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年第二季度报告

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
报告送出日期:2018年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金绝对收益
基金主代码	001059
交易代码	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
报告期末基金份额总额	221,670,738.49份
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。其中,市场中性策略包括量化选股策略和期货对冲策略两大策略。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	2,017,553.64
2.本期利润	2,677,611.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0129
4.期末基金资产净值	228,896,417.86
5.期末基金份额净值	1.033

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;

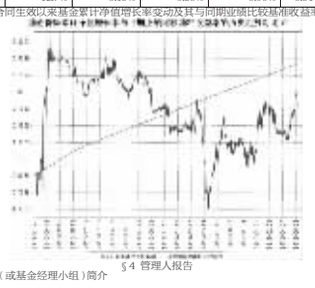
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	1.27%	0.19%	0.36%	0.00%	0.91%	0.19%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏孛	本基金基金经理	2017年3月28日	-	8年	魏孛先生,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遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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

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 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内,本基金采用量化对冲的投资策略,运作正常。选股模型获得了一定的超额收益,在扣除了基差因素的影响后,依然为投资者带来了一定的正收益。我们会持续更新和改进模型,力争更好的表现。

2018年的宏观经济环境非常复杂。第一,名义GDP在高位,一些经济指标显示经济活跃度高。第二,深化供给侧改革,发展巩固新兴产业,独角兽回归引导资金流向支持实体经济。第三,以金融"去杠杆"为目的的各项政策继续推进。第四,中美贸易战逐渐升级,对我国传统产业和新兴产业的发展都会产生重要的影响。股市受到各种因素的共同作用,呈现出震荡向下的趋势。2018年第二季度,上证50指数下跌8.90%,沪深300指数下跌9.94%,中证500指数下跌14.67%,中证800指数下跌11.19%,中证1000指数下跌17.51%,创业板指下跌15.46%。展望2018年下半年,国内经济发展的韧性相信能够持续,政策层面大方向依然会延续,中美贸易摩擦的变数较大,总体上我们对股市的看法是谨慎的,因此我们会加强风险控制,力争净值表现更加稳健。

4.5 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1.27%,业绩比较基准收益率为0.36%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	52,171,736.44	22.62
8	其他资产	25,167,354.40	10.91
9	合计	230,603,289.86	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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

5.2.2 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。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	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	亚邦股份	166,300	1,696,260.00	0.74

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末,本基金未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本报告期末,本基金未持有债券。

5.6 报告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

本报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.7 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

本报告期末,本基金未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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)					3,110,768.80
股指期货投资本期公允价值变动(元)					11,880,691.20

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末,本基金无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末,本基金无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末,本基金无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
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

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	67,623,499.84
报告期期间基金总申购份额	160,553,707.27
减:报告期期间基金总赎回份额	6,506,468.62
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	221,670,738.49

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	4,897,159.65
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,897,159.65
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.21

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2018年4月11日	4,897,159.65	5,000,000.00	0.00%
合计			5,000,000.00	4,897,159.65	

§8 报告期末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
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,350.00	4.51	10,000,350.00	4.51	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,2018年4月21日,本基金成立满3年,本基金的基金资产净值超过2亿元,根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同的规定,本基金继续存续。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会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、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中请募集注册的法律意见书

5、基金管理人业务资格批复、营业执照

6、基金托管人业务资格批复、营业执照

7、报告期内中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

8、中国证监会要求的其他文件

10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/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和复印件。

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:(86)010-63211122 400-868-1166

传真:(86)010-66159121

中金基金管理有限公司
2018年7月19日

中金现金管家货币市场基金

2018年第二季度报告

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
报告送出日期:2018年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金现金管家
基金主代码	000882
交易代码	000882
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月28日
报告期末基金份额总额	11,223,848,257.82份
投资目标	在保障基金资产的安全性和流动性的前提下,通过积极主动管理,力争实现超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	根据对宏观经济指标、货币政策、市场结构变化等因素的研究与分析,对未来一段时期短期市场利率进行判断,对短期利率走势形成合理预期,并据此调整基金资产的配置策略。通过对市场资金供求、基金申赎情况进行动态分析,确定本基金流动性目标,相应调整基金资产在高流动性资产和相对流动性较低资产之间的配比,并根据对短期利率走势的判断确定并调整组合的平均剩余期限。在充分论证银行间市场和交易所市场套利机会可行性基础上,寻找最佳介入时机,进行跨市场操作,获得安全的超额收益。在遵循流动性优先的原则下,建立流动性预警指标,并通过现金库存、资产变现、剩余期限管理等措施确保基金资产的整体变现能力。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
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
下属分级基金的基金简称	中金现金管家A类 / 中金现金管家B类
下属分级基金的交易代码	000882 / 000883
报告期末下属分级基金的份额总额	232,809,369.97份 / 10,991,038,887.85份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)	
	中金现金管家A类	中金现金管家B类
1.本期已实现收益	2,461,147.95	92,854,907.34
2. 本期利润	2,461,147.95	92,854,907.34
3. 期末基金资产净值	232,809,369.97	10,991,038,887.85

注: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)和摊销关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金现金管家A类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9263%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.5897%	0.0007%

