

国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金 招募说明书（更新）摘要

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

重要提示

本基金募集申请已于 2015 年 10 月 30 日获中国证监会证监许可 2437 号文注册。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等做出实质性判断或者保证。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等等。

本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金投资范围中包含中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券，由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险，当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资者在认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 3 月 13 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2018 年 12 月 31 日。

一、基金管理人

一、基金管理人概况

名称：国金基金管理有限公司

成立日期：2011年11月2日

注册地址：北京市怀柔区府前街三号楼3-6

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

法定代表人：尹庆军

组织形式：有限责任公司

联系电话：010-88005888

注册资本：3.6亿元人民币

股权结构：

国金基金管理有限公司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，四家企业共同出资3.6亿元人民币，出资比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。

二、主要人员情况

（一）董事会成员

纪路先生，董事长，硕士EMBA。历任博时基金管理有限公司研究员、金信证券有限责任公司投资研究中心总经理、国金证券股份有限公司研究所总经理。现任国金证券股份有限公司副总经理，国金基金管理有限公司董事长，国金证券（香港）有限公司董事，国金财务（香港）有限公司董事，国金证券上海投资咨询分公司总经理，上海国金理益财富基金销售有限公司执行董事。

金鹏先生，董事，研究生学历。历任涌金期货经纪有限公司总经理助理，上海涌金理财顾问有限公司副总经理，河北财金投资有限公司总经理，涌金实业（集团）有限公司副总裁，国金证券有限责任公司风险控制中心总经理，国金证券股份有限公司董事、副总经理、监事、监事会主席，国金期货有限责任公司董事长。现任国金证券股份有限公司董事、总经理，国金创新投资有限公司董事长，国金期货有限责任公司董事，国金基金管理有限公司董事，国金证券（香港）有限公司董事。

许强先生，董事，硕士。历任苏州商品交易所交易部、交割部、信息部总经理，中国华通物产集团经易期货经纪有限公司副总裁，苏州工业园区国有资产经营公司投资银行部总经理，苏州工业园区地产经营管理公司投资部总经理。现任苏州工业园区资产管理有限公司董事长、国金基金管理有限公司董事。

宁远喜先生，董事，硕士。历任三九集团工程有限公司办公室主任，深圳伯龙建筑工程有限公司总经理助理，广东宝丽华集团有限公司广告部经理，广东宝丽华实业股份有限公司董事会秘书。现任广东宝丽华新能源股份有限公司董事长，广东宝新资产管理有限公司执行董事，宝新融资租赁有限公司执行董事，广东信用宝征信管理有限公司执行董事，梅州客商银行股份有限公司董事长，百合佳缘网络集团股份有限公司副董事长，国金基金管理有限公司董事，深圳微金所金融信息服务有限公司董事，宝合金服投资管理股份有限公司董事。

赵煜先生，董事，学士。历任北京台都汽车安全设备有限公司销售经理，北京顶峰贸易公司销售经理，上海浦东中软科技发展有限公司副总经理。现任涌金实业（集团）有限公司董事长助理，国金基金管理有限公司董事。

尹庆军先生，董事，硕士。历任中央编译局世界所助理研究员、办公厅科研外事秘书，中央编译出版社出版部主任，博时基金管理有限公司人力资源部总经理、董事会秘书、监事，国金基金管理有限公司（筹）拟任督察长，国金基金管理有限公司督察长。现任国金基金管理有限公司董事、总经理，北京千石创富资本管理有限公司董事长。

张克东先生，独立董事，学士，注册会计师。历任煤炭工业部技术发展司、煤炭科学研究总院科员、主任科员，中国国际经济咨询公司、中信会计师事务所咨询员、项目经理，中信会计师事务所副主任，中天信会计师事务所副主任。现任信永中和会计师事务所副总经理、合伙人，国金基金管理有限公司独立董事。

鲍卉芳女士，独立董事，硕士。历任湖北省郟阳地区法律顾问处律师，最高人民检察院法纪厅书记员，北京市中银律师事务所律师，北京市博宇律师事务所律师，北京市大成律师事务所律师，北京市同维律师事务所律师。现任北京市康达律师事务所合伙人、律师，国金基金管理有限公司独立董事。

张勇先生，硕士，高级经济师。历任中国建设银行北京分行二处副处长，中国建设银行北京信托公司总经理，中国信达资产管理股份有限公司托管清算部总

经理，中国金谷国际信托有限责任公司董事长。现任国金基金管理有限公司独立董事。

（二）监事会成员

刘泮先生，监事会主席，硕士。历任南方报业传媒集团资深记者，广东宝丽华新能源股份有限公司董事会秘书、董事。现任广东宝丽华新能源股份有限公司副董事长、总经理兼董事会秘书，国金基金管理有限公司监事会主席、股东代表监事。

