

中金绝对收益策略定期开放混合型 发起式证券投资基金 2017 年年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国建设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 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
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.....	66
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	66

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	66
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	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
8.12 投资组合报告附注	67
§9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3 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	69
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	69
§10 开放式基金份额变动	70
§ 11 重大事件揭示	71
11.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
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	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8 其他重大事件	74
§12 影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	中金绝对收益
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	74,238,794.56 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。
业绩比较基准	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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李虹	田青
	联系电话	010-63211122	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-868-1166	010-67595096
传真		010-66159121	010-66275853
注册地址		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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心

邮政编码	100032	100033
法定代表人	林寿康	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 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	2017 年	2016 年	2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-2,681,127.89	-2,533,986.17	33,192,444.17
本期利润	-3,047,814.19	-2,542,345.74	33,055,672.67
加权平均基金份额本期利润	-0.0269	-0.0172	0.0578
本期加权平均净值利润率	-2.65%	-1.65%	5.56%
本期基金份额净值增长率	-0.98%	-2.20%	4.50%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	926,969.08	2,509,668.37	13,403,537.52
期末可供分配基金份额利润	0.0125	0.0225	0.0454
期末基金资产净值	75,165,763.64	114,170,220.14	308,766,991.02
期末基金份额净值	1.012	1.022	1.045
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	1.20%	2.20%	4.50%

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、本基金合同生效日为 2015 年 4 月 21 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。

3.2 基金净值表现

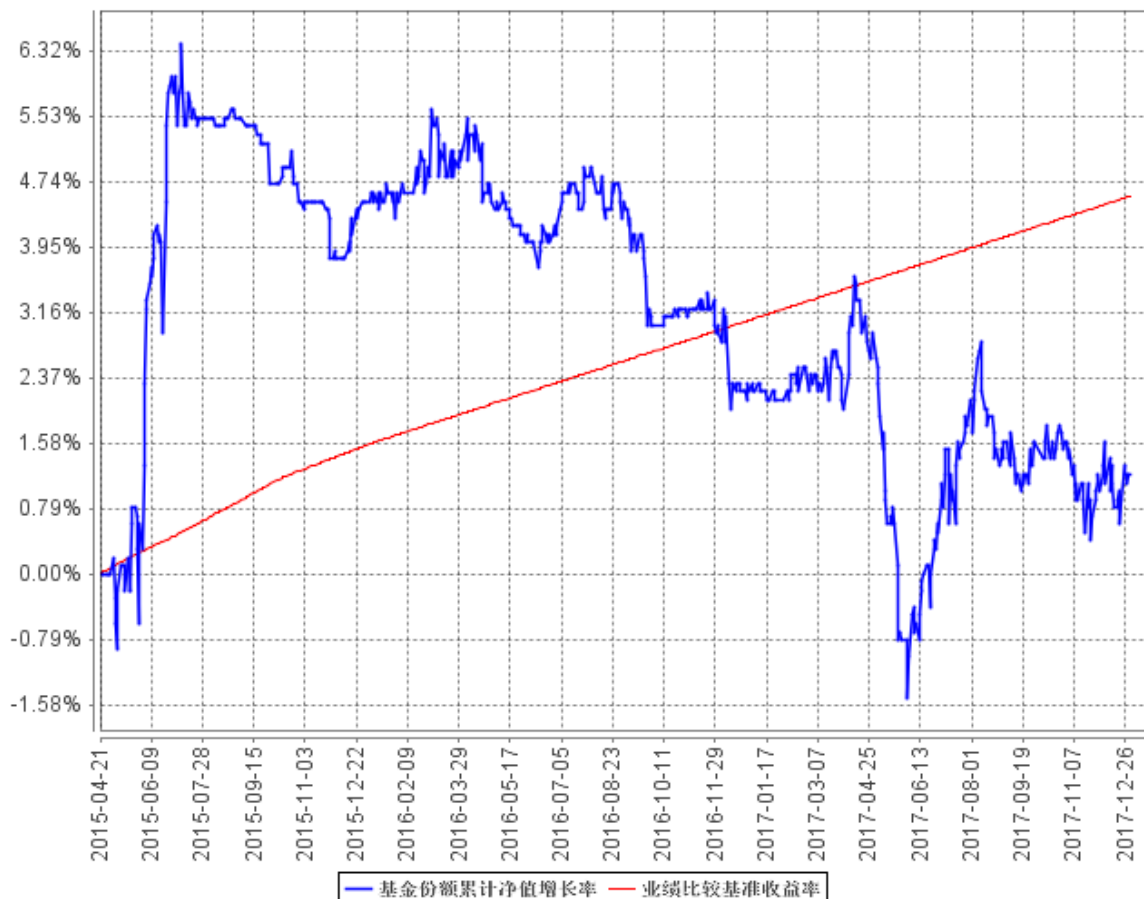
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.39%	0.23%	0.36%	0.00%	-0.75%	0.23%
过去六个月	0.70%	0.25%	0.73%	0.00%	-0.03%	0.25%
过去一年	-0.98%	0.24%	1.46%	0.00%	-2.44%	0.24%

自基金合同生效起至今	1.20%	0.23%	4.56%	0.01%	-3.36%	0.22%
------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

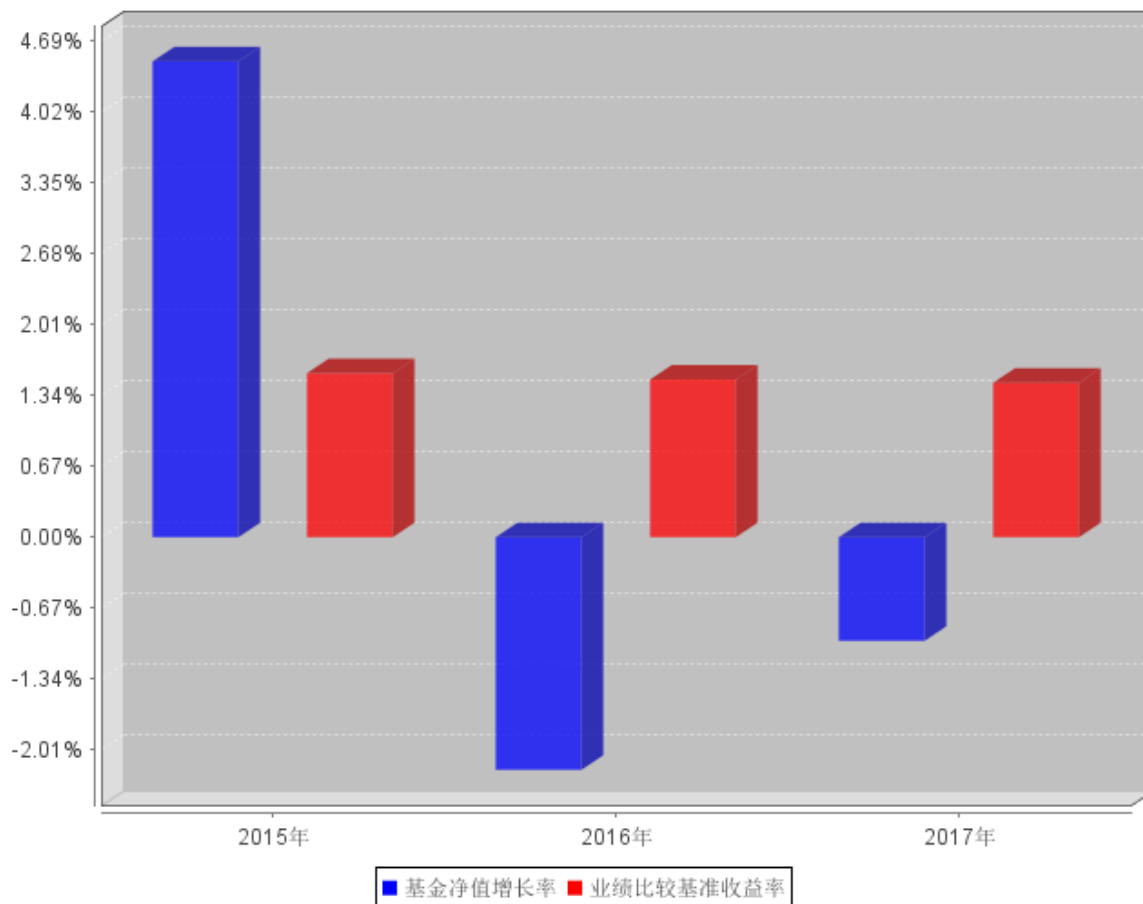
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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

