

国金量化多因子股票型证券投资基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：国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 17 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 16 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已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

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.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	16
4.10 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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§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	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	80

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	80
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	80
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	80
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	80
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	80
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12 投资组合报告附注	81
§9 基金份额持有人信息.....	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	83
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	83
§10 开放式基金份额变动.....	84
§11 重大事件揭示.....	85
11.1 基金份额持有人大会决议	85
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	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	85
11.4 基金投资策略的改变	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	85
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	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	85
11.8 其他重大事件	87
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	92
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	92
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	92
§13 备查文件目录.....	93
13.1 备查文件目录	93
13.2 存放地点	93
13.3 查阅方式	93

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化多因子股票型证券投资基金
基金简称	国金量化多因子
场内简称	-
基金主代码	006195
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 10 月 31 日
基金管理人	国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	23,794,646.32 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注：无

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采用自主开发的量化风险模型对市场的系统性风险进行判断，作为股票、债券、现金等金融工具上大类配置的依据，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，动态地调整各金融工具的投资比例。同时，本基金将适时地采用股指期货对冲策略做套期保值，以达到控制下行风险的目标。</p> <p>2、量化选股模型</p> <p>(1) 多因子选股策略</p> <p>1) 模型构建：本基金股票部分的构建采用 Alpha 多因子选股模型。根据对中国证券市场运行特征的长期研究，利用长期积累并最新扩展的数据库，科学地考虑了大量各类信息，选取估值 (Valuation)、成长 (Growth)、质量 (Quality)、市场 (Market)、和一致预期 (Forecast) 等几大类对股票超额收益具有较强解释度的因子，构建 Alpha 多因子模型，从全市场可投资股票中优选股票组合进行投资。</p> <p>2) 因子调整：本基金量化投资经理和研究人员根据市场状况的变化，定期或不定期地对模型进行复核和改进，发掘影响股票超额收益的有效因子信息，适时调整多因子的具体组成及权重，以不断改善模型的适用</p>

	<p>性。</p> <p>3) 定性优化: 定性分析主要利用基本面研究成果, 对模型自动选股的结果进行复核, 剔除掉满足某些特殊条件的股票, 即在 Alpha 多因子选股模型筛选出的股票名单中, 根据分析师定性研究成果, 剔除掉限制买入类股票, 从而进行定性优化选择。</p> <p>本基金在股票投资过程中, 强调投资纪律, 降低随意性投资带来的风险, 力争实现基金资产超越业绩基准的回报。</p> <p>(2) 统计套利策略</p> <p>本基金通过对股票大量数据的回溯研究, 用量化统计分析工具找出市场内部个股之间的稳定性关系, 将套利建立在历史数据进行统计分析的基础之上, 估计相关变量的概率分布进行套利操作。</p> <p>(3) 事件驱动套利策略</p> <p>本基金通过挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的的时间以及对过往事件的数据检测, 获取时间影响所带来的超额投资回报。</p> <p>(4) 投资组合优化</p> <p>本基金根据量化风险模型对投资组合进行优化, 调整个股权重, 在控制风险的前提下追求收益最大化。</p> <p>3、债券等固定收益类资产投资策略</p> <p>固定收益类资产投资主要用于提高非股票资产的收益率, 管理人将坚持价值投资的理念, 严格控制风险, 追求合理的回报。</p> <p>(1) 在债券投资方面, 管理人将以宏观形势及利率分析为基础, 依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标, 结合货币政策、财政政策的实施情况, 以及国际金融市场基准利率水平及变化情况, 预测未来基准利率水平变化趋势与幅度, 进行定量评价。</p> <p>(2) 可转债投资策略</p> <p>本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证券的估值与价格变化的研究, 采用买入低转换溢价率的债券并持有的投资策略, 密切关注可转换债券市场与股票市场之间的互动关系, 选择恰当的时机进行套利, 获得超额收益。</p> <p>(3) 资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析, 本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下, 采用基本面分析和数量化模型相结合, 对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资, 以降低流动性风险。</p> <p>4、股指期货投资策略</p>
--	--

	<p>本基金将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，以套期保值为主要目的，通过对证券市场和期货市场进行量化研究，结合股指期货定价模型寻求其合理的估值水平，在法律法规允许的范围内进行相应投资操作。</p> <p>5、股票期权投资策略。</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，主要选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。</p> <p>基金管理人将根据审慎原则，建立期货期权投资决策部门或小组，授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项，以防范股票期权投资的风险。</p> <p>6、国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现超额回报。</p> <p>7、权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略主要包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。</p>
业绩比较基准	85%×中证 500 指数收益率+15%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

注：无

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		国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	陈广龙	许俊
	联系电话	010-88005888	010-66594319
	电子邮箱	chenguanglong@gfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4000-2000-18	95566
传真		010-88005666	010-66594942

注册地址	北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100089	100818
法定代表人	尹庆军	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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 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 10 月 31 日 (基金合同生效 日)-2018 年 12 月 31 日	2017 年
本期已实现收益	2,754,494.57	877,991.62	-
本期利润	3,322,052.78	459,635.06	-
加权平均基金份额本期利润	0.1062	0.0030	-
本期加权平均净值利润率	9.35%	0.30%	-
本期基金份额净值增长率	17.91%	-0.40%	-
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	4,149,301.07	-104,414.31	-
期末可供分配基金份额利润	0.1744	-0.0040	-
期末基金资产净值	27,943,947.39	26,030,445.11	-
期末基金份额净值	1.1744	0.9960	-
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	17.44%	-0.40%	-

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. 期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

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

4. 本基金合同自 2018 年 10 月 31 日起生效，至 2018 年 12 月 31 日未满一年。

3.2 基金净值表现

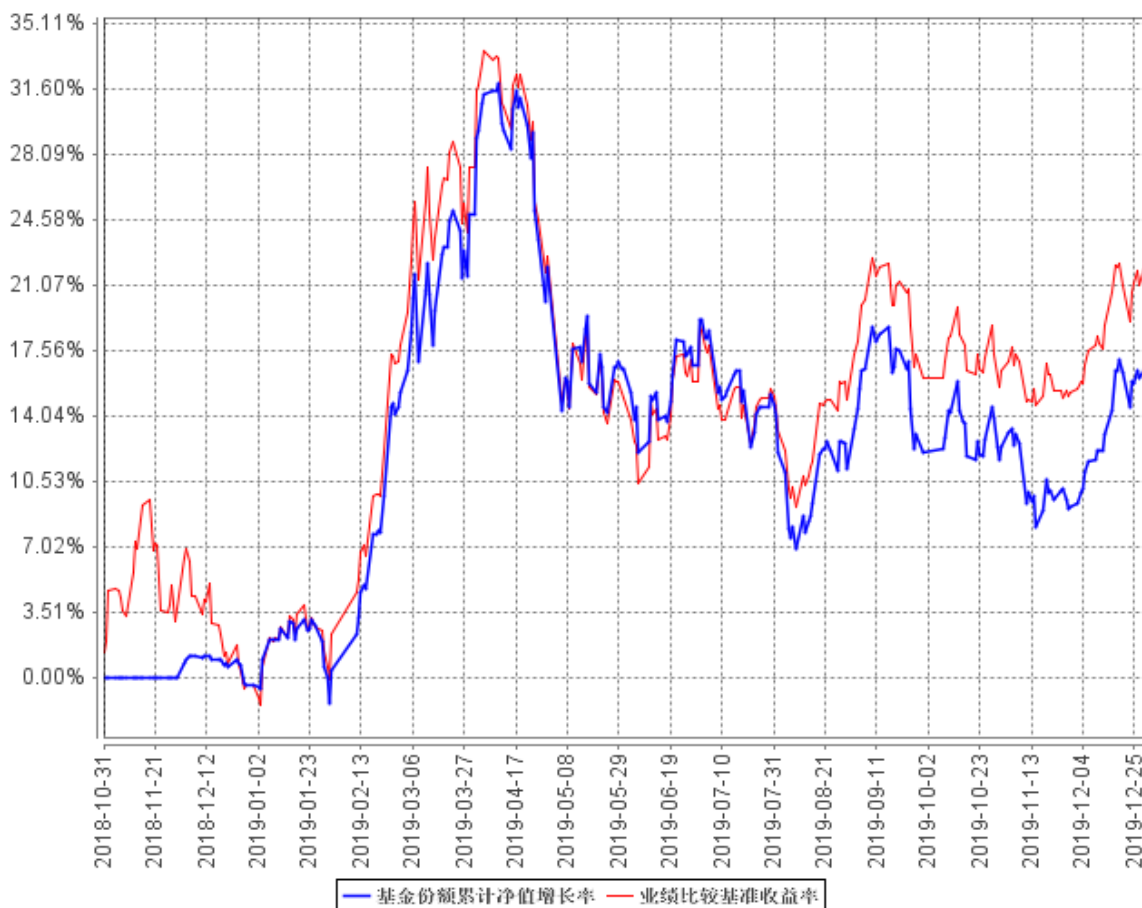
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.74%	0.86%	5.83%	0.79%	-1.09%	0.07%
过去六个月	0.56%	0.99%	5.96%	0.92%	-5.40%	0.07%
过去一年	17.91%	1.25%	23.33%	1.25%	-5.42%	0.00%

自基金合同生效起至今	17.44%	1.15%	22.84%	1.24%	-5.40%	-0.09%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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

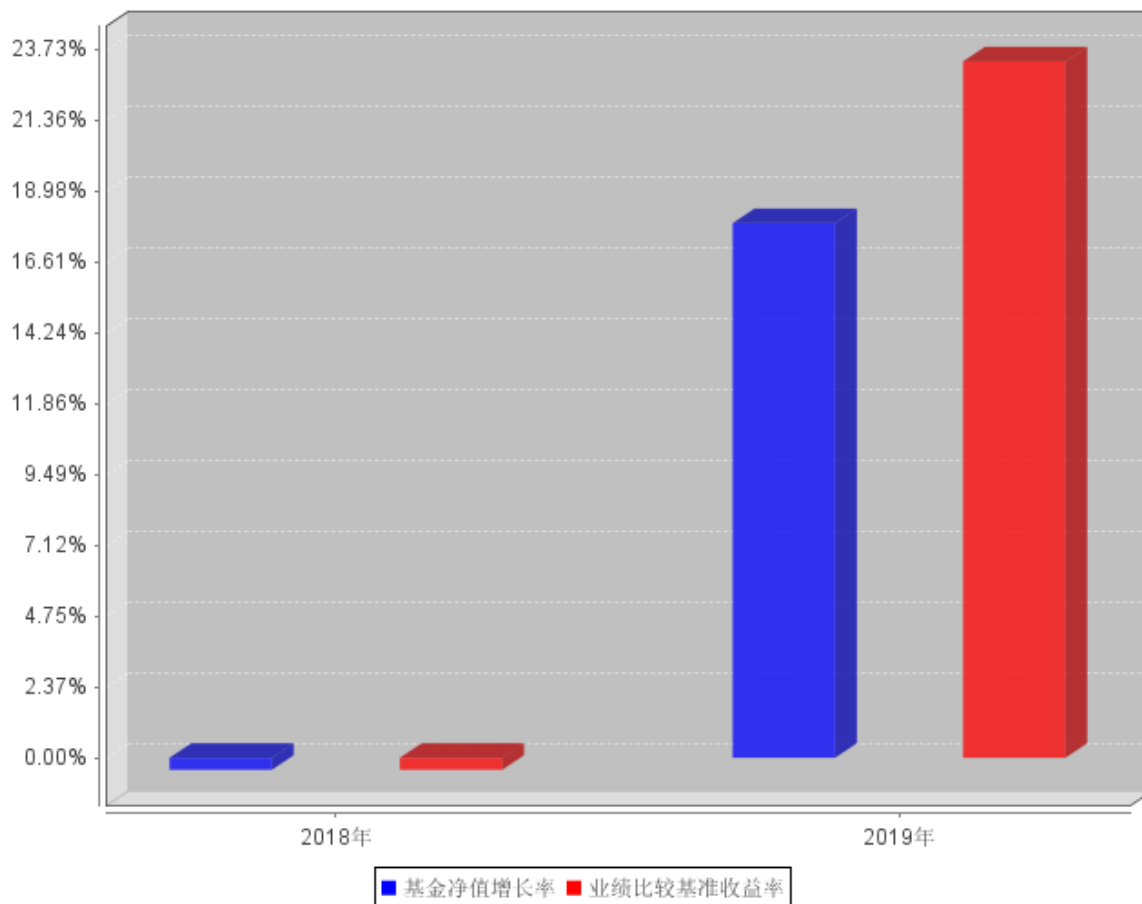
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2018 年 10 月 31 日，图示日期为 2018 年 10 月 31 日至 2019 年 12 月 31 日。
 2、本基金建仓期为 2018 年 10 月 31 日至 2019 年 4 月 30 日，建仓期结束时本产品各项资产配置比例符合合同约定。

