

# 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 年年度报告

2015 年 12 月 31 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：2016 年 3 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2015 年 4 月 21 日起至 2015 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 10        |
| 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.....             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 11        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 12        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 12        |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....       | 12        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 13        |
| 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..... | 13        |
| 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.....      | 13        |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>13</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 13        |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 13        |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>14</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 14        |
| 7.2 利润表.....                                 | 16        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 17        |
| 7.4 报表附注.....                                | 17        |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | <b>39</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 39        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 39        |
| 8.3 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.....       | 40        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 42        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 47        |
| 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.....      | 47        |
| 8.7 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.....   | 47        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 47        |
| 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 .....    | 48        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 48        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 48        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 48        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>49</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 49        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 49        |
| 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 .....     | 50        |
| 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 50        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>50</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>51</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 51        |
| 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 .....      | 51        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 51        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 51        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 51        |
| 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 .....         | 51        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 52        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 53        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                     | <b>55</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 55        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 56        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 56        |

## § 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 | 295,363,453.50 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                          |
|--------|---------------------|-------------------------------|
| 会计师事务所 | 毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层  |
| 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、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 | 2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日 |
| 本期已实现收益       | 33,192,444.17                             |
| 本期利润          | 33,055,672.67                             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0578                                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 5.56%                                     |
| 本期基金份额净值增长率   | 4.50%                                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末                                   |
| 期末可供分配利润      | 13,403,537.52                             |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0454                                    |
| 期末基金资产净值      | 308,766,991.02                            |
| 期末基金份额净值      | 1.045                                     |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2015 年末                                   |
| 基金份额累计净值增长率   | 4.50%                                     |

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；
- 4、本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

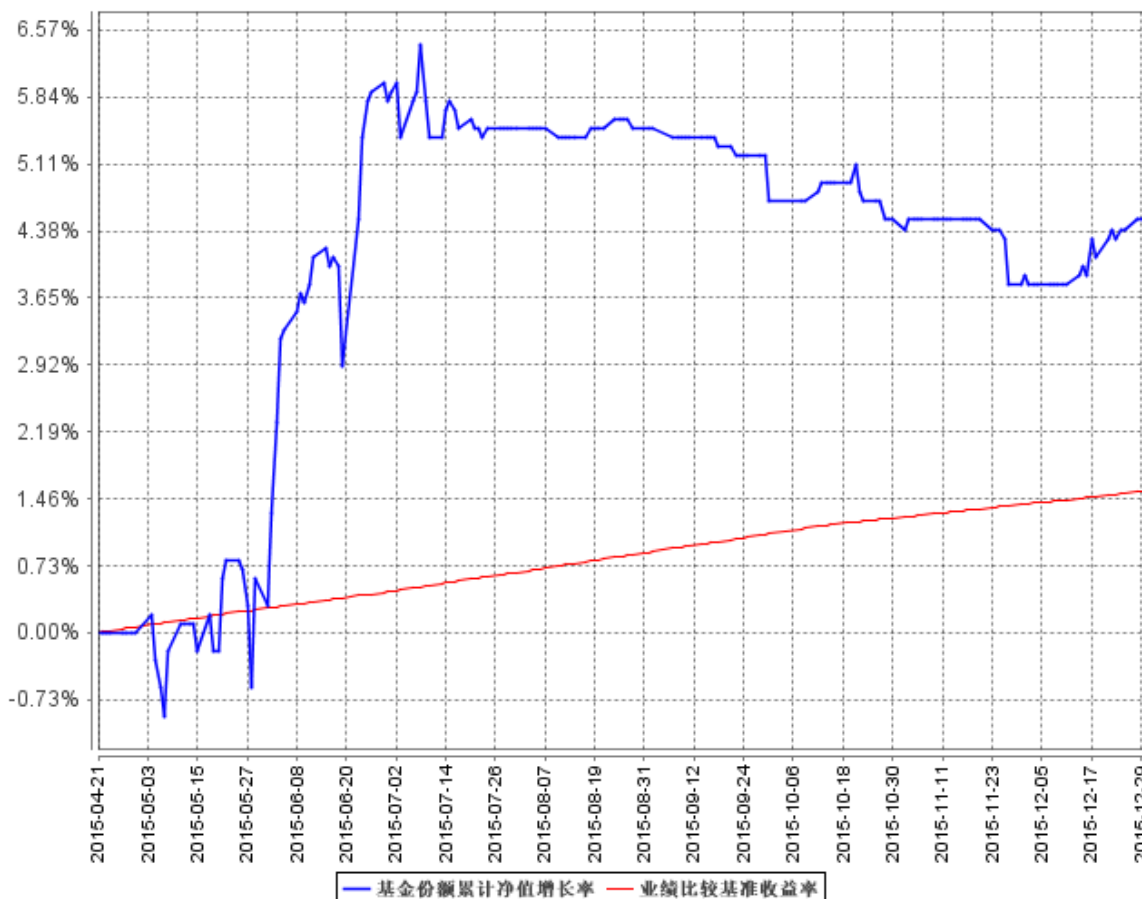
### 3.2 基金净值表现

#### 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      | -0.19%   | 0.11%       | 0.46%      | 0.01%         | -0.65% | 0.10% |
| 过去六个月      | -1.23%   | 0.14%       | 1.10%      | 0.01%         | -2.33% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.50%    | 0.29%       | 1.55%      | 0.01%         | 2.95%  | 0.28% |

#### 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

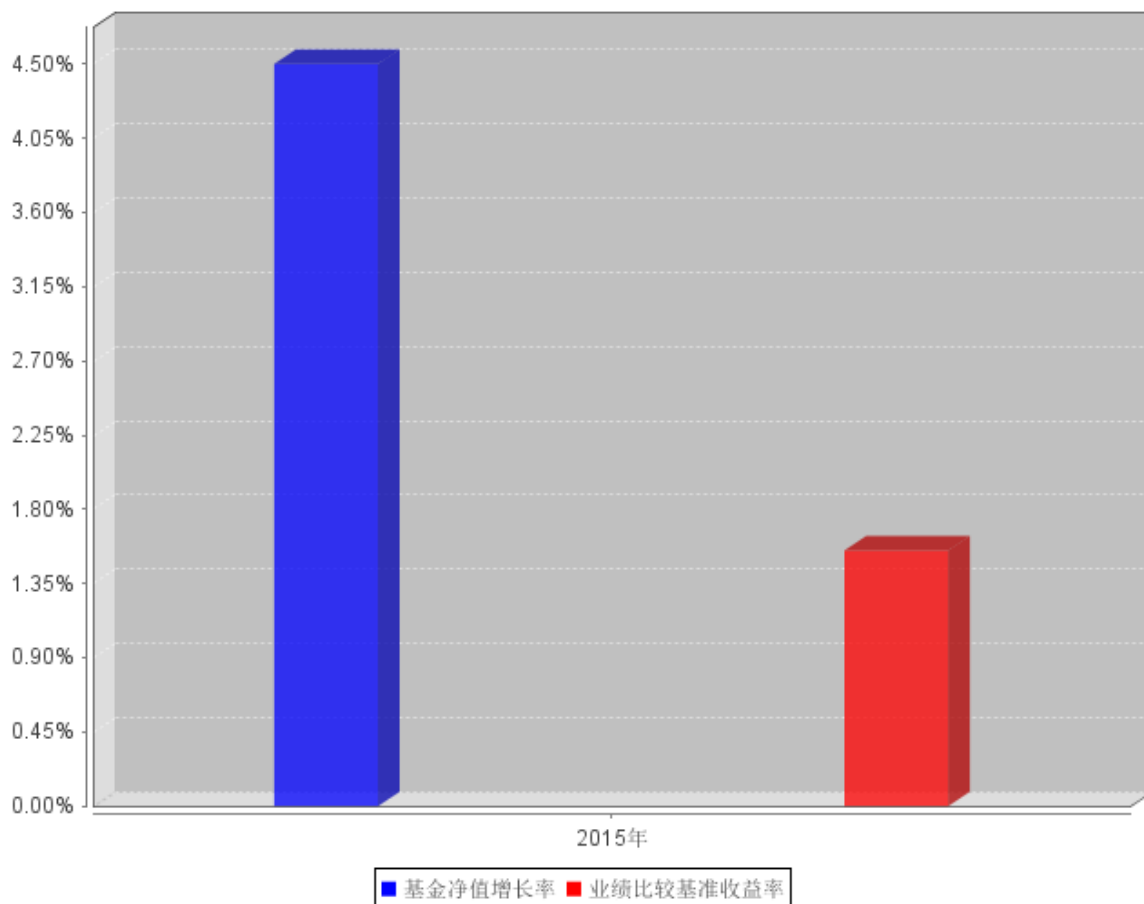
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日。按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

