

中金金泽量化精选混合型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

Table with 2 columns: Item, and two columns for Fund A and Fund C. Shows assets under management for various periods.

§ 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
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table showing the change in the number of shares held by the fund manager and the details of the fund manager's investment in the fund.

§ 8 报告期末发起式基金发起者持有基金份额情况

Table showing the shareholding of the fund's initiators at the end of the reporting period.

§ 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

Table detailing the situation where a single investor holds more than 20% of the fund's shares.

9.2 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。

§ 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金泽量化精选混合型发起式证券投资基金募集注册的文件
2.《中金金泽量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同》
3.《中金金泽量化精选混合型发起式证券投资基金托管协议》
4.本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.报告期内中金金泽量化精选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
9.2 存放地点
10.3 查阅方式

2018年9月30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

§ 1 重要提示
基金管理人:中金基金管理有限公司

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。

§ 2 基金产品概况

Table with 2 columns: Item and Value. Provides details about the fund's name, code, type, and dates.

§ 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

Table showing key financial indicators for the fund, such as net assets and income.

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing the fund's net value growth rate to its benchmark.

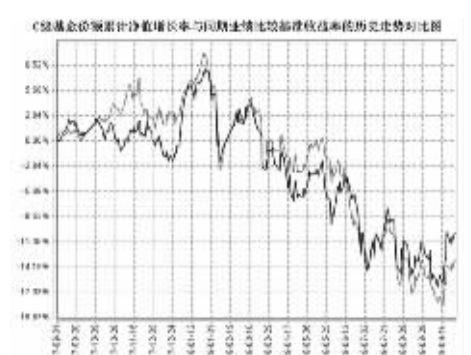
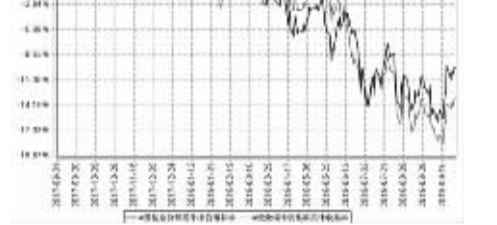
中金金泽 A

Table with 7 columns showing performance metrics for the Gold and Emerald fund.

中金金泽 C

Table with 7 columns showing performance metrics for the Gold and Emerald fund (Class C).

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



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 管理人报告

4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: Name, Position, Start Date, End Date, and Role. Lists the fund manager and other key personnel.

注:1,对本基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日

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

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》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规的规定

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年第三季度,股票市场总体表现较弱,主要指数都有不同程度下跌,沪深 300 指数下跌 2.05%,中证 500 指数下跌 7.99%,中证 800 指数下跌 3.54%,中证 1000 指数下跌 11.08%。

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,对其当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。

展望未来,预计中国经济具备较强韧性,有一定抵御风险的能力,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、成长性且估值

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。

截至本报告期末中金金泽 A 基金份额净值为 0.8996 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.07%;截至本报告期末中金金泽 C 基金份额净值为 0.8952 元,本报告期基金份额净值增长率为 -0.03%;同期业绩比较基准收益率为 -3.27%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

Table showing the portfolio composition of the fund at the end of the reporting period, categorized by asset type and industry.

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

Table showing the stock portfolio breakdown by industry for the fund.

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票资产。

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

Table listing the top 10 stocks held by the fund, ranked by their fair value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing the bond portfolio breakdown by category.

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

Table listing the top 5 bonds held by the fund, ranked by their fair value.

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。

截至本报告期末中金金泽 A 基金份额净值为 0.8996 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.07%;截至本报告期末中金金泽 C 基金份额净值为 0.8952 元,本报告期基金份额净值增长率为 -0.03%;同期业绩比较基准收益率为 -3.27%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

Table showing the portfolio composition of the fund at the end of the reporting period, categorized by asset type and industry.

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

Table showing the stock portfolio breakdown by industry for the fund.

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票资产。

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

Table listing the top 10 stocks held by the fund, ranked by their fair value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing the bond portfolio breakdown by category.

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

Table listing the top 5 bonds held by the fund, ranked by their fair value.

中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

Table with 2 columns: Item, and two columns for Fund A and Fund C. Shows assets under management for various periods.

§ 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
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table showing the change in the number of shares held by the fund manager and the details of the fund manager's investment in the fund.

§ 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

Table detailing the situation where a single investor holds more than 20% of the fund's shares.

§ 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金序量化蓝筹混合型证券投资基金募集注册的文件
2.《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同》
3.《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金托管协议》
4.本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.报告期内中金金序量化蓝筹混合型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
9.2 存放地点
9.3 查阅方式

2018年9月30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

§ 1 重要提示
基金管理人:中金基金管理有限公司

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。

§ 2 基金产品概况

Table with 2 columns: Item and Value. Provides details about the fund's name, code, type, and dates.

§ 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

Table showing key financial indicators for the fund, such as net assets and income.

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing the fund's net value growth rate to its benchmark.

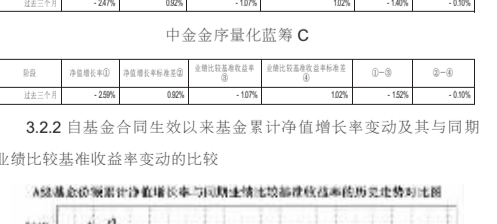
中金金序量化蓝筹 A

Table with 7 columns showing performance metrics for the Gold and Blue fund.

中金金序量化蓝筹 C

Table with 7 columns showing performance metrics for the Gold and Blue fund (Class C).

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



始偏向积极,一是稳定当前的预期,调整去杠杆的节奏,二是为中国转型升级以及中长期的经济增长提供政策支持,例如降税降费、刺激需求促进消费等。

§ 4 管理人报告

4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: Name, Position, Start Date, End Date, and Role. Lists the fund manager and other key personnel.

注:1,上述基金经理的任职日期为本基金合同生效日。

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

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》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规的规定

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,通过系统控制和人

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年的宏观经济主要围绕国内经济形势和中美贸易战两个主题。从国内经济形势来看,中国经济有下行的压力,但国内政策已经开

始偏向积极,一是稳定当前的预期,调整去杠杆的节奏,二是为中国转型升级以及中长期的经济增长提供政策支持,例如降税降费、刺激需求促进消费等。

截至本报告期末中金金序量化蓝筹 A 基金份额净值为 0.9064 元,本报告期基金份额净值增长率为 -2.47%;截至本报告期末中金金序量化蓝筹 C 基金份额净值为 0.9464 元,本报告期基金份额净值增长率为 -2.59%;同期业绩比较基准收益率为 -1.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

Table showing the portfolio composition of the fund at the end of the reporting period, categorized by asset type and industry.

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

Table showing the stock portfolio breakdown by industry for the fund.

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票资产。

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

Table listing the top 10 stocks held by the fund, ranked by their fair value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing the bond portfolio breakdown by category.

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。

截至本报告期末中金金序量化蓝筹 A 基金份额净值为 0.9064 元,本报告期基金份额净值增长率为 -2.47%;截至本报告期末中金金序量化蓝筹 C 基金份额净值为 0.9464 元,本报告期基金份额净值增长率为 -2.59%;同期业绩比较基准收益率为 -1.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

Table showing the portfolio composition of the fund at the end of the reporting period, categorized by asset type and industry.

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

Table showing the stock portfolio breakdown by industry for the fund.

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票资产。

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

Table listing the top 10 stocks held by the fund, ranked by their fair value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing the bond portfolio breakdown by category.