

# 国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示

### 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 29 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	国金鑫瑞灵活
基金主代码	002155
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 13 日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	28,832,486.32 份
基金合同存续期	不定期

注：无。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过合理的资产配置和积极的证券选择，追求在严格控制风险的前提下实现资本的长期稳健回报。
投资策略	本基金将根据对宏观经济周期和市场运行阶段的判断来确定投资组合中各大类资产的权重。在权益类资产投资方面，本基金将综合运用定量分析和定性分析手段，精选出具有内在价值和成长潜力的股票来构建股票投资组合。在固定收益类资产投资方面，本基金将深入研究分析宏观经济和利率趋势，选择流动性好，到期收益率与信用质量相对较高的债券品种进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%。
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。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	彭文敏	吴玉婷
	联系电话	010-88005888	021-52629999—212052
	电子邮箱	pengwenmin@gfund.com	015289@cib.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95561
传真		010-88005666	021-62535823

### 2.4 信息披露方式

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办公场所
------------	------------------

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017年9月13日(基金合同生效日)-2017年12月31日	2016 年
本期已实现收益	-11,080,710.42	2,363,266.82	-
本期利润	-11,733,868.18	2,363,266.82	-
加权平均基金份额本期利润	-0.2180	0.0203	-
本期基金份额净值增长率	-12.35%	3.07%	-
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0966	0.0307	-
期末基金资产净值	26,046,703.49	9,555,261.39	-
期末基金份额净值	0.9034	1.0307	-

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。

#### 3.2 基金净值表现

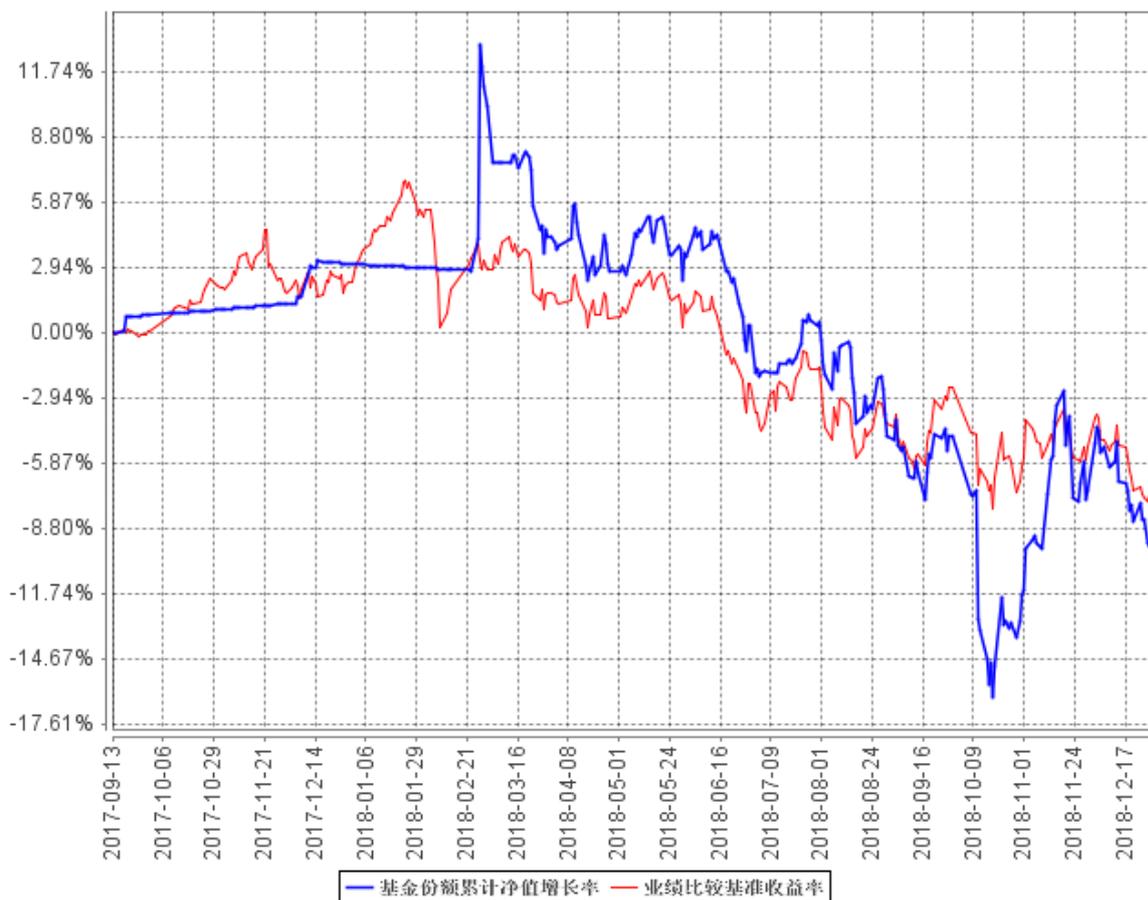
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.23%	1.53%	-4.88%	0.82%	-0.35%	0.71%
过去六个月	-9.96%	1.19%	-5.08%	0.74%	-4.88%	0.45%
过去一年	-12.35%	1.09%	-9.32%	0.67%	-3.03%	0.42%
自基金合同生效起至今	-9.66%	0.95%	-7.23%	0.61%	-2.43%	0.34%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*50%+中证全债指数收益率\*50%

### 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

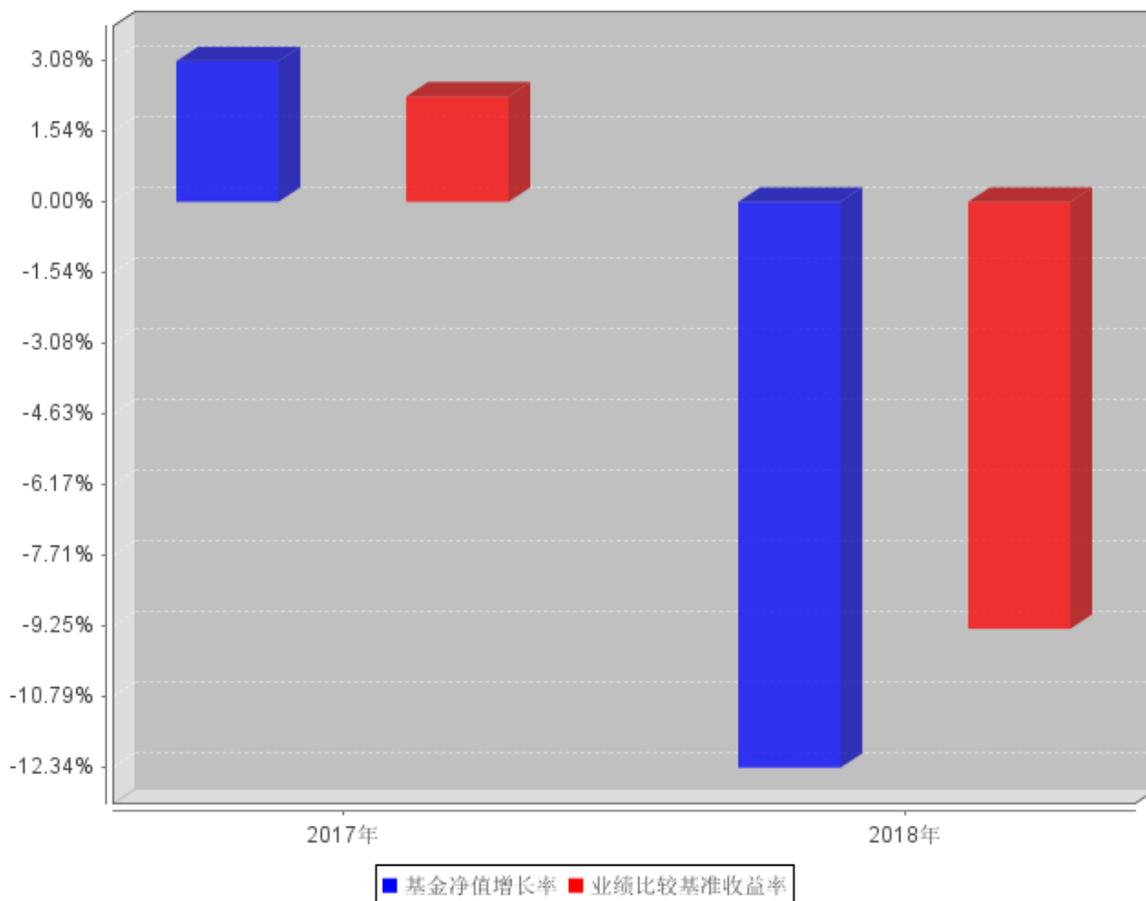
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2017 年 9 月 13 日至 2018 年 12 月 31 日。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2017 年 9 月 13 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 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 2017 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 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2018年12月31日，国金基金管理有限公司共管理13只公募基金，具体包括国金鑫瑞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指数分级证券投资基金、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）、国金及第七天理财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。

