

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式  
证券投资基金  
2016 年年度报告 摘要

2016 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：2017 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示

### 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 2017 年 3 月 30 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	111,660,551.77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		400-868-1166	010-67595096
传真		010-66159121	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年 4 月 21 日 (基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	2014 年
本期已实现收益	-2,533,986.17	33,192,444.17	-
本期利润	-2,542,345.74	33,055,672.67	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0172	0.0578	-
本期基金份额净值增长率	-2.20%	4.50%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0225	0.0454	-
期末基金资产净值	114,170,220.14	308,766,991.02	-
期末基金份额净值	1.022	1.045	-

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

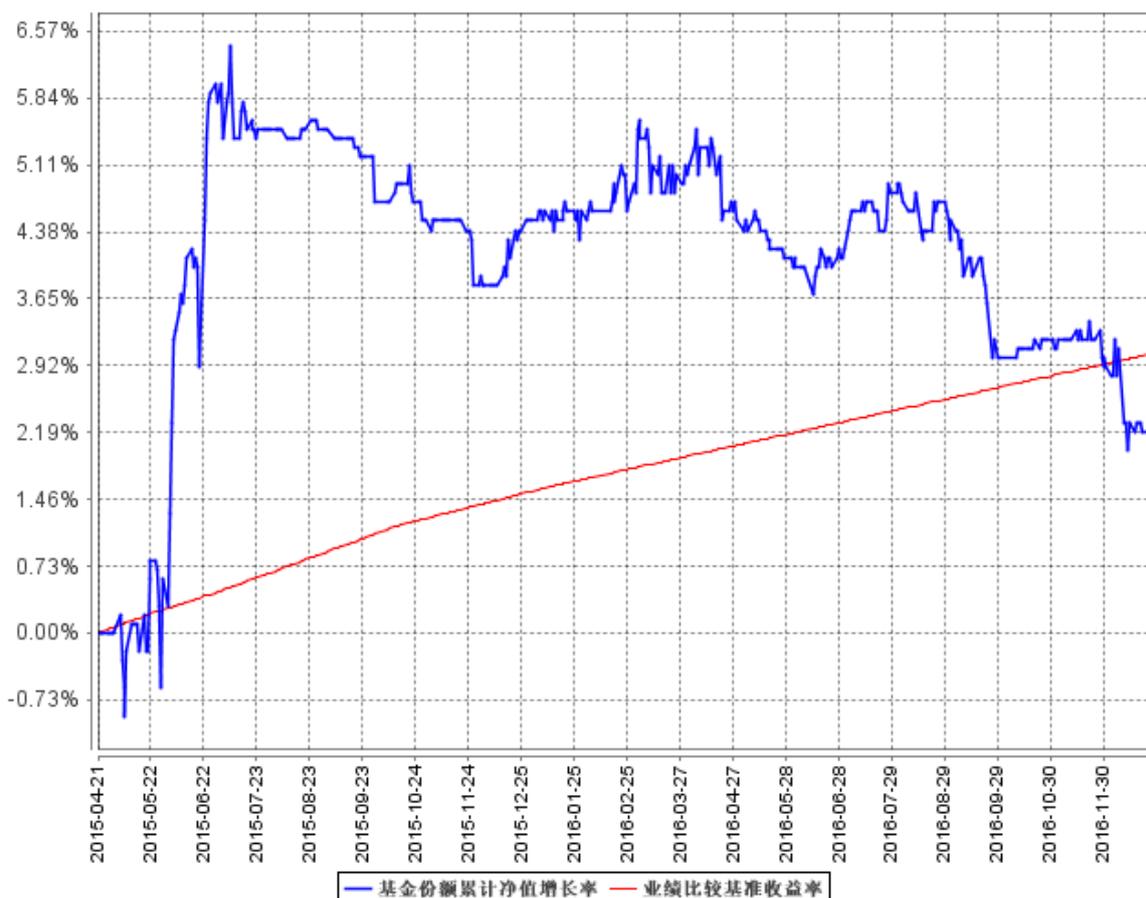
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.78%	0.16%	0.37%	0.01%	-1.15%	0.15%
过去六个月	-1.83%	0.16%	0.74%	0.00%	-2.57%	0.16%
过去一年	-2.20%	0.17%	1.49%	0.00%	-3.69%	0.17%
自基金合同生效起至今	2.20%	0.23%	3.06%	0.01%	-0.86%	0.22%

