

**国泰融安多策略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：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年三月三十日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2019 年 3 月 27 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	国泰融安多策略灵活配置混合
基金主代码	003516
交易代码	003516
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 7 月 3 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	63,145,376.39 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略等。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要根据上市公司获利能力、成长能力以及估值水平来进行个股选择，并结合市场环境灵活运用多种投资策略，建立成长投资策略、价值投资策略、主题投资策略、事件驱动策略、定向增发策略、次新股投资策略等多策略体系，根据市场环境的变化进行针对性的运用。</p> <p>（1）成长投资策略</p>

	<p>本基金将关注成长型上市公司，重点关注中小市值股票中具有潜在高成长性和稳健盈利模式的上市公司，在充分的行业研究和审慎的公司研究基础上，本基金将适度提高成长精选股票的风险水平，对优质成长型公司可给予适当估值溢价。</p> <p>（2）价值投资策略</p> <p>价值投资策略是通过寻找价值被低估的股票进行投资，本基金将根据不同行业特征和市场特征，综合运用市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市销率(P/S)、(P/E)/G、EV/EBITDA 以及现金流折现模型(DCF)等估值指标，精选价值被低估的上市公司进行投资。</p> <p>（3）主题投资策略</p> <p>在我国的不同经济发展阶段，由于社会、文化、科技、国内外宏观经济、国家政策、资本市场发展情况不同，具有不同的投资主题。本基金通过深入研究经济发展和资本市场趋势变化，对影响经济发展或企业盈利的关键性驱动因素及成长动因进行前瞻性的分析，挖掘中长期主题投资机会，并精选出符合投资主题的行业以及具有核心竞争力的上市公司。</p> <p>（4）事件驱动策略</p> <p>本基金将持续关注事件驱动投资机会，重点关注的事项包括：1）并购重组，通过对上市公司资产重组、资产注入、公司兼并收购、公司股权变动、公司再融资、上市公司管理层变动、公司股权激励计划、新产品研发等可能对公司的经营方向、行业地位、核心竞争力产生重要影响的事件进行合理细致的分析，选择基本面向好的企业进行投资；2）定增破发，即在预案期内或锁定期内跌破定增价格的定向增发项目，并结合对其基本面的分析及市场未来走势进行判断，精选价值被低估的定增项目进行投资。</p> <p>（5）定向增发策略</p> <p>本基金从发展前景和估值水平两个角度出发，通过定性和定量分析相结合的方法评价定向增发项目对上市公司未来价值的影响。结合定向增发一二级市场价差的大小，理性做出投资决策。在严格控制风险的前提下，对投资组合进行优化配置和动态调整。</p> <p>（6）次新股投资策略</p> <p>次新股泛指最近特定时间段内（如过去一年、过去半年）首次公开募集的</p>
--	--

	<p>股票。本基金将根据次新股的自身特征，从上市时间、市值、网上中签率、行业、主题、高送转预期、价格等多方面综合分析，充分挖掘成长性高、安全边际较高的次新股进行投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金综合考虑收益性、流动性和风险性，进行积极投资。积极性策略主要包括根据利率预测调整组合久期、选择低估值债券进行投资、把握市场上的无风险套利机会，利用杠杆原理以及各种衍生工具，增加盈利性、控制风险等，以争取获得适当的超额收益，提高整体组合收益率。</p> <p>4、中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>6、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。</p> <p>7、股指期货投资策略</p> <p>本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等预期风险和预期收益的证券投资基金品种，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。

## 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		国泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李永梅	王永民
	联系电话	021-31081600转	010-66594896
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95566
传真		021-31081800	010-66594942

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	<a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层及基金托管人住所

## §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 7 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-5,755,882.82	-790,357.51
本期利润	-4,986,490.45	442,178.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0915	0.0068
本期基金份额净值增长率	-8.32%	-0.02%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1300	-0.0268
期末基金资产净值	57,878,831.23	49,378,189.66
期末基金份额净值	0.9166	0.9998

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）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

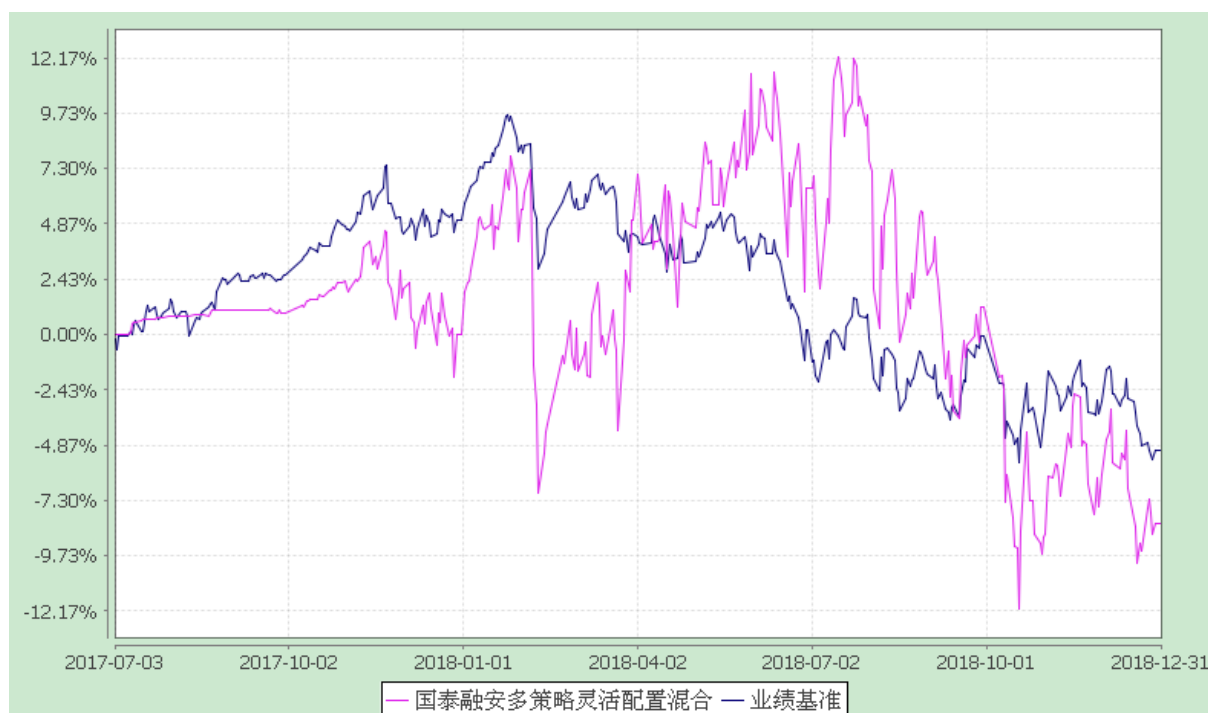
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-9.42%	1.66%	-5.04%	0.82%	-4.38%	0.84%
过去六个月	-13.88%	1.67%	-5.26%	0.74%	-8.62%	0.93%
过去一年	-8.32%	1.73%	-9.62%	0.67%	1.30%	1.06%
自基金合同生效起至今	-8.34%	1.44%	-5.09%	0.58%	-3.25%	0.86%

### 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

国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2017 年 7 月 3 日至 2018 年 12 月 31 日)

