

# 中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 30 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 29 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，毕马威华振会计师事务所（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。

本报告期自 2017 年 7 月 7 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中金丰颐	
基金主代码	004714	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 7 月 7 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	193,178,002.57 份	
下属分级基金的基金简称:	中金丰颐 A	中金丰颐 C
下属分级基金的交易代码:	004714	004715
报告期末下属分级基金的份额总额	193,050,815.37 份	127,187.20 份

### 2.2 基金产品说明

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	本基金使用资产的配置策略在债券及股票之间进行资产配置。债券部分的投资通过对于期限、久期、流动性和收益的管理，尽量做到满足流动性要求的前提下提高收益和安全性。股票部分的投资借助于量化的投资模型进行选股，严格按照模型进行投资，强调投资的纪律，降低随意性投资带来的风险。同时进行股票的打新操作，增强收益，力争基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 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		中金基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李虹	方琦
	联系电话	010-63211122	0755-22160168
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95511-3
传真		010-66159121	0755-82080387

### 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	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
---------------------	---

---

基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所
------------	----------------

## § 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	2017 年 7 月 7 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日	
	中金丰颐 A	中金丰颐 C
本期已实现收益	4,113,066.79	560.10
本期利润	9,397,477.25	464.98
加权平均基金份额本期利润	0.0483	0.0148
本期基金份额净值增长率	4.86%	4.75%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0212	0.0202
期末基金资产净值	202,434,533.25	133,233.41
期末基金份额净值	1.0486	1.0475

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、期末可供分配利润采用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孰低数；

4、本基金合同于 2017 年 7 月 7 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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

中金丰颐 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	3.23%	0.28%	2.33%	0.40%	0.90%	-0.12%
自基金合同生效起至今	4.86%	0.26%	5.15%	0.35%	-0.29%	-0.09%