#### 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		
宫雪	本基金基金经理，国金300指数增强、国金上证50、国金鑫新灵活配置（LOF）基金经理，量化投资事业三部总经理兼产品中心总经理	2017年9月13日	-	10	宫雪女士，中国科学院博士。2008年7月至2011年12月在博时基金管理有限公司股票投资部，任产业分析师；2012年2月至今在国金基金管理有限公司，历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理，现任量化投资事业三部总经理兼产品中心总经理。
杨雨龙	本基金基金经理，国金量化多因子、	2018年7月16日	-	9	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

	国金量化添利基金经理，量化投资事业二部总经理			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》、《国金鑫瑞灵活配置混合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，在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，对开放式基金和特定客户资产管理计划等不同类型业务，公司分别设立独立的投资部门；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等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

本基金运用基于 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优质的价值白马公司。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。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金份额净值收益率为-12.35%，同期业绩比较基准收益率为-9.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前贸易战有趋于缓和的迹象，且贸易谈判也已经有所进展。流动性方面的收缩也趋向于精细化管理。股市在经历了 2018 年的调整以后，目前估值已经有较好的投资价值，年初至今市场已经有了不错的表现。总体来说，我们对今年市场的表现持谨慎乐观的态度，机会大于风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照《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。

#### **4.7 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。

#### **4.8 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

#### **4.9 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**

本报告期，本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形，出现该情况的时间范围为 2018 年 3 月 7 日至 2018 年 5 月 8 日。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

本托管人根据《国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》与《国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金托管协议》，自 2017 年 9 月 13 日起托管国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2019）审字第 61004823_A12 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	国金鑫瑞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>我们审计了国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的国金鑫瑞灵活配置混合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，公允反映了国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度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，我们独立于国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金，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>国金鑫瑞灵活配置混合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鑫瑞灵活配置混合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），</p>

	<p>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鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，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，就可能对国金鑫瑞灵活配置混合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鑫瑞灵活配置混合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</p>

	<p>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	徐艳	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	2019年3月26日	

注：无

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,492,331.41	9,708,810.76
结算备付金		490,912.52	-
存出保证金		40,652.54	-
交易性金融资产	7.4.7.2	16,415,642.06	-
其中：股票投资		16,415,642.06	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		5,095,004.41	-
应收利息	7.4.7.5	2,481.38	4,806.21
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		26,537,024.32	9,713,616.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	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		-	101.37
应付管理人报酬		18,222.75	32,451.43
应付托管费		4,555.68	8,112.84
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	268,207.40	139.68
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	199,335.00	117,550.26
负债合计		490,320.83	158,355.58
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	28,832,486.32	9,270,534.99
未分配利润	7.4.7.10	-2,785,782.83	284,726.40
所有者权益合计		26,046,703.49	9,555,261.39
负债和所有者权益总计		26,537,024.32	9,713,616.97

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.9034 元，基金份额总额为 28,832,486.32 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 9 月 13 日(基 金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-10,332,437.81	2,836,430.71
1. 利息收入		640,276.83	1,427,495.59
其中：存款利息收入	7.4.7.11	298,002.05	1,424,831.54
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		342,274.78	2,664.05
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,910,355.96	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-11,711,111.32	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
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	39,661.75	-
股利收益	7.4.7.16	761,093.61	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-653,157.76	-
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	590,799.08	1,408,935.12
<b>减：二、费用</b>		1,401,430.37	473,163.89
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	426,622.60	282,935.13
2. 托管费	7.4.10.2.2	106,655.56	70,733.76

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	642,030.86	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		431.83	-
7. 其他费用	7.4.7.20	225,689.52	119,495.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-11,733,868.18	2,363,266.82
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-11,733,868.18	2,363,266.82

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	9,270,534.99	284,726.40	9,555,261.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,733,868.18	-11,733,868.18
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）	19,561,951.33	8,663,358.95	28,225,310.28
其中：1. 基金申购款	148,704,219.64	11,329,043.85	160,033,263.49
2. 基金赎回款	-129,142,268.31	-2,665,684.90	-131,807,953.21
五、期末所有者权益（基金净值）	28,832,486.32	-2,785,782.83	26,046,703.49
项目	上年度可比期间 2017 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	200,170,888.02	-	200,170,888.02
二、本期经营活动产生的	-	2,363,266.82	2,363,266.82



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》、《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〈年度报告和半年度报告〉》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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 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，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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；

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

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

卖出权证于交易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交易日结转；

### (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方法进行估值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 6 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 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、基金代销机构
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
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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。

## 7.4.8 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。

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 股票交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2017 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2017 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2017 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2017 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.5 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 2017 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间均无应支付关联方的佣金。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 9 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	426,622.60	282,935.13
其中：支付销售机构的客户维护费	117.71	244.86

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% / \text{当年天数}$$

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。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 9 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	106,655.56	70,733.76

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。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：无

#### 7.4.8.3 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 2017 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间 2017 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间均未运用固有资金投资本基金。

**7.4.8.4.2 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 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	27,874,930.31	96.6789%	8,741,136.47	94.2895%

注：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。

**7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 9 月 13 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行-活期存款	4,492,331.41	293,775.71	9,708,810.76	122,848.21

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率或约定的利率计息。

**7.4.8.6 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。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无

**7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

#### 7.4.9.2 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的股票。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 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。

##### 7.4.9.3.2 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。

#### 7.4.10 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 16,415,642.06 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额。（上年度：无属于第一层次的余额，无属于第二层次的余额，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三层次公允价值本期未发生变动。（上年度：无）

##### 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

注：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 2019 年 3 月 26 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	16,415,642.06	61.86
	其中：股票	16,415,642.06	61.86
7	银行存款和结算备付金合计	4,983,243.93	18.78
8	其他各项资产	5,138,138.33	19.36
9	合计	26,537,024.32	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	180,186.00	0.69
B	采矿业	105,435.00	0.40
C	制造业	10,277,774.06	39.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	989,624.00	3.80
E	建筑业	417,150.00	1.60
F	批发和零售业	906,375.00	3.48
G	交通运输、仓储和邮政业	262,506.00	1.01
H	住宿和餐饮业	61,410.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,370,366.00	5.26
J	金融业	122,296.00	0.47
K	房地产业	743,190.00	2.85
L	租赁和商务服务业	455,928.00	1.75
M	科学研究和技术服务业	71,240.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	60,984.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	281,228.00	1.08
S	综合	109,950.00	0.42
	合计	16,415,642.06	63.02

注：以上行业分类以 2018 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股票投资组合。

**8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

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	002724	海洋王	64,500	336,045.00	1.29
2	300566	激智科技	25,200	332,640.00	1.28
3	601882	海天精工	46,200	325,248.00	1.25
4	002645	华宏科技	43,800	311,856.00	1.20
5	300445	康斯特	30,800	300,300.00	1.15
6	601900	南方传媒	33,400	281,228.00	1.08
7	603090	宏盛股份	20,900	271,282.00	1.04
8	300605	恒锋信息	17,675	265,125.00	1.02
9	603918	金桥信息	22,200	263,070.00	1.01
10	603429	集友股份	10,800	247,428.00	0.95

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

**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	11,891,206.78	124.45
2	600519	贵州茅台	5,823,804.00	60.95
3	600036	招商银行	4,811,211.59	50.35
4	600016	民生银行	3,087,682.00	32.31
5	600887	伊利股份	2,973,918.00	31.12
6	601328	交通银行	2,662,832.00	27.87
7	601288	农业银行	2,432,039.00	25.45
8	600030	中信证券	2,286,546.00	23.93
9	600000	浦发银行	2,221,274.00	23.25
10	601398	工商银行	2,124,054.00	22.23
11	601668	中国建筑	2,038,108.00	21.33
12	601601	中国太保	2,005,333.00	20.99
13	600104	上汽集团	1,984,165.00	20.77
14	601169	北京银行	1,594,611.00	16.69
15	600048	保利地产	1,589,047.00	16.63

