中金消费升级股票型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015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:2016年3月25日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上全部独立董事签字同意,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2016年3月24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。

本报告期自2015年6月24日起至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中金消费升级
基金主代码	001193
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月24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	452,314,796.46份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入研究并积极投资消费升级相关的优质公司,在有效控制下行风险的前提下,力争实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。
业绩比较基准	中证主要消费指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于高预期风险和高预期收益的证券投资基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	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	xxpl@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

§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	2015年6月24日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	-52,344,539.41
本期利润	-10,517,122.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0171
本期基金份额净值增长率	0.80%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0645
期末基金资产净值	456,069,935.59
期末基金份额净值	1.008

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。

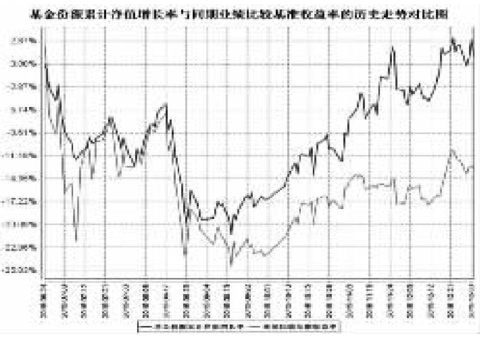
4、本基金合同生效日为2015年6月24日,无上年可比数据,且合同生效当期不满一个自然年度(下同)。

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

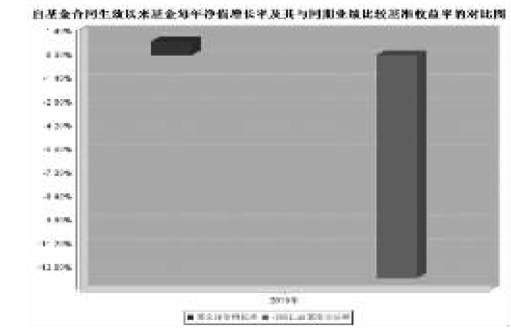
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	21.45%	1.68%	14.09%	1.32%	7.36%	0.36%
过去六个月	3.60%	1.69%	-8.82%	2.19%	12.42%	-0.50%
自基金合同生效起至今	0.80%	1.68%	-13.21%	2.29%	14.01%	-0.61%

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6月24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。

3.2.3 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



注:本基金合同生效日为2015年6月24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")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"、"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2.00亿元人民币。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。

截至2015年12月31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51.43亿。

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		
郭党钰	中金消费升级股票型证券投资基金基金经理	2015年6月24日	–	14	郭党钰先生,工商管理硕士。历任宁波镇海炼化投资经理;华泰证券项目经理;德恒证券高级经理;华策投资有限公司投资副总经理;招商基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部执行总经理,2015年6月24日起任中金消费升级股票型证券投资基金基金经理。

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《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循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规的规定,按照《中金消费升级股票型证券投资基金基金合同》和其他法律文件的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,以尽可能减少和分散投资风险,尽可能保证基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长目标。基金存续期间,基金管理人通过法定的信息披露方式公布基金管理和运作情况,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合相关法规及基金合同的规定。

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

2015年资本市场巨幅震荡,上证综指振幅72%,最低2850点,最高5178点,收盘3539点,涨幅9.4%。创业板综合指数振幅184%,最低1532点,最高4449点,收盘3265点,涨幅106%,2015年初至5月,在融资推动下大幅上涨,最终因为6月杠杆清理而近乎崩盘下跌。7月政策护盘企稳短暂反弹后,8月份再次因汇率贬值大跌,之后市场在第四季度大幅技术反弹。

本基金自6月24日成立,恰逢市场开始调整,初始投资标的以互联网金融、医药、国企改革消费股为主,建仓四分之一左右。之后在千股跌停的极端市场环境下,考虑流动性风险,没有大幅度增加仓位做反弹,9月份,判断市场进入可投资区间,逐步增加仓位,在12月24日根据合同约定,股票持仓达到最低80%的比例要求,2015年末净值恢复到面值之上。

我们的投资始终聚焦在经济转型及消费升级相关的成长股上,重点看好信息、文化娱乐及医疗服务等行业。

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1.008元;本基金份额净值增长率为0.80%,同期业绩比较基准收益率为-13.21%。

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2016年,我们预计指数的涨幅和波动幅度低于2015年,主要在于个股和结构性投资机会。