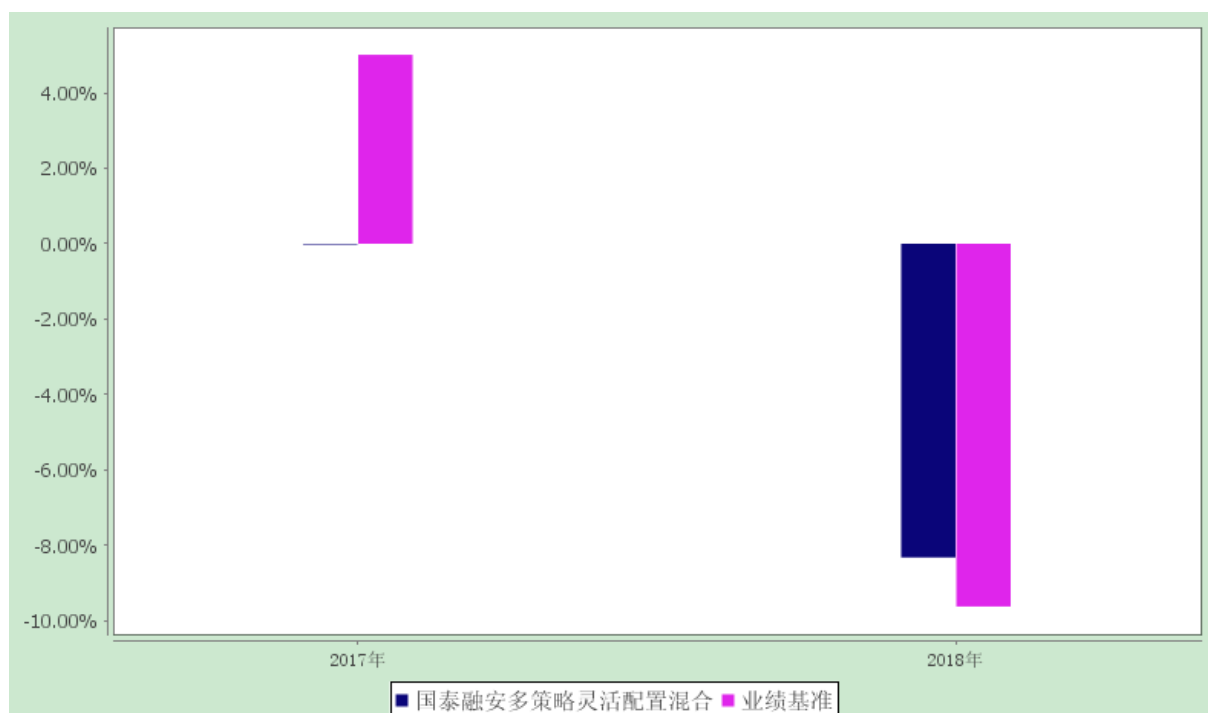


注：本基金自合同生效日为 2017 年 7 月 3 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

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

国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图





注：2017 年计算期间为本基金合同生效日 2017 年 7 月 3 日至 2017 年 12 月 31 日，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立至今尚未进行利润分配。

## §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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 98 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰中证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、

国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰民利保本混合型证券投资基金、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰润鑫纯债债券型证券投资基金、国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰量化价值精选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰

价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来，国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
樊利安	本基金的基金经理	2017-07-03	2018-11-15	13 年	硕士。曾任职上海鑫地投资管理有限公司、天治基金管理有限公司等。2010 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月起任国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原国泰淘新灵活配置混合型证券投资基金）和国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 1 月至 2018 年 8 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月至 2019 年 1 月任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 5 月起兼任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2018 年 2 月任国泰生益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月

				<p>起兼任国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2017 年 1 月任国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）的基金经理，2016 年 5 月至 2017 年 11 月任国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 8 月任国泰添益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 4 月任国泰福益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月至 2018 年 12 月任国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 9 月任国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 8 月任国泰信益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月起兼任国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 6 月任国泰景益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 3 月任国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 5 月任国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 5 月任国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 9 月任国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 11 月任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 9 月任国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月至 2018 年 9 月任国泰</p>
--	--	--	--	---

					宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 11 月起兼任国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，2018 年 1 月至 2018 年 5 月任国泰瑞益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月至 2018 年 8 月任国泰恒益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 9 月起兼任国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理。2015 年 5 月至 2016 年 1 月任研究部副总监，2016 年 1 月至 2018 年 7 月任研究部副总监（主持工作），2018 年 7 月起任研究部总监。
高楠	本基金的基金经理	2017-11-24	-	7 年	硕士研究生。2007 年 7 月至 2008 年 12 月在中期期货有限公司工作，任分析师。2012 年 7 月至 2017 年 7 月在平安资产管理有限责任公司工作，历任分析师、投资经理。2017 年 8 月加入国泰基金管理有限公司，拟任基金经理。2017 年 11 月起任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本

基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

### 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

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《公平交易管理制度》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用于公司所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，旨在规范交易行为，严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

（一）公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

（二）公司制定投资授权机制，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

（三）公司对各投资组合信息进行有效的保密管理，不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔离。

（四）公司实行集中交易制度，严格隔离投资管理职能与交易执行职能，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。

（五）公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

（六）公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析，并评估是否符合公平交易原则。

（七）公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，对交易过程进行定期检查，并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

（一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过

对这些配对的交易价差分析,我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下,且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

## (二) 扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口,将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均,并以此为依据,进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对(样本数 $\geq 30$ ),溢价率均值大部分在 1%数量级及以下。

## (三) 基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对,已要求基金经理对价差作出了解释,根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 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

以上证综指为基准计算,A 股全年以仅次于 2008 年的跌幅收关,属历年来跌幅第二大的年份。2018 年 A 股面临了非常复杂的内外部环境。从经济基本面预期角度,投资者的预期经历从年初的分歧,到年底的极度悲观。从事件发酵的角度看,2018 年经历了从表外融资收紧、海外主要经济体加息、中美贸易摩擦,税费、医疗等民生领域改革。因此,大部分行业都面临了无法预测的外部冲击和国内的政策调整,导致大部分行业的中长期预期混乱,资金更多的是跟随短期事件在不同板块间腾挪及快速轮动,但缺乏持续赚钱效应。综上,2018 年股市下跌的主要原因来自于估值下移,以年度角度看,整体呈现普跌态势,结构性机会并不显著。

本基金秉承自下而上选股思路,在优先考虑行业边际变化的条件上,结合相应行业公司的经营壁垒、行业成长空间、经营治理等微观因素进行综合选股和组合管理。上半年配置主要集中在消费品和 TMT,下半年主要维持在 TMT 和部分逆周期属性明显的行业。年底的持仓主要围绕在农业、消费品、特高压、TMT 中具备成长性的细分板块等进行配置。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2018 年度净值增长率为-8.32%,同期业绩比较基准为-9.62%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预判，2019 年特别是上半年国内经济压力较大，净出口和消费对于经济的贡献度会下降，看短期基建等逆周期投资是增量贡献，看长期中国经济增速仍在逐渐下行，但同时不断优化产业结构提升盈利能力的过程中。映射到股票市场，管理人认为，2019 年的结构性机会将远显著于 2018 年，市场将从杀估值的通杀阶段逐步进入到跟随业绩预期进行投资的结构分化阶段。宏观上几个变量可能将催化这类结构性机会：（1）社融增速的真正拐点；（2）海外主要经济体的货币政策。结构上，当前我们看好农业、代表科技趋势的云计算、与改善民生工程相关的 IT 服务公司、具备逆周期属性的基建、特高压、5G 仍有配置价值。2018 年超跌的部分消费品以及消费电子等领域也逐步迎来配置价值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

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

无。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。



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

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

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2019)第 21094 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国泰融安多策略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	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	5,292,824.80	4,693,568.52
结算备付金	932,214.15	372,132.73
存出保证金	68,230.24	22,423.89
交易性金融资产	51,785,733.88	45,999,925.00
其中：股票投资	51,785,733.88	45,999,925.00
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	68,018.15	-
应收利息	1,685.80	1,565.33
应收股利	-	-
应收申购款	380,503.23	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>58,529,210.25</b>	<b>51,089,615.47</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
负债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	1,464,460.87
应付赎回款	91,777.30	195.32
应付管理人报酬	72,493.04	63,489.41
应付托管费	7,249.30	6,348.93
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	398,668.29	156,930.55
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-

其他负债	80,191.09	20,000.73
<b>负债合计</b>	<b>650,379.02</b>	<b>1,711,425.81</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	63,145,376.39	49,389,500.65
未分配利润	-5,266,545.16	-11,310.99
<b>所有者权益合计</b>	<b>57,878,831.23</b>	<b>49,378,189.66</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>58,529,210.25</b>	<b>51,089,615.47</b>

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9166 元，基金份额总额 63,145,376.39 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国泰融安多策略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	上年度可比期间 2017 年 7 月 3 日（基金合同 生效日）至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-644,392.36</b>	<b>1,338,144.48</b>
1.利息收入	56,005.31	546,657.25
其中：存款利息收入	56,005.31	141,381.18
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	-	405,276.07
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-1,584,166.73	-1,563,830.40
其中：股票投资收益	-1,989,613.56	-1,563,830.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-