张宝全先生，监事，硕士，会计师。历任哈尔滨翔鸿电子有限公司成本会计，哈尔滨八达科技有限公司主办会计，国巨电子（中国）有限公司内审专员，苏州工业园区财政局项目资金管理处副处长。现任苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司总裁助理，国金基金管理有限公司股东代表监事。

聂武鹏先生，职工代表监事，硕士。历任天虹商场股份有限公司培训专员，TCL 集团股份有限公司招聘及培训经理，深圳迅雷网络技术有限公司高级招聘经理、国金基金管理有限公司（筹）综合管理部总经理助理兼人力资本经理，国金基金管理有限公司运营总监兼运营支持部总经理。现任国金基金管理有限公司总经理助理、运营总监兼运营支持部总经理、职工代表监事，北京千石创富资本管理有限公司监事会主席。

刘容女士，职工代表监事，硕士。历任北大方正物产集团农产品部期货研究员兼总办会助理，国金基金管理有限公司（筹）风险管理部风险分析师，国金基金管理有限公司风险管理部风险分析师兼董事会秘书、合规风控部总经理助理。现任国金基金管理有限公司合规风控部副总经理、职工代表监事，北京千石创富资本管理有限公司股东代表监事。

（三）总经理及其他高级管理人员

纪路先生，董事长，硕士 EMBA。简历请见上文。

尹庆军先生，总经理，硕士。简历请见上文。

张丽女士，督察长，硕士，通过国家司法考试，国际注册内部审计师。历任科学出版社法律事务部内部法律顾问，国金基金管理有限公司（筹）监察稽核部法律顾问，国金基金管理有限公司监察稽核部法律顾问、监察稽核部副总经理兼法律顾问、监察稽核部总经理。现任国金基金管理有限公司督察长。

索峰先生，副总经理，学士。历任重庆润庆期货服务有限公司业务部副总经理，重庆星河期货经纪公司业务部投资顾问，上海申银万国证券投资咨询人员，君安证券有限责任公司重庆民生路营业部交易部经理，中国银河证券有限责任公司重庆民族路营业部、重庆管理部研发部经理，银河基金管理有限公司基金经理、固定收益部总监、总经理助理，国金基金管理有限公司总经理助理、固定收益投资总监兼上海资管事业部总经理。现任国金基金管理有限公司副总经理兼固定收益投资总监、上海资管事业部总经理。

韩东霞女士，副总经理，硕士。历任《中外产品报》河北记者站财经记者，河北国际信托投资公司投资部项目经理，新华社中国经济信息社财经记者，联合证券有限责任公司投资银行部、资产管理部总经理助理，富兰克林坦伯顿基金集团坦伯顿国际股份（美国）北京代表处副代表，华宝基金管理有限公司北京分公司总经理、机构及海外销售部总经理、市场副总监、市场总监，北京天星资本股份有限公司副总经理、主管合伙人，平安银行电子信息与智能制造金融事业部投行业务部（北京）副总监，北京浩蓝雷音投资有限公司副总经理，国金基金管理有限公司市场总监。现任国金基金管理有限公司副总经理兼市场总监。

（四）基金经理

宫雪女士，博士。历任博时基金管理有限公司股票投资部产业分析师，国金基金管理有限公司产品经理、行业分析师、产品与金融工程部总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理。现任国金基金管理有限公司量化投资事业三部总经理。截至本招募说明书更新公布之日，兼任国金沪深 300 指数增强证券投资基金、国金上证 50 指数分级证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。

杨雨龙先生，硕士。历任招商银行股份有限公司计划财务部管理会计，博时基金管理有限公司交易部股票交易员，兴业证券股份有限公司研究所金融工程高级分析师，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司数量化投资部副总监兼基金经理。现任国金基金管理有限公司量化投资事业二部总经理，兼任国金民丰回报 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的基金经理。

（五）投资决策委员会成员名单

投资决策委员会成员包括公司总经理尹庆军先生，副总经理兼固定收益投资总监索峰先生，总经理助理兼量化投资总监林健武先生，总经理助理兼联席固定收益投资总监于涛先生，交易总监兼基金交易部总经理詹毛毛先生，量化投资事业二部总经理杨雨龙先生，主动权益投资总监兼主动权益投资部总经理潘九岩先生，研究部总经理尹海峰先生，量化投资事业三部总经理兼基金经理宫雪女士。

（六）上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

（一）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。

（二）办理本基金备案手续。

（三）对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资。

（四）按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益。

（五）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

（六）编制季度、半年度和年度基金报告。

（七）计算并公告基金资产净值、每万份基金已实现收益、7日年化收益率。

（八）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务。

（九）召集基金份额持有人大会。

（十）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

（十一）以基金管理人名义，代表本基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

（十二）中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

（一）基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。

（二）基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券投资基金法》的行

为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- 1、将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资。
- 2、不公平地对待其管理的不同基金资产。
- 3、承销证券。
- 4、违反规定向他人贷款或者提供担保。
- 5、从事可能使基金财产承担无限责任的投资。
- 6、利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益。
- 7、向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失。
- 8、侵占、挪用基金财产。