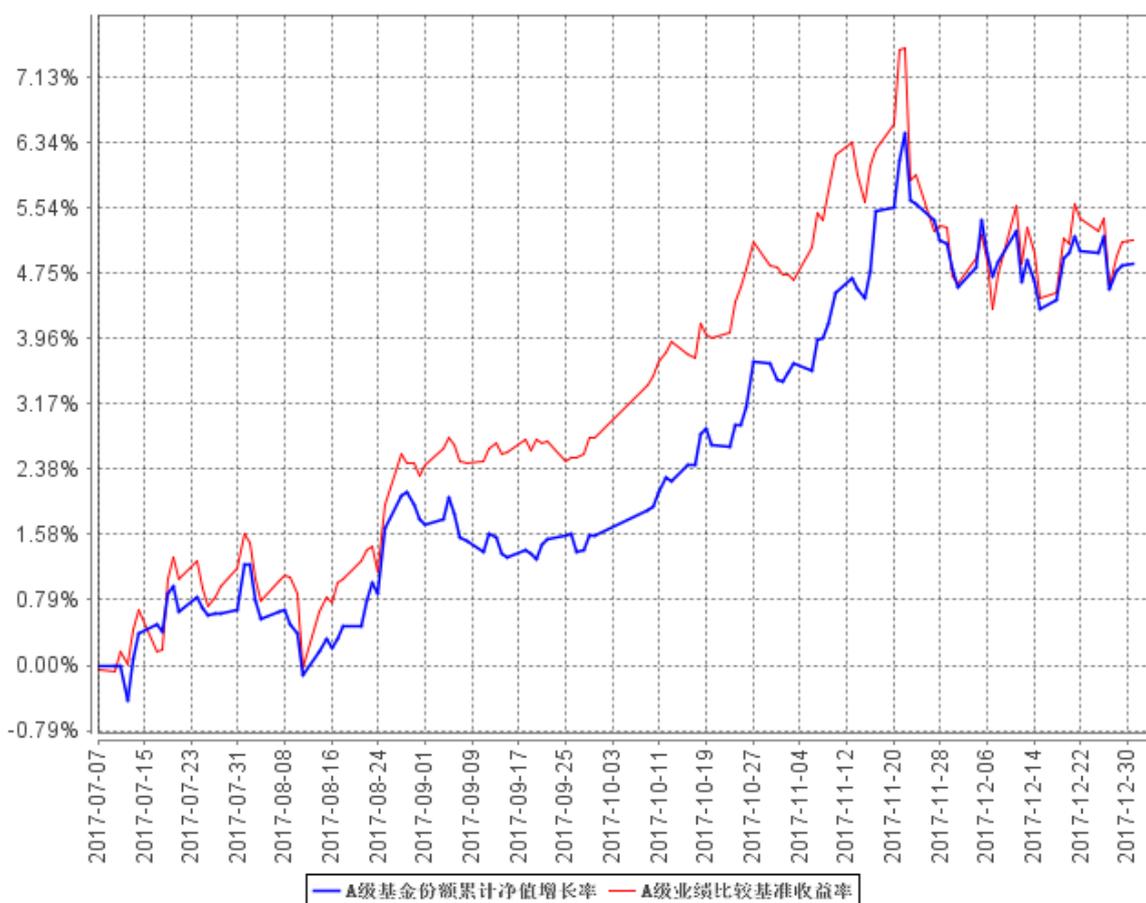
中金丰颐 C

阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

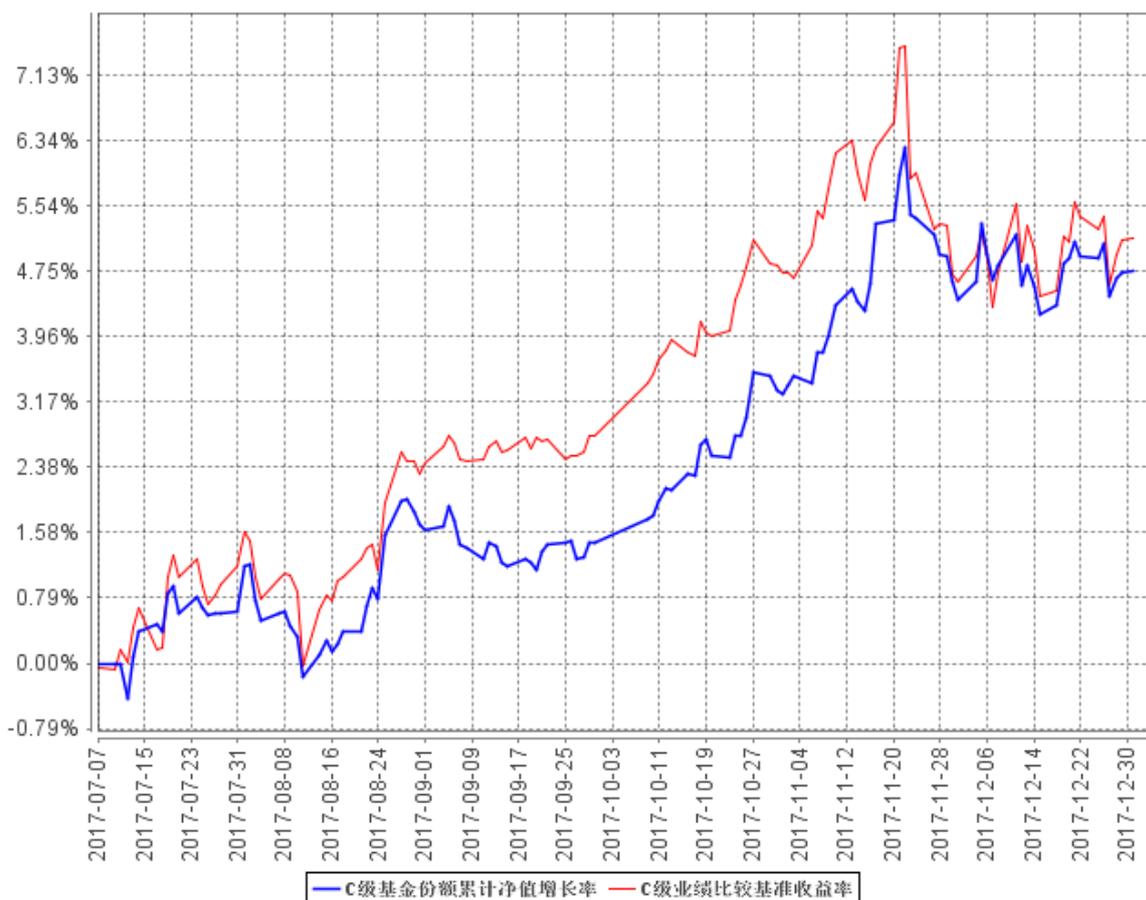
	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	3.23%	0.29%	2.33%	0.40%	0.90%	-0.11%
自基金合同生效起至今	4.75%	0.26%	5.15%	0.35%	-0.40%	-0.09%

