中金丰硕混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:包商银行股份有限公司

送出日期:2018 年 8 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。

基金托管人包商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 29 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中金丰硕
基金主代码	005396
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年1月29日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	包商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	247,306,181.83份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金将重点投资于具备内生性增长基础的价值创造型企业,并重点关注相关个股的安全边际及绝对收益机会。我们策略选择股票集中在市场空间大、周期波动性小、政策支持的行业中,通过市占率、盈利能力、成长能力等核心指标,选择出上述行业中具备长期核心竞争力的龙头企业,买入并持有,从而获得中长期的超额收益。 本基金在行业配置的基础上,通过定性分析和定量分析相结合的办法,挑选出受惠于经济转型并具有核心竞争力的上市公司。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率× 50%+ 中债综合财富(总值)指数收益率× 50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

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	包商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李虹	董雁
	联系电话	010- 63211122	0755- 33352056
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	dongyanbsb@163.com
客户服务电话		400- 868- 1166	95352
传真		010- 66159121	0755- 33352052- 2056

2.4 信息披露方式

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

§ 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29日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-6,364,245.14
本期利润	-17,872,666.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0702
本期基金份额净值增长率	-7.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0718
期末基金资产净值	229,553,375.47
期末基金份额净值	0.9282

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

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

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

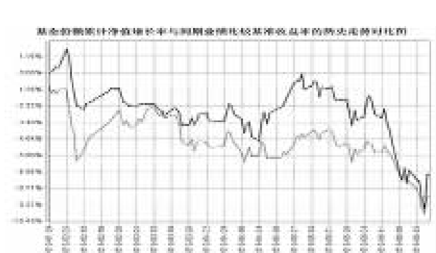
4、本基金合同生效日为 2018 年 1 月 29 日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

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
过去一个月	-4.62%	1.14%	-3.57%	0.64%	-1.05%	0.50%
过去三个月	-4.42%	0.84%	-4.08%	0.57%	-0.34%	0.27%
自基金合同生效起至今	-7.18%	0.72%	-8.69%	0.60%	1.51%	0.12%

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



注:本基金的基金合同生效日为 2018 年 1 月 29 日,按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期,截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

§ 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		
郭党钰	本基金基金经理	2018年1月29日	-	16年	郭党钰先生,工商管理硕士。历任宁波镇海炼化投资经理;华泰证券项目经理;德恒证券高级经理;华策投资有限公司投资副总经理;招商基金管理有限公司投资经理。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。

注:1、上述基金经理任职日期为本基金基金合同生效日。

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》、《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

本基金成立于 2018 年 1 月底,建仓初期以低估值的银行为主,贸易摩擦争端后,叠加去杠杆的压力,调整卖出银行,二季度建仓逐步增持了医药、家电、保险、地产、禽类养殖,6 月后后减持了部分涨后估值较高的医药股,持有估值合理个股,包括地产龙头,销售数据确定,估值低,家电销售符合预期,禽类涨价驱动,但受市场 6 月下旬持续下跌的影响,净值回落较多。

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 0.9282 元;本报告期基金份额净值增长率为 -7.18%,业绩比较基准收益率为 -8.69%。

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 2018 年 3 季度,目前对国内去杠杆、贸易战升级、地产政策打压,预期销售数据环比下滑,综合负面因素抑制经济的悲观反应持续发酵,对内需要观察政策调整措施和后续效果,对外跟踪贸易摩擦的进展。

流动性方面,货币政策边际放松,对冲紧信用下去杠杆的流动性风险,传导到实体目前尚不明显。

估值和基本面,沪深 300 基本跌至近 10 年低点,中证 500 跌至 16 年熔断以来的新低,中小创部分股票估值合理,市盈率和市净率也已经跌至底部区域。

策略上,目前悲观预期没有证伪之前,市场应该处于反复筑底过程,不排除新低可能,但存在业绩能够持续的板块和个股,因此,我们短期基于中报,中期基于行业受贸易摩擦影响小,寻找现金流、负债率安全,在估值偏低的位置增持,关注大金融、医药消费和新能源等新兴行业具备竞争力的个股投资机会。

