

**中金福睿 1 号集合资产管理计划
2018 年年度报告**

2018 年 12 月 31 日

集合计划管理人：中国国际金融股份有限公司

集合计划托管人：中国工商银行股份有限公司广州分行

送出日期：2019 年 3 月 25 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本报告由中金福睿 1 号集合资产管理计划（“本集合计划”）管理人中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）编制。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司广州分行根据本集合计划合同规定，于 2019 年 3 月 23 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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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集合计划合同、说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 集合计划简介	4
2.1 集合计划基本情况	4
2.2 集合计划产品说明	4
2.3 集合计划管理人和集合计划托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、集合计划净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 集合计划净值表现	6
3.3 最近三年集合计划的利润分配情况	7
§4 管理人报告	8
4.1 集合计划管理人及集合计划主办人情况	8
4.2 管理人对报告期内本集合计划运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内集合计划的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对报告期内集合计划利润分配情况的说明	10
§5 审计报告签字页	11
§6 投资组合报告	13
6.1 期末集合计划资产组合情况	13
6.2 投资组合报告附注	13
6.2.1 声明本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期是否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。	13
§7 集合计划份额持有人信息	15
7.1 期末集合计划份额持有人户数及持有人结构	15
§8 集合计划份额变动	15
§9 重大事件揭示	16
9.1 集合计划管理人、集合计划托管人的专门集合计划托管部门的重大人事变动	16
9.2 涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼	16
9.3 集合计划投资策略的改变	16
9.4 为集合计划进行审计的会计师事务所情况	16
9.5 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	16

9.6 其他重大事件	16
§10 影响投资者决策的其他重要信息	17
10.1 集合计划托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	17
10.2 涉及集合计划托管业务的诉讼情况	17
10.3 集合计划托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	17
10.4 影响投资者决策的其他重要信息	17
§11 备查文件目录	18
11.1 本集合计划备查文件目录	18
11.2 存放地点	18
11.3 查阅方式	18
附件一：审计报告正文	21
附件二：托管人报告	22
附件三：托管人履职报告	23

§2 集合计划简介

2.1 集合计划基本情况

集合计划名称	中金福睿1号集合资产管理计划
集合计划简称	中金福睿1号
交易代码	920114
集合计划运作方式	开放式
集合计划合同成立日	2018年5月29日
报告期末集合计划份额总额	128116697.25份
集合计划合同存续期	无固定存续期

2.2 集合计划产品说明

投资目标	本集合计划在有效控制风险的基础上,采用稳健增强型的策略,通过在不同资产类别子基金间的战略配置和动态调整,使整体投资组合在中等风险水平下,达到中高水平的收益。从控制风险的角度考虑,大比例配置低风险和中低风险的资产。从平衡收益的角度考虑,配置一定部分的中高风险和高风险的资产来提高收益水平。通过基本面分析和量化手段,对各类资产以及底层的子基金进行动态调整。在此过程中严格遵守预先设立的风险控制指标,从组合层面控制投资风险,辅以在必要时投资于货币市场基金、同业存单、银行存款、债券逆回购等现金管理类产品,以追求委托资产的长期价值增长。
投资策略	无
业绩比较基准	本集合计划属于中等风险(R3)产品,适合风险承受能力为激进型(C5)、积极型(C4)、稳健型(C3)的投资者。
风险收益特征	中国国际金融股份有限公司

2.3 集合计划管理人和集合计划托管人

项目	集合计划管理人	集合计划托管人
----	---------	---------

名称	中国国际金融股份有限公司	中国工商银行股份有限公司 广州分行
客户服务电话	800-810-8802（固话用户）， (010)6505-0105（手机用户）	020-83786666
传真	8610 65059372	
注册地址	北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层	广州市大沙头路 29 号工银大厦
办公地址	北京朝阳区建国门外大街 1 号国贸 3 期 B 座 42 层	广州市大沙头路 29 号工银大厦
邮政编码	100004	510000
法定代表人/单位负责人	毕明建（代）	周骏

2.4 信息披露方式

登载集合计划年度报告管理人互联网网址	http://www.cicc.com.cn/AssetMgmt
--------------------	---

2.5 其他相关资料

项目	会计师事务所	注册登记机构
名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国证券登记结算有限责任公司
办公地址	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 座 8 层	中国北京市西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

§3 主要财务指标、集合计划净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年
本期已实现收益	-231920.86
本期利润	-634101.22
加权平均集合计划份额本期利润	-0.0049
本期加权平均净值利润率	-0.50%
本期集合计划份额净值增长率	-0.49%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年
期末可供分配利润	-634,101.22
期末可供分配集合计划份额利润	-0.0049
期末集合计划资产净值	127,482,596.03
期末集合计划份额净值	0.9951
3.1.3 累计期末指标	2018 年
集合计划份额累计净值增长率	-0.49%

注：①所述集合计划业绩指标不包括持有人交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益。

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的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