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

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 其他指标

注：无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，股权比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。截至2019年12月31日，国金基金管理有限公司共管理16只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金上证50指数增强证券投资基金（LOF）、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金民丰回报6个月定期开放混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金标普中国A股低波红利指数增强证券投资基金（LOF）。

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		
杨雨龙	本基金基金经理，国金鑫瑞灵活、国金量化添利、国金民丰回报、国金量化多策略基金经理，量化投资事业部总经理	2018年10月31日	-	10	杨雨龙先生，北京大学硕士。2007年7月至2009年9月在招商银行股份有限公司计划财务部任管理会计，2009年10月至2011年9月在博时基金管理有限公司交易部任股票交易员，2011年10月至2014年7月在兴业证券股份有限公司研究所任金融工程高级分析师，2014年7月至2017年6月在摩根士丹利华鑫基金管理有限公司任量化投资部副总监、基金经理。

					2017 年 6 月加入国金基金管理有限公司，任量化投资事业二部总经理。
--	--	--	--	--	--------------------------------------

注：（1）任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《国金量化多因子股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规，制定了《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。该公平交易管理方法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行（集中竞价及非集中竞价交易）、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

第一，明确公平交易的原则：（1）信息获取公平原则，不同投资组合经理可公平获得研究成果；（2）交易机会公平原则，不同投资组合经理可获得公平交易执行的机会。

第二，对公募基金和私募资产管理计划等不同类型业务，公司分别设立独立的投资人员；研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持；设立独立的基金交易部，实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；设立独立的合规风控部，对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、预警、报告等。

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的执行情况进行审核。（2）产品开发：风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标，在投资交易系统中完成风控参数设置，确保做好公平交易的事前控制。（3）研

究与投资：投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为，其中，投资组合经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作，并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理，以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。（4）交易执行：交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度，合规风控部利用投资交易系统对交易执行进行实时监控，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（5）事后分析：合规风控部利用公平交易系统对不同投资组合之间的同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。（6）报告备案：合规风控部根据实时监控及事后分析的结果撰写定期报告，并由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。（7）信息披露环节：信息披露部门在各投资组合的定期报告中，至少披露公司整体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。（8）反馈完善：根据事后分析报告及信息披露结果，公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善，以确保公平交易的执行日臻完善。（9）监督检查：合规风控部监察稽核人员根据法规规定及公司公平交易制度规定，监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况，并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

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。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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

2019 年一季度市场快速上涨，本基金 2018 年底成立，期间还处于建仓期，未完全跟上市场

的涨幅。投资方面，我们运用基于 A 股自身特点开发的量化多因子选股模型进行选股投资，着重量化的方法精选中小盘高成长性公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金单位份额净值 1.1744 元，累计单位净值 1.1744 元。本报告期基金份额净值增长率 17.91%，同期业绩比较基准增长率 23.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新型冠状病毒疫情对 A 股在内的全球市场都造成较大的冲击。虽然短期还无法断定疫情结束时间点，但总体来说我们对今年 A 股市场的表现持谨慎乐观的态度。在市场企稳回升的环境下，个股股价表现分化增大，量化选股策略的一些长效因子的有效性将会得到回归，量化选股策略的超额收益有望得以提升。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法、合规性等进行了监察稽核，通过实时监控、定期检查、专项稽核、日常不定期抽查等方式，及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况，并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层、董事会以及监管部门。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

(1) 进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况不断细化制度流程，及时拟定了相关管理制度，并对原有制度体系进行了持续的更新和完善，截至报告出具日，本基金管理人共制订规章制度 123 项，涵盖公司主要业务范围。

(2) 强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规，将相关规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中，同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式，提高全体员工的合规守法意识。

(3) 有计划地开展监察稽核工作。本报告期内，本基金管理人根据年度监察稽核工作计划、通过日常监察与专项稽核相结合的方式，开展各项监察稽核工作，包括对基金销售、宣传材料、合同、反洗钱工作、基金投资运作、交易（包括公平交易）等方面进行稽核，对于稽核中发现的问题会通过监察稽核报告的形式，及时将潜在风险通报部门负责人、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。通过日常监察与专项稽核的方式，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化内部控制流程，提高了业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

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，本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管行代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值委员会的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配，不存在应分配而未分配的情况。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

4.10 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

本报告期，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情况。截止本报告期末，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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”）在国金量化多因子股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本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	安永华明（2020）审字第 61004823_A15 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	国金量化多因子股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了国金量化多因子股票型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日止期间的利润表、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，后附的国金量化多因子股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金量化多因子股票型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</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，我们独立于国金量化多因子股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>国金量化多因子股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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>管理层负责按照企业会计准则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</p>

	<p>由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国金量化多因子股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金量化多因子股票型证券投资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，就可能导致对国金量化多因子股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披</p>

	<p>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国金量化多因子股票型证券投资基金不能持续经营。</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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊 王海彦
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
审计报告日期	2020 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

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	1,894,706.05	5,257,762.43
结算备付金		784,925.75	4,494,090.91
存出保证金		22,012.02	-
交易性金融资产	7.4.7.2	25,946,800.54	16,239,250.04
其中：股票投资		25,946,800.54	16,086,127.64
基金投资		-	-
债券投资		-	153,122.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	400,607.07
应收利息	7.4.7.5	915.65	9,701.93
应收股利		-	-
应收申购款		2,514.84	5,141.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		28,651,874.85	26,406,553.40
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		-	-
应付赎回款		385,679.85	196,938.74
应付管理人报酬		40,153.41	71,156.50
应付托管费		5,353.77	9,487.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	209,647.06	7,314.87
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	67,093.37	91,210.62
负债合计		707,927.46	376,108.29
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	23,794,646.32	26,134,859.42
未分配利润	7.4.7.10	4,149,301.07	-104,414.31
所有者权益合计		27,943,947.39	26,030,445.11
负债和所有者权益总计		28,651,874.85	26,406,553.40

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.1744 元，基金份额总额为 23,794,646.32 份。

7.2 利润表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

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 10 月 31 日(基 金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		5,310,243.46	1,007,537.04
1. 利息收入		42,464.06	584,329.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	33,095.36	56,827.53
债券利息收入		8,609.58	198.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		759.12	527,303.13
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,366,256.19	-2,773.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,948,399.82	-2,773.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-520.80	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	418,377.17	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	567,558.21	-418,356.56
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	333,965.00	844,337.59
减：二、费用		1,988,190.68	547,901.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	523,473.63	378,542.96
2. 托管费	7.4.10.2.2	69,796.52	50,472.42

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,337,928.53	9,046.04
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	56,992.00	109,840.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,322,052.78	459,635.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,322,052.78	459,635.06

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

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）	26,134,859.42	-104,414.31	26,030,445.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,322,052.78	3,322,052.78
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）	-2,340,213.10	931,662.60	-1,408,550.50
其中：1. 基金申购款	74,469,309.59	11,721,740.82	86,191,050.41
2. 基金赎回款	-76,809,522.69	-10,790,078.22	-87,599,600.91
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）	23,794,646.32	4,149,301.07	27,943,947.39
项目	上年度可比期间 2018 年 10 月 31 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）	249,293,966.03	-	249,293,966.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	459,635.06	459,635.06
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）	-223,159,106.61	-564,049.37	-223,723,155.98
其中：1. 基金申购款	1,379,194.32	13,249.89	1,392,444.21
2. 基金赎回款	-224,538,300.93	-577,299.26	-225,115,600.19
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）	26,134,859.42	-104,414.31	26,030,445.11

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：

<u> 尹庆军 </u>	<u> 聂武鹏 </u>	<u> 于晓莲 </u>
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

国金量化多因子股票型证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1050号文的核准，由国金基金管理有限公司于2018年9月10日到2018年10月26日向社会公开募集，基金合同于2018年10月31日生效。首次募集规模为249,293,966.03份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要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、创业板以及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权、权证）以及经中国证监会批准允许

基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资比例为：股票资产投资比例为基金资产的 80-95%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终，在扣除国债期货、股指期货合约和股票期权需缴纳的交易保证金后，持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为： $85\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 15\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将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的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，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，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1). 存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；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，应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，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2). 不存在活跃市场的金融工具，应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，应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，才使用不可观察输入值；

(3). 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4). 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并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后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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；

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

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等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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 8 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、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

无

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政

策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	1,894,706.05	5,257,762.43
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：	1,894,706.05	5,257,762.43

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	25,797,598.89	25,946,800.54	149,201.65
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	25,797,598.89	25,946,800.54	149,201.65
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	16,504,441.90	16,086,127.64	-418,314.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	153,164.70	153,122.40
	银行间市场	-	-
	合计	153,164.70	153,122.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	16,657,606.60	16,239,250.04	-418,356.56

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	516.24	2,812.68
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	388.52	2,224.53
应收债券利息	-	4,732.19
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-67.47
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	10.89	-
合计	915.65	9,701.93

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

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	209,647.06	7,314.87
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	209,647.06	7,314.87
----	------------	----------

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	93.37	210.62
预提审计费用	50,000.00	40,000.00
预提信息披露费	17,000.00	51,000.00
合计	67,093.37	91,210.62

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,134,859.42	26,134,859.42
本期申购	74,469,309.59	74,469,309.59
本期赎回（以“-”号填列）	-76,809,522.69	-76,809,522.69
- 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	23,794,646.32	23,794,646.32

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	285,549.75	-389,964.06	-104,414.31
本期利润	2,754,494.57	567,558.21	3,322,052.78
本期基金份额交易产生的变动数	1,835,872.39	-904,209.79	931,662.60
其中：基金申购款	13,517,400.60	-1,795,659.78	11,721,740.82
基金赎回款	-11,681,528.21	891,449.99	-10,790,078.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,875,916.71	-726,615.64	4,149,301.07

