

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 更新招募说明书摘要

(2018年第2号)

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

二〇一八年十二月

基金管理人:中金基金管理有限公司

重要提示
中金绝对收益策略定期开放混合型及起式证券投资基金(以下简称"本基金")的募集申请于2015年1月28日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(关于推于中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金出价批算)让册,并于2015年4月21日经中国证监会证券基金机构监管部源跨到2015]1048号(关于中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金备条额认的函)备案。本基金的基金合同于2015年4月21日生效。本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完

基金管理人管理的耳性悬定的业绩不停从心中显然。 未会管理人使服务区职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保 基金管理人依照格尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保 16金 一定盈利,也不保证最低收益、本更新招募说明书已经本基金托管人复核。本更新 致识明于所载从存载止日为2018年10月20日,有关财务数据和净值表现截止日为2018 月30日(财务数据未经审计)。

—、基金管理人

公司的股权结构如下: 股东名称

中国国际重整联队开放公 (二)主要人员情况 1.基金管理人董事会成员 孙青女士、董事长(代履职),管理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资本市场 总经理、公司资本市场总经理及负责人等职务。现任中金基 部副总差理、公司管理部副总经理、定营支持部执行总经理及负责人等职务、现任中金基金管理有限公司总经理。 或首摩在民主董事、机械工程专业学士。历任英国毕马威会计师事务所(英国及香港) 审计、核算见习生。副经理、经理等职务、香港汇丰银行资本市场财务经理、货币及外汇市 放射多经理股界;高盛(亚州),高盛集团(日本东京)即亚设金外汇及大宗商品产品财务 控制负责人、权益类产品财务控制负责人、日本产品财务控制负责人、香港财务控制负责人。 龙州负责人、权益类产品财务控制负责人、日本产品财务控制负责人、香港财务控制负责人。 定制负责人、权益类产品财务控制负责人、日本产品财务控制负责人、香港财务控制负责人。 控制负责人、权益类产品财务控制负责人。日本产品财务控制负责人、香港财务控制负责息。 使用任公司资产管理部亚大区首席营运官、亚大(除日本)首席营运官。产品研发 主管和董事总学理等。是任中国国际金融股份有限公司首席财务官、基市总经理、 陈刚先生,董事、注学博士。历任国国务院发展研究中心技术经济研究所研究人员、北京 也等申期事务所律师,中国国际金融股份有限公司。规律师,中国国际金融(香港)有限公司法律 合规事务负责人。陈刚先生是组约州执业律师并具有中国法律职业资格,现任中国国际金融 金融股份有股公司费成品、董事总经理。 赵健先生、董事、经济学硕士。历任中国国际金融股价有股公司投资保护部经理,中信 产业基金管理有限公司技经是理、维护中金基金管理有限公司及经历报度。 李永先生、董事、法济学硕士。历任中国人保资产管理有限公司及易员、风险监控 人投资经理,非国人务资产管理有限公司及多是,风险监控 人投资经理,非国人参考产管理有限公司及多是,风险监控 人投资经理,非国人参考产管理有限公司及多是,风险监控 人投资经理,非国人参考产管理有限公司及多是,风险监控 人投资经理,非国人参考产管理有限公司,并必会经验是各一条

经理。
张春先生、独立董事、经济学和珠策科学博士。历任美国明尼苏达大学卡尔森管理学院金融系终身教授,中欧国际工商学院金融和会计系讲席教授、系主任、副教务长、现任上海交通来学上海高级金融学院教授、执行院长。
颇羽女士、独立董事、经济法硕士、EMBA硕士。历任云南政法干部管理学院教师、四通组张法律咨询副注任:海问律师事务所证券业务律师;嘉和律师事务所合伙人。现任嘉潔律师事务所创始合伙人。

ペルニ統のボールルーカ州 U駅首合伙人。 | 青七刀、独立董事、哲学博士、历任北京大学光华管理学院团委书记、党委副书记、党 委书记、北京大学医学部副主任、財务部部长、北京大学副总会计师等职务。現任神州泰任 软件駅份 有限公司董事。