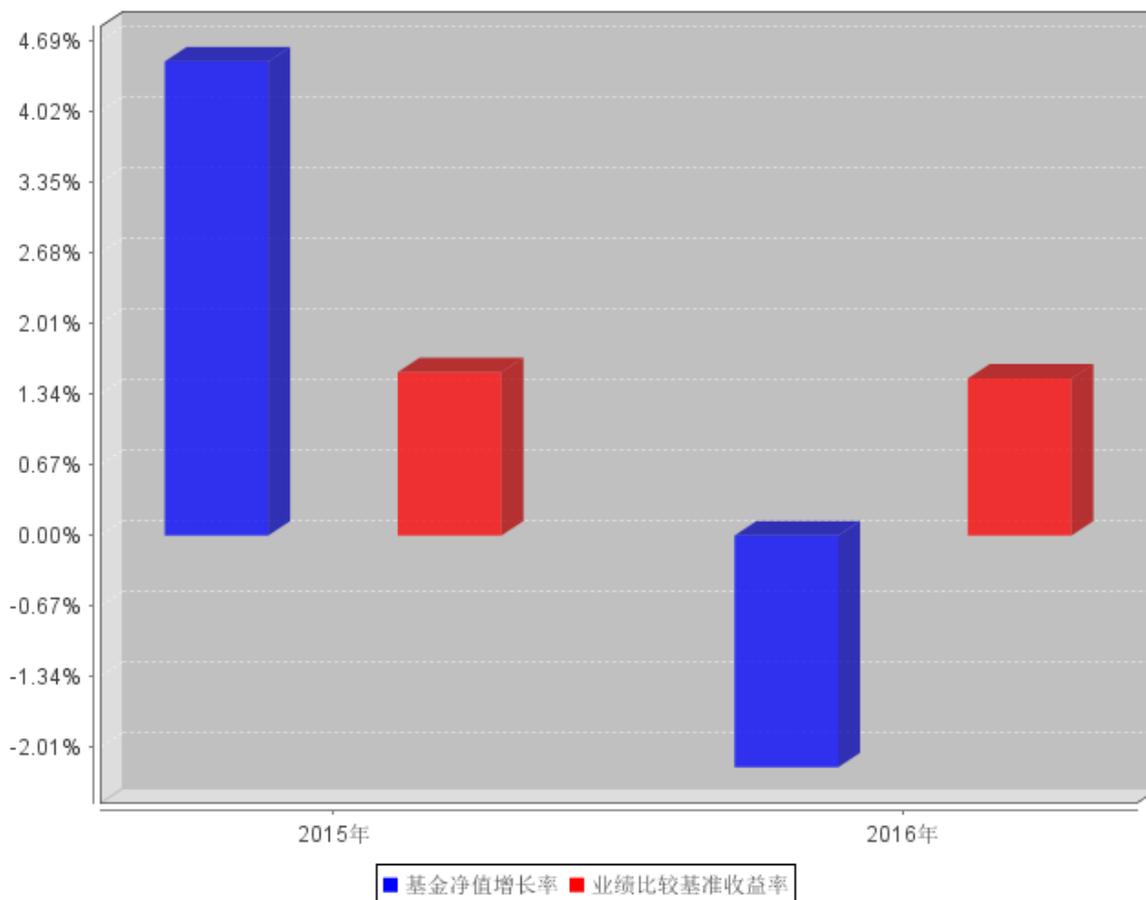
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 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 2016 年 12 月 31 日，公司旗下管理 8 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、中金消费升级股票型证券投资基金、中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金和中金金利债券型证券投资基金，证券投资基金管理规模 35.64 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	-	9	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副总经理。2015 年 4 月起任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经理。2016 年 7 月起任中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理和中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2016 年 11 月起任中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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》、《公开募集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的行为。

