

中金绝对收益策略定期开放 混合型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 28 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	13
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16

6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	65
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	65
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	65
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	65
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注.....	66
§8 基金份额持有人信息.....	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	68
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	69
§10 重大事件揭示.....	70
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件.....	72
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	75

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§12 备查文件目录.....	76
12.1 备查文件目录.....	76
12.2 存放地点.....	76
12.3 查阅方式.....	76

§ 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	221,670,738.49 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	李虹	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
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 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心
邮政编码		100032	100033

法定代表人	林寿康	田国立
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	2,883,423.45
本期利润	3,247,196.11
加权平均基金份额本期利润	0.0234
本期加权平均净值利润率	2.28%
本期基金份额净值增长率	2.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	7,225,679.37
期末可供分配基金份额利润	0.0326
期末基金资产净值	228,896,417.86
期末基金份额净值	1.033
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.30%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

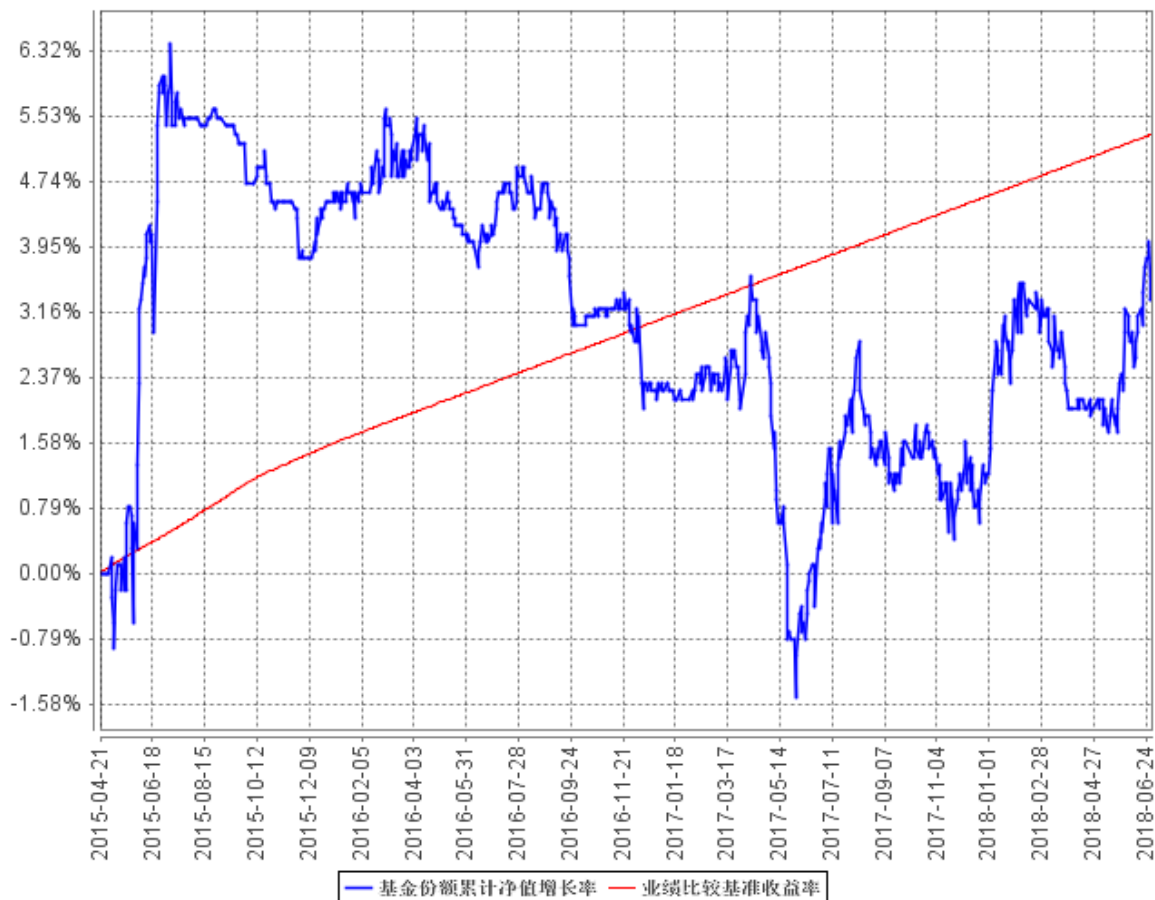
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.39%	0.22%	0.12%	0.00%	0.27%	0.22%
过去三个月	1.27%	0.19%	0.36%	0.00%	0.91%	0.19%
过去六个月	2.08%	0.23%	0.71%	0.00%	1.37%	0.23%
过去一年	2.79%	0.24%	1.45%	0.00%	1.34%	0.24%
过去三年	-2.36%	0.20%	4.83%	0.01%	-7.19%	0.19%
自基金合同生效起至今	3.30%	0.23%	5.30%	0.01%	-2.00%	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



§ 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 3 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。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金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 2018 年 6 月 30 日，公司共管理 14 支开放式基金，证券投资基金管理规模 145.22 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		
魏宇	本基金基金经理	2017 年 3 月 28 日	-	8 年	魏宇先生，香港大学统计专业博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发工作。2014 年 11 月，加入中金基金管理有限公司，现任中金基金管理有限公司量化公募投资部基金经理、副总经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《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 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金继续采用量化对冲投的投资方式，同时采用了打新策略。受市场风格转换影响，在本报告期内，基金净值有一定程度的回撤，但在报告期最后一个月已经有所反弹。接下来，我们会密切监控市场变化以及策略表现，积极应对，在控制风险的同时尽可能获得更好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.033 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.08%，业绩比较基准收益率为 0.71%。

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 年下半年，预计将会继续坚持金融去杠杆，货币政策维持稳健中性的基调不变，流动性“中性适度”，下半年经济下行压力将高于上半年。利好在于中央对于经济的发展已经作出了系列重要的部署：设立“雄安新区”，深化“一带一路”战略等，为新一轮的经济增长提供支撑；PPP 项目预计也将继续稳步推进，助力基建。国际上，主要还是关注全球经济复苏的情况，

以及美国和欧洲的货币政策。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监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历。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,576,720.34	2,005,096.03
结算备付金		39,595,016.10	12,338,799.43
存出保证金		25,166,325.05	8,984,410.97
交易性金融资产	6.4.7.2	147,264,199.02	45,299,556.66
其中：股票投资		147,264,199.02	45,265,338.26
基金投资		-	-
债券投资		-	34,218.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	6,000,000.00	-
应收证券清算款		-	7,080,329.46
应收利息	6.4.7.5	1,029.35	-2,404.08
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		230,603,289.86	75,705,788.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		482,739.05	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		187,964.89	63,730.63
应付托管费		46,991.22	15,932.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	404,457.16	290,361.54
应交税费		477,260.66	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	107,459.02	170,000.00
负债合计		1,706,872.00	540,024.83
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	221,670,738.49	74,238,794.56
未分配利润	6.4.7.10	7,225,679.37	926,969.08
所有者权益合计		228,896,417.86	75,165,763.64
负债和所有者权益总计		230,603,289.86	75,705,788.47

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.033 元，基金份额总额 221,670,738.49 份。

6.2 利润表

会计主体：中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		4,995,297.18	-1,852,361.37
1.利息收入		485,347.34	309,345.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	68,396.53	66,003.70
债券利息收入		3.73	0.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		416,947.08	243,340.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,146,062.45	-2,742,233.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,378,728.43	1,549,417.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,190.20	22.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	4,189,959.02	-5,197,935.77
股利收益	6.4.7.15	1,331,641.66	906,262.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	363,772.66	567,708.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	114.73	12,818.39
减：二、费用		1,748,101.07	2,391,595.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	694,226.62	690,407.75