委书记、北京大学医学部副主任、财务部部长、北京大学副总会计师等职务、现任神州泰岳 软件股份有限公司董事 2.基金管理人监事 夏静女上执行监事,理学硕士。历任举华永道(深圳)咨询有限公司北京分公司风险 管理及内部控制服务部经理;中国国际金融股份有限公司公司稽核部高级经理。现任中金 基金管理有限公司风险管理部负责人。 3.基金管理有限公司风险管理部负责人。 3.基金管理有限公司风险管理部负责人。 为蒂女士、董事长(代规职)。经经里。简历同上。 李永先生,副经经理。预历同上。 活球女士、硕士、历任中国工商银行深圳分行高级理财经理,华安基金管理有限公司 零售业务部副总经理、现任中金基金管理有限公司副总经理。 李建文士、督察长、法学硕士。历任美国公法律师事务所北京代表处律师;中国国际金 融股份有限公司合规管理部副总经理。李虹女士是美国组约州执业律师并具有中国法律 职业资格。

4、华金亚泰亚公理 本基金存获期间,基金经理由李云琪先生变更为魏李先生。 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 经理,中国国际金融股份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 量化公募投资部副总经理。李云琪先生自2017年3月28日起不再担任本基金的基金经

魏孝先生,香港大学统计博士。历任北京尊嘉资产管理有限公司量化策略研究员,现

(一)基本情况 (一)基本情况 (一)基本情况 (一)基本,国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行) 住所:北京市西城区金融大街25号 办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 住定代表人:山国立 法定代表人;田国立 成立时间;2004年09月17日 组织形式;股份有限公司 注册资本。或作伍佰亿壹仟零政拾垛万垛仟肆佰捌拾陆元整 存续期间;持续经营 基金托管资格推文及文号;中国证监会证监基字[1998]12号 联系人;田青

黄秀莲、资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行总行会 计部、长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。 崇绍平、资产托管业务部剧应经理,曾就职于中国建设银行总行投资部。委托代理部、 战略客户部、长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理 经验。

經濟各一郎、宋朝以專各一服分、倡贞证业为官理專工作,具有主商的各一服分和业务官理 經驗。 原打、资产托管业务和副总经理。曾就职于中国建设银行总行国际业务部、长期从事 库约客户服务和业务管理验验。 (三)基金托管业务经营请尽 作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行、中国建设银行一直要转"以 客户为中心"的经营建念、不断加强风险管理和内部控制、严格履行托管人的各项职责。 切实维护资产特有人的合法权益。为货产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发 展,中国建设银行托管资产规模不断扩大、托管业务品种不断增加、已形成包括证券投资 基金、社保基金、保险资金、基本条令个、保护、民风及阳、(成及阳、企业全参等产品在价 托管业务体系,是目前国内托管业务品种资金、、人保入QDI、企业全参等的上有 中国建设银行行已资产规模不断扩大、托管业务基种不断增加、已形成包括证券投资 基金、社保基金、保险资金、基本条令个、保入QB、(成及QDI、企业全参等产品在分 托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末 水平、温得了业内的高度认同,中国建设银行先后次获得(全球托管人)"中国最佳托管 银行"、"以来课《银资"、"中国最佳大任管银行"、连终年来获得中债券、"先资产托管机 构"等实项、并在2016年被《环珠金融》评为中国市场唯一一家"最佳托管银行"、在2017 年来我、亚洲银行家》"最佳托管条次主施家"。

三、相关服务机构 (一)基金份额发售机构

(一)基金份额设售机构
1.直辖机构
(1)直辖和台
经称:中金基金管理有限公司
住所: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:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层
法定代表人,将著《代屋职》
电话:400-6321112
传真:400-6651021
联系人:张显
客户服务电话:400-868-1166
公司网站;www.ciccfund.com
(2) 网上直销

(2) 网上直销 交易系统:中金基金网上直销系统 直销系统网址:https://trade.ciccfund.c 2、其他销售机构

法定代表入注于沙區、, 电话:010-65051166 传真:010-65058065 联系人:杨商子 网址:www.cic.com.cn (3)国信证券股份有限公司 注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层 办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层 法定代表人。何如 联系人.周扬 电话:0755-82130833 传真:0755-82130833 传真:0755-82130835

容服电话: 95538 匈班: www.qbq.com.cn (5) 平安银行股份有限公司 客服电话: 95511转3 网班: bank.pingan.com (6) 中国光大银行股份有限公司 客服电话: 95595

www.cebbank.com 上海陆金所资产管理有限公司

(7)上海陆並所實广管理有限公司 客服电话:4008219031 网站;www.lufunds.com (8) 华西证券账股台解处司 注册地址:成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 法定代表人:杨师祥 联系人:周志姑 电话:028—86152975 传真:028—86152975

