

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 年年度报告摘要

2018 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：2019 年 3 月 28 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 2019 年 3 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。

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## §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	70,667,974.66 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	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

### 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	<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



## § 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	2,039,608.89	-2,681,127.89	-2,533,986.17
本期利润	1,924,496.94	-3,047,814.19	-2,542,345.74
加权平均基金份额本期利润	0.0164	-0.0269	-0.0172
本期基金份额净值增长率	0.40%	-0.98%	-2.20%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0120	0.0125	0.0225
期末基金资产净值	71,776,431.33	75,165,763.64	114,170,220.14
期末基金份额净值	1.016	1.012	1.022

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。

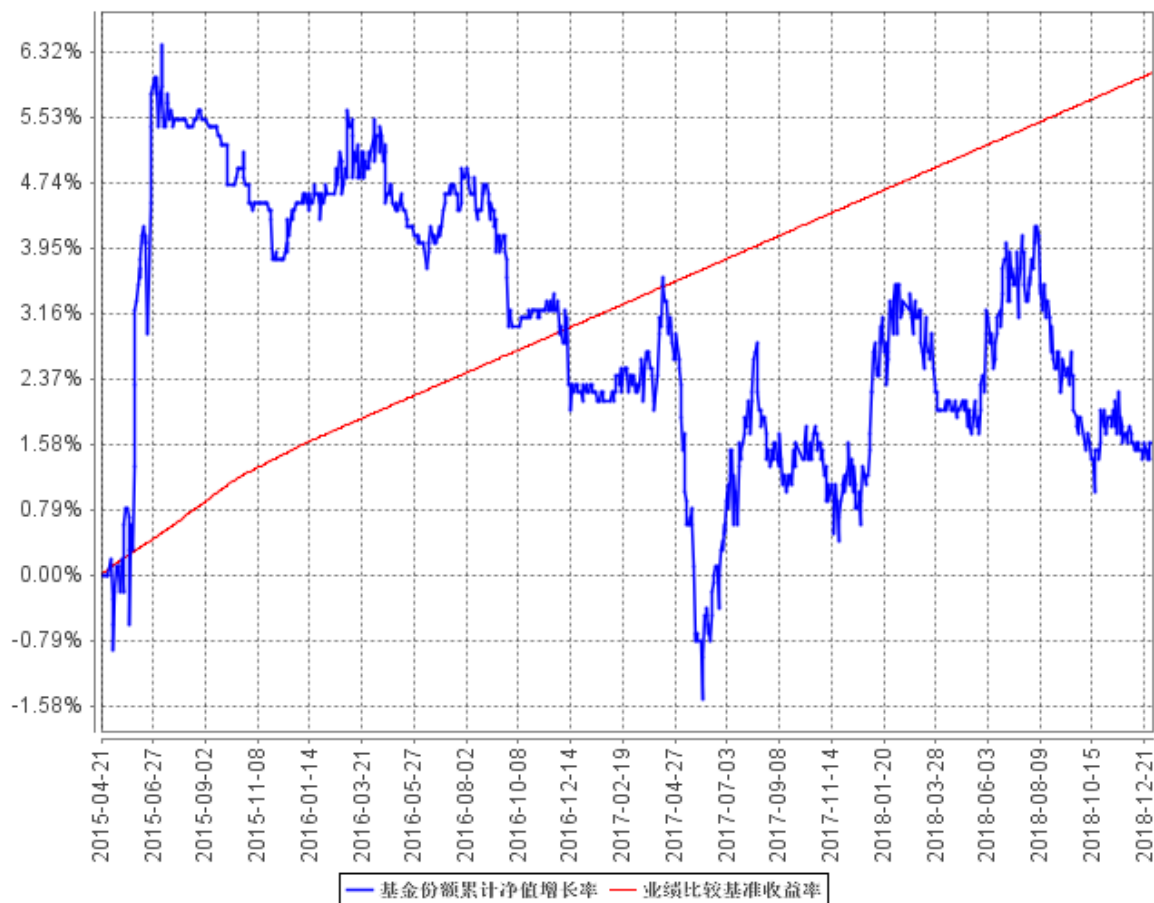
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-0.29%	0.19%	0.36%	0.00%	-0.65%	0.19%
过去六个月	-1.65%	0.23%	0.72%	0.00%	-2.37%	0.23%
过去一年	0.40%	0.23%	1.43%	0.00%	-1.03%	0.23%
过去三年	-2.78%	0.21%	4.44%	0.00%	-7.22%	0.21%
自基金合同生效起至今	1.60%	0.23%	6.06%	0.00%	-4.46%	0.23%