16	600837	海通证券	1,488,225.00	15.57
17	601988	中国银行	1,443,359.00	15.11
18	600019	宝钢股份	1,307,889.00	13.69
19	300219	鸿利智汇	1,293,614.00	13.54
20	601211	国泰君安	1,235,496.00	12.93
21	601801	皖新传媒	1,234,013.00	12.91
22	601766	中国中车	1,157,154.00	12.11
23	600602	云赛智联	1,077,436.00	11.28
24	600028	中国石化	1,071,053.00	11.21
25	600261	阳光照明	1,038,810.00	10.87
26	603738	泰晶科技	1,037,215.79	10.85
27	601818	光大银行	1,021,436.00	10.69
28	600518	康美药业	1,009,127.00	10.56
29	600368	五洲交通	938,857.00	9.83
30	002483	润邦股份	928,035.00	9.71
31	603656	泰禾光电	898,873.00	9.41
32	300174	元力股份	892,727.00	9.34
33	601688	华泰证券	881,377.00	9.22
34	600180	瑞茂通	877,569.00	9.18
35	600995	文山电力	865,663.79	9.06
36	600050	中国联通	859,056.00	8.99
37	603369	今世缘	842,687.00	8.82
38	600345	长江通信	839,066.00	8.78
39	002296	辉煌科技	833,471.00	8.72
40	601006	大秦铁路	821,560.00	8.60
41	002247	聚力文化	818,171.00	8.56
42	600382	广东明珠	803,238.00	8.41
43	601857	中国石油	791,688.00	8.29
44	601628	中国人寿	791,570.00	8.28
45	601137	博威合金	789,644.00	8.26
46	000869	张裕A	787,303.00	8.24
47	601678	滨化股份	779,575.00	8.16
48	600919	江苏银行	776,705.00	8.13
49	601989	中国重工	769,134.00	8.05
50	601669	中国电建	741,650.00	7.76
51	600475	华光股份	735,413.00	7.70

52	002824	和胜股份	732,868.50	7.67
53	600999	招商证券	727,947.00	7.62
54	600785	新华百货	726,505.93	7.60
55	002565	顺灏股份	723,748.00	7.57
56	601186	中国铁建	717,588.00	7.51
57	601368	绿城水务	717,262.00	7.51
58	601088	中国神华	711,553.00	7.45
59	002160	常铝股份	702,867.37	7.36
60	002753	永东股份	697,547.00	7.30
61	300566	激智科技	693,382.00	7.26
62	300360	炬华科技	690,665.00	7.23
63	601900	南方传媒	689,094.00	7.21
64	300410	正业科技	681,088.00	7.13
65	600057	厦门象屿	673,723.00	7.05
66	002861	瀛通通讯	669,013.00	7.00
67	300625	三雄极光	668,914.00	7.00
68	601882	海天精工	667,811.00	6.99
69	000828	东莞控股	665,260.00	6.96
70	300184	力源信息	663,962.00	6.95
71	601336	新华保险	663,469.00	6.94
72	300150	世纪瑞尔	658,759.00	6.89
73	600340	华夏幸福	655,579.00	6.86
74	603985	恒润股份	653,283.30	6.84
75	600444	国机通用	651,292.00	6.82
76	600327	大东方	648,034.50	6.78
77	600012	皖通高速	647,431.89	6.78
78	300488	恒锋工具	646,223.00	6.76
79	601107	四川成渝	641,949.00	6.72
80	300371	汇中股份	628,971.00	6.58
81	600029	南方航空	625,828.99	6.55
82	300445	康斯特	623,365.00	6.52
83	300417	南华仪器	619,048.92	6.48
84	300669	沪宁股份	618,064.00	6.47
85	002645	华宏科技	617,672.00	6.46
86	002730	电光科技	614,782.22	6.43
87	000889	中嘉博创	614,524.00	6.43

88	300549	优德精密	613,020.00	6.42
89	300553	集智股份	612,934.00	6.41
90	603198	迎驾贡酒	611,979.00	6.40
91	603855	华荣股份	608,128.00	6.36
92	600216	浙江医药	600,895.00	6.29
93	600958	东方证券	598,722.00	6.27
94	300435	中泰股份	598,625.00	6.26
95	601168	西部矿业	598,148.78	6.26
96	002613	北玻股份	597,390.00	6.25
97	600843	上工申贝	596,130.00	6.24
98	600293	三峡新材	596,002.00	6.24
99	600726	华电能源	591,477.00	6.19
100	600420	现代制药	590,243.00	6.18
101	300416	苏试试验	589,738.00	6.17
102	603020	爱普股份	585,610.00	6.13
103	603611	诺力股份	582,230.00	6.09
104	603167	渤海轮渡	579,775.00	6.07
105	601390	中国中铁	578,805.00	6.06
106	000997	新大陆	569,379.00	5.96
107	603977	国泰集团	567,106.92	5.94
108	002487	大金重工	566,828.00	5.93
109	600668	尖峰集团	562,789.00	5.89
110	300269	联建光电	562,515.00	5.89
111	600052	浙江广厦	558,567.00	5.85
112	300210	森远股份	558,373.00	5.84
113	002595	豪迈科技	557,449.00	5.83
114	600322	天房发展	551,582.00	5.77
115	600376	首开股份	549,509.00	5.75
116	002852	道道全	548,184.00	5.74
117	600170	上海建工	545,906.00	5.71
118	000639	西王食品	543,993.60	5.69
119	600246	万通地产	543,281.00	5.69
120	600328	兰太实业	539,654.00	5.65
121	000822	山东海化	533,983.00	5.59
122	002187	广百股份	533,884.00	5.59
123	603663	三祥新材	533,221.00	5.58

124	300020	银江股份	520,601.00	5.45
125	600757	长江传媒	517,156.00	5.41
126	603918	金桥信息	510,069.00	5.34
127	600218	全柴动力	504,241.00	5.28
128	603798	康普顿	503,671.00	5.27
129	601985	中国核电	503,135.00	5.27
130	600793	宜宾纸业	501,171.00	5.24
131	600203	福日电子	497,339.00	5.20
132	603599	广信股份	495,475.00	5.19
133	300641	正丹股份	494,515.70	5.18
134	002763	汇洁股份	492,504.80	5.15
135	600980	北矿科技	491,531.00	5.14
136	000021	深科技	491,515.00	5.14
137	002295	精艺股份	487,895.00	5.11
138	300208	恒顺众昇	487,482.00	5.10
139	603416	信捷电气	485,469.00	5.08
140	300537	广信材料	479,976.00	5.02
141	002626	金达威	477,472.00	5.00
142	600020	中原高速	475,939.00	4.98
143	000883	湖北能源	475,707.00	4.98
144	603041	美思德	474,513.00	4.97
145	002081	金螳螂	470,646.00	4.93
146	600111	北方稀土	466,500.00	4.88
147	300387	富邦股份	463,632.00	4.85
148	002274	华昌化工	462,701.00	4.84
149	603822	嘉澳环保	461,845.00	4.83
150	600163	中闽能源	461,510.00	4.83
151	300194	福安药业	460,533.00	4.82
152	600056	中国医药	460,117.00	4.82
153	603360	百傲化学	459,658.11	4.81
154	300414	中光防雷	458,931.00	4.80
155	600982	宁波热电	458,705.00	4.80
156	600508	上海能源	457,328.00	4.79
157	600167	联美控股	454,045.00	4.75
158	002057	中钢天源	452,831.00	4.74
159	000519	中兵红箭	451,234.00	4.72

160	600551	时代出版	450,818.00	4.72
161	300121	阳谷华泰	450,311.00	4.71
162	603806	福斯特	444,585.60	4.65
163	300617	安靠智电	441,316.00	4.62
164	000899	赣能股份	439,991.00	4.60
165	601789	宁波建工	439,306.00	4.60
166	603025	大豪科技	437,244.00	4.58
167	300428	四通新材	435,574.00	4.56
168	300039	上海凯宝	432,704.00	4.53
169	300650	太龙照明	431,934.00	4.52
170	603900	莱绅通灵	431,629.00	4.52
171	002791	坚朗五金	430,062.00	4.50
172	000756	新华制药	429,578.00	4.50
173	600618	氯碱化工	428,448.00	4.48
174	002491	通鼎互联	428,395.00	4.48
175	600606	绿地控股	426,470.00	4.46
176	601515	东风股份	424,555.00	4.44
177	002275	桂林三金	421,103.00	4.41
178	002326	永太科技	420,365.00	4.40
179	300283	温州宏丰	417,366.00	4.37
180	002593	日上集团	416,020.99	4.35
181	603037	凯众股份	415,516.00	4.35
182	002582	好想你	412,751.00	4.32
183	300519	新光药业	412,513.00	4.32
184	300582	英飞特	410,630.00	4.30
185	300632	光莆股份	410,416.00	4.30
186	002099	海翔药业	410,010.00	4.29
187	603520	司太立	409,111.00	4.28
188	603116	红蜻蜓	406,835.00	4.26
189	601199	江南水务	405,191.00	4.24
190	600665	天地源	404,602.00	4.23
191	002820	桂发祥	404,472.00	4.23
192	002728	特一药业	403,552.00	4.22
193	603179	新泉股份	400,771.00	4.19
194	002587	奥拓电子	399,927.00	4.19
195	000715	中兴商业	395,525.00	4.14