各級电话:9584 (9) 北京東京基金销售有限公司 地址:北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层 项址:https://www.hongdianfund.com/ 赴店:010-85643600

电话-010—85643600 (10)交通银行股份有限公司 地址:上海市银城中路188号 法定代表人:牛锡明 客服电话:95559 网址::www.bankcomm.com (11)中国银行股份有限公司 地址:北京市西城区复兴门内大街1号 法定代表人:田国立 电话:95566

(おた) (表表): 田園立 地話: 95566 岡址: www.boc.cn (12) 平安证券有限责任公司 地址: 深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层 法定代表人: 周一滴 窓服电话: 95511转8 岡址: wock.pingan.com 13) 北京庁 史邦澤基金销售有限公司 地址: 北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层 辻守代考末, 本档

14)北京汇成基金销售有限公司 服电话:400-619-9059

例址:www.fundzone.cn (15) 武汉市伯嘉基金销售有限公司 客服电话:400-027-9899 岡址:www.buyfunds.cn (16) 中国中投证券有限责任公司 服申活:400-600-8008,95532

客服电活: 400-600-8008, 95532 | 阿肚: http://www.chian-imscn. | (17) 上海扩采基金销售有限公司 | 注册地址: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号 | 办公地址: 上海市道口区欧阳路196号26号楼2楼41号 | 办公地址: 上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室 | 注定代表人, 杨文斌 | 版系人, 王诗岭 | 电话, 021-0859619 | 传真, 021-0859619 | 传真, 021-0859619 | 传真, 021-0859619 | (6其, 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021-0859619 | 021

客服电话:400—166—6788 例址:http://www.66zichan.com (20)北京肯特瑞龄宫投资管理有限公司 客服电话:95118 同址:http://fund.jd.com (21)银河证券股份有限公司 客服电话:95551

网址:http://www.licaike.com

開始: http://www.chinastock.com.cn/ (22)上海基煜基金销售有限公司 客服电话: 4008-205-369 関址: https://www.jiyufund.com.cn/ (23)和讯信息科技有限公司

(24)北京蛋卷基金销售有限公司

例址:http://fund.eastmoney.com (26)通华财富(上海)基金销售有限公司 客服电话:95156

客服电击: 4006706863 例址: www. hongainvealth.com (28) 北京康鼎耀华投资咨询有限公司 客服赴慈: 4400~819~9868 网站: www.tdyhfund.com (29) 與叙(杭州) 基金销售有限公司 客服电击: 4000~766~123 网络: www.fund123.cn (30) 北京康信基金销售有限公司 客服电击:1010~56075718

网址:www.zhixin-inv.com (31)南京苏宁基金销售有限公司 网址:www.snjijin.com (32)浙江同花顺基金销售有限公司 客服电话:4008-773-772 网址:www.5ifund.com (33)中国工商银行股份有限公司

电话:95588 (34)泰诚财富基金销售(大连)有限公司

地话: 400-0411-001 (35) 兴业银行股份有限公司 网址:www.cib.com.cn 电话:95561 (36)中信建投证券股份有限公司

话: 4008-888-108 他销售机构详见本基金基金份额发售公告或基金管理人届时发布的变更或增减

联系人:白娜 (三)出具法律意见书的律师事务所

(四)审计基金财产的会计师事务所 名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙) 名称:平与城平积公计则甲多所:代称朱普迪合伙) 住肝:中国北京东长安街号东方广场东2办公楼8层 办公地址:中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层 执行事务合伙人:邹俊 电话:010-85185111 签章注册会计师:程海良、李砾 联系人:程梅良

四、基金的名称 中金基金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金。 五、基金的类型与运作方式 五、 (一)基金的类型 混合型发起式证券投资基金。 (二)其金的运作方式

(二)基金的运作方式 契约型,本基金以定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期 之间定期开放的运作方式

之间定期开放的运作方式

本基金观活应用多种绝对收益等部别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。

- 基金股资于依法发行或上市的股票,债券等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资扩展论金融工具。以及法律法规或中国证监会条体生产的股票,则以两次发展,可转,全域上,可约,次级债。可转换债券(含可分离交易可转债),央行票据、短期隐变券、超短期融资券,中期票据等),资产支持证券、债券回购、货币站工具以及法律法规或中国证监会的股票,股价制度,及证债金融工程,但或符合中国证监会的相关规定。