### 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



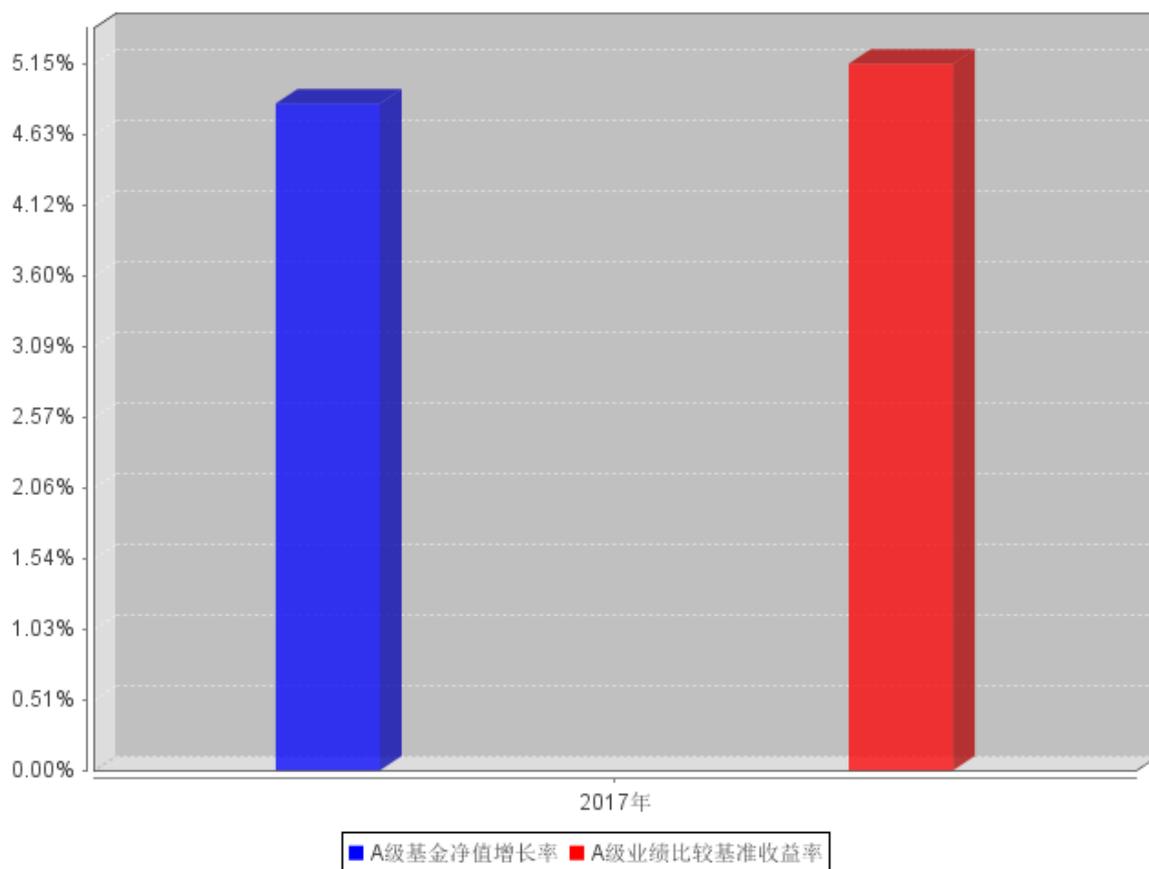
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



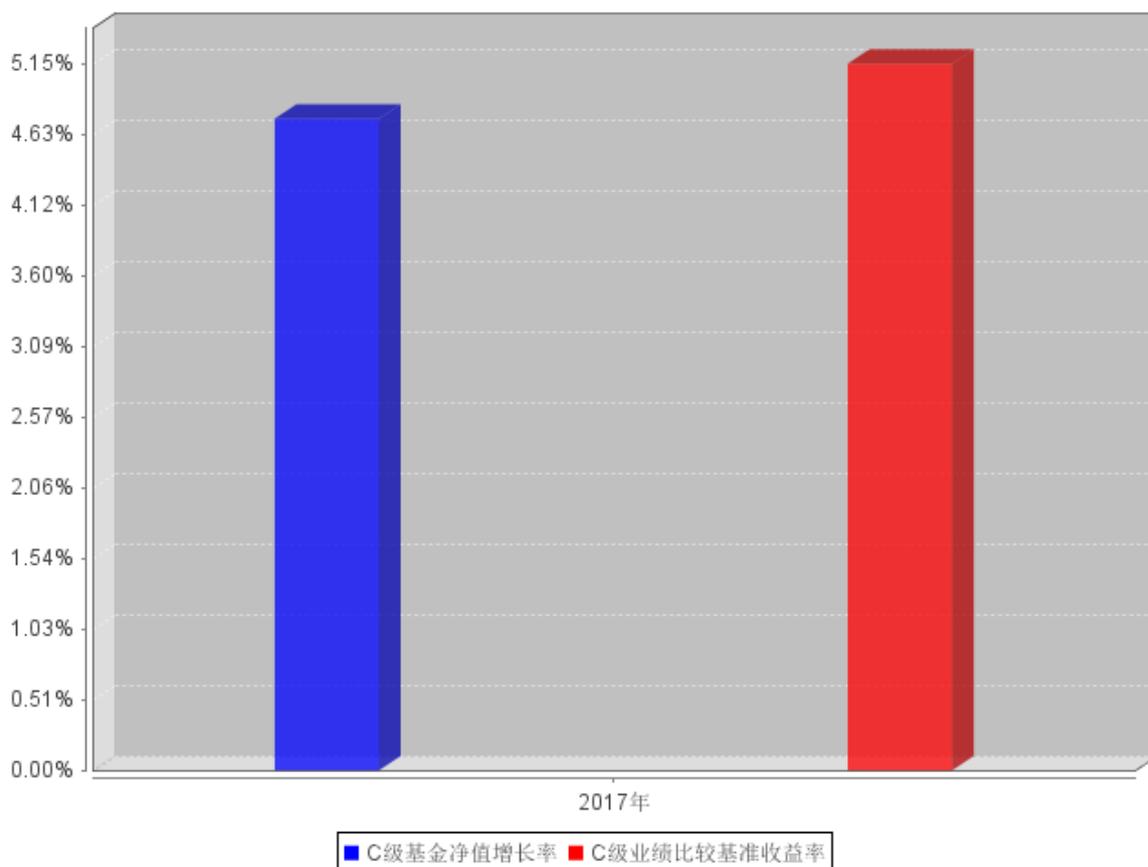
注：本基金的基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日，按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

