（上接B335版）

7.2.1 资产负债表

会计主体：国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月26日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年12月26日	上年度末 2017年12月31日
资 产：	–	–
银行存款	9,803,267.91	9,033,686.24
结算备付金	1,322,623.31	2,335,418.40
存出保证金	15,622.90	12,341.63
交易性金融资产	39,685,354.00	40,532,770.00
其中：股票投资	39,685,354.00	40,322,870.00
基金投资	–	–
债券投资	–	209,900.00
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	–	–
应收利息	5,943.54	5,040.70
应收股利	–	–
应收申购款	8,355.01	109,445.70
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	50,841,166.67	52,028,702.67
负债和所有者权益	**本期末 2018年12月26日**	**上年度末 2017年12月31日**
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	–	–
应付赎回款	63,286.00	131,376.81
应付管理人报酬	56,077.83	66,083.45
应付托管费	9,346.29	11,013.90
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	111,771.05	65,569.61
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	109,340.97	50,026.16
负债合计	349,802.14	324,069.93
所有者权益：	–	–
实收基金	41,097,883.40	31,107,217.29
未分配利润	9,393,481.13	20,597,425.45
所有者权益合计	51,704,642.74	
负债和所有者权益总计	50,841,166.67	52,028,702.67

注：1.报告截止日2018年12月26日（基金合同失效前日），基金份额净值1.038元，基金份额总额48,640,832.64份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年12月26日（基金合同失效前日）。

7.2.2 利润表

会计主体：国泰策略收益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26日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年12月26日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入		-13,349,909.72	3,568,039.27
1.利息收入		117,516.63	159,489.02
其中：存款利息收入	7.2.4.7.11	103,914.39	96,673.21
债券利息收入		2,164.43	45.67
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		11,437.81	62,770.14
其他利息收入		–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,716,905.70	3,358,737.73
其中：股票投资收益	7.2.4.7.12	-10,218,694.50	3,106,267.35
基金投资收益		–	–
债券投资收益	7.2.4.7.13	41,660.26	45,602.80
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益	7.2.4.7.14	-63,300.00	–
股利收益	7.2.4.7.15	523,429.54	206,867.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.16	-3,811,672.81	-6,468.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.17	61,152.16	56,281.29
减：二、费用		1,577,232.37	1,437,988.02
1. 管理人报酬		756,331.68	732,143.59
2. 托管费		126,055.30	122,023.99
3. 销售服务费		–	–
4. 交易费用	7.2.4.7.18	424,530.78	335,669.93
5. 利息支出		–	–
其中：卖出回购金融资产支出		–	–
6. 税金及附加		4.81	–
7. 其他费用	7.2.4.7.19	270,309.80	248,150.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,927,142.09	2,130,051.25
减：所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,927,142.09	2,130,051.25

7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰策略收益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26日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月26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）	31,107,217.29	20,597,425.45	51,704,642.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-14,927,142.09	-14,927,142.09
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）	9,990,666.11	3,723,197.77	13,713,863.88
其中：1.基金申购款	23,031,597.46	9,999,146.84	33,030,744.30
2.基金赎回款	-13,040,931.35	-6,275,949.07	-19,316,880.42
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）	41,097,883.40	9,393,481.13	50,491,364.53
项目	**上年度可比期间 2017年1月1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）	26,956,410.32	16,333,875.92	43,290,286.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	2,130,051.25	2,130,051.25
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）	4,150,806.97	2,133,498.28	6,284,305.25
其中：1.基金申购款	28,255,980.37	18,768,084.10	47,024,064.47
2.基金赎回款	-24,105,173.40	-16,634,585.82	-40,739,759.22
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）	31,107,217.29	20,597,425.45	51,704,642.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.2.1至7.2.4，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

7.2.4 报表附注

7.2.4.1 基金基本情况

国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由原国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更而来。根据《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》的约定以及本基金的基金管理人发布的《关于国泰目标收益保本混合型证券投资基金保本期提前到期处理规则及变更为国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的公告》，截止2014年12月12日止，国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金份额累计净值收益率已连续15个工作日达到或超过首个保本期的预设目标收益率15%，触发提前到期条款，国泰目标收益保本混合型证券投资基金首个保本期提前到期，保本期到期日为2014年12月29日。首个保本期提前到期后进入过渡期，过渡期为2014年12月30日至2015年1月15日。过渡期结束后的下一日起，国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更为“国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金”。自2015年1月16日起，修订后的《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。本基金存续期限不定，原国泰目标收益保本混合型证券投资基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为76,067,182.62元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值，2015年1月16日本基金折算前的基金份额净值为1.183元，精确到小数点后9位为1.183489886。本基金管理人按照1:1.183489886的折算比例将2015年1月16日登记在册的本基金份额进行了折算。折算后当日，基金份额净值调整为1.0000元，相应地，折算前每1份基金份额将折算为1.183489886份。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰策略收益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，包括国内上市交易的股票(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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资范围为：股票、股指期货、权证等资产占基金资产的30%-80%，债券、货币市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的20%以上，其中，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，本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货的投资比例及限制按照法律法规及中国证监会相关规定执行。本基金的业绩比较基准为：60%X沪深300指数收益率+40%X中证全债指数收益率。