第一,宏观层面,经济下行压力依然较大,货币维持宽松,但边际预期降低。第二,企业盈利在不同行业分化较大,主要关注景气度高的行业变化。第三,政策层面,供给侧改革以及国企改革,都是围绕稳增长、调结构,后续执行需要观察。第四,全球经济联动性增强,美元升值带来的汇率压力依然是长期关注的因素。

从长期角度分析,本届政府充分认识到改革及创新对于中国未来经济增长的重要性,因此我们预期政府会在制度改革、放松行政监管等方面有所作为,预期将释放新一轮活力,中国将通过技术创新、制度改革、效率提高从而实现经济的最终转型,但是考虑到新经济替代旧模式不会一帆风顺,股票市场会因为预期差波动频繁。

策略上,我们依然坚持稳增长只能托底、调结构求转型才是大趋势的观点。因此获得长期超额收益依然需要以转型经济作为主线条,重点看好信息消费、互联网金融、医疗服务、文化传媒等消费升级方向个股。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人进一步健全了风险控制和监察稽核机制,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。

首先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。在持续关注"季度监察稽核项目"表中识别的风险点进行自查的同时,还定期进行有重点的检查。在研究投资交易环节,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,对关联交易的日常维护,对基金持仓流动性风险定期关注,并对公平交易执行情况进行检查等等;在营销与销售方面,本基金管理人定期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;在基金的运作保障方面,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来确保本基金财务数据的准确性;在法律合规方面,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。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。

本报告期内,本基金管理人严格按照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。

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,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1600916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	中金消费升级股票型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的中金消费升级股票型证券投资基金(以下简称"本基金")财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表,自2015年6月24日(基金成立日)至2015年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是该基金管理人中金基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员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,并使其实现公允反映;(2)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。
注册会计师的责任段	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基金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。
审计意见段	我们认为,该基金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和以财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员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,公允反映了该基金2015年12月31日的财务状况以及自2015年6月24日(基金成立日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	程海良 黄艾舟
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)
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	2016年3月24日

§7 年度财务报表

7.1资产负债表
会计主体:中金消费升级股票型证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日
资 产:		
银行存款		42,633,315.11
结算备付金		8,206,307.26
存出保证金		614,213.31
交易性金融资产		420,622,051.11
其中:股票投资		420,622,051.11
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		–
应收证券清算款		7,543,199.86
应收利息		15,509.51
应收股利		–
应收申购款		74,106.96
递延所得税资产		–
其他资产		–
资产总计		479,708,703.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015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		20,909,350.42
应付赎回款		628,576.11
应付管理人报酬		642,298.87
应付托管费		107,049.83
应付销售服务费		–
应付交易费用		1,139,209.45
应交税费		–
应付利息		–
应付利润		–
递延所得税负债		–
其他负债		212,282.85
负债合计		23,638,767.53
所有者权益:		
实收基金		452,314,796.46
未分配利润		3,755,139.13
所有者权益合计		456,069,935.59
负债和所有者权益总计		479,708,703.12

注:截至2015年12月31日,中金消费升级股票型证券投资基金份额净值为人民币1.008元,基金份额总额为452,314,796.46份。

7.2 利润表
会计主体:中金消费升级股票型证券投资基金
本报告期:2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入		-2,217,249.52
1.利息收入		1,969,903.41
其中:存款利息收入		787,549.68
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		1,182,353.73
其他利息收入		–
2.投资收益(损失以"-"填列)		-46,595,944.62
其中:股票投资收益		-46,723,168.31
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		–
股利收益		127,223.69
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		41,827,416.80
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		581,374.89
减:二、费用		8,299,873.09
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	4,332,448.56
2.托管费	7.4.8.2.2	722,074.80
3.销售服务费	7.4.8.2.3	–
4.交易费用		3,016,908.91
5.利息支出		–
其中:卖出回购金融资产支出		–
6.其他费用		228,440.82
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-10,517,122.61
减:所得税费用		–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-10,517,122.61

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:中金消费升级股票型证券投资基金
本报告期:2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015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)	694,717,196.35	–	694,717,196.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	-10,517,122.61	-10,517,122.61
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)	-242,402,399.89	14,272,261.74	-228,130,138.15
其中:1.基金申购款	5,123,669.39	-355,529.05	4,768,140.34
2.基金赎回款	-247,526,069.28	14,627,790.79	-232,898,278.49
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)	452,314,796.46	3,755,139.13	456,069,935.59

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:

