中金浙金6个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:中金基金管理有限公司
基金托管人:浙商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月22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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月21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。

本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或超过50%,本基金不向个人投资者销售。

本报告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金浙金
基金主代码	006096
交易代码	006096
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2018年6月21日
报告期末基金份额总额	1,010,000,000.00份
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	1.债券类属配置策略 本基金将根据对政府债券、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,确定债券类属配置策略,并根据市场变化及时进行调整,从而选择既能匹配目标久期、同时又能获得较高持有期收益的类属债券配置比例。 2.久期管理策略 本基金将根据对利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益,在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。 3.收益率曲线策略 本基金资产组合中的长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上,将结合收益率曲线变化的预期,适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合,并进行动态调整。 4.信用债券投资策略 本基金将主要通过买入并持有信用风险可承担、期限与收益率相对合理的信用债券产品,获取票息收益。此外,本基金还将通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断,主动采用信用利差投资策略,获取利差收益。 5.中小企业私募债券投资策略 由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易,并限制投资者数量上限,整体流动性相对较差。同时,受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响,整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中,应采取更为谨慎的投资策略。 本基金将分析和跟踪该类债券发债主体的信用基本面,并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素,确定最终的投资决策。作为开放式基金,本基金将严格控制该类债券占基金净资产的比例,对于有一定信用风险隐患的个券,基于流动性风险的考虑,本基金将及时减仓。 6.国债期货投资策略 本基金投资国债期货,以套期保值为主要目的,将根据风险管理的原则,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。 此外,在严格控制风险的前提下,本基金将适度参与回购交易等投资,以增加收益。 7.资产支持证券投资策略 本基金将持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展,将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,制定周密的投资策略。在具体投资过程中,重点关注标的证券发行条款、基础资产的类型,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响,加强对未来现金流稳定性的分析。本基金将严格控制资产支持证券的总量规模,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,实现资产支持证券对基金资产的最优贡献。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司

§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

主要财务指标	报告期(2018年10月17日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	18,887,433.91
2.本期利润	29,016,098.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.0287
4.期末基金资产净值	1,056,763,514.19
5.期末基金份额净值	1.0463

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;

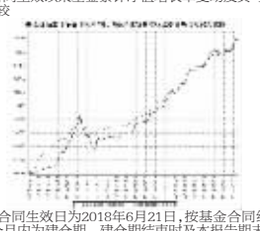
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	2.82%	0.07%	2.67%	0.05%	0.15%	0.02%

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变动的比较



本基金的基金合同生效日为2018年6月21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,建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石玉	本基金的基金经理	2018年6月21日	-	11年	石玉女士,管理学硕士。历任中国科技证券、联合证券职员,天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员,中国国际金融股份有限公司资产管理部高级研究员、基金经理助理,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。

1、本基金基金经理的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 管理人对投资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》和其他有关法律法规及本基金合同的约定,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,在严格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 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,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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年四季度的宏观基本面继续整体利于债券市场,通胀数据、社融数据及经济数据较弱,10月份以来地方债供给压力消退,央行定向降准,叠加市场一致看多担心踏空风险,债市收益率走低。四季度资金面波动较三季度小幅增加,12月底受跨年影响资金市场利率达到全年最高。中债-新综合财富(总值)指数四季度上涨2.66%。

本基金是一个封闭式纯债型基金,投资策略上以高等级债券为主要配资资产,以降低信用风险对组合的影响。基于对债券市场乐观的预期,本组合在四季度积极配置并进行了波段操作。

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1.0463元;本报告期基金份额净值增长率为2.82%,业绩比较基准收益率为2.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金,截止本报告期末,本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,258,553,987.40	78.30
	其中:债券	1,258,553,987.40	78.30
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	21,120,151.68	1.31
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	153,290,462.48	9.54
8	其他资产	174,291,081.66	10.84
9	合计	1,607,255,683.22	100.00

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

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金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

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	32,019,000.00	3.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	459,782,987.40	43.51
	其中:政策性金融债	459,782,987.40	43.51
4	企业债券	81,703,000.00	7.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	685,049,000.00	64.83
10	合计	1,258,553,987.40	119.10

