中金现金管家货币市场基金

2016 第二季度 报告

2016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
报告送出日期:2016年7月19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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金现金管家	
基金主代码	000882	
交易代码	000882	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年11月28日	
报告期末基金份额总额	496,194,738.44份	
投资目标	在保障基金资产的安全性和流动性的前提下,通过积极主动管理,力争实现超越业绩比较基准的稳定收益。	
投资策略	根据对宏观经济指标、货币政策、市场结构变化等因素的研究与分析,对未来一段时期短期市场利率进行判断,对短期利率走势形成合理预期,并据此调整基金资产的配置策略。通过对市场资金供求、基金申赎情况进行动态分析,确定本基金流动性目标,相应调整基金资产在高流动性资产和相对流动性较低资产之间的配比,并根据对短期利率走势的判断确定并调整组合的平均剩余期限。在充分论证银行间市场和交易所市场套利机会可行性基础上,寻找最佳介入时机,进行跨市场操作,获得安全的超额收益。在遵循流动性优先的原则下,建立流动性预警指标,并通过现金库存、资产变现、剩余期限管理等措施确保基金资产的整体变现能力。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中金现金管家A类	中金现金管家B类
下属分级基金的交易代码	000882	000883
报告期末下属分级基金的份额总额	31,229,701.07份	464,965,037.37份

§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(2016年4月1日 - 2016年6月30日)	
	中金现金管家A类	中金现金管家B类
1. 本期已实现收益	110,930.04	4,863,584.55
2.本期利润	110,930.04	4,863,584.55
3.期末基金资产净值	31,229,701.07	464,965,037.37

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金现金管家A类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6136%	0.0047%	0.3366%	0.0000%	0.2770%	0.0047%

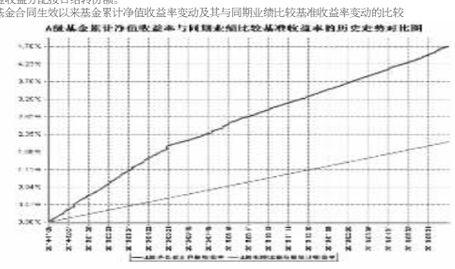
注:本基金收益分配按日结转份额。

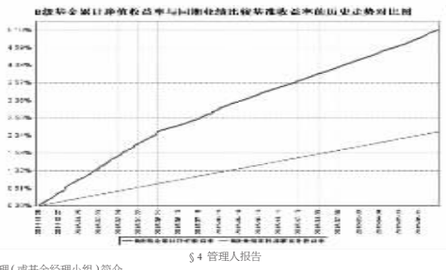
中金现金管家B类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6732%	0.0047%	0.3366%	0.0000%	0.3366%	0.0047%

注:本基金收益分配按日结转份额。

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





§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		
石云峰	本基金的基金经理	2014年11月28日	-	8	石云峰先生,经济学硕士,历任中国邮政储蓄银行总行资金营运部交易员,太平养老保险股份有限公司固定收益投资经理,嘉实基金管理有限公司机构投资部投资经理,现任中金基金管理有限公司机构投资部基金经理,2014年11月4日起任中金纯债债券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《中金现金管家货币市场基金基金合同》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,在保障基金资产的安全性和流动性的前提下,通过积极主动管理,力争实现超越业绩比较基准的稳定收益;在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。报告期内,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 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

尽管在央行对资金面的呵护下,2016年二季度债券市场回购利率较为平稳、资金面较为宽松,银行间隔夜回购利率二季度平均为2.03%,7天2.46%。但是受房地产销售较旺,二季度宏观经济数据较好,叠加债券信用事件频发的冲击下,债券市场波动较大,中债综合财富总指数二季度上涨0.24%,其中,4月下跌0.8%,5月上涨0.3%,6月上涨0.74%。

操作方面,在宏观经济较弱持续时间将会较长的预期下,本组合提高了组合的投资信用等级,维持了较高比例的利率债和短久期的信用债,以给投资者带来相对安全稳定的投资回报为主要任务。

展望2016年三季度,经济基本面在全年看最好的阶段即将过去,预期经济基本面将重新走弱,这有利于债券市场,但在宏观经济较弱的背景下,信用事件的冲击仍会持续。资金面方面,在通胀压力较小、经济基本面仍然较弱背景下,短期流动性压力不大,央行将会继续运用MFL、逆回购等工具,呵护资金面的适度宽松稳定。

本基金将在三季度继续保持适当比例的利率债和高等级信用债,同时精挑细选信用债进行投资,规避资质较差信用债的配置,提高组合整体的抗信用风险能力,维持适度的杠杠,增厚组合投资收益,给投资者带来相对稳定的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-0.86%,同期业绩比较基准收益率为0.37%。

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,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	固定收益投资	309,483,636.08	62.3100
	其中:债券	309,483,636.08	62.3100
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	184,450,863.65	37.1400
4	其他资产	2,722,574.19	0.5500
5	合计	496,657,073.92	100.0000