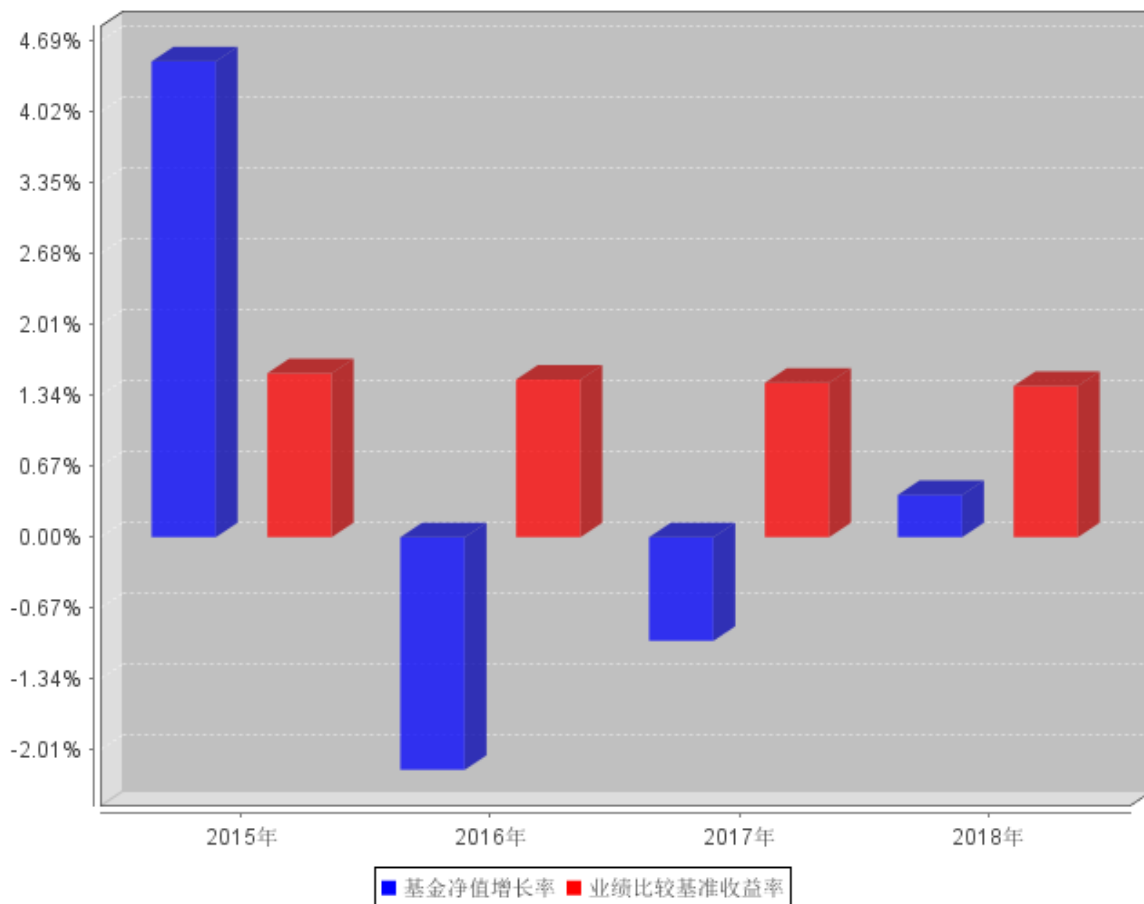
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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，是首家单一股东发起设立的基金公司，注册资本 3.5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金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，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2018 年 12 月 31 日，公司共管理 27 只开放式基金，证券投资基金管理规模 153.48 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，统计学博士，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。2014 年 11 月加入公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任公司量化公募投资部基金经理。

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

在报告期内，本基金主要采用量化对冲的投资策略，运作正常。2018 年 A 股市场跌幅较大，本基金对冲了大部分市场风险，获得了正收益。2019 年我们会持续改进旧的投资策略，并引入新的投资策略，力争有更好的表现。2018 年中国经济的形势较为严峻。第一 A 股上市公司盈利

同比增速在 2018 年上半年见顶后开始向下，短期的经济下行压力较大。第二经济结构性调整和升级，在短期对市场造成一定的压力。第三中美贸易摩擦带来国际政治经济环境的不稳定性上升，中国经济发展的外部环境形势不容乐观。2018 年 A 股市场惨淡收官，全年上证 50 指数下跌 19.83%，沪深 300 指数下跌 25.31%，中证 500 指数下跌 33.32%，创业板指下跌 28.65%。

#### 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 1.016 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.40%，业绩比较基准收益率为 1.43%。