9、泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动。

- 10、玩忽职守，不按照规定履行职责。
- 11、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

（三）基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

（四）基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- 1、越权或违规经营。
- 2、违反基金合同或托管协议。
- 3、故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益。
- 4、在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露。
- 5、拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管。
- 6、玩忽职守、滥用职权。

7、泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

8、除按基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资。

9、协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

10、违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序。

- 11、贬损同行，以提高自己。
- 12、在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分。
- 13、以不正当手段谋求业务发展。
- 14、有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象。
- 15、其他法律、行政法规禁止的行为。

五、基金经理承诺

（一）依照有关法律、法规、规章和基金合同的规定，本着勤勉谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。

（二）不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益。

（三）不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

（四）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

六、基金管理人的内部控制制度

（一）内部控制的原则

1、全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

2、独立性原则：设立独立的合规风控部，合规风控部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查。

3、相互制约原则：各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

4、定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

（二）内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对内部控制负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

1、董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。

2、督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；及时向董事会及/或董

事会下设的相关专门委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告。

3、投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略。

4、风险控制委员会：负责对基金投资运作的风险进行测量和监控。

5、合规风控部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；同时负责对投资事前及事中的风险监控，具体落实针对投研运作的相关法律法规、公司制度及日常的投研风控决策，设置相应的投研风控措施，并对各投资组合风险进行分析，对发现的异常及时向相关部门反馈，以作为调整投资决策的依据。

6、业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门负责人对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

（三）内部控制的措施

1、建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

2、建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

3、建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。

4、建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：分别建立了公司营运风险和投资风险控制委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作和投资有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。

5、建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

6、使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失。

7、提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

（四）基金管理人关于内部合规控制声明书

- 1、本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。
- 2、本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

二、基金托管人

一、基金托管人基本情况

1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

成立时间：1988 年 8 月 22 日

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

托管部门联系人：吴玉婷

电话：021-52629999

传真：021-62159217

2、发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 207.74 亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2017 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 6.42 万亿元，实现营业收入 1399.75 亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润 572.00 亿元。根据 2017 年英国《银行家》杂志“全球银行 1000 强”排名，兴业银行按一级资本排名第 28 位，按总资产排名第 30 位，跻身全球银行 30 强。按照美国《财富》杂志“世界 500 强”最新榜单，兴业银行以 426.216 亿美元总营收排名第 230 位。同时，过去一年在国内外权威机构组织的各项评比中，先后获得“亚洲卓越商业银行”“年度最佳股份制银行”“中国最受尊敬企业”等多项殊荣。

二、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、产品管理处、稽核监察处、运行管理处、养老金管理中心等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

三、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截至 2018 年 6 月 30 日，兴业银行已托管开放式基金 239 只，托管基金财产规模 7959.6 亿元。

四、基金托管人的内部风险控制制度说明

（一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

（三）内部风险控制原则

1、全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

2、独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

3、相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

4、定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

5、防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作

部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

6、有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

7、审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设；

8、责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

五、内部控制制度及措施

（一）制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

（二）建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

（三）风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

（四）相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

（五）人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

（六）应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

六、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

三、相关服务机构

一、基金份额发售机构

（一）直销机构

1、国金基金管理有限公司直销柜台中心

注册地址：北京市怀柔区府前街三号楼 3-6

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

联系人：石迎春

联系电话：010-88005812

客服信箱：service@gfund.com

客服电话：4000-2000-18

传真：010-88005816

网站：<http://www.gfund.com>

2、国金基金网上交易系统

交易系统网址：<https://trade.gfund.com>

目前支持的网上交易支付渠道：工行卡、建行卡、通联支付。

客户服务电话：4000-2000-18

客户服务信箱：service@gfund.com

3、国金基金移动客户端

移动客户端（APP）名称：及第理财

目前支持的移动客户端支付渠道：通联支付

客户服务电话：4000-2000-18

客户服务信箱：service@gfund.com

（二）其他销售机构

1、兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

联系人：唐斌，陈志伟

电话：0591-87824863，0591-87857530

客服电话：95561

网址：www.cib.com.cn

2、深圳前海微众银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座

法定代表人：顾敏

联系人：张建霖

电话：0755-84354739

客服电话：400-999-8800

网址：www.webank.com

3、国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：杜晶

电话：028-86690057

传真号码：028-86690126

客服电话：95310

网址：www.gjq.com.cn

4、东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

邮政编码：213000

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

电话：021-20333910

传真：021-50498825

客服电话：400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

5、联讯证券股份有限公司

注册地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、
四层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