衍生工具收益	-	-
股利收益	405,446.83	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	769,392.37	1,232,536.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	114,376.69	1,122,781.49
<b>减：二、费用</b>	<b>4,342,098.09</b>	<b>895,965.85</b>
1. 管理人报酬	829,703.62	468,628.28
2. 托管费	82,970.47	46,862.82
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,303,911.73	259,139.99
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	125,512.27	121,334.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-4,986,490.45</b>	<b>442,178.63</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-4,986,490.45</b>	<b>442,178.63</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰融安多策略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）	49,389,500.65	-11,310.99	49,378,189.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	-4,986,490.45	-4,986,490.45

期利润)			
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）	13,755,875.74	-268,743.72	13,487,132.02
其中：1.基金申购款	47,486,259.72	208,960.91	47,695,220.63
2.基金赎回款	-33,730,383.98	-477,704.63	-34,208,088.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	63,145,376.39	-5,266,545.16	57,878,831.23
项目	上年度可比期间 2017 年 7 月 3 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）	209,788,601.88	-	209,788,601.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	442,178.63	442,178.63
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）	-160,399,101.23	-453,489.62	-160,852,590.85
其中：1.基金申购款	14,796,347.87	304,603.75	15,100,951.62
2.基金赎回款	-175,195,449.10	-758,093.37	-175,953,542.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少	-	-	-

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	49,389,500.65	-11,310.99	49,378,189.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 周向勇, 主管会计工作负责人: 倪莹, 会计机构负责人: 吴洪涛

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2257 号文《关于准予国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》, 由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 209,787,829.28 元, 业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 666 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 7 月 3 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 209,788,601.88 份基金份额, 其中认购资金利息折合 772.60 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票), 债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货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。本基金的投资组合比例为: 股票资产占基金资产的 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, 持有的现金或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、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率 X50%+中证综合债指数收益率 X50%。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2019 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85

号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a)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。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，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b)对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，股票的股息、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。

(c)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。



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

(e)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
中国建银投资有限责任公司	基金管理人的控股股东
国泰全球投资管理有限公司	基金管理人的控股子公司
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
申万宏源集团股份有限公司(“申万宏源”)	受基金管理人的控股股东中国建投控制的公司

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

##### 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

金额单位：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7月3日（基金合同生效日） 至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
申万宏源	61,504,003.68	2.51%	-	-

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
申万宏源	57,279.50	3.07%	44,817.41	11.24%
关联方名称	上年度可比期间 2017 年 7 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
申万宏源	-	-	-	-

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

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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 7 月 3 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	829,703.62	468,628.28
其中：支付销售机构的客户维护费	17,921.71	1,502.42

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

#### 7.4.8.2 基金托管费

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7月3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	82,970.47	46,862.82

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比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

份额单位：份

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7月3日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
基金合同生效日（2017 年 7 月 3 日）持有的基金份额	-	19,999,000.00
期初持有的基金份额	19,999,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	19,999,000.00	19,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总 份额比例	31.67%	40.49%

注：基金管理人国泰基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托国泰基金管理有限公司直销柜台办理，无申购费用。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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7月3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
中国银行	5,292,824.80	36,831.47	4,693,568.52	135,981.20

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均未有在承销期参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 51,785,733.88 元，无属于第二层次的余额及属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 45,999,925.00 元，无属于第二层次的余额及属于第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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	51,785,733.88	88.48
	其中: 股票	51,785,733.88	88.48
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	6,225,038.95	10.64
8	其他各项资产	518,437.42	0.89
9	合计	58,529,210.25	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 （%）
A	农、林、牧、渔业	3,443,859.08	5.95
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,097,548.10	62.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,424,056.96	2.46
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,818,516.12	18.69
J	金融业	129.12	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,624.50	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	51,785,733.88	89.47

## 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	600312	平高电气	456,544	3,688,875.52	6.37
2	002157	正邦科技	685,600	3,640,536.00	6.29
3	002124	天邦股份	460,600	3,132,080.00	5.41
4	300595	欧普康视	60,383	2,339,237.42	4.04
5	300724	捷佳伟创	81,700	2,326,816.00	4.02
6	300498	温氏股份	86,906	2,275,199.08	3.93
7	603313	梦百合	104,252	2,190,334.52	3.78
8	300559	佳发教育	59,100	2,035,995.00	3.52
9	002230	科大讯飞	82,500	2,032,800.00	3.51
10	600588	用友网络	84,300	1,795,590.00	3.10

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金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	600536	中国软件	16,298,117.10	33.01
2	600029	南方航空	16,141,777.70	32.69
3	601888	中国国旅	15,595,413.01	31.58
4	300226	上海钢联	15,269,545.23	30.92
5	002371	北方华创	14,120,637.04	28.60
6	603019	中科曙光	13,042,131.32	26.41
7	300559	佳发教育	12,695,820.90	25.71
8	300357	我武生物	11,761,552.34	23.82
9	603039	泛微网络	11,708,396.24	23.71
10	300347	泰格医药	11,587,112.40	23.47
11	600588	用友网络	11,510,393.51	23.31
12	000860	顺鑫农业	11,442,261.00	23.17
13	600690	青岛海尔	10,989,513.00	22.26
14	002376	新北洋	9,803,102.50	19.85
15	600009	上海机场	9,694,483.92	19.63
16	300302	同有科技	9,668,222.00	19.58
17	300529	健帆生物	9,597,731.60	19.44
18	002507	涪陵榨菜	9,486,624.34	19.21
19	300602	飞荣达	9,309,196.44	18.85



20	600282	南钢股份	8,469,121.87	17.15
21	603799	华友钴业	8,433,551.64	17.08
22	002368	太极股份	8,427,700.00	17.07
23	300177	中海达	8,408,324.00	17.03
24	300047	天源迪科	8,401,463.60	17.01
25	002493	荣盛石化	8,287,514.42	16.78
26	002299	圣农发展	8,265,622.75	16.74
27	002153	石基信息	8,039,460.60	16.28
28	600718	东软集团	7,794,927.60	15.79
29	603369	今世缘	7,741,091.00	15.68
30	600132	重庆啤酒	7,678,513.30	15.55
31	300010	立思辰	7,639,498.00	15.47
32	601601	中国太保	7,617,473.00	15.43
33	000651	格力电器	7,481,851.57	15.15
34	002304	洋河股份	7,288,191.53	14.76
35	600810	神马股份	7,274,601.20	14.73
36	300146	汤臣倍健	7,265,718.00	14.71
37	000596	古井贡酒	7,265,461.20	14.71
38	002234	民和股份	7,223,463.00	14.63
39	300498	温氏股份	7,193,599.00	14.57
40	300377	赢时胜	7,184,894.70	14.55
41	002007	华兰生物	7,099,629.10	14.38
42	002157	正邦科技	7,073,645.86	14.33
43	002456	欧菲科技	7,068,574.00	14.32
44	300065	海兰信	6,828,960.91	13.83
45	002458	益生股份	6,818,728.00	13.81
46	600782	新钢股份	6,797,467.00	13.77
47	300595	欧普康视	6,691,876.77	13.55
48	601336	新华保险	6,604,162.00	13.37
49	600115	东方航空	6,341,068.01	12.84
50	300170	汉得信息	6,282,098.00	12.72
51	300166	东方国信	6,231,944.14	12.62
52	300348	长亮科技	6,149,989.70	12.45
53	600038	中直股份	6,144,267.00	12.44
54	000921	海信家电	6,075,628.38	12.30
55	300601	康泰生物	5,908,811.48	11.97
56	300451	创业软件	5,803,880.00	11.75
57	000639	西王食品	5,680,479.00	11.50
58	300101	振芯科技	5,653,923.00	11.45
59	600845	宝信软件	5,560,856.16	11.26
60	601318	中国平安	5,542,952.00	11.23
61	000063	中兴通讯	5,541,630.00	11.22
62	600312	平高电气	5,497,254.41	11.13
63	002268	卫士通	5,388,711.00	10.91