### 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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，合同生效当年按实际存续期计算，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

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，自成立以来本基金未进行收益分配。



## § 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

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）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 2.00 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。

截至 2015 年 12 月 31 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 51.43 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；中国国际金融股份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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益行为。

## 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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《中金基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施效果评估、信息披露与报告制度等多方面进行了规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，公司建立了科学合理的投资运作体系和规范的投资流程，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

从 2015 年 4 月 21 日本基金成立初至 2015 年 6 月份，A 股市场屡创新高，市场波动较大，本基金的量化对冲策略表现理想，获得了相对稳健的正收益。但是随着市场在 6 月份之后开始大幅波动，证监会以及交易所陆续出台了平抑市场波动的若干措施，尤其是中金所出台的对于股指期货的若干监管措施对本基金构成了较大影响，使得基金的调仓难度和获取超额收益的难度也随之加大。尤其是在 10 月份，按照合同约定和最新交易规则，本基金被迫进行了相关的建仓操作，从而承受了一定的基差风险并造成了一定的净值回撤。总体而言，进入下半年以来，由于受到股指持续负基差，以及期货市场低流动性的影响，结合绝对收益类产品相对稳健的投资理念，在实际操作的时候我们始终保持相对谨慎，权益类仓位在绝大多数时间内保持较低比例。

### 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 1.045 元；本基金份额净值增长率为 4.50%，同期业绩比较基准收益率为 1.55%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，中国宏观经济依然较为疲弱，考虑到 2016 年市场风险因素较多，比如人民币汇率走势、大股东减持解禁、美联储加息导致全球资金波动、地缘政治等，我们预期市场的不确定性增强。尽管我们对量化策略做出了相应的调整以应对目前绝对收益类产品的相关政策和合同限制，总体而言，受到负基差和期货市场流动性减弱的影响，本基金的短期操作难度加大。但是我们相信市场的创新不会因一时的波动而停滞，相关政策的放开是必然的趋势。绝对收益类作为投资者资产配置的重要资产类别还是有其独特性和稀缺性，从基金的长期投资的角度来说，值得投资者长期关注并持有。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人进一步健全了风险控制和监察稽核机制，根据不同的基金特点与发展情况，及时界定新的风险点，评价风险级别，并纳入稽核计划。

首先本基金管理人以中国证监会“季度监察稽核项目表”为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查。在持续关注“季

度监察稽核项目”表中识别的风险点进行自查的同时，还定期进行有重点的检查。在研究投资交易环节，本基金管理人对投资对象建立筛选流程、对投资对象池（库）进行日常维护与更新，并对基金的投资比例进行日常监控，对关联交易的日常维护，对基金持仓流动性风险定期关注，并对公平交易执行情况进行检查等等；在营销与销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值业务的检查来确保本基金财务数据的准确性；在法律合规方面，本基金管理人对公司制度规范、合同协议、产品方案、对外文件等进行合规性审核。本基金管理人对监察稽核工作流程进行了完善和优化，并按照既定的稽核计划开展内部稽核，对检查出来的问题及时提出改进意见并督促相关部门有效落实。

本报告期内，本基金管理人严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露内容的真实、准确、完整、及时。

#### **4.7 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、中和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、监察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验。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。

#### **4.8 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。

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

本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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                  |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见            |
| 审计报告编号     | 毕马威华振审字第 1600912 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题       | 审计报告   |
|--------------|--|
| 审计报告收件人      | 中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 引言段          | 我们审计了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“该基金”)财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表,自 2015 年 4 月 21 日(基金成立日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是该基金管理人中金基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务                                   |

|           |  |
|-----------|--|
|           | 报表, 并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。   |
| 注册会计师的责任段 | <p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 审计意见段     | 我们认为, 该基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和以财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制, 公允反映了该基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2015 年 4 月 21 日 (基金成立日) 至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。  |
| 注册会计师的姓名  | 程海良 黄艾舟  |
| 会计师事务所的名称 | 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)  |
| 会计师事务所的地址 | 中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层  |
| 审计报告日期    | 2016 年 3 月 24 日  |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产:</b> |         |                         |                          |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 201, 772, 387. 13       | -                        |
| 结算备付金      |         | 95, 466, 420. 69        | -                        |
| 存出保证金      |         | 2, 480, 275. 06         | -                        |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 10, 089, 513. 99        | -                        |
| 其中: 股票投资   |         | 10, 089, 513. 99        | -                        |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 基金投资            |            | -                          | -                           |
| 债券投资            |            | -                          | -                           |
| 资产支持证券投资        |            | -                          | -                           |
| 贵金属投资           |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 24,078.28                  | -                           |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | -                          | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 309,832,675.15             | -                           |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>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          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                          | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 25.07                      | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 261,061.30                 | -                           |
| 应付托管费           |            | 65,265.32                  | -                           |
| 应付销售服务费         |            | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 489,332.44                 | -                           |
| 应交税费            |            | -                          | -                           |
| 应付利息            |            | -                          | -                           |
| 应付利润            |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 250,000.00                 | -                           |
| 负债合计            |            | 1,065,684.13               | -                           |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 295,363,453.50             | -                           |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | 13,403,537.52              | -                           |
| 所有者权益合计         |            | 308,766,991.02             | -                           |
| 负债和所有者权益总计      |            | 309,832,675.15             | -                           |

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.045 元，基金份额总额 295,363,453.50 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。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号        | 本期<br>2015 年 4 月 21 日(基<br>金合同生效日)至<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|------------|---|--|
| <b>一、收入</b>                |            | 46,616,864.24   | -  |
| 1. 利息收入                    |            | 3,575,103.62  | -  |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.11   | 1,181,444.59  | -  |
| 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                 |            | 2,393,659.03  | -  |
| 其他利息收入                     |            | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 41,981,165.56   | -  |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12   | 35,104,735.39   | -  |
| 基金投资收益                     |            | -   | -  |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13   | -   | -  |
| 资产支持证券投资收益                 | 7.4.7.13.5 | -   | -  |
| 贵金属投资收益                    |            | -   | -  |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.14   | 5,059,744.62  | -  |
| 股利收益                       | 7.4.7.15   | 1,816,685.55  | -  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.16   | -136,771.50   | -  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.17   | 1,197,366.56  | -  |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 13,561,191.57   | -  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 7,870,472.13  | -  |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 1,045,250.53  | -  |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | -   | -  |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.18   | 4,377,817.05  | -  |
| 5. 利息支出                    |            | -   | -  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -   | -  |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.19   | 267,651.86  | -  |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 33,055,672.67   | -  |
| 减：所得税费用                    |            | -   | -  |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 33,055,672.67   | -  |

