

# 中金绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	14
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>52</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	52
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
7.6 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.....	64
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	64
7.8 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.....	64
7.9 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.....	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
7.12 投资组合报告附注.....	65

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>66</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
8.3 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.....	67
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	67
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>67</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>68</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
10.2 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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变.....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8 其他重大事件.....	69
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>70</b>
11.1 备查文件目录.....	70
11.2 存放地点.....	70
11.3 查阅方式.....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	中金绝对收益
基金主代码	001059
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 21 日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	709, 513, 460. 11 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金灵活应用多种绝对收益策略对冲本基金的系统性风险，寻求基金资产的长期稳健增值，以期实现超越业绩比较基准的绝对收益。
投资策略	本基金采用市场中性策略为主的多种绝对收益策略剥离系统风险，力争实现基金资产长期稳定的绝对回报。
业绩比较基准	一年期银行定期存款收益率。
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险，实现基金资产的保值增值，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。

### 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		中金基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜季柳	田青
	联系电话	010-63211122	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		(86) 400-868-1166	010-67595096
传真		(86) 010-66159121	010-66275853
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心

	层	
邮政编码	100032	100033
法定代表人	林寿康	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2015 年 4 月 21 日 - 2015 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	36,219,645.48
本期利润	41,217,321.59
加权平均基金份额本期利润	0.0581
本期加权平均净值利润率	5.72%
本期基金份额净值增长率	5.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2015 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	36,219,645.48
期末可供分配基金份额利润	0.0510
期末基金资产净值	750,730,781.70
期末基金份额净值	1.058
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2015 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	5.80%

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、本报告所列示的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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数。

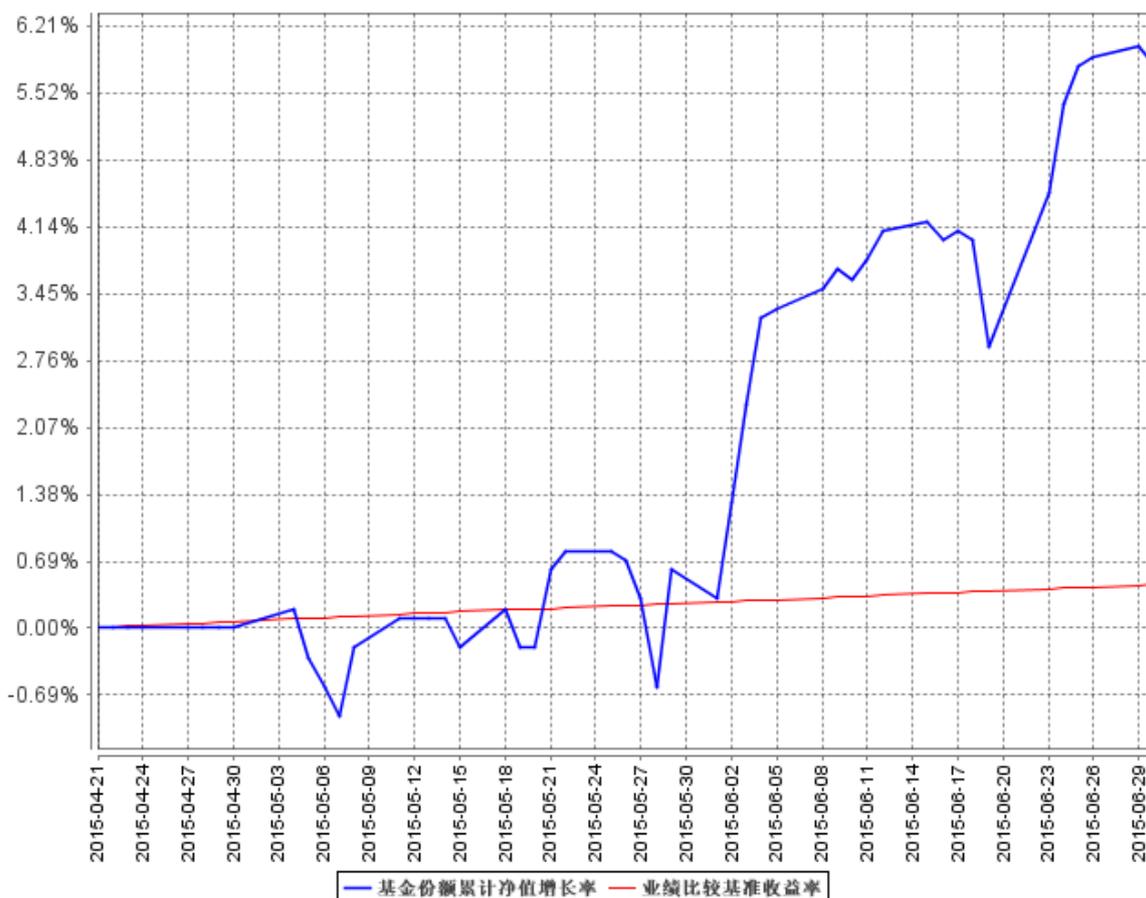
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去一个月	5.17%	0.56%	0.19%	0.01%	4.98%	0.55%
自基金合同生效起至今	5.80%	0.49%	0.45%	0.01%	5.35%	0.48%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日。按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

## § 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

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是证监会批准设立的第 90 家公募基金公司，也是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 1.5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金管理有限公司注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层。公司目前拥有共同基金募集和管理资格、特定客户资产管理业务资格。

截至 2015 年 6 月 30 日，公司旗下管理 4 支开放式基金——中金现金管家货币市场基金、中金纯债债券型证券投资基金、中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金和中金消费升级股票型证券投资基金，证券投资基金管理规模 30.21 亿。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李云琪	本基金的基金经理	2015 年 4 月 21 日	-	8	李云琪先生，工学硕士。历任摩根士丹利信息技术（上海）有限公司固定收益部分析员、经理；中国国际金融有限公司证券投资部经理、高级经理。现任中金基金管理有限公司

					公司量化 公募投资 部基金经 理。
--	--	--	--	--	----------------------------

注：1、任职日期说明：任职日期为基金合同生效日

2、证券从业年限的计算标准：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

3、本基金无基金经理助理

#### 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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定和《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，灵活应用多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险，寻求基金资产的长期稳健增值，以期实现超越业绩比较基准的绝对收益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金自今年 4 月成立以来由于市场处于相对贴水状态，从绝对收益的角度，首先采取了审慎稳健的建仓策略，目的是希望基金保持正收益的前提下稳步增值。进入 5 月份以来，我们抓住基差为正的有利时机开始逐步建仓。我们的统计套利模型表现理想，获得了相对稳健的正收益。

从 5 月底到 6 月中旬，市场情绪波动加大，本基金也抓住有利时机进行了基差套利操作。由于板块风格轮动明显，大小盘的走势经常出现较大的背离。在这种情况下，本基金采用市场中性策略，对于相对大盘策略使用沪深 300 股指期货进行对冲，对于相对小盘策略使用中证 500 股指期货进行对冲。在市场的剧烈风格切换中，较为成功的规避了相关风险，在获得正收益的同时降低了组合的波动率，从而使风险收益比得到提升。

从 6 月中旬开始到 6 月末，受到去杠杆效应的影响，整个市场出现了剧烈的单边下行走势。上证综指在不到一个月的时间内，下跌幅度高达 20% 以上。股指期货出现跌停价格，基差也进入历史罕见的贴水状态。在这种情况下，我们及时的降低了仓位，锁定了基差部分的收益。