④本集合计划于 2018 年 5 月 29 日成立，故本集合计划 2018 年当年的数据和指标为非完整会计年度数据。

3.2 集合计划净值表现

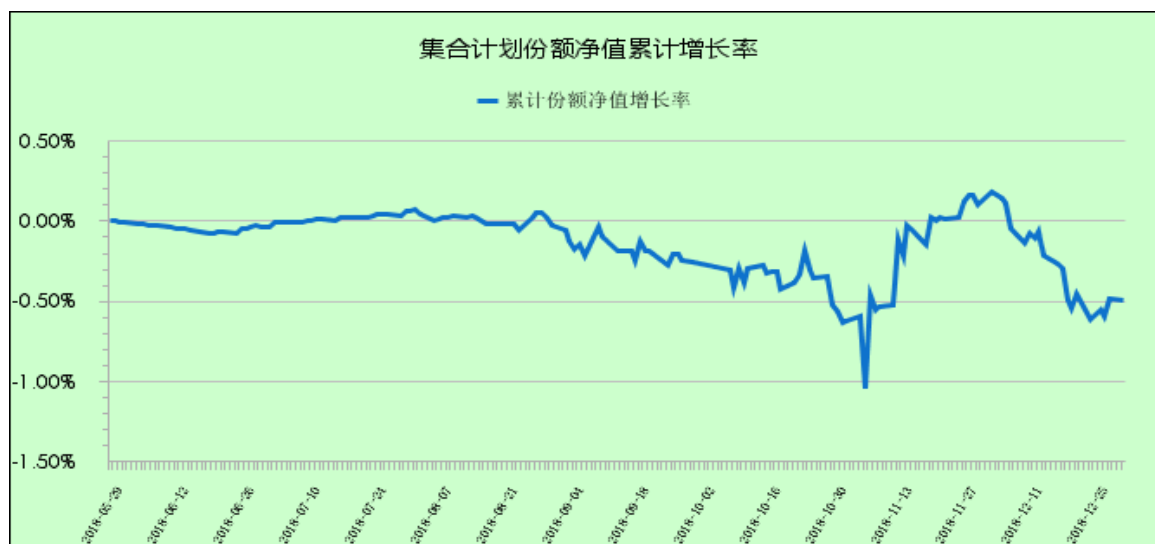
3.2.1 集合计划份额净值增长率

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②
过去三个月	-0.24%	0.14%
过去六个月	-0.45%	0.10%
自集合计划合同生效起至今	-0.49%	0.09%

注：本集合计划于 2018 年 5 月 29 日成立，成立当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

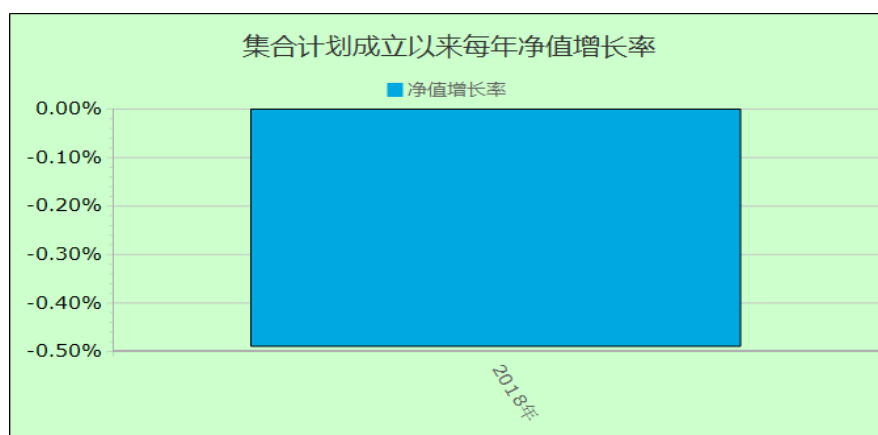
3.2.2 自集合计划合同成立以来集合计划份额累计净值增长率变动

中金福睿 1 号集合资产管理计划累计份额净值增长率历史走势图
(2018 年 5 月 29 日至 2018 年 12 月 31 日)



3.2.3 自集合计划合同成立以来集合计划每年净值增长率

中金福睿 1 号集合资产管理计划每年净值增长率
(2018 年 5 月 29 日至 2018 年 12 月 31 日)



注：本集合计划于 2018 年 5 月 29 日成立，成立当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 最近三年集合计划的利润分配情况

本集合计划自成立以来集合计划无利润分配情况。

§4 管理人报告

4.1 集合计划管理人及集合计划主办人情况

4.1.1 集合计划管理人及其管理集合计划的经验

中国国际金融股份有限公司（“中金公司”或“中金”）是中国首家中外合资投资银行。自1995年成立以来，中金一直致力于为客户提供高质量金融增值服务，建立了以研究为基础，投资银行、股票业务、固定收益、财富管理和投资管理全方位发展的业务结构。凭借深厚的经济、行业、法律法规等专业知识和优质的客户服务，中金在海内外媒体评选中屡获“中国最佳投资银行”“最佳销售服务团队”“最具影响力研究机构”等殊荣。2015年，中金在香港联交所主办成功挂牌上市。2017年，中金与中国中投证券有限责任公司的战略重组完成，中投证券成为中金的全资子公司。秉承“植根中国，融通世界”的理念，通过境内外业务的无缝对接，中金将持续为客户提供一流的金融服务，协助客户实现其战略发展目标。

