中金消费升级股票型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月23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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金消费升级
基金主代码	001193
交易代码	001193
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月24日
报告期末基金份额总额	610,363,213.42份
投资目标	本基金通过深入研究并积极投资消费升级相关的优质公司,在有效控制下行风险的前提下,力争实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略包含大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略和权证投资策略。本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。其中股票投资策略包含消费升级行业的界定,消费升级行业配置策略和个股投资策略。
业绩比较基准	中证主要消费指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
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、债券基金、混合型基金,属于高预期风险和高预期收益的证券投资基金。
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

§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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-93,086,747.87
2.本期利润	-96,738,716.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1463
4.期末基金资产净值	506,660,496.92
5.期末基金份额净值	0.830

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;

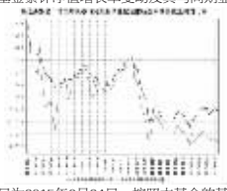
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-14.70%	1.66%	-20.08%	2.77%	5.38%	-1.11%

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



注:本基金的基金合同生效日为2015年6月24日。按照本基金的基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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		
郭竞钰	中金消费升级股票型证券投资基金基金经理	2015年6月24日	-	14	郭竞钰先生,工商管理硕士。历任宁波镇海炼化投资经理;华泰证券项目经理;德恒证券高级经理;华策投资有限公司投资副总经理;招商基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部执行总经理。

注:注:1、任职日期说明:任职日期为基金合同生效日

2、证券从业年限的计算标准: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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定和《中金消费升级股票型证券投资基金基金合同》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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,无损害基金份额持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

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,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规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金自6月24日成立以来,恰逢市场开始调整,初始投资标的以互联网金融、医药、国企改革消费股为主,建仓四分之一左右,之后6月下旬和7月初在千股跌停的极端市场环境下,考虑流动性需求,没有大幅度增加仓位,但受市场大幅下跌影响,净值有所损失。9月份,判断市场进入可投资区间,开始逐步增加仓位。

我们后续的投资依然聚焦在经济转型及消费升级相关的成长股上,重点看好信息、文化娱乐及医疗服务等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-14.70%,同期业绩比较基准收益率为-20.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,短期来看,2015年四季度,在经历6、7、8三个月的大幅下跌后,9月底杠杆清理工作完毕,系统性风险得到较大释放,市场进入修复期,逐步进入市场常态。

中期来看,我们对市场看法相对积极,第一,宏观层面,经济下行压力大的前提下,货币不会收缩。第二,企业盈利,从三季度和上半年情况分析,优质成长股的增长尚可,个别甚至比较突出。第三,政策层面,即将召开的五中全会,在稳增长和调结构方面预计还有后续的支持政策。

从长期角度分析,本届政府充分认识到改革及创新对于中国未来经济增长的重要性,预期中国将通过技术创新、制度改革、效率提高从而实现经济的最终转型。

策略上,我们依然坚持稳增长只能托底,调结构求转型才是大趋势,因此获得长期超额收益依然需要以转型经济作为主线条,重点看好信息消费、互联网金融、医疗服务、文化传媒等消费升级方向个股。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	205,976,695.28	40.20
	其中:股票	205,976,695.28	40.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	257,100,000.00	50.18
	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	48,885,608.32	9.54
8	其他资产	375,833.78	0.07
9	合计	512,338,137.38	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	采矿业	-	-
C	制造业	99,033,603.28	19.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,083,512.02	1.40
E	建筑业	17,079,956.40	3.37
F	批发和零售业	37,299,635.36	7.36
G	交通运输、仓储和邮政业	5,287,747.50	1.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,298,789.97	5.39
J	金融业	-	-
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	5,014,788.35	0.99
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	7,878,662.40	1.56
S	综合	-	-
	合计	205,976,695.28	40.65

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

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	300273	和佳股份	1,217,828	23,491,902.12	4.64
2	300170	汉得信息	1,149,798	17,729,885.16	3.50
3	002081	金 螳 螂	1,298,856	17,079,956.40	3.37
4	300043	互动娱乐	1,209,498	16,920,877.02	3.34
5	000910	大亚科技	926,723	14,938,774.76	2.95
6	600963	岳阳林纸	2,195,270	14,730,261.70	2.91
7	000963	华东医药	173,985	12,152,852.25	2.40
8	000417	合肥百货	1,307,649	10,931,945.64	2.16
9	002462	嘉事堂	295,426	10,836,225.68	2.14
10	300124	汇川技术	221,842	7,921,977.82	1.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本报告期末,本基金未持有债券。

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

注:注:本报告期末,本基金未持有债券。

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

注:本报告期末,本基金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

注:本报告期末,本基金未持有贵金属。

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

注:本报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本报告期末,本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本报告期末,本基金未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本报告期末,本基金未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本报告期末,本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本报告期末,本基金未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	298,114.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	76,240.09
5	应收申购款	1,479.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	375,833.78