下一阶段的操作，本基金将主要着眼于寻找合适的时机增加量化选股模型的仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值为 1.058 元；本基金份额净值增长率为 5.80%，同期业绩比较基准收益率为 0.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管在救市政策的作用下，股市逐渐止跌企稳，未来股市表现的不确定性仍然较大，市场下跌的风险依然不可忽视。我们认为市场的逐渐恢复是一个必然的过程，中国改革开放的良好格局仍在，当前中国经济运行总体平稳，全面深化改革的动力正在逐渐释放。金融环境和货币发行方面，无风险利率持续降低，整个社会财富再配置的需求依然旺盛，金融环境也将更加优化。本基金延续前期的投资理念，在控制风险的基础上追求与市场涨跌无关的绝对收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监督稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

#### 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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	431,200,226.92	-

结算备付金		87,402,466.65	-
存出保证金		4,885,692.75	-
交易性金融资产	6.4.7.2	41,619,378.71	-
其中：股票投资		41,619,378.71	-
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	485,100,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	46,620.85	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,050,254,385.88	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		295,999,486.19	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		604,866.65	-
应付托管费		151,216.67	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,698,426.98	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	69,607.69	-
负债合计		299,523,604.18	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	709,513,460.11	-
未分配利润	6.4.7.10	41,217,321.59	-
所有者权益合计		750,730,781.70	-
负债和所有者权益总计		1,050,254,385.88	-

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.058 元，基金份额总额 709,513,460.11 份。

2、本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，无上年度对比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 4 月 21 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		48,167,640.70	-
1.利息收入		800,397.59	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	202,090.71	-
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		598,306.88	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		42,355,376.73	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	49,916,586.73	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-9,324,991.18	-
股利收益	6.4.7.15	1,763,781.18	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,997,676.11	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,190.27	-
<b>减：二、费用</b>		6,950,319.11	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,382,940.96	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	345,735.24	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	5,144,599.41	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	77,043.50	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		41,217,321.59	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		41,217,321.59	-

注：本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日所有者权益（基金净值）	709,513,460.11	-	709,513,460.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,217,321.59	41,217,321.59
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	709,513,460.11	41,217,321.59	750,730,781.70

注：本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
阚睿

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
孙菁

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
白娜

会计机构负责人

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金(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[2015]144 号《关于准予中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定，定期开放

申购和赎回，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 709,148,033.50 元，业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）毕马威华振验字（2015）第 1500482 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 709,513,460.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 365,426.61 份基金份额。本基金的基金管理人为中金基金，注册登记机构为中金基金，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《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：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），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、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的相关规定）。在正常市场情况下，本基金资产配置的比例范围是：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。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。本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的《企业会计准则》的要求编制。在具体会计核算和信息披露方面，同时亦按照证券投资基金信息披露 XBRL 的模板第 3 号《年度和半年度报告》（中国证监会正式稿）（2014 年 11 月 5 日）和中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则以及中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作规

定的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况及自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动的情况。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1) 金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和衍生工具(主要为股指期货投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### **(2) 金融负债的分类**

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

##### **6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生工具(主要为股指期货投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金(1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且(2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分

别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。在满足基金合同中约定的条件前提下，本基金在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提附加管理费。

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的

差价收入不予征收营业税。

2、对基金从证券市场上取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、自 2013 年 1 月 1 日起，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；持股期限超过一年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。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% 的税率计算个人所得税。

4、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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	431,200,226.92
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	431,200,226.92

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	39,910,373.78	41,619,378.71	1,709,004.93
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	39,910,373.78	41,619,378.71	1,709,004.93
----	---------------	---------------	--------------

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则（试行）》及《企业会计准则—金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具—股指期货投资”与“证券清算款—股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵消的条件，故将“其他衍生工具—股指期货投资”的期货公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

股指期货投资：				2015年6月30日
代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC1507	IC1507	-8	-13,349,760.00	1,167,113.95
IF1507	IF1507	-22	-28,886,880.00	2,121,557.23
总额合计				3,288,671.18
减：可抵销期货暂收款				3,288,671.18
股指期货投资净额				0.00

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	485,100,000.00	-
合计	485,100,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	33,823.89
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	12,689.06
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	107.90
合计	46,620.85

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,698,426.98
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,698,426.98

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	69,607.69
合计	69,607.69

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	709,513,460.11	709,513,460.11
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	709,513,460.11	709,513,460.11

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

(2) 本基金于 2015 年 3 月 23 日至 2015 年 4 月 16 日向社会公开募集，截至 2015 年 4 月 21 日（基金合同生效日）止，募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 709,148,033.50 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 365,426.61 元，以上实收基金合计 709,513,460.11 元，折合为 709,513,460.11 份中金绝对收益策略定期开放基金份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	36,219,645.48	4,997,676.11	41,217,321.59
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,219,645.48	4,997,676.11	41,217,321.59

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	142,289.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	59,443.07
其他	358.04
合计	202,090.71

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,904,653,697.47
减：卖出股票成本总额	1,854,737,110.74
买卖股票差价收入	49,916,586.73

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日
股指期货投资收益	-9,324,991.18

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,763,781.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,763,781.18

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015 年6月30日
1. 交易性金融资产	1,709,004.93
——股票投资	1,709,004.93
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	3,288,671.18
——权证投资	-
——股指期货	3,288,671.18
3. 其他	-
合计	4,997,676.11

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015 年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	14,190.27
合计	14,190.27

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015 年6月30日
交易所市场交易费用	5,032,373.87
银行间市场交易费用	-
股指期货交易费用	112,225.54
合计	5,144,599.41

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	19,490.21
信息披露费	50,117.48
其他	400.00
汇划手续费	7,035.81
合计	77,043.50

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金管理有限公司（中金基金）	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构、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
中国国际金融股份有限公司（中金公司）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：1、本基金本报告期关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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
中金公司	3,798,465,390.99	100.00%	-	-

本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，无上年度可比期间数据。

## 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

## 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至 2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
中金公司	11,402,300,000.00	100.00%	-	-

本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30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
中金公司	2,698,426.98	100.00%	2,698,426.98	100.00%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险金后的净额列示。

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服务信息。

3、本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，无上年度可比期间数据。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,382,940.96	-
其中：支付销售机构的客户维护费	774,665.17	-

注：1、支付基金管理人中金基金管理有限公司的基本管理费按前一日基金资产净值 1%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：日基本管理费=前一日基金资产净值×1%/当年天数。

#### 2、基金管理人的附加管理费

1) 基金管理人可在同时满足以下条件的前提下，提取附加管理费：

①符合基金收益分配条件；

②附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照“新高法原则”提取超额收益的 10%作为附加管理费：即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，基金管理人才能收取附加管理费。

提取评价日：每个基金封闭期的最后一个工作日。

#### 2) 附加管理费的计算方法和提取

在每个提取评价日，在同时满足以上附加管理费提取条件的情况下，附加管理费的计算方法为：

$$\text{附加管理费} = (\text{PA} - \text{PH}) \times 10\% \times \text{SA}$$

其中：

PA 为提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值；

PH 为以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，其中首次封闭期的 PH 为 1；

SA 为提取评价日的基金总份额数。

3、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，本基金本报告期支付销售服务机构的客户维护费为 774,665.17 元，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

4、本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	345,735.24	-

注：1、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。  
2、本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期无销售服务费。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中金公司	10,000,350.00	1.4100%	-	-

本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，无上年度对比数据。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	431,200,226.92	142,289.60	-	-

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。  
 2、本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于 2015 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 28,436,704.94 元。  
 3、本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 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 (股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
600886	国投电力	2015-06-24	重大 事项 停牌	14.87	-	-	212,614	2,717,924.59	3,161,570.18	-
002703	浙江世宝	2015-05-29	重大 事项 停牌	52.01	-	-	25,817	1,033,149.07	1,342,742.17	-