196	603208	江山欧派	391,450.00	4.10
197	600387	海越能源	391,085.00	4.09
198	601579	会稽山	389,407.00	4.08
199	300081	恒信东方	389,291.00	4.07
200	603567	珍宝岛	387,772.00	4.06
201	600297	广汇汽车	382,949.00	4.01
202	603633	徕木股份	380,305.00	3.98
203	600075	新疆天业	379,670.00	3.97
204	300511	雪榕生物	378,724.00	3.96
205	603993	洛阳钼业	375,456.00	3.93
206	600073	上海梅林	372,826.00	3.90
207	600287	江苏舜天	372,556.00	3.90
208	300094	国联水产	371,962.00	3.89
209	300385	雪浪环境	371,314.03	3.89
210	300159	新研股份	370,117.00	3.87
211	000833	粤桂股份	367,089.59	3.84
212	300389	艾比森	360,868.00	3.78
213	600857	宁波中百	359,729.00	3.76
214	603728	鸣志电器	359,312.00	3.76
215	600704	物产中大	358,876.00	3.76
216	000785	武汉中商	355,499.00	3.72
217	002724	海洋王	355,056.00	3.72
218	300403	汉宇集团	354,590.00	3.71
219	600694	大商股份	352,409.00	3.69
220	002598	山东章鼓	352,127.98	3.69
221	600415	小商品城	348,392.00	3.65
222	000921	海信家电	348,325.00	3.65
223	600708	光明地产	347,166.00	3.63
224	000631	顺发恒业	347,015.00	3.63
225	002286	保龄宝	346,467.00	3.63
226	600363	联创光电	343,226.00	3.59
227	000733	振华科技	338,404.00	3.54
228	002855	捷荣技术	338,273.50	3.54
229	300438	鹏辉能源	336,034.00	3.52
230	000541	佛山照明	335,650.00	3.51
231	600093	易见股份	335,233.00	3.51

232	600879	航天电子	334,531.00	3.50
233	603518	维格娜丝	333,849.00	3.49
234	603608	天创时尚	333,695.00	3.49
235	300323	华灿光电	333,266.00	3.49
236	002119	康强电子	331,152.00	3.47
237	601633	长城汽车	328,270.00	3.44
238	603159	上海亚虹	328,153.00	3.43
239	601677	明泰铝业	324,071.00	3.39
240	300346	南大光电	323,326.00	3.38
241	600784	鲁银投资	319,706.00	3.35
242	300300	汉鼎宇佑	318,671.30	3.34
243	002793	东音股份	318,092.00	3.33
244	603203	快克股份	317,768.00	3.33
245	300260	新莱应材	317,222.00	3.32
246	601918	新集能源	316,893.00	3.32
247	300434	金石东方	316,071.00	3.31
248	000965	天保基建	314,599.00	3.29
249	603226	菲林格尔	314,188.30	3.29
250	600418	江淮汽车	313,619.00	3.28
251	600308	华泰股份	308,844.00	3.23
252	300605	恒锋信息	308,661.50	3.23
253	002150	通润装备	306,966.00	3.21
254	600835	上海机电	306,603.00	3.21
255	600547	山东黄金	304,788.00	3.19
256	300480	光力科技	304,590.00	3.19
257	601800	中国交建	303,988.00	3.18
258	002152	广电运通	303,600.50	3.18
259	603558	健盛集团	303,390.00	3.18
260	300279	和晶科技	302,598.00	3.17
261	600663	陆家嘴	301,692.00	3.16
262	600449	宁夏建材	301,275.00	3.15
263	601369	陕鼓动力	301,136.00	3.15
264	002532	新界泵业	300,577.00	3.15
265	603333	尚纬股份	298,272.00	3.12
266	600641	万业企业	297,964.00	3.12
267	600373	中文传媒	295,715.00	3.09

268	300499	高澜股份	292,885.00	3.07
269	600320	振华重工	292,320.00	3.06
270	600062	华润双鹤	292,300.00	3.06
271	002777	久远银海	291,176.00	3.05
272	002783	凯龙股份	290,704.00	3.04
273	600841	上柴股份	290,585.00	3.04
274	002698	博实股份	290,426.00	3.04
275	002380	科远股份	288,538.00	3.02
276	002435	长江润发	287,588.00	3.01
277	300042	朗科科技	286,422.00	3.00
278	600823	世茂股份	286,155.00	2.99
279	603090	宏盛股份	285,530.00	2.99
280	000402	金融街	285,396.58	2.99
281	600666	奥瑞德	284,530.00	2.98
282	000018	神州长城	284,381.00	2.98
283	300287	飞利信	283,588.50	2.97
284	300462	华铭智能	283,474.00	2.97
285	300468	四方精创	283,168.00	2.96
286	002649	博彦科技	283,115.00	2.96
287	300421	力星股份	282,557.00	2.96
288	300182	捷成股份	282,556.00	2.96
289	300415	伊之密	282,063.00	2.95
290	000046	泛海控股	282,028.00	2.95
291	600719	大连热电	281,453.00	2.95
292	600724	宁波富达	280,553.00	2.94
293	600577	精达股份	280,160.00	2.93
294	002771	真视通	279,749.00	2.93
295	603298	杭叉集团	279,694.00	2.93
296	600966	博汇纸业	279,155.00	2.92
297	000055	方大集团	277,899.00	2.91
298	000030	富奥股份	276,099.00	2.89
299	600850	华东电脑	274,458.00	2.87
300	300455	康拓红外	274,301.00	2.87
301	603508	思维列控	273,627.00	2.86
302	000880	潍柴重机	273,244.00	2.86
303	300472	新元科技	272,648.00	2.85

304	601188	龙江交通	272,527.00	2.85
305	300200	高盟新材	272,307.00	2.85
306	000617	中油资本	271,725.00	2.84
307	300440	运达科技	271,512.00	2.84
308	300290	荣科科技	270,983.00	2.84
309	002749	国光股份	269,266.00	2.82
310	002597	金禾实业	269,087.00	2.82
311	603429	集友股份	269,044.00	2.82
312	603016	新宏泰	268,621.00	2.81
313	600829	人民同泰	268,467.00	2.81
314	000034	神州数码	267,908.00	2.80
315	600791	京能置业	267,882.00	2.80
316	600683	京投发展	266,368.00	2.79
317	002534	杭锅股份	265,608.00	2.78
318	002686	亿利达	265,297.00	2.78
319	002514	宝馨科技	264,864.00	2.77
320	000570	苏常柴A	264,721.00	2.77
321	600820	隧道股份	264,442.00	2.77
322	002009	天奇股份	264,212.00	2.77
323	002267	陕天然气	263,640.00	2.76
324	601908	京运通	261,454.00	2.74
325	603001	奥康国际	260,599.00	2.73
326	600688	上海石化	260,176.00	2.72
327	300501	海顺新材	260,082.00	2.72
328	600210	紫江企业	259,822.00	2.72
329	603496	恒为科技	259,224.00	2.71
330	002002	鸿达兴业	257,475.00	2.69
331	600808	马钢股份	257,027.00	2.69
332	000606	顺利办	256,601.00	2.69
333	002014	永新股份	256,475.00	2.68
334	002766	索菱股份	255,903.00	2.68
335	600603	广汇物流	255,846.00	2.68
336	002608	江苏国信	255,771.00	2.68
337	000026	飞亚达A	254,535.00	2.66
338	600390	五矿资本	254,430.00	2.66
339	000065	北方国际	254,293.00	2.66

340	603399	吉翔股份	254,204.00	2.66
341	002615	哈尔斯	253,923.20	2.66
342	002186	全聚德	253,687.00	2.65
343	600379	宝光股份	252,723.00	2.64
344	600644	乐山电力	252,599.00	2.64
345	601618	中国中冶	252,048.00	2.64
346	002853	皮阿诺	251,573.00	2.63
347	000961	中南建设	251,471.00	2.63
348	002801	微光股份	250,617.00	2.62
349	600510	黑牡丹	250,346.00	2.62
350	000529	广弘控股	250,015.00	2.62
351	000887	中鼎股份	249,673.00	2.61
352	002067	景兴纸业	248,782.00	2.60
353	000553	沙隆达 A	248,665.00	2.60
354	600173	卧龙地产	248,548.00	2.60
355	300329	海伦钢琴	247,416.00	2.59
356	002061	浙江交科	246,988.00	2.58
357	300576	容大感光	246,895.00	2.58
358	002496	ST 辉	246,635.00	2.58
359	600897	厦门空港	246,398.00	2.58
360	300272	开能健康	246,276.00	2.58
361	002053	云南能投	245,456.00	2.57
362	603033	三维股份	245,130.00	2.57
363	600248	延长化建	244,568.00	2.56
364	600769	祥龙电业	244,393.00	2.56
365	000952	广济药业	243,733.00	2.55
366	002513	蓝丰生化	243,625.00	2.55
367	002748	世龙实业	243,436.00	2.55
368	300446	乐凯新材	243,369.00	2.55
369	300575	中旗股份	242,794.00	2.54
370	600781	辅仁药业	240,964.00	2.52
371	002085	万丰奥威	240,592.00	2.52
372	002128	露天煤业	239,606.00	2.51
373	603006	黎明股份	239,544.00	2.51
374	000859	国风塑业	239,534.00	2.51
375	300237	美晨生态	239,390.00	2.51