2. 托管费	6.4.10.2.2	173,556.65	172,601.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	782,053.30	1,437,837.94
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		15,083.86	-
7. 其他费用	6.4.7.19	83,180.64	90,747.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,247,196.11	-4,243,956.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,247,196.11	-4,243,956.38

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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）	74,238,794.56	926,969.08	75,165,763.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,247,196.11	3,247,196.11
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）	147,431,943.93	3,051,514.18	150,483,458.11
其中：1.基金申购款	160,568,394.51	3,312,239.14	163,880,633.65
2.基金赎回款	-13,136,450.58	-260,724.96	-13,397,175.54
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）	221,670,738.49	7,225,679.37	228,896,417.86

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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)	111,660,551.77	2,509,668.37	114,170,220.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,243,956.38	-4,243,956.38
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)	69,151,873.31	2,696,923.91	71,848,797.22
其中：1.基金申购款	88,824,237.11	3,197,393.43	92,021,630.54
2.基金赎回款	-19,672,363.80	-500,469.52	-20,172,833.32
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)	180,812,425.08	962,635.90	181,775,060.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 孙菁	_____ 张纳	_____ 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）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。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 2 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金财务报表的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表涵盖期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 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：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、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产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，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-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。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

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。

6.4.4.5 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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金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 / (未弥补亏损) ”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益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（如适用）后的净额确认。

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（如适用）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。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产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，在资金实际占用期间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。

公允价值变动收益 /（损失）核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

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，在资金实际占用期间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。

6.4.4.11 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《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》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；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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 [2017] 13 号《中国证券监督管理委员会关于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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017] 6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《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》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税 [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〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》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：

(a) 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。

(b) 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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。

(c) 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。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司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。

(e) 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。

(f) 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，暂不征收企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	12,576,720.34
定期存款	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	12,576,720.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	158,623,001.32	147,264,199.02	-11,358,802.30
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	158,623,001.32	147,264,199.02	-11,358,802.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

股指期货投资：				2017 年 12 月 31 日
代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC1809	IC1809	-69	-70,553,880.00	5,649,760.00
IF1809	IF1809	-71	-73,331,640.00	5,939,040.00
总额合计				11,588,800.00
减：可抵销期货暂付款				11,588,800.00

股指期货投资净额				0.00
----------	--	--	--	------

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
买入返售证券_上交所	6,000,000.00	-
合计	6,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	880.23
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	1,578.00
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-1,454.11
应收申购款利息	0.13
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	25.10
合计	1,029.35

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	404,457.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	404,457.16

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付审计费	32,828.04
应付信息披露费	74,630.98
合计	107,459.02

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	74,238,794.56	74,238,794.56
本期申购	160,568,394.51	160,568,394.51
本期赎回(以“-”号填列)	-13,136,450.58	-13,136,450.58
- 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	221,670,738.49	221,670,738.49

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,527,904.17	-600,935.09	926,969.08
本期利润	2,883,423.45	363,772.66	3,247,196.11

本期基金份额交易产生的变动数	4,737,325.53	-1,685,811.35	3,051,514.18
其中：基金申购款	5,115,851.48	-1,803,612.34	3,312,239.14
基金赎回款	-378,525.95	117,800.99	-260,724.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,148,653.15	-1,922,973.78	7,225,679.37

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	49,019.75
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,075.26
其他	301.52
合计	68,396.53

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	253,807,873.30
减：卖出股票成本总额	255,186,601.73
买卖股票差价收入	-1,378,728.43

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,190.20
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	3,190.20
----	----------

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	35,101.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,900.00
减：应收利息总额	11.26
买卖债券差价收入	3,190.20

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2018年1月1日至2018年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	4,189,959.02

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,331,641.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,331,641.66

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-11,144,787.15
——股票投资	-11,142,468.75
——债券投资	-2,318.40
——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	11,886,602.22
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	378,042.41
合计	363,772.66

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	114.73
合计	114.73

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	763,778.09
银行间市场交易费用	-
股指期货交易费用	18,275.21
合计	782,053.30

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	32,828.04
信息披露费	44,630.98
汇划手续费	5,721.62
合计	83,180.64

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金本报告披露日，本基金无重大或有事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金管理有限公司(“中金基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司(“中金公司”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中投证券有限责任公司(“中投证券”)	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中金公司	-	-	335,302,914.23	30.69%
中投证券	-	-	181,668,756.67	16.63%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
中金公司	-	-	364,300,000.00	20.67%
中投证券	-	-	634,000,000.00	35.97%

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中金公司	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中金公司	245,208.12	30.69%	245,208.12	19.12%
中投证券	132,854.94	16.63%	132,854.94	10.36%

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	694,226.62	690,407.75

其中：支付销售机构的客户维护费	168,971.63	204,499.23
-----------------	------------	------------

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	173,556.65	172,601.95

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

§ 7 项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 4 月 21 日）持有的基金份额	0.00
期初持有的基金份额	0.00
期间申购/买入总份额	4,897,159.65
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	4,897,159.65
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.21%

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 4 月 21 日）持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	-

期末持有的基金份额	-
占基金总份额比例	

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金总赎回份额含转换出份额。

7.1.1.1.1 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 2018年6月30日		上年度末 2017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	4.5100%	10,000,350.00	13.4700%

7.1.1.1.2 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	12,576,720.34	49,019.75	11,223,887.81	40,295.61

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2018年6月30日的相关余额为人民币3,562,568.65元（2017年6月30日：1,829,091.33元），本期间产生的利息收入为人民币19,376.78元（自2017年1月1日至2017年6月30日止期间：25,708.09元）。

7.1.1.1.3 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中金公司	601138	工业富联	网上发行	2,000	27,540.00

7.1.1.4 其他关联交易事项的说明

无

7.1.2 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

7.1.3 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

7.1.3.1 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

6.4.12.1.1 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
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

7.1.3.2 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
002310	东方	2018年5月	重大	15.03	2018年8月	13.47	100,500	1,898,621.13	1,510,515.00	-

	园林	月 25 日	资产重组		月 27 日						
002450	康得新	2018 年 6 月 4 日	重大资产重组	17.08	-	-	56,600	1,154,984.08	966,728.00	-	
000008	神州高铁	2018 年 6 月 6 日	重大事项	4.96	2018 年 8 月 7 日	4.46	117,559	665,858.41	583,092.64	-	
000669	金鸿控股	2018 年 5 月 18 日	重大资产重组	7.25	2018 年 8 月 6 日	6.53	76,020	594,151.29	551,145.00	-	
601390	中国中铁	2018 年 5 月 7 日	重大事项	7.47	2018 年 8 月 20 日	7.25	33,400	248,794.39	249,498.00	-	
300266	兴源环境	2018 年 2 月 5 日	重大资产重组	19.99	2018 年 7 月 2 日	17.99	11,500	280,887.00	229,885.00	-	
600022	山东钢铁	2018 年 3 月 27 日	重大资产重组	2.02	2018 年 8 月 16 日	1.83	95,599	210,494.71	193,109.98	-	
002426	胜利精密	2018 年 6 月 19 日	重大事项	3.60	2018 年 7 月 3 日	3.26	51,200	199,854.85	184,320.00	-	
002699	美盛文化	2018 年 2 月 5 日	重大资产	18.76	2018 年 7 月 2 日	16.88	9,000	165,497.01	168,840.00	-	