000668	荣丰控股	2015-05-25	重大 事项 停牌	34.79	-	-	38,450	998,757.70	1,337,675.50	-
600167	联美控股	2015-05-27	重大 事项 停牌	25.76	-	-	50,832	1,037,050.55	1,309,432.32	-
300144	宋城演艺	2015-06-18	重大 事项 停牌	76.47	2015-07-20	68.82	16,530	1,315,888.52	1,264,049.10	-
600097	开创国际	2015-06-05	重大 事项 停牌	30.40	-	-	41,398	739,049.72	1,258,499.20	-
601633	长城汽车	2015-06-19	重大 事项 停牌	42.76	2015-07-13	38.50	26,571	1,270,444.83	1,136,175.96	-
600137	浪莎股份	2015-05-29	重大 事项 停牌	43.84	2015-08-25	-	22,400	727,619.00	982,016.00	-
000539	粤电力A	2015-06-08	重大 事项 停牌	11.94	2015-07-21	10.75	82,199	725,681.35	981,456.06	-
000066	长城	2015-06-18	重大	21.54	-	-	37,212	820,124.64	801,546.48	-

	电脑		事项停牌							
002292	奥飞动漫	2015-05-18	重大 事项 停牌	37.85	-	-	16,900	610,279.00	639,665.00	-
600879	航天电子	2015-05-15	重大 事项 停牌	24.50	-	-	23,756	529,001.55	582,022.00	-
002647	宏磊股份	2015-06-05	重大 事项 停牌	35.40	-	-	14,700	416,726.74	520,380.00	-
002620	瑞和股份	2015-06-09	重大 事项 停牌	58.49	2015-08-13	52.55	8,088	293,533.45	473,067.12	-
600061	中纺投资	2015-06-08	重大 事项 停牌	37.82	2015-07-20	34.04	11,784	356,943.48	445,670.88	-
600393	东华实业	2015-06-18	重大 事项 停牌	17.61	2015-07-01	15.85	19,400	302,026.43	341,634.00	-
600277	亿利能源	2015-06-01	重大 事项	14.62	-	-	19,695	259,696.35	287,940.90	-

			停牌							
600410	华胜天成	2015-05-28	重大 事项 停牌	47.84	2015-07-22	43.06	5,217	211,474.24	249,581.28	-
000691	亚太实业	2015-05-12	重大 事项 停牌	10.13	2015-08-19	9.12	20,951	209,495.62	212,233.63	-
002354	天神娱乐	2015-05-28	重大 事项 停牌	96.97	2015-07-23	87.27	2,000	208,994.00	193,940.00	-
300195	长荣股份	2015-06-23	重大 事项 停牌	31.96	2015-08-24	28.76	5,500	181,518.50	175,780.00	-
000672	上峰水泥	2015-06-03	重大 事项 停牌	12.05	-	-	13,223	136,637.11	159,337.15	-
002591	恒大高新	2015-06-24	重大 事项 停牌	19.95	2015-07-17	17.96	7,600	161,039.58	151,620.00	-
002530	丰东股份	2015-06-08	重大 事项 停牌	23.71	-	-	6,295	108,301.92	149,254.45	-

300320	海达股份	2015-06-23	重大 事项 停牌	18.70	2015-07-13	16.83	7,800	144,864.00	145,860.00	-
600778	友好集团	2015-06-02	重大 事项 停牌	16.10	-	-	8,840	115,643.62	142,324.00	-
300346	南大光电	2015-06-25	重大 事项 停牌	35.49	-	-	3,900	137,229.00	138,411.00	-
603017	园区设计	2015-06-23	重大 事项 停牌	58.51	-	-	2,200	129,623.00	128,722.00	-
000963	华东医药	2015-06-26	重大 事项 停牌	71.48	2015-08-05	69.20	1,786	132,444.81	127,663.28	-
000732	泰禾集团	2015-06-25	重大 事项 停牌	34.20	2015-07-02	30.78	3,550	111,676.55	121,410.00	-
000761	本钢板材	2015-06-23	重大 事项 停牌	7.75	2015-07-21	6.93	15,200	119,742.00	117,800.00	-
000862	银星	2015-05-21	重大	11.81	2015-08-18	11.22	9,500	103,472.00	112,195.00	-

	能源		事项停牌							
002416	爱施德	2015-05-05	重大 事项 停牌	20.67	2015-07-29	18.60	5,260	103,002.07	108,724.20	-
002200	云投生态	2015-05-29	重大 事项 停牌	27.07	2015-07-17	24.36	3,972	103,960.12	107,522.04	-
300266	兴源环境	2015-06-03	重大 事项 停牌	55.23	-	-	1,815	91,923.83	100,242.45	-
000716	黑芝麻	2015-06-08	重大 事项 停牌	23.69	2015-08-03	21.32	4,107	91,661.36	97,294.83	-
300255	常山药业	2015-06-03	重大 事项 停牌	34.71	2015-07-13	31.24	2,413	67,934.39	83,755.23	-
002045	国光电器	2015-06-01	重大 事项 停牌	13.92	2015-07-14	12.53	5,826	69,843.07	81,097.92	-
002209	达意隆	2015-06-08	重大 事项	26.54	2015-07-13	23.89	2,768	66,870.98	73,462.72	-

			停牌							
002662	京威股份	2015-05-15	重大 事项 停牌	17.84	2015-08-13	16.06	4,000	72,387.00	71,360.00	-
300047	天源迪科	2015-06-03	重大 事项 停牌	35.88	2015-07-30	32.29	1,950	57,877.00	69,966.00	-
600622	嘉宝集团	2015-05-26	重大 事项 停牌	13.86	2015-07-02	12.47	4,630	58,615.80	64,171.80	-
000679	大连友谊	2015-05-28	重大 事项 停牌	16.48	-	-	3,648	45,003.78	60,119.04	-
601718	际华集团	2015-06-17	重大 事项 停牌	15.12	2015-07-02	13.61	3,936	45,316.65	59,512.32	-
002688	金河生物	2015-06-02	重大 事项 停牌	29.70	2015-07-14	26.73	2,000	46,706.43	59,400.00	-
601877	正泰电器	2015-05-18	重大 事项 停牌	30.62	-	-	1,938	58,063.15	59,341.56	-

300411	金盾股份	2015-06-08	重大 事项 停牌	53.68	-	-	1,022	50,601.05	54,860.96	-
600462	石岷纸业	2015-05-20	重大 事项 停牌	13.22	-	-	4,100	53,382.00	54,202.00	-
002545	东方铁塔	2015-05-19	重大 事项 停牌	26.79	-	-	2,000	50,556.00	53,580.00	-
600395	盘江股份	2015-06-09	重大 事项 停牌	15.71	2015-08-19	14.00	3,067	41,602.29	48,182.57	-
002091	江苏国泰	2015-06-01	重大 事项 停牌	26.22	-	-	1,800	44,945.00	47,196.00	-
002682	龙洲股份	2015-06-25	重大 事项 停牌	29.70	2015-07-03	21.83	1,550	44,083.00	46,035.00	-
300116	坚瑞消防	2015-06-23	重大 事项 停牌	15.62	2015-07-03	9.36	2,900	46,754.00	45,298.00	-
000903	云内	2015-06-02	重大	12.39	2015-07-27	11.10	3,643	38,943.67	45,136.77	-

	动力		事项停牌							
300057	万顺股份	2015-06-03	重大 事项 停牌	26.26	2015-07-20	23.63	1,700	40,671.00	44,642.00	-
000839	中信国安	2015-06-29	重大 事项 停牌	23.57	-	-	1,869	50,182.62	44,052.33	-
002012	凯恩股份	2015-05-28	重大 事项 停牌	14.00	2015-07-01	12.60	3,100	37,276.00	43,400.00	-
002278	神开股份	2015-05-26	重大 事项 停牌	16.09	-	-	2,645	39,373.00	42,558.05	-
300112	万讯自控	2015-06-24	重大 事项 停牌	22.07	-	-	1,900	40,806.00	41,933.00	-
603939	益丰药方	2015-06-08	重大 事项 停牌	99.88	2015-08-17	89.89	390	37,346.61	38,953.20	-
300249	依米康	2015-05-29	重大 事项	35.00	2015-08-17	31.50	1,100	37,554.00	38,500.00	-