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。



### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 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）                        | 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）               | -  | 33,055,672.67  | 33,055,672.67   |
| 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）      | -414,150,006.61                                  | -19,652,135.15 | -433,802,141.76 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 37,658,549.74                                    | 1,807,114.12   | 39,465,663.86   |
| 2. 基金赎回款                               | -451,808,556.35                                  | -21,459,249.27 | -473,267,805.62 |
| 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）                        | 295,363,453.50                                   | 13,403,537.52  | 308,766,991.02  |

注：本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，无上年度对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |            |           |
|-----------|------------|-----------|
| <u>孙菁</u> | <u>杜季柳</u> | <u>白娜</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人  | 会计机构负责人   |

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 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”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2015 年 1 月 28 日证监许可 [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》及配套规则和《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》公开募集。本基金为混合型发起式证券投资基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

本基金通过管理人中金基金直销柜台、建设银行、平安银行股份有限公司、中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）、华西证券股份有限公司、国信证券股份有限公司及齐鲁证券股份有限公司共同销售，募集期为 2015 年 3 月 23 日至 2015 年 4 月 16 日。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，合同生效日基金实收份额为 709,513,460.11 份（含利息转份额 365,426.61 份），发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

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。

#### 7.4.2 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 模板第 3 号《年度和半年度报告》（证监会正式稿）（2015 年 12 月 22 日）和中国证券投资基金业协会于 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则以及附注所述的中国证监会和中国证券投资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 12 月 31 日的财务状况及自 2015 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金财务报表的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表是本基金的首份财务报表，涵盖期间为自 2015 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。本基金编制财务报表采用的货币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别：交易性金融资产和金融负债、应收款项和其他金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征，并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。使用的估值技术主要包括市场法、收益法和成本法。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 / (累计亏损) ”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益 / (损失) 于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产利息收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

股票投资收益 / (损失) 于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账。

衍生工具收益 / (损失) 于卖出衍生工具成交日确认, 并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账。

股利收益于除息日确认, 并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。

公允价值变动收益 / (损失) 系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

根据《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》的规定, 本基金的基本管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率逐日确认。本基金可在同时满足以下条件的前提下, 提取附加管理费: (a) 符合基金收益分配条件; (b) 附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并提取, 提取投资收益的 10% 作为附加管理费。

根据《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》的规定, 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日确认。

本基金的交易费用于交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额, 在回购期内以实际利率法逐日确认, 直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金每年收益分配次数最多为 4 次, 每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日该次单位可供分配利润的 20%, 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配; 本基金收益分配方式为现金分红; 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值, 即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值; 每一基金份额享有同等分配权; 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额, 不足于支付银行转账或其他手续费用时, 基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。

#### 7.4.4.12 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 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证券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或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）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《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发〔2014〕24号），本基金自2015年4月21日起，对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格进行估值。

#### 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

无

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无

### 7.4.5.3 差错更正的说明

无

### 7.4.6 税项

根据财税字 [1998] 55 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税 [2002] 128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (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。
- (2) 基金买卖债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。
- (4) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 201,772,387.13          |
| 定期存款           | -                       |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                       |
| 其他存款           | -                       |
| 合计：            | 201,772,387.13          |

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。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |      |        |
|----|-------------------------|------|--------|
|    | 成本                      | 公允价值 | 公允价值变动 |
|    |                         |      |        |

|               |       |               |               |           |
|---------------|-------|---------------|---------------|-----------|
| 股票            |       | 10,025,460.87 | 10,089,513.99 | 64,053.12 |
| 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            |       | 10,025,460.87 | 10,089,513.99 | 64,053.12 |

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。

#### 7.4.7.3 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 12 月 31 日 |
| 代码         | 名称     | 持仓量(买/卖) | 合约市值          | 公允价值变动           |
| IH1601     | IH1601 | -12      | -8,652,960.00 | -200,824.62      |
| 总额合计       |        |          |               | -200,824.62      |
| 减:可抵销期货暂付款 |        |          |               | -200,824.62      |
| 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

|          |                         |
|----------|-------------------------|
| 项目       | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
| 应收活期存款利息 | 18,684.32               |
| 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  | 5,065.72  |
| 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         | 328.24    |
| 合计         | 24,078.28 |

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。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 489,332.44              |
| 银行间市场应付交易费用 | -                       |
| 合计          | 489,332.44              |

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。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       |
| 应付赎回费       | -                       |
| 预提费用        | 250,000.00              |
| 合计          | 250,000.00              |

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。

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

| 项目            | 本期<br>2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 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          | 37,658,549.74                                    | 37,658,549.74   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -451,808,556.35                                  | -451,808,556.35 |
| - 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           | 295,363,453.50 | 295,363,453.50 |

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 份基金份额。

### 7.4.7.10 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           | 33,192,444.17  | -136,771.50 | 33,055,672.67  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -18,985,283.10 | -666,852.05 | -19,652,135.15 |
| 其中：基金申购款       | 1,750,177.27   | 56,936.85   | 1,807,114.12   |
| 基金赎回款          | -20,735,460.37 | -723,788.90 | -21,459,249.27 |
| 本期已分配利润        | -              | -           | -              |
| 本期末            | 14,207,161.07  | -803,623.55 | 13,403,537.52  |

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月<br>31 日 |
|-----------|---|
| 活期存款利息收入  | 574,971.17  |
| 定期存款利息收入  | 327,333.33  |
| 其他存款利息收入  | -   |
| 结算备付金利息收入 | 272,630.78  |
| 其他        | 6,509.31  |
| 合计        | 1,181,444.59  |

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。

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 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 12 月 31 日 |
|-------------|--|
| 卖出股票成交总额    | 2,576,399,651.20                           |
| 减: 卖出股票成本总额 | 2,541,294,915.81                           |
| 买卖股票差价收入    | 35,104,735.39                              |

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。

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 7.4.7.13.2 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。

#### 7.4.7.13.3 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。

#### 7.4.7.13.4 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。

#### 7.4.7.13.5 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。

### 7.4.7.14 衍生工具收益

#### 7.4.7.14.1 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。

#### 7.4.7.14.2 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<br>2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|----------|--|
| 股指期货投资收益 | 5,059,744.62   |

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。

### 7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

| 项目 | 本期<br>2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|----|--|
|----|--|

|             |              |
|-------------|--------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,816,685.55 |
| 基金投资产生的股利收益 | -            |
| 合计          | 1,816,685.55 |

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。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位:人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|---|
| 1. 交易性金融资产 | 64,053.12   |
| ——股票投资     | 64,053.12   |
| ——债券投资     | -   |
| ——资产支持证券投资 | -   |
| ——贵金属投资    | -   |
| ——其他       | -   |
| 2. 衍生工具    | -   |
| ——权证投资     | -   |
| 3. 其他      | -200,824.62   |
| 合计         | -136,771.50   |

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。

#### 7.4.7.17 其他收入

单位:人民币元

| 项目      | 本期<br>2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31<br>日 |
|---------|---|
| 基金赎回费收入 | 1,182,735.59  |
| 转换费收入   | 440.70  |
| 其他      | 14,190.27   |
| 合计      | 1,197,366.56  |