			重组							
002051	中工国际	2018年4月9日	重大资产重组	15.27	-	-	10,725	184,865.74	163,770.75	-
600750	江中药业	2018年5月2日	重大资产重组	17.75	2018年8月1日	16.12	7,151	130,483.10	126,930.25	-
600811	东方集团	2018年5月30日	重大事项	4.30	-	-	29,299	127,754.52	125,985.70	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大资产重组	9.49	-	-	10,133	105,381.34	96,162.17	-
002437	誉衡药业	2018年6月11日	重大资产重组	6.20	2018年8月13日	5.57	15,200	101,264.65	94,240.00	-
600751	海航科技	2018年1月12日	重大资产重组	6.49	-	-	12,513	78,177.85	81,209.37	-
000825	太钢不锈	2018年4月16日	重大资产重组	6.00	-	-	10,571	60,024.36	63,426.00	-
002359	北讯	2018年5月	重大	19.58	2018年8月	17.62	2,999	76,089.19	58,720.42	-

	集团	月 21 日	资产重组		月 21 日						
002512	达华智能	2018 年 6 月 19 日	重大事项	9.70	-	-	3,900	41,608.00	37,830.00	-	-
600759	洲际油气	2018 年 3 月 27 日	重大资产重组	3.94	-	-	8,699	31,807.66	34,274.06	-	-
300146	汤臣倍健	2018 年 1 月 31 日	重大资产重组	16.60	2018 年 7 月 31 日	16.50	1,200	20,163.00	19,920.00	-	-
002011	盾安环境	2018 年 5 月 2 日	重大资产重组	6.40	-	-	2,400	16,704.37	15,360.00	-	-
002431	棕榈股份	2018 年 5 月 30 日	重大事项	6.71	-	-	2,100	14,990.35	14,091.00	-	-
002573	清新环境	2018 年 6 月 19 日	重大事项	11.55	-	-	1,001	13,854.47	11,561.55	-	-
600687	刚泰控股	2018 年 6 月 11 日	重大事项	9.09	2018 年 8 月 20 日	8.18	900	8,891.36	8,181.00	-	-
002665	首航节能	2018 年 5 月 29 日	重大资产重组	5.80	-	-	1,400	9,242.74	8,120.00	-	-

002408	齐翔腾达	2018年6月19日	重大资产重组	12.28	-	-	635	8,793.53	7,797.80	-
002005	德豪润达	2018年1月2日	重大资产重组	4.36	2018年7月2日	3.92	1,609	7,064.48	7,015.24	-
002477	雏鹰农牧	2018年6月14日	重大事项	3.31	-	-	1,000	3,586.58	3,310.00	-
600122	宏图高科	2018年6月19日	重大资产重组	7.40	-	-	400	3,179.00	2,960.00	-
600335	国机汽车	2018年4月3日	重大事项	10.43	-	-	675	6,999.38	7,040.25	-

7.1.3.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.1.3.3.1 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。

7.1.3.3.2 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。

7.1.4 金融工具风险及管理

7.1.4.1 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。

7.1.4.2 信用风险

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

7.1.4.2.1 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。（上年度末：同）

7.1.4.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

7.1.4.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

7.1.4.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	34,218.40
未评级	-	-
合计	-	34,218.40

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

7.1.4.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

7.1.4.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

7.1.4.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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或期货交易所交易，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。

7.1.4.4 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。

7.1.4.4.1 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。

7.1.4.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,576,720.34	-	-	-	12,576,720.34
结算备付金	39,595,016.10	-	-	-	39,595,016.10
存出保证金	25,166,325.05	-	-	-	25,166,325.05
交易性金融资产- 股票投资	-	-	-	147,264,199.02	147,264,199.02
交易性金融资产- 债券投资	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,029.35	1,029.35
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	83,338,061.49	-	-	147,265,228.37	230,603,289.86
负债					
卖出回购金融资产 款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	482,739.05	482,739.05

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	187,964.89	187,964.89
应付托管费	-	-	-	46,991.22	46,991.22
应付交易费用	-	-	-	404,457.16	404,457.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	477,260.66	477,260.66
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	107,459.02	107,459.02
负债总计	-	-	-	1,706,872.00	1,706,872.00
利率敏感度缺口	83,338,061.49	-	-	-145,558,356.37	228,896,417.86
上年度末 2017 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	2,005,096.03	-	-	-	2,005,096.03
结算备付金	12,338,799.43	-	-	-	12,338,799.43
存出保证金	8,984,410.97	-	-	-	8,984,410.97
交易性金融资产- 股票投资	-	-	-	45,265,338.26	45,265,338.26
交易性金融资产- 债券投资	-	-	34,218.40	-	34,218.40
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	7,080,329.46	7,080,329.46
应收利息	-	-	-	-2,404.08	-2,404.08
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	23,328,306.43	-	34,218.40	52,343,263.64	75,705,788.47
负债					
卖出回购金融资产 款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	63,730.63	63,730.63
应付托管费	-	-	-	15,932.66	15,932.66
应付交易费用	-	-	-	290,361.54	290,361.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	540,024.83	540,024.83
利率敏感度缺口	23,328,306.43	-	34,218.40	51,803,238.81	75,165,763.64

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

7.1.4.4.1.2 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。上期末本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0455%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.1.4.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。

7.1.4.4.3 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。

7.1.4.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	147,264,199.02	64.34	45,265,338.26	60.22
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	34,218.40	0.05
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	147,264,199.02	64.34	45,299,556.66	60.27

7.1.4.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	53,925.11	192,438.64
	沪深 300 指数下降 5%	-53,925.11	-192,438.64

7.1.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 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	147,264,199.02	63.86
	其中：股票	147,264,199.02	63.86
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	6,000,000.00	2.60
	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	52,171,736.44	22.62
7	其他各项资产	25,167,354.40	10.91
8	合计	230,603,289.86	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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	164,418.95	0.07
B	采矿业	4,203,109.61	1.84
C	制造业	72,120,340.33	31.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,498,345.86	2.40
E	建筑业	6,339,708.18	2.77
F	批发和零售业	7,400,221.37	3.23
G	交通运输、仓储和邮政业	6,555,405.68	2.86
H	住宿和餐饮业	14,784.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,505,793.32	1.97
J	金融业	21,696,782.23	9.48
K	房地产业	11,408,715.17	4.98
L	租赁和商务服务业	2,051,499.44	0.90
M	科学研究和技术服务业	17,334.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,783,155.15	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,208.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	3,297,876.63	1.44
S	综合	191,501.10	0.08
	合计	147,264,199.02	64.34