### 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

A级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对比图



C级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对比图



注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日，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

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，自成立以来本基金未进行收益分配。

## § 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

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 2.5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金管理有限公司注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层。

截至 2017 年 12 月 31 日，公司共管理 14 支开放式基金，证券投资基金管理规模 78.30 亿。

#### 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		
石玉	本基金基金经理	2017 年 7 月 7 日	-	10 年	石玉女士，天津大学管理学硕士。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。
郭党钰	本基金基金经理	2017 年 7 月 7 日	-	15 年	郭党钰先生，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。
刘重晋	本基金基金经理	2017 年 8 月 2 日	-	6 年	刘重晋先生，博士。2012 年 2 月至 2017 年 3 月，在松河投资咨询（深圳）有限公司任副总经理、量化研究员。2017 年 4 月加入中金基金管理有限公司，现任中金基金管理有限公司量化投资部基金经理。
闫雯雯	本基金基金经理助理	2017 年 8 月 24 日	-	9 年	闫雯雯女士，工商管理硕士。曾任泰康资产管理有限公司国际投资部、信用评估部研究员，现任中金基金管理有限公司固定收益研究主管。

注：1、本报告期内，石玉女士因休产假暂离工作岗位超过 30 日，经公司决定，在此期间，由郭党钰先生代石玉女士履行本基金基金经理的相关职责。

2、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

3、证券从业的含义遵从《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《中金基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施效果评估、信息披露与报告制度等多方面进行了规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为保证各投资组合在投资信

息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，公司建立了科学合理的投资运作体系和规范的投资流程，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年国内宏观经济稳中向好，下滑低于预期。全年全国 GDP 增长 6.9%，CPI 同比上涨 1.6%。在供给侧改革，去产能和环保压力共同影响下，产能过剩行业的供需关系得到改善，全球经济整体持续复苏，国际大宗商品价格上涨，国际和国内共同作用下，PPI 同比上涨 6.3%，实际表现也高于年初市场预期。

A 股市场在 2017 年呈现较为明显的分化情况，以大盘蓝筹及行业领先的龙头白马股票为代表带动大盘指数持续上涨，全年上证 50 指数上涨 25.08%，沪深 300 指数上涨 21.78%。而个数众多的小市值股票表现较差，中小盘股票为代表的中证 500 指数下跌 0.2%，创业板下跌 10.67%。

债券市场 2017 年整体表现为熊市，2017 年中债综合财富总指数上涨仅 0.24%。资金面在 2017 年整体表现为紧张，短期资金价格水平整体表现为较高。

本基金股票部分在报告期内选取了公司估值较合理，收益稳定，财务质量优异的大盘蓝筹股票进行持有，同时配合股票的打新操作，增厚收益。债券部分，由于收益率曲线非常平坦，短久期品种的相对价值较为突出。我们选择 1 年左右短久期、高等级债券作为底仓，同时，择机参与一些长久期利率债的波段操作。接下来，我们会密切监控市场变化以及策略表现，积极应对，在

控制风险的同时尽可能获得更好的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中金丰颐 A 类份额净值增长率为 4.86%，中金丰颐 C 类份额净值增长率为 4.75%，同期业绩比较基准收益率为 5.15%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为 2018 年将是中国增长延续 2017 年“峰回路转”之后“乘势而上”的一年，增长持续性确认及系统性风险下降为中国投资带来机会。新老经济结构转换仍在推进，城镇化深化、消费升级，产业升级、一产业整合三大产业趋势愈发明显。