			停牌							
002003	伟星股份	2015-06-05	重大 事项 停牌	16.17	-	-	2,340	31,096.21	37,837.80	-
002043	兔宝宝	2015-06-01	重大 事项 停牌	12.84	-	-	2,900	32,001.00	37,236.00	-
002336	人人乐	2015-06-09	重大 事项 停牌	25.53	2015-08-06	22.98	1,446	26,711.76	36,916.38	-
002438	江苏神通	2015-05-25	重大 事项 停牌	32.56	-	-	1,100	34,362.00	35,816.00	-
000608	阳光股份	2015-05-25	重大 事项 停牌	8.23	2015-08-21	7.41	4,300	32,804.00	35,389.00	-
002309	中利科技	2015-06-02	重大 事项 停牌	33.39	2015-07-21	30.05	1,044	30,369.96	34,859.16	-
002329	皇氏集团	2015-06-12	重大 事项 停牌	69.48	2015-08-13	62.53	500	32,030.00	34,740.00	-

002649	博彦科技	2015-06-01	重大 事项 停牌	83.81	2015-08-18	75.43	400	34,147.00	33,524.00	-
002398	建研集团	2015-06-08	重大 事项 停牌	28.49	2015-07-01	25.64	1,173	30,631.59	33,418.77	-
603998	方盛制药	2015-05-28	重大 事项 停牌	65.11	2015-07-01	58.60	500	24,964.00	32,555.00	-
002511	中顺洁柔	2015-06-01	重大 事项 停牌	14.18	2015-07-14	12.76	2,287	30,241.16	32,429.66	-
002109	兴化股份	2015-05-08	重大 事项 停牌	8.54	-	-	3,700	34,669.00	31,598.00	-
002741	光华科技	2015-06-02	重大 事项 停牌	70.04	2015-08-05	63.04	446	28,007.02	31,237.84	-
600654	飞乐股份	2015-06-29	重大 事项 停牌	30.91	-	-	990	38,495.39	30,600.90	-
002147	方圆	2015-06-01	重大	17.90	-	-	1,300	23,790.00	23,270.00	-

	支承		事项停牌							
600763	通策医疗	2015-05-25	重大 事项 停牌	110.36	-	-	200	18,394.00	22,072.00	-
002589	瑞康医药	2015-05-21	重大 事项 停牌	104.25	-	-	200	21,510.00	20,850.00	-
000543	皖能电力	2015-06-15	重大 事项 停牌	21.36	2015-07-14	19.22	900	18,936.00	19,224.00	-
600753	东方银星	2015-06-01	重大 事项 停牌	37.01	2015-08-05	33.31	500	16,603.00	18,505.00	-
600094	大名城	2015-06-26	重大 事项 停牌	20.25	2015-08-05	18.23	800	17,618.00	16,200.00	-
600074	*ST 中达	2015-06-26	重大 事项 停牌	20.92	-	-	700	15,204.00	14,644.00	-
002223	鱼跃医疗	2015-06-25	重大 事项	67.20	2015-07-13	60.48	200	13,040.00	13,440.00	-

			停牌							
002574	明牌珠宝	2015-06-04	重大 事项 停牌	22.90	-	-	567	8,961.60	12,984.30	-
600310	桂东电力	2015-06-30	重大 事项 停牌	31.53	2015-07-13	34.68	400	16,494.00	12,612.00	-
601021	春秋航空	2015-06-26	重大 事项 停牌	126.09	2015-07-21	113.48	100	12,341.54	12,609.00	-
600211	西藏药业	2015-05-22	重大 事项 停牌	60.12	2015-08-11	54.11	200	11,090.00	12,024.00	-
000592	平潭发展	2015-06-30	重大 事项 停牌	29.76	2015-07-14	30.00	400	17,187.00	11,904.00	-
600312	平高电气	2015-06-23	重大 事项 停牌	22.58	-	-	500	12,200.00	11,290.00	-
000665	湖北广电	2015-05-25	重大 事项 停牌	27.90	-	-	400	11,004.00	11,160.00	-

600807	天业股份	2015-06-30	重大 事项 停牌	21.31	2015-08-14	19.18	500	13,787.00	10,655.00	-
001696	宗申动力	2015-06-30	重大 事项 停牌	17.25	2015-08-24	15.53	607	14,390.89	10,470.75	-
300084	海默科技	2015-06-03	重大 事项 停牌	21.43	2015-07-20	19.29	474	7,803.99	10,157.82	-
300028	金亚科技	2015-06-10	重大 事项 停牌	34.51	-	-	289	11,915.48	9,973.39	-
002069	獐子岛	2015-06-01	重大 事项 停牌	19.76	-	-	500	10,190.00	9,880.00	-
300421	力星股份	2015-05-26	重大 事项 停牌	46.31	2015-07-14	41.68	200	8,450.00	9,262.00	-
002522	浙江众成	2015-06-23	重大 事项 停牌	30.60	2015-07-13	27.54	300	9,180.00	9,180.00	-
600641	万业	2015-06-12	重大	11.23	-	-	800	9,032.00	8,984.00	-

	企业		事项停牌							
600676	交运股份	2015-05-27	重大 事项 停牌	19.76	2015-07-07	17.78	429	7,003.42	8,477.04	-
600335	国机汽车	2015-06-15	重大 事项 停牌	37.93	2015-07-21	34.14	200	6,670.00	7,586.00	-
000567	海德股份	2015-06-17	重大 事项 停牌	33.71	2015-08-06	30.34	225	7,306.76	7,584.75	-
300184	力源信息	2015-06-08	重大 事项 停牌	25.94	-	-	290	7,824.20	7,522.60	-
601789	宁波建工	2015-06-15	重大 事项 停牌	18.80	2015-08-13	16.81	400	6,788.00	7,520.00	-
300071	华谊嘉信	2015-05-21	重大 事项 停牌	13.66	-	-	540	7,647.00	7,376.40	-
002183	怡亚通	2015-06-01	重大 事项	73.15	-	-	100	7,206.00	7,315.00	-

			停牌							
300190	维尔利	2015-05-25	重大 事项 停牌	34.34	-	-	200	6,939.00	6,868.00	-
600139	西部 资源	2015-06-08	重大 事项 停牌	22.12	-	-	300	6,588.00	6,636.00	-
002369	卓翼 科技	2015-06-03	重大 事项 停牌	20.03	-	-	300	5,449.00	6,009.00	-
600333	长春 燃气	2015-05-29	重大 事项 停牌	11.97	2015-07-09	10.77	500	6,385.00	5,985.00	-
002445	中南 重工	2015-06-02	重大 事项 停牌	57.80	-	-	100	5,431.00	5,780.00	-
000683	远兴 能源	2015-06-15	重大 事项 停牌	11.52	2015-08-18	10.37	500	5,050.00	5,760.00	-
300031	宝通 带业	2015-06-11	重大 事项 停牌	22.82	-	-	200	4,362.00	4,564.00	-