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10月31日(基金合同生效日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	23,457.90	51,165.02
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	9,289.72	5,662.51
其他	347.74	-
合计	33,095.36	56,827.53

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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年10月31日(基金合同生效日)至2018年12月31日
卖出股票成交总额	656,423,958.89	225,904.00
减：卖出股票成本总额	652,475,559.07	228,677.00
买卖股票差价收入	3,948,399.82	-2,773.00

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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年10月31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	-520.80	-
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	-520.80	-

注：本基金于上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日无债券投资收益。

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10月31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	4,341,235.73	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,252,789.70	-
减：应收利息总额	88,966.83	-
买卖债券差价收入	-520.80	-

注：本基金于上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日无买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日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

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日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

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日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

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日均无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日均无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日均无贵金属申购差价收入。

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**

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日均无衍生工具投资收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日均无其他衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 10 月 31 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	418,377.17	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	418,377.17	-

注：本基金于上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日无股利收益。

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 10 月 31 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	567,558.21	-418,356.56
——股票投资	567,515.91	-418,314.26
——债券投资	42.30	-42.30
——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	567,558.21	-418,356.56

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10月31日(基金合同生效日)至2018年12月31日
基金赎回费收入	333,938.22	844,337.59
转出费收入	26.78	-
合计	333,965.00	844,337.59

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

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10月31日(基金合同生效日)至2018年12月31日
交易所市场交易费用	1,337,928.53	9,046.04
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,337,928.53	9,046.04

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10月31日(基金合同生效日)至2018年12月31日
审计费用	50,000.00	40,000.00
信息披露费	-	67,000.00
银行费用	6,992.00	2,440.56
其他	-	400.00
合计	56,992.00	109,840.56

7.4.7.21 分部报告

无

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大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
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
上海国金理益财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 10 月 31 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	523,473.63	378,542.96
其中：支付销售机构的客户维护费	224,080.72	241,783.49

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

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 10 月 31 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	69,796.52	50,472.42

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无

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

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例
北京 千石 创富 资本 管理 有限 公司	0.00	0.0000%	1,274,763.50	4.8776%

注：1. 除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2. 本基金于本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年10月31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-活期存款	1,894,706.05	23,457.90	5,257,762.43	51,165.02

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

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
601658	邮储银行	2019年12月2日	-	锁定期股票流通受限	5.50	5.71	504,500	2,774,750.00	2,880,695.00	-
601916	浙商银行	2019年11月18日	-	锁定期股票流通受限	4.94	4.66	218,195	1,077,883.30	1,016,788.70	-
601077	渝农商行	2019年10月16日	-	锁定期股票流通受限	7.36	6.26	134,848	992,481.28	844,148.48	-

				限					
--	--	--	--	---	--	--	--	--	--

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、

议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、到期未能及时足额兑付本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级列示的同业存单投资。

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险等。

7.4.13.4.1 利率风险

利率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市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本报告期内，本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,894,706.05	-	-	-	-	-	1,894,706.05
结算备付金	784,925.75	-	-	-	-	-	784,925.75
存出保证金	22,012.02	-	-	-	-	-	22,012.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	25,946,800.54	25,946,800.54
应收利息	-	-	-	-	-	915.65	915.65
应收申购款	-	-	-	-	-	2,514.84	2,514.84
资产总计	2,701,643.82	-	-	-	-	25,950,231.03	28,651,874.85
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	385,679.85	385,679.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	40,153.41	40,153.41
应付托管费	-	-	-	-	-	5,353.77	5,353.77
应付交易费用	-	-	-	-	-	209,647.06	209,647.06
其他负债	-	-	-	-	-	67,093.37	67,093.37
负债总计	-	-	-	-	-	707,927.46	707,927.46
利率敏感度缺口	2,701,643.82	-	-	-	-	25,242,303.57	27,943,947.39
上年度末 2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,257,762.43	-	-	-	-	-	5,257,762.43
结算备付金	4,494,090.91	-	-	-	-	-	4,494,090.91

交易性金融资产		-153,122.40				-16,086,127.64	16,239,250.04
应收证券清算款						400,607.07	400,607.07
应收利息						9,701.93	9,701.93
应收申购款						5,141.02	5,141.02
资产总计	9,751,853.34	153,122.40				-16,501,577.66	26,406,553.40
负债							
应付赎回款						196,938.74	196,938.74
应付管理人报酬						71,156.50	71,156.50
应付托管费						9,487.56	9,487.56
应付交易费用						7,314.87	7,314.87
其他负债						91,210.62	91,210.62
负债总计						376,108.29	376,108.29
利率敏感度缺口	9,751,853.34	153,122.40				-16,125,469.37	26,030,445.11

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末未持有交易性金融资产债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券等，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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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 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	25,946,800.54	92.85	16,086,127.64	61.80
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	153,122.40	0.59
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	25,946,800.54	92.85	16,239,250.04	62.39

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数 (000905.SH) 变化 5%，其他变量不变； Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。		
	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)
	+5%	1,148,839.79	74,541.59
	-5%	-1,148,839.79	-74,541.59

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (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)
		合计	-

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 21,205,168.36 元，无属于第二层次的余额，属于第三层次的余额为 4,741,632.18 元。（上年度末：属于第一层次的余额为人民币 16,021,801.64 元，属于第二层次的余额为人民币 217,448.40 元，无属于第三层次的余额。）

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第二层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2020 年 4 月 17 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	25,946,800.54	90.56
	其中：股票	25,946,800.54	90.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,679,631.80	9.35
8	其他各项资产	25,442.51	0.09
9	合计	28,651,874.85	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	378,268.60	1.35
B	采矿业	296,060.89	1.06
C	制造业	13,424,192.48	48.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	553,945.52	1.98
E	建筑业	408,588.00	1.46
F	批发和零售业	891,261.24	3.19
G	交通运输、仓储和邮政业	620,892.24	2.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,099,324.30	7.51
J	金融业	5,173,118.94	18.51
K	房地产业	620,953.08	2.22
L	租赁和商务服务业	160,203.25	0.57
M	科学研究和技术服务业	204,072.00	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	99,256.00	0.36

0	居民服务、修理和其他服务业	265,472.00	0.95
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	690,251.00	2.47
S	综合	60,941.00	0.22
	合计	25,946,800.54	92.85

注：以上行业分类以 2019 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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	601658	邮储银行	504,500	2,880,695.00	10.31
2	601916	浙商银行	218,195	1,016,788.70	3.64
3	601077	渝农商行	134,848	844,148.48	3.02
4	002540	亚太科技	74,114	315,725.64	1.13
5	600961	株冶集团	36,004	299,193.24	1.07
6	002379	宏创控股	82,000	294,380.00	1.05
7	300150	世纪瑞尔	64,400	276,276.00	0.99
8	300330	华虹计通	27,600	268,548.00	0.96
9	300736	百邦科技	24,400	265,472.00	0.95
10	002380	科远智慧	18,947	264,879.06	0.95
11	300609	汇纳科技	7,115	263,681.90	0.94
12	600071	凤凰光学	22,800	261,288.00	0.94
13	002199	东晶电子	27,900	258,075.00	0.92
14	002922	伊戈尔	17,200	258,000.00	0.92
15	603880	南卫股份	22,000	257,180.00	0.92
16	300532	今天国际	24,000	255,360.00	0.91
17	000020	深华发 A	23,486	250,595.62	0.90
18	000534	万泽股份	26,800	248,704.00	0.89
19	603838	四通股份	29,518	247,360.84	0.89
20	300501	海顺新材	20,400	246,432.00	0.88
21	300560	中富通	15,670	246,019.00	0.88
22	300588	熙菱信息	24,547	245,960.94	0.88
23	300555	路通视信	26,000	243,360.00	0.87
24	002615	哈尔斯	44,000	243,320.00	0.87
25	000668	荣丰控股	17,600	235,840.00	0.84

26	002858	力盛赛车	15,056	226,592.80	0.81
27	300434	金石亚药	29,315	224,259.75	0.80
28	002316	亚联发展	29,600	221,408.00	0.79
29	600386	北巴传媒	59,105	219,870.60	0.79
30	601801	皖新传媒	40,000	219,200.00	0.78
31	002826	易明医药	21,600	218,376.00	0.78
32	300519	新光药业	16,000	216,800.00	0.78
33	600488	天药股份	51,813	215,542.08	0.77
34	002275	桂林三金	16,400	215,168.00	0.77
35	002349	精华制药	48,000	215,040.00	0.77
36	603159	上海亚虹	18,400	212,888.00	0.76
37	600829	人民同泰	31,200	212,784.00	0.76
38	600379	宝光股份	36,800	211,600.00	0.76
39	600262	北方股份	11,600	210,540.00	0.75
40	603331	百达精工	12,800	209,280.00	0.75
41	603861	白云电器	23,898	208,629.54	0.75
42	300484	蓝海华腾	22,800	208,620.00	0.75
43	601882	海天精工	28,675	207,893.75	0.74
44	000548	湖南投资	49,600	207,824.00	0.74
45	002062	宏润建设	59,200	207,792.00	0.74
46	600841	上柴股份	29,377	207,695.39	0.74
47	300447	全信股份	21,200	206,912.00	0.74
48	300512	中亚股份	18,000	206,640.00	0.74
49	300549	优德精密	15,200	205,960.00	0.74
50	600843	上工申贝	26,705	205,361.45	0.73
51	600551	时代出版	24,993	204,942.60	0.73
52	300650	太龙照明	12,111	204,918.12	0.73
53	603637	镇海股份	13,200	204,072.00	0.73
54	603030	全筑股份	34,800	200,796.00	0.72
55	603223	恒通股份	31,104	196,266.24	0.70
56	601126	四方股份	34,867	193,163.18	0.69
57	603033	三维股份	10,400	192,920.00	0.69
58	603289	泰瑞机器	20,800	192,400.00	0.69
59	300189	神农科技	52,800	190,608.00	0.68
60	603037	凯众股份	10,027	190,011.65	0.68
61	002825	纳尔股份	14,020	188,849.40	0.68
62	603668	天马科技	22,800	188,328.00	0.67
63	002748	世龙实业	25,415	187,816.85	0.67
64	002802	洪汇新材	9,252	187,723.08	0.67