中金公司资产管理部成立于2002年，参照国际行业标准与国内监管要求，构建了面向境内外市场统一的资产管理业务平台、内部控制体系和风险管理流程，致力于为境内外客户提供全方位优质服务，实现客户资产的长期稳步增值。

中金公司资产管理业务牌照齐全、产品丰富，拥有全国社保基金管理人、企业年金投资管理人、保险资金投资管理人、境内集合/定向资产管理（定向专户）、QDII集合/定向资产管理、人民币境外合格机构投资者（RQFII）、境外合格机构投资者（QFII）等多项业务资格，并在香港设立了独立的资产管理子公司，获得香港资产管理牌照。截至2018年12月31日，中金公司境内共管理68只集合计划，同时管理着多个全国社保基金、企业年金基金和定向资产管理业务账户。

4.1.2 集合计划投资主办人简介

姓名	职务	任本集合计划 投资主办人期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡迪	投资经理	2018-5-29	至今	5年	胡迪女士毕业于美国哥伦比亚大学，拥有计算机工

				程学士和金融工程硕士学位。2012 年加入中金公司，负责量化策略和大类资产配置研究，现任中金公司集合计划投资主办人。胡女士有 10 年国内外量化投资经验，曾任职纽约美林证券和标准普尔，参与管理上亿美元的全球量化投资组合，覆盖北美、欧洲、日本等地的股票、期权、期货以及其他结构化衍生品。
--	--	--	--	--

4.2 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明

报告期内，2018 年 10 月 22 日之前，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《关于规范证券公司聘用第三方机构为集合资产管理计划提供投资决策相关专业服务的通知》其他相关法律法规以及本集合计划说明书和合同的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产。2018 年 10 月 22 日，证监会发布《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及配套规则（以下简称“资管新规”）后，在过渡期内，本集合计划管理人按照资管新规及本集合计划的说明书和合同的规定执行，确保平稳过渡。

报告期内，本集合计划合法合规运作，投资管理符合相关法律法规、本集合计划说明书和合同的规定，不存在违法违规、未履行合同承诺或损害本集合计划份额持有人利益的情形。

4.3 管理人对报告期内集合计划的投资策略和业绩表现的说明

截至 2018 年 12 月 31 日，本集合计划份额净值为 0.9951 元，累计份额净值为 0.9951 元，本期净值增长率为-0.49%。

4.3.1 报告期内投资运作分析

本产品成立于 2018 年 5 月 29 日，产品成立初期，通过动态资产配置模型对中期宏观经济周期的判断结合投资经理对于市场趋势的预期，叠加贸易摩擦的不确定性，我们对权益市场保持谨慎。同时由于信用风险事件频发，结合下行经济周期，对于信用利差及信用风险都

相对保守，所以我们选择追求相对收益的量化对冲策略并辅以少量择时能力较强的权益类基金进行配置，剩余部分做流动性管理以伺较好的加仓时点随时加仓。

报告期间股票市场大幅下跌，2018/5/29-2018/12/31，沪深 300 指数下跌-21.5%、中证 800 指数下跌-23.5%。福睿一号较好的规避了股票市场大跌及债券市场信用事件不断的风险。基金选择上，本基金首选具有稳定超额业绩的明星管理人管理的指数增强基金，搭配主动管理的股票基金和量化基金，在为组合提供稳定收益的同时严格控制组合波动。对于指数增强和量化对冲基金，主要考察基金超额收益的来源、与其他基金超额收益的相关性以及超额收益的稳定性等因素，结合我们对市场以及风格轮动的判断，优选数理建模和 IT 能力优势明显的管理人，并灵活调整基金的权重和风格。对于主动管理的股票基金，本基金主要使用多重归因分析，并重点考察基金的历史仓位及选股表现等因素。

截至 2018 年 12 月 31 日，福睿 1 号净值 0.9951，最大回撤-1.11%，波动率 1.20%，资产配置和风险控制能力较为突出。

4.3.2 市场展望与投资策略

权益资产方面，2019 年年初，贸易战缓和预期叠加联储鸽派信号，全球风险偏好有所回升。A 股在此背景下，受估值情绪修复、人民币升值、外资流入等多方正面因素推动，国内权益市场大幅反弹。短期来看，A 股技术面与情绪已处在相对高位，市场处于调整期，但 2 月财新 PMI 大幅好转，表明经济动能有逐渐企稳迹象。流动性与政策面推动的估值上涨行情正在演化成对于基本面行情的提前领跑。短期继续看好 2-3 个月基本面的持续好转，权益风险溢价还有收窄空间，牛市仍有空间，短期将仍然保持较高仓位的权益策略产品运行。