邮政编码：518000

法定代表人：徐刚

联系人：彭莲

电话：0755-83331195

客服电话：95564

网址：www.lxsec.com

6、众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室办公地址：
北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招弟

联系人：李艳

电话：010-59497361

客服电话：400-876-9988

网址：www.zscffund.com

7、北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

邮政编码：100102

法定代表人：钟斐斐

联系人：戚晓强

电话：010-61840688

客服电话：4000-618-518

网址：danjuanapp.com

8、北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

通信地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部

注册资本：2000 万元

法定代表人：陈超

电话：4000988511/ 4000888816

传真：010-89188000

客服电话：个人业务：95118 企业业务：400-088-8816

网址：<http://fund.jd.com>

9、凤凰金信（银川）基金销售有限公司

注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号
14 层 1402

邮政编码：750000

法定代表人：程刚

联系人：张旭

电话：010-58160168

传真：010-58160173

客服电话：400-810-5919

网址：www.fengfd.com

10、中民财富基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

邮政编码：200010

法定代表人：弭洪军

联系人：李娜

电话：021-33357030

传真：021-63353736

客服电话：400-876-5716

网址：www.cmiwm.com

11、北京辉腾汇富基金销售有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号 2-2-1

邮政编码：100027

法定代表人：李振

联系人： 彭雪琳

电话： 010-85610733

客服电话： 400-829-1218

网址： www.kstresure.com

12、大连网金基金销售有限公司

注册地址： 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 楼

邮政编码： 116021

法定代表人： 樊怀东

联系人： 辛志辉

电话： 0411-39027817

传真： 0411-39027835

客服电话： 4000-899-100

网址： <http://www.yibaijin.com>

13、阳光人寿保险股份有限公司

注册地址： 海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址： 北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

邮政编码： 100020

法定代表人： 李科

联系人： 杨超

客服电话： 95510

网址： fund.sinosig.com

14、民商基金销售(上海)有限公司

注册地址： 上海黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

邮政编码： 200120

法定代表人： 贲惠琴

联系人： 杨一新

电话： 021-50206002

传真： 021-50206001

客服电话： 021-50206003

公司网址：www.msftcc.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售基金，并及时公告。

二、登记机构

名称：国金基金管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区府前街三号楼 3-6

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

法定代表人：尹庆军

联系人：刘雪

联系电话：010-88005921

传真：010-88005876

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陆奇

联系人：陆奇

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：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

办公地址：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

法定代表人：毛鞍宁

经办注册会计师：徐艳、贺耀

联系人：张晖

联系电话：010-58152145

传真：010-85188298

四、基金的名称

本基金名称：国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型：混合型证券投资基金。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板股票、创业板股票，以及其它经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、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)、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

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。

1、资产配置策略

本基金的大类资产配置策略，主要是根据对宏观经济周期和市场运行阶段的综合研判结果予以决策。通过对比大类资产的相对价值、流动性及市场情绪等指标来判断经济周期所处阶段以及未来发展趋势，动态配置股票、债券、现金之间的比例。具体宏观和市场环境划分阶段如下：

综合值：	周期	复苏	繁荣	衰退	萧条
宏观	经济表现	上行		下行	
	经济周期	复苏	繁荣	衰退	萧条
市场	市场动量	小	大	大	小
	市场情绪	低迷	高涨	高涨	低迷

表 1 宏观经济周期与市场运行阶段

来源：国金基金管理有限公司

在对宏观经济环境有初步判断的基础上，综合考虑整体资产组合的风险、收益、流动性及各类资产相关性等因素，应用量化工具对上述资产配置比例进行优化，在规避风险的前提下，为本基金的资产配置提供支持。

2、股票投资策略

本基金采用“自上而下”的行业配置、与“自下而上”精选个股相结合的投资策略，主要投资于估值合理、具有长期增值潜力的行业及上市公司。

（1）行业配置策略

本基金运用行业基本面、市场估值等指标，选择在不同经济周期阶段中具有较高成长性和景气优势的行业，并选择其中估值合理的行业进行重点投资。

对行业配置权重的确定或调整从以下几个方面考虑：

1) 行业基本面比较。行业比较包括两个层面，行业生命周期和行业景气。

行业生命周期由行业自身发展规律决定，主要受产业链、行业竞争结构等因素的影响；行业景气受宏观经济环境影响而表现不同，主要分析指标包括收入、利润、价格、产量、产能利用率、销量及增速等。

2) 行业市场估值比较。估值体现市场预期，行业间估值排序、行业自身估值水平都影响行业在市场中的表现。因此，运用行业估值模型分析行业投资机会是行之有效的手段，具体指标包括行业间估值比较、行业估值水平、行业的盈利调整等。