65	002357	富临运业	30,000	187,200.00	0.67
66	002053	云南能投	25,841	187,088.84	0.67
67	300539	横河模具	25,600	186,880.00	0.67
68	300243	瑞丰高材	24,400	186,660.00	0.67
69	600097	开创国际	18,745	185,200.60	0.66
70	600163	中闽能源	53,200	184,072.00	0.66
71	300305	裕兴股份	21,907	184,018.80	0.66
72	300268	佳沃股份	13,028	181,219.48	0.65
73	601368	绿城水务	30,703	179,305.52	0.64
74	000695	滨海能源	23,912	178,861.76	0.64
75	300641	正丹股份	35,901	177,709.95	0.64
76	300093	金刚玻璃	16,000	175,680.00	0.63
77	603926	铁流股份	14,390	171,960.50	0.62
78	002553	南方轴承	31,310	169,074.00	0.61
79	002652	扬子新材	43,200	168,912.00	0.60
79	002921	联诚精密	9,200	168,912.00	0.60
80	300652	雷迪克	8,400	167,496.00	0.60
81	601199	江南水务	43,600	165,244.00	0.59
82	600830	香溢融通	29,075	160,203.25	0.57
83	000617	中油资本	13,078	159,159.26	0.57
84	600318	新力金融	22,582	158,074.00	0.57
85	600774	汉商集团	13,854	154,610.64	0.55
86	002718	友邦吊顶	9,200	154,008.00	0.55
87	600824	益民集团	44,000	151,360.00	0.54
88	600785	新华百货	10,000	150,200.00	0.54
89	002133	广宇集团	43,600	144,316.00	0.52
90	600493	凤竹纺织	25,600	143,360.00	0.51
91	601579	会稽山	16,400	140,384.00	0.50
92	600543	莫高股份	24,000	138,960.00	0.50
92	603238	诺邦股份	8,000	138,960.00	0.50
93	002840	华统股份	8,400	136,920.00	0.49
94	600137	浪莎股份	8,632	134,486.56	0.48
95	600683	京投发展	28,236	127,909.08	0.46
96	002297	博云新材	17,748	113,942.16	0.41
97	300722	新余国科	5,428	113,933.72	0.41
98	603303	得邦照明	10,028	103,388.68	0.37
99	000780	平庄能源	33,600	100,800.00	0.36
100	300696	爱乐达	4,443	99,700.92	0.36
101	300157	恒泰艾普	24,127	98,196.89	0.35

102	002828	贝肯能源	8,800	97,064.00	0.35
103	300272	开能健康	19,731	96,287.28	0.34
104	600619	海立股份	11,200	92,400.00	0.33
105	603519	立霸股份	6,358	89,075.58	0.32
106	603029	天鹅股份	4,000	58,440.00	0.21
107	600603	广汇物流	11,600	57,420.00	0.21
108	300730	科创信息	4,005	57,191.40	0.20
109	000863	三湘印象	12,200	56,608.00	0.20
110	600082	海泰发展	14,000	56,280.00	0.20
111	600281	太化股份	13,600	56,032.00	0.20
112	600117	西宁特钢	15,200	54,264.00	0.19
113	000959	首钢股份	15,200	53,656.00	0.19
114	002443	金洲管道	7,600	51,072.00	0.18
115	000430	张家界	9,600	50,016.00	0.18
116	002159	三特索道	4,000	49,240.00	0.18
117	002270	华明装备	8,400	41,328.00	0.15
118	300654	世纪天鸿	3,544	39,515.60	0.14
119	601998	中信银行	6,400	39,488.00	0.14
120	600908	无锡银行	7,090	39,349.50	0.14
121	002807	江阴银行	7,600	35,416.00	0.13
122	600834	申通地铁	4,100	29,602.00	0.11
123	000899	赣能股份	5,200	25,324.00	0.09
124	300563	神宇股份	800	22,400.00	0.08
125	603809	豪能股份	2,200	20,988.00	0.08
126	603580	艾艾精工	1,485	18,681.30	0.07
127	603968	醋化股份	1,200	17,712.00	0.06
128	603665	康隆达	800	17,504.00	0.06
129	002972	科安达	806	16,144.18	0.06
130	603663	三祥新材	700	9,366.00	0.03
131	603725	天安新材	1,136	8,679.04	0.03
132	300171	东富龙	1,200	8,508.00	0.03
133	603109	神驰机电	280	7,411.60	0.03
134	002836	新宏泽	395	4,775.55	0.02
135	000833	粤桂股份	700	3,521.00	0.01
136	000798	中水渔业	400	2,460.00	0.01
137	000715	中兴商业	400	2,436.00	0.01

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	601658	邮储银行	3,963,921.50	15.23
2	600829	人民同泰	3,066,425.00	11.78
3	601168	西部矿业	2,880,864.00	11.07
4	000869	张裕 A	2,834,585.00	10.89
5	002802	洪汇新材	2,776,342.00	10.67
6	600785	新华百货	2,515,404.70	9.66
7	601677	明泰铝业	2,456,084.00	9.44
8	600629	华建集团	2,446,603.00	9.40
9	300419	浩丰科技	2,340,227.38	8.99
10	002053	云南能投	2,339,458.00	8.99
11	300150	世纪瑞尔	2,246,713.00	8.63
12	300434	金石亚药	2,222,598.00	8.54
13	300519	新光药业	2,219,293.00	8.53
14	603669	灵康药业	2,217,549.96	8.52
15	600665	天地源	2,204,552.00	8.47
16	600488	天药股份	2,187,871.00	8.41
17	002062	宏润建设	2,169,434.00	8.33
18	603667	五洲新春	2,131,713.00	8.19
19	002458	益生股份	2,122,305.00	8.15
20	603855	华荣股份	2,034,351.00	7.82
21	300571	平治信息	2,030,970.00	7.80
22	300617	安靠智电	1,996,416.00	7.67
23	002182	云海金属	1,975,397.97	7.59
24	603277	银都股份	1,973,837.00	7.58
25	601107	四川成渝	1,970,070.00	7.57
26	600293	三峡新材	1,955,975.00	7.51
27	603926	铁流股份	1,954,793.20	7.51
28	000617	中油资本	1,944,462.00	7.47
29	601900	南方传媒	1,911,233.00	7.34
30	002753	永东股份	1,901,423.00	7.30
31	600873	梅花生物	1,865,009.00	7.16

32	600327	大东方	1,860,934.00	7.15
33	002295	精艺股份	1,835,057.00	7.05
34	600780	通宝能源	1,831,901.00	7.04
35	300610	晨化股份	1,829,406.00	7.03
36	603156	养元饮品	1,824,225.00	7.01
37	300155	安居宝	1,816,496.00	6.98
38	300243	瑞丰高材	1,812,000.00	6.96
39	603331	百达精工	1,791,699.00	6.88
40	002380	科远智慧	1,788,207.83	6.87
41	603319	湘油泵	1,782,452.80	6.85
42	300652	雷迪克	1,763,408.90	6.77
43	603037	凯众股份	1,761,163.00	6.77
44	002577	雷柏科技	1,746,831.00	6.71
45	600791	京能置业	1,740,029.00	6.68
46	300609	汇纳科技	1,734,098.95	6.66
47	603798	康普顿	1,727,924.00	6.64
48	002884	凌霄泵业	1,718,929.00	6.60
49	300305	裕兴股份	1,695,507.00	6.51
50	002853	皮阿诺	1,686,654.00	6.48
51	002187	广百股份	1,674,065.00	6.43
52	300415	伊之密	1,657,716.00	6.37
53	300620	光库科技	1,644,879.00	6.32
54	002873	新天药业	1,639,352.55	6.30
55	603098	森特股份	1,634,331.00	6.28
56	002165	红宝丽	1,624,185.00	6.24
57	000042	中洲控股	1,613,899.00	6.20
58	603380	易德龙	1,609,440.00	6.18
59	600681	百川能源	1,598,426.00	6.14
60	603589	口子窖	1,591,262.00	6.11
61	603600	永艺股份	1,567,449.00	6.02
62	002771	真视通	1,551,576.00	5.96
63	603768	常青股份	1,542,508.00	5.93
64	601916	浙商银行	1,539,827.64	5.92
65	300277	海联讯	1,531,380.00	5.88
66	600995	文山电力	1,526,941.00	5.87
67	300511	雪榕生物	1,509,544.00	5.80

68	300286	安科瑞	1,480,971.00	5.69
69	600576	祥源文化	1,476,463.00	5.67
70	600308	华泰股份	1,475,265.00	5.67
71	600683	京投发展	1,472,911.00	5.66
72	600390	五矿资本	1,467,986.00	5.64
73	603076	乐惠国际	1,460,132.00	5.61
74	002540	亚太科技	1,457,435.00	5.60
75	002150	通润装备	1,455,662.00	5.59
76	603139	康惠制药	1,437,535.12	5.52
77	600768	宁波富邦	1,436,023.00	5.52
78	603388	元成股份	1,432,270.00	5.50
79	601077	渝农商行	1,417,823.04	5.45
80	603007	花王股份	1,396,923.00	5.37
81	600350	山东高速	1,383,708.00	5.32
82	002067	景兴纸业	1,377,953.00	5.29
83	002026	山东威达	1,377,844.40	5.29
84	603033	三维股份	1,368,205.64	5.26
85	002528	英飞拓	1,366,492.00	5.25
86	600497	驰宏锌锗	1,360,416.00	5.23
87	600487	亨通光电	1,359,073.00	5.22
88	603278	大业股份	1,349,912.60	5.19
89	601500	通用股份	1,340,169.00	5.15
90	000517	荣安地产	1,338,630.00	5.14
91	300360	炬华科技	1,338,484.00	5.14
92	603685	晨丰科技	1,336,181.00	5.13
93	002772	众兴菌业	1,327,587.00	5.10
94	603385	惠达卫浴	1,327,315.72	5.10
95	603298	杭叉集团	1,325,202.00	5.09
96	000030	富奥股份	1,325,102.00	5.09
97	002728	特一药业	1,323,799.00	5.09
98	600673	东阳光	1,321,752.00	5.08
99	603165	荣晟环保	1,306,919.00	5.02
100	603730	岱美股份	1,306,847.00	5.02
101	002608	江苏国信	1,296,862.00	4.98
102	603203	快克股份	1,282,856.17	4.93
103	600703	三安光电	1,275,746.00	4.90

104	002685	华东重机	1,261,233.00	4.85
105	600173	卧龙地产	1,252,396.00	4.81
106	600076	康欣新材	1,251,437.00	4.81
107	600668	尖峰集团	1,245,767.00	4.79
108	300522	世名科技	1,245,420.20	4.78
109	300656	民德电子	1,223,547.00	4.70
110	300074	华平股份	1,222,749.00	4.70
111	300309	吉艾科技	1,217,271.00	4.68
112	002799	环球印务	1,214,701.50	4.67
113	600191	华资实业	1,213,747.00	4.66
114	600979	广安爱众	1,205,523.00	4.63
115	002566	益盛药业	1,190,993.00	4.58
116	603633	徕木股份	1,189,850.00	4.57
117	603311	金海环境	1,175,339.00	4.52
118	300120	经纬辉开	1,172,564.00	4.50
119	000541	佛山照明	1,172,149.00	4.50
120	000848	承德露露	1,163,065.00	4.47
121	600843	上工申贝	1,158,919.00	4.45
122	600551	时代出版	1,155,690.00	4.44
123	600260	凯乐科技	1,150,698.00	4.42
124	002893	华通热力	1,149,055.00	4.41
125	603238	诺邦股份	1,145,978.00	4.40
126	000685	中山公用	1,145,078.00	4.40
127	300461	田中精机	1,142,951.00	4.39
128	300428	四通新材	1,138,845.08	4.38
129	600073	上海梅林	1,136,507.00	4.37
130	300621	维业股份	1,134,869.00	4.36
131	300600	瑞特股份	1,130,435.80	4.34
132	300219	鸿利智汇	1,129,506.00	4.34
133	000525	红太阳	1,128,505.00	4.34
134	600248	延长化建	1,127,628.00	4.33
135	300531	优博讯	1,126,867.00	4.33
136	600976	健民集团	1,125,477.00	4.32
137	300440	运达科技	1,125,010.00	4.32
138	300088	长信科技	1,124,756.00	4.32
139	000415	渤海租赁	1,120,593.00	4.30