但从全年来看，权益市场仍然可能在下半年有二次回调风险。美国 PMI 向下趋势尚未恢复，下半年美国经济的继续放缓会给美股带来压力。如果美股调整期 A 股正处于高位，很可能带动 A 股同时回调。在全球经济与股市相关性不断提高的今天，我们会加强对于海外风险的监控、紧密跟踪经济周期，积极做好权益资产的策略配置与仓位调整。

债券方面，短期上，从近期的多项数据来看，国内的基本面已经出现了一些企稳的迹象，对债市脆弱的情绪可能有负面影响。另一方面，随着猪肉价格的上涨，猪周期所引发的通胀压力开始得到越来越多的关注，对债市带来负面情绪，短期债券市场大概率继续震荡调整。展望后市，国内部分结构性数据指向需求回暖的迹象，叠加贷款利率下行通道的开启，接下来经济下行的幅度和速度或有趋缓，组合债券策略保持中性。

组合配置上，在严控组合风险并满足合同中对于权益仓位的限制下，已于 19 年初大幅提升权益类策略配置至中性仓位，并增加市场优秀的指数增强策略，力争在牛市行情中，获取超越指数的业绩贡献。未来，我们将持续优化调整组合的资产结构和风格，把握市场机会。

4.4 管理人对报告期内集合计划利润分配情况的说明

根据法律法规及本集合计划合同的规定，本集合计划无需进行 2016 年度利润分配。

§5 审计报告签字页

毕马威华振审字第 1901186 号

中金福睿 1 号集合资产管理计划全体持有人:

我们审计了后附的第 1 页至第 19 页的中金福睿 1 号集合资产管理计划 (以下简称“该集合计划”) 的财务报表, 包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益 (集合计划净值) 变动表以及财务报表附注。这些财务报表已由该集合计划管理人按照财务报表附注 2 (以下简称“附注 2”) 所述的编制基础编制。

一、集合计划管理人对财务报表的责任

集合计划管理人负责按照附注 2 所述的编制基础编制财务报表 (包括确定附注 2 所述的编制基础对于在具体情况下编制财务报表的可接受性), 并负责设计、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。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制相关的内部控制, 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。审计工作还包括评价集合计划管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。

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。

审计报告 (续)

毕马威华振审字第 1901186 号

三、审计意见

我们认为，该集合计划的上述财务报表在所有重大方面按照附注 2 所述的编制基础编制。

四、强调事项

我们提醒财务报表使用者关注，如财务报表附注 4 所述，截至该集合计划财务报表批准报出日止，涉及该集合计划的部分税收法规尚未明确，该财务报表中就此所作出的估计可能会根据日后出台的相关税务法规而作出调整。

五、对分发和使用的限制

我们提醒财务报表使用者关注附注 2 对编制基础的说明。该集合计划财务报表仅为按照有关法规要求提交给该集合计划持有人、该集合计划托管人、该集合计划管理人以及相关监管部门之目的而编制，仅供该集合计划持有人、该集合计划托管人、该集合计划管理人以及相关监管部门使用。因此，该财务报表可能不适用于其他用途。

本报告仅供该集合计划持有人、该集合计划托管人、该集合计划管理人以及相关监管部门为上述目的使用。除此之外，本报告不应被任何其他人士所依赖用于任何其他目的。我们对任何其他人士使用本报告产生的一切后果不承担任何责任或义务。

上述第四部分和第五部分内容不影响已发表的审计意见。

毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)

中国注册会计师

奚霞

中国 北京

刘珊珊

2019 年 3 月 25 日

§6 投资组合报告

6.1 期末集合计划资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占集合计划总资产比例
1	权益投资	-	-
	其中: 股票	-	-
2	基金投资	62,500,000.00	48.44%
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	50,397,819.64	39.06%
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	14,932,464.99	11.57%
7	其他资产	1,207,188.11	0.94%
8	合计	129,037,472.74	100.00%

注: 其他资产包括存出保证金、应收股利、应收利息、应收参与款、待摊费用、其他应收款、应收证券清算款以及其他等。

6.2 投资组合报告附注

6.2.1 声明本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

报告期内本集合计划投资的前十名证券的发行主体不存在其他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。

6.2.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,203,902.96

4	应收利息	3,285.15
5	应收参与款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
	合计	1,207,188.11

6.2.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

6.2.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

6.2.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§7 集合计划份额持有人信息

7.1 期末集合计划份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的集合计划份额	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
92.00	1,392,572.80	0.00	0%	128,116,697.25	100%

§8 集合计划份额变动

单位：份

集合计划合同生效日（2018年5月29日）集合计划份额总额	128,116,697.25
报告期期初集合计划份额总额	128,116,697.25
报告期期间集合计划总参与份额	-
报告期期间集合计划总退出份额	-
报告期期间集合计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末集合计划份额总额	128,116,697.25