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.3200	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内,本货币市场基金未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	47
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	48
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本理财基金投资组合平均剩余期限未超过120 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	44.4100	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	25.9800	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	17.0600	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	12.0900	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天 (含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.5400	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,022,984.97	10.0800
	其中:政策性金融债	50,022,984.97	10.0800
4	企业债券	79,974,941.61	16.1200
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	179,485,709.50	36.1700
8	其他	-	-
9	合计	309,483,636.08	62.3700
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150419	15农发19	500,000	50,022,984.97	10.0800
2	111692258	16宁波银行CD068	500,000	49,972,772.76	10.0700
3	111608010	16中信CD010	500,000	49,957,405.03	10.0700
4	111610115	16兴业CD115	300,000	29,843,365.28	6.0100
5	111694572	16宁波银行CD131	300,000	29,804,806.62	6.0100
6	011699980	16国电江苏SCP001	200,000	19,994,282.79	4.0300
7	011699977	16中铁股SCP001	200,000	19,984,331.48	4.0300
8	111610268	16兴业CD268	200,000	19,907,359.81	4.0100
9	041562048	15南浦口CP001	100,000	9,999,283.40	2.0200
10	041566016	15包铝CP001	100,000	9,999,282.92	2.0200

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1026%
报告期内偏离度的最低值	0.0219%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0651%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

5.8.2

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。

5.8.3 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	应收利息	2,672,574.19
4	应收申购款	50,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,722,574.19

5.8.4 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	中金现金管家A类	中金现金管家B类
报告期期初基金份额总额	15,280,094.49	915,991,630.93
报告期期间基金总申购份额	23,489,011.39	184,759,697.94
报告期期间基金总赎回份额	7,539,404.81	635,786,291.50
报告期期末基金份额总额	31,229,701.07	464,965,037.37

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人按照《中金现金管家货币市场基金基金合同》、《中金现金管家货币市场基金招募说明书》的约定费率于2014年11月24日通过中金基金管理有限公司直销中心认购本基金,认购份额共计10,000,450份。

§8 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现金管家货币市场基金募集注册的文件

2、《中金现金管家货币市场基金基金合同》

3、《中金现金管家货币市场基金托管协议》

4、基金管理人业务资格批复、营业执照

5、报告期内中金现金管家货币市场基金在指定媒介上披露的各项公告

6、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中金基金管理有限公司。

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
2016年7月19日

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 第二季度 报告

2016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
报告送出日期:2016年7月19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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金绝对收益
基金主代码	001059
交易代码	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
报告期末基金份额总额	154,204,536.34份
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。其中,市场中性策略包括量化选股策略和期货对冲策略两大策略。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为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。
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

§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(2016年4月1日 - 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	-622,825.80
2.本期利润	-1,377,154.98
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0088
4.期末基金资产净值	160,519,258.60
5.期末基金份额净值	1.041

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;

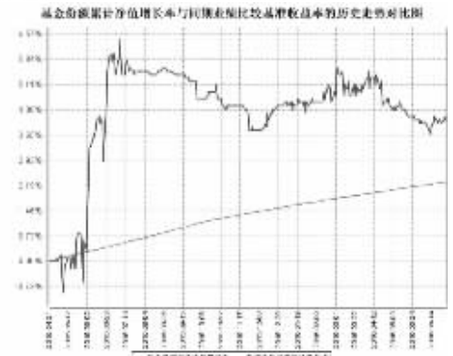
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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

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	-0.86%	0.16%	0.37%	0.00%	-1.23%	0.16%

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



注:本基金的基金合同生效日为2015年4月21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。

§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		
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《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 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

回顾2016年2季度,在经历了1季度市场剧烈波动之后市场呈现出震荡走势,投资者情绪和风险偏好逐渐恢复正常。板块风格方面,受到资金面博弈的影响,整个市场轮动速度加快,呈现出结构性行情,趋势性不明显。期货台约继续保持贴水状态,给本基金的建仓带来了不利的影响。尽管我们的模型相对于标的指数表现理想,但受到持续负基差影响超额收益不够明显,尤其是4月份至五月份期间,受到股指期货基差剧烈波动的影响导致了一定的回撤。

未来一段时间,我们将会密切关注市场及政策的变化,在市场变化中寻找合适的操作时机,在控制风险的前提下尽可能的获取绝对收益。

展望后市,海外主要经济体面临“英国退欧”等后续潜在风险事件的影响潜在增长空间有限,对中国经济而言难言乐观,从国内来看,我们认为关管目前A股估值有所下降,受到供给侧改革逐渐深入以及金融监管的影响,市场流动性边际宽松空间有限。而在上半年刺激需求的政策下产生盈利增长能否成为市场持续支持因素尚待观察。 但是乐观来看目前市场资金仍然较为便宜,市场下跌空间相对有限,符合改革预期的相关热点题材有望得到市场关注。总体而言,我们预计今年以来持续的结构化行情在下半年有望继续延续,即使有趋势性机会也将是阶段性为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-0.86%,同期业绩比较基准收益率为0.37%。