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

本报告期内,包商股份有限公司(以下称"本托管人")在对中金丰硕混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内,由中金基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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:中金丰硕混合型证券投资基金

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		2,268,136.43	-
结算备付金		4,361,335.52	-
存出保证金		346,253.71	-
交易性金融资产		218,591,778.48	-
其中:股票投资		161,418,894.88	-
基金投资		-	-
债券投资		57,172,883.60	-
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		5,100,000.00	-
应收证券清算款		846,549.43	-
应收利息		1,201,163.03	-
应收股利		-	-
应收申购款		195,265.34	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		232,910,481.94	-
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		-	-
卖出回购金融资产款		800,000.00	-
应付证券清算款		1,015,704.06	-
应付赎回款		624,948.34	-
应付管理人报酬		292,782.08	-
应付托管费		29,278.21	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		496,953.90	-
应交税费		7,369.77	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		90,070.11	-
负债合计		3,357,106.47	-
所有者权益:			
实收基金		247,306,181.83	-
未分配利润		-17,752,806.36	-
所有者权益合计		229,553,375.47	-
负债和所有者权益总计		232,910,481.94	-

注:1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.9282 元,基金份额总额 247,306,181.83 份。

2、本基金合同生效日为 2018 年 1 月 29 日,无上年度可比期间数据。

6.2 利润表

会计主体:中金丰硕混合型证券投资基金

本报告期:2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月29日(基金合同生效日)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		-15,243,275.26	-
1.利息收入		2,606,053.92	-
其中:存款利息收入		438,189.18	-
债券利息收入		1,546,363.90	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		621,500.84	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-6,533,523.65	-
其中:股票投资收益		-7,574,857.71	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-302,740.16	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,344,074.22	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-11,508,421.68	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		192,616.15	-
减:二、费用		2,629,391.56	-
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	1,546,394.44	-
2. 托管费	6.4.7.2.2	154,639.54	-
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	-	-
4. 交易费用		808,851.34	-
5. 利息支出		25,779.33	-
其中:卖出回购金融资产支出		25,779.33	-
6. 税金及附加		3,707.29	-
7. 其他费用		90,019.62	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-17,872,666.82	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-17,872,666.82	-

注:本基金合同生效日为 2018 年 1 月 29 日,无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中金丰硕混合型证券投资基金

本报告期:2018 年 1 月 29 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月29日(基金合同生效日)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)	245,273,572.56	-	245,273,572.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-17,872,666.82	-17,872,666.82
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)	2,032,609.27	119,860.46	2,152,469.73
其中:1.基金申购款	51,020,943.97	-1,281,392.43	49,739,551.54
2.基金赎回款	-48,988,334.70	1,401,252.89	-47,587,081.81
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)	247,306,181.83	-17,752,806.36	229,553,375.47

注:本基金合同生效日为 2018 年 1 月 29 日,无上年度可比期间数据。

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

中金丰硕混合型证券投资基金(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 2017 年 11 月 9 日证监许可 [2017] 2023 号《关于准予中金丰硕混合型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、《中金丰硕混合型证券投资基金基金招募说明书》和《中金丰硕混合型证券投资基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金,托管人为包商银行股份有限公司 (以下简称"包商银行")。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国银河证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司及包商银行等共同销售,募集期为 2017 年 12 月 20 日起至 2018 年 1 月 23。经向中国证监会备案,《中金丰硕混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 29 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 245,273,572.56 份 (含利息转份额 128,974.98 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》及其配套规则、《中金丰硕混合型证券投资基金合同》和《中金丰硕混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券 (包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换债券 (含分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券(含短期融资券)、中期票据等)、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、银行存款、同业存单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 (但须符合中国证监会相关规定)。

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《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、自 2018 年 1 月 29 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计估计变更。