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

注:报告期末,本基金持有前十名股票未出现流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	694,717,196.35
报告期期间基金总申购份额	2,247,210.89
减:报告期期间基金总赎回份额	86,601,193.82
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	610,363,213.42

§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

注:本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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。

§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消费升级股票型证券投资基金募集注册的文件

2、《中金消费升级股票型证券投资基金基金合同》

3、《中金消费升级股票型证券投资基金托管协议》

4、基金管理人业务资格批复、营业执照

5、报告期内中金消费升级股票型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

6、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中金基金管理有限公司。

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
2015年10月23日

中金现金管家货币市场基金

【2015】第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月23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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金现金管家	
基金主代码	000882	
交易代码	000882	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年11月28日	
报告期末基金份额总额	1,238,631,622.61份	
投资目标	在保障基金资产的安全性和流动性的前提下,通过积极主动管理,力争实现超越业绩比较基准的稳定收益。	
投资策略	根据对宏观经济指标、货币政策、市场结构变化等因素的研究与分析,对未来一段时期短期市场利率进行判断,对短期利率走势形成合理预期,并据此调整基金资产的配置策略。通过对市场资金供求,基金申赎情况进行动态分析,确定本基金流动性目标,相应调整基金资产在高流动性资产和相对流动性较低资产之间的配比,并根据对短期利率走势的判断确定并调整组合的平均剩余期限。在充分论证银行间市场和交易所市场套利机会可行性基础上,寻找最佳介入时机,进行跨市场操作,获得安全的超额收益。在遵循流动性优先的原则下,建立流动性预警指标,并通过现金库存、资产变现、剩余期限管理等措施确保基金资产的整体变现能力。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中金现金管家A类	中金现金管家B类
下属分级基金的交易代码	000882	000883
报告期末下属分级基金的份额总额	18,457,664.26份	1,220,173,968.35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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)	
	中金现金管家A类	中金现金管家B类
1. 本期已实现收益	119,537.13	5,268,416.21
2. 本期利润	119,537.13	5,268,416.21
3. 期末基金资产净值	18,457,664.26	1,220,173,968.35

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金现金管家A类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6529%	0.0069%	0.3403%	0.0000%	0.3126%	0.0069%

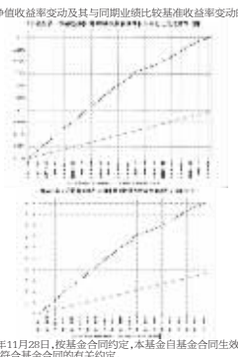
注:本基金收益分配按日结转份额。

中金现金管家B类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7137%	0.0069%	0.3403%	0.0000%	0.3734%	0.0069%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金的基金合同生效日为2014年11月28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		
石云峰	本基金的基金经理	2014年11月28日	-	8	石云峰先生,经济学硕士。历任中国邮政储蓄银行总行资金营运部交易员,太平养老保险股份有限公司固定收益投资经理,嘉实基金管理有限公司机构投资部投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理,2014年11月4日起任中金纯债债券型证券投资基金基金经理。

注:1、任职日期说明:任职日期为基金合同生效日

2、证券从业年限的计算标准: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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定和《中金现金管家货币市场基金基金合同》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在保障基金资产的安全性和流动性的前提下,通过积极主动管理,力争实现超越业绩比较基准的稳定收益在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

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,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规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,国内经济依然面临较大的下行压力,货币政策对实体经济的传导较慢,宏观经济数据持续低于预期。工业增加值同比增速由6月份的6.8%下降到7月的6%,8月份为6.1%。通胀数据表现为先上后下,CPI同比数据回升到8月份的1.96%,9月份回落至1.6%的水平,而7月、8月和9月PPI跌幅扩大为-5.73%、-5.92%和-5.9%,工业通缩压力较大。

2015年8月11日,中国人民银行宣布团日起完善人民币汇率中间价报价机制,人民币出现一定贬值,外汇占款有所下降,为此人民银行在9月初下调0.5%存款准备金率。总体来看,货币政策总体延续适度宽松的基调,但受到外汇占款下降的影响,三季度货金利率较6月份有所提高,但远低于上半年平均水平。

市场表现方面,受到外汇占款减少的影响,银行间货币市场利率较6月份有所反弹,但比较平稳,短期债券收益率呈现先下后上的态势。其中,银行间七天回购加权利率除7月初较高之外,基本稳定在2.3-2.6%的水平,银行间1年期AAA短融收益率由6月底的3.4%左右的水平下降到8月初3%左右,随后反弹,三季度末在3.3%左右。

操作方面,报告期内本基金秉持稳健投资原则,谨慎操作,以确保组合安全性和流动性为首要任务的基础上,灵活配置短期债券、同业存款和逆回购。在三季度债券收益率逐步走低的情况下,适当降低了债券的占比。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期A类基金份额净值收益率为0.6529%,B类基金份额净值收益率为0.7137%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,宏观经济、货币政策和资金面仍将是影响货币市场的主要因素。海外方面,美国经济温和复苏,但并非预期中的那么强,市场对其12月份加息也开始有所分歧,新兴市场压力持续存在,预期四季度有所缓解。国内经济方面,经济仍在探底过程中,央行货币政策仍将适度宽松,预计稳增长的措施仍会出台托底经济。与此同时,通胀仍然会在低位运行,这也为货币政策持续宽松创造了条件。