对于 2018 年证券市场，我们认为整体市场向好，会有一些结构性的机会，尤其一些新兴产业发展方兴未艾，人工智能、物联网、5G 等喷涌而出，相关领域的中国企业开始崭露头角。然而全球经济复苏情况，海外地缘政治风险情况，金融去杠杆进行，产业政策变化，资管行业监管政策等也会为 2018 年的证券市场带来不确定性。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作，强化制度完善及对制度执行情况的监督检查，根据不同的基金特点与发展情况，及时界定新的风险点，评价风险级别，并纳入稽核计划，有效保证了基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1) 本基金管理人以中国证监会《季度监察稽核项目表》为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，及定期进行有重点的检查。2) 研究、投资交易环节，本基金管理人对投资对象建立筛选流程、对投资对象池（库）进行日常维护与更新，并对基金的投资比例进行日常监控，对关联交易进行日常维护，定期关注基金持仓流动性风险，并对公平交易执行情况进行检查等。3) 营销与销售方面，本基金管理人对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查，同时加强对基金销售部门的合规培训。4) 基金运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值业务的检查力度，保证基金运营安全、准确。5) 法律合规方面，本基金管理人对公司制度规范、合同协议、产品方案、对外文件等进行合规性审核。6) 信息披露方面，本基金管理人严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定，认真做好本基金的信息

披露工作，确保信息披露内容的真实、准确、完整、及时。此外，本基金管理人对监察稽核工作流程进行了完善和优化，并按照既定的稽核计划开展内部稽核，对检查出来的问题及时提出改进意见并督促相关部门有效落实。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高监察稽核工作的有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场和交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中金基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1801571 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的第 1 页至第 31 页的中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“中金丰颐基金”）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2017 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了中金丰颐基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2017 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中金丰颐基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>中金丰颐基金管理人中金基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括中金丰颐基金 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，</p>

	我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中金丰颐基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，中金丰颐基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责评估中金丰颐基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非中金丰颐基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>中金丰颐基金管理人中金基金管理有限公司治理层负责监督中金丰颐基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>

	<p>(3) 评价中金丰颐基金管理人中金基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对中金丰颐基金管理人中金基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中金丰颐基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中金丰颐基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与中金丰颐基金管理人中金基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	程海良   管祎铭
会计师事务所的地址	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层
审计报告日期	2018 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款		215,046.58
结算备付金		929,938.82
存出保证金		37,791.64
交易性金融资产		195,556,718.61
其中：股票投资		62,965,726.11
基金投资		-
债券投资		132,590,992.50
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		3,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息		3,554,917.02
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		203,294,412.67
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		195,191.67
应付赎回款		219.01
应付管理人报酬		257,926.67
应付托管费		17,195.13
应付销售服务费		50.43
应付交易费用		56,062.58
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		200,000.52
负债合计		726,646.01
<b>所有者权益：</b>		
实收基金		193,178,002.57
未分配利润		9,389,764.09
所有者权益合计		202,567,766.66
负债和所有者权益总计		203,294,412.67

注：1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，中金丰颐 A 基金份额净值 1.0486 元，基金份额总额 193,050,815.37 份；中金丰颐 C 基金份额净值 1.0475 元，基金份额总额 127,187.2 份。中金丰颐份额总额合计为 193,178,002.57 份。

2、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日，无上年度对比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2017 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		11,249,882.26
1.利息收入		3,069,360.00
其中：存款利息收入		127,100.74
债券利息收入		2,541,653.53
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		400,605.73
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,865,747.34
其中：股票投资收益		2,702,837.88
基金投资收益		-
债券投资收益		-364,665.36
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		527,574.82
3.公允价值变动收益（损失以		5,284,315.34

“-”号填列)		
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		30,459.58
<b>减：二、费用</b>		<b>1,851,940.03</b>
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,451,686.55
2. 托管费	7.4.8.2.2	96,779.00
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	93.83
4. 交易费用		83,347.19
5. 利息支出		16,533.46
其中：卖出回购金融资产支出		16,533.46
6. 其他费用		203,500.00
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>9,397,942.23</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>9,397,942.23</b>

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日，无上年度可比期间数据。

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	200,078,654.27	-	200,078,654.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	9,397,942.23	9,397,942.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-6,900,651.70	-8,178.14	-6,908,829.84
其中：1. 基金申购款	147,703.57	6,766.67	154,470.24
2. 基金赎回款	-7,048,355.27	-14,944.81	-7,063,300.08
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	193,178,002.57	9,389,764.09	202,567,766.66

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日，无上年度对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