140	603661	恒林股份	1,118,628.00	4.30
141	002441	众业达	1,114,482.00	4.28
142	002379	宏创控股	1,111,631.00	4.27
143	603567	珍宝岛	1,111,262.00	4.27
144	002763	汇洁股份	1,108,185.00	4.26
145	603757	大元泵业	1,106,022.00	4.25
146	002882	金龙羽	1,104,015.00	4.24
147	000705	浙江震元	1,101,519.00	4.23
148	300546	雄帝科技	1,095,446.00	4.21
149	603958	哈森股份	1,092,255.00	4.20
150	603861	白云电器	1,088,331.00	4.18
151	002749	国光股份	1,083,465.60	4.16
152	601222	林洋能源	1,080,955.00	4.15
153	600828	茂业商业	1,080,176.00	4.15
154	300447	全信股份	1,078,445.00	4.14
155	603100	川仪股份	1,075,485.00	4.13
156	300248	新开普	1,075,316.39	4.13
157	300270	中威电子	1,073,211.00	4.12
158	300582	英飞特	1,068,590.00	4.11
159	603015	弘讯科技	1,063,965.00	4.09
160	000949	新乡化纤	1,062,826.00	4.08
161	600865	百大集团	1,060,019.00	4.07
162	000782	美达股份	1,059,288.00	4.07
163	600082	海泰发展	1,058,180.00	4.07
164	600606	绿地控股	1,056,241.00	4.06
165	002651	利君股份	1,055,294.00	4.05
166	603416	信捷电气	1,051,446.00	4.04
167	600221	海航控股	1,048,078.00	4.03
168	603955	大千生态	1,047,183.00	4.02
169	603266	天龙股份	1,044,831.00	4.01
170	603900	莱绅通灵	1,043,224.20	4.01
171	603001	奥康国际	1,041,103.00	4.00
172	002746	仙坛股份	1,032,647.00	3.97
173	002790	瑞尔特	1,030,396.00	3.96
174	603976	正川股份	1,025,154.40	3.94
175	603507	振江股份	1,021,692.00	3.92

176	600862	中航高科	1,015,311.00	3.90
177	603303	得邦照明	1,012,324.28	3.89
178	002346	柘中股份	1,012,068.00	3.89
179	002331	皖通科技	1,009,562.00	3.88
180	002452	长高集团	1,008,997.00	3.88
181	002900	哈三联	1,007,106.00	3.87
182	002252	上海莱士	1,002,845.00	3.85
183	000639	西王食品	1,000,851.00	3.84
184	601801	皖新传媒	997,881.00	3.83
185	002929	润建股份	997,640.00	3.83
186	002824	和胜股份	980,108.00	3.77
187	002275	桂林三金	979,904.55	3.76
188	002724	海洋王	978,382.40	3.76
189	603829	洛凯股份	977,960.00	3.76
190	300455	康拓红外	976,862.00	3.75
191	002403	爱仕达	975,439.00	3.75
192	600475	华光股份	974,090.00	3.74
193	300727	润禾材料	969,304.00	3.72
194	603880	南卫股份	968,153.00	3.72
195	600461	洪城水业	967,589.00	3.72
196	002543	万和电气	958,076.38	3.68
197	600833	第一医药	956,422.00	3.67
198	002861	瀛通通讯	949,523.00	3.65
199	000153	丰原药业	943,638.00	3.63
200	000821	京山轻机	943,350.00	3.62
201	300290	荣科科技	939,596.50	3.61
202	603928	兴业股份	938,918.00	3.61
203	002349	精华制药	938,751.00	3.61
204	000419	通程控股	938,229.00	3.60
205	300353	东土科技	936,741.00	3.60
206	002598	山东章鼓	933,537.00	3.59
207	603369	今世缘	928,289.14	3.57
208	300550	和仁科技	926,756.00	3.56
209	603558	健盛集团	923,624.00	3.55
210	600159	大龙地产	920,856.00	3.54
211	300061	康旗股份	920,338.40	3.54

212	600097	开创国际	915,988.00	3.52
213	600642	申能股份	915,962.00	3.52
214	000021	深科技	914,253.00	3.51
215	300374	恒通科技	909,654.00	3.49
216	002615	哈尔斯	909,253.75	3.49
217	600814	杭州解百	906,239.00	3.48
218	002806	华锋股份	904,614.00	3.48
219	000919	金陵药业	899,978.00	3.46
220	603161	科华控股	898,992.00	3.45
221	300729	乐歌股份	898,290.00	3.45
222	002817	黄山胶囊	898,188.00	3.45
223	300583	赛托生物	892,428.00	3.43
224	000046	泛海控股	888,088.00	3.41
225	603166	福达股份	883,795.00	3.40
226	300535	达威股份	882,717.00	3.39
227	002712	思美传媒	881,194.00	3.39
228	000858	五粮液	879,708.00	3.38
229	000066	中国长城	876,716.00	3.37
230	002878	元隆雅图	875,226.00	3.36
231	002120	韵达股份	872,892.00	3.35
232	002272	川润股份	872,612.00	3.35
233	601628	中国人寿	868,443.00	3.34
234	600887	伊利股份	867,763.00	3.33
235	000603	盛达资源	866,522.00	3.33
236	002718	友邦吊顶	862,630.00	3.31
237	002217	合力泰	861,435.00	3.31
238	300321	同大股份	858,964.00	3.30
239	000635	英力特	855,180.00	3.29
240	000963	华东医药	850,404.04	3.27
241	603980	吉华集团	846,579.00	3.25
242	002351	漫步者	845,029.00	3.25
243	000537	广宇发展	844,692.00	3.25
244	002316	亚联发展	840,255.00	3.23
245	300146	汤臣倍健	839,628.00	3.23
246	002654	万润科技	839,596.00	3.23
247	600719	大连热电	834,000.00	3.20

248	002399	海普瑞	833,535.00	3.20
249	300204	舒泰神	831,401.00	3.19
250	600180	瑞茂通	830,970.00	3.19
251	600611	大众交通	829,503.50	3.19
252	002620	瑞和股份	825,875.00	3.17
253	600229	城市传媒	824,894.35	3.17
254	600493	凤竹纺织	823,018.00	3.16
255	600167	联美控股	821,174.40	3.15
256	603023	威帝股份	820,189.00	3.15
257	000921	海信家电	818,981.00	3.15
258	000906	浙商中拓	817,090.24	3.14
259	600580	卧龙电驱	815,391.00	3.13
260	600310	桂东电力	815,378.00	3.13
261	002392	北京利尔	814,085.00	3.13
262	300418	昆仑万维	810,618.00	3.11
263	600168	武汉控股	807,162.00	3.10
264	000985	大庆华科	806,196.00	3.10
265	002291	星期六	803,762.00	3.09
266	600269	赣粤高速	803,685.00	3.09
267	002267	陕天然气	803,196.00	3.09
268	600373	中文传媒	801,638.00	3.08
269	002574	明牌珠宝	801,405.00	3.08
270	002534	杭锅股份	798,640.00	3.07
271	603918	金桥信息	796,767.00	3.06
272	603198	迎驾贡酒	796,652.00	3.06
273	000661	长春高新	791,455.00	3.04
274	300555	路通视信	790,138.00	3.04
275	300122	智飞生物	789,066.00	3.03
276	000666	经纬纺机	788,703.00	3.03
277	000411	英特集团	788,544.00	3.03
278	601595	上海电影	785,054.00	3.02
279	000032	深桑达 A	781,060.00	3.00
280	000530	大冷股份	776,094.00	2.98
281	000719	中原传媒	768,649.00	2.95
282	002762	金发拉比	768,465.00	2.95
283	000676	智度股份	766,363.00	2.94

284	603116	红蜻蜓	765,035.00	2.94
285	603059	倍加洁	762,599.00	2.93
286	300159	新研股份	761,750.00	2.93
287	603839	安正时尚	760,274.00	2.92
288	600262	北方股份	759,144.00	2.92
289	002825	纳尔股份	756,906.00	2.91
290	300145	中金环境	753,052.00	2.89
291	002463	沪电股份	748,643.00	2.88
292	600127	金健米业	747,445.00	2.87
293	002759	天际股份	745,862.00	2.87
294	300017	网宿科技	741,109.00	2.85
295	300272	开能健康	736,335.86	2.83
296	600757	长江传媒	733,394.00	2.82
297	002776	柏堡龙	731,211.00	2.81
298	601515	东风股份	724,132.00	2.78
299	300634	彩讯股份	723,650.00	2.78
300	000899	赣能股份	720,883.00	2.77
301	002152	广电运通	717,955.00	2.76
302	300716	国立科技	715,939.00	2.75
303	600516	方大炭素	714,995.00	2.75
304	300641	正丹股份	709,733.00	2.73
305	603030	全筑股份	706,907.00	2.72
306	603041	美思德	701,445.00	2.69
307	600901	江苏租赁	696,926.00	2.68
308	002435	长江健康	696,627.77	2.68
309	300320	海达股份	691,113.00	2.66
310	002533	金杯电工	684,641.00	2.63
311	000885	城发环境	682,684.00	2.62
312	000060	中金岭南	681,685.00	2.62
313	600603	广汇物流	679,771.00	2.61
314	603818	曲美家居	679,553.00	2.61
315	600449	宁夏建材	671,705.00	2.58
316	600841	上柴股份	671,273.00	2.58
317	300660	江苏雷利	670,816.00	2.58
318	603016	新宏泰	669,792.00	2.57
319	600508	上海能源	667,917.00	2.57

320	603898	好莱客	665,011.00	2.55
321	002234	民和股份	663,741.00	2.55
322	000922	佳电股份	663,726.00	2.55
323	600784	鲁银投资	662,431.00	2.54
324	002833	弘亚数控	661,692.00	2.54
325	002236	大华股份	661,418.00	2.54
326	002144	宏达高科	661,306.00	2.54
327	300117	嘉寓股份	659,958.00	2.54
328	601567	三星医疗	659,249.00	2.53
329	000096	广聚能源	658,984.00	2.53
330	002128	露天煤业	658,706.00	2.53
331	002729	好利来	656,924.00	2.52
332	600070	浙江富润	650,072.00	2.50
333	300584	海辰药业	649,129.00	2.49
334	300650	太龙照明	648,269.00	2.49
335	600319	ST 亚星	646,434.00	2.48
336	601518	吉林高速	645,578.00	2.48
337	002829	星网宇达	645,428.00	2.48
338	601368	绿城水务	641,924.00	2.47
339	000959	首钢股份	637,877.00	2.45
340	000779	甘咨询	634,859.00	2.44
341	600018	上港集团	631,897.00	2.43
342	600857	宁波中百	631,124.00	2.42
343	600577	精达股份	630,213.00	2.42
344	600802	福建水泥	630,211.00	2.42
345	600713	南京医药	629,280.00	2.42
346	603813	原尚股份	626,074.00	2.41
347	300235	方直科技	625,491.00	2.40
348	600163	中闽能源	621,200.00	2.39
349	000547	航天发展	619,512.00	2.38
350	603608	天创时尚	618,799.00	2.38
351	603887	城地股份	617,464.00	2.37
352	600690	海尔智家	616,548.00	2.37
353	603726	朗迪集团	616,317.00	2.37
354	600864	哈投股份	615,127.00	2.36
355	002304	洋河股份	610,820.00	2.35