3) 在上述初步筛选的基础上，结合产业政策，从全球产业格局变迁、国内经济增长驱动等角度，寻求符合国际经济发展趋势和国内经济结构转型主题、估值合理的优势行业。

(2) 个股投资策略

本基金将采用定量分析和定性分析相结合的方法来建立股票库。首先，运用流动性、盈利能力、估值水平等指标对所有 A 股进行定量筛选，构建股票备选库。其次，在此基础上通过对上市公司基本面进行深入的研究和定性分析，进一步发掘符合本基金投资理念、且估值合理的优质个股构建股票风格库。

1) 定量筛选

本基金管理人将通过以下两步对上市公司股票进行筛选，建立本基金的股票备选库。

A. 在市场所有 A 股中，剔除 ST、*ST 及公司认为的其它高风险品种股票。

B. 在上一步的基础上，重点考察盈利能力、估值等指标，并根据这些指标综合排序、筛选，形成股票备选库。

盈利能力指标：盈利能力是指企业获取利润的能力，利润是经营者经营业绩和管理效能的集中体现。企业的盈利能力指标是本基金管理人在投资运作过程中重点关注的因素。本基金选取净资产收益率（ROE）、总资产报酬率（ROA）、主营业务收入同比增长率、主营业务利润同比增长率等指标作为衡量标准。

估值指标：企业的估值水平在一定程度上反应了其未来成长性以及当前投资的安全性。估值合理将是本基金选股的一个重要条件。本基金采用市盈率（P/E）、市净率（P/B）、市盈率相对盈利增长比例（PEG）等估值指标，并参考国际估值分析方法、结合国内市场特征对入选的上市公司股票进行综合评估入选，选取估

值合理的个股。

2) 定性分析

从以下几个方面对股票备选库中的股票进行定性分析：

行业发展前景及地位：公司所在行业发展趋势良好，具有良好的行业成长性；公司在行业中处于领先地位，或者在生产、技术、市场等一个或多个方面具有行业内领先地位，并在短时间内难以被行业内的其他竞争对手超越，在未来的发展中，其在行业或者细分行业中的地位预期会有较大的上升。

治理结构：公司治理结构良好，管理规范，已建立起市场化经营机制、决策效率高、对市场变化反应灵敏并内控有力。**主要考核指标：**财务信息质量、所有权结构、独立董事制度、信息披露制度等等。

营运状况：公司营运状况良好，股东和管理层结构稳定；各项财务指标状况良好；公司具有清晰的发展战略等。

核心竞争力：公司主营业务可持续发展能力强，在行业中处于领先地位，具备核心竞争优势，比如专利技术、资源独占、销售网络垄断、独特的市场形象、较高的品牌认知度等。

风险因素考察：公司在技术、营销、内部控制等方面不存在较大风险，同时公司具备与规模扩张匹配的较强的管理能力。

3) 构建投资组合

在对上市公司股票进行定量筛选和定性分析的基础上，基金经理结合研究员对行业 and 个股的分析结果，精选优质企业，形成股票风格库，构建股票投资组合。

3、债券投资策略

在保持组合高度流动性的前提下，结合对国内外宏观经济基本面、金融市场运行趋势、市场资金面情况及市场供求、债市收益率水平、期限利差及信用利差等各方面的分析，制定组合动态配置策略的基础上，合理安排基金组合中债券投资组合的久期及期限结构，结合内部研究和信用评级积极优选个券进行投资。具体投资策略包括：

(1) 久期及期限结构管理

久期管理是债券组合管理的核心环节，是提高收益、控制风险的有效手段，也是衡量基金组合资产和负债是否匹配的关键指标。组合资产久期要与组合负债

即募集资金久期匹配，以规避潜在的流动性风险。由于久期也是衡量市场利率水平的变化对债券组合投资的收益影响程度的指标。本基金在保持资产和负债久期基本匹配的基础上，还会综合分析中国宏观经济、财政金融政策和市场状况，对未来市场利率走势做出预测，并根据预测结果微调组合债券久期：当预期市场利率处于上升通道时，适度降低组合久期；当预期市场利率处于下降通道时，适度提高组合久期，在有效控制风险基础上，有效提高组合整体的收益水平。

同时，在确定久期策略的基础上，本基金还将根据市场环境和期限利差走势分析选择不同的组合期限结构策略，主要的期限结构策略包括：骑乘策略、哑铃组合策略、子弹组合策略等。

（2）通过利率和信用利差分析确定券种配置

券种配置策略主要体现为对不同类型债券的选择，通过利率水平和信用利差分析发现具有相对配置价值的债券种类，结合组合流动性需求和风险承受能力随时调整组合结构，通过券种的选择和调整优化债券组合收益。本基金所选券种均为银行间市场和交易所发行的债券品种，主要包括：国债、央行票据、政策性金融债、商业银行金融债及次级债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转债和可分离债等监管机构批准投资的品种。本基金在充分考虑不同类型债券流动性、税收、以及信用风险等因素基础上，进行类属配置，优化组合收益。

