

# 中金消费升级股票型证券投资基金

## 2018年第一季度报告

本报告期，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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明  
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 报告期内本基金投资策略和运作分析  
本基金第二季度重仓了家用电器、食品饮料和医药生物板块，减持金融股、传媒股。二季度末大幅调仓中，本基金依据持仓进行了减持，同时大幅调仓了。

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0.745元；本报告期基金份额净值增长率为1.78%，业绩比较基准收益率为3.29%。

4.6 报告期内本基金持有人数或基金资产净值预警说明  
本报告期，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。

5.1 报告期末基金资产组合情况  
5.1.1 报告期末基金资产组合情况

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.3 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

5.1.4 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债券投资明细

5.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

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

5.1.7 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权证投资明细

5.1.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10 本报告期涉及股指期货、国债期货的投资政策

5.1.11 本报告期股指期货投资评价

5.1.12 本报告期国债期货投资评价

5.1.13 本报告期国债期货投资评价

5.1.14 本报告期国债期货投资评价

5.1.15 本报告期国债期货投资评价

5.1.16 本报告期国债期货投资评价

5.1.17 本报告期国债期货投资评价

5.1.18 本报告期国债期货投资评价

5.1.19 本报告期国债期货投资评价

5.1.20 本报告期国债期货投资评价

5.1.21 本报告期国债期货投资评价

5.1.22 本报告期国债期货投资评价

5.1.23 本报告期国债期货投资评价

5.1.24 本报告期国债期货投资评价

5.1.25 本报告期国债期货投资评价

5.1.26 本报告期国债期货投资评价

5.1.27 本报告期国债期货投资评价

5.1.28 本报告期国债期货投资评价

5.1.29 本报告期国债期货投资评价

5.1.30 本报告期国债期货投资评价

5.1.31 本报告期国债期货投资评价

5.1.32 本报告期国债期货投资评价

5.1.33 本报告期国债期货投资评价

5.1.34 本报告期国债期货投资评价

5.1.35 本报告期国债期货投资评价

5.1.36 本报告期国债期货投资评价

5.1.37 本报告期国债期货投资评价

5.1.38 本报告期国债期货投资评价

5.1.39 本报告期国债期货投资评价

5.1.40 本报告期国债期货投资评价

5.1.41 本报告期国债期货投资评价

5.1.42 本报告期国债期货投资评价

5.1.43 本报告期国债期货投资评价

5.1.44 本报告期国债期货投资评价

5.1.45 本报告期国债期货投资评价

5.1.46 本报告期国债期货投资评价

5.1.47 本报告期国债期货投资评价

5.1.48 本报告期国债期货投资评价

5.1.49 本报告期国债期货投资评价

5.1.50 本报告期国债期货投资评价

5.1.51 本报告期国债期货投资评价

5.1.52 本报告期国债期货投资评价

5.1.53 本报告期国债期货投资评价

5.1.54 本报告期国债期货投资评价

5.1.55 本报告期国债期货投资评价

5.1.56 本报告期国债期货投资评价

5.1.57 本报告期国债期货投资评价

5.1.58 本报告期国债期货投资评价

5.1.59 本报告期国债期货投资评价

5.1.60 本报告期国债期货投资评价

5.1.61 本报告期国债期货投资评价

5.1.62 本报告期国债期货投资评价

5.1.63 本报告期国债期货投资评价

5.1.64 本报告期国债期货投资评价

5.1.65 本报告期国债期货投资评价

5.1.66 本报告期国债期货投资评价

5.1.67 本报告期国债期货投资评价

5.1.68 本报告期国债期货投资评价

5.1.69 本报告期国债期货投资评价

5.1.70 本报告期国债期货投资评价

5.1.71 本报告期国债期货投资评价

5.1.72 本报告期国债期货投资评价

5.1.73 本报告期国债期货投资评价

5.1.74 本报告期国债期货投资评价

5.1.75 本报告期国债期货投资评价

5.1.76 本报告期国债期货投资评价

5.1.77 本报告期国债期货投资评价

5.1.78 本报告期国债期货投资评价

5.1.79 本报告期国债期货投资评价

5.1.80 本报告期国债期货投资评价

5.1.81 本报告期国债期货投资评价

5.1.82 本报告期国债期货投资评价

5.1.83 本报告期国债期货投资评价

5.1.84 本报告期国债期货投资评价

5.1.85 本报告期国债期货投资评价

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

### 重要提示

基金管理人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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

### 2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 中金消费升级; 基金代码, 001019; 交易代码, 001019; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年11月10日; 报告期末基金份额总额, 341,568,300.04份