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130222	13国开22	1,500,000	154,485,000.00	14.62
2	140808	17山东09	1,000,000	102,590,000.00	9.71
3	140775	17厦门05	1,000,000	102,110,000.00	9.66
4	140156	16北京02	1,000,000	98,670,000.00	9.34
5	147854	18福建01	800,000	80,784,000.00	7.64

5.6 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。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	91,661.65
2	应收证券清算款	149,563,082.15
3	应收股利	-
4	应收利息	24,636,337.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	174,291,081.66

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,010,000,000.00
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,010,000,000.00

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.99

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.99	10,000,000.00	0.99	自基金合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.99	10,000,000.00	0.99	-

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年10月1日至2018年12月31日	1,000,000,000.00	0.00	0.00	1,000,000,000.00	99.01%

产品持有风险

(1)定期开放运作的风险

本基金以定期开放方式运作且不上市交易,投资者仅可在开放运作期申赎基金份额,在封闭运作期内无法申购赎回。若投资者在开放运作期未赎回基金份额,则需继续持有至下一封闭运作期结束才能赎回,投资者在封闭运作期内存在无法赎回基金份额的风险。

(2)单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额可达到或者超过50%的风险

本基金单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额可达到或者超过50%,单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者大额赎回时,可能会对本基金资产运作及净值表现产生较大影响。且相对于其他基金,本基金更可能因开放期内单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者集中大额赎回发生巨额赎回。当发生巨额赎回时,基金管理人可能根据基金当时的资产组合状况决定延缓支付赎回款,投资者面临赎回款被延缓支付的风险。

(3)基金资产投资特定品种可能引起的风险

a.国债期货投资风险

本基金资产组合特有的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一,是指由于期货与现货间的价差的波动,影响套期保值效果,使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类:一类为流通量风险,是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险,此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的;另一类为资金量风险,是指资金量无法满足保证金要求,使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

b.资产支持证券投资风险

本基金投资品种包含资产支持证券品种,由于资产支持证券一般都针对特定机构投资人发行,且仅在特定机构投资人范围内流通转让,该品种的流动性较差,且抵押资产的流动性较差,因此,持有资产支持证券可能给组合资产净值带来一定的风险。另外,资产支持证券还面临提前偿还和延期支付的风险。

c.中小企业私募债券投资风险

本基金投资品种包含中小企业私募债券,中小企业私募债券是由非上市公司采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易,一般情况下,受市场流动性所限,本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

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浙金6个月定期开放债券型发起式证券投资基金募集注册的文件

2、《中金浙金6个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》

3、《中金浙金6个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》

4、中金浙金6个月定期开放债券型发起式证券投资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、报告期内中金浙金6个月定期开放债券型发起式证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

7、基金托管人业务资格批复、营业执照

8、中国证监会要求的其他文件

10.2 存放地点

备查文件1-6及备查文件8存放于基金管理人的住所,备查文件7存放于基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

投资者可在基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人。

咨询电话:(86)010-63211122 400-868-1166

传真:(86)010-66159121

中金基金管理有限公司
2019年1月22日

中金MSCI中国A股国际低波动指数发起式证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:中金基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司
报告送出日期:2019年1月22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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月21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。

本报告期自2018年10月17日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金MSCI低波动
基金主代码	006343
交易代码	006343
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年10月17日
报告期末基金份额总额	12,491,997.75份
投资目标	本基金跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法,按照标的指数的成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	MSCI中国A股国际低波动指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型证券投资基金和混合型证券投资基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
下属分级基金的基金简称	中金MSCI低波动A / 中金MSCI低波动C
下属分级基金的交易代码	006343 / 006344
报告期末下属分级基金的份额总额	12,367,157.73份 / 124,840.02份

§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

主要财务指标	报告期(2018年10月17日-2018年12月31日)	
	中金MSCI低波动A	中金MSCI低波动C
1. 本期已实现收益	10,515.01	11,791.46
2. 本期利润	-294,802.44	37,219.44
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0279	0.0044
4. 期末基金资产净值	12,068,012.27	122,017.34
5. 期末基金份额净值	0.9758	0.9774

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。

3.2 基金净值表现

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

中金MSCI低波动A

阶段	净值增长率①	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
2018年10月17日至2018年12月31日	-2.42%	0.90%	-1.52%	1.26%	-0.90%	-0.36%

