

中金金序量化成长混合型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

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
1.1 重要提示
1.2 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在报告期间内无违法违规行为

经济持续向好,经济活跃度提高,第二,深化供给侧结构性改革,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

根据经中国证监会备案的《中金金序量化成长混合型证券投资基金合同》和《中金金序量化成长混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容,本基金根据认购、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别

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

Table with 3 columns: 关联方名称, 期末余额, 占本基金资产净值比例。显示了关联方存款和利息收入的情况。

6.4.7.7 其他关联方交易事项的说明
6.4.7.8 其他关联方(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.8.1 因认购发生/增发证券于期末未持有的流通受限证券

Table with 10 columns: 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动, 公允价值变动占基金资产净值比例。

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购
6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购
6.4.9 有助于理解和风险分析报表需要说明的其他事项

Table with 6 columns: 资产类别, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动, 公允价值变动占基金资产净值比例。

7.1 期末基金资产组合情况
7.1.1 基金资产组合情况
7.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 6 columns: 行业名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动, 公允价值变动占基金资产净值比例。

7.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
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

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

7.4 报告期内大额申购赎回基金资产净值2%或前20名的股票投资明细
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

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入金额, 占期末基金资产净值比例。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票投资明细
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 6 columns: 序号, 债券名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

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
7.7 投资组合报告附注

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

7.8 影响投资决策的其他重要信息
7.8.1 报告期内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

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

7.8.2 报告期内基金投资的前十名债券未超出基金合同规定的备选股票库
7.8.3 报告期内基金投资的前十名资产支持证券未超出基金合同规定的备选股票库

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

7.8.4 报告期内基金投资的前十名权证未超出基金合同规定的备选股票库
7.8.5 报告期内基金投资的前十名股指期货未超出基金合同规定的备选股票库

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

7.8.6 报告期内基金投资的前十名期权未超出基金合同规定的备选股票库
7.8.7 报告期内基金投资的前十名贵金属未超出基金合同规定的备选股票库

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

2.1 基金基本情况
2.1.1 基金名称
2.1.2 基金代码
2.1.3 基金管理人

2.2 基金产品说明
2.2.1 基金类型
2.2.2 基金运作方式
2.2.3 基金管理人

2.3 基金管理人
2.3.1 基金管理人概况
2.3.2 基金管理人主要人员情况

2.4 信息披露方式
2.4.1 信息披露网站
2.4.2 信息披露联系人

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

Table with 3 columns: 基金名称, 期末余额, 占基金资产净值比例。

Table with 3 columns: 基金名称, 期初余额, 期末余额, 公允价值变动。

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

Table with 7 columns: 期间, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, 净值增长率与业绩比较基准收益率的差额。

Table with 7 columns: 基金名称, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, 净值增长率与业绩比较基准收益率的差额。

3.2.1 基金净值表现
3.2.2 基金净值表现
3.2.3 基金净值表现

Table with 3 columns: 基金名称, 期末余额, 占基金资产净值比例。

Table with 3 columns: 基金名称, 期初余额, 期末余额, 公允价值变动。

注:1.报告截止日2018年6月30日,中金金序量化成长A基金资产净值0.8947亿元,基金份额总额156,172,650.96份;中金金序量化成长C基金资产净值0.8927亿元,基金份额总额52,535.30份;中金金序量化成长B基金资产净值为156,225,186.26份