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 2015 年 4 月 21 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		
李云琪	本基金基金经理	2015 年 4 月 21 日	2017 年 3 月 28 日	10 年	李云琪先生，工学硕士。历任摩根士丹利信息技术(上海)有限公司固定收益部分析员、经理；中国国际金融有限公司证券投资部经理、高级经理。本报告期内曾任中金基金管理有限公司量化公募投资部副总经理。
魏宇	本基金基金经理	2017 年 3 月 28 日	-	7 年	魏宇先生，香港大学统计专业博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发工作。2014 年 11 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公募投资部副总经理。

注：1、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。

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，本基金采用量化对冲的投资策略，运作正常。我们根据不同的市场环境以及模型表现，选用不同的股票池和股指期货来进行投资，并且在资金足够的一段时间内，加入打新策略，增厚收益。总体上来说，选股模型有一定的超额收益，但未能覆盖股指期货的基差损失，造成了一定的亏损。我们会持续改进和丰富投资策略，力争为投资者带来回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值为 1.012 元；本基金份额净值增长率为-0.98%，同期业绩比较基准收益率为 1.46%。

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 2018 年，总体来看，中国的经济增长无忧。全球经济复苏的趋势将会得到延续，贸易将会有较快增长；制造业投资有望回升；国内消费增速依然平稳；房地产在发展租赁市场的政策导向下，其投资也有超预期的可能。我们还需要重点关注经济增长的结构优化，实体经济去杠杆，供给侧结构性改革，环保目标的推进，以及制造产业结构升级。在未来的投资中，我们将重视宏观经济对市场的影响，尤其是对市场风格的影响，并积极调整投资策略，适应市场，力争取得更好的表现。

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

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、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供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《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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 1801565 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	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式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 35 页的中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“中金绝对收益基金”）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度的利润表、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，公允反映了中金绝对收益基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度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，我们独立于中金绝对收益基金，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>中金绝对收益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。其他信息包括中金绝对收益基金 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，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中金绝对收益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，中金绝对收益基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责评估中金绝对收益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，除非中金绝对收益基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>中金绝对收益基金管理人中金基金管理有限公司治理层负责监督中金绝对收益基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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) 评价中金绝对收益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) 对中金绝对收益基金管理人中金基金管理有限公司管理层使用</p>

	<p>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，就可能导致对中金绝对收益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绝对收益基金不能持续经营。</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>我们与中金绝对收益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：中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,005,096.03	61,659,549.71
结算备付金		12,338,799.43	27,121,662.40
存出保证金		8,984,410.97	4,262,769.68
交易性金融资产	7.4.7.2	45,299,556.66	20,794,715.85
其中：股票投资		45,265,338.26	20,794,715.85
基金投资		-	-
债券投资		34,218.40	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		7,080,329.46	1,432,433.40
应收利息	7.4.7.5	-2,404.08	6,178.67
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		75,705,788.47	115,277,309.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		63,730.63	96,961.09
应付托管费		15,932.66	24,240.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	290,361.54	545,888.21
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	170,000.00	440,000.00
负债合计		540,024.83	1,107,089.57
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	74,238,794.56	111,660,551.77
未分配利润	7.4.7.10	926,969.08	2,509,668.37
所有者权益合计		75,165,763.64	114,170,220.14
负债和所有者权益总计		75,705,788.47	115,277,309.71

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.012 元，基金份额总额 74,238,794.56 份。

7.2 利润表

会计主体：中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		1,451,720.47	3,418,435.77
1. 利息收入		533,408.80	976,290.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	99,952.74	368,348.51
债券利息收入		11.05	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		433,445.01	607,942.23
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		957,979.73	2,195,326.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	13,126,112.88	5,277,801.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,170.14	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-13,433,496.60	-3,764,104.80
股利收益	7.4.7.15	1,262,193.31	681,629.95
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-366,686.30	-8,359.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	327,018.24	255,178.06
减：二、费用		4,499,534.66	5,960,781.51
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,153,226.00	1,576,993.21
2. 托管费	7.4.10.2.2	288,306.54	389,489.73
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.18	2,878,074.86	3,596,820.50
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	179,927.26	397,478.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,047,814.19	-2,542,345.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,047,814.19	-2,542,345.74

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 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）	111,660,551.77	2,509,668.37	114,170,220.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,047,814.19	-3,047,814.19
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）	-37,421,757.21	1,465,114.90	-35,956,642.31
其中：1. 基金申购款	88,826,293.55	3,197,426.14	92,023,719.69
2. 基金赎回款	-126,248,050.76	-1,732,311.24	-127,980,362.00
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）	74,238,794.56	926,969.08	75,165,763.64
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	295,363,453.50	13,403,537.52	308,766,991.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,542,345.74	-2,542,345.74
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）	-183,702,901.73	-8,351,523.41	-192,054,425.14
其中：1. 基金申购款	365,699.62	13,360.63	379,060.25
2. 基金赎回款	-184,068,601.35	-8,364,884.04	-192,433,485.39
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）	111,660,551.77	2,509,668.37	114,170,220.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（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”）于 2015 年 1 月 28 日证监许可 [2015] 144 号《关于准予中金绝对收益策略定期开放混合型发起式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《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为混合型发起式证券投资基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

本基金通过管理人中金基金直销柜台、建设银行、平安银行股份有限公司、中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）、华西证券股份有限公司、国信证券股份有限公司及齐鲁证券股份有限公司共同销售，募集期为 2015 年 3 月 23 日至 2015 年 4 月 16 日。经向中国证监会备案，《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 21 日正

式生效，合同生效日基金实收份额为 709,513,460.11 份（含利息转份额 365,426.61 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具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。

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、2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比

例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 /（未弥补亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益 /（损失）核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日该次单位可供分配利润的 20%，若《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式为现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告 [2017] 13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017] 6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益

品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	2,005,096.03	61,659,549.71
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	2,005,096.03	61,659,549.71

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	45,481,671.81	45,265,338.26	-216,333.55
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	34,218.40	2,318.40
	银行间市场	-	-
	合计	34,218.40	2,318.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	45,513,571.81	45,299,556.66	-214,015.15
项目	上年度末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	20,817,908.10	20,794,715.85	-23,192.25
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	20,817,908.10	20,794,715.85	-23,192.25

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则（试行）》及《企业会计准则—金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具—股指期货投资”与“证券清算款—股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵消的条件，故将“其他衍生工具—股指期货投资”的期货公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

股指期货投资：				2017年12月31日
代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC1701	IC1801	-34	-42,563,920.00	-297,802.22
总额合计				-297,802.22
减：可抵销期货暂付款				-297,802.22
股指期货投资净额				0.00

股指期货投资:				2016 年 12 月 31 日
代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC1701	IC1701	-16	-19,895,040.00	-121,938.82
总额合计				-121,938.82
减: 可抵销期货暂付款				-121,938.82
股指期货投资净额				0.00