§9 重大事件揭示

9.1 集合计划管理人、集合计划托管人的专门集合计划托管部门的重大人事变动

9.1.1 集合计划管理人的重大人事变动

集合计划管理人无重大人事变动。

9.1.2 集合计划托管人的专门托管部门的重大人事变动

集合计划托管人的专门集合计划托管部门的重大无人人事变动。

9.2 涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼

本报告期无涉及本集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

9.3 集合计划投资策略的改变

本集合计划本报告期投资策略未发生改变。

9.4 为集合计划进行审计的会计师事务所情况

本集合计划本报告期内由毕马威华振会计师事务所提供审计服务，本报告期内应支付给该会计师事务所审计费 18,000.00 元。该事务所已连续为本集合计划提供 1 年审计服务。

9.5 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本集合计划管理人、托管人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚等情况。

9.6 其他重大事件

无

§10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 集合计划托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

10.2 涉及集合计划托管业务的诉讼情况

无。

10.3 集合计划托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.4 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§11 备查文件目录

11.1 本集合计划备查文件目录

- 11.1.1 《中金福睿1号集合资产管理计划说明书》
- 11.1.2 《中金福睿1号集合资产管理计划集合资产管理合同》
- 11.1.3 《中金福睿1号集合资产管理计划托管协议》
- 11.1.4 管理人业务资格批件、营业执照

11.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和/或集合计划托管人的住所。

11.3 查阅方式

- 11.3.1 网站: <http://www.cicc.com.cn/AsssetMgmt>
- 11.3.2 电话: 800-810-8802 (固话用户), (010)6505-0105 (手机用户)

附件一：审计报告全文

中金福睿1号集合资产管理计划

自2018年5月29日(合同生效日)
至2018年12月31日止期间财务报表

审计报告

毕马威华振审字第 1901186 号

中金福睿 1 号集合资产管理计划全体持有人:

我们审计了后附的第 1 页至第 17 页的中金福睿 1 号集合资产管理计划 (以下简称“该集合计划”) 的财务报表, 包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益 (集合计划净值) 变动表以及财务报表附注。这些财务报表已由该集合计划管理人按照财务报表附注 2 (以下简称“附注 2”) 所述的编制基础编制。

一、集合计划管理人对财务报表的责任

集合计划管理人负责按照附注 2 所述的编制基础编制财务报表 (包括确定附注 2 所述的编制基础对于在具体情况下编制财务报表的可接受性), 并负责设计、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。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制相关的内部控制, 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。审计工作还包括评价集合计划管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。

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。

审计报告 (续)

毕马威华振审字第 1901186 号

三、 审计意见

我们认为，该集合计划的上述财务报表在所有重大方面按照附注 2 所述的编制基础编制。

四、 强调事项

我们提醒财务报表使用者关注，如财务报表附注 4 所述，截至该集合计划财务报表批准报出日止，涉及该集合计划的部分税收法规尚未明确，该财务报表中就此所作出的估计可能会根据日后出台的相关税务法规而作出调整。

五、 对分发和使用的限制

我们提醒财务报表使用者关注附注 2 对编制基础的说明。该集合计划财务报表仅为按照有关法规要求提交给该集合计划持有人、该集合计划托管人、该集合计划管理人以及相关监管部门之目的而编制，仅供该集合计划持有人、该集合计划托管人、该集合计划管理人以及相关监管部门使用。因此，该财务报表可能不适用于其他用途。

本报告仅供该集合计划持有人、该集合计划托管人、该集合计划管理人以及相关监管部门为上述目的使用。除此之外，本报告不应被任何其他人士所依赖用于任何其他目的。我们对任何其他人士使用本报告产生的一切后果概不承担任何责任或义务。

上述第四部分和第五部分内容不影响已发表的审计意见。

毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)

中国注册会计师

奚霞

中国 北京

刘珊珊

中金福睿1号集合资产管理计划
资产负债表
2018年12月31日
(金额单位:人民币元)

	附注	2018年
资产		
银行存款	5	14,932,464.99
交易性金融资产	6	112,897,819.64
其中:基金投资		62,500,000.00
资产管理计划投资		50,397,819.64
应收利息	7	3,285.15
应收股利		1,203,902.96
		<hr/>
资产合计		<u>129,037,472.74</u>

刊载于第5页至第17页的财务报表附注为本财务报表的组成部分。

中金福睿 1 号集合资产管理计划
资产负债表 (续)
2018 年 12 月 31 日
(金额单位: 人民币元)

	附注	<u>2018 年</u>
负债和所有者权益		
负债		
应付管理人报酬		1,514,164.25
应付托管费		22,712.46
其他负债	8	<u>18,000.00</u>
负债合计		<u>1,554,876.71</u>
所有者权益		
实收基金	9	128,116,697.25
未弥补亏损	10	<u>(634,101.22)</u>
所有者权益合计		<u>127,482,596.03</u>
负债和所有者权益合计		<u>129,037,472.74</u>
集合计划份额 (份):		128,116,697.25
集合计划份额净值:		0.9951

此财务报表已获本集合计划管理人中国国际金融股份有限公司批准。

黄劲峯 首席财务执行官	冯平 资产管理部负责人	公司盖章
----------------	----------------	------

日期: 2019 年 3 月 22 日

刊载于第 5 页至第 17 页的财务报表附注为本财务报表的组成部分。

中金福睿 1 号集合资产管理计划
 利润表
 自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日)
 至 2018 年 12 月 31 日止期间
 (金额单位: 人民币元)