376	603615	茶花股份	238,536.00	2.50
377	002116	中国海诚	238,532.00	2.50
378	000702	正虹科技	238,195.00	2.49
379	600118	中国卫星	237,609.00	2.49
380	002734	利民股份	237,274.00	2.48
381	600477	杭萧钢构	235,763.00	2.47
382	603306	华懋科技	234,772.00	2.46
383	002482	广田集团	234,132.00	2.45
384	603601	再升科技	234,036.00	2.45
385	002239	奥特佳	233,838.00	2.45
386	603938	三孚股份	233,748.00	2.45
387	600035	楚天高速	233,743.00	2.45
388	600051	宁波联合	233,727.00	2.45
389	002838	道恩股份	233,683.00	2.45
390	000738	航发控制	233,596.00	2.44
391	002039	黔源电力	233,280.00	2.44
392	600664	哈药股份	232,940.00	2.44
393	600971	恒源煤电	232,777.00	2.44
394	002361	神剑股份	232,321.00	2.43
395	300459	金科文化	232,110.00	2.43
396	600143	金发科技	231,689.00	2.42
397	000415	渤海租赁	231,548.00	2.42
398	600023	浙能电力	231,267.00	2.42
399	002775	文科园林	231,229.00	2.42
400	600986	科达股份	230,961.00	2.42
401	300621	维业股份	230,452.00	2.41
402	000767	漳泽电力	229,567.00	2.40
403	600236	桂冠电力	228,793.00	2.39
404	600816	安信信托	228,407.00	2.39
405	601567	三星医疗	228,324.00	2.39
406	600282	南钢股份	228,221.00	2.39
407	603788	宁波高发	228,220.00	2.39
408	603015	弘讯科技	228,157.00	2.39
409	000598	兴蓉环境	227,988.00	2.39
410	600500	中化国际	227,871.00	2.38
411	600970	中材国际	227,407.00	2.38

412	002802	洪汇新材	227,259.00	2.38
413	002860	星帅尔	227,172.00	2.38
414	603906	龙蟠科技	226,678.00	2.37
415	603677	奇精机械	226,589.00	2.37
416	300447	全信股份	226,269.00	2.37
417	002549	凯美特气	226,061.00	2.37
418	300563	神宇股份	225,304.00	2.36
419	002462	嘉事堂	225,266.00	2.36
420	603987	康德莱	225,173.00	2.36
421	601158	重庆水务	225,115.00	2.36
422	600854	春兰股份	224,880.00	2.35
423	300286	安科瑞	223,545.00	2.34
424	601101	昊华能源	223,103.00	2.33
425	002118	紫鑫药业	222,700.00	2.33
426	600178	东安动力	222,613.00	2.33
427	603113	金能科技	222,395.00	2.33
428	600888	新疆众和	222,376.00	2.33
429	603766	隆鑫通用	221,993.00	2.32
430	600350	山东高速	221,752.00	2.32
431	603926	铁流股份	221,654.00	2.32
432	002531	天顺风能	221,348.00	2.32
433	603388	元成股份	221,316.00	2.32
434	002533	金杯电工	220,991.00	2.31
435	600422	昆药集团	220,884.00	2.31
436	000040	东旭蓝天	220,823.00	2.31
437	300376	易事特	220,772.00	2.31
438	603997	继峰股份	220,613.00	2.31
439	002669	康达新材	220,402.00	2.31
440	002711	欧浦智网	220,301.00	2.31
441	603100	川仪股份	220,249.00	2.31
442	603300	华铁科技	220,104.00	2.30
443	300423	鲁亿通	219,970.00	2.30
444	300118	东方日升	219,350.00	2.30
445	002603	以岭药业	218,874.00	2.29
446	600323	瀚蓝环境	218,794.00	2.29
447	002600	领益智造	218,736.00	2.29

448	603585	苏利股份	218,707.00	2.29
449	002788	鹭燕医药	218,436.00	2.29
450	300082	奥克股份	218,244.00	2.28
451	002381	双箭股份	217,687.00	2.28
452	000096	广聚能源	217,582.00	2.28
453	300611	美力科技	216,900.00	2.27
454	603980	吉华集团	216,542.00	2.27
455	603239	浙江仙通	216,520.00	2.27
456	300497	富祥股份	216,449.00	2.27
457	000999	华润三九	215,333.00	2.25
458	000525	红太阳	214,465.00	2.24
459	000900	现代投资	214,363.00	2.24
460	002840	华统股份	214,361.00	2.24
461	002518	科士达	214,324.00	2.24
462	002470	金正大	214,281.00	2.24
463	300190	维尔利	214,140.00	2.24
464	002171	楚江新材	214,139.00	2.24
465	000928	中钢国际	214,120.00	2.24
466	002868	绿康生化	211,795.00	2.22
467	600505	西昌电力	210,765.00	2.21
468	000603	盛达矿业	210,755.00	2.21
469	000601	韶能股份	210,635.00	2.20
470	300535	达威股份	209,912.00	2.20
471	000836	富通鑫茂	209,705.00	2.19
472	600713	南京医药	209,618.00	2.19
473	002540	亚太科技	209,415.00	2.19
474	600168	武汉控股	208,771.00	2.18
475	300138	晨光生物	208,642.00	2.18
476	002100	天康生物	208,343.00	2.18
477	600706	曲江文旅	207,628.00	2.17
478	002062	宏润建设	206,850.00	2.16
479	600381	青海春天	205,968.00	2.16
480	300640	德艺文创	204,041.00	2.14
481	600226	瀚叶股份	203,790.00	2.13
482	603919	金徽酒	203,713.00	2.13
483	300453	三鑫医疗	203,468.00	2.13

484	600491	龙元建设	203,302.00	2.13
485	002732	燕塘乳业	202,476.00	2.12
486	603811	诚意药业	202,423.00	2.12
487	002166	莱茵生物	202,270.00	2.12
488	002566	益盛药业	202,086.00	2.11
489	000885	城发环境	200,242.00	2.10
490	603309	维力医疗	200,239.00	2.10
491	600351	亚宝药业	199,972.00	2.09
492	002589	瑞康医药	199,837.00	2.09
493	300233	金城医药	199,742.00	2.09
494	603589	口子窖	199,567.00	2.09
495	601952	苏垦农发	199,217.00	2.08
496	603609	禾丰牧业	199,103.00	2.08
497	300636	同和药业	198,975.00	2.08
498	300243	瑞丰高材	197,914.00	2.07
499	601229	上海银行	197,452.00	2.07
500	300560	中富通	197,027.00	2.06
501	600830	香溢融通	196,653.00	2.06
502	002017	东信和平	196,523.00	2.06
503	600126	杭钢股份	195,943.00	2.05
504	000848	承德露露	195,592.00	2.05
505	002107	沃华医药	194,948.00	2.04
506	002872	天圣制药	194,707.00	2.04
507	000657	中钨高新	192,296.00	2.01
508	000524	岭南控股	191,897.00	2.01

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	9,698,983.00	101.50
2	600519	贵州茅台	5,663,554.50	59.27
3	600036	招商银行	4,109,307.00	43.01
4	600887	伊利股份	2,645,414.00	27.69
5	600016	民生银行	2,556,653.40	26.76
6	601328	交通银行	2,395,840.00	25.07