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	600519	贵州茅台	4,200	3,072,132.00	1.34
2	600016	民生银行	397,010	2,779,070.00	1.21
3	600015	华夏银行	265,300	1,976,485.00	0.86
4	000718	苏宁环球	515,187	1,890,736.29	0.83
5	300039	上海凯宝	321,375	1,863,975.00	0.81
6	600557	康缘药业	148,810	1,837,803.50	0.80
7	002304	洋河股份	13,800	1,816,080.00	0.79
8	601006	大秦铁路	215,200	1,766,792.00	0.77
9	601169	北京银行	285,087	1,719,074.61	0.75
10	603188	ST 亚邦	166,300	1,696,260.00	0.74
11	601717	郑煤机	275,755	1,602,136.55	0.70
12	600919	江苏银行	246,000	1,576,860.00	0.69
13	600369	西南证券	396,800	1,527,680.00	0.67
14	002310	东方园林	100,500	1,510,515.00	0.66
15	600422	昆药集团	193,899	1,502,717.25	0.66
16	002317	众生药业	141,974	1,500,665.18	0.66
17	000157	中联重科	359,200	1,476,312.00	0.64
18	600153	建发股份	164,130	1,475,528.70	0.64
19	000848	承德露露	138,918	1,471,141.62	0.64
20	601888	中国国旅	22,800	1,468,548.00	0.64
21	002603	以岭药业	104,810	1,465,243.80	0.64
22	601168	西部矿业	232,920	1,462,737.60	0.64
23	600208	新湖中宝	381,200	1,456,184.00	0.64
24	000425	徐工机械	339,200	1,438,208.00	0.63

25	600170	上海建工	470,700	1,430,928.00	0.63
26	600376	首开股份	203,112	1,427,877.36	0.62
27	600585	海螺水泥	41,063	1,374,789.24	0.60
28	000338	潍柴动力	153,400	1,342,250.00	0.59
29	000069	华侨城 A	185,640	1,342,177.20	0.59
30	600309	万华化学	28,800	1,308,096.00	0.57
31	601166	兴业银行	90,230	1,299,312.00	0.57
32	600741	华域汽车	54,240	1,286,572.80	0.56
33	600611	大众交通	321,135	1,278,117.30	0.56
34	000895	双汇发展	48,010	1,267,944.10	0.55
35	601229	上海银行	80,173	1,263,526.48	0.55
36	603288	海天味业	17,000	1,251,880.00	0.55
37	601009	南京银行	161,410	1,247,699.30	0.55
38	600383	金地集团	121,240	1,235,435.60	0.54
39	601318	中国平安	20,600	1,206,748.00	0.53
40	600674	川投能源	136,198	1,187,646.56	0.52
41	600597	光明乳业	117,847	1,163,149.89	0.51
42	000826	启迪桑德	65,540	1,145,639.20	0.50
43	601997	贵阳银行	90,550	1,119,198.00	0.49
44	600398	海澜之家	85,160	1,084,938.40	0.47
45	002572	索菲亚	32,530	1,046,815.40	0.46
46	600219	南山铝业	382,300	1,036,033.00	0.45
47	600820	隧道股份	171,700	1,014,747.00	0.44
48	600978	宜华生活	147,060	1,004,419.80	0.44
49	601021	春秋航空	28,520	999,055.60	0.44
50	000623	吉林敖东	54,910	987,281.80	0.43
51	002450	康得新	56,600	966,728.00	0.42
52	600104	上汽集团	26,780	937,032.20	0.41
53	600757	长江传媒	164,145	933,985.05	0.41
54	002294	信立泰	24,610	914,753.70	0.40
55	601818	光大银行	242,690	888,245.40	0.39
56	600655	豫园股份	92,949	878,368.05	0.38
57	300027	华谊兄弟	138,510	853,221.60	0.37
58	600216	浙江医药	65,848	840,878.96	0.37
59	601333	广深铁路	197,300	838,525.00	0.37
60	002233	塔牌集团	73,014	835,280.16	0.36
61	002463	沪电股份	215,309	805,255.66	0.35
62	600867	通化东宝	33,210	796,043.70	0.35
63	600664	哈药股份	199,329	791,336.13	0.35

64	603198	迎驾贡酒	42,799	786,217.63	0.34
65	600073	上海梅林	118,130	784,383.20	0.34
66	000528	柳工	72,420	775,618.20	0.34
67	600572	康恩贝	98,436	705,786.12	0.31
68	600089	特变电工	101,642	704,379.06	0.31
69	600694	大商股份	21,499	698,932.49	0.31
70	600887	伊利股份	24,810	692,199.00	0.30
71	601678	滨化股份	111,399	688,445.82	0.30
72	600729	重庆百货	20,600	678,770.00	0.30
73	600705	中航资本	140,730	657,209.10	0.29
74	600064	南京高科	89,400	656,196.00	0.29
75	603444	吉比特	5,099	651,601.21	0.28
76	600500	中化国际	95,300	649,946.00	0.28
77	002280	联络互动	109,222	624,749.84	0.27
78	000031	中粮地产	104,864	606,113.92	0.26
79	600009	上海机场	10,782	598,185.36	0.26
80	000627	天茂集团	83,833	588,507.66	0.26
81	601001	大同煤业	118,228	586,410.88	0.26
82	601016	节能风电	203,959	585,362.33	0.26
83	000008	神州高铁	117,559	583,092.64	0.25
84	000581	威孚高科	26,137	577,889.07	0.25
85	002056	横店东磁	79,685	558,591.85	0.24
86	000552	靖远煤电	169,079	552,888.33	0.24
87	000669	金鸿控股	76,020	551,145.00	0.24
88	600167	联美控股	54,720	547,200.00	0.24
89	000625	长安汽车	60,300	542,700.00	0.24
90	603025	大豪科技	27,733	536,356.22	0.23
91	002004	华邦健康	104,399	530,346.92	0.23
92	000778	新兴铸管	120,770	516,895.60	0.23
93	000858	五粮液	6,700	509,200.00	0.22
94	002152	广电运通	85,400	502,152.00	0.22
95	601117	中国化学	73,840	496,943.20	0.22
96	601211	国泰君安	33,270	490,399.80	0.21
97	000501	鄂武商A	39,543	485,983.47	0.21
98	600648	外高桥	25,910	473,634.80	0.21
99	600017	日照港	146,874	471,465.54	0.21
100	000100	TCL 集团	153,700	445,730.00	0.19
101	600649	城投控股	72,723	445,064.76	0.19
102	600863	内蒙华电	194,453	441,408.31	0.19

103	300026	红日药业	120,753	440,748.45	0.19
104	601311	骆驼股份	38,109	437,110.23	0.19
105	000926	福星股份	60,019	431,536.61	0.19
106	000568	泸州老窖	7,040	428,454.40	0.19
107	002110	三钢闽光	26,610	426,558.30	0.19
108	600795	国电电力	158,400	415,008.00	0.18
109	601788	光大证券	37,520	411,969.60	0.18
110	000598	兴蓉环境	101,090	410,425.40	0.18
111	601928	凤凰传媒	67,470	410,217.60	0.18
112	600618	氯碱化工	47,509	404,301.59	0.18
113	601601	中国太保	12,600	401,310.00	0.18
114	601991	大唐发电	130,900	396,627.00	0.17
115	601328	交通银行	68,100	390,894.00	0.17
116	600837	海通证券	40,200	380,694.00	0.17
117	600126	杭钢股份	63,628	379,859.16	0.17
118	002332	仙琚制药	43,330	379,137.50	0.17
119	600881	亚泰集团	101,556	378,803.88	0.17
120	000758	中色股份	83,200	374,400.00	0.16
121	002261	拓维信息	79,900	367,540.00	0.16
122	601811	新华文轩	37,049	360,116.28	0.16
123	600511	国药股份	13,106	353,206.70	0.15
124	000887	中鼎股份	24,509	353,174.69	0.15
125	600639	浦东金桥	27,818	347,168.64	0.15
126	000006	深振业 A	56,899	333,428.14	0.15
127	300002	神州泰岳	76,700	319,839.00	0.14
128	601689	拓普集团	16,273	316,347.12	0.14
129	000547	航天发展	40,000	312,400.00	0.14
130	000999	华润三九	11,109	309,163.47	0.14
131	600256	广汇能源	74,609	305,150.81	0.13
132	600143	金发科技	58,201	303,809.22	0.13
133	601801	皖新传媒	39,720	302,269.20	0.13
134	002508	老板电器	9,773	299,249.26	0.13
135	601099	太平洋	126,100	295,074.00	0.13
136	000049	德赛电池	10,419	294,024.18	0.13
137	002815	崇达技术	18,148	292,182.80	0.13
138	600886	国投电力	39,700	288,619.00	0.13
139	600282	南钢股份	65,146	287,945.32	0.13
140	601607	上海医药	11,640	278,196.00	0.12
141	000651	格力电器	5,900	278,185.00	0.12