（3）加强内部信用评估、优化个券选择

本基金在综合考虑久期、期限结构及券种配置的基础上，还要加强信用品种的内部信用评估，优化个券选择。通过综合性的内部信用评估系统对标的个券进行信用评级，将通过信用评级的债券纳入备选库，再结合对个体券种的价值分析在备选库内选择相应的最优投资对象。本基金还将采取积极主动的策略，通过内部信用分析和研究判断找出市场定价错误和回购套利机会，在确定存在超额收益的情况下，积极把握市场机会。本基金在已有组合基础上，根据对未来市场预期的变化，持续运用上述策略对债券组合进行动态调整。

（4）回购杠杆策略

本基金将密切跟踪市场收益率情况及资金成本水平，实时把握不同市场和不同期限品种之间的收益率差异，在控制流动性风险的基础上，积极采取适度的回购杠杆操作，有效增厚基金资产收益。

（5）中小企业私募债投资策略

中小企业私募债具有票息收益高、信用风险高、流动性差、规模小等特点。短期内，中小企业私募债对本基金的贡献有限，但本基金将在市场条件允许的情况下进行择优投资。由于中小企业私募债的发行主体多为非上市民营企业，个体异质性强、信息少且透明度低，因此在投资研究方面主要采用逐案分析的方法（Case-by-case），通过尽职调查进行独立评估，信用分析以经营风险、财务风险和回收率（Recovery rate）等指标为重点。此外，针对中小企业私募债的投资，基金管理人将根据审慎原则，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

4、可转换债券投资策略

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。

5、权证投资策略

在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并积极利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。

6、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。

九、基金的业绩比较基准

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%。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

本报告期为 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

1、报告期末基金资产组合情况

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
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	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

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	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

(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。

3、报告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	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
11	600791	京能置业	67,400	245,336.00	0.94
12	600980	北矿科技	25,000	244,750.00	0.94
13	002824	和胜股份	26,800	244,684.00	0.94
14	600052	浙江广厦	84,800	244,224.00	0.94
15	600322	天房发展	75,000	243,750.00	0.94
16	603033	三维股份	12,900	243,552.00	0.94
17	002565	顺灏股份	63,300	238,641.00	0.92
18	603615	茶花股份	27,700	236,281.00	0.91
19	300650	太龙照明	17,500	235,550.00	0.90
20	300150	世纪瑞尔	57,000	234,840.00	0.90
21	300553	集智股份	7,200	234,648.00	0.90
22	300417	南华仪器	15,400	232,540.00	0.89

23	600057	厦门象屿	55,600	232,408.00	0.89
24	603416	信捷电气	11,500	232,070.00	0.89
25	603041	美思德	16,300	230,971.00	0.89
26	002753	永东股份	25,600	230,912.00	0.89
27	600248	延长化建	58,200	227,562.00	0.87
28	300641	正丹股份	45,780	227,068.80	0.87
29	600475	华光股份	27,500	225,500.00	0.87
30	603306	华懋科技	15,800	225,150.00	0.86
31	002247	聚力文化	47,900	223,214.00	0.86
32	600035	楚天高速	75,400	222,430.00	0.85
33	600163	中闽能源	68,400	217,512.00	0.84
34	601368	绿城水务	37,200	215,388.00	0.83
35	601199	江南水务	59,200	210,752.00	0.81
36	600178	东安动力	50,100	210,420.00	0.81
37	002820	桂发祥	16,900	205,166.00	0.79
38	603100	川仪股份	27,100	203,792.00	0.78
39	603006	联明股份	22,100	202,878.00	0.78
40	600505	西昌电力	44,100	202,419.00	0.78
41	601579	会稽山	22,200	197,358.00	0.76
42	603020	爱普股份	26,400	196,152.00	0.75
43	600293	三峡新材	49,600	193,936.00	0.74
44	000889	中嘉博创	18,900	192,780.00	0.74
45	000756	新华制药	34,200	189,810.00	0.73
46	600829	人民同泰	32,500	189,475.00	0.73
47	300194	福安药业	57,100	183,291.00	0.70
48	300501	海顺新材	10,900	181,921.00	0.70
49	300094	国联水产	35,400	180,186.00	0.69
50	600865	百大集团	31,700	175,935.00	0.68
51	300760	迈瑞医疗	1,601	174,861.22	0.67
52	000715	中兴商业	29,900	173,719.00	0.67
53	600785	新华百货	10,600	173,310.00	0.67
54	002674	兴业科技	21,000	159,390.00	0.61
55	000639	西王食品	24,400	156,404.00	0.60
56	002763	汇洁股份	18,700	149,787.00	0.58
57	603679	华体科技	6,400	144,512.00	0.55
58	002791	坚朗五金	14,400	141,984.00	0.55
59	002652	扬子新材	35,500	137,030.00	0.53
60	300423	鲁亿通	7,300	128,699.00	0.49