注: 买入持仓量以正数表示, 卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	558.77	3,262.11
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	507.43	2,874.52
应收债券利息	7.36	-
应收买入返售证券利息	-3,500.54	-
应收申购款利息	0.13	0.13
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	22.77	41.91
合计	-2,404.08	6,178.67

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	290,361.54	545,888.21
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	290,361.54	545,888.21

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	170,000.00	440,000.00
合计	170,000.00	440,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	111,660,551.77	111,660,551.77
本期申购	88,826,293.55	88,826,293.55
本期赎回（以“-”号填列）	-126,248,050.76	-126,248,050.76
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	74,238,794.56	74,238,794.56

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,810,410.18	-300,741.81	2,509,668.37
本期利润	-2,681,127.89	-366,686.30	-3,047,814.19
本期基金份额交易产生的变动数	1,398,621.88	66,493.02	1,465,114.90
其中：基金申购款	2,475,190.45	722,235.69	3,197,426.14
基金赎回款	-1,076,568.57	-655,742.67	-1,732,311.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,527,904.17	-600,935.09	926,969.08

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	60,783.88	292,463.62
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	37,940.91	71,383.86
其他	1,227.95	4,501.03
合计	99,952.74	368,348.51

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	1,060,256,384.78	1,318,601,615.95
减：卖出股票成本总额	1,047,130,271.90	1,313,323,814.56
买卖股票差价收入	13,126,112.88	5,277,801.39

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,170.14	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	3,170.14	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	21,673.83	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	18,500.00	-
减：应收利息总额	3.69	-
买卖债券差价收入	3,170.14	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-13,433,496.60	-3,764,104.80

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,262,193.31	681,629.95
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,262,193.31	681,629.95

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-190,822.90	-87,245.37
——股票投资	-193,141.30	-87,245.37
——债券投资	2,318.40	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-175,863.40	78,885.80
合计	-366,686.30	-8,359.57

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	327,018.24	254,860.87
转换费收入	-	317.19
合计	327,018.24	255,178.06

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	2,807,133.79	3,484,661.76
银行间市场交易费用	-	-
股指期货交易费用	70,941.07	112,158.74
合计	2,878,074.86	3,596,820.50

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	90,000.00	300,000.00
汇划手续费	9,927.26	17,478.07
合计	179,927.26	397,478.07

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中金基金管理有限公司(“中金基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司(“中金公司”)	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、基金销售机构
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：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
中金公司	335,302,914.23	15.74%	507,633,736.59	19.22%
中投证券	479,727,279.66	22.52%	0.00	0.00%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	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 成交总额的比 例
中投证券	2,417.20	11.15%	0.00	0.00%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
中金公司	364,300,000.00	13.48%	987,800,000.00	13.29%
中投证券	1,048,700,000.00	38.79%	0.00	0.00%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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1月1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
中金公司	245,208.12	15.74%	0.00	0.00%
中投证券	350,826.32	22.52%	20,234.09	6.97%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中金公司	371,232.39	19.22%	0.00	0.00%
中投证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,153,226.00	1,576,993.21
其中：支付销售机构的客户维护费	374,168.55	742,381.43

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

2、基金管理人的附加管理费

1) 基金管理人可在同时满足以下条件的前提下，提取附加管理费：

①符合基金收益分配条件；

②附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照“新高法原则”提取超额收益的 10%作为附加管理费；即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，基金管理人才能收取附加管理费。

提取评价日：每个基金封闭期的最后一个工作日。

2) 附加管理费的计算方法和提取

在每个提取评价日，在同时满足以上附加管理费提取条件的情况下，附加管理费的计算方法为：

$$\text{附加管理费} = (\text{PA} - \text{PH}) \times 10\% \times \text{SA}$$

其中：

PA 为提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值；

PH 为以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，其中首次封闭期的 PH 为 1；

SA 为提取评价日的基金总份额数。

3、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，本基金本报告期支付销售服务机构的客户维护费为 374,168.55 元，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	288,306.54	389,489.73

注：支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中金公司	10,000,350.00	13.47%	10,000,350.00	8.96%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.10.5 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1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	2,005,096.03	60,783.88	61,659,549.71	292,463.62

注：1、本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金通过“建设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1,071,081.40元(2016年12月31日：人民币5,892,002.01元)，本期间产生的利息收入为人民币39,168.86元(自2016年1月1日至2016年12月31日止期间：人民币75,884.76元)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间没有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

7.4.11 利润分配情况

本基金在报告期内未进行过利润分配。

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123004	铁汉转债	2017年12月18日	2018年1月26日	新债未上市	100.00	100.00	39	3,900.00	3,900.00	-

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。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限股票。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600525	长园集团	2017年12月25日	重大资产事项	15.79	2018年1月10日	17.30	95,355	1,543,192.69	1,505,655.45	-
600666	奥瑞德	2017年6月1日	重大资产重组	17.40	-	-	67,840	1,174,342.00	1,180,416.00	-
600664	哈药股份	2017年9月28日	重大资产重组	5.81	2018年2月27日	6.00	127,074	745,749.35	738,299.94	-
002366	台海核电	2017年12月6日	重大资产重组	26.45	-	-	7,900	226,809.00	208,955.00	-
000547	航天发展	2017年10月30日	重大资产事项	10.83	2018年3月29日	11.80	8,300	89,640.00	89,889.00	-
300116	坚瑞沃能	2017年12月18日	重大资产重组	7.62	-	-	10,343	84,114.25	78,813.66	-
000979	中弘股份	2017年9月7日	重大资产重组	1.94	2018年2月14日	1.75	14,788	28,936.26	28,688.72	-

002745	木林森	2017年12月28日	重大资产事项	45.50	2018年1月5日	46.50	293	13,530.74	13,331.50	-
300010	立思辰	2017年11月17日	重大资产事项	11.17	2018年2月22日	10.05	998	11,657.12	11,147.66	-
300159	新研股份	2017年11月23日	重大资产重组	10.40	2018年3月22日	9.36	751	8,861.80	7,810.40	-
002358	森源电气	2017年12月7日	重大资产重组	14.86	2018年3月7日	15.05	200	3,002.00	2,972.00	-
002004	华邦健康	2017年12月14日	重大资产事项	6.73	2018年3月14日	7.30	400	2,709.00	2,692.00	-
000766	通化金马	2017年11月24日	重大资产重组	13.60	-	-	100	1,351.00	1,360.00	-
002122	天马股份	2017年12月19日	重大资产重组	8.49	-	-	100	1,076.79	849.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险等。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制控制在合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资（上年度末：同）。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	34,218.40	-
未评级	-	-
合计	34,218.40	-

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，针对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性风险预警及危机的处理、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性风险指标进行监控。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在行业 and 个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、期货交易所等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险；市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,005,096.03	-	-	-	2,005,096.03
结算备付金	12,338,799.43	-	-	-	12,338,799.43
存出保证金	8,984,410.97	-	-	-	8,984,410.97
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	45,265,338.26	45,265,338.26
交易性金融资产-债券投资	-	-	34,218.40	-	34,218.40
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	7,080,329.46	7,080,329.46
应收利息	-	-	-	-2,404.08	-2,404.08
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	23,328,306.43	-	34,218.40	52,343,263.64	75,705,788.47
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算	-	-	-	-	-

款					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	63,730.63	63,730.63
应付托管费	-	-	-	15,932.66	15,932.66
应付交易费用	-	-	-	290,361.54	290,361.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	540,024.83	540,024.83
利率敏感度缺口	23,328,306.43	-	-34,218.40	51,803,238.81	75,165,763.64
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	61,659,549.71	-	-	-	61,659,549.71
结算备付金	27,121,662.40	-	-	-	27,121,662.40
存出保证金	4,262,769.68	-	-	-	4,262,769.68
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-20,794,715.85	20,794,715.85
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,432,433.40	1,432,433.40
应收利息	-	-	-	6,178.67	6,178.67
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	93,043,981.79	-	-	-22,233,327.92	115,277,309.71
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	96,961.09	96,961.09
应付托管费	-	-	-	24,240.27	24,240.27
应付交易费用	-	-	-	545,888.21	545,888.21
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	440,000.00	440,000.00