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。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位:人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月<br>31 日 |
|-----------|---|
| 交易所市场交易费用 | 4,198,704.86  |
| 银行间市场交易费用 | -   |
| 股指期货交易费用  | 179,112.19  |
| 合计        | 4,377,817.05  |

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。

#### 7.4.7.19 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 12 月 31 日 |
| 审计费用  | 70,000.00                                  |
| 信息披露费 | 180,000.00                                 |
| 汇划手续费 | 17,251.86                                  |
| 其他    | 400.00                                     |
| 合计    | 267,651.86                                 |

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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日, 本基金无重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金本报告披露日, 本基金无重大或有事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系                     |
|-------|-----------------------------|
| 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 |
| 建设银行  | 基金托管人、基金销售机构                |
| 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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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 12 月 31 日 |              |
|       | 成交金额                                       | 占当期股票成交总额的比例 |
| 中金公司  | 4,448,056,777.15                           | 86.76%       |

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。

### 7.4.10.1.2 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。

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |                |
|-------|---------------------------------------|----------------|
|       | 回购成交金额                                | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 中金公司  | 12,095,900,000.00                     | 32.16%         |

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。

### 7.4.10.1.4 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。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年4月21日(基金合同生效日)至2015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 |
| 中金公司  | 559,896.14                            | 53.03%     | 0.00     | 0.00%        |

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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 7,870,472.13                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,744,376.32                          |

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 3,744,376.32 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。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,045,250.53                                     |

注：1、支付基金托管人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。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期无销售服务费。

### 7.4.10.3 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。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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<br>2015年12月31日 |                      |
|-------|--------------------|----------------------|
|       | 持有的<br>基金份额        | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例 |
| 中金公司  | 10,000,350.00      | 3.39%                |

注：本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 日，无上年度对比数据。

#### 7.4.10.5 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<br>名称 | 本期<br>2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |            |
|-----------|---------------------------------------|------------|
|           | 期末余额                                  | 当期利息收入     |
| 建设银行      | 201,772,387.13                        | 574,971.17 |

注：1、本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金通过“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 12 月 31 日的相关余额为人民币 10,896,887.94 元，本期间产生的利息收入为人民币 279,137.53 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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无



## 7.4.11 利润分配情况

### 7.4.11.1 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。

## 7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 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。

### 7.4.12.2 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 |
|--------|------|-------------|--------|--------|------------|--------|--------|------------|------------|----|
| 000066 | 长城电脑 | 2015年6月18日  | 重大事项停牌 | 21.54  | 2016年3月10日 | 19.39  | 37,212 | 820,124.64 | 801,546.48 | -  |
| 600873 | 梅花集团 | 2015年12月17日 | 重大事项停牌 | 9.14   | 2016年1月4日  | 14.28  | 23,700 | 217,389.00 | 216,618.00 | -  |
| 002530 | 丰东股份 | 2015年6月8日   | 重大事项停牌 | 23.71  | 2016年1月25日 | 21.34  | 6,295  | 108,301.92 | 149,254.45 | -  |
| 600462 | 石岷纸业 | 2015年5月20日  | 重大事项停牌 | 13.22  | 2016年1月27日 | 11.90  | 4,100  | 53,382.00  | 54,202.00  | -  |
| 002109 | 兴化股份 | 2015年5月8日   | 重大事项停牌 | 8.54   | 2016年1月4日  | 9.39   | 3,700  | 34,669.00  | 31,598.00  | -  |
| 002147 | 方圆支承 | 2015年6月1日   | 重大事项停牌 | 17.90  | 2016年1月12日 | 16.11  | 1,300  | 23,790.00  | 23,270.00  | -  |
| 300043 | 互动娱乐 | 2015年12月17日 | 重大事项停牌 | 15.80  | -          | -      | 1,000  | 15,920.00  | 15,800.00  | -  |
| 300028 | 金亚科技 | 2015年6月12日  | 重大事项停牌 | 34.51  | -          | -      | 289    | 11,915.48  | 9,973.39   | -  |
| 601717 | 郑煤机  | 2015年12月18日 | 重大事项停牌 | 7.52   | -          | -      | 1,300  | 9,685.00   | 9,776.00   | -  |
| 002164 | 宁波   | 2015年12月    | 重大     | 10.35  | -          | -      | 700    | 7,224.00   | 7,245.00   | -  |

|        |          |                     |                |       |                   |       |     |          |          |  |
|--------|----------|---------------------|----------------|-------|-------------------|-------|-----|----------|----------|--|
|        | 东力       | 17 日                | 事项<br>停牌       |       |                   |       |     |          |          |  |
| 300242 | 明家<br>科技 | 2015 年 12 月<br>18 日 | 重大<br>事项<br>停牌 | 49.96 | 2016 年 1 月 4<br>日 | 41.95 | 100 | 5,065.00 | 4,996.00 |  |
| 000712 | 锦龙<br>股份 | 2015 年 12 月<br>25 日 | 重大<br>事项<br>停牌 | 29.12 | 2016 年 1 月 4<br>日 | 26.21 | 33  | 985.70   | 960.96   |  |

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，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。

##### **7.4.13.2.1 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。

##### **7.4.13.2.2 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。

#### **7.4.13.3 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。

#### **7.4.13.4 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。

### 7.4.13.4.1 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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2015年12月31日 | 1年以内           | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计             |
|--------------------|----------------|------|------|---------------|----------------|
| 资产                 |                |      |      |               |                |
| 银行存款               | 201,772,387.13 | -    | -    | -             | 201,772,387.13 |
| 结算备付金              | 95,466,420.69  | -    | -    | -             | 95,466,420.69  |
| 存出保证金              | 2,480,275.06   | -    | -    | -             | 2,480,275.06   |
| 交易性金融资产-股票投资       | -              | -    | -    | 10,089,513.99 | 10,089,513.99  |
| 交易性金融资产-债券投资       | -              | -    | -    | -             | -              |
| 买入返售金融资产           | -              | -    | -    | -             | -              |
| 应收证券清算款            | -              | -    | -    | -             | -              |
| 应收利息               | -              | -    | -    | 24,078.28     | 24,078.28      |
| 应收股利               | -              | -    | -    | -             | -              |
| 应收申购款              | -              | -    | -    | -             | -              |
| 资产总计               | 299,719,082.88 | -    | -    | 10,113,592.27 | 309,832,675.15 |
| 负债                 |                |      |      |               |                |
| 卖出回购金融资产款          | -              | -    | -    | -             | -              |
| 应付证券清算款            | -              | -    | -    | 25.07         | 25.07          |
| 应付赎回款              | -              | -    | -    | -             | -              |
| 应付管理人报酬            | -              | -    | -    | 261,061.30    | 261,061.30     |
| 应付托管费              | -              | -    | -    | 65,265.32     | 65,265.32      |
| 应付交易费用             | -              | -    | -    | 489,332.44    | 489,332.44     |
| 应付利息               | -              | -    | -    | -             | -              |
| 其他负债               | -              | -    | -    | 250,000.00    | 250,000.00     |
| 负债总计               | -              | -    | -    | 1,065,684.13  | 1,065,684.13   |
| 利率敏感度缺口            | 299,719,082.88 | -    | -    | 9,047,908.14  | 308,766,991.02 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2015 年 12 月 31 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  | 10,089,513.99           | 3.27          |
| 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            | 10,089,513.99           | 3.27          |

#### 7.4.13.4.3.2 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。

#### 7.4.13.4.4 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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### (a) 公允价值计量的层次