142	600079	人福医药	20,364	269,212.08	0.12
143	600056	中国医药	14,526	265,390.02	0.12
144	300297	蓝盾股份	32,628	264,613.08	0.12
145	601618	中国中冶	76,900	256,077.00	0.11
146	600000	浦发银行	26,312	251,542.72	0.11
147	600006	东风汽车	61,330	250,839.70	0.11
148	002277	友阿股份	54,320	250,415.20	0.11
149	601390	中国中铁	33,400	249,498.00	0.11
150	000876	新希望	39,100	247,894.00	0.11
151	601000	唐山港	105,369	247,617.15	0.11
152	601186	中国铁建	28,600	246,532.00	0.11
153	002191	劲嘉股份	31,709	236,866.23	0.10
154	300266	兴源环境	11,500	229,885.00	0.10
155	002589	瑞康医药	16,238	221,486.32	0.10
156	002701	奥瑞金	39,499	215,664.54	0.09
157	000997	新大陆	13,500	212,625.00	0.09
158	002128	露天煤业	23,010	208,470.60	0.09
159	000423	东阿阿胶	3,760	202,325.60	0.09
160	300287	飞利信	27,627	198,638.13	0.09
161	000980	众泰汽车	27,920	198,511.20	0.09
162	600717	天津港	25,920	195,177.60	0.09
163	600518	康美药业	8,500	194,480.00	0.08
164	002344	海宁皮城	39,800	193,428.00	0.08
165	002002	鸿达兴业	41,929	193,292.69	0.08
166	600022	山东钢铁	95,599	193,109.98	0.08
167	002221	东华能源	19,636	191,843.72	0.08
168	601377	兴业证券	36,000	189,720.00	0.08
169	002416	爱施德	32,284	189,507.08	0.08
170	000488	晨鸣纸业	14,339	185,259.88	0.08
171	600748	上实发展	36,744	185,189.76	0.08
172	002385	大北农	44,754	184,834.02	0.08
173	002426	胜利精密	51,200	184,320.00	0.08
174	000830	鲁西化工	10,699	182,738.92	0.08
175	601800	中国交建	15,900	181,101.00	0.08
176	600028	中国石化	27,800	180,422.00	0.08
177	600939	重庆建工	36,499	180,305.06	0.08
178	601668	中国建筑	32,820	179,197.20	0.08
179	600580	卧龙电气	23,421	178,468.02	0.08
180	300122	智飞生物	3,900	178,386.00	0.08

181	600201	生物股份	10,369	177,206.21	0.08
182	000002	万科 A	7,200	177,120.00	0.08
183	002608	江苏国信	25,491	175,887.90	0.08
184	600060	海信电器	13,036	174,552.04	0.08
185	000766	通化金马	14,600	173,448.00	0.08
186	002699	美盛文化	9,000	168,840.00	0.07
187	601669	中国电建	31,310	167,821.60	0.07
188	600808	马钢股份	46,730	167,760.70	0.07
189	000333	美的集团	3,200	167,104.00	0.07
190	002051	中工国际	10,725	163,770.75	0.07
191	000963	华东医药	3,330	160,672.50	0.07
192	300088	长信科技	27,600	160,080.00	0.07
193	600062	华润双鹤	6,499	159,550.45	0.07
194	000661	长春高新	698	158,934.60	0.07
195	600260	凯乐科技	5,762	154,652.08	0.07
196	002064	华峰氨纶	36,901	152,401.13	0.07
197	000028	国药一致	2,999	149,650.10	0.07
198	600160	巨化股份	20,326	148,786.32	0.07
199	600195	中牧股份	7,608	147,975.60	0.06
200	002707	众信旅游	15,199	145,910.40	0.06
201	603328	依顿电子	13,387	145,248.95	0.06
202	600390	五矿资本	18,700	144,925.00	0.06
203	600993	马应龙	8,399	142,866.99	0.06
204	002440	闰土股份	12,076	141,168.44	0.06
205	002373	千方科技	10,700	139,635.00	0.06
206	601179	中国西电	40,710	139,228.20	0.06
207	600094	大名城	23,873	137,508.48	0.06
208	000012	南玻 A	27,759	137,407.05	0.06
209	002022	科华生物	11,399	135,078.15	0.06
210	600426	华鲁恒升	7,599	133,666.41	0.06
211	600373	中文传媒	10,400	133,640.00	0.06
212	600458	时代新材	18,099	133,208.64	0.06
213	600926	杭州银行	11,900	131,971.00	0.06
214	600535	天士力	5,080	131,165.60	0.06
215	600516	方大炭素	5,378	131,115.64	0.06
216	600765	中航重机	17,360	129,158.40	0.06
217	000541	佛山照明	21,472	128,617.28	0.06
218	603019	中科曙光	2,800	128,436.00	0.06
219	002078	太阳纸业	13,221	128,111.49	0.06

220	600750	江中药业	7,151	126,930.25	0.06
221	600811	东方集团	29,299	125,985.70	0.06
222	000553	沙隆达 A	7,900	124,899.00	0.05
223	600023	浙能电力	26,600	123,956.00	0.05
224	002354	天神娱乐	12,953	119,944.78	0.05
225	002410	广联达	4,312	119,571.76	0.05
226	000977	浪潮信息	5,000	119,250.00	0.05
227	600329	中新药业	6,199	117,781.00	0.05
228	000783	长江证券	21,570	117,125.10	0.05
229	600737	中粮糖业	15,268	115,120.72	0.05
230	600325	华发股份	14,823	114,581.79	0.05
231	002916	深南电路	1,800	114,318.00	0.05
232	600300	维维股份	35,010	114,132.60	0.05
233	300182	捷成股份	15,015	113,813.70	0.05
234	601155	新城控股	3,670	113,659.90	0.05
235	601020	华钰矿业	8,200	113,078.00	0.05
236	300070	碧水源	8,100	112,833.00	0.05
237	000413	东旭光电	18,200	110,292.00	0.05
238	002244	滨江集团	21,199	110,234.80	0.05
239	002174	游族网络	5,500	109,450.00	0.05
240	600755	厦门国贸	14,968	109,116.72	0.05
241	600565	迪马股份	36,697	108,256.15	0.05
242	300159	新研股份	15,200	107,616.00	0.05
243	601128	常熟银行	18,231	104,281.32	0.05
244	002709	天赐材料	2,700	104,058.00	0.05
245	601200	上海环境	6,300	99,729.00	0.04
246	601985	中国核电	17,300	97,745.00	0.04
247	600839	四川长虹	33,700	96,382.00	0.04
248	300324	旋极信息	10,133	96,162.17	0.04
249	300308	中际旭创	1,600	96,064.00	0.04
250	002375	亚厦股份	17,699	94,512.66	0.04
251	600031	三一重工	10,520	94,364.40	0.04
252	002437	誉衡药业	15,200	94,240.00	0.04
253	603858	步长制药	2,200	94,138.00	0.04
254	000860	顺鑫农业	2,510	94,125.00	0.04
255	000975	银泰资源	9,259	93,886.26	0.04
256	000078	海王生物	19,203	92,366.43	0.04
257	300253	卫宁健康	7,200	89,208.00	0.04
258	000813	德展健康	10,800	88,992.00	0.04