负债总计	-	-	-	1,107,089.57	1,107,089.57
利率敏感度缺口	93,043,981.79	-	-	21,126,238.35	114,170,220.14

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0455%(上年度末 0%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：权益类空头头寸的价值占权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	45,265,338.26	60.22	20,794,715.85	18.21
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	34,218.40	0.05	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	45,299,556.66	60.27	20,794,715.85	18.21

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	192,438.64	247,348.54
	沪深 300 指数下降 5%	-192,438.64	-247,348.54

7.4.14 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
交易性金融资产				
股票投资	41,394,457.93	3,870,880.33	-	45,265,338.26
债券投资		30,318.40	3,900.00	34,218.40
合计	41,394,457.93	3,901,198.73	3,900.00	45,299,556.66
2016 年 12 月 31 日				
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	19,264,617.41	1,530,098.44	-	20,794,715.85
合计	19,264,617.41	1,530,098.44	-	20,794,715.85

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 3,874,780.33 元（2016 年 12 月 31 日：1,530,098.44 元）。于 2017 年 12 月 31 日及 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的资产三个层次之间没有发生其他重大转换。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（2016 年 12 月 31 日：无）。

(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	45,265,338.26	59.79
	其中：股票	45,265,338.26	59.79
2	固定收益投资	34,218.40	0.05
	其中：债券	34,218.40	0.05
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	14,343,895.46	18.95
7	其他各项资产	16,062,336.35	21.22
8	合计	75,705,788.47	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	30,427.04	0.04
B	采矿业	1,181,677.29	1.57
C	制造业	29,952,615.05	39.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	538,046.92	0.72
E	建筑业	965,607.76	1.28
F	批发和零售业	3,001,267.08	3.99
G	交通运输、仓储和邮政业	1,270,525.87	1.69
H	住宿和餐饮业	346,859.18	0.46
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,620,415.31	3.49
J	金融业	1,200,304.00	1.60
K	房地产业	2,731,198.05	3.63
L	租赁和商务服务业	364,027.89	0.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	554,461.31	0.74

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,856.46	0.03
R	文化、体育和娱乐业	487,049.05	0.65
S	综合	-	-
	合计	45,265,338.26	60.22

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沪港通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600525	长园集团	95,355	1,505,655.45	2.00
2	600666	奥瑞德	67,840	1,180,416.00	1.57
3	300115	长盈精密	54,357	1,090,944.99	1.45
4	600565	迪马股份	229,177	916,708.00	1.22
5	601717	郑煤机	134,516	885,115.28	1.18
6	600141	兴发集团	51,532	870,890.80	1.16
7	002078	太阳纸业	92,561	858,966.08	1.14
8	000488	晨鸣纸业	49,728	828,965.76	1.10
9	600438	通威股份	67,221	814,046.31	1.08
10	600580	卧龙电气	97,317	779,509.17	1.04
11	601001	大同煤业	127,249	769,856.45	1.02
12	600664	哈药股份	127,074	738,299.94	0.98
13	600160	巨化股份	68,844	731,811.72	0.97
14	600643	爱建集团	61,350	679,758.00	0.90
15	600755	厦门国贸	60,727	613,342.70	0.82
16	600380	健康元	54,365	608,344.35	0.81
17	002195	二三四五	97,140	567,297.60	0.75
18	600335	国机汽车	49,060	551,434.40	0.73
19	600750	江中药业	21,519	548,304.12	0.73
20	002048	宁波华翔	22,561	536,951.80	0.71
21	600392	盛和资源	28,154	534,926.00	0.71
22	002416	爱施德	55,549	526,049.03	0.70
23	600970	中材国际	50,531	499,751.59	0.66

24	600757	长江传媒	70,079	487,049.05	0.65
25	000039	中集集团	21,305	486,819.25	0.65
26	000786	北新建材	21,583	485,617.50	0.65
27	000598	兴蓉环境	88,862	482,520.66	0.64
28	600346	恒力股份	39,122	482,374.26	0.64
29	002573	清新环境	21,037	478,171.01	0.64
30	600037	歌华有线	36,416	473,043.84	0.63
31	600557	康缘药业	34,972	471,422.56	0.63
32	300182	捷成股份	53,041	456,683.01	0.61
33	000732	泰禾集团	22,809	456,636.18	0.61
34	000513	丽珠集团	6,838	454,385.10	0.60
35	603589	口子窖	9,783	450,507.15	0.60
36	600270	外运发展	25,831	446,359.68	0.59
37	601128	常熟银行	62,375	444,733.75	0.59
38	600694	大商股份	13,064	440,648.72	0.59
39	600516	方大炭素	15,218	439,495.84	0.58
40	000587	金洲慈航	62,639	438,473.00	0.58
41	600079	人福医药	24,288	433,297.92	0.58
42	600787	中储股份	39,167	430,837.00	0.57
43	300274	阳光电源	22,822	428,368.94	0.57
44	600808	马钢股份	103,546	427,644.98	0.57
45	600765	中航重机	34,368	413,103.36	0.55
46	600835	上海机电	16,773	410,938.50	0.55
47	300287	飞利信	51,850	384,208.50	0.51
48	000778	新兴铸管	72,952	380,809.44	0.51
49	000418	小天鹅 A	5,484	372,089.40	0.50
50	601233	桐昆股份	16,275	366,024.75	0.49
51	600582	天地科技	76,211	354,381.15	0.47
52	600388	龙净环保	20,202	349,494.60	0.46
53	600754	锦江股份	10,742	346,859.18	0.46
54	600511	国药股份	12,434	345,665.20	0.46
55	000536	华映科技	69,771	344,668.74	0.46
56	603025	大豪科技	11,611	341,595.62	0.45
57	000596	古井贡酒	5,112	335,705.04	0.45
58	000050	深天马 A	16,152	318,355.92	0.42
59	600428	中远海特	56,431	316,577.91	0.42
60	000581	威孚高科	12,628	303,072.00	0.40
61	000825	太钢不锈	61,052	302,817.92	0.40
62	000661	长春高新	1,597	292,251.00	0.39

63	603225	新风鸣	8,039	287,796.20	0.38
64	002019	亿帆医药	12,855	286,023.75	0.38
65	002092	中泰化学	21,424	285,153.44	0.38
66	000158	常山股份	34,828	276,534.32	0.37
67	002051	中工国际	14,917	274,920.31	0.37
68	000718	苏宁环球	62,885	272,292.05	0.36
69	002503	搜于特	49,030	271,626.20	0.36
70	000656	金科股份	54,673	270,631.35	0.36
71	600409	三友化工	27,641	265,077.19	0.35
72	000990	诚志股份	15,172	261,868.72	0.35
73	002179	中航光电	6,411	252,465.18	0.34
74	603328	依顿电子	17,385	249,474.75	0.33
75	600183	生益科技	14,404	248,613.04	0.33
76	000012	南玻 A	29,373	248,201.85	0.33
77	000528	柳 工	28,798	245,646.94	0.33
78	002056	横店东磁	22,456	240,279.20	0.32
79	600594	益佰制药	21,747	222,254.34	0.30
80	002366	台海核电	7,900	208,955.00	0.28
81	002273	水晶光电	8,752	206,459.68	0.27
82	002544	杰赛科技	12,706	199,865.38	0.27
83	600657	信达地产	34,853	194,479.74	0.26
84	600872	中炬高新	7,702	190,701.52	0.25
85	600859	王府井	9,086	185,354.40	0.25
86	600743	华远地产	49,457	181,012.62	0.24
87	600122	宏图高科	17,678	171,299.82	0.23
88	000830	鲁西化工	10,567	168,226.64	0.22
89	002128	露天煤业	15,159	167,961.72	0.22
90	600366	宁波韵升	9,421	165,055.92	0.22
91	002517	恺英网络	7,222	160,400.62	0.21
92	600074	ST 保千里	15,202	150,043.74	0.20
93	000021	深科技	15,368	149,530.64	0.20
94	600823	世茂股份	30,159	148,985.46	0.20
95	601777	力帆股份	20,202	146,666.52	0.20
96	002642	荣之联	11,075	145,193.25	0.19
97	600260	凯乐科技	4,392	127,851.12	0.17
98	600640	号百控股	8,387	122,617.94	0.16
99	002332	仙琚制药	14,776	120,719.92	0.16
100	002127	南极电商	9,901	120,693.19	0.16
101	000090	天健集团	11,584	116,303.36	0.15