## 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

进入 2016 年以来，国际政治经济形势不确定性进一步增多。中国经济改革出现积极变化，但是结构性问题仍然较为突出。A 股市场在年初经历较大波动之后，总体表现稳健，以结构性行情为主。在本报告期内，受中金所交易规则的影响，股指期货与现货基差全年处于长期贴水状态，给本产品的运作带来了较大障碍。本基金在本年度严格遵守基金合同，采用多种绝对收益类量化策略的投资方式，同时保留一部分底仓进行新股申购。由于本报告期内股指期货贴水幅度过大，现货组合的超额收益没有完全覆盖基差收敛造成的损失。我们将紧密跟踪股指期货市场交易的流动性及基差水平，在严格控制本基金投资风险的前提下审慎决策，力争本基金的稳健运行，减少基差贴水带来的期货端亏损。

### 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 1.022 元；本基金份额净值增长率为-2.20%，同期业绩比较基准收益率为 1.49%。

## 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 2017 年，我们认为货币政策将从相对宽松转向稳健中性，更加强调金融风险，同时需要高度关注通胀预期变化对政策的影响。A 股市场短期受到新股发行节奏加快，增量资金不足的影响，导致股指的向上动力不足。长期来看，企业盈利状况的实质性改善有望带动市场的向上突破和情绪改善，全年来看，我们认为仍将以结构性行情为主。从国际宏观形势来看，需要重点关注美元的加息步伐给国内带来的经济扰动以及特朗普政府的贸易保护主义政策对中国的影响。对于本产品运作而言，更重要的是，我们已经看到相应的股指期货限制正在逐步放开，量化产品可望重新回归正常运作，投资运作难度相比 2016 年将大幅降低，量化投资将重新得到市场认可和重视。管理人将继续坚持量化研究，并控制波动风险，力争获取稳健的收益。

## 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；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、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《公开募集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 1701518 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 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表、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（以下简称“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和公允列报相关的内部控制，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中金基金管理有限公司管理层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。</p> <p>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在财务报表附注中所列示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的规定编制，公允反映了该基金 2016 年 12 月 31 日财务状况以及 2016 年度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	管祎铭
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	2017 年 3 月 30 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		61,659,549.71	201,772,387.13
结算备付金		27,121,662.40	95,466,420.69
存出保证金		4,262,769.68	2,480,275.06
交易性金融资产		20,794,715.85	10,089,513.99
其中：股票投资		20,794,715.85	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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		1,432,433.40	-
应收利息		6,178.67	24,078.28
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		115,277,309.71	309,832,675.15
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 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		-	-
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		96,961.09	261,061.30
应付托管费		24,240.27	65,265.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		545,888.21	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		440,000.00	250,000.00
负债合计		1,107,089.57	1,065,684.13
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		111,660,551.77	295,363,453.50
未分配利润		2,509,668.37	13,403,537.52
所有者权益合计		114,170,220.14	308,766,991.02
负债和所有者权益总计		115,277,309.71	309,832,675.15

报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.022 元，基金份额总额 111,660,551.77 份。

## 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 21 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		3,418,435.77	46,616,864.24
1. 利息收入		976,290.74	3,575,103.62
其中：存款利息收入		368,348.51	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		607,942.23	2,393,659.03
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,195,326.54	41,981,165.56
其中：股票投资收益		5,277,801.39	35,104,735.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-3,764,104.80	5,059,744.62
股利收益		681,629.95	1,816,685.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-8,359.57	-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）		255,178.06	1,197,366.56
<b>减：二、费用</b>		5,960,781.51	13,561,191.57

1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,576,993.21	7,870,472.13
2. 托管费	7.4.8.2.2	389,489.73	1,045,250.53
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		3,596,820.50	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		397,478.07	267,651.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,542,345.74	33,055,672.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,542,345.74	33,055,672.67

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	295,363,453.50	13,403,537.52	308,766,991.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-2,542,345.74	-2,542,345.74
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）	-183,702,901.73	-8,351,523.41	-192,054,425.14
其中：1. 基金申购款	365,699.62	13,360.63	379,060.25
2. 基金赎回款	-184,068,601.35	-8,364,884.04	-192,433,485.39
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）	111,660,551.77	2,509,668.37	114,170,220.14
项目	上年度可比期间 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（本期净利润）	-	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