259	002640	跨境通	5,799	87,100.98	0.04
260	600885	宏发股份	2,899	86,738.08	0.04
261	002491	通鼎互联	7,815	86,512.05	0.04
262	601898	中煤能源	17,630	85,152.90	0.04
263	002268	卫士通	3,900	85,137.00	0.04
264	601127	小康股份	4,900	84,721.00	0.04
265	600859	王府井	3,940	83,803.80	0.04
266	002583	海能达	10,000	83,500.00	0.04
267	600011	华能国际	13,100	83,316.00	0.04
268	600959	江苏有线	16,210	82,671.00	0.04
269	000009	中国宝安	16,799	82,315.10	0.04
270	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.04
271	600751	海航科技	12,513	81,209.37	0.04
272	002019	亿帆医药	4,594	81,084.10	0.04
273	000066	中国长城	11,400	81,054.00	0.04
274	000750	国海证券	22,605	80,699.85	0.04
275	600908	无锡银行	13,599	80,098.11	0.03
276	002407	多氟多	5,700	79,914.00	0.03
277	000898	鞍钢股份	14,190	79,038.30	0.03
278	600872	中炬高新	2,784	77,952.00	0.03
279	600643	爱建集团	8,253	77,578.20	0.03
280	300315	掌趣科技	18,400	76,912.00	0.03
281	601288	农业银行	22,000	75,680.00	0.03
282	002195	二三四五	17,569	75,195.32	0.03
283	300043	星辉娱乐	18,700	74,800.00	0.03
284	600823	世茂股份	17,800	74,404.00	0.03
285	600499	科达洁能	10,800	74,088.00	0.03
286	002400	省广集团	22,800	73,644.00	0.03
287	600395	盘江股份	12,119	73,562.33	0.03
288	002439	启明星辰	3,465	73,527.30	0.03
289	000060	中金岭南	15,000	72,900.00	0.03
290	600718	东软集团	5,529	72,208.74	0.03
291	000563	陕国投A	20,700	70,380.00	0.03
292	002176	江特电机	7,199	69,974.28	0.03
293	600169	太原重工	29,799	69,729.66	0.03
294	300166	东方国信	4,700	69,231.00	0.03
295	600277	亿利洁能	13,203	69,183.72	0.03
296	002048	宁波华翔	5,500	67,815.00	0.03
297	600895	张江高科	5,800	66,700.00	0.03

298	600528	中铁工业	6,300	64,386.00	0.03
299	000513	丽珠集团	1,456	63,991.20	0.03
300	000825	太钢不锈	10,571	63,426.00	0.03
301	600545	卓郎智能	7,919	62,876.86	0.03
302	600525	长园集团	5,941	62,796.37	0.03
303	000418	小天鹅A	900	62,415.00	0.03
304	600410	华胜天成	7,100	62,125.00	0.03
305	600875	东方电气	8,299	61,495.59	0.03
306	000703	恒逸石化	4,120	61,305.60	0.03
307	000937	冀中能源	14,821	60,914.31	0.03
308	600936	广西广电	12,599	59,971.24	0.03
309	002359	北讯集团	2,999	58,720.42	0.03
310	600521	华海药业	2,199	58,691.31	0.03
311	002183	怡亚通	8,799	58,513.35	0.03
312	603568	伟明环保	2,259	57,152.70	0.02
313	600743	华远地产	22,030	56,617.10	0.02
314	603369	今世缘	2,450	55,933.50	0.02
315	600594	益佰制药	6,190	55,462.40	0.02
316	300010	立思辰	4,500	55,080.00	0.02
317	001696	宗申动力	11,199	54,875.10	0.02
318	600598	北大荒	5,899	54,034.84	0.02
319	600108	亚盛集团	18,599	53,751.11	0.02
320	000596	古井贡酒	600	53,268.00	0.02
321	600380	健康元	4,486	53,203.96	0.02
322	600869	智慧能源	11,200	52,864.00	0.02
323	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.02
324	600801	华新水泥	3,387	50,906.61	0.02
325	002038	双鹭药业	1,300	49,387.00	0.02
326	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.02
327	000402	金融街	6,000	48,300.00	0.02
328	600970	中材国际	7,085	47,327.80	0.02
329	601777	力帆股份	8,827	46,165.21	0.02
330	300055	万邦达	3,999	45,948.51	0.02
331	300113	顺网科技	2,599	45,248.59	0.02
332	600292	远达环保	7,688	45,128.56	0.02
333	002505	大康农业	20,900	44,726.00	0.02
334	002093	国脉科技	5,800	44,718.00	0.02
335	600276	恒瑞医药	590	44,698.40	0.02
336	600809	山西汾酒	700	44,023.00	0.02

337	002251	步步高	3,800	43,244.00	0.02
338	002250	联化科技	4,900	43,218.00	0.02
339	600777	新潮能源	19,400	42,486.00	0.02
340	601988	中国银行	11,700	42,237.00	0.02
341	000685	中山公用	5,299	42,233.03	0.02
342	600348	阳泉煤业	5,899	42,177.85	0.02
343	600637	东方明珠	2,800	42,168.00	0.02
344	603355	莱克电气	1,400	42,070.00	0.02
345	002073	软控股份	7,255	41,716.25	0.02
346	600582	天地科技	11,359	41,687.53	0.02
347	002223	鱼跃医疗	2,100	40,929.00	0.02
348	002368	太极股份	1,399	40,668.93	0.02
349	600120	浙江东方	2,920	39,566.00	0.02
350	002588	史丹利	7,620	39,471.60	0.02
351	002818	富森美	1,483	39,121.54	0.02
352	600536	中国软件	1,799	38,912.37	0.02
353	600563	法拉电子	777	38,453.73	0.02
354	603833	欧派家居	300	38,259.00	0.02
355	603556	海兴电力	2,090	37,975.30	0.02
356	002512	达华智能	3,900	37,830.00	0.02
357	600068	葛洲坝	5,140	37,059.40	0.02
358	603589	口子窖	597	36,685.65	0.02
359	000878	云南铜业	3,800	36,252.00	0.02
360	600161	天坛生物	1,820	35,217.00	0.02
361	601966	玲珑轮胎	2,200	34,694.00	0.02
362	600759	洲际油气	8,699	34,274.06	0.01
363	600179	安通控股	3,380	34,239.40	0.01
364	603883	老百姓	400	33,264.00	0.01
365	600155	华创阳安	4,600	33,074.00	0.01
366	600317	营口港	14,399	32,541.74	0.01
367	600623	华谊集团	3,202	31,955.96	0.01
368	002503	搜于特	8,800	30,800.00	0.01
369	600240	华业资本	4,200	30,786.00	0.01
370	600816	安信信托	4,200	30,408.00	0.01
371	002600	领益智造	5,800	30,102.00	0.01
372	002345	潮宏基	3,500	30,100.00	0.01
373	002657	中科金财	1,900	30,096.00	0.01
374	600350	山东高速	7,400	29,970.00	0.01
375	603816	顾家家居	400	29,404.00	0.01

