

# 中金价值轮动灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

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:上海浦东发展银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

### 32.2 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



**§ 2 基金产品概况**

基金代码	005262
基金简称	005262
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月27日
报告期末基金份额总额	143,766,871.52份

**投资目标**  
在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资策略,力争实现基金资产的长期增值。

**投资策略**  
本基金的投资策略主要基于对宏观经济、行业、市场和个股的综合研判,在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资策略,力争实现基金资产的长期增值。

**业绩比较基准**  
中证500指数收益率×50%+中债综合指数(总值)收益率×50%

**风险收益特征**  
本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

**基金管理人**  
中金基金管理有限公司  
基金托管人  
上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现异常交易行为。

**§ 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	82,159,990.38	70.89
2	固定收益	82,159,990.38	70.89
3	货币资金	10,080,000.00	8.66
4	贵金属	10,080,000.00	8.66
5	金融衍生品	-	-
6	买入返售金融资产	18,100,000.00	15.57
7	银行存款和其他货币资金合计	5,649,525.50	4.86
8	其他资产	20,289.33	0.22
9	合计	116,220,375.61	100.00

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	煤炭业	-	-
C	制造业	56,072,287.20	48.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	信息技术业	-	-
G	交通、运输、仓储业	-	-
H	批发和零售业	-	-
I	金融业	10,474,233.19	9.12
J	房地产业	16,613,500.00	14.60
K	其他	-	-
L	国防军工	-	-
M	科学、技术和研发业	-	-
N	其他	-	-
O	其他	-	-
P	其他	-	-
Q	其他	-	-
R	其他	-	-
S	其他	-	-
合计	权益投资	82,159,990.38	71.96

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期 2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日	本报告期初至本报告期末	本报告期初至本报告期末
1.本期利润总额	-	-16,971,289.50	-	-26,489.94
2.本期净利润	-	-17,164,799.46	-	-27,184.84
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.1203	-	-0.0785
4.期末基金资产净值	-	113,867,509.89	-	220,183.65
5.期末基金份额净值	-	0.7927	-	0.9955

### 3.2 基金净值表现

**32.1 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**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-19.00%	12.0%	-0.15%	0.67%	-10.75%	0.53%

**中债综合指数(C)**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-11.12%	12.2%	-0.15%	0.67%	-10.97%	0.55%

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	煤炭业	-	-
C	制造业	56,072,287.20	48.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	信息技术业	-	-
G	交通、运输、仓储业	-	-
H	批发和零售业	-	-
I	金融业	10,474,233.19	9.12
J	房地产业	16,613,500.00	14.60
K	其他	-	-
L	国防军工	-	-
M	科学、技术和研发业	-	-
N	其他	-	-
O	其他	-	-
P	其他	-	-
Q	其他	-	-
R	其他	-	-
S	其他	-	-
合计	权益投资	82,159,990.38	71.96

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期 2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日	本报告期初至本报告期末	本报告期初至本报告期末
1.本期利润总额	-	-16,971,289.50	-	-26,489.94
2.本期净利润	-	-17,164,799.46	-	-27,184.84
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.1203	-	-0.0785
4.期末基金资产净值	-	113,867,509.89	-	220,183.65
5.期末基金份额净值	-	0.7927	-	0.9955

### 3.2 基金净值表现

**32.1 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**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-19.00%	12.0%	-0.15%	0.67%	-10.75%	0.53%

**中债综合指数(C)**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-11.12%	12.2%	-0.15%	0.67%	-10.97%	0.55%

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期 2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日	本报告期初至本报告期末	本报告期初至本报告期末
1.本期利润总额	-	-16,971,289.50	-	-26,489.94
2.本期净利润	-	-17,164,799.46	-	-27,184.84
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.1203	-	-0.0785
4.期末基金资产净值	-	113,867,509.89	-	220,183.65
5.期末基金份额净值	-	0.7927	-	0.9955

### 3.2 基金净值表现

**32.1 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**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-19.00%	12.0%	-0.15%	0.67%	-10.75%	0.53%

**中债综合指数(C)**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-11.12%	12.2%	-0.15%	0.67%	-10.97%	0.55%

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期 2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日	本报告期初至本报告期末	本报告期初至本报告期末
1.本期利润总额	-	-16,971,289.50	-	-26,489.94
2.本期净利润	-	-17,164,799.46	-	-27,184.84
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.1203	-	-0.0785
4.期末基金资产净值	-	113,867,509.89	-	220,183.65
5.期末基金份额净值	-	0.7927	-	0.9955

### 3.2 基金净值表现

**32.1 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**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-19.00%	12.0%	-0.15%	0.67%	-10.75%	0.53%