6.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期未发生重大会计差错更正。

6.4.5 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:

(1)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。

(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。

(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 (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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
包商银行	基金托管人、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:1、本基金本报告期关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中投证券	678,598,559.26	100.00%

注:本基金合同生效日为 2018 年 1 月 29 日,无上年度可比期间数据。

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中投证券	81,988,454.93	100.00%

注:本基金合同生效日为 2018 年 1 月 29 日,无上年度可比期间数据。

6.4.7.1.3 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29日(基金合同生效日)至2018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
中投证券	3,959,600,000.00	100.00%

注:本基金合同生效日为 2018 年 1 月 29 日,无上年度可比期间数据。

6.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.5 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29日(基金合同生效日)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
中投证券	496,253.90	100.00%	496,253.90	100.00%

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险金后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场服务信息。

3、本基金合同生效日为 2018 年 1 月 29 日,无上年度可比期间数据。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,546,394.44
其中:支付销售机构的客户维护费	644,036.70

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 1.50%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× 1.50%/ 当年天数。

2、注:本基金合同生效日为 2018 年 1 月 29 日,无上年度可比期间数据。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	154,639.54

注:1、支付基金托管人包商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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× 0.15%/ 当年天数。

2、本基金合同生效日为 2018 年 1 月 29 日,无上年度可比期间数据。

6.4.7.2.3 销售服务费

本基金本报告期无销售服务费。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购) 交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.7.5 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 2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
包商银行	2,268,136.43	75,738.34

注:1、本基金的银行存款由基金托管人包商银行保管,按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金通过"包商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 4,707,589.23 元,本期间产生的利息收入为人民币 30,728.20 元 。

3、本基金合同生效日为 2018 年 1 月 29 日,无上年度可比期间数据。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 期末(2018 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 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	-

注: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。

6.4.8.2 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
002426	胜利精密	2018年6月19日	重大事项停牌	3.60	2018年7月3日	3.26	305,200	1,286,286.00	1,098,720.00	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止,本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0,无抵押债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 800,000.00 元,于 2018 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和 / 或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	161,418,894.88	69.31
	其中:股票	161,418,894.88	69.31
2	固定收益投资	57,172,883.60	24.55
	其中:债券	57,172,883.60	24.55
	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	5,100,000.00	2.19
	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	6,629,471.95	2.85
7	其他各项资产	2,589,231.51	1.11
8	合计	232,910,481.94	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	5,175,259.00	2.25
B	采矿业	4,801,263.00	2.09
C	制造业	104,444,189.01	45.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,417,954.85	0.62
E	建筑业	3,892,978.00	1.70
F	批发和零售业	4,653,387.75	2.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,049.02	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,613,341.45	8.11
J	金融业	2,873,796.46	1.25
K	房地产业	11,190,054.00	4.87
L	租赁和商务服务业	1,634,173.20	0.71
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,721,449.14	1.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	161,418,894.88	70.32

7.2.2 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股票资产。

7.3 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	600048	保利地产	505,970	6,172,834.00	2.69
2	002332	仙琚制药	662,083	5,793,226.25	2.52
3	000651	格力电器	86,600	4,083,190.00	1.78
4	002299	圣农发展	247,900	3,839,971.00	1.67
5	000910	大亚圣象	202,200	3,417,180.00	1.49
6	600383	金地集团	334,000	3,403,460.00	1.48
7	600285	羚锐制药	367,800	3,277,098.00	1.43
8	002422	科伦药业	92,301	2,962,862.10	1.29
9	600436	片仔癀	26,200	2,932,566.00	1.28
10	601336	新华保险	66,679	2,859,195.52	1.25