300360	炬华科技	2015-06-15	重大 事项 停牌	44.08	-	-	100	3,887.00	4,408.00	-
601003	柳钢股份	2015-06-16	重大 事项 停牌	7.20	-	-	600	3,900.00	4,320.00	-
300048	合康变频	2015-06-01	重大 事项 停牌	21.29	-	-	200	4,390.00	4,258.00	-
002166	莱茵生物	2015-05-25	重大 事项 停牌	40.49	2015-07-02	36.44	100	3,983.00	4,049.00	-
002242	九阳股份	2015-06-15	重大 事项 停牌	19.45	2015-07-07	17.51	200	3,760.00	3,890.00	-
300161	华中数控	2015-05-22	重大 事项 停牌	38.20	-	-	100	3,888.00	3,820.00	-
600113	浙江东日	2015-06-16	重大 事项 停牌	18.08	2015-07-08	16.27	200	3,730.00	3,616.00	-
300291	华录	2015-06-30	重大	37.76	2015-07-13	34.65	95	4,998.04	3,587.20	-

	百纳		事项停牌							
000558	莱茵置业	2015-06-15	重大 事项 停牌	32.80	2015-07-13	29.52	100	3,152.00	3,280.00	-
002605	姚记扑克	2015-06-16	重大 事项 停牌	29.01	-	-	96	2,515.20	2,784.96	-
600531	豫光金铅	2015-06-11	重大 事项 停牌	27.53	2015-07-03	24.78	100	2,636.00	2,753.00	-
000519	江南红箭	2015-06-15	重大 事项 停牌	26.06	-	-	100	2,418.00	2,606.00	-
000889	茂业物流	2015-06-03	重大 事项 停牌	23.00	2015-08-04	20.70	100	2,125.00	2,300.00	-
002214	大立科技	2015-06-15	重大 事项 停牌	20.90	-	-	100	1,994.00	2,090.00	-
002375	亚厦股份	2015-06-17	重大 事项	29.21	2015-07-20	26.29	52	1,568.00	1,518.92	-

			停牌						
--	--	--	----	--	--	--	--	--	--

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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余额。

#### 6.4.12.3.2 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余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为特殊的混合型基金，通过多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险，实现基金资产的保值增值，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险等。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制控制在合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面，一是基金份额持有人在本基金开放期可随时要求赎回其持有的基金份额，二是来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。本基金在开放期保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。本基金所持有的大部分证券在证券交易所交易，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险；市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理

方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	431,200,226.92	-	-	-	431,200,226.92
结算备付金	87,402,466.65	-	-	-	87,402,466.65
存出保证金	4,885,692.75	-	-	-	4,885,692.75
交易性金融资产-股票 投资	-	-	-	41,619,378.71	41,619,378.71
交易性金融资产-债券 投资	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	485,100,000.00	-	-	-	485,100,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	46,620.85	46,620.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	1,008,588,386.32	-	-	41,665,999.56	1,050,254,385.88
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	295,999,486.19	295,999,486.19
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	604,866.65	604,866.65
应付托管费	-	-	-	151,216.67	151,216.67
应付交易费用	-	-	-	2,698,426.98	2,698,426.98
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	69,607.69	69,607.69
负债总计	-	-	-	299,523,604.18	299,523,604.18
利率敏感度缺口	1,008,588,386.32	-	-	-257,857,604.62	750,730,781.70

注：1、表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2、本基金合同生效日为2015年4月21日，无上年度对比数据。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用市场中性策略为主的多种绝对收益策略剥离系统风险，力争实现基金资产长期稳定的绝对回报。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：权益类空头头寸的价值占权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	41,619,378.71	5.54
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	41,619,378.71	5.54

本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，无上年度对比数据。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

**6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无

**§ 7 投资组合报告****7.1 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	41,619,378.71	3.96
	其中：股票	41,619,378.71	3.96
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	485,100,000.00	46.19
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	518,602,693.57	49.38
7	其他各项资产	4,932,313.60	0.47
8	合计	1,050,254,385.88	100.00

**7.2 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,248,761.24	0.30
B	采矿业	568,066.39	0.08
C	制造业	19,658,823.04	2.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,963,843.18	0.93
E	建筑业	1,416,657.04	0.19
F	批发和零售业	2,623,520.70	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	751,153.74	0.10
H	住宿和餐饮业	19,485.00	0.00

I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,316,751.23	0.31
J	金融业	23,814.00	0.00
K	房地产业	2,809,950.68	0.37
L	租赁和商务服务业	20,398.40	0.00
M	科学研究和技术服务业	162,140.77	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	207,172.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	22,072.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,795,525.30	0.24
S	综合	11,244.00	0.00
	合计	41,619,378.71	5.54

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600886	国投电力	212,614	3,161,570.18	0.42
2	002703	浙江世宝	25,817	1,342,742.17	0.18
3	000668	荣丰控股	38,450	1,337,675.50	0.18
4	600167	联美控股	50,832	1,309,432.32	0.17
5	300144	宋城演艺	16,530	1,264,049.10	0.17
6	600097	开创国际	41,398	1,258,499.20	0.17
7	002153	石基信息	8,874	1,153,531.26	0.15
8	601633	长城汽车	26,571	1,136,175.96	0.15
9	600648	外高桥	28,300	992,764.00	0.13
10	600137	浪莎股份	22,400	982,016.00	0.13
11	000539	粤电力A	82,199	981,456.06	0.13
12	002475	立讯精密	26,000	879,060.00	0.12
13	600519	贵州茅台	3,400	876,010.00	0.12
14	000803	金宇车城	32,425	851,804.75	0.11
15	000066	长城电脑	37,212	801,546.48	0.11
16	002696	百洋股份	36,800	797,456.00	0.11
17	000961	中南建设	39,500	788,815.00	0.11
18	600900	长江电力	53,920	773,752.00	0.10

19	002634	棒杰股份	21,601	684,751.70	0.09
20	600350	山东高速	77,000	659,120.00	0.09
21	002292	奥飞动漫	16,900	639,665.00	0.09
22	600879	航天电子	23,756	582,022.00	0.08
23	002647	宏磊股份	14,700	520,380.00	0.07
24	600768	宁波富邦	21,230	492,536.00	0.07
25	002620	瑞和股份	8,088	473,067.12	0.06
26	600061	中纺投资	11,784	445,670.88	0.06
27	002113	天润控股	14,200	389,506.00	0.05
28	600306	商业城	23,100	386,694.00	0.05
29	601801	皖新传媒	13,100	382,127.00	0.05
30	000710	天兴仪表	16,143	345,298.77	0.05
31	600393	东华实业	19,400	341,634.00	0.05
32	600028	中国石化	46,100	325,466.00	0.04
33	600758	红阳能源	17,859	288,958.62	0.04
34	600277	亿利能源	19,695	287,940.90	0.04
35	600410	华胜天成	5,217	249,581.28	0.03
36	600578	京能热电	25,900	231,287.00	0.03
37	002034	美欣达	5,655	226,200.00	0.03
38	600985	雷鸣科化	10,146	225,545.58	0.03
39	300073	当升科技	8,300	222,772.00	0.03
40	000691	亚太实业	20,951	212,233.63	0.03
41	002584	西陇化工	5,775	211,365.00	0.03
42	002354	天神娱乐	2,000	193,940.00	0.03
43	600241	时代万恒	13,200	192,060.00	0.03
44	600421	*ST 国药	11,700	182,871.00	0.02
45	600619	海立股份	12,700	182,118.00	0.02
46	300195	长荣股份	5,500	175,780.00	0.02
47	002180	艾派克	3,800	167,200.00	0.02
48	600770	综艺股份	8,400	164,136.00	0.02
49	002692	远程电缆	7,479	159,601.86	0.02
50	000672	上峰水泥	13,223	159,337.15	0.02
51	002591	恒大高新	7,600	151,620.00	0.02
52	002530	丰东股份	6,295	149,254.45	0.02
53	300320	海达股份	7,800	145,860.00	0.02
54	600778	友好集团	8,840	142,324.00	0.02
55	300346	南大光电	3,900	138,411.00	0.02
56	603017	园区设计	2,200	128,722.00	0.02
57	000963	华东医药	1,786	127,663.28	0.02