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：

_____ 孙菁	_____ 杜季柳	_____ 白娜
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**

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合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,同时亦按照中国证监会颁布的同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况及 2016 年度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**

#### **7.4.5 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《财政部、国家税务总局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 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》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) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (3) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金没有计提有关增值税费用。

- (4) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

- (5) 对基金取得的股票的股息、红利收入，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。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红

利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(6) 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。

(7) 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 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。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
中金公司	507,633,736.59	19.22%	4,448,056,777.15	86.76%

##### 7.4.8.1.2 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。

##### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 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	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
中金公司	987,800,000.00	13.29%	12,095,900,000.00	32.16%

#### 7.4.8.1.4 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。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	371,232.39	19.22%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 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	1,576,993.21	7,870,472.13

其中：支付销售机构的客户维护费	742,381.43	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 742,381.43 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。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	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	389,489.73	1,045,250.53

注：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。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期无销售服务费。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015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	8.9600%	10,000,350.00	3.3900%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
建设银行	61,659,549.71	292,463.62	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2016年12月31日的相关余额为人民币5,892,002.01元(2015年12月31日：人民币10,896,887.94元)，本期间产生的利息收入为人民币75,884.76元(自2015年4月21日至2015年12月31日止期间：人民币279,137.53元)。

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与认购关联方承销的证券。

### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

### 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	14,111	56,444.00	56,444.00	-

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002396	星网锐捷	2016 年 9 月 12 日	重大事项停牌	19.70	2017 年 2 月 21 日	18.35	28,936	570,250.53	570,039.20	-
600151	航天机电	2016 年 11 月 11 日	重大事项停牌	10.97	-	-	40,100	447,960.28	439,897.00	-
002681	奋达科技	2016 年 12 月 19 日	重大事项停牌	12.93	-	-	7,643	98,324.34	98,823.99	-
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大事项停牌	7.29	-	-	11,801	85,567.06	86,029.29	-
603986	兆易创新	2016 年 9 月 19 日	重大事项停牌	177.97	2017 年 3 月 13 日	195.77	423	9,838.98	75,281.31	-
002727	一心堂	2016 年 12 月	重大事项	21.20	2017 年 1 月	21.66	3,161	66,385.90	67,013.20	-

		月 28 日	停牌		5 日						
600875	东方 电气	2016 年 12 月 9 日	重大 事项 停牌	10.79	2017 年 3 月 28 日	10.90	4,700	48,026.00	50,713.00	-	
000748	长城 信息	2016 年 11 月 1 日	重大 事项 停牌	20.31	-	-	1,600	33,043.00	32,496.00	-	
002025	航天 电器	2016 年 9 月 12 日	重大 事项 停牌	25.20	-	-	945	23,044.57	23,814.00	-	
000050	深天 马 A	2016 年 9 月 12 日	重大 事项 停牌	18.82	2017 年 3 月 23 日	20.70	615	11,705.64	11,574.30	-	
300243	瑞丰 高材	2016 年 9 月 20 日	重大 事项 停牌	15.18	2017 年 1 月 4 日	16.70	500	7,807.00	7,590.00	-	
300323	华灿 光电	2016 年 4 月 18 日	重大 事项 停牌	8.99	2017 年 1 月 9 日	8.65	400	3,588.00	3,596.00	-	
600649	城投 控股	2016 年 12 月 6 日	重大 事项 停牌	20.34	-	-	100	2,058.00	2,034.00	-	
000829	天音 控股	2016 年 9 月 29 日	重大 事项 停牌	11.28	-	-	146	1,742.11	1,646.88	-	
600537	亿晶 光电	2016 年 12 月 27 日	重大 事项 停牌	7.43	2017 年 1 月 13 日	8.17	147	1,064.83	1,092.21	-	
000560	昆百 大 A	2016 年 9 月 2 日	重大 事项 停牌	10.40	2017 年 3 月 24 日	11.44	100	997.67	1,040.00	-	
002129	中环 股份	2016 年 4 月 25 日	重大 事项 停牌	8.27	-	-	100	871.24	827.00	-	
002440	闰土 股份	2016 年 10 月 24 日	重大 事项 停牌	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	9	139.68	147.06	-	