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (1) 金融工具公允价值计量的方法

单位：人民币元

|         | 2015 年 12 月 31 日 |              |      |               |
|---------|------------------|--------------|------|---------------|
|         | 第一层次             | 第二层次         | 第三层次 | 合计            |
| 交易性金融资产 |                  |              |      |               |
| 股票投资    | 8,761,273.71     | 1,325,240.28 | -    | 10,089,513.99 |
| 合计      | 8,761,273.71     | 1,325,240.28 | -    | 10,089,513.99 |

对于在资产负债表日以公允价值计量的交易性金融资产的公允价值信息，本基金在估计公允价值时运用的主要方法和假设参见财务报表附注。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关债券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关债券的公允价值列入第一层次。

本基金本期间持有的以公允价值计量的金融资产的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金本报告期末未持有公允价值归属于第三层次的金融工具。

##### (b) 其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

不以公允价值计量的金融资产和金融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之间无重大差异。

## § 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              | 10,089,513.99  | 3.26          |
|    | 其中：股票             | 10,089,513.99  | 3.26          |
| 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          | -              | -             |
|    | 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      | 297,238,807.82 | 95.94         |
| 7  | 其他各项资产            | 2,504,353.34   | 0.81          |
| 8  | 合计                | 309,832,675.15 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -             |
| B  | 采矿业              | 281,674.35   | 0.09          |
| C  | 制造业              | 2,934,813.55 | 0.95          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 192,243.00   | 0.06          |
| E  | 建筑业              | 595,794.34   | 0.19          |
| F  | 批发和零售业           | 31,640.00    | 0.01          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 166,418.28   | 0.05          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 287,424.69   | 0.09          |

|   |               |               |      |
|---|---------------|---------------|------|
| J | 金融业           | 5,441,863.54  | 1.76 |
| K | 房地产业          | 157,642.24    | 0.05 |
| 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            | 10,089,513.99 | 3.27 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 8.3 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  | 601318 | 中国平安 | 26,002 | 936,072.00 | 0.30         |
| 2  | 000066 | 长城电脑 | 37,212 | 801,546.48 | 0.26         |
| 3  | 600016 | 民生银行 | 67,927 | 654,816.28 | 0.21         |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 30,621 | 522,700.47 | 0.17         |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 23,680 | 426,003.20 | 0.14         |
| 6  | 600000 | 浦发银行 | 21,500 | 392,805.00 | 0.13         |
| 7  | 601328 | 交通银行 | 54,193 | 349,002.92 | 0.11         |
| 8  | 601288 | 农业银行 | 88,800 | 286,824.00 | 0.09         |
| 9  | 601766 | 中国南车 | 21,049 | 270,479.65 | 0.09         |
| 10 | 600519 | 贵州茅台 | 1,154  | 251,791.26 | 0.08         |
| 11 | 601169 | 北京银行 | 23,400 | 246,402.00 | 0.08         |
| 12 | 600887 | 伊利股份 | 13,987 | 229,806.41 | 0.07         |
| 13 | 601398 | 工商银行 | 49,600 | 227,168.00 | 0.07         |
| 14 | 601668 | 中国建筑 | 34,443 | 218,368.62 | 0.07         |
| 15 | 600873 | 梅花集团 | 23,700 | 216,618.00 | 0.07         |
| 16 | 601601 | 中国太保 | 7,323  | 211,341.78 | 0.07         |
| 17 | 601989 | 中国重工 | 21,084 | 198,189.60 | 0.06         |



|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 18 | 601988 | 中国银行 | 48,389 | 194,039.89 | 0.06 |
| 19 | 600637 | 百视通  | 4,363  | 165,314.07 | 0.05 |
| 20 | 600104 | 上汽集团 | 7,700  | 163,394.00 | 0.05 |
| 21 | 601211 | 国泰君安 | 6,600  | 157,740.00 | 0.05 |
| 22 | 600048 | 保利地产 | 14,816 | 157,642.24 | 0.05 |
| 23 | 600999 | 招商证券 | 7,205  | 156,348.50 | 0.05 |
| 24 | 601818 | 光大银行 | 36,570 | 155,056.80 | 0.05 |
| 25 | 600015 | 华夏银行 | 12,400 | 150,536.00 | 0.05 |
| 26 | 002530 | 丰东股份 | 6,295  | 149,254.45 | 0.05 |
| 27 | 601390 | 中国中铁 | 12,839 | 140,201.88 | 0.05 |
| 28 | 600050 | 中国联通 | 19,759 | 122,110.62 | 0.04 |
| 29 | 600518 | 康美药业 | 7,066  | 119,768.70 | 0.04 |
| 30 | 600028 | 中国石化 | 24,130 | 119,684.80 | 0.04 |
| 31 | 601006 | 大秦铁路 | 13,662 | 117,766.44 | 0.04 |
| 32 | 601186 | 中国铁建 | 8,338  | 112,396.24 | 0.04 |
| 33 | 601628 | 中国人寿 | 3,900  | 110,409.00 | 0.04 |
| 34 | 601985 | 中国核电 | 10,800 | 103,032.00 | 0.03 |
| 35 | 601857 | 中国石油 | 11,153 | 93,127.55  | 0.03 |
| 36 | 600795 | 国电电力 | 22,700 | 89,211.00  | 0.03 |
| 37 | 601336 | 新华保险 | 1,600  | 83,536.00  | 0.03 |
| 38 | 600010 | 包钢股份 | 22,432 | 80,979.52  | 0.03 |
| 39 | 600893 | 航空动力 | 1,791  | 80,648.73  | 0.03 |
| 40 | 600585 | 海螺水泥 | 4,688  | 80,164.80  | 0.03 |
| 41 | 601669 | 中国水电 | 9,600  | 77,088.00  | 0.02 |
| 42 | 600111 | 包钢稀土 | 5,428  | 76,100.56  | 0.02 |
| 43 | 601088 | 中国神华 | 4,600  | 68,862.00  | 0.02 |
| 44 | 600109 | 国金证券 | 4,169  | 67,204.28  | 0.02 |
| 45 | 600150 | 中国船舶 | 1,700  | 59,211.00  | 0.02 |
| 46 | 600958 | 东方证券 | 2,532  | 58,970.28  | 0.02 |
| 47 | 600462 | 石岷纸业 | 4,100  | 54,202.00  | 0.02 |
| 48 | 601998 | 中信银行 | 7,469  | 53,926.18  | 0.02 |
| 49 | 600018 | 上港集团 | 7,508  | 48,651.84  | 0.02 |
| 50 | 601800 | 中国交建 | 3,560  | 47,739.60  | 0.02 |
| 51 | 600739 | 辽宁成大 | 1,400  | 31,640.00  | 0.01 |
| 52 | 002109 | 兴化股份 | 3,700  | 31,598.00  | 0.01 |
| 53 | 002147 | 方圆支承 | 1,300  | 23,270.00  | 0.01 |
| 54 | 300043 | 互动娱乐 | 1,000  | 15,800.00  | 0.01 |
| 55 | 300028 | 金亚科技 | 289    | 9,973.39   | 0.00 |
| 56 | 601717 | 郑煤机  | 1,300  | 9,776.00   | 0.00 |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 57 | 002164 | 宁波东力 | 700 | 7,245.00 | 0.00 |
| 58 | 300242 | 明家科技 | 100 | 4,996.00 | 0.00 |
| 59 | 000712 | 锦龙股份 | 33  | 960.96   | 0.00 |