58	000732	泰禾集团	3,550	121,410.00	0.02
59	000761	本钢板材	15,200	117,800.00	0.02
60	002725	跃岭股份	5,000	115,200.00	0.02
61	300336	新文化	4,800	114,432.00	0.02
62	002169	智光电气	4,300	114,208.00	0.02
63	000983	西山煤电	12,000	113,760.00	0.02
64	000501	鄂武商 A	5,500	112,750.00	0.02
65	000862	银星能源	9,500	112,195.00	0.01
66	300086	康芝药业	4,100	110,700.00	0.01
67	300342	天银机电	3,000	109,950.00	0.01
68	002416	爱施德	5,260	108,724.20	0.01
69	603369	今世缘	2,900	107,561.00	0.01
70	002200	云投生态	3,972	107,522.04	0.01
71	300266	兴源环境	1,815	100,242.45	0.01
72	000716	黑芝麻	4,107	97,294.83	0.01
73	600378	天科股份	4,400	90,904.00	0.01
74	300174	元力股份	3,200	87,424.00	0.01
75	300423	鲁亿通	2,100	85,659.00	0.01
76	300255	常山药业	2,413	83,755.23	0.01
77	002045	国光电器	5,826	81,097.92	0.01
78	002102	冠福股份	5,700	77,748.00	0.01
79	603288	海天味业	2,400	76,656.00	0.01
80	002317	众生药业	2,700	76,113.00	0.01
81	002059	云南旅游	6,200	75,206.00	0.01
82	002372	伟星新材	4,200	74,634.00	0.01
83	300375	鹏翎股份	2,800	73,612.00	0.01
84	002177	御银股份	5,100	73,542.00	0.01
85	002209	达意隆	2,768	73,462.72	0.01
86	002677	浙江美大	4,600	73,140.00	0.01
87	002662	京威股份	4,000	71,360.00	0.01
88	002609	捷顺科技	3,500	70,000.00	0.01
89	300047	天源迪科	1,950	69,966.00	0.01
90	002121	科陆电子	2,300	69,069.00	0.01
91	600706	曲江文旅	3,200	67,072.00	0.01
92	002691	石中装备	3,300	66,429.00	0.01
93	600262	北方股份	1,700	65,331.00	0.01
94	300324	旋极信息	2,300	65,297.00	0.01
95	600622	嘉宝集团	4,630	64,171.80	0.01
96	600532	宏达矿业	3,600	63,864.00	0.01

97	300106	西部牧业	2,500	63,500.00	0.01
98	002709	天赐材料	1,600	62,992.00	0.01
99	002205	国统股份	2,300	62,974.00	0.01
100	300103	达刚路机	2,500	61,600.00	0.01
101	600864	哈投股份	3,800	61,560.00	0.01
102	300108	双龙股份	3,600	61,272.00	0.01
103	300236	上海新阳	1,900	60,230.00	0.01
104	000679	大连友谊	3,648	60,119.04	0.01
105	300335	迪森股份	3,500	59,640.00	0.01
106	601718	际华集团	3,936	59,512.32	0.01
107	002688	金河生物	2,000	59,400.00	0.01
108	601877	正泰电器	1,938	59,341.56	0.01
109	300117	嘉寓股份	5,300	58,088.00	0.01
110	600292	中电远达	1,900	58,026.00	0.01
111	300234	开尔新材	2,700	57,726.00	0.01
112	002117	东港股份	1,700	56,933.00	0.01
113	300330	华虹计通	2,800	56,056.00	0.01
114	002324	普利特	1,600	55,520.00	0.01
115	600694	大商股份	1,000	55,280.00	0.01
116	002244	滨江集团	3,000	55,230.00	0.01
117	300411	金盾股份	1,022	54,860.96	0.01
118	002124	天邦股份	2,700	54,540.00	0.01
119	600462	石岷纸业	4,100	54,202.00	0.01
120	002545	东方铁塔	2,000	53,580.00	0.01
121	300067	安诺其	4,700	53,204.00	0.01
122	300286	安科瑞	1,700	50,813.00	0.01
123	300109	新开源	700	49,686.00	0.01
124	600480	凌云股份	2,100	49,476.00	0.01
125	300270	中威电子	2,700	49,302.00	0.01
126	300321	同大股份	500	49,135.00	0.01
127	002483	润邦股份	2,800	49,000.00	0.01
128	600395	盘江股份	3,067	48,182.57	0.01
129	000860	顺鑫农业	2,100	48,111.00	0.01
130	002091	江苏国泰	1,800	47,196.00	0.01
131	002572	索菲亚	1,214	46,896.82	0.01
132	002682	龙洲股份	1,550	46,035.00	0.01
133	002265	西仪股份	2,500	45,500.00	0.01
134	300116	坚瑞消防	2,900	45,298.00	0.01
135	000903	云内动力	3,643	45,136.77	0.01

136	300057	万顺股份	1,700	44,642.00	0.01
137	600313	中农资源	2,500	44,200.00	0.01
138	000839	中信国安	1,869	44,052.33	0.01
139	002356	浩宁达	1,800	43,974.00	0.01
140	601579	会稽山	2,300	43,861.00	0.01
141	002012	凯恩股份	3,100	43,400.00	0.01
142	600148	长春一东	1,800	43,326.00	0.01
143	002278	神开股份	2,645	42,558.05	0.01
144	300112	万讯自控	1,900	41,933.00	0.01
145	000056	深国商	1,400	41,776.00	0.01
146	603368	柳州医药	500	41,060.00	0.01
147	600064	南京高科	2,100	40,950.00	0.01
148	600129	太极集团	1,500	40,830.00	0.01
149	300378	鼎捷软件	500	40,570.00	0.01
150	002053	云南盐化	1,400	40,194.00	0.01
151	300091	金通灵	1,000	39,800.00	0.01
152	603997	继峰股份	1,600	39,664.00	0.01
153	603939	益丰药方	390	38,953.20	0.01
154	603268	松发股份	900	38,574.00	0.01
155	300249	依米康	1,100	38,500.00	0.01
156	002003	伟星股份	2,340	37,837.80	0.01
157	000023	深天地A	1,500	37,500.00	0.00
158	002043	兔宝宝	2,900	37,236.00	0.00
159	600764	中电广通	1,600	36,960.00	0.00
160	002336	人人乐	1,446	36,916.38	0.00
161	002134	天津普林	2,800	36,764.00	0.00
162	600823	世茂股份	2,800	36,484.00	0.00
163	600062	华润双鹤	1,400	36,456.00	0.00
164	002438	江苏神通	1,100	35,816.00	0.00
165	000608	阳光股份	4,300	35,389.00	0.00
166	002532	新界泵业	1,800	35,370.00	0.00
167	603766	隆鑫通用	1,400	35,140.00	0.00
168	002405	四维图新	800	35,040.00	0.00
169	002309	中利科技	1,044	34,859.16	0.00
170	002329	皇氏集团	500	34,740.00	0.00
171	002056	横店东磁	1,100	34,408.00	0.00
172	600976	武汉健民	1,000	34,040.00	0.00
173	300292	吴通通讯	1,000	33,830.00	0.00
174	002649	博彦科技	400	33,524.00	0.00