356	002225	濮耐股份	609,052.00	2.34
357	600618	氯碱化工	607,484.00	2.33
358	300389	艾比森	606,743.00	2.33
359	300599	雄塑科技	605,098.00	2.32
360	600075	新疆天业	604,912.00	2.32
361	600126	杭钢股份	603,075.25	2.32
362	300722	新余国科	601,301.00	2.31
363	300512	中亚股份	600,762.00	2.31
364	603679	华体科技	599,934.00	2.30
365	603199	九华旅游	598,777.00	2.30
366	300294	博雅生物	598,119.14	2.30
367	600706	曲江文旅	596,931.00	2.29
368	002489	浙江永强	596,511.00	2.29
369	002658	雪迪龙	596,423.00	2.29
370	600867	通化东宝	593,750.00	2.28
371	300468	四方精创	591,213.00	2.27
372	601877	正泰电器	590,721.00	2.27
373	002600	领益智造	590,150.00	2.27
374	600089	特变电工	589,992.00	2.27
375	601318	中国平安	589,335.00	2.26
376	600805	悦达投资	588,510.00	2.26
377	600266	城建发展	587,339.00	2.26
378	300625	三雄极光	585,931.00	2.25
379	600382	广东明珠	582,195.00	2.24
380	600171	上海贝岭	581,012.00	2.23
381	002241	歌尔股份	580,971.00	2.23
382	002196	方正电机	580,689.00	2.23
383	000895	双汇发展	580,486.00	2.23
384	603889	新澳股份	578,853.00	2.22
385	600704	物产中大	578,762.00	2.22
386	601566	九牧王	577,684.00	2.22
387	002227	奥特迅	573,419.00	2.20
388	600598	北大荒	572,238.00	2.20
389	000718	苏宁环球	570,745.00	2.19
390	601126	四方股份	568,034.00	2.18
391	300710	万隆光电	567,696.00	2.18

392	600793	宜宾纸业	567,347.00	2.18
393	300136	信维通信	566,066.00	2.17
394	600619	海立股份	564,598.00	2.17
395	300118	东方日升	564,316.00	2.17
396	000049	德赛电池	564,202.00	2.17
397	601882	海天精工	563,116.00	2.16
398	600051	宁波联合	562,764.00	2.16
399	000100	TCL 集团	561,024.00	2.16
400	600246	万通地产	559,579.00	2.15
401	600847	万里股份	559,502.00	2.15
402	300050	世纪鼎利	559,148.00	2.15
403	300532	今天国际	558,340.00	2.14
404	600429	三元股份	558,261.00	2.14
405	002850	科达利	557,344.00	2.14
406	300172	中电环保	554,555.00	2.13
407	000031	大悦城	553,475.00	2.13
408	000836	富通鑫茂	553,346.00	2.13
409	603656	泰禾光电	553,041.00	2.12
410	300033	同花顺	553,039.00	2.12
411	600795	国电电力	552,780.00	2.12
412	300711	广哈通信	552,082.00	2.12
413	601899	紫金矿业	551,596.00	2.12
414	603200	上海洗霸	551,474.00	2.12
415	600023	浙能电力	551,434.00	2.12
416	601158	重庆水务	549,673.00	2.11
417	600830	香溢融通	549,258.00	2.11
418	300695	兆丰股份	547,759.00	2.10
419	600362	江西铜业	547,408.00	2.10
420	300696	爱乐达	547,204.00	2.10
421	600183	生益科技	546,420.00	2.10
422	300082	奥克股份	545,735.00	2.10
423	600223	鲁商发展	545,473.00	2.10
424	603767	中马传动	544,949.00	2.09
425	600210	紫江企业	544,850.00	2.09
426	000631	顺发恒业	543,657.00	2.09
427	600724	宁波富达	542,695.00	2.08

428	002352	顺丰控股	542,048.00	2.08
429	600184	光电股份	539,910.00	2.07
430	000725	京东方 A	538,922.00	2.07
431	000573	粤宏远 A	538,430.00	2.07
432	600318	新力金融	538,210.00	2.07
433	000876	新希望	537,789.00	2.07
434	603822	嘉澳环保	534,113.00	2.05
435	002748	世龙实业	528,955.00	2.03
436	600387	海越能源	528,168.00	2.03
437	603067	振华股份	527,559.40	2.03
438	300459	金科文化	525,294.00	2.02
439	300003	乐普医疗	524,919.00	2.02
440	002037	久联发展	524,261.00	2.01
441	000733	振华科技	524,101.00	2.01
442	002299	圣农发展	521,432.00	2.00
443	601006	大秦铁路	520,746.00	2.00
444	600009	上海机场	520,686.00	2.00

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601168	西部矿业	2,882,404.48	11.07
2	600829	人民同泰	2,880,223.99	11.06
3	000869	张裕 A	2,871,389.59	11.03
4	002802	洪汇新材	2,699,803.64	10.37
5	600785	新华百货	2,442,932.89	9.38
6	600629	华建集团	2,438,092.74	9.37
7	601677	明泰铝业	2,405,038.83	9.24
8	300419	浩丰科技	2,373,898.88	9.12
9	002458	益生股份	2,317,961.36	8.90
10	600665	天地源	2,228,091.15	8.56
11	300150	世纪瑞尔	2,224,166.75	8.54
12	300571	平治信息	2,171,169.75	8.34
13	002053	云南能投	2,169,907.32	8.34
14	601900	南方传媒	2,145,305.34	8.24

15	603855	华荣股份	2,134,881.65	8.20
16	002062	宏润建设	2,118,886.16	8.14
17	603669	灵康药业	2,112,454.18	8.12
18	603667	五洲新春	2,108,168.09	8.10
19	600293	三峡新材	2,103,433.61	8.08
20	603277	银都股份	2,064,768.75	7.93
21	002753	永东股份	2,064,540.42	7.93
22	300519	新光药业	2,042,172.65	7.85
23	300434	金石亚药	2,006,349.86	7.71
24	300617	安靠智电	1,965,075.48	7.55
25	601107	四川成渝	1,965,067.95	7.55
26	600488	天药股份	1,961,029.98	7.53
27	002182	云海金属	1,941,852.15	7.46
28	600873	梅花生物	1,893,592.23	7.27
29	300610	晨化股份	1,887,828.95	7.25
30	603926	铁流股份	1,878,723.96	7.22
31	000617	中油资本	1,856,831.24	7.13
32	600780	通宝能源	1,838,772.31	7.06
33	300155	安居宝	1,832,840.74	7.04
34	600327	大东方	1,825,510.22	7.01
35	002295	精艺股份	1,813,303.36	6.97
36	603156	养元饮品	1,806,045.81	6.94
37	603798	康普顿	1,779,863.14	6.84
38	603319	湘油泵	1,771,791.65	6.81
39	600791	京能置业	1,753,257.02	6.74
40	002884	凌霄泵业	1,737,271.41	6.67
41	300243	瑞丰高材	1,722,324.99	6.62
42	300415	伊之密	1,719,142.75	6.60
43	002853	皮阿诺	1,715,297.15	6.59
44	002577	雷柏科技	1,711,775.28	6.58
45	002187	广百股份	1,699,775.02	6.53
46	603589	口子窖	1,695,861.74	6.51
47	603098	森特股份	1,671,900.99	6.42
48	002771	真视通	1,669,277.68	6.41
49	603380	易德龙	1,659,975.93	6.38
50	600995	文山电力	1,656,489.02	6.36
51	300620	光库科技	1,653,431.06	6.35
52	000042	中洲控股	1,614,639.57	6.20

53	002165	红宝丽	1,608,595.46	6.18
54	603037	凯众股份	1,608,139.70	6.18
55	603600	永艺股份	1,606,523.02	6.17
56	002873	新天药业	1,588,771.92	6.10
57	603331	百达精工	1,585,064.81	6.09
58	002380	科远智慧	1,576,461.72	6.06
59	600681	百川能源	1,574,346.75	6.05
60	300277	海联讯	1,569,215.88	6.03
61	300286	安科瑞	1,565,952.70	6.02
62	603768	常青股份	1,563,555.82	6.01
63	300652	雷迪克	1,561,710.34	6.00
64	300511	雪榕生物	1,522,168.92	5.85
65	600576	祥源文化	1,508,151.51	5.79
66	002150	通润装备	1,505,791.48	5.78
67	600308	华泰股份	1,492,845.45	5.73
68	600390	五矿资本	1,489,947.36	5.72
69	300305	裕兴股份	1,476,811.10	5.67
70	600768	宁波富邦	1,464,528.78	5.63
71	603388	元成股份	1,442,815.10	5.54
72	603076	乐惠国际	1,438,337.25	5.53
73	600487	亨通光电	1,435,785.60	5.52
74	603139	康惠制药	1,429,177.53	5.49
75	300609	汇纳科技	1,413,007.08	5.43
76	603730	岱美股份	1,389,611.06	5.34
77	000517	荣安地产	1,389,577.35	5.34
78	603033	三维股份	1,385,990.41	5.32
79	600683	京投发展	1,384,371.08	5.32
80	603633	徕木股份	1,380,103.97	5.30
81	600350	山东高速	1,379,650.90	5.30
82	002528	英飞拓	1,373,125.43	5.28
83	002067	景兴纸业	1,366,379.60	5.25
84	300360	炬华科技	1,363,323.38	5.24
85	002026	山东威达	1,361,181.56	5.23
86	002608	江苏国信	1,355,887.68	5.21
87	002728	特一药业	1,354,642.57	5.20
88	603278	大业股份	1,353,574.83	5.20
89	300088	长信科技	1,353,441.49	5.20
90	603385	惠达卫浴	1,345,016.60	5.17

91	000030	富奥股份	1,339,436.73	5.15
92	600673	东阳光	1,324,297.88	5.09
93	603007	花王股份	1,310,343.73	5.03
94	603203	快克股份	1,308,780.36	5.03
95	600497	驰宏锌锗	1,308,676.33	5.03
96	300522	世名科技	1,297,162.37	4.98
97	603100	川仪股份	1,295,834.16	4.98
98	603416	信捷电气	1,290,040.97	4.96
99	603165	荣晟环保	1,285,798.75	4.94
100	002772	众兴菌业	1,284,839.63	4.94
101	002685	华东重机	1,283,160.42	4.93
102	600248	延长化建	1,282,198.35	4.93
103	603298	杭叉集团	1,281,282.26	4.92
104	600173	卧龙地产	1,271,469.82	4.88
105	603685	晨丰科技	1,262,834.80	4.85
106	300600	瑞特股份	1,260,630.64	4.84
107	601500	通用股份	1,251,462.95	4.81
108	600703	三安光电	1,245,006.17	4.78
109	300309	吉艾科技	1,231,077.99	4.73
110	600191	华资实业	1,222,274.80	4.70
111	601658	邮储银行	1,212,117.06	4.66
112	300219	鸿利智汇	1,210,742.39	4.65
113	600475	华光股份	1,210,251.10	4.65
114	600979	广安爱众	1,209,260.86	4.65
115	600668	尖峰集团	1,208,710.76	4.64
116	002724	海洋王	1,208,342.29	4.64
117	603311	金海环境	1,208,236.91	4.64
118	600076	康欣新材	1,203,634.97	4.62
119	002763	汇洁股份	1,201,764.57	4.62
120	002566	益盛药业	1,197,187.01	4.60
121	300656	民德电子	1,192,033.50	4.58
122	000541	佛山照明	1,192,013.66	4.58
123	002799	环球印务	1,187,924.79	4.56
124	000685	中山公用	1,184,076.45	4.55
125	300461	田中精机	1,178,071.13	4.53
126	300120	经纬辉开	1,156,099.05	4.44
127	600073	上海梅林	1,155,979.68	4.44
128	000848	承德露露	1,155,034.80	4.44