#### 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 2019 年，中国经济增长在国际周期及国内因素共同作用下可能继续下行，尽管 2018 年下半年至今市场预期已经在调低，但是考虑到增长下行风险仍未体现充分，2019 年股票资产仍可能承受较大压力。在 2019 年最初的 1 个多月里，A 股各大指数都有较大幅度的反弹，这主要是因为中美贸易谈判呈现出乐观的预期以及 2018 年的下跌已经使多个指数的估值处于历史低位。这就更加说明了以中美关系为代表的国际政治经济环境是影响中国经济以及 A 股市场的重要因素，2019 年必须密切关注并迅速反应。如果中美谈判取得阶段性成果，那么必须认真分析其对各个行业的影响。而对个股而言，其自身的业绩以及随之而来的估值、成长预期等指标将成为影响其股价在行业中相对表现的重要指标。2019 年风险和机遇共存。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作，强化制度完善及对制度执行情况的监督检查，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，有效保证了基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1) 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，及定期进行有重点的检查。2) 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，对关联交易进行日常维护，定期关注基金持仓流动性风险，并对公平交易执行情况进行检查等。3) 营销与销售方面，本基金管理人对本基金宣传推介材料、销售服务协议合规性等进行检查，同时加强对基金销售部门的合规培训。4) 基金运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、资

金清算业务的检查力度，保证基金运营安全、准确。5) 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。6) 信息披露方面，本基金管理人严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》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。此外，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。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高监察稽核工作的有效性。

#### 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 1901204 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
审计意见	<p>我们审计了后附的第 1 页至第 38 页的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“中金绝对收益基金”）财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的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、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的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，公允反映了中金绝对收益基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中金绝对收益基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>
强调事项	无
其他事项	无

<p>其他信息</p>	<p>中金绝对收益基金管理人中金基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括中金绝对收益基金 2018 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中金绝对收益基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、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，使其实现公允反映，并设计、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。在编制财务报表时，中金绝对收益基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责评估中金绝对收益基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非中金绝对收益基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。中金绝对收益基金管理人中金基金管理有限公司治理层负责监督中金绝对收益基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设</p>

	<p>计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(3) 评价中金绝对收益基金管理人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及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对中金绝对收益基金管理人中金基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中金绝对收益基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中金绝对收益基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与中金绝对收益基金管理人中金基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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)
注册会计师的姓名	奚霞   刘珊珊
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	2019年3月27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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		10,499,379.77	2,005,096.03
结算备付金		7,453,330.31	12,338,799.43
存出保证金		2,641,844.74	8,984,410.97
交易性金融资产		24,033,054.46	45,299,556.66
其中：股票投资		24,033,054.46	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		-	-
买入返售金融资产		28,000,000.00	-
应收证券清算款		9,265.35	7,080,329.46
应收利息		42,633.30	-2,404.08
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		72,679,507.93	75,705,788.47
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 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		8,335.18	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		60,955.72	63,730.63
应付托管费		15,238.92	15,932.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		641,411.37	290,361.54
应交税费		52,135.41	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		125,000.00	170,000.00
负债合计		903,076.60	540,024.83
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		70,667,974.66	74,238,794.56
未分配利润		1,108,456.67	926,969.08
所有者权益合计		71,776,431.33	75,165,763.64
负债和所有者权益总计		72,679,507.93	75,705,788.47

报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.016 元，基金份额总额 70,667,974.66 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		5,160,115.14	1,451,720.47
1. 利息收入		640,856.23	533,408.80
其中：存款利息收入		100,766.69	99,952.74
债券利息收入		3.73	11.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		540,085.81	433,445.01
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,175,330.43	957,979.73
其中：股票投资收益		-21,942,464.99	13,126,112.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益		3,190.20	3,170.14
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		24,183,687.16	-13,433,496.60
股利收益		1,930,918.06	1,262,193.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-115,111.95	-366,686.30
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		459,040.43	327,018.24

<b>减：二、费用</b>		3,235,618.20	4,499,534.66
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,195,263.47	1,153,226.00
2. 托管费	7.4.8.2.2	298,815.83	288,306.54
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		1,520,363.57	2,878,074.86
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		87,061.26	-
7. 其他费用		134,114.07	179,927.26
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,924,496.94	-3,047,814.19
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,924,496.94	-3,047,814.19

### 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	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）	-	1,924,496.94	1,924,496.94
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）	-3,570,819.90	-1,743,009.35	-5,313,829.25
其中：1. 基金申购款	165,502,298.65	3,489,799.52	168,992,098.17
2. 基金赎回款	-169,073,118.55	-5,232,808.87	-174,305,927.42
五、期末所有者权益（基金净值）	70,667,974.66	1,108,456.67	71,776,431.33
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-3,047,814.19	-3,047,814.19
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）	-37,421,757.21	1,465,114.90	-35,956,642.31
其中：1. 基金申购款	88,826,293.55	3,197,426.14	92,023,719.69
2. 基金赎回款	-126,248,050.76	-1,732,311.24	-127,980,362.00
五、期末所有者权益（基金净值）	74,238,794.56	926,969.08	75,165,763.64