	附注	自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日止期间
收入		
利息收入		119,052.89
其中: 存款利息收入	11	119,052.89
投资净收益		1,203,902.96
其中: 股利收益	12	1,203,902.96
公允价值变动净损失	13	<u>(402,180.36)</u>
收入合计		<u>920,775.49</u>
减: 费用		
管理人报酬	16(c)iii	1,514,164.25
托管费	16(c)iv	22,712.46
其他费用	14	<u>18,000.00</u>
费用合计		<u>1,554,876.71</u>
净亏损		<u><u>(634,101.22)</u></u>

刊载于第 5 页至第 17 页的财务报表附注为本财务报表的组成部分。

中金福睿 1 号集合资产管理计划
所有者权益 (集合计划净值) 变动表
自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日止期间
(金额单位: 人民币元)

	附注	<u>实收基金</u> (附注 9)	<u>未弥补亏损</u> (附注 10)	<u>所有者权益合计</u>
期初所有者权益 (集合计划净值)		128,116,697.25	-	128,116,697.25
本期经营活动产生的集合计划 净值变动数 (本期净亏损)		-	(634,101.22)	(634,101.22)
期末所有者权益 (集合计划净值)		<u>128,116,697.25</u>	<u>(634,101.22)</u>	<u>127,482,596.03</u>

刊载于第 5 页至第 17 页的财务报表附注为本财务报表的组成部分。

中金福睿 1 号集合资产管理计划
财务报表附注
(金额单位: 人民币元)

1 基本情况

中金福睿 1 号集合资产管理计划 (“本集合计划”) 是依据中国证券监督管理委员会 (“中国证监会”) 于 2013 年 6 月 26 日修订并发布的《证券公司客户资产管理业务办法》以及《证券公司集合资产管理业务实施细则》设立的集合资产管理计划。本集合计划的管理人为中国国际金融股份有限公司 (“中金公司”), 托管人为中国工商银行股份有限公司广州分行 (“工商银行”)。

本集合计划由中国工商银行股份有限公司作为推广机构, 自 2018 年 5 月 7 日至 2018 年 5 月 25 日止期间进行推广。本集合计划于 2018 年 5 月 29 日成立, 成立之日集合计划实收份额为 128,116,697.25 份 (含利息转份额 16,697.25 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。

本集合计划存续期为 3 年, 主要投资于金融产品, 包括公募证券投资基金、基金公司及其子公司特定多个客户资产管理计划、证券公司集合资产管理计划、期货公司资产管理计划、保险资产管理计划、证券投资集合资金信托计划 (前述资管计划及信托计划须由托管人或保管人托管或保管)、中国证券投资基金业协会备案的并由具有基金托管业务资质或综合托管业务资质的托管人进行托管的私募证券投资基金 (若本计划认购处于募集期的私募证券投资基金, 可不受事前备案之限但应在该私募证券投资基金募集完毕后向基金业协会备案。本计划管理人应向本计划托管人提供被投资私募证券投资基金向基金业协会备案的有关证明材料) 等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国证监会认可的其他投资品种。所投资金融产品必须以股票、债券、期货等各类标准化金融资产和 / 或期权、收益互换为投资标的, 不得投资除公募证券投资基金以外的资产管理产品; 现金类资产 (包括货币市场基金、同业存单、债券逆回购、银行存款和现金)。

2 财务报表的编制基础

本集合计划财务报表是以持续经营为基础编制的。

本财务报表仅为按照有关法规要求向本集合计划持有人、本集合计划托管人、本集合计划管理人以及相关监管部门提供信息之目的而编制, 并仅供上述使用者为上述目的使用。

本财务报表附注中不披露风险管理和公允价值相关内容。因此, 本财务报表不是一份完整的财务报表, 也不包含一份完整财务报表所应披露的所有会计政策及附注

本财务报表根据以下附注 3 中所述的会计政策编制，这些会计政策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，同时按照中国证券业协会于 2012 年 10 月 19 日颁布的《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》的规定编制，亦参照了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》的规定。

3 主要会计政策

(1) 会计年度

本集合计划财务报表的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表是本集合计划的首份财务报表，涵盖期间为自 2018 年 5 月 29 日（合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间。

(2) 记账本位币及列报货币

本集合计划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。本集合计划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。

(3) 金融资产及金融负债的分类

本集合计划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、可供出售金融资产、持有至到期投资及其他金融负债。本集合计划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。本集合计划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。

本集合计划目前持有的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。

(4) 金融资产及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集合计划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，本集合计划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，且本集合计划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，虽然本集合计划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。

金融资产转移满足终止确认条件的，本集合计划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，本集合计划终止确认该金融负债或其一部分。

(5) 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本集合计划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。

本集合计划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，本集合计划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。

(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：

- 本集合计划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；
- 本集合计划计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