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值计量

##### (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。

单位：人民币元

	2016 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	19,264,617.41	1,530,098.44	-	20,794,715.85
合计	19,264,617.41	1,530,098.44	-	20,794,715.85
	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	8,764,273.71	1,325,240.28	-	10,089,513.99
合计	8,764,273.71	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。

##### (b) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

于 2016 年 12 月 31 日及 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的流通受限的股票由于公开价格无法正常获取而从第一层次调整至第二层次，账面价值分别为人民币 1,530,098.44 元及人民币 1,325,240.28 元。于 2016 年及 2015 年，本基金持有的以公允价值计量的资产的第一层次与第二层次之间没有发生其他重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

2016 年，本基金公允价值计量所使用的估值技术并未发生变更。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2015 年 12 月 31 日：无）。

(2) 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	20,794,715.85	18.04
	其中：股票	20,794,715.85	18.04
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	88,781,212.11	77.02
7	其他各项资产	5,701,381.75	4.95
8	合计	115,277,309.71	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	126,669.56	0.11
B	采矿业	699,787.66	0.61
C	制造业	14,349,757.96	12.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,092,817.26	0.96
E	建筑业	90,244.89	0.08
F	批发和零售业	1,980,063.52	1.73
G	交通运输、仓储和邮政业	59,716.14	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	594,257.10	0.52
J	金融业	56,444.00	0.05
K	房地产业	1,303,035.63	1.14
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	72,864.00	0.06
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	367,364.13	0.32
S	综合	1,694.00	0.00
	合计	20,794,715.85	18.21

### 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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600335	国机汽车	71,700	871,155.00	0.76
2	603188	亚邦股份	47,100	841,206.00	0.74
3	002463	沪电股份	163,853	783,217.34	0.69
4	600894	广日股份	49,065	670,718.55	0.59
5	002309	中利科技	46,757	664,416.97	0.58
6	002118	紫鑫药业	85,039	612,280.80	0.54
7	601717	郑煤机	87,095	612,277.85	0.54
8	000600	建投能源	68,700	610,056.00	0.53
9	000973	佛塑科技	80,746	605,595.00	0.53
10	002396	星网锐捷	28,936	570,039.20	0.50

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601668	中国建筑	23,615,629.84	7.65
2	601818	光大银行	20,621,577.90	6.68
3	600048	保利地产	20,292,087.00	6.57
4	601288	农业银行	19,513,706.00	6.32
5	601398	工商银行	18,250,194.00	5.91
6	601318	中国平安	16,183,684.57	5.24
7	601988	中国银行	15,296,725.00	4.95
8	600519	贵州茅台	15,251,282.93	4.94
9	600999	招商证券	14,566,700.74	4.72
10	600104	上汽集团	13,282,707.88	4.30
11	600837	海通证券	12,663,429.04	4.10
12	600030	中信证券	12,455,897.00	4.03

13	601166	兴业银行	11,126,288.00	3.60
14	600015	华夏银行	9,608,176.95	3.11
15	002146	荣盛发展	9,253,766.56	3.00
16	601328	交通银行	9,253,368.00	3.00
17	601006	大秦铁路	9,062,432.66	2.94
18	600028	中国石化	8,864,485.00	2.87
19	600415	小商品城	8,857,283.60	2.87
20	600027	华电国际	8,499,839.12	2.75
21	600010	包钢股份	8,316,905.00	2.69
22	600100	同方股份	7,599,566.82	2.46
23	601600	中国铝业	7,485,784.83	2.42
24	601688	华泰证券	7,124,234.64	2.31
25	000001	平安银行	7,047,836.28	2.28
26	600718	东软集团	6,905,629.56	2.24
27	601989	中国重工	6,825,399.00	2.21
28	600518	康美药业	6,735,677.14	2.18
29	600887	伊利股份	6,453,620.00	2.09
30	000625	长安汽车	6,310,270.80	2.04