金融工具(但领符合中国证监会的相关规定),如法律法规或指数。 则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,可以将其典人投资范围。 本基金的投资提出任例为,本基金权益类空头头寸的价值上有基金权益类多头头寸的价值的价值是有图象。 所见的是国务的。—120%之间,其中,权益类空头头寸的价值是有圈参卖出的股票市值。实出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值;权益类多头、寸的价值是指是人持有的股票市值。买人股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多人工具价值的合计值。 把数据的均存个交易日日线,持有的买人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99%。其时期均至个多月日均线,持有的买人期货合约价值有价证之一年以内的政府债务,权证。资产支持证券。买人返售金融资产代全货用实门的等。 开放期内,每个交易日日终。并有的实人服务会务保证金后,基金保留的现金或调用日在一年以内的政府债务,以证、资产支持证券。买人服务会等是不是的国务在指数,以证、资产支持证券。买人服务金额资产价值的95%。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金。应收申购款等。

等。 本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第(一)项、第(三)项、第(五)项次第(七)项的限制。 传法金参与融资融券和转融通业务及投资其他品种(包括但不限于期权、收益互换等)的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资源格和风险收益特征 并控制风险的前捷下、经与基金托管人协商一致后、参与融资融券业务、转融通业务及投资其他品种。以提高投资效率及进行风险管理。周时基金参与融资融券、转融通业务及投资其他品种风险控制顺则,具体零与比例限制、费用收全信息披露、估值方法及其他相关主律法规的要求执行。 人具本的投资策略

"一)量化选股 本基金的量化选股模型在注重基本面研究的同时,结合多种统计量化策略,主要包括 多因于模型和统计套利模型。

《1)多因子模型 《1)多因子模型 本基金的多因子选股策略秉承价值投资和技术投资相结合的理念,不但将可能影响 股价并且具有经济意义的基本面指标纳入因子汇总,包括盈利能力,价值,成长性,规模等 基本面因子;同时也关注市场短期的波动指标,包括交易活动,持仓量,成交量,期现价差、 不同期限的边量趋势,强弱指标,超妥超少、反转概率等发大因子。通过对因子的量化分析 和综合评价,精选最能代表这些因子的个股构建多头组合。 (2) 经计专和推测

(2)统计套利模型 本基金通过对股票大量数据的回溯研究,用量优先计分析工具找出市场内部个股之 同的稳定性关系,估计其概率分布并确定该分布的极端区域。由于市场进入这些极端区域 域后价格关系不能长久维持,可以借由计算机快速捕捉市场进入这些极端区域的机会, 挑选历史上大概率随赢市场的股票进行组合,试图以较高的成功概率进场套利。统计套 "活现金在2016年之方3年1年期报程与经济公长的五建动之,估计相关率量的概率分布

(3)事件级对模型 本基金通过挖捆和深人分析可能造成股价异常波动的事件以及对过往事件的数据 检测。获取事件影响所带来的超额投资回报。事件驱动模型的"事件"是指具有较为明确 的时间和内容,能够对部分投资人的投资行为产生一定的影响,从而决定股价短期波动 的因素。

。 (二)期货对冲策略 本基金的期货对冲策略包含了对冲策略、期现套利策略和择时策略。

本基金的期份对沖領略包含了对沖領略,期现套利策略和译时策略。 (1)对沖海縣 本基金将按照现货头寸和股票特性,使用量化方法剥离并测算整体的市场风险,进而 调整期份对冲的数量。以达到对冲市场风险。 (2)期现套利策略 当期份会约的基差变化达到一定要求时,本基金进行期现头寸的调整,赚取基差收 当期份会约跨期基差合理时进行期货换仓,获得跨期查利收益。 (3)择时策略。 通过对历史数据的研究,给出对市场涨跌判断的择时信号。根据信号的强弱增加或减 体的仓位。或者输放用平均补助股情期份会约的头、活料付据包括长期份定观经济 、市场资金而等基本面信息,中期的市场情绪和指数的形态,以及短期技术指标超买 编额下、中级举注。