(7) 实收基金

实收基金为对外发行集合计划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。由于集合计划份额拆分引起的实收基金份额变动于集合计划份额拆分日根据拆分前的集合计划份额

数及确定的拆分比例计算确认。由于参与和退出引起的实收基金份额变动分别于集合计划份额参与确认日及集合计划份额退出确认日确认。

(8) 损益平准金

损益平准金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在参与或退出集合计划份额时，参与或退出款项中包含的按累计未分配的已实现收益或未弥补的已实现亏损占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在参与或退出集合计划份额时，参与或退出款项中包含的按累计未实现利得（或损失）占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划份额参与确认日或集合计划份额退出确认日进行确认和计量，并于期末全额转入未分配利润或未弥补亏损。

(9) 收入 / (损失) 确认

收入是本集合计划在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本集合计划、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

投资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后的净额确认。

货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日每万份收益计提红利基金红利收入；其他类型基金于除权日按基金管理公司公布的收益分配方案计算确认。

分红收益按宣告的分红比例计算的金额确认。

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，并扣除适用情况下代扣代缴的个人所得税后的净额确认，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。

公允价值变动净收益 / (损失) 核算集合计划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。

(10) 费用确认

管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按集合计划合同约定的费率和计算方法确认。

投资交易时发生的交易费用于交易日确认并作为集合计划费用计入当期损益。

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。

其他费用如不影响估值日集合计划份额净值小数点后第四位，发生时直接计入集合计划损益；如果影响集合计划份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入集合计划损益。

(11) 集合计划的收益分配政策

本集合计划的每一份额享有集合计划份额收益的同等分配权。集合计划份额收益以现金形式分配，集合计划持有人可以选择现金红利或按分红除权日的集合计划份额单位净值转为集合计划份额。收益分配必须符合以下条件：

- (a) 同一种类集合计划份额的每一份额享有同等分配权；
- (b) 集合计划收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；
- (c) 当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- (d) 法律、法规或中国证监会另有规定的从其规定。

(12) 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本集合计划目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

(13) 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则并参照中国证监会允许的证券投资基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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，本集合计划参照中国证监会公告 [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》，根据具体情况参照《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。

4 税项

本集合计划运作过程中涉及的各项纳税事项，依照财政部、国家税务总局的相关规定以及其他相关规定执行。主要税项列示如下：

(a) 增值税及附加

根据财政部和国家税务总局发布的《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016] 36 号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税[2016] 46 号)、《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》(财税 [2016] 70 号)、《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[2016] 140 号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税 [2017] 2 号) 及《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税 [2017] 56 号)，自 2016 年 5 月 1 日起，金融业纳入“营改增”试点范围；自 2018 年 1 月 1 日以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品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；对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对资管产品在 2018 年 1 月 1 日 (含) 以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照资管产品管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(b) 所得税

截至本集合计划财务报表批准报出日，财政部和国家税务总局并未出台针对客户资产管理业务纳税问题的具体规定。因此，截至 2018 年 12 月 31 日，本集合计划没有计提有关所得税费用。如果涉及本集合计划业务的有关税收法规颁布，本集合计划所涉及的所得税可能会根据日后出台的相关税务法规而作出调整。

(c) 印花税

本集合计划自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日止期间进行的证券交易所适用的印花税税率为 0.10%，根据财政部和国家税务总局的有关规定，证券 (股票) 交易印花税征收方式为单边征收，即仅对出让方按 0.10% 的税率征收印花税，对受让方不再征税。

(d) 代扣代缴个人所得税

根据《中华人民共和国个人所得税法》、《国家税务总局关于加强企业债券利息个人所得税代扣代缴工作的通知》(国税函 [2003] 612 号)、《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 [2012] 85 号) 及《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 [2015] 101 号) 及其他相关税务法规的规定, 个人投资者直接投资股票或债券的, 上市公司及债券兑付机构派发或支付给个人投资者的股息红利及债券利息收入应由上市公司及债券兑付机构对相应个人所得税进行代扣代缴。本集合计划收取的股息红利及债券利息尚未由上市公司及债券兑付机构于派发或支付时代扣代缴个人所得税。截至本集合计划财务报表批准报出日, 由于没有专门针对集合资产管理计划作为上述股息红利及债券利息个人所得税代扣代缴义务人的明确税务规定, 经与托管行协商一致, 本集合计划对所取得的股息红利收入不计提股息红利个人所得税; 本集合计划在实际取得债券利息收入时按收到的利息金额确认收入, 不计提债券利息个人所得税。如果上述税务事项的最终认定结果与估计存在差异, 该差异将可能对作出上述最终认定期间的应代扣代缴所得税和所有者权益金额产生影响。

5 银行存款

2018 年

活期存款 14,932,464.99

6 交易性金融资产

2018 年

	<u>成本</u>	<u>公允价值</u>	<u>估值减值</u>
基金投资	62,500,000.00	62,500,000.00	-
资产管理计划投资	<u>50,800,000.00</u>	<u>50,397,819.64</u>	<u>(402,180.36)</u>
合计	<u>113,300,000.00</u>	<u>112,897,819.64</u>	<u>(402,180.36)</u>