## 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 | 49,789,895.40 | 16.13           |
| 2  | 601288 | 农业银行 | 47,001,290.95 | 15.22           |
| 3  | 600016 | 民生银行 | 45,547,601.34 | 14.75           |
| 4  | 601398 | 工商银行 | 45,067,690.26 | 14.60           |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 42,689,537.48 | 13.83           |
| 6  | 600015 | 华夏银行 | 39,567,317.37 | 12.81           |
| 7  | 600000 | 浦发银行 | 37,232,856.42 | 12.06           |
| 8  | 000402 | 金融街  | 32,616,980.62 | 10.56           |
| 9  | 601318 | 中国平安 | 30,976,344.80 | 10.03           |
| 10 | 601668 | 中国建筑 | 29,366,908.80 | 9.51            |
| 11 | 600011 | 华能国际 | 27,452,694.75 | 8.89            |
| 12 | 601818 | 光大银行 | 26,070,399.00 | 8.44            |
| 13 | 600048 | 保利地产 | 24,648,719.80 | 7.98            |
| 14 | 600030 | 中信证券 | 23,954,180.43 | 7.76            |
| 15 | 600066 | 宇通客车 | 21,855,300.49 | 7.08            |
| 16 | 600027 | 华电国际 | 21,151,038.57 | 6.85            |
| 17 | 600104 | 上汽集团 | 20,693,289.37 | 6.70            |
| 18 | 600352 | 浙江龙盛 | 19,919,363.83 | 6.45            |
| 19 | 600823 | 世茂股份 | 18,261,462.06 | 5.91            |
| 20 | 000333 | 美的集团 | 17,738,246.88 | 5.74            |
| 21 | 600741 | 华域汽车 | 17,649,771.31 | 5.72            |
| 22 | 601988 | 中国银行 | 17,626,411.00 | 5.71            |
| 23 | 002146 | 荣盛发展 | 17,224,726.20 | 5.58            |
| 24 | 601169 | 北京银行 | 17,145,184.80 | 5.55            |
| 25 | 000651 | 格力电器 | 17,083,710.96 | 5.53            |
| 26 | 600050 | 中国联通 | 17,002,713.95 | 5.51            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 27 | 600519 | 贵州茅台 | 16,422,138.41 | 5.32 |
| 28 | 600340 | 华夏幸福 | 14,534,626.16 | 4.71 |
| 29 | 000625 | 长安汽车 | 14,449,984.20 | 4.68 |
| 30 | 002304 | 洋河股份 | 14,359,323.50 | 4.65 |
| 31 | 000002 | 万科A  | 13,872,659.18 | 4.49 |
| 32 | 600660 | 福耀玻璃 | 13,181,476.59 | 4.27 |
| 33 | 601006 | 大秦铁路 | 12,917,732.55 | 4.18 |
| 34 | 601328 | 交通银行 | 12,739,928.00 | 4.13 |
| 35 | 601009 | 南京银行 | 12,275,138.72 | 3.98 |
| 36 | 600887 | 伊利股份 | 11,924,898.98 | 3.86 |
| 37 | 600177 | 雅戈尔  | 11,796,850.15 | 3.82 |
| 38 | 601555 | 东吴证券 | 11,609,382.34 | 3.76 |
| 39 | 000623 | 吉林敖东 | 11,513,622.12 | 3.73 |
| 40 | 300133 | 华策影视 | 11,436,512.30 | 3.70 |
| 41 | 600585 | 海螺水泥 | 11,249,101.00 | 3.64 |
| 42 | 600089 | 特变电工 | 11,006,706.42 | 3.56 |
| 43 | 600886 | 国投电力 | 10,671,922.90 | 3.46 |
| 44 | 601998 | 中信银行 | 10,466,575.00 | 3.39 |
| 45 | 000876 | 新希望  | 10,312,340.00 | 3.34 |
| 46 | 002202 | 金风科技 | 10,305,516.30 | 3.34 |
| 47 | 002595 | 豪迈科技 | 10,179,159.59 | 3.30 |
| 48 | 000600 | 建投能源 | 10,123,530.28 | 3.28 |
| 49 | 000869 | 张裕A  | 9,548,847.05  | 3.09 |
| 50 | 600655 | 豫园商城 | 9,412,053.99  | 3.05 |
| 51 | 601088 | 中国神华 | 9,253,090.67  | 3.00 |
| 52 | 000063 | 中兴通讯 | 9,242,503.40  | 2.99 |
| 53 | 600373 | 中文传媒 | 9,238,576.73  | 2.99 |
| 54 | 600999 | 招商证券 | 9,115,204.64  | 2.95 |
| 55 | 601633 | 长城汽车 | 9,066,061.89  | 2.94 |
| 56 | 600019 | 宝钢股份 | 9,026,248.04  | 2.92 |
| 57 | 000895 | 双汇发展 | 9,008,618.50  | 2.92 |
| 58 | 600376 | 首开股份 | 8,791,217.44  | 2.85 |
| 59 | 002410 | 广联达  | 8,745,040.84  | 2.83 |
| 60 | 600029 | 南方航空 | 8,715,800.00  | 2.82 |
| 61 | 000858 | 五粮液  | 8,620,302.53  | 2.79 |
| 62 | 002440 | 闰土股份 | 8,445,569.08  | 2.74 |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 63 | 600518 | 康美药业   | 8,218,613.01 | 2.66 |
| 64 | 600221 | 海南航空   | 8,192,525.22 | 2.65 |
| 65 | 600377 | 宁沪高速   | 8,143,660.00 | 2.64 |
| 66 | 000423 | 东阿阿胶   | 8,109,662.18 | 2.63 |
| 67 | 300058 | 蓝色光标   | 8,078,010.55 | 2.62 |
| 68 | 600867 | 通化东宝   | 7,890,038.52 | 2.56 |
| 69 | 600282 | 南钢股份   | 7,860,552.00 | 2.55 |
| 70 | 002294 | 信立泰    | 7,857,602.75 | 2.54 |
| 71 | 000550 | 江铃汽车   | 7,822,789.34 | 2.53 |
| 72 | 000069 | 华侨城A   | 7,753,463.00 | 2.51 |
| 73 | 000039 | 中集集团   | 7,732,387.68 | 2.50 |
| 74 | 000826 | 启迪桑德   | 7,659,332.80 | 2.48 |
| 75 | 600617 | *ST 联华 | 7,630,149.96 | 2.47 |
| 76 | 601607 | 上海医药   | 7,602,574.70 | 2.46 |
| 77 | 000963 | 华东医药   | 7,506,567.02 | 2.43 |
| 78 | 002400 | 省广股份   | 7,494,711.58 | 2.43 |
| 79 | 300003 | 乐普医疗   | 7,378,123.00 | 2.39 |
| 80 | 601179 | 中国西电   | 7,222,035.00 | 2.34 |
| 81 | 600068 | 葛洲坝    | 7,066,786.00 | 2.29 |
| 82 | 600079 | 人福医药   | 6,830,398.68 | 2.21 |
| 83 | 600582 | 天地科技   | 6,828,333.40 | 2.21 |
| 84 | 600827 | XD 友谊股 | 6,743,490.39 | 2.18 |
| 85 | 601766 | 中国南车   | 6,703,132.50 | 2.17 |
| 86 | 000725 | 京东方A   | 6,449,198.00 | 2.09 |
| 87 | 000999 | 华润三九   | 6,445,039.74 | 2.09 |
| 88 | 000568 | 泸州老窖   | 6,433,602.97 | 2.08 |
| 89 | 000686 | 东北证券   | 6,382,636.00 | 2.07 |
| 90 | 600835 | 上海机电   | 6,381,555.00 | 2.07 |
| 91 | 600648 | 外高桥    | 6,196,545.00 | 2.01 |