判断下一步涨跌走势。 (4)其他对冲工具的运用,基金经理会实时关注市场的发展和新对冲工具的出现,适

时运用其他的对冲工具进行合理对冲。
(三)其他策略
(1)情绪投资策略
在债券投资策略
在债券投资方面,本基金将深人研究国民经济运行状况,货币市场及资本市场资金供 求关系,采取利率策略,信用策略,相对价值策的以及正逆回购进行杠杆操作等积极投资 策略,在严格控制风险的制度下,发掘和利用市场头衡提供的投资机会,实现组合增值。
(2)衍生品投资策略
在严格遵守证监会发相关法律法规规定和控制基金下行风险的前提下,本基金将合

(27/13年高班文政聯絡 在严格遵守证监会及相关法律法规规定和控制基金下行风险的前提下,本基金将合理利用股指期货,权证等行生品工具,通过量化方法挖掘可能的套利机会。在严格控制风险的基础上,提高基金资产的投资收益。 基金管理人建立了股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期

30日。本报告财务数据未经审计。 1. 报告期末基金资产组合情况

1	权益投资	85,523,720.64	73.83
	其中:股票	85,523,720.64	73.83
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	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返 售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,065,619.87	13.87
8	其他资产	14,255,119.31	12.31
9	合计	115,844,459.82	100.00
	设告期末按行业分类的股票 报告期末按行业分类的境		
P 76T	行业 光剔	公会价值(元)	上北全资产岛估计例(mt)

	报告期末按行业分类的境内股		
玛	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
	农、林、牧、渔业	73,559.78	0.06
	采矿业	2,297,180.53	2.00
	制造业	41,331,812.76	36.00
,	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	1,840,658.01	1.60
	建筑业	2,142,748.48	1.87
	批发和零售业	3,937,295.52	3.43
	交通运输、仓储和邮政业	1,733,239.05	1.51
	住宿和餐饮业	-	-
	信息传输、软件和信息技术服务 业	1,688,583.92	1.47
	金融业	20,458,162.19	17.82
	房地产业	6,066,029.18	5.28
	租赁和商务服务业	1,425,590.42	1.24
	科学研究和技术服务业	15,288.00	0.01
	水利、环境和公共设施管理业	442,980.25	0.39
	居民服务、修理和其他服务业	-	-
	教育	-	-
	卫生和社会工作	21,744.00	0.02
	文化、体育和娱乐业	2,031,568.19	1.77
	综合	17,280.36	0.02
	合计	85,523,720.64	74.49

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约 序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 3,226,350.0 民生银行 2.092.783.28 601818 364,990 1,427,110.90 1.24 216,848 1,324,941.28

1,240,261.00 1,220,434.67

1,169,592.3

L汽集团 本报告期末,本基金未持有债券。 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

大秦铁路

9. 18日39/16 中部 本报告期末、本基金未持有资产支持证券。 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。 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。 4.44年期末,本基金未持有权证。

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 持仓量 合约市值(元) 代码 名称

-29 -27,539,560.00 IF1812 沪深300期货1812合约 -38 -39,197,760.00 -2,495,517.00 公允价值变动总额合计(元 -4,054,478.18 股指期货投资本期公允价值变动(-15,643,278.18

(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。力争在牛市和赌市中均分投资者获取稳健的正向收益。 10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 (1)本期国债期货投资政策

(1)本期国情即拐投资政策 本报告期末,本基金无国债期货投资。 (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,本基金投资的国债期货投资。 (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。 11.报容别今和经率时;

11. 投资组合报告附注 (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 制目前一年内受到公开谴责。外罚的情形。

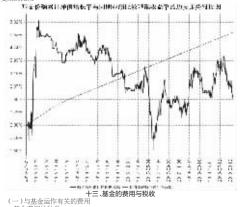
(2)本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,254,084.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,034.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,255,119.31

15. 投资组合根启树注的其他文字描述部分 由于四含五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。 十二.基金的业绩 基金管理人依照恪尽职守,诚实"信用"谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)本报告期基金					益率的比较	Ê
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			2-4
2015年4月21日(基金 合同生效日)至2015 年12月31日	4.50%	0.29%	1.55%	0.01%	2.95%	0.28%
2016年1月1日至2016 年12月31日	-2.20%	0.17%	1.49%	0.00%	-3.69%	0.17%
2017年1月1日至2017 年12月31日	-0.98%	0.24%	1.46%	0.00%	-2.44%	0.24%
2018年1月1日至2018 年9月30日	0.69%	0.24%	1.07%	0.00%	-0.38%	0.24%
基金合同生效日起至	1.00%	0.2266	5 6901.	0.0166	2 7900	0.2266