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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	17,412,836.00	7.59
2	000001	平安银行	13,723,885.00	5.98
3	002456	欧菲科技	10,821,934.58	4.71
4	601336	新华保险	10,283,977.00	4.48
5	601009	南京银行	10,144,053.00	4.42
6	601939	建设银行	9,991,151.00	4.35
7	601818	光大银行	9,816,172.00	4.28
8	600048	保利地产	9,717,159.24	4.23
9	002555	三七互娱	9,558,281.00	4.16
10	601012	隆基股份	9,277,376.38	4.04
11	002343	慈文传媒	8,352,282.00	3.64
12	002332	仙琚制药	7,837,329.50	3.41
13	601601	中国太保	7,805,162.69	3.40
14	601998	中信银行	7,344,256.85	3.20
15	000661	长春高新	7,341,318.00	3.20
16	600285	羚锐制药	7,164,995.00	3.12
17	603883	老百姓	6,786,566.00	2.96
18	600729	重庆百货	6,409,228.00	2.79
19	000910	大亚圣象	6,340,306.00	2.76
20	000651	格力电器	6,269,370.00	2.73
21	000963	华东医药	6,107,158.00	2.66
22	002680	ST长生	5,268,563.08	2.30
23	601699	潞安环能	5,170,500.00	2.25
24	601318	中国平安	5,165,472.00	2.25
25	000333	美的集团	5,035,245.00	2.19
26	002422	科伦药业	4,994,858.00	2.18
27	601988	中国银行	4,930,175.00	2.15
28	601169	北京银行	4,895,905.00	2.13
29	600887	伊利股份	4,878,501.00	2.13

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	15,301,005.10	6.67
2	000001	平安银行	11,133,640.64	4.85
3	601009	南京银行	9,762,832.26	4.25
4	601818	光大银行	8,965,002.80	3.91
5	000661	长春高新	8,911,846.85	3.88
6	601939	建设银行	8,578,506.04	3.74
7	601012	隆基股份	8,524,260.31	3.71
8	600729	重庆百货	8,257,507.88	3.60
9	601601	中国太保	7,638,256.62	3.33
10	603883	老百姓	7,345,481.94	3.20
11	002343	慈文传媒	7,277,439.61	3.17
12	002680	ST长生	6,986,721.78	3.04
13	002456	欧菲科技	6,943,344.66	3.02
14	601336	新华保险	6,932,109.05	3.02
15	601998	中信银行	6,750,768.84	2.94
16	002555	三七互娱	6,402,949.39	2.79
17	601699	潞安环能	4,927,349.98	2.15
18	601169	北京银行	4,857,132.00	2.12
19	601318	中国平安	4,773,538.68	2.08
20	600887	伊利股份	4,745,577.25	2.07
21	300326	凯利泰	4,662,411.44	2.03

7.4.3 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	429,785,760.60
卖出股票收入(成交)总额	249,264,669.35

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	23,611,383.60	10.29
	其中:政策性金融债	23,611,383.60	10.29
4	企业债券	13,487,500.00	5.88
5	企业短期融资券	10,093,000.00	4.40
6	中期票据	9,981,000.00	4.35
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	57,172,883.60	24.91

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开 1701	235,220	23,611,383.60	10.29
2	041760062	17鄂西圈 CP001	100,000	10,093,000.00	4.40
3	101564066	15抚州投资 MTN001	100,000	9,981,000.00	4.35
4	122406	15新湖债	85,000	8,500,000.00	3.70
5	122444	15冠城债	50,000	4,987,500.00	2.17

7.7 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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

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。

7.12.3 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	346,253.71
2	应收证券清算款	846,549.43
3	应收股利	-
4	应收利息	1,201,163.03
5	应收申购款	195,265.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,589,231.51

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
7,819	31,628.88	0.00	0.00%	247,306,181.83	100.00%

8.2 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	0.00	0.0000%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2018年1月29日)基金份额总额	245,273,572.56
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	51,020,943.97
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	48,988,334.70
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	247,306,181.83

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

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

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任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中投证券	2	678,598,559.26	100.00%	496,253.90	100.00%	-
太平洋	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、个股分析的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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中投证券	81,988,454.93	100.00%	3,959,600,000.00	100.00%	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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。

11.2 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

2018 年 8 月 28 日