中金MSCI低波动C

阶段	净值增长率①	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
2018年10月17日至2018年12月31日	-2.26%	0.90%	-1.52%	1.26%	-0.74%	-0.36%

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变动的比较

本基金的基金合同生效日为2018年10月17日,按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期,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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱宝臣	本基金的基金经理	2018年10月17日	-	11年	朱宝臣先生,计算科学硕士。2008年10月加入中国国际金融股份有限公司,历任资产管理部投资经理、量化投资监控;2017年10月加入中金基金,现任中金基金量化投资团队负责人。

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

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》、《基金合同和其他有关法律法规,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,在严格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 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,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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年四季度的宏观基本面继续整体利于债券市场,通胀数据、社融数据及经济数据较弱,10月份以来地方债供给压力消退,央行定向降准,叠加市场一致看多担心踏空风险,债市收益率走低。四季度资金面波动较三季度小幅增加,12月底受跨年影响资金市场利率达到全年最高。中债-新综合财富(总值)指数四季度上涨2.66%。

本基金是一个封闭式纯债型基金,投资策略上以高等级债券为主要配资资产,以降低信用风险对组合的影响。基于对债券市场乐观的预期,本组合在四季度积极配置并进行了波段操作。

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1.0463元;本报告期基金份额净值增长率为2.82%,业绩比较基准收益率为2.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金,截止本报告期末,本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

§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	11,549,714.17	91.90
	其中:股票	11,549,714.17	91.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	733,997.00	5.84
	其中:债券	733,997.00	5.84
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	137,665.41	1.10
8	其他资产	146,506.00	1.17
9	合计	12,567,882.58	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	5,992.00	0.05
B	采矿业	614,026.00	5.04
C	制造业	4,391,094.00	36.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,046,490.00	8.58
E	建筑业	43,665.00	0.36
F	批发和零售业	286,328.00	2.35
G	交通运输、仓储和邮政业	523,531.00	4.29
H	住宿和餐饮业	9,576.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,320.00	0.31
J	金融业	3,651,050.17	29.95
K	房地产业	243,228.00	2.00
L	租赁和商务服务业	127,300.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	23,111.00	0.19
	合计	11,012,461.17	90.34

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	205,424.00	1.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	25,448.00	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	306,381.00	2.51
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	537,253.00	4.41

5.2.3 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。

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

5.3.1 报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	24,500	389,060.00	3.19
2	601166	兴业银行	22,700	339,138.00	2.78
3	600016	民生银行	58,380	334,517.40	2.74
4	601169	北京银行	58,600	328,746.00	2.70
5	600886	国投电力	40,800	328,440.00	2.69
6	601328	交通银行	52,900	306,291.00	2.51
7	000876	新希望	38,200	278,096.00	2.28
8	600000	浦发银行	26,400	258,720.00	2.12
9	601288	农业银行	64,500	232,200.00	1.90
10	601939	建设银行	35,200	224,224.00	1.84

5.3.2 报告期末积极投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601229	上海银行	11,100	124,209.00	1.02
2	603288	海天味业	1,700	116,960.00	0.96
3	000333	美的集团	2,400	88,464.00	0.73
4	600919	江苏银行	12,000	71,640.00	0.59
5	601997	贵阳银行	6,400	68,352.00	0.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	26,031.20	0.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	707,965.80	5.81
	其中:政策性金融债	707,965.80	5.81
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	733,997.00	6.02

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018002	国开1302	5,500	550,275.00	4.51
2	018005	国开1701	1,570	157,690.80	1.29
3	019602	18国债10	260	26,031.20	0.21

5.6 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。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,885.75
2	应收证券清算款	99,740.82
3	应收股利	-
4	应收利息	36,879.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	146,506.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金积极投资的前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中金MSCI低波动A	中金MSCI低波动C
基金合同生效日(2018年10月17日)基金份额总额	10,236,943.81	44,267,417.71
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	2,228,871.71	59,286.29
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	98,657.79	44,201,863.98
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)	-	-
报告期期末基金份额总额	12,367,157.73	124,840.02

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	10,000,000.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	80.05

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	认购	2018年10月15日	10,000,000.00	10,000,000.00