102	603369	今世缘	7,198	111,640.98	0.15
103	002384	东山精密	3,530	100,463.80	0.13
104	000937	冀中能源	17,045	99,201.90	0.13
105	000612	焦作万方	9,751	91,659.40	0.12
106	002390	信邦制药	10,671	90,169.95	0.12
107	000547	航天发展	8,300	89,889.00	0.12
108	600967	内蒙一机	7,331	88,338.55	0.12
109	600325	华发股份	11,692	86,053.12	0.11
110	300039	上海凯宝	12,682	80,657.52	0.11
111	600655	豫园股份	7,427	79,765.98	0.11
112	300116	坚瑞沃能	10,343	78,813.66	0.10
113	002342	巨力索具	13,025	78,019.75	0.10
114	002183	怡亚通	10,872	76,647.60	0.10
115	002002	鸿达兴业	10,864	74,309.76	0.10
116	600329	中新药业	4,805	71,450.35	0.10
117	000501	鄂武商 A	4,369	69,729.24	0.09
118	000620	新华联	12,193	69,500.10	0.09
119	600292	远达环保	7,675	68,691.25	0.09
120	000563	陕国投 A	16,037	68,157.25	0.09
121	002123	梦网荣信	6,562	67,916.70	0.09
122	603806	福斯特	1,922	65,540.20	0.09
123	600348	阳泉煤业	8,627	63,667.26	0.08
124	600017	日照港	16,392	63,600.96	0.08
125	000703	恒逸石化	2,846	61,388.22	0.08
126	300197	铁汉生态	5,010	60,871.50	0.08
127	002223	鱼跃医疗	3,057	59,917.20	0.08
128	601678	滨化股份	7,068	57,392.16	0.08
129	002022	科华生物	4,124	56,127.64	0.07
130	002635	安洁科技	2,150	56,093.50	0.07
131	002434	万里扬	5,189	54,484.50	0.07
132	002551	尚荣医疗	5,643	51,689.88	0.07
133	002440	闰土股份	2,614	51,469.66	0.07
134	600971	恒源煤电	4,848	50,564.64	0.07
135	002064	华峰氨纶	10,257	50,259.30	0.07
136	600572	康恩贝	6,865	48,535.55	0.06
137	300043	星辉娱乐	7,734	47,332.08	0.06
138	000816	智慧农业	14,625	46,946.25	0.06
139	000761	本钢板材	8,851	46,025.20	0.06
140	000997	新大陆	2,496	44,753.28	0.06

141	000049	德赛电池	1,095	43,351.05	0.06
142	600126	杭钢股份	5,949	40,869.63	0.05
143	000027	深圳能源	6,669	40,414.14	0.05
144	000667	美好置业	12,873	39,133.92	0.05
145	002681	奋达科技	3,093	34,517.88	0.05
146	000400	许继电气	2,539	33,489.41	0.04
147	600894	广日股份	3,490	32,631.50	0.04
148	600801	华新水泥	2,200	31,086.00	0.04
149	600282	南钢股份	6,318	30,579.12	0.04
150	000979	中弘股份	14,788	28,688.72	0.04
151	603515	欧普照明	649	27,803.16	0.04
152	002244	滨江集团	3,300	26,235.00	0.03
153	600885	宏发股份	600	24,822.00	0.03
154	002308	威创股份	1,976	24,107.20	0.03
155	002410	广联达	1,200	23,520.00	0.03
156	002191	劲嘉股份	2,520	23,310.00	0.03
157	600138	中青旅	1,068	22,289.16	0.03
158	002299	圣农发展	1,520	21,888.00	0.03
159	002707	众信旅游	2,000	21,780.00	0.03
160	000066	长城电脑	2,966	21,622.14	0.03
161	300244	迪安诊断	883	20,856.46	0.03
162	600277	亿利洁能	3,176	20,453.44	0.03
163	000426	兴业矿业	2,004	19,699.32	0.03
164	600151	航天机电	2,589	19,650.51	0.03
165	300297	蓝盾股份	1,856	17,706.24	0.02
166	601689	拓普集团	708	17,515.92	0.02
167	600266	北京城建	1,305	17,147.70	0.02
168	603169	兰石重装	2,004	16,813.56	0.02
169	600737	中粮糖业	1,800	14,310.00	0.02
170	601127	小康股份	700	14,077.00	0.02
171	002063	远光软件	1,265	13,446.95	0.02
172	002745	木林森	293	13,331.50	0.02
173	601000	唐山港	2,792	13,150.32	0.02
174	600597	光明乳业	849	12,862.35	0.02
175	300010	立思辰	998	11,147.66	0.01
176	600240	华业资本	1,200	10,296.00	0.01
177	000975	银泰资源	700	9,352.00	0.01
178	601016	节能风电	2,718	8,942.22	0.01
179	002408	齐翔腾达	700	8,876.00	0.01

180	000960	锡业股份	649	8,566.80	0.01
181	000998	隆平高科	332	8,539.04	0.01
182	002032	苏泊尔	200	8,076.00	0.01
183	002354	天神娱乐	462	7,900.20	0.01
184	300159	新研股份	751	7,810.40	0.01
185	000988	华工科技	468	7,759.44	0.01
186	603568	伟明环保	361	7,599.05	0.01
187	000727	华东科技	2,969	7,066.22	0.01
188	002005	德豪润达	1,609	7,015.24	0.01
189	600618	氯碱化工	640	6,931.20	0.01
190	600623	华谊集团	809	6,900.77	0.01
191	002444	巨星科技	493	6,818.19	0.01
192	002589	瑞康医药	464	6,240.80	0.01
193	002482	广田集团	750	6,015.00	0.01
194	600143	金发科技	900	5,913.00	0.01
195	600729	重庆百货	227	5,688.62	0.01
196	600578	京能电力	1,507	5,575.90	0.01
197	002285	世联行	500	5,575.00	0.01
198	600545	卓郎智能	500	5,490.00	0.01
199	600978	宜华生活	566	5,173.24	0.01
200	600155	宝硕股份	500	5,115.00	0.01
201	002266	浙富控股	1,154	4,996.82	0.01
202	600566	济川药业	100	3,815.00	0.01
203	002050	三花智控	200	3,668.00	0.00
204	600393	粤泰股份	500	3,170.00	0.00
205	603658	安图生物	59	3,139.98	0.00
206	000877	天山股份	300	3,120.00	0.00
207	002233	塔牌集团	256	3,048.96	0.00
208	002358	森源电气	200	2,972.00	0.00
209	000078	海王生物	460	2,714.00	0.00
210	002004	华邦健康	400	2,692.00	0.00
211	600318	新力金融	200	2,540.00	0.00
212	000652	泰达股份	547	2,412.27	0.00
213	002375	亚厦股份	300	2,256.00	0.00
214	600100	同方股份	200	1,960.00	0.00
215	000631	顺发恒业	440	1,896.40	0.00
216	000897	津滨发展	503	1,700.14	0.00
217	600584	长电科技	68	1,450.44	0.00
218	600395	盘江股份	200	1,374.00	0.00