64	300212	易华录	5,349,212.00	10.83
65	603658	安图生物	5,301,270.00	10.74
66	000650	仁和药业	5,219,464.61	10.57
67	603027	千禾味业	5,196,759.00	10.52
68	300024	机器人	5,183,168.20	10.50
69	601288	农业银行	5,141,474.58	10.41
70	002281	光迅科技	5,115,163.86	10.36
71	601111	中国国航	5,085,515.00	10.30
72	601186	中国铁建	5,077,768.06	10.28
73	300073	当升科技	5,018,795.40	10.16
74	002236	大华股份	4,886,970.96	9.90
75	600048	保利地产	4,844,910.00	9.81
76	601939	建设银行	4,839,253.00	9.80
77	600519	贵州茅台	4,793,390.00	9.71
78	600271	航天信息	4,779,061.00	9.68
79	600329	中新药业	4,726,099.00	9.57
80	600570	恒生电子	4,443,258.00	9.00
81	600569	安阳钢铁	4,433,954.00	8.98
82	300454	深信服	4,430,218.48	8.97
83	300136	信维通信	4,418,606.56	8.95
84	002557	洽洽食品	4,397,982.95	8.91
85	600562	国睿科技	4,163,416.00	8.43
86	002142	宁波银行	4,158,806.89	8.42
87	001979	招商蛇口	4,131,519.36	8.37
88	600809	山西汾酒	4,099,469.53	8.30
89	002563	森马服饰	4,072,397.00	8.25
90	600028	中国石化	4,064,043.30	8.23
91	600340	华夏幸福	4,017,838.00	8.14
92	300061	康旗股份	3,976,098.58	8.05
93	000932	华菱钢铁	3,952,963.01	8.01
94	603288	海天味业	3,926,893.40	7.95
95	002124	天邦股份	3,916,862.50	7.93
96	600036	招商银行	3,828,156.55	7.75
97	000858	五粮液	3,758,151.00	7.61
98	600801	华新水泥	3,751,292.23	7.60
99	300394	天孚通信	3,743,973.00	7.58
100	600188	兖州煤业	3,673,427.89	7.44
101	600332	白云山	3,547,812.45	7.18
102	601636	旗滨集团	3,527,961.00	7.14
103	603345	安井食品	3,516,847.30	7.12
104	000852	石化机械	3,497,965.80	7.08
105	600585	海螺水泥	3,486,110.00	7.06
106	600855	航天长峰	3,479,964.00	7.05
107	002262	恩华药业	3,475,100.80	7.04

108	000066	中国长城	3,462,347.00	7.01
109	601800	中国交建	3,446,607.83	6.98
110	000729	燕京啤酒	3,428,068.00	6.94
111	002044	美年健康	3,424,801.65	6.94
112	603589	口子窖	3,405,634.00	6.90
113	600581	八一钢铁	3,332,021.00	6.75
114	300502	新易盛	3,233,440.58	6.55
115	300253	卫宁健康	3,216,030.11	6.51
116	601003	柳钢股份	3,211,180.00	6.50
117	300168	万达信息	3,198,330.44	6.48
118	000418	小天鹅 A	3,184,455.00	6.45
119	002567	唐人神	3,164,821.50	6.41
120	002648	卫星石化	3,163,689.00	6.41
121	300684	中石科技	3,129,604.00	6.34
122	300113	顺网科技	3,099,920.10	6.28
123	601233	桐昆股份	3,057,428.00	6.19
124	600305	恒顺醋业	3,036,247.00	6.15
125	600779	水井坊	3,033,222.00	6.14
126	300659	中孚信息	3,004,315.00	6.08
127	002029	七匹狼	2,992,679.95	6.06
128	002230	科大讯飞	2,971,026.00	6.02
129	000681	视觉中国	2,947,209.92	5.97
130	600498	烽火通信	2,916,635.00	5.91
131	002468	申通快递	2,903,706.00	5.88
132	601128	常熟银行	2,896,800.76	5.87
133	601166	兴业银行	2,814,247.00	5.70
134	600887	伊利股份	2,782,086.00	5.63
135	300036	超图软件	2,757,961.94	5.59
136	601857	中国石油	2,729,658.00	5.53
137	300424	航新科技	2,728,086.00	5.52
138	002410	广联达	2,699,673.16	5.47
139	600055	万东医疗	2,664,550.00	5.40
140	002065	东华软件	2,641,426.00	5.35
141	601155	新城控股	2,588,093.00	5.24
142	600720	祁连山	2,586,625.00	5.24
143	300369	绿盟科技	2,583,785.45	5.23
144	002439	启明星辰	2,545,655.05	5.16
145	300439	美康生物	2,531,971.00	5.13
146	603313	梦百合	2,524,046.00	5.11
147	002271	东方雨虹	2,512,723.00	5.09
148	002668	奥马电器	2,510,682.00	5.08
149	300078	思创医惠	2,495,071.00	5.05
150	002390	信邦制药	2,482,038.00	5.03
151	300724	捷佳伟创	2,427,781.90	4.92

152	002402	和而泰	2,423,079.00	4.91
153	300458	全志科技	2,375,328.51	4.81
154	600884	杉杉股份	2,352,505.00	4.76
155	300633	开立医疗	2,345,923.00	4.75
156	002343	慈文传媒	2,340,927.50	4.74
157	300523	辰安科技	2,336,470.00	4.73
158	600183	生益科技	2,334,874.70	4.73
159	002829	星网宇达	2,325,666.00	4.71
160	603466	风语筑	2,319,371.00	4.70
161	603883	老百姓	2,298,352.86	4.65
162	000538	云南白药	2,291,024.25	4.64
163	002250	联化科技	2,282,583.00	4.62
164	300630	普利制药	2,281,195.00	4.62
165	002092	中泰化学	2,266,077.00	4.59
166	300014	亿纬锂能	2,259,100.00	4.58
167	603711	香飘飘	2,257,297.00	4.57
168	002841	视源股份	2,256,556.88	4.57
169	000333	美的集团	2,249,046.00	4.55
170	300059	东方财富	2,240,597.20	4.54
171	000799	酒鬼酒	2,235,495.00	4.53
172	000636	风华高科	2,234,104.00	4.52
173	002384	东山精密	2,230,864.00	4.52
174	300571	平治信息	2,227,519.00	4.51
175	600583	海油工程	2,224,053.31	4.50
176	300729	乐歌股份	2,222,829.20	4.50
177	600559	老白干酒	2,221,782.80	4.50
178	600337	美克家居	2,214,392.00	4.48
179	002680	*ST 长生	2,208,258.00	4.47
180	600085	同仁堂	2,182,460.00	4.42
181	603486	科沃斯	2,173,327.00	4.40
182	601952	苏垦农发	2,172,100.20	4.40
183	002110	三钢闽光	2,167,018.00	4.39
184	002463	沪电股份	2,165,516.00	4.39
185	601088	中国神华	2,164,567.00	4.38
186	002202	金风科技	2,162,361.20	4.38
187	002466	天齐锂业	2,160,900.00	4.38
188	600837	海通证券	2,159,923.00	4.37
189	002792	通宇通讯	2,159,181.00	4.37
190	600763	通策医疗	2,152,347.00	4.36
191	601818	光大银行	2,149,487.00	4.35
192	002332	仙琚制药	2,135,667.00	4.33
193	300284	苏交科	2,135,536.40	4.32
194	002366	台海核电	2,130,307.50	4.31
195	600703	三安光电	2,128,458.00	4.31