129	002893	华通热力	1,153,804.40	4.43
130	300440	运达科技	1,152,771.34	4.43
131	300531	优博讯	1,141,825.57	4.39
132	300621	维业股份	1,137,634.87	4.37
133	600260	凯乐科技	1,136,951.33	4.37
134	603757	大元泵业	1,136,249.42	4.37
135	000415	渤海租赁	1,134,911.28	4.36
136	300428	四通新材	1,132,507.87	4.35
137	300270	中威电子	1,130,316.80	4.34
138	300546	雄帝科技	1,128,723.24	4.34
139	000639	西王食品	1,124,724.81	4.32
140	002441	众业达	1,120,746.24	4.31
141	000705	浙江震元	1,120,354.19	4.30
142	600976	健民集团	1,118,578.08	4.30
143	002540	亚太科技	1,117,501.10	4.29
144	300074	华平股份	1,116,950.34	4.29
145	300248	新开普	1,116,542.38	4.29
146	603661	恒林股份	1,099,969.39	4.23
147	000525	红太阳	1,099,305.90	4.22
148	002824	和胜股份	1,093,618.20	4.20
149	603955	大千生态	1,087,220.09	4.18
150	002749	国光股份	1,086,330.45	4.17
151	603567	珍宝岛	1,085,132.64	4.17
152	002651	利君股份	1,082,227.89	4.16
153	600828	茂业商业	1,081,515.57	4.15
154	300582	英飞特	1,080,809.76	4.15
155	002882	金龙羽	1,075,454.46	4.13
156	000949	新乡化纤	1,070,795.66	4.11
157	600862	中航高科	1,064,999.07	4.09
158	603958	哈森股份	1,064,392.18	4.09
159	601222	林洋能源	1,055,583.22	4.06
160	603900	莱绅通灵	1,052,388.06	4.04
161	603507	振江股份	1,048,080.70	4.03
162	600606	绿地控股	1,040,439.91	4.00
163	603238	诺邦股份	1,032,635.51	3.97
164	002346	柘中股份	1,032,041.55	3.96
165	603001	奥康国际	1,024,821.82	3.94
166	603266	天龙股份	1,024,052.41	3.93

167	002900	哈三联	1,021,912.04	3.93
168	603976	正川股份	1,019,277.81	3.92
169	600221	海航控股	1,018,788.00	3.91
170	600461	洪城水业	1,015,402.18	3.90
171	603015	弘讯科技	1,013,562.44	3.89
172	002331	皖通科技	1,012,744.80	3.89
173	002452	长高集团	1,006,485.92	3.87
174	300455	康拓红外	1,006,308.48	3.87
175	600865	百大集团	1,005,033.86	3.86
176	002746	仙坛股份	1,004,794.64	3.86
177	002790	瑞尔特	1,000,748.46	3.84
178	002861	瀛通通讯	998,862.06	3.84
179	600082	海泰发展	997,969.29	3.83
180	000153	丰原药业	991,726.78	3.81
181	300353	东土科技	988,646.08	3.80
182	000782	美达股份	982,509.53	3.77
183	002929	润建股份	982,101.23	3.77
184	300727	润禾材料	975,580.33	3.75
185	002403	爱仕达	975,290.79	3.75
186	600843	上工申贝	972,670.19	3.74
187	300550	和仁科技	968,394.64	3.72
188	603928	兴业股份	963,776.92	3.70
189	002600	领益智造	958,350.86	3.68
190	603829	洛凯股份	958,008.80	3.68
191	002252	上海莱士	955,453.81	3.67
192	603918	金桥信息	953,351.95	3.66
193	002543	万和电气	947,928.25	3.64
194	002351	漫步者	946,498.92	3.64
195	603369	今世缘	942,581.08	3.62
196	002806	华锋股份	926,970.32	3.56
197	002598	山东章鼓	926,412.64	3.56
198	603161	科华控股	925,240.81	3.55
199	603166	福达股份	924,639.11	3.55
200	000419	通程控股	923,772.13	3.55
201	000066	中国长城	921,352.80	3.54
202	603041	美思德	920,240.28	3.54
203	002817	黄山胶囊	919,630.81	3.53
204	300374	恒通科技	918,998.26	3.53

205	603303	得邦照明	918,185.60	3.53
206	600833	第一医药	916,308.93	3.52
207	600642	申能股份	915,098.70	3.52
208	002654	万润科技	911,738.88	3.50
209	300447	全信股份	910,244.00	3.50
210	300290	荣科科技	906,975.98	3.48
211	300729	乐歌股份	906,541.62	3.48
212	000821	京山轻机	904,886.47	3.48
213	600814	杭州解百	904,395.12	3.47
214	300583	赛托生物	902,099.51	3.47
215	601801	皖新传媒	899,478.04	3.46
216	600551	时代出版	898,384.71	3.45
217	603558	健盛集团	897,680.30	3.45
218	600167	联美控股	895,347.78	3.44
219	000046	泛海控股	894,890.97	3.44
220	600887	伊利股份	894,368.36	3.44
221	600159	大龙地产	893,112.29	3.43
222	000919	金陵药业	893,036.05	3.43
223	002120	韵达股份	889,668.80	3.42
224	000661	长春高新	887,841.30	3.41
225	000858	五粮液	880,056.98	3.38
226	002712	思美传媒	878,485.82	3.37
227	300321	同大股份	874,754.21	3.36
228	601628	中国人寿	874,044.09	3.36
229	002272	川润股份	871,130.86	3.35
230	300535	达威股份	868,877.20	3.34
231	000603	盛达资源	864,188.23	3.32
232	603198	迎驾贡酒	861,667.35	3.31
233	603980	吉华集团	861,114.03	3.31
234	300146	汤臣倍健	856,300.03	3.29
235	603861	白云电器	853,112.46	3.28
236	002878	元隆雅图	852,300.12	3.27
237	002392	北京利尔	850,232.69	3.27
238	300159	新研股份	849,092.00	3.26
239	300061	康旗股份	845,540.71	3.25
240	002217	合力泰	845,499.00	3.25
241	000032	深桑达 A	839,327.27	3.22
242	300204	舒泰神	839,086.04	3.22

243	000719	中原传媒	838,883.07	3.22
244	603839	安正时尚	838,746.22	3.22
245	000666	经纬纺机	837,512.02	3.22
246	000906	浙商中拓	836,320.44	3.21
247	000635	英力特	833,403.74	3.20
248	000537	广宇发展	833,342.00	3.20
249	000021	深科技	833,047.15	3.20
250	002399	海普瑞	829,900.20	3.19
251	300145	中金环境	826,760.29	3.18
252	600168	武汉控股	824,816.06	3.17
253	600580	卧龙电驱	821,139.19	3.15
254	300418	昆仑万维	820,755.20	3.15
255	300122	智飞生物	817,766.30	3.14
256	002534	杭锅股份	817,485.40	3.14
257	600516	方大炭素	817,254.51	3.14
258	000921	海信家电	817,059.75	3.14
259	002291	星期六	809,856.23	3.11
260	000963	华东医药	807,608.36	3.10
261	600719	大连热电	802,364.26	3.08
262	002620	瑞和股份	800,541.10	3.08
263	600180	瑞茂通	799,636.92	3.07
264	601595	上海电影	798,403.34	3.07
265	000530	大冷股份	795,679.87	3.06
266	000985	大庆华科	795,356.13	3.06
267	603059	倍加洁	791,140.64	3.04
268	002267	陕天然气	790,205.99	3.04
269	600229	城市传媒	788,090.28	3.03
270	600373	中文传媒	785,664.91	3.02
271	600127	金健米业	782,742.90	3.01
272	002574	明牌珠宝	781,844.22	3.00
273	603023	威帝股份	775,351.59	2.98
274	600310	桂东电力	773,801.54	2.97
275	000676	智度股份	772,130.34	2.97
276	002762	金发拉比	771,960.35	2.97
277	002275	桂林三金	770,646.56	2.96
278	600611	大众交通	768,780.44	2.95
279	600097	开创国际	767,894.17	2.95
280	000411	英特集团	767,066.09	2.95

281	002152	广电运通	766,226.85	2.94
282	600269	赣粤高速	765,739.68	2.94
283	002379	宏创控股	762,635.72	2.93
284	603116	红蜻蜓	757,973.02	2.91
285	601515	东风股份	745,906.82	2.87
286	002435	长江健康	739,399.95	2.84
287	300641	正丹股份	732,073.43	2.81
288	002718	友邦吊顶	728,194.13	2.80
289	002759	天际股份	725,302.22	2.79
290	000885	城发环境	724,664.36	2.78
291	603880	南卫股份	722,936.72	2.78
292	603822	嘉澳环保	721,396.41	2.77
293	002776	柏堡龙	721,079.48	2.77
294	300634	彩讯股份	718,957.36	2.76
295	300136	信维通信	718,174.60	2.76
296	300468	四方精创	703,768.75	2.70
297	002236	大华股份	703,370.50	2.70
298	002349	精华制药	700,109.17	2.69
299	002463	沪电股份	698,827.44	2.68
300	600757	长江传媒	697,864.40	2.68
301	603818	曲美家居	696,572.84	2.68
302	603898	好莱客	694,801.76	2.67
303	002533	金杯电工	694,374.06	2.67
304	300660	江苏雷利	692,563.85	2.66
305	000060	中金岭南	690,638.35	2.65
306	300716	国立科技	689,457.64	2.65
307	600901	江苏租赁	682,164.12	2.62
308	601567	三星医疗	678,964.13	2.61
309	600493	凤竹纺织	676,132.94	2.60
310	300235	方直科技	675,773.22	2.60
311	300017	网宿科技	674,648.92	2.59
312	603656	泰禾光电	674,521.79	2.59
313	000899	赣能股份	673,991.07	2.59
314	600449	宁夏建材	673,800.40	2.59
315	300584	海辰药业	671,389.62	2.58
316	002128	露天煤业	669,817.17	2.57
317	300389	艾比森	668,253.55	2.57
318	600784	鲁银投资	666,755.70	2.56