孙菁 杜季柳 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中金消费升级股票型证券投资基金(以下简称"本基金")依据中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")于2015年3月25日证监许可[2015]435号《关于准予中金消费升级股票型证券投资基金注册的批复》核准,由中金基金管理有限公司(以下简称"中金基金")依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金消费升级股票型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式股票型基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金,托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称"建设银行")。

本基金通过中金基金直销中心、建设银行及中国国际金融股份有限公司(以下简称"中金公司")公开发售,募集期为2015年6月2日至2015年6月19日。经向中国证监会备案,《中金消费升级股票型证券投资基金基金合同》于2015年6月24日正式生效,合同生效日基金实收份额为694,717,196.35份(含利息转份额409,128.68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》及其配套规则、《中金消费升级股票型证券投资基金基金合同》和《中金消费升级股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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,同时亦按照证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度和半年度报告》(证监会正式稿)(2015年12月22日)和中国证券投资基金业协会于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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则以及附注所述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规定的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及自2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

本报告期本基金无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无差错更正。

7.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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[2012]85号文《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《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》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)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。

(b)基金买卖债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(c)对基金取得的债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

(d)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,暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
建设银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中金公司	1,320,972,274.65	42.23%

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中金公司	3,824,100,000.00	45.13%

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015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	44,793.92	3.28%	0.00	0.00%

注: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基金后的净额列示。

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,332,448.56
其中:支付销售机构的客户维护费	2,973,208.79

注:支付基金管理人中金基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

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人民币2,973,208.79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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	722,074.80

注:支付基金托管人建设银行的基金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。计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	–

注:本报告期本基金无销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期本基金未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金合同生效日(2015年6月24日)持有的基金份额	–
期初持有的基金份额	–
期间申购/买入总份额	–
期间因拆分变动份额	–
减:期间赎回/卖出总份额	–
期末持有的基金份额	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–

注:本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	42,633,315.11	710,081.68

注: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2015年12月31日的相关余额为人民币8,820,520.57元,本期间产生的利息收入为人民币77,463.29元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金没有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期本基金无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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
300025	华星创业	2015年11月26日	重大资产重组	28.28	–	–	1,113,748	23,587,086.74	31,496,793.44	–

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金无交易所市场债券正回购余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

(a)公允价值计量的层次

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。

(1)金融工具公允价值计量的方法
2015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389,125,257.6731,496,793.44-420,622,051.11
合计389,125,257.6731,496,793.44-420,622,051.11

对于在资产负债表日以公允价值计量的交易性金融资产的公允价值信息,本基金在估计公允价值时运用的主要方法和假设参见财务报表附注。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关债券的公允价值列入第二层次或第三层次,上述事项解除时将相关债券的公允价值列入第一层次。

本基金本期间持有的以公允价值计量的金融资产的公允价值所属层次未发生重大变动。

(3)第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金本报告期末未持有公允价值归属于第三层次的金融工具。

(b)其他金融工具的公允价值 (年末非以公允价值计量的项目)

不以公允价值计量的金融资产和负债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	420,622,051.11	87.68
	其中:股票	420,622,051.11	87.68
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	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	50,839,622.37	10.60
7	其他各项资产	8,247,029.64	1.72
8	合计	479,708,703.12	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	224,860,978.66	49.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,718,461.41	1.69
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	23,713,544.00	5.20
G	交通运输、仓储和邮政业	13,657,800.00	2.99
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	98,484,169.07	21.59
J	金融业	–	–
K	房地产业	15,348,410.00	3.37
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	14,582,927.97	3.20
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	22,255,760.00	4.88
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	420,622,051.11	92.23

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港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前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300025	华星创业	1,113,748	31,496,793.44	6.91
2	300166	东方国信	827,185	26,494,735.55	5.81
3	300160	秀强股份	615,192	24,638,439.60	5.40
4	300236	上海新阳	612,164	23,598,922.20	5.17
5	002074	国轩高科	627,939	23,296,536.90	5.11
6	600446	金证股份	455,000	22,381,450.00	4.91
7	300347	泰格医药	724,000	22,255,760.00	4.88
8	600071	凤凰光学	813,067	21,017,781.95	4.61
9	000639	西王食品	1,192,582	20,178,487.44	4.42
10	600055	华润万东	463,844	19,629,878.08	4.30