376	002635	安洁科技	1,700	29,240.00	0.01
377	002479	富春环保	5,010	28,306.50	0.01
378	002308	威创股份	3,377	28,029.10	0.01
379	300273	和佳股份	4,099	27,791.22	0.01
380	600125	铁龙物流	3,300	27,621.00	0.01
381	600996	贵广网络	3,700	27,454.00	0.01
382	603766	隆鑫通用	4,966	26,965.38	0.01
383	002642	荣之联	2,900	26,651.00	0.01
384	600827	百联股份	2,600	26,520.00	0.01
385	600183	生益科技	2,869	26,280.04	0.01
386	600575	皖江物流	6,999	25,966.29	0.01
387	002118	紫鑫药业	3,599	25,732.85	0.01
388	000519	中兵红箭	3,300	25,641.00	0.01
389	600066	宇通客车	1,300	24,947.00	0.01
390	600773	西藏城投	3,600	24,912.00	0.01
391	600267	海正药业	1,700	24,718.00	0.01
392	300058	蓝色光标	4,300	24,510.00	0.01
393	002399	海普瑞	1,100	24,354.00	0.01
394	002030	达安基因	1,550	23,901.00	0.01
395	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
396	002807	江阴银行	3,999	22,474.38	0.01
397	603658	安图生物	263	21,686.98	0.01
398	600640	号百控股	2,104	21,397.68	0.01
399	002242	九阳股份	1,199	21,210.31	0.01
400	002340	格林美	3,500	21,175.00	0.01
401	300199	翰宇药业	1,427	20,377.56	0.01
402	000543	皖能电力	4,600	20,286.00	0.01
403	600614	鹏起科技	3,500	19,985.00	0.01
404	002517	恺英网络	2,776	19,959.44	0.01
405	300146	汤臣倍健	1,200	19,920.00	0.01
406	300274	阳光电源	2,088	18,729.36	0.01
407	300202	聚龙股份	1,700	17,731.00	0.01
408	002390	信邦制药	2,399	17,560.68	0.01
409	600037	歌华有线	1,700	17,544.00	0.01
410	600039	四川路桥	5,300	17,384.00	0.01
411	600645	中源协和	900	17,334.00	0.01
412	600704	物产中大	3,300	17,259.00	0.01
413	600053	九鼎投资	1,000	17,170.00	0.01
414	601233	桐昆股份	969	16,686.18	0.01

415	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01
416	000166	申万宏源	3,700	16,169.00	0.01
417	600315	上海家化	399	15,812.37	0.01
418	600058	五矿发展	1,900	15,789.00	0.01
419	603569	长久物流	1,081	15,436.68	0.01
420	002011	盾安环境	2,400	15,360.00	0.01
421	300244	迪安诊断	800	15,208.00	0.01
422	000761	本钢板材	3,744	15,125.76	0.01
423	600971	恒源煤电	2,112	15,079.68	0.01
424	600657	信达地产	3,500	14,875.00	0.01
425	600754	锦江股份	400	14,784.00	0.01
426	600338	西藏珠峰	700	14,504.00	0.01
427	002431	棕榈股份	2,100	14,091.00	0.01
428	002180	纳思达	500	13,730.00	0.01
429	002424	贵州百灵	1,200	13,632.00	0.01
430	300418	昆仑万维	700	13,216.00	0.01
431	002444	巨星科技	1,154	12,705.54	0.01
432	002672	东江环保	919	12,029.71	0.01
433	601098	中南传媒	930	11,755.20	0.01
434	002470	金正大	1,700	11,696.00	0.01
435	002573	清新环境	1,001	11,561.55	0.01
436	600642	申能股份	2,299	11,540.98	0.01
437	600332	白云山	300	11,415.00	0.00
438	000538	云南白药	100	10,696.00	0.00
439	601608	中信重工	4,000	10,400.00	0.00
440	600466	蓝光发展	1,654	10,254.80	0.00
441	600428	中远海特	2,854	10,131.70	0.00
442	603877	太平鸟	300	9,999.00	0.00
443	603228	景旺电子	200	9,888.00	0.00
444	600166	福田汽车	4,799	9,741.97	0.00
445	002384	东山精密	400	9,600.00	0.00
446	000400	许继电气	1,200	9,372.00	0.00
447	002092	中泰化学	953	9,186.92	0.00
448	000877	天山股份	1,300	8,775.00	0.00
449	600687	刚泰控股	900	8,181.00	0.00
450	002665	首航节能	1,400	8,120.00	0.00
451	002179	中航光电	200	7,800.00	0.00
452	002408	齐翔腾达	635	7,797.80	0.00
453	002299	圣农发展	500	7,745.00	0.00

454	300376	易事特	1,400	7,518.00	0.00
455	600418	江淮汽车	1,099	7,154.49	0.00
456	600335	国机汽车	675	7,040.25	0.00
457	002127	南极电商	748	7,023.72	0.00
458	002005	德豪润达	1,609	7,015.24	0.00
459	000667	美好置业	3,199	6,813.87	0.00
460	600917	重庆燃气	1,000	6,810.00	0.00
461	000156	华数传媒	700	6,748.00	0.00
462	002465	海格通信	800	6,424.00	0.00
463	603899	晨光文具	200	6,338.00	0.00
464	600578	京能电力	1,900	5,928.00	0.00
465	600409	三友化工	654	5,630.94	0.00
466	600879	航天电子	799	5,616.97	0.00
467	601933	永辉超市	700	5,348.00	0.00
468	002249	大洋电机	1,200	5,172.00	0.00
469	002839	张家港行	800	4,872.00	0.00
470	000656	金科股份	1,000	4,800.00	0.00
471	000970	中科三环	500	4,675.00	0.00
472	000988	华工科技	300	4,335.00	0.00
473	600862	中航高科	700	4,305.00	0.00
474	002366	台海核电	300	4,278.00	0.00
475	002663	普邦股份	1,400	4,158.00	0.00
476	600138	中青旅	199	3,966.07	0.00
477	000600	建投能源	700	3,899.00	0.00
478	600835	上海机电	192	3,621.12	0.00
479	000686	东北证券	560	3,589.60	0.00
480	300134	大富科技	400	3,576.00	0.00
481	300001	特锐德	300	3,408.00	0.00
482	002477	雏鹰农牧	1,000	3,310.00	0.00
483	002920	德赛西威	100	2,990.00	0.00
484	600122	宏图高科	400	2,960.00	0.00
485	002266	浙富控股	751	2,816.25	0.00
486	600388	龙净环保	218	2,786.04	0.00
487	000969	安泰科技	400	2,500.00	0.00
488	000690	宝新能源	300	2,088.00	0.00
489	002482	广田集团	300	1,791.00	0.00
490	600633	浙数文化	200	1,668.00	0.00
491	601019	山东出版	200	1,602.00	0.00
492	600021	上海电力	200	1,348.00	0.00