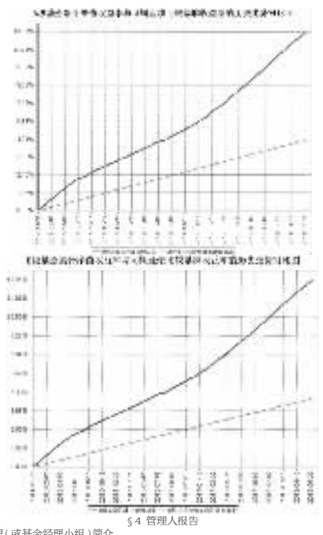
本基金收益分配按日结转份额。

中金现金管家B类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9869%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.6503%	0.0007%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石玉	本基金的基金经理	2016年7月16日	-	11年	石玉女士,管理学硕士。历任中国科技证券、联合证券职员,天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员,中国国际金融股份有限公司资产管理部高级研究员,基金经理助理,投资经理,现任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理,执行总经理。
闫雯雯	本基金基金经理助理	2017年8月24日	-	10年	闫雯雯女士,工商管理硕士,曾任泰康资产管理有限公司国际投资部、信用评估部研究员,现任中金基金管理有限公司固定收益研究主管。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、研究活动的控内幕交易指导意见》和其他有关法律法规及本基金合同的约定,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,在严格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 公平交易专项说明

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

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年二季度,股票市场总体表现较弱,主要指数下跌幅度较大,沪深300指数下跌9.94%,中证500指数下跌14.67%,中证800指数下跌11.19%,中证1000指数下跌17.51%。

报告期内,本基金执行了既定的量化精选投资策略,从全市场精选出优质公司的股票,对其中部分估值合理的股票进行配置。本报告期本基金份额净值增长率高于同期业绩比较基准收益率。

展望未来,预计中国经济依然具备较强的韧性,有较强抵御风险的能力。A股市场目前估值处于较低水平,具备较好的长期投资价值。本基金将继续执行量化精选投资策略,重点投资于具备盈利能力、成长能力且估值合理的公司,与这些优质公司一起成长,为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金现金管家A基金份额净值为0.8990元,本报告期基金份额净值增长率为-9.34%;截至本报告期末中金现金管家C基金份额净值为0.8955元,本报告期基金份额净值增长率为-9.41%;同期业绩比较基准收益率为-10.56%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	3,760,233,599.53	32.25
	其中:债券	3,760,233,599.53	32.25
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,478,984,698.73	21.26
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,020,497,906.45	43.06
4	其他资产	399,057,588.65	3.42
5	合计	11,658,773,793.36	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	562,348,848.23	6.21
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	431,008,839.98	3.84
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内,本货币市场基金未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	82
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	25.20	3.84
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	41.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	16.70	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	3.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	13.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.32	3.84

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240 天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	888,420,362.80	7.92
	其中:政策性金融债	888,420,362.80	7.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,075,396.69	0.09
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,861,737,840.04	25.50
8	其他	-	-
9	合计	3,760,233,599.53	33.50
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160208	16国开08	3,500,000	347,198,982.36	3.09
2	140303	14进出03	2,000,000	201,803,959.20	1.80
3	111818128	18华夏银行CD128	2,000,000	198,780,883.47	1.77
4	111816165	18上海银行CD165	2,000,000	198,775,424.06	1.77
5	111897821	18宁波银行CD092	2,000,000	198,703,624.13	1.77
6	111895707	18徽商银行CD066	2,000,000	197,286,096.83	1.76
7	111811132	18平安银行CD132	1,500,000	149,078,353.54	1.33
8	111811035	18平安银行CD035	1,000,000	99,656,384.91	0.89
9	111896676	18北京农商银行CD026	1,000,000	99,548,366.50	0.89
10	111783160	17广州农村商业银行CD150	1,000,000	99,438,209.23	0.89

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0502%
报告期内偏离度的最低值	-0.0061%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0175%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到过0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到过0.5%。

5.8 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	52,860,436.89
5	应收申购款	346,197,151.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	399,057,588.65

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中金现金管家A类	中金现金管家B类
报告期期初基金份额总额	314,482,984.65	10,537,563,879.09
报告期期间基金总申购份额	214,514,717.43	13,311,258,248.55
报告期期间基金总赎回份额	296,188,332.11	12,857,783,239.79
报告期期末基金份额总额	232,809,369.97	10,991,038,887.85

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 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2018年4月16日	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00%
合计			50,000,000.00	50,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予中金现金管家货币市场基金募集注册的文件

2、《中金现金管家货币市场基金基金合同》

3、《中金现金管家货币市场基金托管协议》

4、中金现金管家货币市场基金申请募集注册的法律意见书

5、基金管理人业务资格批复、营业执照

6、基金托管人业务资格批复、营业执照

7、报告期内中金现金管家货币市场基金在指定媒介上披露的各项公告

8、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/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和复印件。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:(86)010-63211122 400-868-1166

传真:(86)010-66159121

中金基金管理有限公司
2018年7月19日

中金金泽量化精选混合型发起式证券投资基金

2018年第二季度报告

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
报告送出日期:2018年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金金泽
基金主代码	005005
交易代码	005005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月1日
报告期末基金份额总额	20,366,437.23份
投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股,在充分控制投资风险的前提下,力求实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金的量化模型从策略配置出发,投资框架涵盖理论驱动型策略、数据驱动型策略和混合策略三大类别。其中,理论驱动型策略包括注重基本面分析的因子策略以及密集使用量价关系的动量、反转策略;数据驱动型策略有模式识别类策略、机器学习类策略;本基金在资产投资过程中将使用模型动态调配各策略类别的比重,强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险,力争基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	中证800指数收益率*95%+中债综合指数收益率*5%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期的风险和预期收益高于货币市场基金、债券证券投资基金,低于股票型证券投资基金。
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
下属分级基金的基金简称	中金金泽A / 中金金泽C
下属分级基金的交易代码	005005 / 005006
报告期末下属分级基金的份额总额	17,079,614.15份 / 3,286,823.08份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)	
	中金金泽A	中金金泽C
1. 本期已实现收益	-1,961,940.29	-381,156.01
2. 本期利润	-1,598,525.