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

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
张纳

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
白娜

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《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及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的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2018 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**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### **7.4.4.2 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。

### 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：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。

本基金目前持有的股票投资及债券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。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。

### 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：

(1) 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；

(2) 应收款项以实际利率法按摊余成本计量；

(3) 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：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产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：

(1) 所转移金融资产的账面价值；

(2) 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。

#### 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。

#### 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：

- 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；
- 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。

#### 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/(未弥补亏损)”。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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。

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。

#### 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《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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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。

## 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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔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〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号文《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：

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。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。

(2)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”）运营资管产品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。对资管产品基金在 2018 年 1 月 1 日以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、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。免征增值税。

(3) 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。

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。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。

(5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。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。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.7 关联方关系

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
中金资本运营有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金浦成投资有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金期货有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中国国际金融(香港)有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司

1、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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中金公司	-	-	335,302,914.23	15.74%
中投证券	-	-	479,727,279.66	22.52%

#### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中投证券	-	-	2,417.20	11.15%

#### 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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	-	-	364,300,000.00	13.48%
中投证券	-	-	1,048,700,000.00	38.79%

#### 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 2018年1月1日至2018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	-	-	-	-
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	245,208.12	15.74%	-	0.00%
中投证券	350,826.32	22.52%	20,234.09	6.97%

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 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,195,263.47	1,153,226.00
其中：支付销售机构的客户维护费	287,690.22	374,168.55

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 287,690.22 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
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	298,815.83	288,306.54

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

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
期间申购/买入总份额	4,897,159.65	-
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	6.9300%	-

##### 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		上年度末	
	2018年12月31日		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
中国国际金融股份有限公司	-	-	10,000,350.00	13.4700%

本报告期末除基金管理人之外关联方未投资本基金。

##### 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国建设银行股份有限公司	10,499,379.77	73,865.04	2,005,096.03	60,783.88
--------------	---------------	-----------	--------------	-----------

- 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 12 月 31 日的相关余额为人民币 1,771,251.77 元（2017 年 12 月 31 日：人民币 1,071,081.40 元），本期间产生的利息收入为人民币 26,901.65 元（自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日止期间：人民币 39,168.86 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

金额单位：人民币元

本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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
中金基金	601138	工业富联	网上发行	2,000	27,540.00

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

#### 7.4.9 期末（2018 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

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限股票。

##### 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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

600030	中信 证券	2018 年 12月 25日	临时 停牌	16.01	2019年 1月 10日	17.15	5,800	100,132.13	92,858.00	-
000708	大冶 特钢	2018 年 12月 25日	临时 停牌	8.77	2019年 1月 3日	9.65	500	4,626.96	4,385.00	-

### 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) 以公允价值计量的资产和负债

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到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

持续的公允价值 计量资产	本期末 (2018年12月31日)			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产				
- 股票投资	24,033,054.46	23,935,811.46	97,243.00	-
- 债券投资	-	-	-	-
- 基金投资	-	-	-	-
- 资产支持证券投资	-	-	-	-
持续以公允价值计量的 资产总额	24,033,054.46	23,935,811.46	97,243.00	-

持续的公允价值 计量资产	上年度末 (2017年12月31日)			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产				



- 股票投资	45,265,338.26	41,394,457.93	3,870,880.33	-
- 债券投资	34,218.40	-	30,318.40	3,900.00
- 基金投资	-	-	-	-
- 资产支持证券投资	-	-	-	-
持续以公允价值计量的资产总额	45,299,556.66	41,394,457.93	3,901,198.73	3,900.00

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次，账面价值为人民币 97,243.00 元（2017 年 12 月 31 日：人民币 3,874,780.33 元）。于 2018 年 12 月 31 日及 2017 年 12 月 31 日，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的三个层次之间没有发生重大转换。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。

(b) 第二层次及第三层次的公允价值计量

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）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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（2017 年 12 月 31 日：无）。

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、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	24,033,054.46	33.07
	其中：股票	24,033,054.46	33.07
2	买入返售金融资产	28,000,000.00	38.53
3	银行存款和结算备付金合计	17,952,710.08	24.70
4	其他各项资产	2,693,743.39	3.71
5	合计	72,679,507.93	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	9,801.00	0.01
B	采矿业	912,360.63	1.27
C	制造业	12,190,209.99	16.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,035,371.66	1.44
E	建筑业	341,559.95	0.48
F	批发和零售业	1,251,716.95	1.74
G	交通运输、仓储和邮政业	741,547.07	1.03
H	住宿和餐饮业	15,044.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	539,948.64	0.75
J	金融业	5,002,325.81	6.97
K	房地产业	1,157,845.34	1.61
L	租赁和商务服务业	360,788.57	0.50
M	科学研究和技术服务业	36,072.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	72,274.20	0.10
Q	卫生和社会工作	4,551.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	284,126.65	0.40
S	综合	77,511.00	0.11
	合计	24,033,054.46	33.48