219	000766	通化金马	100	1,360.00	0.00
220	600466	蓝光发展	113	1,056.55	0.00
221	600300	维维股份	236	1,031.32	0.00
222	600826	兰生股份	70	921.90	0.00
223	002122	天马股份	100	849.00	0.00
224	600863	内蒙华电	200	594.00	0.00
225	002242	九阳股份	35	593.95	0.00
226	600073	上海梅林	31	251.72	0.00
227	002392	北京利尔	37	186.48	0.00

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601818	光大银行	15,830,066.00	13.87
2	601318	中国平安	15,207,166.73	13.32
3	601166	兴业银行	12,923,260.00	11.32
4	601288	农业银行	12,737,508.00	11.16
5	600016	民生银行	11,762,234.00	10.30
6	600000	浦发银行	8,995,728.25	7.88
7	601377	兴业证券	8,943,325.00	7.83
8	000039	中集集团	8,557,019.58	7.49
9	601668	中国建筑	8,538,817.20	7.48
10	601186	中国铁建	8,508,920.96	7.45
11	600690	青岛海尔	8,102,290.48	7.10
12	600029	南方航空	7,998,268.62	7.01
13	600028	中国石化	7,274,931.00	6.37
14	601006	大秦铁路	7,205,053.17	6.31
15	000623	吉林敖东	7,152,239.41	6.26
16	002456	欧菲光	6,984,583.75	6.12
17	000858	五粮液	6,914,363.50	6.06
18	600048	保利地产	6,905,891.00	6.05
19	002024	苏宁云商	6,860,747.32	6.01
20	600141	兴发集团	6,673,796.00	5.85

21	002078	太阳纸业	6,181,455.00	5.41
22	002195	二三四五	6,164,712.14	5.40
23	000415	渤海金控	6,110,987.00	5.35
24	600015	华夏银行	5,957,731.00	5.22
25	002183	怡亚通	5,835,100.54	5.11
26	600886	国投电力	5,815,881.00	5.09
27	000718	苏宁环球	5,812,232.60	5.09
28	002007	华兰生物	5,755,523.62	5.04
29	002152	广电运通	5,668,348.00	4.96
30	600409	三友化工	5,531,460.00	4.84
31	000060	中金岭南	5,480,380.95	4.80
32	000686	东北证券	5,480,150.00	4.80
33	000568	泸州老窖	5,395,522.78	4.73
34	000528	柳工	5,383,678.79	4.72
35	600808	马钢股份	5,169,550.00	4.53
36	002304	洋河股份	5,161,073.36	4.52
37	000983	西山煤电	5,049,921.72	4.42
38	601390	中国中铁	5,008,319.14	4.39
39	002500	山西证券	4,952,257.00	4.34
40	000725	京东方A	4,849,773.00	4.25
41	601233	桐昆股份	4,688,343.00	4.11
42	600582	天地科技	4,620,557.34	4.05
43	600597	光明乳业	4,536,974.00	3.97
44	600170	上海建工	4,535,037.00	3.97
45	600383	金地集团	4,513,807.00	3.95
46	000338	潍柴动力	4,490,367.00	3.93
47	600074	ST保千里	4,451,894.00	3.90
48	600919	江苏银行	4,444,053.00	3.89
49	002714	牧原股份	4,429,417.00	3.88
50	000625	长安汽车	4,424,813.00	3.88
51	000069	华侨城A	4,378,955.00	3.84
52	000630	铜陵有色	4,367,781.00	3.83
53	600160	巨化股份	4,362,662.14	3.82
54	600023	浙能电力	4,248,467.00	3.72
55	000661	长春高新	4,171,199.00	3.65
56	000786	北新建材	4,017,910.00	3.52

57	600859	王府井	4,012,176.22	3.51
58	600089	特变电工	4,002,732.48	3.51
59	000425	徐工机械	3,993,148.00	3.50
60	600252	中恒集团	3,942,817.68	3.45
61	002241	歌尔股份	3,937,680.29	3.45
62	600674	川投能源	3,901,130.00	3.42
63	000001	平安银行	3,884,196.00	3.40
64	002244	滨江集团	3,876,110.00	3.40
65	000761	本钢板材	3,860,034.00	3.38
66	601997	贵阳银行	3,851,568.23	3.37
67	000400	许继电气	3,846,220.42	3.37
68	600754	锦江股份	3,777,748.16	3.31
69	000555	神州信息	3,775,320.67	3.31
70	600297	广汇汽车	3,768,686.00	3.30
71	601001	大同煤业	3,708,907.00	3.25
72	600525	长园集团	3,622,096.00	3.17
73	600893	航发动力	3,587,653.70	3.14
74	600795	国电电力	3,586,778.00	3.14
75	002131	利欧股份	3,579,104.00	3.13
76	600282	南钢股份	3,553,441.70	3.11
77	601985	中国核电	3,548,117.00	3.11
78	002463	沪电股份	3,483,870.15	3.05
79	000726	鲁泰A	3,443,965.58	3.02
80	600801	华新水泥	3,422,166.20	3.00
81	002396	星网锐捷	3,400,507.60	2.98
82	600104	上汽集团	3,376,530.00	2.96
83	002470	金正大	3,356,123.07	2.94
84	600737	中粮糖业	3,337,356.00	2.92
85	000826	启迪桑德	3,301,626.00	2.89
86	000540	中天城投	3,290,575.00	2.88
87	600565	迪马股份	3,267,077.00	2.86
88	601688	华泰证券	3,257,704.00	2.85
89	601088	中国神华	3,177,159.00	2.78
90	600873	梅花生物	3,167,348.00	2.77
91	002048	宁波华翔	3,159,398.00	2.77
92	600900	长江电力	3,144,956.00	2.75

93	601628	中国人寿	3,127,905.64	2.74
94	600580	卧龙电气	3,090,100.14	2.71
95	000418	小天鹅A	3,077,032.02	2.70
96	002174	游族网络	3,062,357.49	2.68
97	002444	巨星科技	3,048,395.00	2.67
98	600019	宝钢股份	3,015,710.00	2.64
99	000712	锦龙股份	3,003,075.00	2.63
100	601398	工商银行	2,969,929.00	2.60
101	601601	中国太保	2,966,367.00	2.60
102	000830	鲁西化工	2,961,153.00	2.59
103	300274	阳光电源	2,948,095.26	2.58
104	600260	凯乐科技	2,946,123.00	2.58
105	600688	上海石化	2,942,221.00	2.58
106	600816	安信信托	2,940,928.00	2.58
107	002050	三花智控	2,898,613.00	2.54
108	600031	三一重工	2,840,911.00	2.49
109	000536	华映科技	2,837,078.00	2.48
110	002309	中利科技	2,813,802.00	2.46
111	600563	法拉电子	2,786,940.36	2.44
112	000402	金融街	2,766,150.14	2.42
113	601699	潞安环能	2,759,227.00	2.42
114	600335	国机汽车	2,758,516.00	2.42
115	600428	中远海特	2,755,395.00	2.41
116	601928	凤凰传媒	2,731,273.57	2.39
117	600704	物产中大	2,711,479.00	2.37
118	600872	中炬高新	2,706,465.75	2.37
119	600809	山西汾酒	2,705,333.00	2.37
120	000876	新希望	2,702,795.65	2.37
121	600499	科达洁能	2,702,155.00	2.37
122	000021	深科技	2,677,735.94	2.35
123	600060	海信电器	2,654,596.52	2.33
124	600519	贵州茅台	2,637,394.97	2.31
125	002142	宁波银行	2,617,736.90	2.29
126	600309	万华化学	2,605,225.20	2.28
127	603589	口子窖	2,570,178.00	2.25
128	600038	中直股份	2,562,855.00	2.24