7	601288	农业银行	2,032,106.00	21.27
8	600030	中信证券	1,978,258.00	20.70
9	600104	上汽集团	1,836,537.00	19.22
10	601398	工商银行	1,761,948.00	18.44
11	600000	浦发银行	1,722,582.63	18.03
12	601668	中国建筑	1,654,502.40	17.32
13	601601	中国太保	1,562,999.00	16.36
14	300219	鸿利智汇	1,334,488.00	13.97
15	601169	北京银行	1,299,762.00	13.60
16	601988	中国银行	1,269,962.00	13.29
17	601801	皖新传媒	1,234,993.00	12.92
18	600048	保利地产	1,191,817.00	12.47
19	600837	海通证券	1,139,562.00	11.93
20	600261	阳光照明	1,060,217.00	11.10
21	601211	国泰君安	1,032,071.00	10.80
22	600019	宝钢股份	1,024,243.00	10.72
23	600028	中国石化	1,023,826.00	10.71
24	600518	康美药业	1,010,831.00	10.58
25	600602	云赛智联	991,953.00	10.38
26	603656	泰禾光电	929,143.60	9.72
27	600368	五洲交通	922,298.00	9.65
28	603738	泰晶科技	921,691.46	9.65
29	002483	润邦股份	908,940.00	9.51
30	300174	元力股份	892,630.00	9.34
31	601818	光大银行	870,651.00	9.11
32	600180	瑞茂通	866,714.00	9.07
33	002296	辉煌科技	848,888.00	8.88
34	601766	中国中车	841,175.00	8.80
35	600995	文山电力	839,665.00	8.79
36	600345	长江通信	836,936.00	8.76
37	603369	今世缘	822,361.00	8.61
38	601137	博威合金	816,759.00	8.55
39	600382	广东明珠	801,306.00	8.39
40	000869	张裕A	769,246.00	8.05
41	601006	大秦铁路	765,456.00	8.01
42	601857	中国石油	742,229.00	7.77
43	601678	滨化股份	727,496.00	7.61
44	601688	华泰证券	717,758.00	7.51

45	300360	炬华科技	716,526.00	7.50
46	300625	三雄极光	698,341.00	7.31
47	300410	正业科技	694,716.00	7.27
48	002160	常铝股份	687,999.00	7.20
49	601628	中国人寿	683,520.00	7.15
50	600012	皖通高速	678,571.00	7.10
51	002730	电光科技	672,890.00	7.04
52	600050	中国联通	671,533.00	7.03
53	002861	瀛通通讯	662,082.00	6.93
54	600919	江苏银行	658,734.00	6.89
55	000828	东莞控股	656,220.00	6.87
56	603985	恒润股份	651,982.70	6.82
57	601107	四川成渝	647,375.00	6.78
58	600327	大东方	641,743.00	6.72
59	300549	优德精密	640,718.00	6.71
60	300184	力源信息	637,063.00	6.67
61	300669	沪宁股份	635,222.06	6.65
62	300488	恒锋工具	630,983.00	6.60
63	300435	中泰股份	619,232.00	6.48
64	300371	汇中股份	618,500.00	6.47
65	002487	大金重工	610,143.00	6.39
66	300416	苏试试验	608,723.00	6.37
67	601669	中国电建	607,796.00	6.36
68	601168	西部矿业	604,870.00	6.33
69	600668	尖峰集团	604,526.00	6.33
70	600726	华电能源	602,125.00	6.30
71	300210	森远股份	601,520.00	6.30
72	601088	中国神华	593,859.00	6.21
73	600999	招商证券	586,953.00	6.14
74	002295	精艺股份	583,171.00	6.10
75	601390	中国中铁	582,860.00	6.10
76	300269	联建光电	581,866.00	6.09
77	601186	中国铁建	581,711.00	6.09
78	603259	药明康德	578,473.41	6.05
79	603855	华荣股份	576,749.00	6.04
80	600420	现代制药	576,163.00	6.03
81	603167	渤海轮渡	575,714.00	6.03
82	600328	兰太实业	571,795.00	5.98

83	603198	迎驾贡酒	571,774.00	5.98
84	603611	诺力股份	570,629.00	5.97
85	600444	国机通用	569,659.00	5.96
86	601336	新华保险	565,386.00	5.92
87	603663	三祥新材	560,499.00	5.87
88	601989	中国重工	559,976.00	5.86
89	002595	豪迈科技	550,861.00	5.77
90	603977	国泰集团	550,440.26	5.76
91	000997	新大陆	550,219.00	5.76
92	600376	首开股份	549,462.00	5.75
93	600785	新华百货	548,981.02	5.75
94	002613	北玻股份	548,679.00	5.74
95	600216	浙江医药	546,242.58	5.72
96	600170	上海建工	541,369.00	5.67
97	600843	上工申贝	539,763.00	5.65
98	300020	银江股份	536,080.00	5.61
99	600218	全柴动力	535,549.00	5.60
100	600246	万通地产	532,377.95	5.57
101	600757	长江传媒	532,148.00	5.57
102	000822	山东海化	531,759.00	5.57
103	002187	广百股份	529,660.00	5.54
104	002247	聚力文化	528,298.00	5.53
105	300283	温州宏丰	523,188.00	5.48
106	002852	道道全	514,530.00	5.38
107	600793	宜宾纸业	487,833.00	5.11
108	600203	福日电子	482,215.00	5.05
109	000021	深科技	476,205.00	4.98
110	300428	四通新材	474,761.00	4.97
111	600020	中原高速	473,631.00	4.96
112	601789	宁波建工	471,115.00	4.93
113	603599	广信股份	470,585.00	4.92
114	601368	绿城水务	465,262.00	4.87
115	000883	湖北能源	464,710.00	4.86
116	300537	广信材料	464,476.80	4.86
117	600508	上海能源	463,606.00	4.85
118	600475	华光股份	463,206.00	4.85
119	002565	顺灏股份	461,788.00	4.83
120	600551	时代出版	461,203.00	4.83

121	002081	金 螳 螂	461,162.00	4.83
122	300387	富邦股份	460,255.00	4.82
123	600982	宁波热电	459,144.00	4.81
124	300414	中光防雷	458,150.00	4.79
125	000519	中兵红箭	456,293.00	4.78
126	600340	华夏幸福	454,497.00	4.76
127	603360	百傲化学	452,865.26	4.74
128	603806	福斯特	449,164.00	4.70
129	300208	恒顺众昇	448,927.00	4.70
130	300121	阳谷华泰	446,768.00	4.68
131	600029	南方航空	446,226.00	4.67
132	300617	安靠智电	445,420.00	4.66
133	002274	华昌化工	442,192.00	4.63
134	600056	中国医药	441,206.00	4.62
135	002626	金 达 威	438,735.00	4.59
136	600057	厦门象屿	435,043.00	4.55
137	002326	永太科技	434,679.00	4.55
138	002824	和胜股份	434,108.00	4.54
139	600297	广汇汽车	432,013.00	4.52
140	002753	永东股份	428,579.00	4.49
141	002057	中钢天源	426,695.00	4.47
142	000899	赣能股份	423,661.00	4.43
143	600167	联美控股	423,216.00	4.43
144	600618	氯碱化工	419,879.00	4.39
145	300519	新光药业	419,295.00	4.39
146	002275	桂林三金	417,488.60	4.37
147	603798	康普顿	415,844.00	4.35
148	603025	大豪科技	413,031.00	4.32
149	002728	特一药业	412,903.00	4.32
150	603822	嘉澳环保	412,454.00	4.32
151	600958	东方证券	410,919.00	4.30
152	601900	南方传媒	410,494.00	4.30
153	002593	日上集团	407,580.00	4.27
154	600665	天地源	405,722.00	4.25
155	603520	司太立	404,919.00	4.24
156	000889	中嘉博创	403,546.00	4.22
157	002099	海翔药业	401,547.00	4.20
158	603900	莱绅通灵	401,039.00	4.20

159	603037	凯众股份	400,700.00	4.19
160	601985	中国核电	397,449.00	4.16
161	300039	上海凯宝	396,335.00	4.15
162	601515	东风股份	394,134.00	4.12
163	300582	英飞特	392,762.00	4.11
164	600387	海越能源	392,471.00	4.11
165	600073	上海梅林	392,316.00	4.11
166	603116	红蜻蜓	392,184.00	4.10
167	002582	好想你	389,998.00	4.08
168	603179	新泉股份	389,546.00	4.08
169	603567	珍宝岛	388,665.00	4.07
170	300632	光莆股份	388,562.00	4.07
171	600075	新疆天业	388,120.00	4.06
172	600293	三峡新材	385,748.00	4.04
173	603020	爱普股份	383,374.00	4.01
174	002491	通鼎互联	381,764.00	4.00
175	300511	雪榕生物	379,642.00	3.97
176	603633	徕木股份	378,004.80	3.96
177	300553	集智股份	377,424.00	3.95
178	600111	北方稀土	376,728.00	3.94
179	002598	山东章鼓	374,083.00	3.91
180	300150	世纪瑞尔	373,510.00	3.91
181	600287	江苏舜天	372,387.00	3.90
182	000639	西王食品	367,907.20	3.85
183	603208	江山欧派	367,202.00	3.84
184	300260	新莱应材	366,759.00	3.84
185	600857	宁波中百	362,163.00	3.79
186	300159	新研股份	360,622.00	3.77
187	002587	奥拓电子	359,618.00	3.76
188	300081	恒信东方	358,064.00	3.75
189	300417	南华仪器	357,483.95	3.74
190	000733	振华科技	357,184.00	3.74
191	000921	海信家电	354,268.00	3.71
192	600415	小商品城	352,292.00	3.69
193	000785	武汉中商	351,435.00	3.68
194	603728	鸣志电器	350,714.00	3.67
195	300385	雪浪环境	350,594.12	3.67
196	600363	联创光电	349,975.00	3.66