乃支持确認计準備培養率与同期心想比較時能改為平成历史走過到此刻



十三.基金的费用与税收
1.基金费用的种类
(1)基金管理人的费用
1.基金费用的种类
(1)基金管理人的管理费;
(2)基金任意人的托管费;
(3)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
(4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
(5)基金的证券,期贷交易费用;
(6)基金的证券,期贷交易费用;
(6)基金的证券,期贷交易费用;
(8)基金相关账户的开户及维护费用;
(8)基金相关账户的开户及维护费用;
(8)基金相关账户的开户及维护费用;
(8)基金相关账户的开户及维护费用;
(2)接金牌对张力量方关键定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的转他费用。
2.基金费用计据方法,计提标准和支付方式
(1)基金管理人的管理费为基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。
和下:基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。
和下:基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。
和下:基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之有。
和下:基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之有。

以下: A、基金管理人的基本管理费 本基金的基本管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。基本管理费的计算

支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。 费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解

B.基金管理人的树加管理费 1)基金管理人可在同时满走以下条件的前提下,提取附加管理费。 (1)基合基金收益分配条件。 (2)对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 设金收益的10%作为附加管理费:即每次提取评价日境取附加管理费前的基金份领累 护住公观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 银净值和的购高者基金管理人才能收取的加管理费。 提取评价日;每个基金封闭期的最后一个工作日。 2)附加管理费时算方法和提取 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 方法为。

其中, 为提取评价日摄取附加管理费前的基金份额累计净值; 为以往接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,其中首次封闭期的为1; 为据取评价日的基金比例额数。

图本学规模 = $(P_A - P_B) \times 10\% \times S_A$

为提取评价日的基金总份额数。 由基金社管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内,按 服指定的账户路径进行资金支付、基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假 日、公休假等。文付日期顾证。费用自动加划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符, 及时联系基金托管人协商解决。 (2)基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如 下。

H=E×0.2%+当年大数 H为每日应计据的基金托管费 E为前一日的基金资产净值 基金托管费由计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据与基金管 理人核对一致的财务数据,目动在月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付, 基金管理人无需用出具资金划按指令。若遇法定节假日,公休日等,支付日期顺延,费用自 动加划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及叶银系基金托管人协商解决。 上述"一、基金费用的种类中第3—9项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用 实际支出金额列人当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。 (二)不列人基金费用的项目

(二)不列人基金费用的项目 下列费用不列人基金费用的项目 1.基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3.《基金合同》生效前的相关费用; 4.其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列人基金费用的项目。

4.共同依据和天公年在來及产目區止血云的有大规定不得列入整金取用的项目。 (三)基金的收 本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按图家税收法律,法规执行。 +在招募说明书依据(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》及证券投资基金销售管理办法》、(证券投资基金信息披露管理办法》及证券投资基金销售管理办法》、(证券投资基金信息披露管理办法》及货户有关法律法规的要求、对本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新、共职更新的成分公析。

更新的内容如片: 1.在"重更提片"都分更新了相关内容: 2.在"第三部分基金管理人"部分更新了相关内容: 3.在"第四部分基金件管人"部分更新了相关内容: 4.在"第五部分相关服务机构"中,增加了部分销售机构并更新了相关服务机构的内

4.在"第五部分相关服务机构"中,增加1 mp/用于mp/m=1 mp/用于mp/m=1 mp/m=1 mp/m=

江苏爱朋医疗科技股份有限公司 首次公开发行股票并在创业板上市网上定价发行 申购情况及中签率公告

保荐人(主承销商):广发证券股份有限公司

江苏爱朋医疗科技股份有限公司(以下简称"发行人")首次公开发行不 超过2,020万股人民币普通股(A股)(以下简称"本次发行")并在创业板上市 的申请已获中国证券监督管理委员会证监许可【2018】1802号文核准。本次发 行采用网下向符合条件的投资者询价配售(以下简称"网下发行")和网上按 市值申购向持有深圳市场非限售A股或非限售存托凭证市值的社会公众投资