129	000959	首钢股份	2,556,440.00	2.24
130	600426	华鲁恒升	2,543,663.00	2.23
131	600188	兖州煤业	2,526,471.22	2.21
132	600657	信达地产	2,502,882.00	2.19
133	000728	国元证券	2,482,093.50	2.17
134	603766	隆鑫通用	2,478,355.80	2.17
135	600970	中材国际	2,476,902.00	2.17
136	603799	华友钴业	2,468,302.00	2.16
137	002601	佰利联	2,460,392.00	2.16
138	600757	长江传媒	2,457,633.00	2.15
139	600176	中国巨石	2,416,512.00	2.12
140	600511	国药股份	2,413,536.54	2.11
141	600518	康美药业	2,406,742.00	2.11
142	002416	爱施德	2,392,762.20	2.10
143	300115	长盈精密	2,391,196.31	2.09
144	600498	烽火通信	2,385,961.36	2.09
145	000709	河钢股份	2,375,070.00	2.08
146	600804	鹏博士	2,372,170.04	2.08
147	601899	紫金矿业	2,361,063.00	2.07
148	600068	葛洲坝	2,355,594.00	2.06
149	601866	中远海发	2,328,995.00	2.04
150	002128	露天煤业	2,328,803.95	2.04
151	601225	陕西煤业	2,322,203.00	2.03
152	600373	中文传媒	2,300,630.53	2.02

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	16,466,603.79	14.42
2	601818	光大银行	15,632,149.97	13.69
3	601288	农业银行	12,967,212.06	11.36
4	601166	兴业银行	12,383,154.78	10.85
5	600016	民生银行	11,311,177.72	9.91
6	601668	中国建筑	9,274,751.03	8.12

7	600000	浦发银行	8,867,435.89	7.77
8	601377	兴业证券	8,855,892.66	7.76
9	600029	南方航空	8,533,268.87	7.47
10	000039	中集集团	8,525,834.22	7.47
11	601186	中国铁建	8,408,231.23	7.36
12	600690	青岛海尔	8,387,635.30	7.35
13	601006	大秦铁路	7,395,535.32	6.48
14	000858	五粮液	7,334,367.65	6.42
15	000623	吉林敖东	7,284,977.22	6.38
16	600028	中国石化	7,284,303.97	6.38
17	600048	保利地产	7,182,119.19	6.29
18	002456	欧菲光	7,172,335.65	6.28
19	002024	苏宁云商	7,041,805.94	6.17
20	600015	华夏银行	6,386,420.80	5.59
21	000415	渤海金控	6,209,671.75	5.44
22	002195	二三四五	5,965,410.50	5.23
23	600886	国投电力	5,888,882.67	5.16
24	600141	兴发集团	5,779,513.80	5.06
25	002152	广电运通	5,755,472.60	5.04
26	000060	中金岭南	5,681,137.44	4.98
27	000983	西山煤电	5,660,494.01	4.96
28	002183	怡亚通	5,623,903.36	4.93
29	002078	太阳纸业	5,560,889.10	4.87
30	000568	泸州老窖	5,432,319.90	4.76
31	000718	苏宁环球	5,392,484.59	4.72
32	000686	东北证券	5,365,723.72	4.70
33	000338	潍柴动力	5,339,433.23	4.68
34	002007	华兰生物	5,330,283.46	4.67
35	600409	三友化工	5,236,760.96	4.59
36	002304	洋河股份	5,177,428.84	4.53
37	601390	中国中铁	5,122,488.60	4.49
38	000528	柳工	5,084,489.43	4.45
39	002500	山西证券	4,883,967.52	4.28
40	600808	马钢股份	4,875,783.59	4.27
41	600597	光明乳业	4,816,799.38	4.22
42	000725	京东方A	4,787,886.61	4.19
43	002714	牧原股份	4,755,538.89	4.17
44	600383	金地集团	4,737,044.52	4.15

45	000069	华侨城 A	4,694,483.09	4.11
46	000630	铜陵有色	4,655,082.83	4.08
47	600170	上海建工	4,633,721.06	4.06
48	601233	桐昆股份	4,533,183.55	3.97
49	600919	江苏银行	4,406,697.57	3.86
50	000625	长安汽车	4,381,694.46	3.84
51	002463	沪电股份	4,352,403.54	3.81
52	000425	徐工机械	4,338,227.55	3.80
53	600023	浙能电力	4,322,980.75	3.79
54	600074	ST 保千里	4,311,230.90	3.78
55	002244	滨江集团	4,246,510.20	3.72
56	600582	天地科技	4,024,732.20	3.53
57	600859	王府井	4,020,041.52	3.52
58	002241	歌尔股份	3,962,200.18	3.47
59	600089	特变电工	3,944,640.05	3.46
60	600674	川投能源	3,938,785.27	3.45
61	002396	星网锐捷	3,936,665.92	3.45
62	000001	平安银行	3,934,967.94	3.45
63	000661	长春高新	3,916,841.33	3.43
64	000761	本钢板材	3,891,180.15	3.41
65	601997	贵阳银行	3,830,827.47	3.36
66	600297	广汇汽车	3,800,622.58	3.33
67	600795	国电电力	3,793,207.13	3.32
68	600252	中恒集团	3,767,608.38	3.30
69	000400	许继电气	3,755,706.75	3.29
70	000786	北新建材	3,724,145.62	3.26
71	600893	航发动力	3,706,990.46	3.25
72	600282	南钢股份	3,675,318.39	3.22
73	600801	华新水泥	3,630,945.01	3.18
74	600160	巨化股份	3,617,913.03	3.17
75	601985	中国核电	3,577,780.20	3.13
76	600104	上汽集团	3,553,020.25	3.11
77	601088	中国神华	3,544,706.92	3.10
78	600754	锦江股份	3,514,501.98	3.08
79	002131	利欧股份	3,489,359.01	3.06
80	000555	神州信息	3,477,903.80	3.05
81	002309	中利科技	3,467,529.45	3.04
82	000726	鲁 泰 A	3,378,486.55	2.96

83	000540	中天城投	3,373,001.37	2.95
84	002470	金正大	3,364,989.82	2.95
85	000826	启迪桑德	3,316,782.41	2.91
86	600737	中粮糖业	3,286,674.26	2.88
87	600019	宝钢股份	3,282,485.42	2.88
88	600900	长江电力	3,210,942.14	2.81
89	601688	华泰证券	3,188,499.14	2.79
90	601628	中国人寿	3,144,385.20	2.75
91	002174	游族网络	3,134,275.86	2.75
92	600872	中炬高新	3,115,481.41	2.73
93	600499	科达洁能	3,083,998.74	2.70
94	600335	国机汽车	3,080,425.84	2.70
95	002444	巨星科技	3,046,435.71	2.67
96	600816	安信信托	3,034,799.79	2.66
97	601398	工商银行	3,031,043.00	2.65
98	000712	锦龙股份	3,029,199.46	2.65
99	601601	中国太保	3,013,068.46	2.64
100	002050	三花智控	2,995,252.70	2.62
101	600031	三一重工	2,991,894.16	2.62
102	600688	上海石化	2,985,090.43	2.61
103	000830	鲁西化工	2,936,017.38	2.57
104	600260	凯乐科技	2,926,019.00	2.56
105	601699	潞安环能	2,912,446.71	2.55
106	600873	梅花生物	2,844,577.54	2.49
107	000418	小天鹅A	2,838,304.81	2.49
108	601001	大同煤业	2,830,166.43	2.48
109	600309	万华化学	2,816,319.55	2.47
110	600519	贵州茅台	2,809,911.23	2.46
111	600809	山西汾酒	2,808,533.97	2.46
112	000959	首钢股份	2,731,426.46	2.39
113	300274	阳光电源	2,714,944.10	2.38
114	002048	宁波华翔	2,713,477.07	2.38
115	600704	物产中大	2,703,664.81	2.37
116	601928	凤凰传媒	2,696,612.90	2.36
117	603799	华友钴业	2,689,721.02	2.36
118	000876	新希望	2,686,367.00	2.35
119	000402	金融街	2,677,997.24	2.35
120	600563	法拉电子	2,674,786.11	2.34