493	000979	中弘股份	1,300	1,313.00	0.00
494	002489	浙江永强	300	1,092.00	0.00
495	000592	平潭发展	300	852.00	0.00
496	600151	航天机电	200	812.00	0.00
497	600297	广汇汽车	100	586.00	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	600519	贵州茅台	3,901,469.00	5.19
2	600016	民生银行	3,607,886.00	4.80
3	601678	滨化股份	3,536,921.00	4.71
4	600557	康缘药业	3,195,527.00	4.25
5	601717	郑煤机	2,783,146.00	3.70
6	600611	大众交通	2,711,191.17	3.61
7	600015	华夏银行	2,596,340.00	3.45
8	601166	兴业银行	2,573,546.00	3.42
9	300039	上海凯宝	2,517,142.51	3.35
10	600801	华新水泥	2,421,980.00	3.22
11	000848	承德露露	2,367,081.91	3.15
12	600104	上汽集团	2,330,947.32	3.10
13	000718	苏宁环球	2,313,696.70	3.08
14	600376	首开股份	2,278,620.57	3.03
15	600383	金地集团	2,276,913.00	3.03
16	601169	北京银行	2,240,092.00	2.98
17	601006	大秦铁路	2,168,679.00	2.89
18	600919	江苏银行	2,158,689.00	2.87
19	600572	康恩贝	2,147,168.04	2.86
20	601168	西部矿业	2,134,280.00	2.84
21	002233	塔牌集团	2,122,364.90	2.82
22	603188	ST 亚邦	2,090,669.00	2.78
23	002310	东方园林	2,075,961.00	2.76
24	002508	老板电器	2,046,120.21	2.72

25	600585	海螺水泥	2,034,227.00	2.71
26	600369	西南证券	2,007,191.00	2.67
27	002304	洋河股份	1,984,274.94	2.64
28	600820	隧道股份	1,979,750.00	2.63
29	600978	宜华生活	1,962,221.00	2.61
30	600170	上海建工	1,958,413.00	2.61
31	600208	新湖中宝	1,942,717.00	2.58
32	600153	建发股份	1,933,002.16	2.57
33	000338	潍柴动力	1,897,792.00	2.52
34	000069	华侨城 A	1,894,290.32	2.52
35	601001	大同煤业	1,890,109.69	2.51
36	600422	昆药集团	1,868,400.79	2.49
37	600438	通威股份	1,864,251.00	2.48
38	600887	伊利股份	1,837,943.00	2.45
39	000528	柳 工	1,828,052.00	2.43
40	601888	中国国旅	1,824,386.00	2.43
41	002603	以岭药业	1,808,801.00	2.41
42	601818	光大银行	1,799,915.00	2.39
43	601009	南京银行	1,787,953.54	2.38
44	601229	上海银行	1,775,641.62	2.36
45	600282	南钢股份	1,768,870.00	2.35
46	002317	众生药业	1,758,930.12	2.34
47	600741	华域汽车	1,749,442.00	2.33
48	600216	浙江医药	1,745,564.90	2.32
49	603198	迎驾贡酒	1,699,420.57	2.26
50	000157	中联重科	1,680,237.00	2.24
51	000895	双汇发展	1,679,644.47	2.23
52	600059	古越龙山	1,675,284.00	2.23
53	000425	徐工机械	1,674,474.00	2.23
54	002572	索菲亚	1,656,377.00	2.20
55	600009	上海机场	1,653,950.00	2.20
56	000826	启迪桑德	1,653,814.40	2.20
57	600674	川投能源	1,641,198.00	2.18
58	601997	贵阳银行	1,639,387.77	2.18
59	600126	杭钢股份	1,633,899.00	2.17
60	600309	万华化学	1,627,870.00	2.17

61	600597	光明乳业	1,595,272.00	2.12
62	002294	信立泰	1,595,002.00	2.12
63	603288	海天味业	1,555,282.00	2.07
64	600089	特变电工	1,542,887.34	2.05
65	600073	上海梅林	1,512,542.00	2.01
66	601021	春秋航空	1,509,673.00	2.01

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	601678	滨化股份	2,886,330.04	3.84
2	600438	通威股份	2,696,351.16	3.59
3	600801	华新水泥	2,426,265.58	3.23
4	600141	兴发集团	2,175,708.51	2.89
5	300115	长盈精密	2,150,493.15	2.86
6	600525	长园集团	2,150,469.88	2.86
7	601001	大同煤业	2,095,814.51	2.79
8	000488	晨鸣纸业	2,037,157.64	2.71
9	600160	巨化股份	1,993,356.32	2.65
10	601717	郑煤机	1,948,363.57	2.59
11	000786	北新建材	1,865,981.29	2.48
12	600970	中材国际	1,853,248.50	2.47
13	002508	老板电器	1,700,719.74	2.26
14	600059	古越龙山	1,682,568.52	2.24
15	600557	康缘药业	1,673,052.35	2.23
16	600565	迪马股份	1,597,117.10	2.12
17	600104	上汽集团	1,576,127.20	2.10
18	600428	中远海特	1,550,477.80	2.06
19	600282	南钢股份	1,518,189.90	2.02
20	002078	太阳纸业	1,514,458.83	2.01
21	000661	长春高新	1,511,467.04	2.01

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	368,327,931.24
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	253,807,873.30
--------------	----------------

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

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
IC1809	中证 500 期货 1809 合约	-69	-70,553,880.00	5,649,760.00	-
IF1809	沪深 300 期货 1809 合约	-71	-73,331,640.00	5,939,040.00	-
公允价值变动总额合计（元）					11,588,800.00
股指期货投资本期收益（元）					4,315,657.78
股指期货投资本期公允价值变动（元）					11,886,602.22

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在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	25,166,325.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	1,029.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,167,354.40

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

报告期末，本基金前十名股票不存在流通受限的情况。

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
2,099	105,607.78	95,238,756.24	42.96%	126,431,982.25	57.04%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,033,178.65	0.4661%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
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 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	4.51%	10,000,350.00	4.51%	自基金合同生效之日起不少于三年，已到期
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,350.00	4.51%	10,000,350.00	4.51%	-

§ 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	74,238,794.56
本报告期基金总申购份额	160,568,394.51
减：本报告期基金总赎回份额	13,136,450.58
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	221,670,738.49

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

本基金本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门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，基金管理人与股东中国国际金融股份有限公司就侵犯商标权及不正当竞争事项，联合向北京市朝阳区人民法院起诉南京中金基金管理有限公司。截至 2018 年 6 月 30 日，该案已获法院受理，尚未开庭。除前述事项外，本报告期无涉及基金管理人的其他诉讼事项。

本报告期无涉及本基金基金财产、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。

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	
国金证券	2	469,838,043.15	75.55%	343,558.27	75.55%	-
太平洋	2	152,062,804.53	24.45%	111,202.88	24.45%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

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
国金证券	-	-	2,041,700,000.00	97.05%	-	-
太平洋	35,101.46	100.00%	62,000,000.00	2.95%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

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	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 1 月 19 日
2	中金基金管理有限公司关于调整旗下基金所持长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 2 月 7 日
3	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蚂蚁（杭州）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 3 月 16 日

	基金销售有限公司为销售机构的公告	及/或公司网站	
4	关于新增北京植信基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 22 日
5	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 28 日
6	关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》对短期投资行为收取短期赎回费的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 30 日
7	中金基金管理有限公司关于修改旗下部分开放式基金《基金合同》、《托管协议》等法律文件的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 30 日
8	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年度报告及摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 30 日
9	关于新增南京苏宁基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 4 月 11 日
10	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 4 月 23 日
11	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金网上申购富士康工业互联网股份有限公司首次公开发行 A 股股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 5 月 30 日

12	关于新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 5 月 31 日
13	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及其摘要（2018 年第 1 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 6 月 5 日
14	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 6 月 27 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，本基金单一投资者持有份额比例没有超过总份额 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 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注册的文件
- 2、《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、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、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 8、本报告期内在指定媒介上披露的有关本基金的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人和/或基金托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：010-63211122 400-868-1166

传真：010-66159121

中金基金管理有限公司

2018年8月28日