Table with 3 columns: 基金名称, 期末余额, 占基金资产净值比例。

6.2 利润分配
6.2.1 基金利润分配
6.2.2 基金利润分配

Table with 3 columns: 基金名称, 期末余额, 占基金资产净值比例。

4.3 管理人报告
4.3.1 基金管理人及基金托管人
4.3.2 基金管理人及基金托管人

4.3.3 基金管理人及基金托管人
4.3.4 基金管理人及基金托管人
4.3.5 基金管理人及基金托管人

4.3.6 基金管理人及基金托管人
4.3.7 基金管理人及基金托管人
4.3.8 基金管理人及基金托管人

4.3.9 基金管理人及基金托管人
4.3.10 基金管理人及基金托管人
4.3.11 基金管理人及基金托管人

4.3.12 基金管理人及基金托管人
4.3.13 基金管理人及基金托管人
4.3.14 基金管理人及基金托管人

4.3.15 基金管理人及基金托管人
4.3.16 基金管理人及基金托管人
4.3.17 基金管理人及基金托管人

4.6 管理人报告
4.6.1 基金管理人
4.6.2 基金管理人

4.6.3 基金管理人
4.6.4 基金管理人
4.6.5 基金管理人

4.6.6 基金管理人
4.6.7 基金管理人
4.6.8 基金管理人

4.6.9 基金管理人
4.6.10 基金管理人
4.6.11 基金管理人

4.6.12 基金管理人
4.6.13 基金管理人
4.6.14 基金管理人

4.6.15 基金管理人
4.6.16 基金管理人
4.6.17 基金管理人

4.6.18 基金管理人
4.6.19 基金管理人
4.6.20 基金管理人

4.6.21 基金管理人
4.6.22 基金管理人
4.6.23 基金管理人

4.6.24 基金管理人
4.6.25 基金管理人
4.6.26 基金管理人

4.6.27 基金管理人
4.6.28 基金管理人
4.6.29 基金管理人

4.6.30 基金管理人
4.6.31 基金管理人
4.6.32 基金管理人

4.6.33 基金管理人
4.6.34 基金管理人
4.6.35 基金管理人

4.6.36 基金管理人
4.6.37 基金管理人
4.6.38 基金管理人

4.6.39 基金管理人
4.6.40 基金管理人
4.6.41 基金管理人

4.6.42 基金管理人
4.6.43 基金管理人
4.6.44 基金管理人

4.6.45 基金管理人
4.6.46 基金管理人
4.6.47 基金管理人

4.6.48 基金管理人
4.6.49 基金管理人
4.6.50 基金管理人

4.6.51 基金管理人
4.6.52 基金管理人
4.6.53 基金管理人

4.6.54 基金管理人
4.6.55 基金管理人
4.6.56 基金管理人

4.6.57 基金管理人
4.6.58 基金管理人
4.6.59 基金管理人

4.6.60 基金管理人
4.6.61 基金管理人
4.6.62 基金管理人

4.6.63 基金管理人
4.6.64 基金管理人
4.6.65 基金管理人

4.6.66 基金管理人
4.6.67 基金管理人
4.6.68 基金管理人

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

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
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
7.9 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

8.1 期末基金资产组合情况
8.1.1 基金资产组合情况
8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 6 columns: 行业名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动, 公允价值变动占基金资产净值比例。

8.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
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

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

8.4 报告期内大额申购赎回基金资产净值2%或前20名的股票投资明细
8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入金额, 占期末基金资产净值比例。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票投资明细
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 6 columns: 序号, 债券名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

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
8.7 投资组合报告附注

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

8.8 影响投资决策的其他重要信息
8.8.1 报告期内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

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

8.8.2 报告期内基金投资的前十名债券未超出基金合同规定的备选股票库
8.8.3 报告期内基金投资的前十名资产支持证券未超出基金合同规定的备选股票库

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

8.8.4 报告期内基金投资的前十名权证未超出基金合同规定的备选股票库
8.8.5 报告期内基金投资的前十名股指期货未超出基金合同规定的备选股票库

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

8.8.6 报告期内基金投资的前十名期权未超出基金合同规定的备选股票库
8.8.7 报告期内基金投资的前十名贵金属未超出基金合同规定的备选股票库

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

8.8.8 报告期内基金投资的前十名权证未超出基金合同规定的备选股票库
8.8.9 报告期内基金投资的前十名股指期货未超出基金合同规定的备选股票库

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

8.8.10 报告期内基金投资的前十名期权未超出基金合同规定的备选股票库
8.8.11 报告期内基金投资的前十名贵金属未超出基金合同规定的备选股票库

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

8.8.12 报告期内基金投资的前十名权证未超出基金合同规定的备选股票库
8.8.13 报告期内基金投资的前十名股指期货未超出基金合同规定的备选股票库

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值变动。

8.8.14 报告期内基金投资的前十名权证未超出基金合同规定的备选股票库
8.8.15 报告期内基金投资的前十名股指期货未超出基金合同规定的备选股票库