61	002608	江苏国信	16,300	124,695.00	0.48
62	300403	汉宇集团	24,100	120,982.00	0.46
63	300600	瑞特股份	7,400	119,362.00	0.46
64	600854	春兰股份	33,200	115,536.00	0.44
65	000833	粤桂股份	24,800	113,088.00	0.43
66	600455	博通股份	5,000	109,950.00	0.42
67	600769	祥龙电业	28,100	109,590.00	0.42
68	000968	蓝焰控股	9,900	105,435.00	0.40
69	600830	香溢融通	21,600	103,464.00	0.40
70	603300	华铁科技	21,000	100,800.00	0.39
71	002771	真视通	8,900	98,256.00	0.38
72	600862	中航高科	17,400	97,440.00	0.37
73	600792	云煤能源	36,200	97,016.00	0.37
74	603738	泰晶科技	7,500	94,875.00	0.36
75	603822	嘉澳环保	4,000	93,160.00	0.36
76	603038	华立股份	5,600	92,960.00	0.36
77	600444	国机通用	8,700	83,085.00	0.32
78	603955	大千生态	5,700	79,230.00	0.30
79	300346	南大光电	8,700	77,082.00	0.30
80	000404	长虹华意	18,800	72,568.00	0.28
81	002116	中国海诚	10,400	71,240.00	0.27
82	002734	利民股份	6,600	67,584.00	0.26
83	600602	云赛智联	12,900	64,242.00	0.25
84	300396	迪瑞医疗	5,300	62,964.00	0.24
85	600926	杭州银行	8,300	61,420.00	0.24
86	000524	岭南控股	8,900	61,410.00	0.24
87	000430	张家界	12,600	60,984.00	0.23
88	601997	贵阳银行	5,700	60,876.00	0.23
89	603798	康普顿	5,900	59,649.00	0.23
90	002756	永兴特钢	4,500	53,640.00	0.21
91	600231	凌钢股份	19,300	51,531.00	0.20
92	000153	丰原药业	8,500	43,775.00	0.17
93	002380	科远股份	4,000	42,120.00	0.16
94	603333	尚纬股份	8,000	40,080.00	0.15
95	600368	五洲交通	10,900	33,463.00	0.13
96	603360	百傲化学	2,500	30,900.00	0.12
97	002587	奥拓电子	5,600	27,216.00	0.10
98	603977	国泰集团	3,600	24,876.00	0.10

99	600781	辅仁药业	1,900	24,035.00	0.09
100	002057	中钢天源	3,900	22,698.00	0.09
101	600609	金杯汽车	7,200	22,320.00	0.09
102	300160	秀强股份	6,300	21,735.00	0.08
103	002351	漫步者	4,100	20,254.00	0.08
104	002483	润邦股份	5,500	20,075.00	0.08
105	000796	凯撒旅游	2,900	19,256.00	0.07
106	600644	乐山电力	4,200	18,858.00	0.07
107	002100	天康生物	4,100	17,220.00	0.07
108	000676	智度股份	1,800	17,082.00	0.07
109	300006	莱美药业	4,200	15,120.00	0.06
110	603855	华荣股份	1,700	13,396.00	0.05
111	300549	优德精密	1,000	11,390.00	0.04
112	002671	龙泉股份	2,600	10,660.00	0.04
113	000502	绿景控股	1,300	9,880.00	0.04
114	300324	旋极信息	1,700	9,537.00	0.04
115	603023	威帝股份	1,900	8,854.00	0.03
116	000900	现代投资	1,700	6,613.00	0.03
117	600353	旭光股份	1,500	5,985.00	0.02
118	002613	北玻股份	1,800	4,788.00	0.02
119	600356	恒丰纸业	800	4,392.00	0.02
120	300250	初灵信息	200	2,220.00	0.01
121	300108	吉药控股	300	1,500.00	0.01
122	603811	诚意药业	48	779.04	0.00
123	002062	宏润建设	200	768.00	0.00
124	603166	福达股份	100	512.00	0.00

4、报告期内股票投资组合的重大变动报告

（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	联明股份	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。

（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	汉字集团	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。

（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。

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。

6、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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7、报告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、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。

9、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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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

(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。

11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

报告期, 本基金未投资国债期货。

(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投资国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

报告期内, 本基金未参与国债期货交易。

12、投资组合报告附注

(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。

(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报告期内本基金未投资证券。

(3) 其他资产构成

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
3	应收股利	-
4	应收利息	2,481.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,138,138.33

(4) 报告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。

(5) 报告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。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