121	002142	宁波银行	2,613,687.74	2.29
122	000709	河钢股份	2,613,317.24	2.29
123	000728	国元证券	2,593,189.88	2.27
124	600038	中直股份	2,581,466.67	2.26
125	600188	兖州煤业	2,555,457.05	2.24
126	600426	华鲁恒升	2,555,447.53	2.24
127	600518	康美药业	2,526,608.94	2.21
128	000021	深科技	2,526,267.02	2.21
129	601225	陕西煤业	2,481,663.62	2.17
130	600498	烽火通信	2,476,653.89	2.17
131	000536	华映科技	2,469,062.94	2.16
132	603766	隆鑫通用	2,439,418.51	2.14
133	002601	佰利联	2,395,203.99	2.10
134	600060	海信电器	2,389,512.54	2.09
135	600580	卧龙电气	2,389,292.03	2.09
136	601899	紫金矿业	2,384,331.49	2.09
137	600176	中国巨石	2,374,798.87	2.08
138	600068	葛洲坝	2,354,750.19	2.06
139	600428	中远海特	2,345,789.24	2.05
140	601866	中远海发	2,318,430.50	2.03
141	600657	信达地产	2,286,813.89	2.00

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	1,071,794,035.61
卖出股票收入（成交）总额	1,060,256,384.78

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

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）	34,218.40	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,218.40	0.05

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	110040	生益转债	280	30,318.40	0.04
2	123004	铁汉转债	39	3,900.00	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1801	IC1801	-34	-42,563,920.00	-297,802.22	-
公允价值变动总额合计（元）					-297,802.22
股指期货投资本期收益（元）					-13,433,496.60
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-175,863.40

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金利用股指期货与股票现货组合之间进行对冲，并通过量化模型，寻找最优的股指期货对冲工具构建整个组合，从而剥离现货组合的系统性风险，仅保留现货组合相对于期货组合的超额收益，力争在牛市和熊市中均为投资者获取稳健的正向收益。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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	8,984,410.97
2	应收证券清算款	7,080,329.46
3	应收股利	-
4	应收利息	-2,404.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,062,336.35

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600525	长园集团	1,505,655.45	2.00	重大资产事项
2	600666	奥瑞德	1,180,416.00	1.57	重大资产重组

8.12.6 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。

§ 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

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
1,563	47,497.63	10,000,350.00	13.47%	64,238,444.56	86.53%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.00%

9.3 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 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	-	-	-	-	-
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	10,000,350.00	13.47	10,000,350.00	13.47	自基金合同 生效之日起 不少于三年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,350.00	13.47	10,000,350.00	13.47	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年4月21日）基金份额总额	709,513,460.11
本报告期期初基金份额总额	111,660,551.77
本报告期基金总申购份额	88,826,293.55
减:本报告期基金总赎回份额	126,248,050.76
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	74,238,794.56

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；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。

2017 年 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

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 80,000.00 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到任何稽查或处罚。

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	
中投证券	2	479,727,279.66	22.52%	350,826.32	22.52%	-
华泰证券	2	353,397,603.09	16.59%	258,439.34	16.59%	-
中金公司	2	335,302,914.23	15.74%	245,208.12	15.74%	-
申万宏源证 券	2	256,563,591.64	12.04%	187,625.24	12.04%	-
民族证券	1	161,352,566.29	7.57%	117,996.64	7.57%	-
方正证券	1	146,773,746.06	6.89%	107,336.69	6.89%	-
太平洋	2	91,780,841.50	4.31%	67,119.08	4.31%	-
银河证券	2	84,466,106.52	3.96%	61,770.66	3.96%	-
广发证券	2	72,401,141.12	3.40%	52,947.45	3.40%	-
国信证券	2	59,366,987.71	2.79%	43,415.17	2.79%	-
国金证券	2	55,604,839.77	2.61%	40,664.80	2.61%	-
西藏东财	2	33,615,947.49	1.58%	24,583.51	1.58%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

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、个股分析的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
中投证券	2,417.20	11.15%	1,048,700,000.00	38.79%	-	-
华泰证券	-	-	974,500,000.00	36.05%	-	-
中金公司	-	-	364,300,000.00	13.48%	-	-
申万宏源证券	-	-	16,000,000.00	0.59%	-	-
民族证券	-	-	17,600,000.00	0.65%	-	-
方正证券	2,823.18	13.03%	-	-	-	-
太平洋	-	-	41,500,000.00	1.54%	-	-
银河证券	-	-	37,900,000.00	1.40%	-	-
广发证券	-	-	85,000,000.00	3.14%	-	-
国信证券	16,433.45	75.82%	53,800,000.00	1.99%	-	-
国金证券	-	-	44,700,000.00	1.65%	-	-
西藏东财	-	-	19,200,000.00	0.71%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 1 月 20 日
2	2017 年春节假期期间交易及服务提示	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 1 月 23 日
3	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 2 月 23 日
4	关于新增平安证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 2 月 28 日
5	关于旗下部分基金新增上海好买基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 15 日
6	关于新增上海万得投资顾问有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 15 日
7	关于中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金增加销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 15 日
8	关于新增上海陆享投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 22 日
9	关于中金绝对收益策略定期开放混合型基金开放申购、赎回及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 28 日

10	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年3月28日
11	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金2016年度报告及其摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年3月31日
12	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金2017年第1季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年4月21日
13	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年4月22日
14	关于新增中国银河证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年5月26日
15	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书及其摘要(2017年第1号)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年6月3日
16	关于中金绝对收益策略定期开放混合型基金开放申购、赎回和转换相关业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年6月28日
17	关于中金基金管理有限公司调整旗下基金最低持有份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年6月29日
18	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年7月4日
19	关于新增上海基煜基金销售有限公司	《中国证券报》、《上	2017年7月4日

	公司为销售机构的公告	海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	
20	关于中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开展赎回费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年7月5日
21	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年7月21日
22	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告及其摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年8月29日
23	关于新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年8月3日
24	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京肯特瑞财富投资管理有限公司费率活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年8月3日
25	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告及其摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年8月29日
26	关于新增和讯科技有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年9月8日
27	关于新增北京蛋卷销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年9月16日
28	关于中金绝对收益策略定期开放混合型基金开放申购、赎回和转换相关业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年9月29日

29	关于旗下部分基金新增上海天天基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 10 月 23 日
30	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 10 月 26 日
31	关于新增通华财富（上海）基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 11 月 13 日
32	关于新增洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 12 月 2 日
33	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书及其摘要(2017 年第 2 号)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 12 月 5 日
34	关于新增北京唐鼎耀华投资咨询有限公司销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 12 月 13 日
35	中金基金管理有限公司关于旗下公募基金及特定客户资产管理计划实施增值税政策的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 12 月 30 日

§ 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

本报告期内，本基金单一投资者持有份额比例没有超过总份额 20%的情况。

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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金之法律意见书
- 5、《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 6、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 8、本报告期内在指定媒介上披露的有关本基金的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/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和复印件。

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

2018年3月30日