196	603737	三棵树	2,128,397.00	4.31
197	000768	中航飞机	2,127,533.00	4.31
198	600487	亨通光电	2,124,901.00	4.30
199	300609	汇纳科技	2,122,359.00	4.30
200	600256	广汇能源	2,111,896.00	4.28
201	002609	捷顺科技	2,104,089.00	4.26
202	603305	旭升股份	2,103,869.00	4.26
203	603387	基蛋生物	2,099,547.00	4.25
204	000739	普洛药业	2,095,023.00	4.24
205	002796	世嘉科技	2,091,300.00	4.24
206	002405	四维图新	2,085,842.63	4.22
207	002677	浙江美大	2,067,960.00	4.19
208	300550	和仁科技	2,061,601.00	4.18
209	300476	胜宏科技	2,060,458.80	4.17
210	002095	生意宝	2,057,470.00	4.17
211	002139	拓邦股份	2,056,713.00	4.17
212	603496	恒为科技	2,054,798.28	4.16
213	002867	周大生	2,043,855.00	4.14
214	300033	同花顺	2,029,638.00	4.11
215	601566	九牧王	1,982,211.36	4.01
216	300618	寒锐钴业	1,981,355.00	4.01
217	603885	吉祥航空	1,921,251.56	3.89
218	002035	华帝股份	1,915,243.40	3.88
219	000661	长春高新	1,890,804.00	3.83
220	002180	纳思达	1,890,218.00	3.83
221	600990	四创电子	1,889,088.00	3.83
222	600486	扬农化工	1,863,412.00	3.77
223	603127	昭衍新药	1,859,397.00	3.77
224	600895	张江高科	1,835,428.40	3.72
225	002747	埃斯顿	1,833,965.00	3.71
226	600406	国电南瑞	1,831,196.00	3.71
227	002206	海利得	1,826,776.00	3.70
228	000876	新希望	1,809,867.00	3.67
229	000703	恒逸石化	1,809,753.00	3.67
230	002594	比亚迪	1,803,736.00	3.65
231	300130	新国都	1,797,026.80	3.64
232	600598	北大荒	1,787,463.00	3.62
233	601766	中国中车	1,771,948.00	3.59
234	002008	大族激光	1,766,401.96	3.58
235	002154	报喜鸟	1,739,579.78	3.52
236	603160	汇顶科技	1,729,730.00	3.50
237	601808	中海油服	1,657,519.00	3.36
238	600546	山煤国际	1,654,983.00	3.35
239	000022	深赤湾 A	1,648,228.00	3.34

240	600050	中国联通	1,639,027.00	3.32
241	600997	开滦股份	1,629,012.63	3.30
242	603939	益丰药房	1,627,429.00	3.30
243	002531	天顺风能	1,619,107.00	3.28
244	600547	山东黄金	1,608,583.00	3.26
245	600489	中金黄金	1,608,495.00	3.26
246	600803	新奥股份	1,604,184.50	3.25
247	000656	金科股份	1,601,439.00	3.24
248	600522	中天科技	1,600,617.00	3.24
249	600872	中炬高新	1,597,230.00	3.23
250	603882	金域医学	1,589,739.00	3.22
251	600967	内蒙一机	1,583,794.00	3.21
252	300323	华灿光电	1,556,981.66	3.15
253	300336	新文化	1,541,844.52	3.12
254	603869	新智认知	1,531,508.00	3.10
255	002185	华天科技	1,523,508.00	3.09
256	300433	蓝思科技	1,520,210.00	3.08
257	300310	宜通世纪	1,520,161.00	3.08
258	600383	金地集团	1,511,029.00	3.06
259	600596	新安股份	1,509,546.30	3.06
260	601998	中信银行	1,506,437.00	3.05
261	002475	立讯精密	1,500,419.00	3.04
262	300188	美亚柏科	1,453,153.00	2.94
263	600276	恒瑞医药	1,437,361.00	2.91
264	603606	东方电缆	1,397,910.60	2.83
265	002348	高乐股份	1,366,085.00	2.77
266	603707	健友股份	1,267,312.00	2.57
267	600879	航天电子	1,262,787.00	2.56
268	300406	九强生物	1,260,407.00	2.55
269	002338	奥普光电	1,247,378.00	2.53
270	300463	迈克生物	1,246,893.00	2.53
271	603156	养元饮品	1,238,969.00	2.51
272	300525	博思软件	1,237,428.00	2.51
273	300469	信息发展	1,233,440.00	2.50
274	603848	好太太	1,200,010.23	2.43
275	002049	紫光国微	1,196,565.00	2.42
276	000006	深振业 A	1,189,233.00	2.41
277	002661	克明面业	1,189,020.00	2.41
278	000818	航锦科技	1,182,104.00	2.39
279	601872	招商轮船	1,181,811.00	2.39
280	601339	百隆东方	1,180,276.00	2.39
281	300308	中际旭创	1,177,874.80	2.39
282	000158	常山北明	1,173,585.50	2.38
283	300506	名家汇	1,170,218.00	2.37

284	600460	士兰微	1,168,009.24	2.37
285	600507	方大特钢	1,166,698.00	2.36
286	000717	韶钢松山	1,166,603.00	2.36
287	603639	海利尔	1,166,427.40	2.36
288	300183	东软载波	1,165,532.00	2.36
289	600185	格力地产	1,163,175.00	2.36
290	603520	司太立	1,160,522.00	2.35
291	600702	舍得酒业	1,157,485.00	2.34
292	300637	扬帆新材	1,154,001.00	2.34
293	600026	中远海能	1,151,548.00	2.33
294	600141	兴发集团	1,147,895.65	2.32
295	600757	长江传媒	1,146,034.00	2.32
296	601668	中国建筑	1,144,710.00	2.32
297	002714	牧原股份	1,143,416.00	2.32
298	002395	双象股份	1,142,288.40	2.31
299	000911	南宁糖业	1,141,548.00	2.31
300	000547	航天发展	1,139,143.00	2.31
301	002313	日海智能	1,137,431.00	2.30
302	600075	新疆天业	1,135,989.00	2.30
303	300199	翰宇药业	1,134,704.00	2.30
304	002382	蓝帆医疗	1,134,540.00	2.30
305	603960	克来机电	1,133,871.00	2.30
306	603398	邦宝益智	1,133,663.00	2.30
307	300122	智飞生物	1,133,211.00	2.29
308	600867	通化东宝	1,132,796.80	2.29
309	000597	东北制药	1,132,484.89	2.29
310	002032	苏泊尔	1,130,483.52	2.29
311	000968	蓝焰控股	1,130,325.00	2.29
312	600118	中国卫星	1,128,964.00	2.29
313	002087	新野纺织	1,123,311.00	2.27
314	300138	晨光生物	1,123,136.00	2.27
315	603659	璞泰来	1,121,417.00	2.27
316	603214	爱婴室	1,120,825.00	2.27
317	600623	华谊集团	1,118,720.00	2.27
318	600019	宝钢股份	1,116,150.00	2.26
319	002307	北新路桥	1,112,722.80	2.25
320	000507	珠海港	1,110,375.00	2.25
321	600161	天坛生物	1,108,988.10	2.25
322	300383	光环新网	1,106,369.00	2.24
323	002832	比音勒芬	1,102,699.00	2.23
324	603779	威龙股份	1,099,738.00	2.23
325	600426	华鲁恒升	1,099,524.12	2.23
326	600372	中航电子	1,093,863.00	2.22
327	300596	利安隆	1,093,737.50	2.22

328	603690	至纯科技	1,093,333.00	2.21
329	000877	天山股份	1,092,524.00	2.21
330	300144	宋城演艺	1,090,079.00	2.21
331	300661	圣邦股份	1,089,352.00	2.21
332	002478	常宝股份	1,088,001.00	2.20
333	600380	健康元	1,086,910.00	2.20
334	002606	大连电瓷	1,086,698.00	2.20
335	002310	东方园林	1,086,687.00	2.20
336	603113	金能科技	1,085,686.00	2.20
337	603636	南威软件	1,083,680.00	2.19
338	000796	凯撒旅游	1,078,714.00	2.18
339	002607	亚夏汽车	1,078,209.00	2.18
340	603055	台华新材	1,078,093.00	2.18
341	002341	新纶科技	1,077,243.00	2.18
342	603259	药明康德	1,071,826.44	2.17
343	002488	金固股份	1,071,685.50	2.17
344	000938	紫光股份	1,068,463.00	2.16
345	002472	双环传动	1,060,225.00	2.15
346	603660	苏州科达	1,055,650.00	2.14
347	603538	美诺华	1,053,071.80	2.13
348	603456	九洲药业	1,052,609.60	2.13
349	600345	长江通信	1,051,237.00	2.13
350	300294	博雅生物	1,050,744.64	2.13
351	002526	山东矿机	1,048,546.00	2.12
352	603508	思维列控	1,047,904.20	2.12
353	603357	设计总院	1,047,744.00	2.12
354	601990	南京证券	1,047,546.00	2.12
355	300569	天能重工	1,047,224.00	2.12
356	002233	塔牌集团	1,046,487.00	2.12
357	600691	阳煤化工	1,045,936.00	2.12
358	000586	汇源通信	1,043,975.00	2.11
359	002916	深南电路	1,042,634.00	2.11
360	300222	科大智能	1,038,141.00	2.10
361	002229	鸿博股份	1,036,364.00	2.10
362	002399	海普瑞	1,031,105.20	2.09
363	002100	天康生物	1,027,362.00	2.08
364	600339	中油工程	1,023,929.00	2.07
365	300496	中科创达	1,023,306.00	2.07
366	000011	深物业 A	1,021,948.00	2.07
367	002321	华英农业	1,020,067.78	2.07
368	002537	海联金汇	1,018,875.00	2.06
369	300604	长川科技	1,017,367.00	2.06
370	002582	好想你	1,016,176.20	2.06
371	300085	银之杰	1,013,595.00	2.05



