中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015年6月30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:2015年8月26日

§1 重要提示

1.1 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的法律责任。本半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2015年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	709,513,460.11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	杜季柳	田青
	联系电话	010-63211122	010-67595096
	电子邮箱	zxpl@ciccfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		86 400-868-1166	010-67595096
传真		86 010-66159121	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015年4月21日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	36,219,645.48
本期利润	41,217,321.59
加权平均基金份额本期利润	0.0581
本期基金份额净值增长率	5.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0510
期末基金资产净值	750,730,781.70
期末基金份额净值	1.058

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;

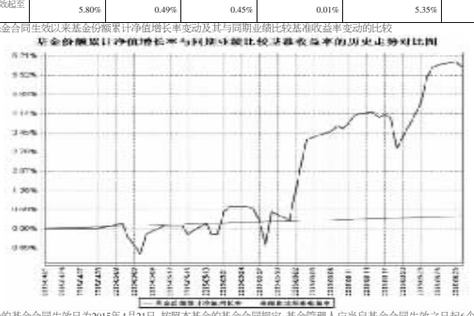
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数。

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
过去一个月	5.17%	0.56%	0.19%	0.01%	4.98%	0.55%
自基金合同生效起至今	5.80%	0.49%	0.45%	0.01%	5.35%	0.48%

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



注:本基金的基金合同生效日为2015年4月21日,按照本基金的基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

§4 管理人报告

4.1 基金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")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,是证监会批准设立的第90家公募基金公司,也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1.5亿元人民币,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。中金基金管理有限公司注册地址为北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室,办公地址为北京市西城区太平桥大街18号丰融国际中心北楼17层。公司目前拥有共同基金募集和管理资格,特定客户资产管理业务资格。

截至2015年6月30日,公司旗下管理4支开放式基金--中金现金管家货币市场基金、中金纯债债券型证券投资基金、中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金和中金消费升级股票型证券投资基金,证券投资基金管理规模30.21亿元。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李云琪	本基金的基金经理	2015年4月21日	-	8	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。现任中金基金管理有限公司量化公募投资部基金经理。

注:1、任职日期说明:任职日期为基金合同生效日

2、证券从业年限的计算标准:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定

3、本基金无基金经理助理

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定和《中金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》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,灵活应用多种绝对收益策略剥离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,无损害基金份额持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 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

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 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

本基金自今年4月成立以来由于市场处于相对贴水状态,从绝对收益的角度,首先采取了审慎稳健的建仓策略,目的是希望基金保持正收益的前提下稳步增值。进入5月份以来,我们抓住基差为正的有利时机开始逐步建仓,我们的统计套利模型表现理想,获得了相对稳健的正收益。

从5月底到6月中旬,市场情绪波动加大,本基金也抓住有利时机进行了基差套利操作。由于板块风格轮动明显,大小盘的走势经常出现较大的背离。在这种情况下,本基金采用市场中性策略,对于相对大盘策略使用沪深300股指期货进行对冲,对于相对小盘策略使用中证500股指期货进行对冲。在市场的剧烈风格切换中,较为成功的规避了相关风险,在获得正收益的同时降低了组合的波动率,从而使风险收益比得到提升。

从6月中旬开始到6月末,受到去杠杆攻应的影响,整个市场出现了剧烈的单边下行走势。上证综指在不到一个月的时间内,下跌幅度高达20%以上,股指期货出现跌停价格,基差也进入到历史罕见的贴水状态。在这种情况下,我们及时的降低了仓位,锁定了基差部分的收益。

下一阶段的操作,本基金将主要着眼于寻找合适的时机增加量化选股模型的仓位。

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1.058元;本基金份额净值增长率为5.80%,同期业绩比较基准收益率为0.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管在政市政策的作用下,股市逐渐止跌企稳,未来股市表现的不确定性仍然较大,市场下跌的风险依然不可忽视。我们认为市场的逐渐恢复是一个必然的过程,中国改革开放的良好格局仍在,当前中国经济运行总体平稳,全面深化改革的动力正在逐渐释放。金融环境和货币发行方面,无风险利率持续降低,整个社会财富再配置的需求依然旺盛,金融环境也将更加优化。本基金会延续前期的投资理念,在控制风险的基础上追求与市场涨跌无关的绝对收益。

4.6 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、年末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、监督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历,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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定,本报告期内未实施利润分配。

4.8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 托管人对本半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半年度财务会计报告(未经审计)

