

中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告

2018 年 9 月 30 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

报告送出日期：2018 年 10 月 24 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 中金丰鸿 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 004712 |
| 交易代码 | 004712 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 6,599,776.39 份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。 |
| 投资策略 | 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 | 中证 500 指数收益率×50%+中债综合财富（总值）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。 |

| | | |
|-----------------|----------------|-------------|
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中金丰鸿 A | 中金丰鸿 C |
| 下属分级基金的场内简称 | - | - |
| 下属分级基金的交易代码 | 004712 | 004713 |
| 下属分级基金的前端交易代码 | - | - |
| 下属分级基金的后端交易代码 | - | - |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 6,584,918.14 份 | 14,858.25 份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | - | - |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2018年7月1日—2018年9月30日） | |
|-----------------|---------------------------|-----------|
| | 中金丰鸿 A | 中金丰鸿 C |
| 1. 本期已实现收益 | -6,635,566.93 | -4,495.16 |
| 2. 本期利润 | -2,102,682.06 | -1,417.35 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0399 | -0.0583 |
| 4. 期末基金资产净值 | 6,183,913.96 | 13,818.51 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9391 | 0.9300 |

1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
2. 本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金丰鸿 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -5.39% | 0.60% | -3.23% | 0.64% | -2.16% | -0.04% |

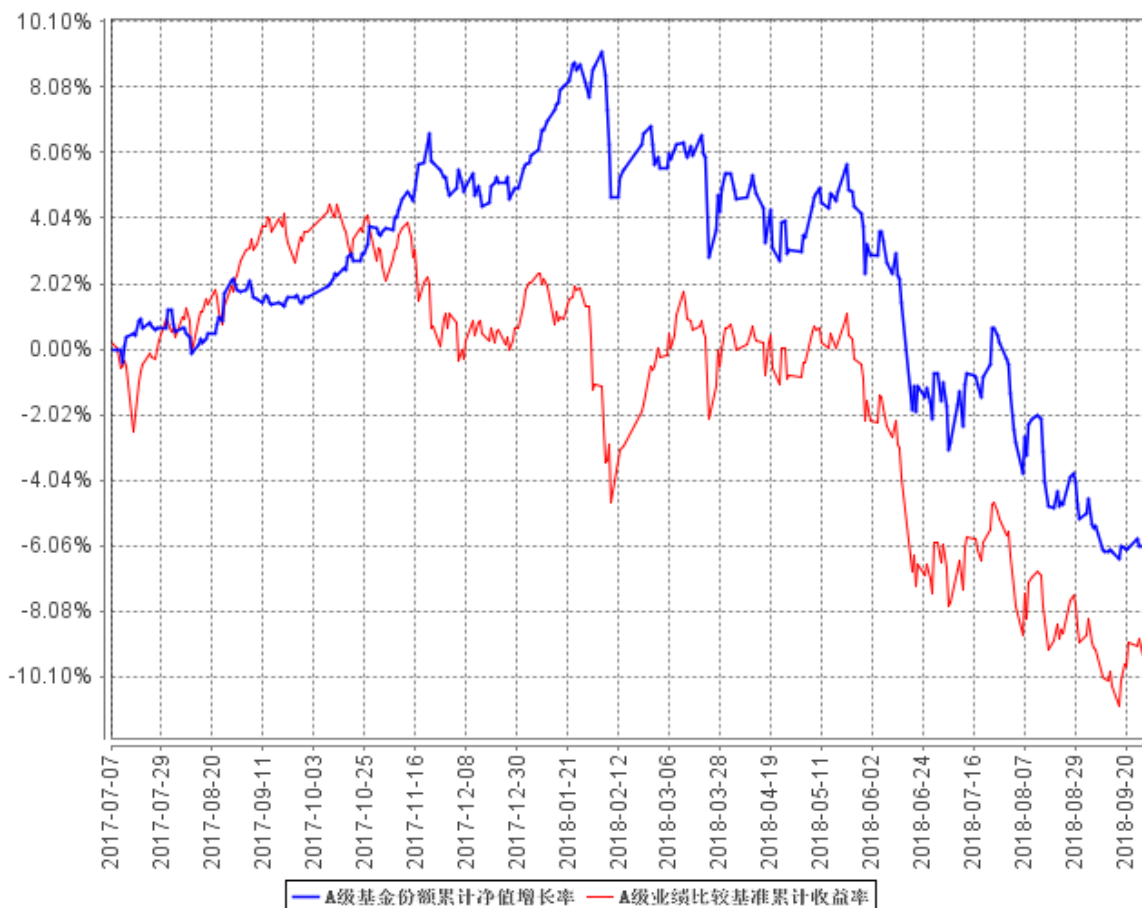
中金丰鸿 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -5.39% | 0.60% | -3.23% | 0.64% | -2.16% | -0.04% |

| | | | | | | |
|-------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三个月 | -5.35% | 0.60% | -3.23% | 0.64% | -2.12% | -0.04% |
|-------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|

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

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



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。建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3.3 其他指标