#### 8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 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 | 49,714,743.35 | 16.10           |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 2  | 601288 | 农业银行 | 47,497,766.60 | 15.38 |
| 3  | 601398 | 工商银行 | 45,466,234.45 | 14.73 |
| 4  | 600016 | 民生银行 | 45,082,360.44 | 14.60 |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 43,231,128.86 | 14.00 |
| 6  | 600015 | 华夏银行 | 40,385,542.21 | 13.08 |
| 7  | 600000 | 浦发银行 | 37,349,024.17 | 12.10 |
| 8  | 000402 | 金融街  | 33,032,162.89 | 10.70 |
| 9  | 601318 | 中国平安 | 30,584,841.99 | 9.91  |
| 10 | 601668 | 中国建筑 | 29,015,220.99 | 9.40  |
| 11 | 600011 | 华能国际 | 28,750,817.19 | 9.31  |
| 12 | 601818 | 光大银行 | 26,530,530.32 | 8.59  |
| 13 | 600048 | 保利地产 | 24,477,975.31 | 7.93  |
| 14 | 600030 | 中信证券 | 24,042,735.13 | 7.79  |
| 15 | 600027 | 华电国际 | 22,016,614.27 | 7.13  |
| 16 | 600066 | 宇通客车 | 21,404,383.76 | 6.93  |
| 17 | 600104 | 上汽集团 | 20,348,647.93 | 6.59  |
| 18 | 600352 | 浙江龙盛 | 20,102,168.06 | 6.51  |
| 19 | 000333 | 美的集团 | 18,087,638.28 | 5.86  |
| 20 | 000651 | 格力电器 | 18,026,412.27 | 5.84  |
| 21 | 600823 | 世茂股份 | 17,802,551.08 | 5.77  |
| 22 | 601988 | 中国银行 | 17,754,083.96 | 5.75  |
| 23 | 600741 | 华域汽车 | 17,241,648.92 | 5.58  |
| 24 | 601169 | 北京银行 | 17,094,904.99 | 5.54  |
| 25 | 600050 | 中国联通 | 16,774,091.11 | 5.43  |
| 26 | 600519 | 贵州茅台 | 16,442,613.30 | 5.33  |
| 27 | 002146 | 荣盛发展 | 16,184,722.19 | 5.24  |
| 28 | 600340 | 华夏幸福 | 14,590,762.14 | 4.73  |
| 29 | 002304 | 洋河股份 | 14,301,012.49 | 4.63  |
| 30 | 000002 | 万科A  | 14,276,286.77 | 4.62  |
| 31 | 000625 | 长安汽车 | 13,755,519.62 | 4.45  |
| 32 | 601328 | 交通银行 | 13,437,018.01 | 4.35  |
| 33 | 600660 | 福耀玻璃 | 13,124,566.72 | 4.25  |
| 34 | 601009 | 南京银行 | 13,065,228.57 | 4.23  |
| 35 | 601006 | 大秦铁路 | 12,827,563.85 | 4.15  |
| 36 | 600887 | 伊利股份 | 12,609,505.32 | 4.08  |
| 37 | 600177 | 雅戈尔  | 11,761,277.34 | 3.81  |
| 38 | 300133 | 华策影视 | 11,758,926.02 | 3.81  |
| 39 | 000623 | 吉林敖东 | 11,436,732.04 | 3.70  |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 40 | 600585 | 海螺水泥  | 11,399,744.42 | 3.69 |
| 41 | 601555 | 东吴证券  | 11,071,147.88 | 3.59 |
| 42 | 600089 | 特变电工  | 10,836,293.38 | 3.51 |
| 43 | 601998 | 中信银行  | 10,642,027.05 | 3.45 |
| 44 | 002202 | 金风科技  | 10,608,180.82 | 3.44 |
| 45 | 600886 | 国投电力  | 10,212,612.25 | 3.31 |
| 46 | 002595 | 豪迈科技  | 10,077,057.63 | 3.26 |
| 47 | 000876 | 新希望   | 10,073,644.53 | 3.26 |
| 48 | 000600 | 建投能源  | 10,035,455.77 | 3.25 |
| 49 | 600376 | 首开股份  | 9,913,433.67  | 3.21 |
| 50 | 600655 | 豫园商城  | 9,655,353.02  | 3.13 |
| 51 | 000869 | 张裕A   | 9,472,744.74  | 3.07 |
| 52 | 600373 | 中文传媒  | 9,446,465.17  | 3.06 |
| 53 | 601088 | 中国神华  | 9,299,031.26  | 3.01 |
| 54 | 000858 | 五粮液   | 9,119,882.40  | 2.95 |
| 55 | 600029 | 南方航空  | 9,081,851.43  | 2.94 |
| 56 | 600019 | 宝钢股份  | 9,042,452.20  | 2.93 |
| 57 | 601633 | 长城汽车  | 9,041,596.79  | 2.93 |
| 58 | 600999 | 招商证券  | 8,941,196.55  | 2.90 |
| 59 | 002440 | 闰土股份  | 8,840,070.64  | 2.86 |
| 60 | 000063 | 中兴通讯  | 8,781,299.19  | 2.84 |
| 61 | 002410 | 广联达   | 8,773,483.77  | 2.84 |
| 62 | 000423 | 东阿阿胶  | 8,704,608.56  | 2.82 |
| 63 | 000895 | 双汇发展  | 8,635,268.91  | 2.80 |
| 64 | 000069 | 华侨城A  | 8,577,655.01  | 2.78 |
| 65 | 300058 | 蓝色光标  | 8,443,632.55  | 2.73 |
| 66 | 600221 | 海南航空  | 8,355,973.85  | 2.71 |
| 67 | 600518 | 康美药业  | 8,345,537.83  | 2.70 |
| 68 | 600377 | 宁沪高速  | 8,261,111.02  | 2.68 |
| 69 | 000039 | 中集集团  | 8,129,950.21  | 2.63 |
| 70 | 600867 | 通化东宝  | 7,974,214.02  | 2.58 |
| 71 | 000826 | 启迪桑德  | 7,843,132.61  | 2.54 |
| 72 | 000550 | 江铃汽车  | 7,797,654.26  | 2.53 |
| 73 | 002400 | 省广股份  | 7,792,673.58  | 2.52 |
| 74 | 600282 | 南钢股份  | 7,760,574.51  | 2.51 |
| 75 | 002294 | 信立泰   | 7,695,767.16  | 2.49 |
| 76 | 000963 | 华东医药  | 7,510,817.71  | 2.43 |
| 77 | 600617 | *ST联华 | 7,501,200.85  | 2.43 |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 78 | 300003 | 乐普医疗   | 7,325,262.55 | 2.37 |
| 79 | 601607 | 上海医药   | 7,319,337.91 | 2.37 |
| 80 | 601179 | 中国西电   | 7,280,164.77 | 2.36 |
| 81 | 000568 | 泸州老窖   | 6,964,185.80 | 2.26 |
| 82 | 000725 | 京东方 A  | 6,925,272.85 | 2.24 |
| 83 | 000999 | 华润三九   | 6,791,314.53 | 2.20 |
| 84 | 600068 | 葛洲坝    | 6,755,779.46 | 2.19 |
| 85 | 600079 | 人福医药   | 6,716,370.88 | 2.18 |
| 86 | 000686 | 东北证券   | 6,511,983.69 | 2.11 |
| 87 | 600350 | 山东高速   | 6,509,673.67 | 2.11 |
| 88 | 600582 | 天地科技   | 6,502,154.31 | 2.11 |
| 89 | 600827 | XD 友谊股 | 6,486,985.14 | 2.10 |
| 90 | 600835 | 上海机电   | 6,458,092.13 | 2.09 |
| 91 | 000539 | 粤电力 A  | 6,428,057.61 | 2.08 |
| 92 | 000413 | 东旭光电   | 6,359,198.02 | 2.06 |
| 93 | 000709 | 河北钢铁   | 6,270,409.70 | 2.03 |