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,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	32,331,201.71	20.01
	其中:股票	32,331,201.71	20.01
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	-	-
	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	122,813,415.77	76.03
8	其他资产	6,390,919.34	3.96
9	合计	161,535,536.82	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	298,506.00	0.19
B	采矿业	1,568,157.68	0.98
C	制造业	14,924,366.53	9.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	461,566.81	0.29
E	建筑业	572,113.30	0.36
F	批发和零售业	289,316.72	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	1,923,773.19	1.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	622,406.24	0.39
J	金融业	8,369,807.03	5.21
K	房地产业	1,855,805.84	1.16
L	租赁和商务服务业	751,445.37	0.47
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,392.00	0.01
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	107,590.00	0.07
S	综合	572,955.00	0.36
	合计	32,331,201.71	20.14

5.2.2 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。

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	601166	兴业银行	106,200	1,618,488.00	1.01
2	601318	中国平安	50,100	1,605,204.00	1.00
3	000333	美的集团	45,800	1,086,376.00	0.68
4	600519	贵州茅台	3,385	988,149.20	0.62
5	000651	格力电器	49,800	957,156.00	0.60
6	600177	雅戈尔	69,200	954,268.00	0.59
7	002304	洋河股份	12,997	934,744.24	0.58
8	600104	上汽集团	39,100	793,339.00	0.49
9	601328	交通银行	137,800	775,814.00	0.48
10	000738	中航动控	28,790	760,056.00	0.47

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末,本基金未持有债券。

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

本报告期末,本基金未持有债券。

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

本报告期末,本基金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

本报告期末,本基金未持有贵金属。

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

本报告期末,本基金未持有权证。

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

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
IF1607	IF1607	-31	-28,954,620.00	-922,920.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-922,920.00
股指期货投资本期收益(元)					340,785.42
股指期货投资本期公允价值变动(元)					264,554.58

5.9.2 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。

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

本报告期末,本基金无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末,本基金无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末,本基金无国债期货投资。

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	6,386,443.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,476.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,390,919.34

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金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	000651	格力电器	957,156.00	0.60	临时停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,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

报告期期初基金份额总额	190,344,935.68
报告期期间基金总申购份额	12,909.14
减:报告期期间基金总赎回份额	36,153,308.48
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	154,204,536.34

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末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	50,935.19	0.03	-	-	-
基金经理等人员	10,000,350.00	6.49	10,000,350.00	6.49	自基金合同生效之日起不少于三年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,051,285.19	6.52	10,000,350.00	6.49	-

§9 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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会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、基金管理人业务资格批复、营业执照

5、报告期内中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

6、中国证监会要求的其他文件

10.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中金基金管理有限公司。

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
2016年7月19日

中金纯债债券型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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
报告送出日期:2016年7月19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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金纯债	
基金主代码	000801	
交易代码	000801	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年11月4日	
报告期末基金份额总额	290,649,257.54份	
投资目标	在有效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	本基金在对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场政策等研究的基础上,自上而下地决定债券组合久期、动态调整各类资产比例,结合收益率水平曲线形态分析和类属资产相对估值分析,优化债券组合的期限结构和类属配置。	
业绩比较基准	中证全债指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	中金纯债A	中金纯债C
下属分级基金的交易代码	000801	000802
报告期末下属分级基金的份额总额	279,520,432.81份	11,128,824.73份

§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(2016年4月1日 - 2016年6月30日)	
	中金纯债A	中金纯债C
1.本期已实现收益	396,213.49	38,696.00
2.本期利润	-289,046.93	-76,882.91
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0033	-0.0063
4.期末基金资产净值	305,662,028.55	12,071,431.43
5.期末基金份额净值	1.094	1.085

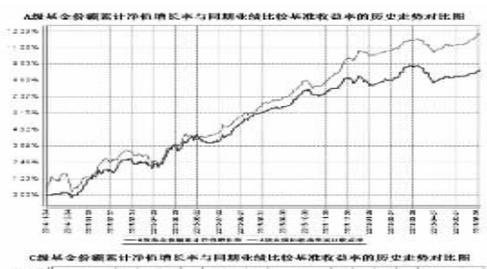
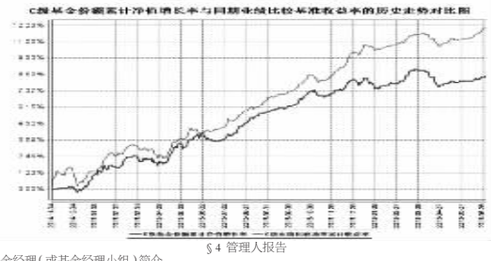
3.2 基金净值表现

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

中金纯债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	-0.18%	0.07%	0.36%	0.06%	-0.54%	0.01%

中金纯债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	-0.37%	0.07%	0.36%	0.06%	-0.73%	0.01%

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