6.1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:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	431,200,226.92	-
结算备付金	87,402,466.65	-
存出保证金	4,885,692.75	-
交易性金融资产	41,619,378.71	-
其中:股票投资	41,619,378.71	-
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	485,100,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	46,620.85	-
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,050,254,385.88	-
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	295,999,486.19	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	604,866.65	-
应付托管费	151,216.67	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,698,426.98	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	69,607.69	-
负债合计	299,523,604.18	-
所有者权益:		
实收基金	709,513,460.11	-
未分配利润	41,217,321.59	-
所有者权益合计	750,730,781.70	-
负债和所有者权益总计	1,050,254,385.88	-

注:1、报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.058元,基金份额总额709,513,460.11份。

2、本基金合同生效日为2015年4月21日,无上年度对比数据。

6.2 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:2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	48,167,640.70	-
1.利息收入	800,397.59	-
其中:存款利息收入	202,090.71	-
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	598,306.88	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	42,355,376.73	-
其中:股票投资收益	49,916,586.73	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-9,324,991.18	-
股利收益	1,763,781.18	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	4,997,676.11	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	14,190.27	-
减:二、费用	6,950,319.11	-
1.管理人报酬	1,382,940.96	-
2.托管费	345,735.24	-
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	5,144,599.41	-
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	77,043.50	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	41,217,321.59	-
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	41,217,321.59	-

注:本基金合同生效日为2015年4月21日,无上年度可比期间数据。

6.3 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:2015年4月21日 至 2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日所有者权益(基金净值)	709,513,460.11	-	709,513,460.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	41,217,321.59	41,217,321.59
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	709,513,460.11	41,217,321.59	750,730,781.70

注:本基金合同生效日为2015年4月21日,无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____阚睿_____ _____孙菁_____ _____白娜_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")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》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》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,定期开放申购和赎回,首次设立募集不包括认购资金利息共募集709,148,033.50元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字(2015)第1500482号验资报告予以验证。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,基金合同生效日的基金份额总额为709,513,460.11份基金份额,其中认购资金利息折合365,426.61份基金份额。本基金的基金管理人为中金基金,注册登记机构为中金基金,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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(但须符合中国证监会的相关规定),在正常市场情况下,本基金资产配置的比例范围是: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,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照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》的要求编制。在具体会计核算和信息披露方面,同时按照证券投资基金信息披露XBRL的模板第3号《年度和半年度报告》(中国证监会正式稿)(2014年11月5日)和中国证券投资基金业协会(以下简称"基金业协会")于2012年11月16日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则以及中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作规定的要求,真实、完整地反映了本基金2015年6月30日的财务状况及自2015年1月1日至2015年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动的情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无

6.4.5.3 差错更正的说明

无

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于证券业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税,基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

2、对基金从证券市场上取得的收入,包括买卖股票的差价收入,股权的股息、红利收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3、自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,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;持股期限超过一年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计算个人所得税。

4、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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金发起人、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(中国建设银行)	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

注:1、本基金本报告期关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	3,798,465,390.99	100.00%	-	-

本基金合同生效日为2015年4月21日,无上年度可比期间数据。

债券交易

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债券交易。

债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	11,402,300,000.00	100.00%	-	-

本基金合同生效日为2015年4月21日,无上年度可比期间数据。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30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	2,698,426.98	100.00%	2,698,426.98	100.00%

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。

3、本基金合同生效日为2015年4月21日,无上年度可比期间数据。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,382,940.96	-
其中:支付销售机构的客户维护费	774,665.17	-

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:日基金管理费=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到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:

附加管理费=(PA — PH)×10%×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774,665.17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。

4、本基金合同生效日为2015年4月21日,无上年度可比期间数据。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	345,735.24	-

注:1、支付基金托管人中国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。

2、本基金合同生效日为2015年4月21日,无上年度可比期间数据。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期无销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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 2015年6月30日		上年度末 2014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	1.4100%	-	-

本基金合同生效日为2015年4月21日,无上年度对比数据。

6.4.8.5 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 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	431,200,226.92	142,289.60	-	-

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

2、本基金通过"中国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2015年6月30日的相关余额为人民币28,436,704.94元。