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 2,551,320,376.68 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,576,399,651.20 |

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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。

#### 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。

#### 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

| 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         |
|-------------------|--------|----------|---------------|-------------|--------------|
| IH1601            | IH1601 | -12      | -8,652,960.00 | -200,824.62 | -            |
| 公允价值变动总额合计（元）     |        |          |               |             | -200,824.62  |
| 股指期货投资本期收益（元）     |        |          |               |             | 5,059,744.62 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |        |          |               |             | -200,824.62  |

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元



| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 2,480,275.06 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 24,078.28    |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,504,353.34 |

### 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处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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  | 000066 | 长城电脑 | 801,546.48  | 0.26          | 重大事项停牌   |

### 8.12.6 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。

## § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 3,729        | 79,207.15     | 20,000,700.00 | 6.77%      | 275,362,753.50 | 93.23%     |

### 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<br>持有本基金 | 51,878.97  | 0.02%    |

### 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<br>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                 |

### 9.4 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<br>基金总份<br>额比例（%） | 发起份额总数        | 发起份额占<br>基金总份<br>额比例（%） | 发起份额承<br>诺持有期限          |
|-----------------|---------------|-------------------------|---------------|-------------------------|-------------------------|
| 基金管理人固有<br>资金   | -             | -                       | -             | -                       | -                       |
| 基金管理人高级<br>管理人员 | 50,935.19     | 0.02                    | -             | -                       | -                       |
| 基金经理等人员         | -             | -                       | -             | -                       | -                       |
| 基金管理人股东         | 10,000,350.00 | 3.39                    | 10,000,350.00 | 3.39                    | 自基金合同<br>生效之日起<br>不少于三年 |
| 其他              | -             | -                       | -             | -                       | -                       |
| 合计              | -             | 3.41                    | 10,000,350.00 | 3.39                    | -                       |

## § 10 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                  | 37,658,549.74  |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额                | 451,808,556.35 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份<br>额减少以“-”填列） | -              |
| 本报告期末基金份额总额                            | 295,363,453.50 |

注：报告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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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

1、2015 年 8 月 14 日，经中金基金管理有限公司第一届董事会第八次会议审议通过，免去罗若宏先生副总经理职务。

2、2015 年 9 月 23 日，经中金基金管理有限公司第一届董事会第九次会议审议通过，任命杜季柳女士为公司副总经理。

3、2015 年 12 月 31 日，经中金基金管理有限公司第一届董事会第九次会议审议通过，总经理阚睿先生离任，由孙菁女士继任公司总经理，孙菁女士同时解除原副总经理任职。

4、2015 年 12 月 31 日，根据中金基金股东中国国际金融股份有限公司股东决议，任命孙菁女士为中金基金第一届董事会董事；免去阚睿先生中金基金第一届董事会董事任职。

本报告期内，公司无董事长、法定代表人、其他高级管理人员和执行监事变动情况。

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 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。本基金本报告期内应支付审计费用 70,000.00 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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

## 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 |    |
| 中金公司   |        | 24,448,056,777.15 | 86.76%       | 559,896.14 | 53.03%     | -  |
| 华泰证券   | 2      | 266,281,022.46    | 5.19%        | 194,731.48 | 18.44%     | -  |
| 银河证券   | 2      | 159,232,908.30    | 3.11%        | 116,447.02 | 11.03%     | -  |
| 国信证券   | 2      | 121,118,142.58    | 2.36%        | 88,017.26  | 8.34%      | -  |
| 申万宏源证券 | 2      | 110,137,874.32    | 2.15%        | 80,543.47  | 7.63%      | -  |
| 广发证券   | 2      | 13,110,950.70     | 0.26%        | 9,587.88   | 0.91%      | -  |
| 华西证券   | 2      | 8,943,957.37      | 0.17%        | 6,540.59   | 0.62%      | -  |

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，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；能根据基金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。

2、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机构。
- (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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易            |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中金公司 | -    | -            | 12,095,900,000.00 | 32.16%         | -    | -            |

|        |   |   |                   |        |   |   |
|--------|---|---|-------------------|--------|---|---|
| 华泰证券   | - | - | 1,736,300,000.00  | 4.62%  | - | - |
| 银河证券   | - | - | 472,500,000.00    | 1.26%  | - | - |
| 国信证券   | - | - | 7,985,900,000.00  | 21.23% | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | 240,200,000.00    | 0.64%  | - | - |
| 广发证券   | - | - | 209,300,000.00    | 0.56%  | - | - |
| 华西证券   | - | - | 14,869,700,000.00 | 39.54% | - | - |

## 11.8 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和/或公司网站 | 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和/或公司网站 | 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和/或公司网站 | 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 | 中国证监会指定报刊和/或公司网站 | 2015年4月9日  |
| 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和/或公司网站 | 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和/或公司网站 | 2015年6月8日  |
| 7  | 中金基金管理有限公司关于网                            | 中国证监会指定报         | 2015年6月12日 |

|    |  |                  |             |
|----|--|------------------|-------------|
|    | 上直销身份认证系统升级的公告                                   | 刊和/或公司网站         |             |
| 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和/或公司网站 | 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和/或公司网站 | 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和/或公司网站 | 2015年7月3日   |
| 11 | 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 年第 2 季度报告          | 中国证监会指定报刊和/或公司网站 | 2015年7月20日  |
| 12 | 中金绝对收益定期开放混合型发起式证券投资基金 2015 年半年度报告               | 中国证监会指定报刊和/或公司网站 | 2015年8月26日  |
| 13 | 中金绝对收益定期开放混合型发起式证券投资基金 2015 年半年度报告-摘要            | 中国证监会指定报刊和/或公司网站 | 2015年8月26日  |
| 14 | 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中国光大银行股份有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊和/或公司网站 | 2015年9月25日  |
| 15 | 中金绝对收益策略定期开放混合型基金第一个开放期开放申购、赎回相关业务的公告            | 中国证监会指定报刊和/或公司网站 | 2015年9月28日  |
| 16 | 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                    | 中国证监会指定报刊和/或公司网站 | 2015年10月23日 |

|    |  |                  |                  |
|----|--|------------------|------------------|
|    | 年第 3 季度报告                                      |                  |                  |
| 17 | 中金基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京乐融多源投资咨询有限公司为销售机构的公告     | 中国证监会指定报刊和/或公司网站 | 2015 年 10 月 28 日 |
| 18 | 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交通银行股份有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊和/或公司网站 | 2015 年 11 月 5 日  |
| 19 | 中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2015 年第 1 号）   | 中国证监会指定报刊和/或公司网站 | 2015 年 12 月 1 日  |
| 20 | 中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要（2015 年第 1 号） | 中国证监会指定报刊和/或公司网站 | 2015 年 12 月 1 日  |
| 21 | 关于中金绝对收益策略定期开放混合型基金开放申购、赎回和转换相关业务的公告           | 中国证监会指定报刊和/或公司网站 | 2015 年 12 月 29 日 |

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批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注册文件
- 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、关于申请募集中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金之法律意见书
- 5、《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》及其更新
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

基金合同、托管协议及其他备查文件存放在基金管理人及基金托管人住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件，也可按工本费购买复印件。

中金基金管理有限公司  
2016年3月25日