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600055	华润万东	69,578,582.67	15.26
2	000601	韶能股份	65,771,063.58	14.42
3	300170	汉得信息	62,982,305.35	13.81
4	000417	合肥百货	55,143,515.78	12.09
5	300273	和佳股份	52,486,983.20	11.51
6	601601	中国太保	44,129,869.05	9.68
7	300133	华策影视	42,298,293.78	9.27
8	300302	同有科技	38,618,308.55	8.47
9	300166	东方国信	38,470,416.17	8.44
10	300160	秀强股份	38,151,983.70	8.37
11	300124	汇川技术	37,960,204.83	8.32
12	600410	华胜天成	35,083,664.91	7.69
13	300005	探路者	34,949,319.36	7.66
14	300061	康耐特	34,139,843.44	7.49
15	300236	上海新阳	33,886,473.20	7.43
16	000776	广发证券	32,542,008.90	7.14
17	600787	中储股份	31,612,826.01	6.93
18	600999	招商证券	31,035,233.88	6.80
19	300095	华伍股份	30,367,984.46	6.66
20	002081	金 螳 螂	29,359,633.20	6.44
21	600963	岳阳林纸	29,320,430.33	6.43
22	002627	宜昌交运	29,150,168.24	6.39
23	000963	华东医药	29,132,004.00	6.39
24	000910	大亚科技	29,004,535.95	6.36
25	300253	卫宁软件	28,709,671.52	6.30
26	300025	华星创业	28,475,250.55	6.24
27	000978	桂林旅游	27,297,071.32	5.99
28	600071	凤凰光学	27,145,365.37	5.95
29	600030	中信证券	26,949,282.00	5.91
30	600647	同达创业	25,501,596.00	5.59
31	300043	互动娱乐	24,262,389.49	5.32
32	300291	华录百纳	24,145,338.70	5.29
33	601328	交通银行	24,000,378.70	5.26
34	300347	泰格医药	23,934,607.37	5.25
35	002074	国轩高科	23,490,538.70	5.15
36	002462	嘉事堂	22,922,961.58	5.03
37	600986	科达股份	22,400,294.24	4.91
38	600446	金证股份	20,958,042.25	4.60
39	600036	招商银行	20,833,099.70	4.57
40	000639	西王食品	20,319,814.57	4.46
41	002516	旷达科技	16,911,061.78	3.71
42	300037	新宙邦	16,831,817.50	3.69
43	002373	千方科技	16,268,444.80	3.57
44	002020	京新药业	16,140,604.62	3.54
45	300334	津膜科技	16,085,304.91	3.53
46	300050	世纪鼎利	15,943,028.00	3.50
47	300018	中元华电	15,521,102.00	3.40
48	002649	博彦科技	15,455,104.00	3.39
49	300103	达刚路机	15,241,841.82	3.34
50	002610	爱康科技	15,070,753.30	3.30
51	000158	常山股份	14,173,690.00	3.11
52	300071	华谊嘉信	13,882,351.00	3.04
53	002711	欧浦智网	13,368,126.00	2.93
54	600313	中农资源	13,056,252.51	2.86
55	600809	山西汾酒	12,699,836.00	2.78
56	600037	歌华有线	12,361,869.00	2.71
57	600775	南京熊猫	11,934,159.00	2.62
58	600648	外高桥	11,904,341.60	2.61
59	002014	永新股份	10,720,032.90	2.35
60	002019	亿帆鑫富	10,257,965.00	2.25