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-----------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 石玉 | 本基金基金经理 | 2017 年 7 月 7 日 | - | 11 年 | 石玉女士，管理学硕士。历任中国科技证券、联合证券职员，天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员，中国国际金融股份有限公司资产管理部高级研究员、基金经理助理、投资经理，现任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理，执行总经理。 |
| 郭党钰 | 本基金基金经理 | 2017 年 7 月 7 日 | - | 16 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基金经理、执行总经理。 |
| 刘重晋 | 本基金基金经理 | 2017 年 8 月 2 日 | - | 7 年 | 刘重晋先生，博士。历任松河投资咨询（深圳）有限公司任副总经理、量化研究员。现任中金基金管理有限公司量化投资部基金经理、高级经理。 |
| 闫雯雯 | 本基金基金经理助理 | 2017 年 8 月 24 日 | - | 10 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。 |

1、对本基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为本基金管理人对外披露的基金经理离任日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”为本

基金管理人对外披露的任免日期。

2、本基金基金经理助理的任职日期、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《证券业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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》和其他有关法律法规及本基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年三季度，A 股市场呈现出小幅震荡下行的趋势，沪深 300 指数由 3510 点下跌 2.05%至 3438 点，中证 500 指数从 5217 点下跌至 4800 点，下跌幅度达 7.99%，市场整体表现较为弱势。

三季度中由于本基金的投资需要，基本清空了股票持仓，短期内当前基金主要进行风险较低的固定收益类的产品投资。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。

展望下一季度，贸易战在一段时间内仍然会对市场造成一定影响，金融监管环境及宏观的货币政策有略微放松的趋势，仍需耐心等待与观察。当前市场环境下，盈利能力强、盈利稳定、经营质量好的公司更占优势，需要我们更加关注。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金丰鸿 A 基金份额净值为 0.9391 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.39%；截至本报告期末中金丰鸿 C 基金份额净值为 0.9300 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.35%；同期业绩比较基准收益率为-3.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金资产净值已连续 20 个工作日低于五千万元（2018 年 8 月 16 日，首次净值低于五千万元）。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|--------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 243,119.07 | 3.60 |
| | 其中：股票 | 243,119.07 | 3.60 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 900,000.00 | 13.32 |
| | 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 | 4,044,870.01 | 59.88 |
| 8 | 其他资产 | 1,567,211.25 | 23.20 |
| 9 | 合计 | 6,755,200.33 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 24,428.00 | 0.39 |
| C | 制造业 | 106,773.00 | 1.72 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 7,518.00 | 0.12 |
| F | 批发和零售业 | 41,956.00 | 0.68 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 55,001.57 | 0.89 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 7,442.50 | 0.12 |
| 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 | 243,119.07 | 3.92 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1 | 300324 | 旋极信息 | 7,171 | 55,001.57 | 0.89 |
| 2 | 600335 | 国机汽车 | 4,700 | 38,775.00 | 0.63 |
| 3 | 600759 | 洲际油气 | 6,200 | 24,428.00 | 0.39 |
| 4 | 002512 | 达华智能 | 2,500 | 24,150.00 | 0.39 |
| 5 | 600796 | 钱江生化 | 3,600 | 21,888.00 | 0.35 |
| 6 | 300108 | 吉药控股 | 2,700 | 21,033.00 | 0.34 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 7 | 002011 | 盾安环境 | 3,900 | 19,110.00 | 0.31 |
| 8 | 600768 | 宁波富邦 | 1,000 | 11,040.00 | 0.18 |
| 9 | 300197 | 铁汉生态 | 1,400 | 7,518.00 | 0.12 |
| 10 | 002573 | 清新环境 | 650 | 7,442.50 | 0.12 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券类资产。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券类资产。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 65,363.71 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,502,481.78 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | -634.24 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,567,211.25 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 300324 | 旋极信息 | 55,001.57 | 0.89 | 临时停牌 |
| 2 | 600335 | 国机汽车 | 38,775.00 | 0.63 | 临时停牌 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|------|------|
| 3 | 600759 | 洲际油气 | 24,428.00 | 0.39 | 临时停牌 |
| 4 | 002512 | 达华智能 | 24,150.00 | 0.39 | 临时停牌 |
| 5 | 600796 | 钱江生化 | 21,888.00 | 0.35 | 临时停牌 |
| 6 | 300108 | 吉药控股 | 21,033.00 | 0.34 | 临时停牌 |
| 7 | 002011 | 盾安环境 | 19,110.00 | 0.31 | 临时停牌 |
| 8 | 600768 | 宁波富邦 | 11,040.00 | 0.18 | 临时停牌 |
| 9 | 300197 | 铁汉生态 | 7,518.00 | 0.12 | 临时停牌 |
| 10 | 002573 | 清新环境 | 7,442.50 | 0.12 | 临时停牌 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中金丰鸿 A | 中金丰鸿 C |
|---------------------------|----------------|-----------|
| 报告期期初基金份额总额 | 100,890,203.05 | 26,975.19 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 22,170.99 | 4,181.89 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 94,327,455.90 | 16,298.83 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 6,584,918.14 | 14,858.25 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|--------------------------------|---------------|------|---------------|--------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2018 年 7 月 1 日-2018 年 9 月 30 日 | 21,491,310.04 | - | 14,950,000.00 | 6,541,310.04 | 99.11% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| | | | | | | | |
| | | | | | | | |

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、本基金申请募集注册的法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 7、中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

8、中国证监会要求的其他文件

9.2 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。

9.3 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10月24日