<u>孙菁</u>	<u>张纳</u>	<u>白娜</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2017 年 5 月 9 日证监许可 [2017] 679 号《关于准予中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式混合型基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台及中金基金网上直销平台进行销售，募集期为 2017 年 5 月 23 日起至 2017 年 7 月 4 日。经向中国证监会备案，《中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 7 月 7 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 200,078,654.27 份，发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据经中国证监会备案的《中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购 / 申购时，收取认购 / 申购费用，但从本类别基金资产中不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取认购 / 申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规

定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况、自 2017 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

### 7.4.4.2 会计估计变更的说明

无

### 7.4.4.3 差错更正的说明

无

## 7.4.5 税项

根据财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人

所得税政策有关问题的通知》、财税〔2005〕103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字〔2008〕16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

## 7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
平安银行	基金托管人
中国国际金融股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中投证券有限责任公司(“中投证券”)	基金管理人股东的一级全资子公司
中金资本运营有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金浦成投资有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金期货有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中国国际金融(香港)有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中投证券	73,774.28	0.09%

注：本基金合同生效日为2017年7月7日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.1.2 债券交易

本基金本报告期无关联方债券交易。

#### 7.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中投证券	36,200,000.00	3.44%

注：本基金合同生效日为2017年7月7日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期与上年度可比期间无关联方权证交易。

**7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中投证券	53.97	0.10%	53.97	0.10%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险金后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场服务信息。

3、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日，无上年度可比期间数据。

**7.4.7.2 关联方报酬****7.4.7.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	84.99

注：1、支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

2、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日，无上年度可比期间数据。

**7.4.7.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：1、支付基金托管人平安银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐

日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

2、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日，无上年度可比期间数据。

### 7.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金丰颐 A	中金丰颐 C	合计
中金基金	-	13.36	13.36
合计	-	13.36	13.36

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费。

2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.60% 的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。计算公式为：本基金 C 类基金日基金销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.60% / 当年天数。

3、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日，无上年度可比期间数据。

### 7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金于本基金本报告期未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金于本期末除基金管理人之外的其他关联方未运用固有资金投资本基金。

### 7.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	

	期末余额	当期利息收入
中国平安银行	215,046.58	26,465.77

注：1、本基金通过“平安银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于 2017 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 967,730.46 元，当期产生的利息收入为人民币 8,134.97 元。

2、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项

#### 7.4.8 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

注：根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

##### 7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未发生银行间市场债券正回购交易。

#### 7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未发生交易所市场债券正回购交易。

#### 7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的资产和负债下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

	2017 年 12 月 31 日			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
持续的公允价值计量资产				
交易性金融资产				
-股票投资	62,928,829.66	-	36,896.45	62,965,726.11
-债券投资	-	132,590,992.50	-	132,590,992.50
持续以公允价值计量的资产总额	62,928,829.66	132,590,992.50	36,896.45	195,556,718.61

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次，账面价值为人民币 36,896.45 元。于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的资产的三个层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

##### (a) 第二层次及第三层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2) 其他金融工具的公允价值（年末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	62,965,726.11	30.97
	其中：股票	62,965,726.11	30.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	132,590,992.50	65.22
	其中：债券	132,590,992.50	65.22
	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	3,000,000.00	1.48
	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	1,144,985.40	0.56
8	其他各项资产	3,592,708.66	1.77
9	合计	203,294,412.67	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,556,272.00	1.26
C	制造业	13,072,766.55	6.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	445,383.20	0.22
E	建筑业	3,599,271.00	1.78
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,241,915.94	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	732,381.00	0.36

J	金融业	39,236,323.42	19.37
K	房地产业	2,081,413.00	1.03
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	62,965,726.11	31.08

### 8.2.2 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。

### 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	138,200	9,671,236.00	4.77
2	600519	贵州茅台	7,300	5,091,677.00	2.51
3	600036	招商银行	131,200	3,807,424.00	1.88
4	601166	兴业银行	157,400	2,674,226.00	1.32
5	600016	民生银行	300,900	2,524,551.00	1.25
6	600887	伊利股份	76,600	2,465,754.00	1.22
7	601328	交通银行	347,700	2,159,217.00	1.07
8	600000	浦发银行	147,800	1,860,802.00	0.92
9	601288	农业银行	485,300	1,858,699.00	0.92
10	600030	中信证券	101,000	1,828,100.00	0.90