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

单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年4月1日至2018年6月30日); 1.本期已实现收益, -3,481,189.60; 2.本期公允价值变动收益, -3,483,433.57; 3.本期利润, 0.0141; 4.本期基金份额净值增长率, 1798.3862%; 5.本期基金份额净值增长率, 0.745

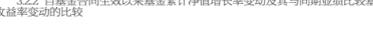
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

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。

3.2.1 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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准②, 业绩比较基准收益差③, 业绩比较基准收益差④, ①-③, ②-④; 过去三个月, 1.79%, 1.29%, 3.29%, 1.39%, -1.51%, -0.09%

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的比较



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

### 重要提示

基金管理人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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

### 2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 中金量化多策略; 基金代码, 001022; 交易代码, 001022; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年11月10日; 报告期末基金份额总额, 130,068,061.71份

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

单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年4月1日至2018年6月30日); 1.本期已实现收益, -3,481,189.60; 2.本期公允价值变动收益, -3,483,433.57; 3.本期利润, 0.0141; 4.本期基金份额净值增长率, 1798.3862%; 5.本期基金份额净值增长率, 0.745

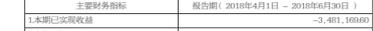
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

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。

3.2.1 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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准②, 业绩比较基准收益差③, 业绩比较基准收益差④, ①-③, ②-④; 过去三个月, -2.78%, 1.06%, -7.88%, 0.01%, -0.26%, 0.14%

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的比较



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

### 重要提示

基金管理人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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

### 2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 中金量化多策略; 基金代码, 001022; 交易代码, 001022; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年11月10日; 报告期末基金份额总额, 130,068,061.71份

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

单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年4月1日至2018年6月30日); 1.本期已实现收益, -3,481,189.60; 2.本期公允价值变动收益, -3,483,433.57; 3.本期利润, 0.0141; 4.本期基金份额净值增长率, 1798.3862%; 5.本期基金份额净值增长率, 0.745

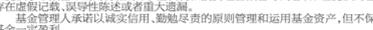
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

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。

3.2.1 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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准②, 业绩比较基准收益差③, 业绩比较基准收益差④, ①-③, ②-④; 过去三个月, -5.71%, 0.84%, -7.03%, 0.84%, 1.46%, -0.01%

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的比较



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

### 重要提示

基金管理人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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

### 2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 中金量化多策略; 基金代码, 001022; 交易代码, 001022; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年11月10日; 报告期末基金份额总额, 130,068,061.71份

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

单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年4月1日至2018年6月30日); 1.本期已实现收益, -3,481,189.60; 2.本期公允价值变动收益, -3,483,433.57; 3.本期利润, 0.0141; 4.本期基金份额净值增长率, 1798.3862%; 5.本期基金份额净值增长率, 0.745

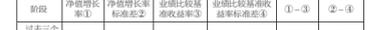
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

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。

3.2.1 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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准②, 业绩比较基准收益差③, 业绩比较基准收益差④, ①-③, ②-④; 过去三个月, -5.71%, 0.84%, -7.03%, 0.84%, 1.46%, -0.01%

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的比较



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

### 重要提示

基金管理人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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

### 2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 中金量化多策略; 基金代码, 001022; 交易代码, 001022; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年11月10日; 报告期末基金份额总额, 130,068,061.71份

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

单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年4月1日至2018年6月30日); 1.本期已实现收益, -3,481,189.60; 2.本期公允价值变动收益, -3,483,433.57; 3.本期利润, 0.0141; 4.本期基金份额净值增长率, 1798.3862%; 5.本期基金份额净值增长率, 0.745

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。

3.2.1 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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准②, 业绩比较基准收益差③, 业绩比较基准收益差④, ①-③, ②-④; 过去三个月, -5.71%, 0.84%, -7.03%, 0.84%, 1.46%, -0.01%

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的比较



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

### 重要提示

基金管理人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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

### 2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 中金量化多策略; 基金代码, 001022; 交易代码, 001022; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年11月10日; 报告期末基金份额总额, 130,068,061.71份

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

单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年4月1日至2018年6月30日); 1.本期已实现收益, -3,481,189.60; 2.本期公允价值变动收益, -3,483,433.57; 3.本期利润, 0.0141; 4.本期基金份额净值增长率, 1798.3862%; 5.本期基金份额净值增长率, 0.745

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。

3.2.1 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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准②, 业绩比较基准收益差③, 业绩比较基准收益差④, ①-③, ②-④; 过去三个月, -5.71%, 0.84%, -7.03%, 0.84%, 1.46%, -0.01%

3.2.2