## 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	601318	中国平安	15,700	880,770.00	1.23
2	000651	格力电器	18,900	674,541.00	0.94
3	601166	兴业银行	36,530	545,758.20	0.76
4	600016	民生银行	84,692	485,285.16	0.68
5	600585	海螺水泥	12,873	376,921.44	0.53
6	601328	交通银行	59,000	341,610.00	0.48
7	002004	华邦健康	70,809	326,429.49	0.45
8	600580	卧龙电驱	50,021	315,132.30	0.44
9	600028	中国石化	61,500	310,575.00	0.43
10	600031	三一重工	35,620	297,070.80	0.41

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

## 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	601318	中国平安	5,510,617.37	7.33
2	600519	贵州茅台	5,362,752.00	7.13
3	601678	滨化股份	5,276,490.00	7.02
4	601166	兴业银行	4,880,587.00	6.49
5	600016	民生银行	4,623,452.00	6.15
6	600557	康缘药业	4,612,285.56	6.14
7	601717	郑煤机	4,220,641.00	5.62
8	600104	上汽集团	3,911,708.32	5.20
9	600887	伊利股份	3,792,001.28	5.04

10	600611	大众交通	3,774,062.41	5.02
11	600572	康恩贝	3,710,062.04	4.94
12	600422	昆药集团	3,425,951.81	4.56
13	601818	光大银行	3,341,475.00	4.45
14	000848	承德露露	3,306,536.91	4.40
15	600585	海螺水泥	3,303,028.29	4.39
16	601006	大秦铁路	3,286,040.00	4.37
17	000338	潍柴动力	3,276,868.00	4.36
18	002304	洋河股份	3,169,508.94	4.22
19	000778	新兴铸管	3,158,609.00	4.20
20	601009	南京银行	3,110,744.54	4.14
21	600978	宜华生活	3,095,211.80	4.12
22	300039	上海凯宝	3,092,613.51	4.11
23	000718	苏宁环球	3,031,468.70	4.03
24	600597	光明乳业	3,024,226.12	4.02
25	601169	北京银行	3,004,494.31	4.00
26	002317	众生药业	2,992,965.12	3.98
27	002603	以岭药业	2,954,623.00	3.93
28	600015	华夏银行	2,935,529.00	3.91
29	002233	塔牌集团	2,863,003.90	3.81
30	600383	金地集团	2,843,379.00	3.78
31	600919	江苏银行	2,799,178.00	3.72
32	000651	格力电器	2,749,798.00	3.66
33	300026	红日药业	2,620,854.08	3.49
34	601888	中国国旅	2,609,911.00	3.47
35	002332	仙琚制药	2,565,969.00	3.41
36	000069	华侨城A	2,558,712.32	3.40
37	600282	南钢股份	2,553,299.00	3.40
38	600801	华新水泥	2,543,223.00	3.38
39	600376	首开股份	2,525,297.57	3.36
40	600031	三一重工	2,524,775.00	3.36
41	600881	亚泰集团	2,517,673.00	3.35
42	603198	迎驾贡酒	2,501,963.57	3.33
43	600741	华域汽车	2,427,663.18	3.23
44	601168	西部矿业	2,363,351.00	3.14
45	000568	泸州老窖	2,363,156.52	3.14

46	601001	大同煤业	2,362,349.69	3.14
47	603188	亚邦股份	2,333,991.00	3.11
48	600195	中牧股份	2,329,004.99	3.10
49	600309	万华化学	2,325,241.00	3.09
50	000898	鞍钢股份	2,293,171.00	3.05
51	601229	上海银行	2,291,042.82	3.05
52	002508	老板电器	2,262,417.21	3.01
53	601811	新华文轩	2,253,157.96	3.00
54	601233	桐昆股份	2,245,134.00	2.99
55	600694	大商股份	2,235,515.29	2.97
56	600525	长园集团	2,227,747.40	2.96
57	600170	上海建工	2,223,609.00	2.96
58	600820	隧道股份	2,216,544.00	2.95
59	600481	双良节能	2,216,143.00	2.95
60	600153	建发股份	2,187,536.16	2.91
61	600369	西南证券	2,172,402.00	2.89
62	002004	华邦健康	2,168,996.00	2.89
63	600216	浙江医药	2,125,634.90	2.83
64	000858	五粮液	2,104,122.00	2.80
65	600126	杭钢股份	2,095,638.00	2.79
66	002310	东方园林	2,075,961.00	2.76
67	600089	特变电工	2,036,318.34	2.71
68	600655	豫园股份	2,025,911.00	2.70
69	600208	新湖中宝	2,023,855.00	2.69
70	600808	马钢股份	2,019,441.00	2.69
71	000625	长安汽车	2,015,618.00	2.68
72	000826	启迪桑德	2,003,896.40	2.67
73	000425	徐工机械	1,968,415.00	2.62
74	601997	贵阳银行	1,965,607.77	2.62
75	002572	索菲亚	1,953,937.00	2.60
76	600438	通威股份	1,952,058.00	2.60
77	600674	川投能源	1,946,970.00	2.59
78	000528	柳工	1,938,465.00	2.58
79	000157	中联重科	1,934,842.40	2.57
80	600028	中国石化	1,897,626.00	2.52
81	601016	节能风电	1,897,404.00	2.52