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000601	韶能股份	56,682,392.71	12.43
2	300170	汉得信息	52,726,056.90	11.56
3	000417	合肥百货	46,792,185.76	10.26
4	300133	华策影视	46,186,939.21	10.13
5	601601	中国太保	44,255,319.13	9.70
6	600055	华润万东	40,364,416.13	8.85
7	300005	探路者	36,610,674.50	8.03
8	600410	华胜天成	36,466,164.55	8.00
9	300302	同有科技	32,369,614.29	7.10
10	300160	秀强股份	32,210,409.81	7.06
11	000776	广发证券	31,902,172.65	7.00
12	300273	和佳股份	31,791,874.23	6.97
13	000910	大亚科技	31,468,871.68	6.90
14	600999	招商证券	31,365,266.02	6.88
15	600030	中信证券	30,488,863.31	6.69
16	002081	金 螳 螂	30,316,091.07	6.65
17	300253	卫宁软件	30,295,601.82	6.64
18	600963	岳阳林纸	28,670,659.47	6.29
19	300043	互动娱乐	25,507,348.72	5.59
20	601328	交通银行	24,472,430.49	5.37
21	300291	华录百纳	24,275,699.90	5.32
22	002627	宜昌交运	24,219,006.04	5.31
23	300095	华伍股份	22,738,679.62	4.99
24	000963	华东医药	22,303,589.89	4.89
25	300124	汇川技术	22,058,605.02	4.84
26	600787	中储股份	20,667,712.10	4.53
27	600036	招商银行	19,681,853.43	4.32
28	002373	千方科技	19,464,851.21	4.27
29	002020	京新药业	17,783,092.80	3.90
30	600986	科达股份	17,304,711.80	3.79
31	300018	中元华电	17,192,101.50	3.77
32	002610	爱康科技	17,157,601.49	3.76
33	300037	新宙邦	16,529,841.84	3.62
34	002516	旷达科技	16,054,388.54	3.52
35	300050	世纪鼎利	15,701,960.99	3.44
36	300334	津膜科技	15,326,281.37	3.36
37	000158	常山股份	15,144,764.00	3.32
38	300071	华谊嘉信	14,516,310.80	3.18
39	600648	外高桥	13,086,343.76	2.87
40	600037	歌华有线	12,916,745.83	2.83
41	600647	同达创业	11,861,427.07	2.60
42	300061	康耐特	11,768,383.63	2.58
43	300236	上海新阳	11,515,037.20	2.52
44	600809	山西汾酒	11,387,603.70	2.50
45	000978	桂林旅游	11,074,619.09	2.43
46	300166	东方国信	10,728,247.40	2.35
47	002462	嘉事堂	10,264,869.30	2.25
48	300063	天龙集团	10,255,459.70	2.25
49	600071	凤凰光学	9,790,175.41	2.15
50	601336	新华保险	9,613,048.60	2.11
51	600775	南京熊猫	9,417,581.70	2.06
52	600313	中农资源	9,330,649.15	2.05
53	600085	同仁堂	9,281,680.20	2.04
54	600571	信雅达	9,214,658.63	2.02

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	1,776,723,489.83
卖出股票收入(成交)总额	1,351,205,687.21

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

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	614,213.31
2	应收证券清算款	7,543,199.86
3	应收股利	–
4	应收利息	15,509.51
5	应收申购款	74,106.96
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	8,247,029.64

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	300025	华星创业	31,496,793.44	6.91	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
4,606	98,201.22	0.00	–	452,314,796.46	100.00%

9.3 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	63,712.42	0.0141%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年6月24日)基金份额总额	694,717,196.35
本报告期期初基金份额总额	–
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,123,669.39
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	247,526,069.28
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	452,314,796.46

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

1、2015年8月14日,经中金基金管理有限公司第一届董事会第八次会议审议通过,免去罗若宏先生副总经理职务。

2、2015年9月23日,经中金基金管理有限公司第一届董事会第九次会议审议通过,任命杜季柳女士为公司副总经理。

3、2015年12月31日,经中金基金管理有限公司第一届董事会第九次会议审议通过,总经理阙睿先生离任,由孙菁女士继任公司总经理,孙菁女士同时解除原副总经理任职。

4、2015年12月31日,根据中金基金股东中国国际金融股份有限公司股东决议,任命孙菁女士为中金基金第一届董事会董事;免去阙睿先生中金基金第一届董事会董事任职。

本报告期内,公司无董事长、法定代表人、其他高级管理人员和执行监事变动情况。

本基金托管人2015年1月4日发布任免通知,聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人2015年9月18日发布任免通知,解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

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60,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受任何稽查或处罚。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华西证券	2	520,881,473.75	16.65%	380,919.37	27.88%	–
国信证券	2	432,621,073.05	13.83%	316,373.73	23.16%	–
中金公司	2	1,320,972,274.65	42.23%	44,793.92	3.28%	–
广发证券	2	305,158,780.06	9.76%	223,163.02	16.33%	–
申万宏源	2	157,642,454.47	5.04%	115,283.19	8.44%	–
银河证券	2	130,234,549.16	4.16%	95,241.02	6.97%	–
华泰证券	2	260,418,571.90	8.33%	190,444.06	13.94%	–

注:1、报告期本基金未退租证券公司交易单元。

2、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服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告;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。

3、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
华西证券	–	–	1,342,200,000.00	15.84%	–	–
国信证券	–	–	2,461,500,000.00	29.05%	–	–
中金公司	–	–	3,824,100,000.00	45.13%	–	–
广发证券	–	–	374,200,000.00	4.42%	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	357,200,000.00	4.22%	–	–
华泰证券	–	–	115,000,000.00	1.36%	–	–

中金基金管理有限公司
2016年3月25日