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。

7.2.4.2 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》、《国泰策略收益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7.2.4.4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。

经中国证监会批准，本基金将于基金合同失效日下一日转型为国泰量化策略收益混合型证券投资基金，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为基础编制。

7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年12月26日（基金合同失效前日）期间的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26日（基金合同失效前日）的财务状况以及2018年1月1日至2018年12月26日（基金合同失效前日）期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.2.4.4 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。

7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.2.4.5.1 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。

7.2.4.5.2 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。

7.2.4.5.3 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。

7.2.4.6 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。

7.2.4.7 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、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
申万宏源集团股份有限公司（“申万宏源”）	基金销售机构、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。

7.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.2.4.8.1.1 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26日		上年度可比期间 2017年1月1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	25,001,021.30	8.50%	17,810,909.76	7.71%

7.2.4.8.1.2 债券交易

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26日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
申万宏源	1,092,447.40	9.25%	–	–

7.2.4.8.1.3 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。

7.2.4.8.1.4 权证交易

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权证交易。

7.2.4.8.1.5 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26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	23,283.00	9.04%	15,546.16	13.91%
关联方名称	**上年度可比期间 2017年1月1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	16,587.34	8.17%	10,953.55	16.71%

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。

7.2.4.8.2 关联方报酬

7.2.4.8.2.1 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26日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日-
当期发生的基金应支付的管理费	756,331.68	732,143.59
其中：支付销售机构的客户维护费	168,589.12	236,084.86

注：支付基金管理人国泰基金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×1.50%÷当年天数。

7.2.4.8.2.2 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26日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日-
当期发生的基金应支付的托管费	126,055.30	122,023.99

注：注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.2.4.8.3 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通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.4.8.4.1 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26日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 -
期初持有的基金份额	13,975,541.58	–
期间申购/买入总份额	2,093,925.10	13,975,541.58
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	16,069,466.68	13,975,541.58
期末持有的基金份额占基金总份额比例	33.04%	37.96%

注：1.期间申购总份额含红利再投、转换入份额为2,093,925.10份。

2. 基金管理人国泰基金在本年度申购本基金的交易委托国泰直销办理，适用费率为0.05%。

7.2.4.8.4.2 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。

7.2.4.8.5 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26日		上年度可比期间 2017年1月1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
中国建设银行	9,803,267.91	67,707.24	9,033,686.24	84,535.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.2.4.8.6 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均未通过关联方购买其承销的证券。

7.2.4.8.7 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均无须作说明的其他关联交易事项。

7.2.4.9 期末（2018年12月26日）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.2.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600482	中国动力	2018-12-14	重大事项	22.07	2018-12-28	21.16	39,400.00	891,596.39	869,558.00	–

注：本基金截至2018年12月26日(基金合同失效前日)止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.9.3.1 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。

7.2.4.9.3.2 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。

7.2.4.10 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26日(基金合同失效前日)，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38,815,796.00元，属于第二层次的余额为869,558.00元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次39,909,500.00元，第二层次623,270.00元，无第三层次)。

(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26日(基金合同失效前日)，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 国泰量化策略收益混合型证券投资基金

8.1.1 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	39,637,024.00	78.30
	其中：股票	39,637,024.00	78.30
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	6,088,165.48	12.03
8	其他各项资产	4,897,016.29	9.67
9	合计	50,622,205.77	100.00

8.1.2 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	1,604,476.00	3.19
C	制造业	13,780,704.00	27.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	488,000.00	0.97
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	3,468,875.00	6.90
G	交通运输、仓储和邮政业	1,883,904.00	3.75
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,542,508.00	5.06
J	金融业	13,295,570.00	26.45
K	房地产业	2,572,987.00	5.12
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	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	39,637,024.00	78.86