7 应收利息

2018 年

应收活期存款利息 3,285.15

8 其他负债

2018年

应付专业服务费 18,000.00

9 实收基金

自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日)
至 2018 年 12 月 31 日止期间

集合计划份额 (份) 账面金额

期初 / 期末余额 128,116,697.25 128,116,697.25

10 未弥补亏损

自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日)
至 2018 年 12 月 31 日止期间

已实现部分 未实现部分 未弥补亏损合计

期初余额 - - -

本期亏损 (231,920.86) (402,180.36) (634,101.22)

期末余额 (231,920.86) (402,180.36) (634,101.22)

11 存款利息收入

自 2018 年 5 月 29 日
(合同生效日) 至
2018 年 12 月 31 日止期间

活期存款利息收入 119,052.89

12 股利收益

自 2018 年 5 月 29 日
(合同生效日) 至
2018 年 12 月 31 日止期间

基金投资产生的股利收益

1,203,902.96

13 公允价值变动净损失

自 2018 年 5 月 29 日
(合同生效日) 至
2018 年 12 月 31 日止期间

交易性金融资产
- 资产管理计划投资

(402,180.36)

14 其他费用

自 2018 年 5 月 29 日
(合同生效日) 至
2018 年 12 月 31 日止期间

专业服务费

18,000.00

15 利润分配情况

本集合计划自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日止期间未进行过利润分配。

16 关联方及其交易

(a) 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

(b) 本集合计划关联方

关联方名称

与本集合计划关系

中金公司

管理人

中国工商银行

托管人及推广机构

(c) 关联方交易

i) 通过关联方交易单元进行的交易

本集合计划自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日止期间没有通过关联方交易单元进行过交易。

ii) 应支付关联方的佣金

本集合计划自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日止期间没有应支付关联方的佣金。

iii) 集合计划管理人报酬

自 2018 年 5 月 29 日
(合同生效日) 至
2018 年 12 月 31 日止期间

当期发生的应支付的管理费

1,514,164.25

按照持有人、管理人和托管人三方签订的集合资产管理合同规定, 管理人管理费按前一日资产净值的 2.00% 的年费率按日计提, 按季支付, 由托管人支付给管理人。管理人业绩报酬按集合计划合同规定的方法和标准计算, 并于收益分配基准日、份额退出日和集合计划终止日计提, 在退出款、分红款项或终止清算款项划出日支付。

iv) 集合计划托管费

自 2018 年 5 月 29 日
(合同生效日) 至
2018 年 12 月 31 日止期间

当期发生的应支付的托管费 **22,712.46**

本集合计划自成立之日起下一日计提托管费。本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.03% 年费率计算。

v) 与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购) 交易

本集合计划自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日止期间未与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购) 交易。

vi) 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日止期间		
<u>关联方名称</u>	<u>银行存款期末余额</u>	<u>当期利息收入</u>
工商银行	14,932,464.99	119,052.89

本集合计划的银行存款由本集合计划托管人工商银行保管，按 0.72% 的利率计息。

vii) 本集合计划在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划自 2018 年 5 月 29 日 (合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日止期间未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

17 期末本集合计划持有的流通受限证券

(a) 因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券

于 2018 年 12 月 31 日，本集合计划未持有因认购新发 / 增发证券而持有的流通受限证券。

(b) 期末持有的暂时停牌等流通受限证券

于 2018 年 12 月 31 日，本集合计划持有因暂时停牌而流通受限证券。

18 或有或承诺事项

截至 2018 年 12 月 31 日，本集合计划无需作披露的重大或有或承诺事项。

19 资产负债表日后事项

截至本集合计划财务报表批准报出日，本集合计划无需作披露的资产负债表日后事项。

附件二：托管人报告

托管报告

2018年，本托管人在对中金福睿1号集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守法律法规和托管协议的有关规定，不存在任何损害持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

2018年，中金福睿1号集合资产管理计划的管理人——中国国际金融股份有限公司在中金福睿1号集合资产管理计划的投资运作、资产净值计算、费用开支等问题上，不存在任何损害持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照法律法规的有关规定进行。

本托管人依法对中国国际金融股份有限公司编制和披露的中金福睿1号集合资产管理计划2018年报告中的主要财务指标、净值表现、投资组合报告进行了核查，以上内容真实、准确和完整。



附件三：托管人履职报告

（一） 报告期内本计划托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国工商银行股份有限公司广州分行在对本资产管理计划的托管过程中，严格遵守了国家有关法律法规、本计划资产管理合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害资产份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

（二） 托管人对报告期内本计划投资运作遵规守信、财产估值等情况的说明

本报告期内，本托管人严格按照国家法律法规、本计划资产管理合同、托管协议和其他有关规定，对本计划财产估值的计算等方面进行了认真的复核，对本计划的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人存在损害资产份额持有人利益的行为。

（三） 托管人对本报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的【主要会计数据和财务指标、净值表现、投资组合报告、集合计划份额变动】等内容所涉及的财务数据，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。