82	600073	上海梅林	1,883,598.14	2.51
83	000895	双汇发展	1,880,931.47	2.50
84	000623	吉林敖东	1,868,196.37	2.49
85	002294	信立泰	1,862,961.00	2.48
86	000049	德赛电池	1,836,867.24	2.44
87	600094	大名城	1,827,152.16	2.43
88	000423	东阿阿胶	1,824,285.00	2.43
89	002152	广电运通	1,806,244.00	2.40
90	000031	中粮地产	1,804,421.80	2.40
91	600580	卧龙电气	1,786,548.12	2.38
92	600009	上海机场	1,762,084.00	2.34
93	600219	南山铝业	1,757,415.00	2.34
94	601328	交通银行	1,746,434.00	2.32
95	000552	靖远煤电	1,729,925.00	2.30
96	002589	瑞康医药	1,693,680.43	2.25
97	600059	古越龙山	1,675,284.00	2.23
98	600755	厦门国贸	1,674,597.00	2.23
99	600757	长江传媒	1,674,354.00	2.23
100	600000	浦发银行	1,667,829.39	2.22
101	000999	华润三九	1,667,288.00	2.22
102	600970	中材国际	1,649,593.00	2.19
103	601928	凤凰传媒	1,639,208.00	2.18
104	002048	宁波华翔	1,632,121.00	2.17
105	600056	中国医药	1,628,723.97	2.17
106	002056	横店东磁	1,619,081.24	2.15
107	600143	金发科技	1,607,959.50	2.14
108	603288	海天味业	1,602,492.00	2.13
109	601288	农业银行	1,599,669.00	2.13
110	600863	内蒙华电	1,592,349.00	2.12
111	002142	宁波银行	1,586,742.00	2.11
112	600064	南京高科	1,575,358.34	2.10
113	600266	北京城建	1,563,022.00	2.08
114	601021	春秋航空	1,556,280.00	2.07
115	600516	方大炭素	1,542,786.03	2.05
116	600256	广汇能源	1,537,477.00	2.05
117	600160	巨化股份	1,519,138.00	2.02

118	603056	德邦股份	1,510,157.00	2.01
119	000488	晨鸣纸业	1,504,913.00	2.00

#### 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	600519	贵州茅台	5,380,014.08	7.16
2	601678	滨化股份	4,974,122.04	6.62
3	601717	郑煤机	4,878,697.77	6.49
4	601318	中国平安	4,634,196.00	6.17
5	600557	康缘药业	4,538,395.12	6.04
6	601166	兴业银行	4,271,432.05	5.68
7	600016	民生银行	3,829,978.40	5.10
8	600104	上汽集团	3,668,654.32	4.88
9	600887	伊利股份	3,645,873.40	4.85
10	600525	长园集团	3,605,739.30	4.80
11	600572	康恩贝	3,600,511.05	4.79
12	600611	大众交通	3,515,575.96	4.68
13	000778	新兴铸管	3,495,040.06	4.65
14	000338	潍柴动力	3,263,674.80	4.34
15	000718	苏宁环球	3,139,740.95	4.18
16	002304	洋河股份	3,048,285.00	4.06
17	600422	昆药集团	3,041,732.32	4.05
18	601001	大同煤业	3,039,856.36	4.04
19	000848	承德露露	2,980,471.68	3.97
20	601818	光大银行	2,978,685.70	3.96
21	601006	大秦铁路	2,953,536.00	3.93
22	600585	海螺水泥	2,850,473.75	3.79
23	600438	通威股份	2,786,478.16	3.71
24	300039	上海凯宝	2,747,968.78	3.66
25	601888	中国国旅	2,699,798.74	3.59
26	601009	南京银行	2,699,583.76	3.59
27	002233	塔牌集团	2,697,672.70	3.59
28	600978	宜华生活	2,662,996.29	3.54
29	002603	以岭药业	2,611,959.30	3.47
30	600597	光明乳业	2,581,003.36	3.43
31	601233	桐昆股份	2,571,649.81	3.42