8.1.3 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	601318	中国平安	68,100	3,820,410.00	7.60
2	600036	招商银行	93,200	2,348,640.00	4.67
3	000651	格力电器	54,400	1,941,536.00	3.86
4	601328	交通银行	330,900	1,915,911.00	3.81
5	601601	中国太保	56,200	1,597,766.00	3.18
6	601211	国泰君安	99,500	1,524,340.00	3.03
7	601818	光大银行	399,000	1,476,300.00	2.94
8	600585	海螺水泥	49,800	1,458,144.00	2.90
9	000338	潍柴动力	179,000	1,378,300.00	2.74
10	601088	中国神华	75,500	1,355,980.00	2.70

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。

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	1,887,898.90	3.76
2	601211	国泰君安	1,508,485.00	3.00
3	000338	潍柴动力	1,375,876.05	2.74
4	600637	东方明珠	1,322,836.14	2.63
5	002007	华兰生物	1,290,825.00	2.56
6	600153	建发股份	1,248,907.00	2.48
7	600340	华夏幸福	1,116,647.42	2.22
8	300122	智飞生物	1,105,241.99	2.20
9	600887	伊利股份	1,000,918.00	1.99
10	600760	中航沈飞	980,817.00	1.95
11	002120	韵达股份	851,296.20	1.69
12	002146	荣盛发展	738,005.00	1.47
13	601607	上海医药	574,140.00	1.14
14	603160	汇顶科技	504,394.00	1.00
15	603288	海天味业	464,630.00	0.92
16	600104	上汽集团	464,348.80	0.92
17	002602	世纪华通	444,835.00	0.89
18	600900	长江电力	428,706.31	0.85
19	601877	正泰电器	349,551.88	0.70
20	601225	陕西煤业	250,561.00	0.50

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。

8.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	1,928,328.22	3.84
2	000001	平安银行	1,507,469.80	3.00
3	600660	福耀玻璃	1,434,017.53	2.85
4	002739	万达电影	1,349,882.00	2.69
5	600795	国电电力	1,151,238.00	2.29
6	000671	阳光城	1,149,987.00	2.29
7	000002	万科A	1,115,250.71	2.22
8	601009	南京银行	794,479.00	1.58
9	600482	中国动力	792,498.00	1.58
10	600309	万华化学	788,577.99	1.57
11	600271	航天信息	769,712.00	1.53
12	603858	步长制药	758,751.70	1.51
13	002304	洋河股份	660,504.04	1.31
14	601998	中信银行	645,795.00	1.28
15	600332	白云山	628,323.68	1.25
16	600038	中直股份	525,298.00	1.05
17	600009	上海机场	513,456.00	1.02
18	600893	航发动力	459,294.00	0.91
19	300124	汇川技术	430,178.00	0.86
20	600219	南山铝业	368,456.00	0.73

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。

8.1.4.3 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	18,685,966.69
卖出股票的收入（成交）总额	18,579,708.62

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。

8.1.5 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。

8.1.6 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。

8.1.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.1.8 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。

8.1.9 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。

8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.10.1 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。

8.1.10.2 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。

8.1.11 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。

8.1.12 投资组合报告附注

8.1.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“招商银行”“交通银行”“光大银行”公告其违规情况外），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。

中国银行保险监督管理委员会于2018年5月4日公布招商银行主要违法违规事实：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。根据以上情况，银保监会做出如下行政处罚决定：罚款6570万元，没收违法所得3.024万元，罚没合计6573.024万元。

交通银行于2018年12月7日收到中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款50万元，违规行为为并购贷款占并购交易价款比例不合规、并购贷款尽职调查和风险评估不到位。12月18日，交通银行收到中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款690万元，违规行为包括（一）不良信贷资产未洁净转让，理财资金投资本行不良信贷资产收益权；（二）未尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产；（三）档案管理不到位，内控管理存在严重漏洞；（四）理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；（五）违规向土地储备机构提供融资；（六）信贷资金违规承接本行表外理财资产；（七）理财资金违规投资项目资本金；（八）部分理财产品信息披露不合规；（九）现场检查配合不力。

光大银行于2018年12月7日收到中国银行保险监督管理委员会公开处罚，没收违法所得100万元，罚款1020万元，合计1120万元。光大银行本次违规行为包括：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）以误导方式违规销售理财产品；（三）以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品；（四）违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务；（五）同业投资违规接受担保；（六）通过同业投资或贷款虚增存款规模。

本基金管理人此前投资招商银行、交通银行、光大银行股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司违规受处罚事件进行了及时分析和研究，认为相关违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

8.1.12.2 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。

8.1.12.3 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	15,622.90
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	5,943.54
5	应收申购款	8,355.01
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	29,921.45

8.1.12.4 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。

8.1.12.5 期末前十名股票中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 国泰量化