为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 8 月 28 日
22	关于新增中银国际证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 9 月 17 日
23	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2019 年 10 月 24 日
24	中金衡优灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2019 年 10 月 24 日
25	关于中金沪深 300 指数增强、中金衡优新增招商证券为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 10 月 30 日
26	关于旗下部分基金新增中信证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 11 月 12 日
27	关于旗下部分基金新增北京肯特瑞基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 11 月 12 日
28	关于旗下部分基金新增中信证券（山东）有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 11 月 21 日
29	中金基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金估值调整情况的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 6 日
30	关于中金衡优灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（包括转换转入、定期定额投资）业务的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 10 日
31	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 2019 年第一次分红公告	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 23 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019 年 10 月 28 日至 2019 年 12 月 31 日	0.00	89,774,665.59	44,887,333.00	44,887,332.59	37.31%
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>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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、《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 6、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 8、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
- 9、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2020年4月21日