**中债综合指数(C)**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-11.12%	12.2%	-0.15%	0.67%	-10.97%	0.55%

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期 2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日	本报告期初至本报告期末	本报告期初至本报告期末
1.本期利润总额	-	-16,971,289.50	-	-26,489.94
2.本期净利润	-	-17,164,799.46	-	-27,184.84
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.1203	-	-0.0785
4.期末基金资产净值	-	113,867,509.89	-	220,183.65
5.期末基金份额净值	-	0.7927	-	0.9955

### 3.2 基金净值表现

**32.1 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**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-19.00%	12.0%	-0.15%	0.67%	-10.75%	0.53%

**中债综合指数(C)**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-11.12%	12.2%	-0.15%	0.67%	-10.97%	0.55%

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期 2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日	本报告期初至本报告期末	本报告期初至本报告期末
1.本期利润总额	-	-16,971,289.50	-	-26,489.94
2.本期净利润	-	-17,164,799.46	-	-27,184.84
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.1203	-	-0.0785
4.期末基金资产净值	-	113,867,509.89	-	220,183.65
5.期末基金份额净值	-	0.7927	-	0.9955

### 3.2 基金净值表现

**32.1 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**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-19.00%	12.0%	-0.15%	0.67%	-10.75%	0.53%

**中债综合指数(C)**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-11.12%	12.2%	-0.15%	0.67%	-10.97%	0.55%

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期 2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日	本报告期初至本报告期末	本报告期初至本报告期末
1.本期利润总额	-	-16,971,289.50	-	-26,489.94
2.本期净利润	-	-17,164,799.46	-	-27,184.84
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.1203	-	-0.0785
4.期末基金资产净值	-	113,867,509.89	-	220,183.65
5.期末基金份额净值	-	0.7927	-	0.9955

### 3.2 基金净值表现

**32.1 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**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-19.00%	12.0%	-0.15%	0.67%	-10.75%	0.53%

**中债综合指数(C)**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-11.12%	12.2%	-0.15%	0.67%	-10.97%	0.55%

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期 2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日	本报告期初至本报告期末	本报告期初至本报告期末
1.本期利润总额	-	-16,971,289.50	-	-26,489.94
2.本期净利润	-	-17,164,799.46	-	-27,184.84
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.1203	-	-0.0785
4.期末基金资产净值	-	113,867,509.89	-	220,183.65
5.期末基金份额净值	-	0.7927	-	0.9955

### 3.2 基金净值表现

**32.1 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**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-19.00%	12.0%	-0.15%	0.67%	-10.75%	0.53%

**中债综合指数(C)**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-11.12%	12.2%	-0.15%	0.67%	-10.97%	0.55%

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期 2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日	本报告期初至本报告期末	本报告期初至本报告期末
1.本期利润总额	-	-16,971,289.50	-	-26,489.94
2.本期净利润	-	-17,164,799.46	-	-27,184.84
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.1203	-	-0.0785
4.期末基金资产净值	-	113,867,509.89	-	220,183.65
5.期末基金份额净值	-	0.7927	-	0.9955

### 3.2 基金净值表现

**32.1 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**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-19.00%	12.0%	-0.15%	0.67%	-10.75%	0.53%

**中债综合指数(C)**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-11.12%	12.2%	-0.15%	0.67%	-10.97%	0.55%

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期 2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日	本报告期初至本报告期末	本报告期初至本报告期末
1.本期利润总额	-	-16,971,289.50	-	-26,489.94
2.本期净利润	-	-17,164,799.46	-	-27,184.84
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.1203	-	-0.0785
4.期末基金资产净值	-	113,867,509.89	-	220,183.65
5.期末基金份额净值	-	0.7927	-	0.9955

### 3.2 基金净值表现

**32.1 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**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-19.00%	12.0%	-0.15%	0.67%	-10.75%	0.53%

**中债综合指数(C)**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-11.12%	12.2%	-0.15%	0.67%	-10.97%	0.55%

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期 2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日	本报告期初至本报告期末	本报告期初至本报告期末
1.本期利润总额	-	-16,971,289.50	-	-26,489.94
2.本期净利润	-	-17,164,799.46	-	-27,184.84
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.1203	-	-0.0785
4.期末基金资产净值	-	113,867,509.89	-	220,183.65
5.期末基金份额净值	-	0.7927	-	0.9955

### 3.2 基金净值表现

**32.1 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**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-19.00%	12.0%	-0.15%	0.67%	-10.75%	0.53%

**中债综合指数(C)**

基金份额		净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	①-③	
过去三个月	-11.12%	12.2%	-0.15%	0.67%	-10.97%	0.55%

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期 2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日	本报告期初至本报告期末	本报告期初至本报告期末
1.本期利润总额	-	-16,971,289.50	-	-26,489.94
2.本期净利润	-	-17,164,799.46	-	-27,184.84
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.1203	-	-0.0785
4.期末基金资产净值	-	113,867,509.89	-	220,183.65
5.期末基金份额净值	-	0.7927	-	0.9955

### 3.2 基金净值表现