197	600704	物产中大	348,687.00	3.65
198	600606	绿地控股	347,552.00	3.64
199	300389	艾比森	342,785.00	3.59
200	002119	康强电子	341,085.00	3.57
201	603608	天创时尚	339,892.00	3.56
202	601677	明泰铝业	338,105.00	3.54
203	603203	快克股份	336,523.65	3.52
204	300566	激智科技	334,883.00	3.50
205	603558	健盛集团	334,822.00	3.50
206	002286	保龄宝	333,466.00	3.49
207	002152	广电运通	332,040.00	3.47
208	000541	佛山照明	331,040.00	3.46
209	002532	新界泵业	330,295.00	3.46
210	600093	易见股份	329,918.00	3.45
211	002855	捷荣技术	329,902.90	3.45
212	300323	华灿光电	326,986.00	3.42
213	002763	汇洁股份	324,897.20	3.40
214	000631	顺发恒业	323,771.00	3.39
215	603159	上海亚虹	323,715.00	3.39
216	601918	新集能源	323,190.00	3.38
217	600879	航天电子	321,974.00	3.37
218	000606	顺利办	319,347.00	3.34
219	300480	光力科技	319,329.00	3.34
220	300300	汉鼎宇佑	318,384.00	3.33
221	600784	鲁银投资	316,288.00	3.31
222	603518	维格娜丝	315,205.00	3.30
223	600663	陆家嘴	314,411.20	3.29
224	601633	长城汽车	313,268.00	3.28
225	002067	景兴纸业	311,793.00	3.26
226	002793	东音股份	311,665.00	3.26
227	600694	大商股份	310,948.00	3.25
228	600850	华东电脑	309,707.00	3.24
229	300434	金石东方	307,802.00	3.22
230	002783	凯龙股份	306,969.00	3.21
231	600835	上海机电	305,553.40	3.20
232	603226	菲林格尔	305,397.20	3.20
233	300445	康斯特	304,488.00	3.19
234	601882	海天精工	304,249.00	3.18

235	600418	江淮汽车	302,972.00	3.17
236	000965	天保基建	302,307.00	3.16
237	600320	振华重工	301,020.00	3.15
238	300438	鹏辉能源	300,093.00	3.14
239	002698	博实股份	298,877.00	3.13
240	600308	华泰股份	298,123.00	3.12
241	002150	通润装备	297,823.00	3.12
242	600449	宁夏建材	297,588.63	3.11
243	603496	恒为科技	297,097.00	3.11
244	300042	朗科科技	294,805.00	3.09
245	600666	奥瑞德	294,469.00	3.08
246	600322	天房发展	292,621.00	3.06
247	002649	博彦科技	292,566.00	3.06
248	002777	久远银海	292,237.00	3.06
249	300287	飞利信	291,333.00	3.05
250	601369	陕鼓动力	289,756.00	3.03
251	600724	宁波富达	287,574.00	3.01
252	300499	高澜股份	287,183.00	3.01
253	603298	杭叉集团	286,596.00	3.00
254	600641	万业企业	285,640.00	2.99
255	600577	精达股份	285,624.00	2.99
256	002549	凯美特气	285,531.00	2.99
257	600603	广汇物流	285,502.00	2.99
258	002791	坚朗五金	284,731.00	2.98
259	300415	伊之密	282,920.00	2.96
260	600823	世茂股份	282,870.00	2.96
261	300462	华铭智能	282,524.00	2.96
262	300279	和晶科技	282,516.00	2.96
263	600052	浙江广厦	282,217.00	2.95
264	002435	长江润发	280,084.00	2.93
265	300468	四方精创	280,072.00	2.93
266	000055	方大集团	278,274.00	2.91
267	600062	华润双鹤	277,914.80	2.91
268	000026	飞亚达 A	277,001.00	2.90
269	603508	思维列控	276,835.00	2.90
270	000570	苏常柴 A	276,824.00	2.90
271	000046	泛海控股	275,141.00	2.88
272	600547	山东黄金	274,979.00	2.88

273	300641	正丹股份	274,680.00	2.87
274	600719	大连热电	273,940.00	2.87
275	300472	新元科技	273,661.00	2.86
276	600708	光明地产	272,995.00	2.86
277	300421	力星股份	272,978.00	2.86
278	300455	康拓红外	271,228.00	2.84
279	600808	马钢股份	269,564.00	2.82
280	600683	京投发展	267,851.00	2.80
281	601188	龙江交通	266,877.00	2.79
282	300290	荣科科技	266,627.00	2.79
283	300200	高盟新材	266,395.00	2.79
284	002514	宝馨科技	265,985.00	2.78
285	002853	皮阿诺	265,340.00	2.78
286	300182	捷成股份	264,130.00	2.76
287	002009	天奇股份	263,570.00	2.76
288	600688	上海石化	263,344.00	2.76
289	000880	潍柴重机	263,099.00	2.75
290	000961	中南建设	262,148.00	2.74
291	603001	奥康国际	261,205.00	2.73
292	002380	科远股份	261,145.00	2.73
293	600820	隧道股份	260,684.00	2.73
294	000034	神州数码	260,300.00	2.72
295	000617	中油资本	260,148.00	2.72
296	600210	紫江企业	260,024.00	2.72
297	000859	国风塑业	259,499.00	2.72
298	000402	金融街	258,094.00	2.70
299	603333	尚纬股份	257,710.00	2.70
300	002186	全聚德	257,677.00	2.70
301	600379	宝光股份	257,290.00	2.69
302	600966	博汇纸业	257,274.00	2.69
303	000065	北方国际	257,254.00	2.69
304	002749	国光股份	256,476.70	2.68
305	601800	中国交建	255,910.00	2.68
306	002645	华宏科技	255,066.00	2.67
307	000415	渤海租赁	254,614.00	2.66
308	600841	上柴股份	254,422.00	2.66
309	600373	中文传媒	253,496.00	2.65
310	002534	杭锅股份	253,184.00	2.65

311	000529	广弘控股	252,962.00	2.65
312	603399	吉翔股份	252,388.00	2.64
313	002686	亿利达	252,214.00	2.64
314	002597	金禾实业	251,259.00	2.63
315	002014	永新股份	250,716.00	2.62
316	603416	信捷电气	250,590.00	2.62
317	002860	星帅尔	250,345.00	2.62
318	600051	宁波联合	249,823.00	2.61
319	600173	卧龙地产	249,700.00	2.61
320	603918	金桥信息	249,561.00	2.61
321	600510	黑牡丹	249,368.00	2.61
322	300576	容大感光	249,196.00	2.61
323	002615	哈尔斯	248,616.80	2.60
324	002053	云南能投	247,403.00	2.59
325	600986	科达股份	247,210.20	2.59
326	002482	广田集团	247,130.00	2.59
327	000833	粤桂股份	246,387.00	2.58
328	300621	维业股份	246,218.00	2.58
329	601908	京运通	246,017.00	2.57
330	601618	中国中冶	244,968.00	2.56
331	002801	微光股份	243,839.00	2.55
332	300346	南大光电	243,757.00	2.55
333	603015	弘讯科技	243,445.00	2.55
334	000952	广济药业	243,231.00	2.55
335	300329	海伦钢琴	241,329.00	2.53
336	002267	陕天然气	240,700.00	2.52
337	300446	乐凯新材	239,219.00	2.50
338	603677	奇精机械	239,170.00	2.50
339	600897	厦门空港	239,072.64	2.50
340	600350	山东高速	239,011.00	2.50
341	603993	洛阳钼业	238,818.00	2.50
342	002118	紫鑫药业	238,808.00	2.50
343	600491	龙元建设	238,492.00	2.50
344	000738	航发控制	238,370.00	2.49
345	600477	杭萧钢构	238,194.00	2.49
346	002513	蓝丰生化	237,964.00	2.49
347	002838	道恩股份	237,790.30	2.49
348	600163	中闽能源	237,232.00	2.48