32	002332	仙琚制药	2,557,176.98	3.40
33	600801	华新水泥	2,556,127.28	3.40
34	002317	众生药业	2,540,428.50	3.38
35	600919	江苏银行	2,505,523.00	3.33
36	603198	迎驾贡酒	2,501,749.66	3.33
37	601169	北京银行	2,498,765.16	3.32
38	600282	南钢股份	2,451,043.90	3.26
39	600015	华夏银行	2,446,220.06	3.25
40	600808	马钢股份	2,397,641.75	3.19
41	600383	金地集团	2,366,662.00	3.15
42	600694	大商股份	2,345,775.94	3.12
43	300026	红日药业	2,334,435.56	3.11
44	603188	亚邦股份	2,323,630.04	3.09
45	000488	晨鸣纸业	2,320,982.64	3.09
46	600580	卧龙电气	2,249,432.23	2.99
47	600141	兴发集团	2,248,495.51	2.99
48	600160	巨化股份	2,232,470.32	2.97
49	600755	厦门国贸	2,204,819.34	2.93
50	300115	长盈精密	2,201,559.15	2.93
51	600195	中牧股份	2,199,247.09	2.93
52	600881	亚泰集团	2,197,737.11	2.92
53	601811	新华文轩	2,194,187.93	2.92
54	600741	华域汽车	2,190,341.57	2.91
55	000528	柳工	2,187,048.07	2.91
56	000898	鞍钢股份	2,184,706.40	2.91
57	600376	首开股份	2,184,117.50	2.91
58	600481	双良节能	2,183,496.10	2.90
59	002508	老板电器	2,181,391.20	2.90
60	601229	上海银行	2,175,992.80	2.89
61	600970	中材国际	2,143,799.50	2.85
62	601168	西部矿业	2,143,400.69	2.85
63	600031	三一重工	2,135,656.18	2.84
64	600309	万华化学	2,127,640.98	2.83
65	600126	杭钢股份	2,057,202.37	2.74
66	000069	华侨城A	2,050,807.80	2.73
67	600757	长江传媒	2,027,181.72	2.70
68	600820	隧道股份	1,994,361.00	2.65
69	600009	上海机场	1,991,292.10	2.65



70	600664	哈药股份	1,980,451.42	2.63
71	000651	格力电器	1,959,599.00	2.61
72	000568	泸州老窖	1,927,399.99	2.56
73	000786	北新建材	1,923,653.29	2.56
74	600655	豫园股份	1,923,215.66	2.56
75	000895	双汇发展	1,889,930.18	2.51
76	600516	方大炭素	1,888,080.50	2.51
77	000425	徐工机械	1,881,427.40	2.50
78	600089	特变电工	1,880,894.42	2.50
79	600369	西南证券	1,870,737.00	2.49
80	600073	上海梅林	1,866,923.38	2.48
81	600170	上海建工	1,859,277.00	2.47
82	600565	迪马股份	1,843,990.10	2.45
83	600674	川投能源	1,821,540.40	2.42
84	002416	爱施德	1,797,107.70	2.39
85	600216	浙江医药	1,789,937.89	2.38
86	600079	人福医药	1,785,204.47	2.38
87	000625	长安汽车	1,775,002.00	2.36
88	000423	东阿阿胶	1,773,092.50	2.36
89	600765	中航重机	1,766,128.10	2.35
90	002048	宁波华翔	1,763,424.22	2.35
91	600094	大名城	1,759,631.19	2.34
92	000049	德赛电池	1,751,345.54	2.33
93	002152	广电运通	1,744,871.89	2.32
94	603025	大豪科技	1,723,003.85	2.29
95	002572	索菲亚	1,717,068.08	2.28
96	002078	太阳纸业	1,711,410.83	2.28
97	600059	古越龙山	1,682,568.52	2.24
98	000858	五粮液	1,681,307.00	2.24
99	000661	长春高新	1,677,851.72	2.23
100	002056	横店东磁	1,672,672.04	2.23
101	601997	贵阳银行	1,666,587.41	2.22
102	002004	华邦健康	1,662,433.06	2.21
103	601016	节能风电	1,644,992.44	2.19
104	002294	信立泰	1,640,315.10	2.18
105	601288	农业银行	1,631,140.00	2.17
106	000157	中联重科	1,627,122.00	2.16
107	600153	建发股份	1,625,574.30	2.16

108	600208	新湖中宝	1,624,714.00	2.16
109	000031	中粮地产	1,624,418.20	2.16
110	000598	兴蓉环境	1,600,126.97	2.13
111	600436	片仔癀	1,579,990.50	2.10
112	000552	靖远煤电	1,578,128.46	2.10
113	601021	春秋航空	1,577,645.50	2.10
114	600428	中远海特	1,575,349.06	2.10
115	000623	吉林敖东	1,570,233.73	2.09
116	000999	华润三九	1,541,132.28	2.05
117	002142	宁波银行	1,541,009.80	2.05
118	600256	广汇能源	1,534,560.95	2.04
119	600219	南山铝业	1,526,334.00	2.03
120	603288	海天味业	1,525,433.42	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	566,256,306.41
卖出股票收入（成交）总额	564,207,136.17