372	002912	中新赛克	1,011,459.00	2.05
373	002078	太阳纸业	1,010,803.68	2.05
374	603609	禾丰牧业	1,009,585.00	2.04
375	000918	嘉凯城	1,009,426.00	2.04
376	002777	久远银海	1,008,606.00	2.04
377	600373	中文传媒	1,008,600.87	2.04
378	300642	透景生命	1,001,332.00	2.03

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	600029	南方航空	17,383,380.00	35.20
2	600536	中国软件	16,862,185.66	34.15
3	601888	中国国旅	15,330,096.29	31.05
4	300226	上海钢联	15,132,460.15	30.65
5	002371	北方华创	13,814,380.78	27.98
6	603019	中科曙光	13,064,596.90	26.46
7	000860	顺鑫农业	12,460,394.53	25.23
8	300347	泰格医药	11,700,891.84	23.70
9	300357	我武生物	11,677,798.11	23.65
10	603039	泛微网络	11,603,113.28	23.50
11	300559	佳发教育	10,884,464.50	22.04
12	600690	青岛海尔	10,340,106.00	20.94
13	600282	南钢股份	9,844,398.17	19.94
14	300302	同有科技	9,788,887.29	19.82
15	601601	中国太保	9,733,458.00	19.71
16	300529	健帆生物	9,717,502.24	19.68
17	600009	上海机场	9,685,148.14	19.61
18	002376	新北洋	9,680,156.77	19.60
19	002507	涪陵榨菜	9,572,186.30	19.39
20	300602	飞荣达	9,145,135.15	18.52
21	300170	汉得信息	9,051,213.53	18.33
22	600588	用友网络	9,049,848.00	18.33
23	300047	天源迪科	8,506,255.48	17.23
24	002368	太极股份	8,318,561.00	16.85
25	603799	华友钴业	8,289,220.49	16.79
26	600132	重庆啤酒	8,280,489.50	16.77
27	601939	建设银行	8,258,888.60	16.73

28	002153	石基信息	8,167,874.82	16.54
29	300177	中海达	8,074,340.46	16.35
30	002493	荣盛石化	8,064,104.00	16.33
31	002299	圣农发展	7,904,273.10	16.01
32	300010	立思辰	7,796,929.42	15.79
33	600519	贵州茅台	7,758,301.17	15.71
34	600115	东方航空	7,714,182.27	15.62
35	000651	格力电器	7,673,230.00	15.54
36	600718	东软集团	7,609,628.10	15.41
37	600810	神马股份	7,587,808.55	15.37
38	603369	今世缘	7,539,727.93	15.27
39	300065	海兰信	7,311,540.66	14.81
40	000596	古井贡酒	7,275,475.80	14.73
41	002304	洋河股份	7,251,605.92	14.69
42	300377	赢时胜	7,216,462.60	14.61
43	002234	民和股份	7,181,228.00	14.54
44	002458	益生股份	7,083,968.47	14.35
45	600048	保利地产	7,022,549.00	14.22
46	002456	欧菲科技	6,936,742.00	14.05
47	002007	华兰生物	6,917,841.59	14.01
48	300146	汤臣倍健	6,869,147.91	13.91
49	600782	新钢股份	6,743,373.27	13.66
50	300166	东方国信	6,486,691.88	13.14
51	601336	新华保险	6,369,729.35	12.90
52	300601	康泰生物	6,270,082.20	12.70
53	600038	中直股份	6,169,091.80	12.49
54	300101	振芯科技	6,134,642.00	12.42
55	002142	宁波银行	6,126,945.58	12.41
56	000921	海信家电	5,986,987.00	12.12
57	300348	长亮科技	5,796,052.00	11.74
58	000639	西王食品	5,701,827.80	11.55
59	600845	宝信软件	5,675,507.47	11.49
60	601636	旗滨集团	5,653,430.30	11.45
61	000063	中兴通讯	5,521,329.55	11.18
62	300212	易华录	5,357,609.44	10.85
63	002268	卫士通	5,285,584.80	10.70
64	300024	机器人	5,253,341.00	10.64
65	603027	千禾味业	5,149,865.00	10.43
66	601288	农业银行	5,115,935.00	10.36
67	600329	中新药业	5,091,894.12	10.31
68	601318	中国平安	5,082,335.90	10.29
69	300498	温氏股份	5,003,799.38	10.13
70	603658	安图生物	4,997,265.25	10.12
71	000650	仁和药业	4,975,005.00	10.08

72	601111	中国国航	4,966,483.04	10.06
73	002236	大华股份	4,960,493.52	10.05
74	002281	光迅科技	4,956,151.00	10.04
75	300073	当升科技	4,949,404.00	10.02
76	300595	欧普康视	4,699,047.65	9.52
77	601233	桐昆股份	4,687,796.09	9.49
78	600271	航天信息	4,644,064.57	9.41
79	600570	恒生电子	4,503,385.24	9.12
80	601155	新城控股	4,446,473.00	9.00
81	600569	安阳钢铁	4,281,457.00	8.67
82	001979	招商蛇口	4,274,746.00	8.66
83	000932	华菱钢铁	4,265,250.47	8.64
84	002557	洽洽食品	4,223,994.31	8.55
85	600801	华新水泥	4,221,363.73	8.55
86	300454	深信服	4,205,905.13	8.52
87	600562	国睿科技	4,192,500.54	8.49
88	300136	信维通信	4,150,530.45	8.41
89	603288	海天味业	4,089,470.80	8.28
90	300451	创业软件	4,068,105.97	8.24
91	600809	山西汾酒	4,065,863.60	8.23
92	600028	中国石化	4,024,522.00	8.15
93	603345	安井食品	3,938,819.00	7.98
94	002563	森马服饰	3,881,483.00	7.86
95	002157	正邦科技	3,861,972.00	7.82
96	600036	招商银行	3,853,164.00	7.80
97	300061	康旗股份	3,714,498.55	7.52
98	600188	兖州煤业	3,710,596.00	7.51
99	000858	五粮液	3,686,305.00	7.47
100	002008	大族激光	3,613,368.35	7.32
101	601186	中国铁建	3,606,387.12	7.30
102	000729	燕京啤酒	3,547,623.00	7.18
103	600703	三安光电	3,515,816.20	7.12
104	600332	白云山	3,483,240.71	7.05
105	601800	中国交建	3,477,978.00	7.04
106	600855	航天长峰	3,446,129.00	6.98
107	002262	恩华药业	3,440,921.00	6.97
108	000066	中国长城	3,438,902.49	6.96
109	000852	石化机械	3,421,402.60	6.93
110	600340	华夏幸福	3,402,161.22	6.89
111	603589	口子窖	3,386,844.00	6.86
112	600581	八一钢铁	3,362,019.00	6.81
113	002044	美年健康	3,351,585.93	6.79
114	300253	卫宁健康	3,342,090.33	6.77
115	601003	柳钢股份	3,332,249.38	6.75