一、基金净值表现

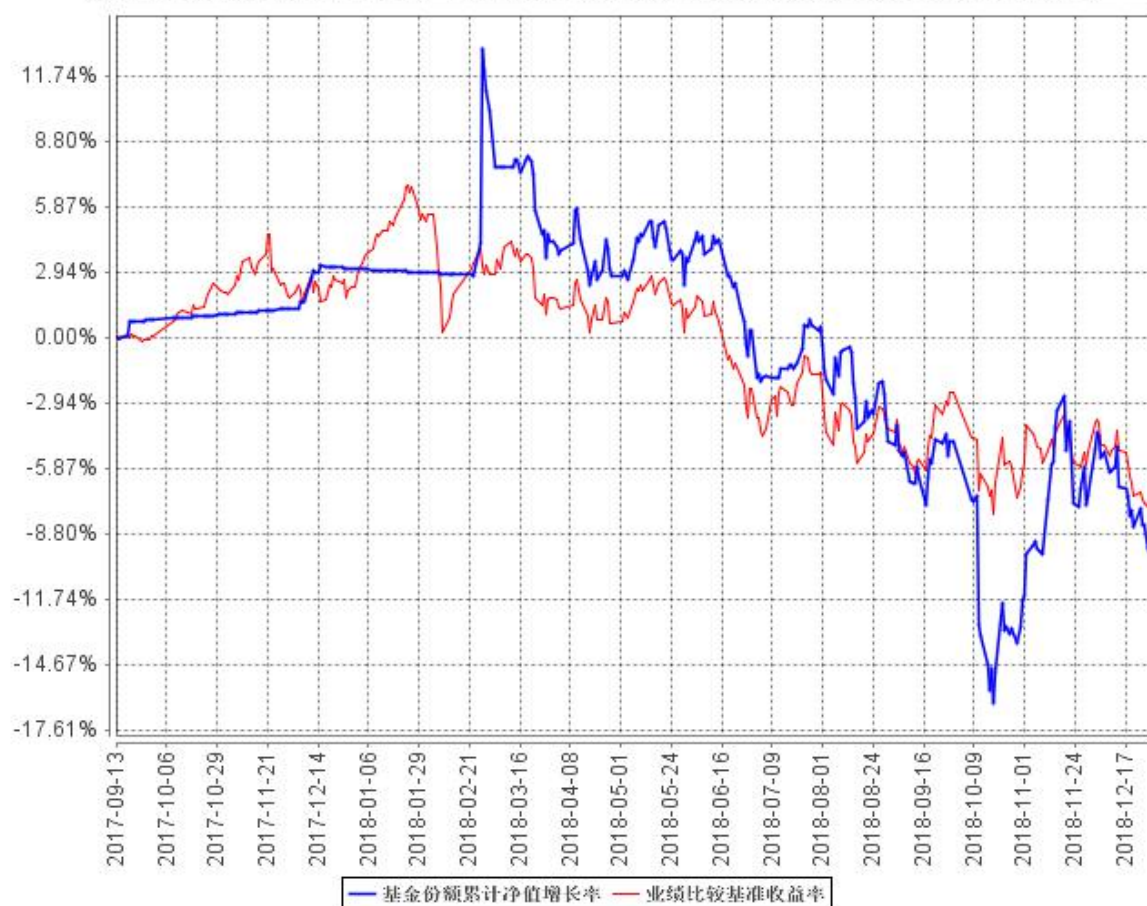
1、本基金合同生效日为 2017 年 9 月 13 日，基金合同生效以来（截至 2018 年 12 月 31 日）的基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较如下表所示：

阶段	净值增长率①	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
2017年9月13日（基金合同生效日）至2017年12月31日	3.07%	0.15%	2.30%	0.37%	0.77%	-0.22%
2018年1月1日至2018年12月31日	-12.35%	1.09%	-9.32%	0.67%	-3.03%	0.42%
2017年9月13日（基金合同生效日）至2018年12月31日	-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%

2、自基金合同生效以来基金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：本基金基金合同生效日为2017年9月13日，图示日期为2017年9月13日至2018年12月31日。

3、其他指标

注：无

十三、费用概览

本基金费用的种类包括：

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

十四、对招募说明书更新部分的说明

国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）招募说明书（更新）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2018 年 10 月 27 日刊登的本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- （一）更新了“重要提示”中相关内容。
- （二）更新了“三、基金管理人”中相关内容。
- （三）更新了“四、基金托管人”中相关内容。
- （四）更新了“五、相关服务机构”中相关信息。
- （五）更新了“九、基金的投资”中相关内容。
- （六）更新了“十、基金的业绩”中相关内容。
- （七）更新了“二十二、其他应披露事项”，披露了自上次招募说明书发布以来涉及本基金的相关公告。

国金基金管理有限公司
二〇一九年四月二十七日