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601668	中国建筑	23,925,585.12	7.75
2	601818	光大银行	20,671,280.02	6.69
3	600048	保利地产	20,536,038.65	6.65
4	601288	农业银行	19,749,825.96	6.40
5	601398	工商银行	18,303,948.66	5.93
6	601318	中国平安	17,122,387.22	5.55
7	600519	贵州茅台	15,769,091.76	5.11
8	601988	中国银行	15,416,122.58	4.99
9	600999	招商证券	14,513,235.61	4.70
10	600104	上汽集团	13,455,607.80	4.36
11	600837	海通证券	12,876,628.48	4.17
12	600030	中信证券	12,624,132.53	4.09
13	601166	兴业银行	11,615,457.77	3.76

14	600015	华夏银行	9,646,344.86	3.12
15	601328	交通银行	9,549,615.04	3.09
16	002146	荣盛发展	9,410,729.85	3.05
17	601006	大秦铁路	9,017,639.45	2.92
18	600415	小商品城	9,010,559.83	2.92
19	600028	中国石化	8,855,377.71	2.87
20	600027	华电国际	8,565,971.45	2.77
21	600010	包钢股份	8,337,076.36	2.70
22	600100	同方股份	7,524,856.55	2.44
23	601600	中国铝业	7,454,999.76	2.41
24	601688	华泰证券	7,216,904.42	2.34
25	000001	平安银行	7,038,613.30	2.28
26	601989	中国重工	6,974,795.46	2.26
27	600718	东软集团	6,969,888.29	2.26
28	600887	伊利股份	6,824,178.27	2.21
29	600518	康美药业	6,767,374.62	2.19
30	000625	长安汽车	6,362,696.58	2.06

### 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	1,324,116,261.79
卖出股票收入（成交）总额	1,318,601,615.95

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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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
IC1701	IC1701	-16	-19,895,040.00	-121,938.82	-
公允价值变动总额合计（元）					-121,938.82
股指期货投资本期收益（元）					-3,764,104.80
股指期货投资本期公允价值变动（元）					78,885.80

### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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本期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、处罚的情形。

### 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	4,262,769.68
2	应收证券清算款	1,432,433.40
3	应收股利	-
4	应收利息	6,178.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,701,381.75

### 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	002396	星网锐捷	570,039.20	0.50	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 (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
2,194	50,893.60	10,000,350.00	8.96%	101,660,201.77	91.04%

### 9.3 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	1,897.82	0.0017%

### 9.4 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

### 9.5 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	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	10,000,350.00	8.96	10,000,350.00	8.96	自基金合同 生效之日起

					不少于三年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,350.00	8.96	10,000,350.00	8.96	-

## § 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
本报告期期初基金份额总额	295,363,453.50
本报告期基金总申购份额	365,699.62
减:本报告期基金总赎回份额	184,068,601.35
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	111,660,551.77

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。

## § 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

2016年1月6日，根据中金基金股东中金公司股东决定，同意黄晓衡先生辞去中金基金独立董事职务，任命张龙先生为中金基金第一届董事会独立董事。

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。

基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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 80,000.00 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	2	507,633,736.59	19.22%	371,232.39	19.22%	-
国信证券	2	484,899,414.09	18.36%	354,606.34	18.36%	-
华西证券	2	412,599,222.04	15.62%	301,732.34	15.62%	-
华泰证券	2	350,880,481.74	13.28%	256,600.12	13.28%	-
广发证券	2	243,803,428.61	9.23%	178,293.75	9.23%	-
民族证券	1	231,217,082.55	8.75%	169,089.24	8.75%	-
方正证券	1	144,400,745.14	5.47%	105,601.07	5.47%	-
申万宏源证券	2	135,712,685.87	5.14%	99,247.77	5.14%	-
银河证券	2	130,355,543.98	4.93%	95,328.28	4.93%	-

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。

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	-	-	987,800,000.00	13.29%	-	-
国信证券	-	-	1,198,900,000.00	16.13%	-	-
华西证券	-	-	1,608,800,000.00	21.64%	-	-
华泰证券	-	-	532,000,000.00	7.16%	-	-
广发证券	-	-	1,070,900,000.00	14.41%	-	-
民族证券	-	-	254,400,000.00	3.42%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	1,725,400,000.00	23.21%	-	-
银河证券	-	-	54,900,000.00	0.74%	-	-

**§ 12 影响投资者决策的其他重要信息**

无
---

中金基金管理有限公司  
2017年3月31日