175	002398	建研集团	1,173	33,418.77	0.00
176	002150	通润装备	2,300	32,568.00	0.00
177	603998	方盛制药	500	32,555.00	0.00
178	002511	中顺洁柔	2,287	32,429.66	0.00
179	002109	兴化股份	3,700	31,598.00	0.00
180	002741	光华科技	446	31,237.84	0.00
181	600654	飞乐股份	990	30,600.90	0.00
182	300226	上海钢联	371	30,051.00	0.00
183	000902	新洋丰	1,100	29,865.00	0.00
184	000977	浪潮信息	1,000	29,550.00	0.00
185	002650	加加食品	1,700	29,359.00	0.00
186	000421	南京中北	2,600	29,276.00	0.00
187	300398	飞凯材料	400	28,292.00	0.00
188	600392	盛和资源	1,100	28,061.00	0.00
189	600328	兰太实业	1,800	27,900.00	0.00
190	300153	科泰电源	2,200	27,698.00	0.00
191	002350	北京科锐	1,200	27,576.00	0.00
192	603030	全筑股份	800	27,296.00	0.00
193	300066	三川股份	1,700	26,809.00	0.00
194	601116	三江购物	1,900	26,429.00	0.00
195	603019	中科曙光	300	25,977.00	0.00
196	002651	利君股份	600	25,920.00	0.00
197	600657	信达地产	3,100	25,544.00	0.00
198	600213	亚星客车	1,900	25,384.00	0.00
199	002243	通产丽星	1,800	24,840.00	0.00
200	600651	飞乐音响	1,200	24,684.00	0.00
201	600999	招商证券	900	23,814.00	0.00
202	002713	东易日盛	700	23,520.00	0.00
203	300081	恒信移动	500	23,400.00	0.00
204	300334	津膜科技	800	23,320.00	0.00
205	002147	方圆支承	1,300	23,270.00	0.00
206	000823	超声电子	1,700	22,882.00	0.00
207	002328	新朋股份	1,600	22,400.00	0.00
208	000819	岳阳兴长	600	22,146.00	0.00
209	600763	通策医疗	200	22,072.00	0.00
210	002597	金禾实业	1,800	22,014.00	0.00
211	000419	通程控股	2,000	21,960.00	0.00
212	002273	水晶光电	700	21,875.00	0.00
213	600571	信雅达	200	21,170.00	0.00

214	002515	金字火腿	900	20,925.00	0.00
215	002589	瑞康医药	200	20,850.00	0.00
216	002452	长高集团	2,000	20,780.00	0.00
217	300428	四通新材	400	20,680.00	0.00
218	002556	辉隆股份	1,000	20,010.00	0.00
219	000838	国兴地产	900	19,827.00	0.00
220	000524	岭南控股	900	19,485.00	0.00
221	002111	威海广泰	600	19,404.00	0.00
222	000543	皖能电力	900	19,224.00	0.00
223	300299	富春通信	700	18,606.00	0.00
224	600753	东方银星	500	18,505.00	0.00
225	600543	莫高股份	1,200	18,492.00	0.00
226	300223	北京君正	500	17,800.00	0.00
227	600452	涪陵电力	700	17,759.00	0.00
228	300034	钢研高纳	500	17,745.00	0.00
229	600594	益佰制药	300	17,439.00	0.00
230	600420	现代制药	400	17,400.00	0.00
231	601016	节能风电	600	17,316.00	0.00
232	002105	信隆实业	1,600	17,280.00	0.00
233	300372	欣泰电气	900	16,902.00	0.00
234	600100	同方股份	800	16,792.00	0.00
235	600094	大名城	800	16,200.00	0.00
236	300194	福安药业	600	15,870.00	0.00
237	002487	大金重工	1,200	15,840.00	0.00
238	300337	银邦股份	600	15,828.00	0.00
239	002579	中京电子	1,000	15,800.00	0.00
240	600611	大众交通	900	14,985.00	0.00
241	002312	三泰控股	400	14,984.00	0.00
242	600287	江苏舜天	1,000	14,680.00	0.00
243	600074	*ST 中达	700	14,644.00	0.00
244	002721	金一文化	200	14,002.00	0.00
245	002129	中环股份	700	13,853.00	0.00
246	600332	广州药业	400	13,784.00	0.00
247	600582	天地科技	800	13,672.00	0.00
248	002223	鱼跃医疗	200	13,440.00	0.00
249	600776	东方通信	800	13,192.00	0.00
250	002098	浔兴股份	900	13,185.00	0.00
251	002574	明牌珠宝	567	12,984.30	0.00
252	300107	建新股份	1,500	12,930.00	0.00

253	300069	金利华电	300	12,900.00	0.00
254	300201	海伦哲	800	12,720.00	0.00
255	600310	桂东电力	400	12,612.00	0.00
256	601021	春秋航空	100	12,609.00	0.00
257	002693	双成药业	900	12,420.00	0.00
258	000681	视觉中国	300	12,318.00	0.00
259	002032	苏泊尔	500	12,305.00	0.00
260	002014	永新股份	500	12,110.00	0.00
261	002576	通达动力	400	12,076.00	0.00
262	600211	西藏药业	200	12,024.00	0.00
263	600704	物产中大	500	11,940.00	0.00
264	000592	平潭发展	400	11,904.00	0.00
265	002131	利欧股份	200	11,702.00	0.00
266	600297	美罗药业	600	11,514.00	0.00
267	000505	珠江控股	800	11,448.00	0.00
268	600312	平高电气	500	11,290.00	0.00
269	000702	正虹科技	900	11,250.00	0.00
270	600783	鲁信创投	300	11,244.00	0.00
271	002631	德尔家居	400	11,212.00	0.00
272	600570	恒生电子	100	11,205.00	0.00
273	000665	湖北广电	400	11,160.00	0.00
274	000158	常山股份	500	10,950.00	0.00
275	600067	冠城大通	1,100	10,912.00	0.00
276	002335	科华恒盛	300	10,854.00	0.00
277	600612	老凤祥	200	10,708.00	0.00
278	300399	京天利	74	10,664.88	0.00
279	600807	天业股份	500	10,655.00	0.00
280	001696	宗申动力	607	10,470.75	0.00
281	002216	三全食品	700	10,290.00	0.00
282	002314	雅致股份	800	10,256.00	0.00
283	600970	中材国际	700	10,234.00	0.00
284	002047	宝鹰股份	800	10,224.00	0.00
285	600387	海越股份	400	10,208.00	0.00
286	300084	海默科技	474	10,157.82	0.00
287	600862	南通科技	400	10,156.00	0.00
288	600894	广日股份	500	9,980.00	0.00
289	300028	金亚科技	289	9,973.39	0.00
290	002069	獐子岛	500	9,880.00	0.00
291	002611	东方精工	700	9,765.00	0.00

292	002254	泰和新材	600	9,660.00	0.00
293	300421	力星股份	200	9,262.00	0.00
294	002522	浙江众成	300	9,180.00	0.00
295	300132	青松股份	800	9,064.00	0.00
296	600641	万业企业	800	8,984.00	0.00
297	000595	宝塔实业	700	8,925.00	0.00
298	002551	尚荣医疗	200	8,678.00	0.00
299	603788	宁波高发	200	8,498.00	0.00
300	600676	交运股份	429	8,477.04	0.00
301	002666	德联集团	300	8,340.00	0.00
302	002482	广田股份	300	8,190.00	0.00
303	002126	银轮股份	400	8,064.00	0.00
304	002247	帝龙新材	300	7,860.00	0.00
305	002699	美盛文化	200	7,852.00	0.00
306	600335	国机汽车	200	7,586.00	0.00
307	000567	海德股份	225	7,584.75	0.00
308	300184	力源信息	290	7,522.60	0.00
309	601789	宁波建工	400	7,520.00	0.00
310	000555	神州信息	100	7,480.00	0.00
311	300071	华谊嘉信	540	7,376.40	0.00
312	002492	恒基达鑫	470	7,336.70	0.00
313	002183	怡亚通	100	7,315.00	0.00
314	002307	北新路桥	500	6,920.00	0.00
315	300190	维尔利	200	6,868.00	0.00
316	600139	西部资源	300	6,636.00	0.00
317	002478	常宝股份	400	6,556.00	0.00
318	002369	卓翼科技	300	6,009.00	0.00
319	600333	长春燃气	500	5,985.00	0.00
320	002582	好想你	200	5,832.00	0.00
321	002445	中南重工	100	5,780.00	0.00
322	000683	远兴能源	500	5,760.00	0.00
323	000062	深圳华强	100	5,707.00	0.00
324	000965	天保基建	500	5,420.00	0.00
325	002614	蒙发利	300	5,349.00	0.00
326	002275	桂林三金	200	5,112.00	0.00
327	600588	用友软件	100	4,588.00	0.00
328	300031	宝通带业	200	4,564.00	0.00
329	600782	新钢股份	600	4,542.00	0.00
330	300360	炬华科技	100	4,408.00	0.00