319	600508	上海能源	665,809.02	2.56
320	600802	福建水泥	664,945.56	2.55
321	600018	上港集团	662,492.96	2.55
322	002144	宏达高科	662,409.03	2.54
323	600163	中闽能源	661,809.58	2.54
324	603726	朗迪集团	661,515.04	2.54
325	600603	广汇物流	657,034.10	2.52
326	603887	城地股份	656,130.73	2.52
327	600070	浙江富润	654,812.95	2.52
328	601368	绿城水务	652,790.54	2.51
329	300625	三雄极光	652,211.84	2.51
330	002241	歌尔股份	651,417.54	2.50
331	600857	宁波中百	650,004.30	2.50
332	600319	ST 亚星	648,906.45	2.49
333	000922	佳电股份	648,864.33	2.49
334	000096	广聚能源	647,043.20	2.49
335	603016	新宏泰	644,586.55	2.48
336	300272	开能健康	642,744.70	2.47
337	002615	哈尔斯	642,700.77	2.47
338	600577	精达股份	642,435.00	2.47
339	002234	民和股份	640,811.36	2.46
340	002829	星网宇达	639,210.59	2.46
341	603813	原尚股份	636,412.24	2.44
342	002833	弘亚数控	634,087.18	2.44
343	600864	哈投股份	633,504.60	2.43
344	002225	濮耐股份	632,704.15	2.43
345	600867	通化东宝	629,483.83	2.42
346	300117	嘉寓股份	629,394.40	2.42
347	600690	海尔智家	628,452.71	2.41
348	600618	氯碱化工	628,074.00	2.41
349	600713	南京医药	626,977.17	2.41
350	300650	太龙照明	626,721.59	2.41
351	601518	吉林高速	623,393.82	2.39
352	002489	浙江永强	620,059.50	2.38
353	002729	好利来	619,066.91	2.38
354	300294	博雅生物	618,483.56	2.38
355	603199	九华旅游	617,244.14	2.37
356	000836	富通鑫茂	616,872.41	2.37

357	300320	海达股份	615,928.58	2.37
358	000779	甘咨询	614,961.91	2.36
359	000100	TCL 集团	614,545.25	2.36
360	300118	东方日升	610,037.60	2.34
361	600793	宜宾纸业	609,945.89	2.34
362	000547	航天发展	606,259.88	2.33
363	300599	雄塑科技	605,818.98	2.33
364	000959	首钢股份	605,213.49	2.33
365	600126	杭钢股份	603,932.10	2.32
366	600805	悦达投资	603,655.04	2.32
367	300050	世纪鼎利	603,472.50	2.32
368	002777	久远银海	595,861.00	2.29
369	600706	曲江文旅	595,274.49	2.29
370	002658	雪迪龙	594,457.40	2.28
371	600444	国机通用	591,129.38	2.27
372	603608	天创时尚	591,104.15	2.27
373	600246	万通地产	590,853.68	2.27
374	601318	中国平安	589,984.00	2.27
375	002316	亚联发展	587,809.26	2.26
376	603090	宏盛股份	587,452.45	2.26
377	600051	宁波联合	586,813.59	2.25
378	000049	德赛电池	586,378.64	2.25
379	601566	九牧王	583,901.30	2.24
380	600704	物产中大	580,646.66	2.23
381	000876	新希望	580,338.24	2.23
382	601077	渝农商行	577,332.09	2.22
383	601999	出版传媒	576,802.01	2.22
384	600382	广东明珠	576,089.91	2.21
385	600429	三元股份	574,747.65	2.21
386	601877	正泰电器	574,561.80	2.21
387	002352	顺丰控股	574,537.63	2.21
388	600089	特变电工	574,404.44	2.21
389	002196	方正电机	573,418.12	2.20
390	300711	广哈通信	572,494.28	2.20
391	000636	风华高科	571,803.70	2.20
392	600847	万里股份	570,516.32	2.19
393	002227	奥特迅	567,369.85	2.18
394	603889	新澳股份	564,992.68	2.17

395	002825	纳尔股份	564,882.18	2.17
396	300082	奥克股份	564,067.52	2.17
397	601899	紫金矿业	563,271.00	2.16
398	600223	鲁商发展	562,878.86	2.16
399	300686	智动力	562,486.68	2.16
400	000631	顺发恒业	559,516.00	2.15
401	600724	宁波富达	559,248.00	2.15
402	600266	城建发展	559,184.36	2.15
403	600598	北大荒	558,053.51	2.14
404	600184	光电股份	557,755.28	2.14
405	300172	中电环保	556,764.04	2.14
406	600171	上海贝岭	552,358.60	2.12
407	600262	北方股份	550,286.20	2.11
408	000725	京东方 A	550,164.00	2.11
409	600188	兖州煤业	549,977.55	2.11
410	002850	科达利	549,444.40	2.11
411	600075	新疆天业	548,749.90	2.11
412	300003	乐普医疗	548,001.85	2.11
413	000031	大悦城	546,449.60	2.10
414	603767	中马传动	545,542.02	2.10
415	600362	江西铜业	544,437.10	2.09
416	601158	重庆水务	543,819.95	2.09
417	603679	华体科技	543,102.13	2.09
418	601006	大秦铁路	542,500.00	2.08
419	002805	丰元股份	541,791.74	2.08
420	300710	万隆光电	541,305.20	2.08
421	600023	浙能电力	534,961.12	2.06
422	000895	双汇发展	534,072.00	2.05
423	002742	三圣股份	533,322.68	2.05
424	601882	海天精工	532,829.77	2.05
425	002544	杰赛科技	531,657.07	2.04
426	002641	永高股份	530,666.30	2.04
427	000933	神火股份	530,564.04	2.04
428	600250	南纺股份	530,550.02	2.04
429	300695	兆丰股份	530,189.61	2.04
430	300459	金科文化	529,383.52	2.03
431	600578	京能电力	528,768.00	2.03
432	300258	精锻科技	528,020.00	2.03

433	603067	振华股份	526,102.48	2.02
434	002413	雷科防务	524,201.64	2.01
435	000573	粤宏远 A	523,894.00	2.01
436	002425	凯撒文化	521,904.93	2.00
437	600795	国电电力	521,449.03	2.00

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	661,768,716.06
卖出股票收入（成交）总额	656,423,958.89

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：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

注：本基金本报告期末投资贵金属。

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

注：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

注：本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本产品暂不对股指期货进行投资。

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

本基金目前暂不对国债期货进行投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，邮储银行于 2019 年 7 月 3 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定，罚款合计 140 万元。主要违法违规事实：（一）未按监管要求对代理营业机构进行考核；（二）劳务派遣工违规担任综合柜员；（三）员工信息管理不到位；（四）未按规定开展审计工作。

渝农商行于 2019 年 6 月 27 日收到中国银行保险监督管理委员会重庆监管局行政处罚决定，罚款合计 20 万元。主要违法违规事实：内控管理不严。

浙商银行于 2019 年 12 月 31 日收到中国人民银行杭州中心支行行政处罚决定，罚款合计 1010 万元。主要违法违规事实：1. 未按规定履行客户身份识别义务。2. 未按规定保存客户身份资料及交易记录。3. 未按规定进行可疑交易报告。4. 与身份不明的客户进行交易。

上述证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本期基金投资组合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	22,012.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	915.65
5	应收申购款	2,514.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,442.51

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601658	邮储银行	2,880,695.00	10.31	锁定期股票流通受限
2	601916	浙商银行	1,016,788.70	3.64	锁定期股票流通受限
3	601077	渝农商行	844,148.48	3.02	锁定期股票流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
955	24,915.86	0.00	0.00%	23,794,646.32	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	240,717.94	1.0116%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年10月31日）基金份额总额	249,293,966.03
本报告期期初基金份额总额	26,134,859.42
本报告期基金总申购份额	74,469,309.59
减:本报告期基金总赎回份额	76,809,522.69
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	23,794,646.32

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人发生重大人事变动。根据国金基金管理有限公司第三届董事会审议通过，韩东霞女士自 2019 年 7 月 1 日起不再担任公司副总经理，聂武鹏先生自 2019 年 7 月 18 日起担任公司副总经理，陈琨先生自 2019 年 9 月 16 日起担任公司副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门发生重大人事变动。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；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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略无重大变化：运用基于 A 股自身特点开发的量化多因子选股模型进行选股投资，着重用量化的方法精选中小盘高成长性公司。仓位方面基本维持中高仓位，基本不进行大规模的择时和加减仓。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000 元人民币。截至本报告期末，该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
东方证券	1	690,060,254.27	52.65%	297,626.02	52.65%	-
招商证券	2	316,343,207.09	24.13%	136,440.66	24.13%	-
华宝证券	1	304,323,347.46	23.22%	131,256.57	23.22%	-

注：1. 本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

（1）基金专用交易席位的选择标准如下：

- ① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③ 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需要；
- ④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；
- ⑤ 交易佣金收取标准合理。

（2）基金专用交易席位的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

2. 本报告期新增华宝证券一个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	8,051,084.39	100.00%	1,500,000.00	100.00%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《关于增加大连网金基金销售有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年1月4日
2	《关于增加阳光人寿保险股份有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年1月10日
3	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年1月19日
4	《关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年2月23日
5	《关于增加民商基金销售(上海)有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年3月7日
6	《关于增加华西证券股份有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年3月21日
7	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2018 年年度报告》”	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年3月30日
8	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2018 年年度报告摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年3月30日
9	《关于北京懒猫金融信息服务有限公司终止代理销售国金基金管理有限公司旗下基金的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年4月18日

10	《国金基金管理有限公司关于增加国金证券、上海基煜为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 4 月 20 日
11	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 4 月 22 日
12	《国金基金管理有限公司关于增加泰信财富、奕丰金融为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 4 月 25 日
13	《关于国金基金管理有限公司开通旗下部分基金转换业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 5 月 22 日
14	《关于增加国融证券股份有限公司为国金量化多因子股票型证券投资基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 5 月 31 日
15	《关于增加国都证券、平安证券为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 6 月 11 日
16	《关于增加洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 6 月 20 日
17	《国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的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 6 月 21 日
18	《关于增加民生证券为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 6 月 28 日
19	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 7 月 3 日

		站	
20	《国金基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年7月9日
21	《关于增加基煜基金、长量基金、蛋卷基金、国信嘉利、汇成基金、中信证券、中信证券（山东）、中信期货为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年7月12日
22	《国金基金管理有限公司关于增加联储证券、招商证券为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年7月16日
23	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年7月18日
24	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年7月22日
25	《国金基金管理有限公司关于增加华瑞保险销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年8月2日
26	《关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年8月20日
27	《关于增加恒泰证券股份有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年8月21日
28	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2019 年半年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年8月27日

		站	
29	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 8 月 27 日
30	《国金基金管理有限公司关于增加汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 8 月 28 日
31	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 9 月 18 日
32	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 10 月 23 日
33	《国金量化多因子股票型证券投资基金基金合同》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 10 月 23 日
34	《国金量化多因子股票型证券投资基金托管协议》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 10 月 23 日
35	《国金量化多因子股票型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 10 月 23 日
36	《关于国金基金管理有限公司旗下部分证券投资基金修改基金合同的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 10 月 23 日
37	《关于国金基金管理有限公司调整旗下部分基金单笔申购最低金额的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 10 月 24 日
38	《关于增加中信建投证券股份有	指定披露媒体和本	2019 年 12 月 5 日

	限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》	基金基金管理人网站	
39	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的东旭光电估值方法调整的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 12 月 6 日

注：本报告期内，基金管理人按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定每个开放日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§ 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

注：本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金量化多因子股票型证券投资基金基金合同；
- 3、国金量化多因子股票型证券投资基金托管协议；
- 4、国金量化多因子股票型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

13.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。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或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2020 年 4 月 17 日