349	300403	汉宇集团	236,820.00	2.48
350	300272	开能健康	235,696.00	2.47
351	601101	昊华能源	235,427.00	2.46
352	600390	五矿资本	235,216.00	2.46
353	600980	北矿科技	235,055.00	2.46
354	300440	运达科技	235,040.00	2.46
355	600816	安信信托	234,884.00	2.46
356	002802	洪汇新材	234,520.00	2.45
357	002748	世龙实业	233,677.00	2.45
358	002085	万丰奥威	233,311.00	2.44
359	600023	浙能电力	232,786.00	2.44
360	603601	再升科技	232,651.00	2.43
361	000030	富奥股份	232,618.00	2.43
362	600323	瀚蓝环境	232,430.00	2.43
363	300082	奥克股份	231,890.00	2.43
364	603016	新宏泰	230,732.00	2.41
365	002039	黔源电力	230,272.00	2.41
366	600500	中化国际	230,014.00	2.41
367	600664	哈药股份	229,400.00	2.40
368	300575	中旗股份	229,269.00	2.40
369	002361	神剑股份	229,026.00	2.40
370	002775	文科园林	228,950.00	2.40
371	603938	三孚股份	228,904.00	2.40
372	300459	金科文化	228,837.00	2.39
373	603906	龙蟠科技	228,621.00	2.39
374	002669	康达新材	228,532.00	2.39
375	600970	中材国际	228,117.00	2.39
376	000598	兴蓉环境	228,080.00	2.39
377	600282	南钢股份	227,706.00	2.38
378	603041	美思德	227,026.00	2.38
379	002766	索菱股份	226,972.00	2.38
380	603239	浙江仙通	226,724.00	2.37
381	002128	露天煤业	226,571.00	2.37
382	300286	安科瑞	226,555.00	2.37
383	603766	隆鑫通用	226,500.00	2.37
384	300243	瑞丰高材	226,350.00	2.37
385	300118	东方日升	226,320.00	2.37
386	000767	漳泽电力	226,305.00	2.37

387	002002	鸿达兴业	225,291.00	2.36
388	600422	昆药集团	225,264.00	2.36
389	601158	重庆水务	225,065.00	2.36
390	002061	浙江交科	224,160.00	2.35
391	600118	中国卫星	224,100.00	2.35
392	002381	双箭股份	223,872.00	2.34
393	603987	康德莱	222,362.00	2.33
394	002462	嘉事堂	222,109.00	2.32
395	600971	恒源煤电	221,536.00	2.32
396	002166	莱茵生物	221,518.00	2.32
397	300376	易事特	221,182.00	2.31
398	000040	东旭蓝天	220,396.00	2.31
399	000702	正虹科技	220,183.00	2.30
400	000603	盛达矿业	219,882.00	2.30
401	603113	金能科技	219,822.00	2.30
402	002540	亚太科技	219,536.00	2.30
403	603980	吉华集团	219,483.00	2.30
404	600236	桂冠电力	219,336.00	2.30
405	600706	曲江文旅	219,235.00	2.29
406	002107	沃华医药	219,166.72	2.29
407	603585	苏利股份	219,013.00	2.29
408	603609	禾丰牧业	218,852.00	2.29
409	603388	元成股份	218,453.00	2.29
410	000928	中钢国际	218,089.00	2.28
411	000018	神州长城	217,676.00	2.28
412	300237	美晨生态	217,598.00	2.28
413	300563	神宇股份	215,775.00	2.26
414	300611	美力科技	215,201.00	2.25
415	000999	华润三九	215,165.00	2.25
416	600888	新疆众和	214,207.00	2.24
417	603926	铁流股份	213,893.88	2.24
418	002062	宏润建设	213,309.00	2.23
419	002600	领益智造	213,272.00	2.23
420	300447	全信股份	213,229.00	2.23
421	002533	金杯电工	212,910.00	2.23
422	300560	中富通	212,825.00	2.23
423	002531	天顺风能	212,650.00	2.23
424	603309	维力医疗	212,406.00	2.22

425	000553	沙隆达 A	212,319.00	2.22
426	000715	中兴商业	211,931.00	2.22
427	000887	中鼎股份	211,400.00	2.21
428	000900	现代投资	211,074.00	2.21
429	002603	以岭药业	210,871.00	2.21
430	002496	ST 辉	210,490.00	2.20
431	300194	福安药业	210,164.00	2.20
432	600644	乐山电力	209,290.00	2.19
433	000836	富通鑫茂	208,804.00	2.19
434	300190	维尔利	208,361.00	2.18
435	603997	继峰股份	208,354.98	2.18
436	002100	天康生物	207,727.00	2.17
437	000525	红太阳	207,695.00	2.17
438	600713	南京医药	207,674.00	2.17
439	300603	立昂技术	207,673.00	2.17
440	600168	武汉控股	207,564.00	2.17
441	000550	江铃汽车	207,045.00	2.17
442	603788	宁波高发	206,117.00	2.16
443	300353	东土科技	205,862.00	2.15
444	300636	同和药业	205,743.00	2.15
445	600143	金发科技	205,575.88	2.15
446	300138	晨光生物	205,335.00	2.15
447	600381	青海春天	205,087.00	2.15
448	002566	益盛药业	204,829.00	2.14
449	300453	三鑫医疗	203,753.00	2.13
450	603886	元祖股份	203,503.00	2.13
451	300535	达威股份	203,294.00	2.13
452	002868	绿康生化	202,564.00	2.12
453	601579	会稽山	202,234.00	2.12
454	002518	科士达	201,800.00	2.11
455	002820	桂发祥	201,544.00	2.11
456	000601	韶能股份	201,290.00	2.11
457	300310	宜通世纪	201,165.00	2.11
458	300497	富祥股份	200,464.00	2.10
459	603919	金徽酒	199,085.00	2.08
460	300640	德艺文创	198,905.00	2.08
461	600351	亚宝药业	198,502.00	2.08
462	002470	金正大	197,852.00	2.07

463	000657	中钨高新	197,687.00	2.07
464	300233	金城医药	197,299.00	2.06
465	601229	上海银行	197,228.00	2.06
466	300571	平治信息	196,673.00	2.06
467	002171	楚江新材	196,177.00	2.05
468	600197	伊力特	195,535.00	2.05
469	002017	东信和平	194,415.00	2.03
470	600126	杭钢股份	193,770.00	2.03
471	002840	华统股份	193,605.00	2.03
472	601952	苏垦农发	193,295.00	2.02
473	603589	口子窖	192,984.00	2.02
474	002239	奥特佳	192,960.00	2.02
475	603099	长白山	192,956.00	2.02
476	300098	高新兴	192,824.00	2.02
477	002872	天圣制药	192,772.00	2.02
478	000032	深桑达 A	192,488.00	2.01
479	000848	承德露露	192,203.00	2.01
480	600513	联环药业	191,632.20	2.01

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	263,040,450.07
卖出股票收入（成交）总额	234,260,538.93

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投资。

#### 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投资。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	报告期内，本基金运用股指期货是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，总体风险可控且符合既定的投资政策和投资目标。
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					39,661.75
股指期货投资本期公允价值变动（元）					0.00

注：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

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 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，没有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。

### 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	40,652.54
2	应收证券清算款	5,095,004.41
4	应收利息	2,481.38
9	合计	5,138,138.33

### 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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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
204	141,335.72	28,749,745.46	99.71%	82,740.86	0.29%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	10,111.05	0.0351%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（ 2017 年 9 月 13 日 ）基金份额总额	200,170,888.02
本报告期期初基金份额总额	9,270,534.99
本报告期期间基金总申购份额	148,704,219.64
减:本报告期期间基金总赎回份额	129,142,268.31
本报告期期末基金份额总额	28,832,486.32

## § 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，基金管理人于 2018 年 12 月 15 日发布公告，聘任韩东霞女士为公司副总经理。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无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

本报告期内，本基金投资策略未发生重大改变。

### 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	242,834,740.42	48.88%	177,583.28	48.88%	-
东方证券	1	187,998,587.84	37.84%	137,485.38	37.84%	-
华创证券	1	65,982,270.55	13.28%	48,253.37	13.28%	-

注：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》（证监基金字[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。

### 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
银河证券	-	-	111,700,000.00	92.54%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	9,000,000.00	7.46%	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年1月1日至2018年2月26日；2018年4月1日至2018年12月31日	8,741,136.47	27,874,930.31	8,741,136.47	27,874,930.31	96.68%
	2	2018年3月6日至2018年8月1日	0.00	74,334,696.15	73,459,881.00	874,815.15	3.03%
	3	2018年3月6日至2018年3月13日	0.00	46,458,836.65	46,458,836.65	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过 20%的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。</p>							

注：申购份额包含红利再投资。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

国金基金管理有限公司

2019 年 3 月 30 日