116	600585	海螺水泥	3,322,610.99	6.73
117	000418	小天鹅 A	3,301,414.00	6.69
118	600967	内蒙一机	3,237,736.66	6.56
119	300168	万达信息	3,237,250.92	6.56
120	300502	新易盛	3,147,073.48	6.37
121	300684	中石科技	3,081,461.52	6.24
122	300659	中孚信息	3,076,966.00	6.23
123	600498	烽火通信	3,061,063.50	6.20
124	002410	广联达	3,044,887.00	6.17
125	300113	顺网科技	3,016,464.06	6.11
126	002648	卫星石化	3,014,237.00	6.10
127	000636	风华高科	3,012,047.00	6.10
128	600305	恒顺醋业	3,007,415.00	6.09
129	601128	常熟银行	2,928,320.98	5.93
130	300439	美康生物	2,882,087.00	5.84
131	600887	伊利股份	2,858,979.00	5.79
132	000681	视觉中国	2,844,856.00	5.76
133	600779	水井坊	2,841,508.00	5.75
134	002027	分众传媒	2,834,956.78	5.74
135	000902	新洋丰	2,816,340.80	5.70
136	002439	启明星辰	2,805,247.61	5.68
137	002468	申通快递	2,800,671.66	5.67
138	601166	兴业银行	2,794,262.85	5.66
139	300036	超图软件	2,783,896.00	5.64
140	002029	七匹狼	2,765,746.00	5.60
141	601857	中国石油	2,716,421.00	5.50
142	600312	平高电气	2,715,480.16	5.50
143	002463	沪电股份	2,686,763.00	5.44
144	300369	绿盟科技	2,678,556.40	5.42
145	300394	天孚通信	2,635,093.00	5.34
146	002065	东华软件	2,577,822.00	5.22
147	300424	航新科技	2,565,278.00	5.20
148	600055	万东医疗	2,519,681.06	5.10
149	600720	祁连山	2,502,812.00	5.07
150	601398	工商银行	2,460,359.64	4.98
151	600763	通策医疗	2,453,096.78	4.97
152	002390	信邦制药	2,444,803.00	4.95
153	300078	思创医惠	2,437,803.00	4.94
154	002402	和而泰	2,427,613.90	4.92
155	002343	慈文传媒	2,426,574.38	4.91
156	002668	奥马电器	2,420,966.00	4.90
157	002271	东方雨虹	2,410,873.00	4.88
158	603466	风语筑	2,403,250.00	4.87
159	603883	老百姓	2,381,028.00	4.82

160	600895	张江高科	2,378,682.80	4.82
161	600884	杉杉股份	2,378,285.34	4.82
162	000768	中航飞机	2,367,686.96	4.80
163	300729	乐歌股份	2,367,108.48	4.79
164	002092	中泰化学	2,366,854.00	4.79
165	300630	普利制药	2,339,576.08	4.74
166	300633	开立医疗	2,314,089.00	4.69
167	000799	酒鬼酒	2,258,574.00	4.57
168	002841	视源股份	2,236,338.00	4.53
169	600085	同仁堂	2,235,597.00	4.53
170	002202	金风科技	2,234,210.24	4.52
171	603305	旭升股份	2,234,053.00	4.52
172	002110	三钢闽光	2,228,920.00	4.51
173	600837	海通证券	2,224,598.00	4.51
174	300458	全志科技	2,224,528.00	4.51
175	603496	恒为科技	2,221,427.30	4.50
176	600183	生益科技	2,216,417.23	4.49
177	002680	*ST 长生	2,212,895.00	4.48
178	601952	苏垦农发	2,182,991.20	4.42
179	002095	生意宝	2,179,234.00	4.41
180	300523	辰安科技	2,178,313.68	4.41
181	300059	东方财富	2,176,698.00	4.41
182	000538	云南白药	2,168,726.00	4.39
183	601088	中国神华	2,165,814.91	4.39
184	601818	光大银行	2,165,801.00	4.39
185	300618	寒锐钴业	2,157,224.00	4.37
186	603737	三棵树	2,154,013.00	4.36
187	600337	美克家居	2,149,606.00	4.35
188	002405	四维图新	2,149,287.28	4.35
189	002867	周大生	2,145,970.00	4.35
190	300476	胜宏科技	2,137,337.80	4.33
191	000333	美的集团	2,123,404.69	4.30
192	002829	星网宇达	2,119,453.00	4.29
193	002366	台海核电	2,111,419.35	4.28
194	300284	苏交科	2,108,968.04	4.27
195	600559	老白干酒	2,101,057.80	4.26
196	603486	科沃斯	2,099,653.00	4.25
197	300571	平治信息	2,090,959.85	4.23
198	002384	东山精密	2,083,970.00	4.22
199	002466	天齐锂业	2,075,505.00	4.20
200	600583	海油工程	2,071,501.96	4.20
201	002677	浙江美大	2,065,270.00	4.18
202	600487	亨通光电	2,053,342.00	4.16
203	603939	益丰药房	2,023,770.00	4.10

204	300033	同花顺	2,021,054.00	4.09
205	603387	基蛋生物	2,008,282.00	4.07
206	603885	吉祥航空	1,998,022.59	4.05
207	002567	唐人神	1,997,650.00	4.05
208	600031	三一重工	1,988,123.00	4.03
209	002332	仙琚制药	1,947,782.93	3.94
210	601566	九牧王	1,945,851.00	3.94
211	600256	广汇能源	1,942,897.25	3.93
212	000998	隆平高科	1,938,214.00	3.93
213	002035	华帝股份	1,919,656.80	3.89
214	002747	埃斯顿	1,914,588.00	3.88
215	603127	昭衍新药	1,908,178.00	3.86
216	002609	捷顺科技	1,882,013.40	3.81
217	600486	扬农化工	1,874,311.00	3.80
218	002139	拓邦股份	1,860,333.00	3.77
219	600990	四创电子	1,855,508.37	3.76
220	002206	海利得	1,807,354.00	3.66
221	000661	长春高新	1,781,627.00	3.61
222	000703	恒逸石化	1,761,170.00	3.57
223	600406	国电南瑞	1,752,805.29	3.55
224	600383	金地集团	1,745,600.00	3.54
225	300130	新国都	1,727,943.00	3.50
226	600596	新安股份	1,724,786.00	3.49
227	002180	纳思达	1,713,431.00	3.47
228	600598	北大荒	1,712,832.10	3.47
229	300188	美亚柏科	1,695,394.00	3.43
230	300323	华灿光电	1,682,430.00	3.41
231	002531	天顺风能	1,680,078.51	3.40
232	600050	中国联通	1,666,350.00	3.37
233	603160	汇顶科技	1,659,000.80	3.36
234	600997	开滦股份	1,596,611.00	3.23
235	000656	金科股份	1,594,435.00	3.23
236	600547	山东黄金	1,584,774.30	3.21
237	600546	山煤国际	1,583,310.00	3.21
238	601808	中海油服	1,570,129.36	3.18
239	600872	中炬高新	1,568,942.00	3.18
240	600522	中天科技	1,555,001.00	3.15
241	603882	金域医学	1,548,233.00	3.14
242	600489	中金黄金	1,542,431.00	3.12
243	300310	宜通世纪	1,538,667.00	3.12
244	300433	蓝思科技	1,502,123.00	3.04
245	600803	新奥股份	1,496,113.75	3.03
246	300336	新文化	1,494,278.11	3.03
247	603869	新智认知	1,492,415.91	3.02