331	601003	柳钢股份	600	4,320.00	0.00
332	300048	合康变频	200	4,258.00	0.00
333	002166	莱茵生物	100	4,049.00	0.00
334	002242	九阳股份	200	3,890.00	0.00
335	300161	华中数控	100	3,820.00	0.00
336	600113	浙江东日	200	3,616.00	0.00
337	300291	华录百纳	95	3,587.20	0.00
338	600503	华丽家族	200	3,480.00	0.00
339	300165	天瑞仪器	100	3,477.00	0.00
340	000558	莱茵置业	100	3,280.00	0.00
341	601608	中信重工	200	3,260.00	0.00
342	002605	姚记扑克	96	2,784.96	0.00
343	600531	豫光金铅	100	2,753.00	0.00
344	000519	江南红箭	100	2,606.00	0.00
345	300013	新宁物流	100	2,591.00	0.00
346	002442	龙星化工	200	2,546.00	0.00
347	000889	茂业物流	100	2,300.00	0.00
348	002420	毅昌股份	200	2,258.00	0.00
349	002214	大立科技	100	2,090.00	0.00
350	600981	汇鸿股份	100	1,746.00	0.00
351	002375	亚厦股份	52	1,518.92	0.00
352	002060	粤水电	100	1,242.00	0.00
353	002195	二三四五	8	332.48	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	601166	兴业银行	30,401,601.40	4.05
2	601398	工商银行	29,081,113.60	3.87
3	601288	农业银行	28,242,212.95	3.76
4	600036	招商银行	26,753,895.30	3.56
5	600015	华夏银行	26,074,877.36	3.47
6	600000	浦发银行	25,502,115.26	3.40
7	600016	民生银行	25,219,353.60	3.36
8	000402	金融街	24,502,190.62	3.26

9	600011	华能国际	20,573,327.75	2.74
10	600030	中信证券	18,224,429.43	2.43
11	601668	中国建筑	18,048,096.80	2.40
12	601318	中国平安	17,969,025.80	2.39
13	600048	保利地产	15,181,350.80	2.02
14	600027	华电国际	15,006,083.57	2.00
15	600066	宇通客车	14,869,034.49	1.98
16	600823	世茂股份	14,808,621.06	1.97
17	601818	光大银行	14,725,113.00	1.96
18	000651	格力电器	13,657,845.90	1.82
19	600104	上汽集团	13,182,878.37	1.76
20	600050	中国联通	12,945,692.95	1.72

#### 7.4.2 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	601166	兴业银行	30,337,938.05	4.04
2	601398	工商银行	29,116,657.43	3.88
3	601288	农业银行	28,274,833.51	3.77
4	600036	招商银行	27,437,440.54	3.65
5	600015	华夏银行	26,757,086.73	3.56
6	600000	浦发银行	25,648,360.88	3.42
7	000402	金融街	25,334,745.81	3.37
8	600016	民生银行	24,928,938.47	3.32
9	600011	华能国际	22,255,432.30	2.96
10	601318	中国平安	18,185,649.12	2.42
11	600030	中信证券	18,061,946.06	2.41
12	601668	中国建筑	18,045,214.05	2.40
13	600027	华电国际	16,207,809.97	2.16
14	601818	光大银行	15,299,942.15	2.04
15	600048	保利地产	14,739,494.12	1.96
16	600823	世茂股份	14,665,600.88	1.95
17	600066	宇通客车	14,570,349.43	1.94
18	000651	格力电器	14,376,623.32	1.92
19	601988	中国银行	13,018,187.51	1.73

20	600050	中国联通	12,877,685.09	1.72
----	--------	------	---------------	------

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,894,647,484.52
卖出股票收入（成交）总额	1,904,653,697.47

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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。

### 7.6 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。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1507	IC1507	-8	-13,349,760.00	1,167,113.95	-
IF1507	IF1507	-22	-28,886,880.00	2,121,557.23	-
公允价值变动总额合计（元）					3,288,671.18
股指期货投资本期收益（元）					-9,324,991.18
股指期货投资本期公允价值变动（元）					3,288,671.18

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金利用股指期货与股票现货组合之间进行对冲，并通过量化模型，寻找最优的股指期货

对冲工具构建整个组合，从而剥离现货组合的系统性风险，仅保留现货组合相对于期货组合的超额收益，力争在牛市和熊市中均为投资者获取稳健的正向收益。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本报告期本基金投资的前十名证券的发行主体，除荣丰控股（000668）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2014年8月29日，荣丰控股因“1、资产认购协议、对外财务资助未履行董事会审议程序，也未及时履行披露义务；2、重大合作协议未及时履行披露义务”受到深圳证券交易所的通报批评处分。由于本基金采用量化模型选股，加之产品在6月末保持低仓位，而荣丰控股自5月22号起停牌无法交易，客观上造成持仓占比被动增加。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 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	4,885,692.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	46,620.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,932,313.60

### 7.12.4 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处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600886	国投电力	3,161,570.18	0.42	重大事项停牌
2	002703	浙江世宝	1,342,742.17	0.18	重大事项停牌
3	000668	荣丰控股	1,337,675.50	0.18	重大事项停牌
4	600167	联美控股	1,309,432.32	0.17	重大事项停牌
5	300144	宋城演艺	1,264,049.10	0.17	重大事项停牌
6	600097	开创国际	1,258,499.20	0.17	重大事项停牌
7	601633	长城汽车	1,136,175.96	0.15	重大事项停牌
8	600137	浪莎股份	982,016.00	0.13	重大事项停牌

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
6,216	114,143.09	21,996,607.95	3.10%	687,516,852.16	96.90%

### 8.2 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	148,634.10	0.02%

**8.3 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

**8.4 发起式基金发起资金持有份额情况**

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	49,516.20	0.01	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	10,000,350.00	1.41	10,000,350.00	1.41	三年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,049,866.20	1.42	10,000,350.00	1.41	-

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2015年4月21日）基金份额总额	709,513,460.11
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	709,513,460.11

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
中金公司	2	3,798,465,390.99	100.00%	-	-	-

注：1、报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

2、本基金管理人负责选择证券经营结构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营结构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	-	-	11,402,300,000.00	100.00%	-	-

**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金新增国信证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015年3月24日
2	关于中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金新增齐鲁证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015年4月1日
3	关于中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金新增华西证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015年4月2日
4	关于中金绝对收益策略定期开放	中国证监会指定报	2015年4月9日

	混合型发起式证券投资基金新增平安银行为销售机构的公告	刊及公司网站	
5	中金基金管理有限公司网上交易系统暂停服务公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015 年 6 月 3 日
6	中金基金管理有限公司关于建设银行电子银行系统升级的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015 年 6 月 8 日
7	中金基金管理有限公司关于网上直销身份认证系统升级的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015 年 6 月 12 日
8	中金基金管理有限公司关于网上直销开通招商银行借记卡支付的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015 年 6 月 24 日
9	中金基金管理有限公司关于建设银行电子银行系统升级的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015 年 6 月 26 日
10	中金基金管理有限公司关于建设银行电子银行系统升级的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015 年 7 月 3 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中金基金管理有限公司  
2015 年 8 月 26 日