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	8,938,072.42	4.41
2	600519	贵州茅台	4,356,644.00	2.15
3	600036	招商银行	3,793,711.00	1.87
4	601166	兴业银行	3,275,375.00	1.62
5	600016	民生银行	2,911,886.00	1.44
6	601328	交通银行	2,490,846.00	1.23
7	601668	中国建筑	2,220,239.00	1.10
8	600000	浦发银行	2,210,721.00	1.09
9	600030	中信证券	2,132,278.00	1.05
10	601288	农业银行	2,096,507.00	1.03
11	600887	伊利股份	1,922,015.80	0.95
12	600837	海通证券	1,823,785.00	0.90
13	600104	上汽集团	1,702,137.00	0.84
14	601601	中国太保	1,693,357.21	0.84
15	601169	北京银行	1,676,034.84	0.83
16	601398	工商银行	1,663,868.00	0.82
17	601766	中国中车	1,491,387.00	0.74
18	601211	国泰君安	1,410,395.00	0.70
19	601988	中国银行	1,189,107.00	0.59
20	600048	保利地产	1,179,014.00	0.58

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	1,924,871.00	0.95
2	600519	贵州茅台	977,082.00	0.48
3	600036	招商银行	608,016.00	0.30
4	601766	中国中车	532,231.00	0.26
5	601901	方正证券	461,193.36	0.23
6	601166	兴业银行	453,479.00	0.22
7	600016	民生银行	439,040.00	0.22
8	601788	光大证券	437,709.00	0.22

9	600030	中信证券	403,849.00	0.20
10	600887	伊利股份	400,586.00	0.20
11	601328	交通银行	392,609.00	0.19
12	601211	国泰君安	382,356.00	0.19
13	601288	农业银行	360,629.00	0.18
14	601390	中国中铁	342,052.54	0.17
15	601668	中国建筑	320,027.00	0.16
16	601601	中国太保	301,725.00	0.15
17	601398	工商银行	292,623.00	0.14
18	600000	浦发银行	289,162.00	0.14
19	600104	上汽集团	277,750.00	0.14
20	601198	东兴证券	273,383.00	0.13

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	70,922,910.39
卖出股票收入（成交）总额	16,240,192.28

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,975,800.00	5.42
	其中：政策性金融债	10,975,800.00	5.42
4	企业债券	81,495,192.50	40.23
5	企业短期融资券	30,100,000.00	14.86
6	中期票据	10,020,000.00	4.95
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	132,590,992.50	65.46

**8.6 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**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	108601	国开 1703	110,000	10,975,800.00	5.42
2	041759001	17 京机电 CP001	100,000	10,108,000.00	4.99
3	011762021	17 汉江水电 SCP001	100,000	10,071,000.00	4.97
4	011754056	17 永达 SCP001	100,000	10,069,000.00	4.97
5	011780002	17 盈峰 SCP002	100,000	10,056,000.00	4.96

**8.7 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。

**8.8 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贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 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。

**8.11.2 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。

**8.11.3 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。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1**

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

**8.12.2**

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。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	37,791.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,554,917.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,592,708.66

**8.12.4 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。

**8.12.5 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流通受限股票。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中金丰颐 A	127	1,520,085.16	193,024,460.00	99.99%	26,355.37	0.01%
中金丰颐 C	77	1,651.78	-	-	127,187.20	100.00%
合计	204	946,950.99	193,024,460.00	99.92%	153,542.57	0.08%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金丰颐 A	7,861.52	0.0041%
	中金丰颐 C	1,401.59	1.1020%
	合计	9,263.11	0.0048%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金丰颐 A	0~10
	中金丰颐 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中金丰颐 A	0~10
	中金丰颐 C	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金丰颐 A	中金丰颐 C
基金合同生效日（2017 年 7 月 7 日）基金份额总额	200,065,024.78	13,629.49
本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	7,093.77	140,609.80
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	7,021,303.18	27,052.09
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）	-	-
本报告期期末基金份额总额	193,050,815.37	127,187.20

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017 年 1 月 20 日，公司股东作出决定，任命林寿康先生、黄劲峰先生、陈刚先生、孙菁女士、杜季柳女士、赵璧先生、张春先生、张龙先生、颜羽女士担任公司第二届董事会董事，任期三年；其中，林寿康先生担任董事长，张春先生、张龙先生和颜羽女士担任独立董事。刘健女士自 2017 年 2 月 10 日起不再担任公司董事。杜季柳女士自 2017 年 10 月 10 日起不再担任公司董事，由李永先生接替杜季柳女士担任公司第二届董事会董事职务。

沈芸女士自 2017 年 2 月 10 日任期届满之日起不再担任公司督察长，由公司副总经理杜季柳女士代为履行督察长职务。李虹女士自 2017 年 3 月 24 日起担任公司督察长职务，公司副总经理杜季柳女士不再代为履行督察长职务。李永先生自 2017 年 8 月 4 日起担任公司副总经理。杜季柳女士自 2017 年 9 月 30 日起不再担任公司副总经理。