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
IC1901	中证 500 期货 1901 合约	-9	-7,435,800.00	257,520.00	-
IF1901	沪深 300 期货 1901 合约	-14	-12,615,120.00	702,180.00	-
公允价值变动总额合计（元）					959,700.00
股指期货投资本期收益（元）					24,909,197.78
股指期货投资本期公允价值变动（元）					1,257,502.22

### 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之间进行对冲，并通过量化模型，寻找最优的股指期货对冲工具构建整个组合，从而剥离现货组合的系统性风险，仅保留现货组合相对于期货组合的超额收益，力争在牛市和熊市中均为投资者获取稳健的正向收益。

## 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

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除兴业银行（601166）、民生银行（600016）、交通银行（601328）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018 年 5 月 4 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监银罚决字

(2018) 1 号)，对兴业银行重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；非真实转让信贷资产；无授信额度或超授信额度办理同业业务；内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；债券卖出回购业务违规出表；个人理财资金违规投资；提供日期倒签的材料；部分非现场监管统计数据与事实不符；个别董事未经任职资格核准即履职；变相批量转让个人贷款；向四证不全的房地产项目提供融资等违法违规事实进行处罚。

2018 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监银罚决字（2018）12 号），对交通银行不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权；未尽尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产；档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞；理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；违规向土地储备机构提供融资；信贷资金违规承接本行表外理财资产；理财资金违规投资项目资本金；部分理财产品信息披露不合规；现场检查配合不力等违法违规事实进行处罚。同日，（银保监银罚决字（2018）13 号）对交通银行并购贷款占并购交易价款比例不合规；并购贷款尽职调查和风险评估不到位等违法违规事实进行处罚。

2018 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监银罚决字（2018）5 号），对民生银行贷款业务严重违反审慎经营规则等违法违规事实进行处罚。同日，（银保监银罚决字（2018）8 号）对民生银行内控管理严重违反审慎经营规则；同业投资违规接受担保；同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；本行理财产品之间风险隔离不到位；个人理财资金违规投资；票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；为非保本理财产品提供保本承诺等违法违规事实进行处罚。

本基金采用量化对冲的投资策略，由于有套保的限制很大一部分仓位集中于沪深 300 成分股内，而银行业在沪深 300 指数中占很大权重，所以不可避免的选入多家银行，同时我们认为兴业银行（601166）、民生银行（600016）、交通银行（601328）所受处罚并未对其投资价值产生实质性的负面影响，所以依然按照模型选股的结果而没有进行专门的减仓操作。

#### 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	2,641,844.74
2	应收证券清算款	9,265.35
3	应收利息	42,633.30
4	合计	2,693,743.39

#### 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，本基金投资的前十名股票中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
1,385	51,023.81	17,381,594.37	24.60%	53,286,380.29	75.40%

### 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	719,716.96	1.0184%

### 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	0~10

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金已成立满 3 年，本报告期内无发起式基金持有份额情况。

## §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
本报告期期间基金总申购份额	165,502,298.65
减：本报告期期间基金总赎回份额	169,073,118.55
本报告期期末基金份额总额	70,667,974.66

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

本报告期内，基金管理人中金基金原董事长林寿康先生离职，2018 年 10 月 18 日起总经理孙菁女士代为履行中金基金董事长（法定代表人）职务。2019 年 1 月 18 日起，楚钢先生担任中金基金董事长（法定代表人）。

2018 年 9 月 3 日起，汤琰女士担任基金管理人中金基金副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已按照相关规定向监管部门报告并履行信息披露程序。

本报告期内本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

1、本报告期内，基金管理人与股东中金公司就侵犯商标权及不正当竞争事项，联合向南京市中级人民法院起诉，截至报告期末本案尚无判决。

2、本报告期内无涉及基金财产、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 35,000.00 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	
国金证券	2	594,009,142.02	52.58%	434,382.60	52.58%	-
东兴证券	2	246,806,532.10	21.85%	180,480.32	21.85%	-
太平洋	2	152,062,804.53	13.46%	111,202.88	13.46%	-
西藏东财	2	122,400,264.20	10.83%	89,510.57	10.84%	-
华泰证券	2	14,404,422.15	1.28%	10,534.20	1.28%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中金	2	-	-	-	-	-

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	-	-	2,069,200,000.00	72.20%	-	-
东兴证券	-	-	734,800,000.00	25.64%	-	-
太平洋	35,101.46	100.00%	62,000,000.00	2.16%	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	-	-	-	-

## §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。

中金基金管理有限公司

2019 年 3 月 28 日