248	002475	立讯精密	1,490,666.00	3.02
249	002154	报喜鸟	1,484,324.13	3.01
250	601998	中信银行	1,450,253.00	2.94
251	002185	华天科技	1,446,845.00	2.93
252	000022	深赤湾 A	1,443,002.00	2.92
253	002348	高乐股份	1,435,556.00	2.91
254	600276	恒瑞医药	1,401,415.00	2.84
255	603606	东方电缆	1,308,763.40	2.65
256	300406	九强生物	1,307,049.00	2.65
257	603156	养元饮品	1,293,170.00	2.62
258	002338	奥普光电	1,291,791.00	2.62
259	300525	博思软件	1,283,554.00	2.60
260	300463	迈克生物	1,263,459.00	2.56
261	002049	紫光国微	1,256,923.00	2.55
262	600075	新疆天业	1,238,611.00	2.51
263	000629	攀钢钒钛	1,225,921.00	2.48
264	300469	信息发展	1,223,180.00	2.48
265	603707	健友股份	1,221,688.60	2.47
266	603711	香飘飘	1,220,376.00	2.47
267	000918	嘉凯城	1,211,434.00	2.45
268	600879	航天电子	1,209,885.00	2.45
269	002661	克明面业	1,205,752.00	2.44
270	603639	海利尔	1,200,368.00	2.43
271	300506	名家汇	1,196,564.00	2.42
272	600635	大众公用	1,192,563.00	2.42
273	603659	璞泰来	1,178,381.00	2.39
274	603259	药明康德	1,174,943.00	2.38
275	000547	航天发展	1,171,108.00	2.37
276	300199	翰宇药业	1,171,108.00	2.37
277	600161	天坛生物	1,165,968.10	2.36
278	300138	晨光生物	1,157,804.00	2.34
279	000158	常山北明	1,147,116.00	2.32
280	601339	百隆东方	1,145,305.00	2.32
281	300183	东软载波	1,138,900.00	2.31
282	603398	邦宝益智	1,129,249.00	2.29
283	002792	通宇通讯	1,128,058.00	2.28
284	000818	航锦科技	1,126,572.00	2.28
285	600118	中国卫星	1,119,160.12	2.27
286	002087	新野纺织	1,116,962.00	2.26
287	600702	舍得酒业	1,115,013.00	2.26
288	300550	和仁科技	1,113,343.50	2.25
289	603848	好太太	1,110,340.00	2.25
290	600623	华谊集团	1,106,917.00	2.24
291	000586	汇源通信	1,105,436.00	2.24

292	600507	方大特钢	1,104,582.00	2.24
293	600426	华鲁恒升	1,103,326.00	2.23
294	000717	韶钢松山	1,099,980.00	2.23
295	002526	山东矿机	1,099,086.00	2.23
296	002607	亚夏汽车	1,098,453.00	2.22
297	603960	克来机电	1,095,851.00	2.22
298	600019	宝钢股份	1,095,373.00	2.22
299	300014	亿纬锂能	1,093,070.00	2.21
300	603214	爱婴室	1,092,608.00	2.21
301	603456	九洲药业	1,091,347.80	2.21
302	002395	双象股份	1,089,387.00	2.21
303	000006	深振业 A	1,088,336.00	2.20
304	300661	圣邦股份	1,084,789.04	2.20
305	002832	比音勒芬	1,081,895.00	2.19
306	603690	至纯科技	1,081,419.48	2.19
307	600185	格力地产	1,080,246.00	2.19
308	600867	通化东宝	1,074,826.85	2.18
309	000938	紫光股份	1,074,136.20	2.18
310	002382	蓝帆医疗	1,074,058.00	2.18
311	000877	天山股份	1,071,129.00	2.17
312	603508	思维列控	1,070,341.42	2.17
313	300398	飞凯材料	1,069,461.00	2.17
314	002478	常宝股份	1,068,212.24	2.16
315	002307	北新路桥	1,066,156.00	2.16
316	600372	中航电子	1,064,319.00	2.16
317	601872	招商轮船	1,063,380.00	2.15
318	002916	深南电路	1,061,989.80	2.15
319	300308	中际旭创	1,061,469.00	2.15
320	002488	金固股份	1,060,708.00	2.15
321	300144	宋城演艺	1,059,632.00	2.15
322	603929	亚翔集成	1,059,409.00	2.15
323	600373	中文传媒	1,058,489.00	2.14
324	600460	士兰微	1,053,753.00	2.13
325	603779	威龙股份	1,051,392.00	2.13
326	603660	苏州科达	1,049,980.00	2.13
327	600345	长江通信	1,048,553.00	2.12
328	603055	台华新材	1,048,353.00	2.12
329	300294	博雅生物	1,047,500.00	2.12
330	600757	长江传媒	1,046,690.81	2.12
331	600026	中远海能	1,046,322.00	2.12
332	300637	扬帆新材	1,044,419.00	2.12
333	300596	利安隆	1,040,807.50	2.11
334	603357	设计总院	1,039,162.74	2.10
335	601668	中国建筑	1,037,507.00	2.10



336	600661	昂立教育	1,037,400.00	2.10
337	300122	智飞生物	1,037,136.00	2.10
338	002032	苏泊尔	1,036,495.00	2.10
339	002229	鸿博股份	1,036,233.00	2.10
340	002472	双环传动	1,035,581.00	2.10
341	603113	金能科技	1,030,557.00	2.09
342	000796	凯撒旅游	1,030,003.00	2.09
343	600141	兴发集团	1,027,728.60	2.08
344	000011	深物业 A	1,026,555.00	2.08
345	300085	银之杰	1,026,179.00	2.08
346	002606	大连电瓷	1,025,736.00	2.08
347	002124	天邦股份	1,024,558.00	2.07
348	300642	透景生命	1,021,413.00	2.07
349	300569	天能重工	1,019,081.70	2.06
350	002796	世嘉科技	1,015,553.00	2.06
351	000968	蓝焰控股	1,014,533.00	2.05
352	002310	东方园林	1,013,941.54	2.05
353	601990	南京证券	1,013,086.00	2.05
354	002399	海普瑞	1,013,011.40	2.05
355	000039	中集集团	1,012,807.00	2.05
356	000597	东北制药	1,012,555.00	2.05
357	300609	汇纳科技	1,010,085.11	2.05
358	002912	中新赛克	1,006,756.00	2.04
359	000911	南宁糖业	1,004,555.00	2.03
360	300222	科大智能	1,002,016.00	2.03
361	002582	好想你	1,001,727.78	2.03
362	300324	旋极信息	1,001,569.00	2.03
363	300383	光环新网	999,763.00	2.02
364	002341	新纶科技	997,275.00	2.02
365	002321	华英农业	996,735.00	2.02
366	000507	珠海港	989,961.00	2.00
367	002777	久远银海	988,515.00	2.00

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

买入股票的成本（成交）总额	1,228,695,003.83
卖出股票的收入（成交）总额	1,221,688,973.76

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### **8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

#### **8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

#### **8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### **8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### **8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

##### **8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### **8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

#### **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本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受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 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	68,230.24
2	应收证券清算款	68,018.15
3	应收股利	-
4	应收利息	1,685.80
5	应收申购款	380,503.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	518,437.42

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §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
832	75,895.89	50,910,304.78	80.62%	12,235,071.61	19.38%

## 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	28,743.31	0.05%

## 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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017 年 7 月 3 日)基金份额总额	209,788,601.88
本报告期期初基金份额总额	49,389,500.65
本报告期基金总申购份额	47,486,259.72
减：本报告期基金总赎回份额	33,730,383.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	63,145,376.39

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金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

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2018 年 7 月 28 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司副总经理任职公告》，经本基金管理人第七届董事会第十六次会议审议通过，聘任封雪梅女士担任公司副总经理；

2018 年 12 月 13 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第七届董事会第十九次会议审议通过，陈星德先生不再担任公司副总经理。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 60,000 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金证券	2	567,146,767.14	23.15%	414,753.88	22.24%	-
长江证券	1	559,185,571.98	22.82%	408,933.68	21.93%	-
东方证券	1	491,893,443.15	20.07%	359,721.78	19.29%	-
中投证券	1	157,861,391.29	6.44%	115,443.65	6.19%	-
中信建投	3	148,250,751.38	6.05%	113,872.33	6.11%	-
安信证券	1	131,534,194.44	5.37%	122,498.11	6.57%	-
光大证券	1	122,656,069.07	5.01%	89,698.98	4.81%	-
中信证券	1	112,502,524.19	4.59%	104,773.02	5.62%	-
国金证券	1	68,394,726.60	2.79%	50,017.66	2.68%	-
申万宏源	1	61,504,003.68	2.51%	57,279.50	3.07%	-
瑞银证券	1	23,252,108.68	0.95%	22,119.81	1.19%	-
银河证券	1	6,159,540.01	0.25%	5,736.48	0.31%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

#### 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		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	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

## 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 12 月 31 日	19,999,000.00	-	-	19,999,000.00	31.67%
	2	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 29 日	9,999,000.00	-	-	9,999,000.00	15.83%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							