2017 年 3 月 15 日，公司执行监事夏静女士任期届满连任公司执行监事。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。本基金本报告期内应支付审计费用 50,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
太平洋证券	2	12,106,421.73	14.07%	8,853.50	15.84%	-
方正证券	2	70,288,564.85	81.70%	44,373.68	79.40%	-
中投证券	2	73,774.28	0.09%	53.97	0.10%	-
国金证券	2	3,564,029.54	4.14%	2,606.43	4.66%	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- （1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- （3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合

模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
太平洋证券	2,615,525.92	4.12%	172,810,000.00	16.43%	-	-
方正证券	44,953,574.57	70.73%	713,700,000.00	67.85%	-	-
中投证券	-	-	36,200,000.00	3.44%	-	-
国金证券	15,985,683.40	25.15%	129,100,000.00	12.27%	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	2017 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	-	48,511,640.00	-	48,511,640.00	25.11%
	2	2017 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	-	56,502,260.00	-	56,502,260.00	29.25%

#### 产品特有风险

(1) 本基金是混合型基金，股票资产占基金资产的比例范围为 0-95%；股票等权益类产品出现市场性整体下跌时将可能影响到本基金的业绩表现。

#### (2) 采用量化投资策略风险

##### 1) 规模风险

规模风险是指管理资产规模过大导致的获利空间缩窄、投资回报下降的风险。若相似策略的产品规模过于庞大，各产品的交易单量大又相对集中，可能导致较大的滑点，从而影响本基金表现。所有的量化选股策略对资产规模都有一定的限制，过大的规模会对投资收益有影响。

##### 2) 模型有效性及策略失败风险

模型有效性风险主要是模型捕捉的机会消失可能导致获利能力下降甚至丧失，所有的模型均有失效的可能，从而影响基金的表现；本基金的投资策略主要包括量化选股策略和其他策略，力求实现基金资产的稳定增值，但有可能因投资策略的失败而导致基金损失。

##### 3) 股票选择风险

本基金的量化选股模型在注重基本面研究的同时，结合多种统计量化策略，主要包括多因子模型和统计套利模型等，期望筛选出对比做空的股指或个股有超额收益的股票。但有可能在某区间本基金买入的股票收益率低于做空的股指收益率，从而导致基金损失。

##### 4) 本金损失风险

本基金灵活应用各种收益策略来对冲基金的系统性风险或进行投资个股的筛选，但投资策略的失败和投资市场的波动可能会导致投资本基金的投资者遭受本金损失，存在本金损失的风险。

##### 5) 卖空风险

本基金适时采用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险，但可以不完全对冲，根据合同本基

金可以持有净多头或净空头头寸，将来亦有可能会优选做空个股、做空其他衍生工具的方式来实实现投资目标。如果基金管理人判断失误可能导致本基金在某些市场情况下无法跑赢普通偏股型基金，也有可能特殊情况下发生比普通偏股型基金更大的损失。

#### 6) 金融数据的风险

本基金应用量化模型和外部提供商的金融数据协助进行量化选股。数据通常来源于不同的数据提供商，且在进行数据清洗、加工后作为量化模型的输入变量。采集到的原始金融数据的错误或完整、预处理过程中的缺陷都可能直接影响量化模型的输出结果，形成数据风险，对基金的业绩产生不利的影响。

##### (3) 股指期货投资风险

1) 流动性风险：基金在股指期货市场成交不活跃时，可能在建仓和平仓股指期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

2) 基差风险：在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股票指数现货价格与股指期货合约价格波动不一致而遭受基差风险。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本基金投资产生影响。

3) 合约展期风险：本基金所投资的期货合约主要包括股指期货当月和近月合约。当基金所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

4) 到期日风险：股指期货合约到期时，基金财产如持有为平仓合约，中金所将按照交割结算价将基金持有的合约进行现金交割，导致基金无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

5) 股指期货保证金不足风险：由于股指期货价格朝不利方向变动，导致期货账户的资金低于金融期货交易所或者期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，股指期货头寸将被强行平仓，导致无法规避对冲系统性风险，直接影响本基金收益水平，从而产生风险。

6) 杠杆风险：股指期货作为金融衍生品，其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，基金可能承受超出保证金甚至基金资产本金的损失。

7) 对手方风险：基金管理人运用基金财产投资于股指期货时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金财产遭受损失。

8) 平仓风险：期货经纪公司或其客户保证金不足，又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所以对期货经纪公司的经纪账户强行平仓，资产管理计划财产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

(4) 国债期货投资风险本基金对国债期货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。

##### (5) 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者发行，且仅在特定机构投资者范围内流通转让，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。

##### (6) 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，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，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。

(7) 流通受限证券投资风险

本基金可以投资流通受限证券，该类证券有一定期限的锁定期，锁定期内不得上市交易或转让，由此可能给基金带来更大的流动性风险、操作风险和估值风险等各类风险。

## 12.2 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。

中金基金管理有限公司  
2018 年 3 月 30 日