3、本基金合同生效日为2015年4月21日,无上年度可比期间数据。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与或不参与承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.9 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 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
600886	国投电力	2015-06-24	重大事项停牌	14.87	-	-	212,614	2,717,924.59	3,161,570.18	-
002703	浙江世宝	2015-05-29	重大事项停牌	52.01	-	-	25,817	1,033,149.07	1,342,742.17	-
000668	荣丰控股	2015-05-25	重大事项停牌	34.79	-	-	38,450	998,757.70	1,337,675.50	-
600167	联美控股	2015-05-27	重大事项停牌	25.76	-	-	50,832	1,037,050.55	1,309,432.32	-
300144	宋城演艺	2015-06-18	重大事项停牌	76.47	2015-07-20	68.82	16,530	1,315,888.52	1,264,049.10	-
600097	开创国际	2015-06-05	重大事项停牌	30.40	-	-	41,398	739,049.72	1,258,499.20	-
601633	长城汽车	2015-06-19	重大事项停牌	42.76	2015-07-13	38.50	26,571	1,270,444.83	1,136,175.96	-
600137	浪莎股份	2015-05-29	重大事项停牌	43.84	2015-08-25	-	22,400	727,619.00	982,016.00	-
000539	粤电力A	2015-06-08	重大事项停牌	11.94	2015-07-21	10.75	82,199	725,681.35	981,456.06	-
000066	长城电脑	2015-06-18	重大事项停牌	21.54	-	-	37,212	820,124.64	801,546.48	-
002292	奥飞动漫	2015-05-18	重大事项停牌	37.85	-	-	16,900	610,279.00	639,665.00	-
600879	航天电子	2015-05-15	重大事项停牌	24.50	-	-	23,756	529,001.55	582,022.00	-
002647	宏磊股份	2015-06-05	重大事项停牌	35.40	-	-	14,700	416,726.74	520,380.00	-
002620	瑞和股份	2015-06-09	重大事项停牌	58.49	2015-08-13	52.55	8,088	293,533.45	473,067.12	-
600061	中纺投资	2015-06-08	重大事项停牌	37.82	2015-07-20	34.04	11,784	356,943.48	445,670.88	-
600393	东华实业	2015-06-18	重大事项停牌	17.61	2015-07-01	15.85	19,400	302,026.43	341,634.00	-
600277	亿利能源	2015-06-01	重大事项停牌	14.62	-	-	19,695	259,696.35	287,940.90	-
600410	华胜天成	2015-05-28	重大事项停牌	47.84	2015-07-22	43.06	5,217	211,474.24	249,581.28	-
000691	亚太实业	2015-05-12	重大事项停牌	10.13	2015-08-19	9.12	20,951	209,495.62	212,233.63	-
002354	天神娱乐	2015-05-28	重大事项停牌	96.97	2015-07-23	87.27	2,000	208,994.00	193,940.00	-
300195	长荣股份	2015-06-23	重大事项停牌	31.96	2015-08-24	28.76	5,500	181,518.50	175,780.00	-
000672	上峰水泥	2015-06-03	重大事项停牌	12.05	-	-	13,223	136,637.11	159,337.15	-
002591	恒大高新	2015-06-24	重大事项停牌	19.95	2015-07-17	17.96	7,600	161,039.58	151,620.00	-
002530	丰东股份	2015-06-08	重大事项停牌	23.71	-	-	6,295	108,301.92	149,254.45	-
300320	海达股份	2015-06-23	重大事项停牌	18.70	2015-07-13	16.83	7,800	144,864.00	145,860.00	-
600778	友好集团	2015-06-02	重大事项停牌	16.10	-	-	8,840	115,643.62	142,324.00	-
300346	南大光电	2015-06-25	重大事项停牌	35.49	-	-	3,900	137,229.00	138,411.00	-
603017	园区设计	2015-06-23	重大事项停牌	58.51	-	-	2,200	129,623.00	128,722.00	-
000963	华东医药	2015-06-26	重大事项停牌	71.48	2015-08-05	69.20	1,786	132,444.81	127,663.28	-
000732	泰禾集团	2015-06-25	重大事项停牌	34.20	2015-07-02	30.78	3,550	111,676.55	121,410.00	-
000761	本钢板材	2015-06-23	重大事项停牌	7.75	2015-07-21	6.93	15,200	119,742.00	117,800.00	-
000862	银星能源	2015-05-21	重大事项停牌	11.81	2015-08-18	11.22	9,500	103,472.00	112,195.00	-
002416	爱施德	2015-05-05	重大事项停牌	20.67	2015-07-29	18.60	5,260	103,002.07	108,724.20	-
002200	云投生态	2015-05-29	重大事项停牌	27.07	2015-07-17	24.36	3,972	103,960.12	107,522.04	-
300266	兴源环境	2015-06-03	重大事项停牌	55.23	-	-	1,815	91,923.83	100,242.45	-
000716	黑芝麻	2015-06-08	重大事项停牌	23.69	2015-08-03	21.32	4,107	91,661.36	97,294.83	-
300255