预计四季度在宏观经济仍然低迷,外汇逐步稳定的情形下,债券市场走强的概率较大。我们关注稳增长政策的力度以及海外市场的走势,预计这两个因素会对四季度货币市场和债券市场产生较深的影响。另外,我们持续关注信用风险事件,部分周期性行业低等级信用债需要高度警惕。

本基金将继续本着稳健投资的原则,以确保组合安全性和流动性为首要任务,兼顾收益性,密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况,平衡配置同业存款和债券投资,保持合理流动性资产配置,努力为投资人创造安全稳定的收益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	320,394,453.64	25.86
	其中:债券	320,394,453.64	25.86
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	470,001,425.00	37.93
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	444,471,647.14	35.87
4	其他资产	4,264,065.02	0.34
5	合计	1,239,131,590.80	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		0.23
	其中:买断式回购融资		0.00
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内,本货币市场基金未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	81
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	19

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内本理财基金投资组合平均剩余期限未超过120 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	72.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	7.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	5.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	14.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.70	-

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,339,137.15	6.49
	其中:政策性金融债	80,339,137.15	6.49
4	企业债券	240,055,316.49	19.38
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	320,394,453.64	25.87
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130219	13国开19	500,000	50,243,896.94	4.06
2	150211	15国开11	300,000	30,095,240.21	2.43
3	011503003	15中石化SCP003	300,000	30,002,015.54	2.42
4	011599089	15山钢SCP002	200,000	20,067,913.16	1.62
5	041454064	14鞍钢股CP001	200,000	20,021,087.19	1.62
6	011590008	15苏交通SCP008	200,000	20,000,138.85	1.61
7	011599559	15厦国贸SCP006	200,000	19,998,952.54	1.61
8	011570009	15赣高速SCP009	200,000	19,994,975.43	1.61
9	011599555	15京能洁能SCP004	200,000	19,994,160.73	1.61
10	041560028	15鄂西圈CP001	100,000	10,001,515.67	0.81

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	8
报告期内偏离度的最高值	0.3872%
报告期内偏离度的最低值	0.0633%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1430%

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十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

5.8.2

本报告期内本基金没有出现持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3

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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	4,262,065.02
4	应收申购款	2,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,264,065.02

5.8.5 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

项目	中金现金管家A类	中金现金管家B类
报告期期初基金份额总额	16,147,179.45	1,423,826,538.02
报告期期间基金总申购份额	29,314,854.40	1,496,216,323.92
减:报告期期间基金总赎回份额	27,004,369.59	1,699,868,903.59
报告期期末基金份额总额	18,457,664.26	1,220,173,958.35

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;基金总赎回份额含转换出份额。

§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
05	红利再投资	2015年9月30日	81,653.10	81,653.10	0.0000%
04	红利再投资	2015年8月31日	107,936.00	107,936.00	0.0000%
03	红利再投资	2015年7月31日	95,628.28	95,628.28	0.0000%
02	赎回	2015年7月24日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.0000%
01	申购	2015年7月8日	40,000,000.00	40,000,000.00	0.0000%
合计			50,285,217.38	50,285,217.38	

注:基金管理人按照《中金现金管家货币市场基金基金合同》、《中金现金管家货币市场基金招募说明书》的约定费率于2014年11月24日通过中金基金管理有限公司直销中心认购本基金,认购份额共计10,000,450份。

§8 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。

§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现金管家货币市场基金募集注册的文件

2、《中金现金管家货币市场基金基金合同》

3、《中金现金管家货币市场基金托管协议》

4、基金管理人业务资格批复、营业执照

5、报告期内中金现金管家货币市场基金在指定媒介上披露的各项公告

6、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中金基金管理有限公司。

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
2015年10月23日

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

【2015】第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月23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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金绝对收益
基金主代码	001059
交易代码	001059
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2015年4月21日
报告期末基金份额总额	709,513,460.11份
投资目标	本基金灵活应用多种绝对收益策略对冲本基金的系统性风险,寻求基金资产的长期稳健增值,以期实现超越业绩比较基准的绝对收益。
投资策略	本基金采用市场中性策略为主的多种绝对收益策略剥离系统风险,力争实现基金资产长期稳定的绝对回报。其中,市场中性策略包括量化选股策略和期货对冲策略两大策略。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款收益率。
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金,通过多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险,实现基金资产的保值增值。因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。
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

§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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-4,191,412.14
2.本期利润	-7,952,449.07
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0112
4.期末基金资产净值	742,778,332.63
5.期末基金份额净值	1.047

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;

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	1.04%	0.16%	0.63%	0.01%	1.67%	0.15%

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