中融量化小盘股票型发起式证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2019年03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。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年03月20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。

本报告中的财务资料经审计,上会会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中融量化小盘股票	
基金主代码	004272	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年06月17日	
基金管理人	中融基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	23,801,366.73份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中融量化小盘股票A	中融量化小盘股票C
下属分级基金的交易代码	004272	004273
报告期末下属分级基金的份额总额	21,659,195.93份	2,142,170.80份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用数量化的投资方法精选个股,严格按照纪律执行,力争长期稳定地获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1. 资产配置策略 2. 股票投资策略 (1)多因子选股模型 (2)投资组合优化策略 (3)事件投资策略 3. 债券投资策略 4. 中小企业私募债券投资策略 5. 资产支持证券投资策略 6. 股指期货投资策略 7. 现金管理策略 8. 权证投资策略
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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		中融基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周铁云	王永民
	联系电话	010-56517129	010-66594896
	电子邮箱	zhoutieyun@zrfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-160-6000;010-56517299	95566
传真		010-56517001	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zrfunds.com.cn/
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
注册登记机构	中融基金管理有限公司	北京市朝阳区东风南路3号院中国台托北京国际区C座4层、5层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年		2017年5月17日(基金合同生效日)-2017年12月31日	
	中融量化小盘股票A	中融量化小盘股票C	中融量化小盘股票A	中融量化小盘股票C
本期已实现收益	-6,406,367.99	-679,148.91	6,594,620.59	729,302.70
本期利润	-7,389,968.02	-757,527.71	7,289,244.33	811,397.50
加权平均基金份额本期利润	-0.3249	-0.3219	0.1257	0.0213
3.1.2 期末数据和指标	期末		期末	
期末可供分配基金份额利润	0.7202	0.7135	1.0517	1.0460
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000

注:所述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;

2.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;

3.期末可供分配利润为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的孰低数。

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

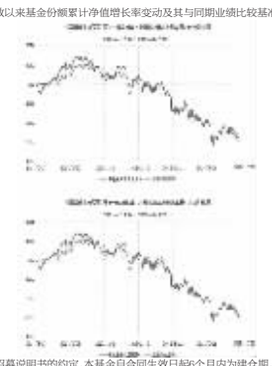
中融量化小盘股票A

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
过去三个月	-11.62%	1.66%	-12.52%	1.74%	0.90%	-0.08%
过去六个月	-18.58%	1.46%	-19.15%	1.50%	0.57%	-0.04%
过去一年	-31.52%	1.43%	-31.85%	1.43%	0.33%	0.00%
自基金合同生效起至今	-27.98%	1.26%	-29.28%	1.26%	1.30%	0.00%

中融量化小盘股票C

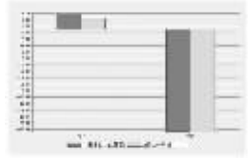
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.70%	1.66%	-12.52%	1.74%	0.82%	-0.08%
过去六个月	-18.74%	1.46%	-19.15%	1.50%	0.41%	-0.04%
过去一年	-31.79%	1.43%	-31.85%	1.43%	0.06%	0.00%
自基金合同生效起至今	-29.65%	1.26%	-29.28%	1.26%	0.63%	0.00%

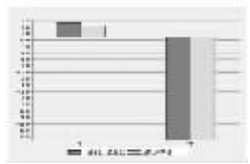
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注:本基金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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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

本基金管理人为中融基金管理有限公司,成立于2013年5月31日,由中融国际信托有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资,注册资金115亿元人民币。

截至2018年12月31日,中融基金管理有限公司共管理46只基金,包括中融增鑫一年定期开放债券型证券投资基金、中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金、中融中证银行指数分级证券投资基金、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金、中融中证煤炭指数分级证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融鑫视野灵活配置混合型证券投资基金、中融稳健添利债券型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融融裕双利债券型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融融信双盈债券型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融上海满算所银行间1-3年高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上海满算所银行间3-5年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上海满算所银行间0-1年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上海满算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融量化多因子混合型发起式证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融盈泽债券型证券投资基金、中融量化小盘股票型发起式证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金(FOF)、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融季季红3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金。

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		
赵菲	中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金、中融中证银行指数分级证券投资基金、中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金、中融中证煤炭指数分级证券投资基金、中融量化多因子混合型发起式证券投资基金、中融量化小盘股票型发起式证券投资基金、中融量化多因子混合型发起式证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金(FOF)的投资决策小组成员,投资部总监,基金经理助理,现任公司固定收益部总监,现任公司投资决策委员会委员,现任公司投资决策委员会主席,现任公司固定收益部总监,现任公司投资决策委员会委员,现任公司投资决策委员会委员,现任公司投资决策委员会委员