者定价发行(以下简称"网上发行")相结合的方式

排进行信息披露

定本次发行股份数量为2,020万股。回拨机制启动前,网下初始发行数量1,300 万股,占本次发行总股数的64.36%;网上初始发行数量720万股,占本次发行总 股数的35.64%。 发行人于2018年12月4日(T日)利用深圳证券交易所交易系统网上定价 初始发行"爱朋医疗"A股720万股。

发行人与主承销商广发证券股份有限公司(以下简称"主承销商")协商确

本次发行在缴款环节有重大变化,敬请投资者重点关注,并于2018年12月 6日(T+2日)及时履行缴款义务: 1、网下投资者应根据《江苏爱朋医疗科技股份有限公司首次公开发行股 票并在创业板上市网下发行初步配售结果公告》,于2018年12月6日(T+2日) 16:00前,按最终确定的发行价格与获配数量,及时足额缴纳新股认购资金

网上投资者申购新股中签后,应根据《江苏爱朋医疗科技股份有限公司

首次公开发行股票并在创业板上市网上定价发行摇号中签结果公告》履行缴 以务,确保其资金账户在2018年12月6日(T+2日)日终有足额的新股认购资 金,投资者款项划付需遵守投资者所在证券公司的相关规定。 网下和网上投资者放弃认购部分的股份由主承销商包销 2、当出现网下和网上投资者缴款认购的股份数量合计不足本次公开发行

数量的70%时,主承销商将中止本次新股发行,并就中止发行的原因和后续安

3、有效报价网下投资者未参与申购或者获得初步配售的网下投资者未及 时足额缴纳认购款的,将被视为违约并应承担违约责任,主承销商将违约情况 报中国证券业协会备案。网上投资者连续12个月内累计出现3次中签但未足额缴款的情形时,自结算参与人最近一次申报其放弃认购的次日起6个月(按180 个自然日计算,含次日)内不得参与新股、存托凭证、可转换公司债券、可交换 一、网上申购情况 主承销商根据深圳证券交易所提供的数据、对本次网上定价发行的申购情

况进行了统计,本次网上定价发行有效申购户数为11,295,440户,有效申购股 数为57,927,470,500股,配号总数为115,854,941个,起始号码为000000000001, 截止号码为000115854941 二、回拨机制实施、发行结构及网上发行中签率 根据《江苏爱朋医疗科技股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上

市发行公告》公布的回拨机制,由于网上初步有效申购倍数为8,045.48201倍

高于150倍,发行人和主承销商决定启动回拨机制,将本次发行股份的54.36% 由网下回拨至网上。回拨后,网下最终发行数量为202万股,占本次发行总量 的10%;网上最终发行数量为1,818万股,占本次发行总量90%。回拨后本次网 上发行中签率为0.0313840736%,有效申购倍数为3,186.32951倍。 三. 网上摇号抽签 发行人与主承销商定于2018年12月5日(T+1日)在深圳市红荔路上步工

业区10栋2楼进行摇号抽签,并将于2018年12月6日(T+2日)在《中国证券报》、

《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》上公布摇号中签结果

发行人:江苏爱朋医疗科技股份有限公司 2018年12月5日 证券代码:002092 证券简称:中泰化学 公告编号:2018-159

新疆中泰化学股份有限公司关于 下属公司收到专项补贴资金的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性 陈述或重大遗漏。

一、获得补助的基本情况 根据《新疆维吾尔自治区关于提高出疆棉纱棉布运费补贴标准有关问题的通知》、《自 治区纺织服装生产企业电费财政补贴暂行管理办法》、《自治区纺织服装企业新招录新疆籍 员工社会保险补贴资金管理暂行办法》、《新疆维吾尔自治区纺织服装产业专项补贴资金管 理办法》、《关于切实做好城乡富余劳动力有组织转移就业政策保障工作的通知》、《关于拨 付2018年10月份产业扶持资金的通知》(阿经开财发[2018]42号)以及《关于拨付2018年10月 份优惠政策补贴资金的通知》(阿经开财发[2018]41号)的文件通知,新疆中泰化学股份有限 公司(以下简称"公司")下属公司新疆富丽达纤维有限公司(以下简称"新疆富丽达")、阿 拉尔市富丽达纤维有限公司(以下简称"阿拉尔富丽达")、巴州金富特种纱业有限公司(以 下简称"巴州金富")、新疆富丽震纶棉纺有限公司(以下简称"富丽震纶")于近日收到上

述补贴资金共计2,949.18万元,具体如下: (一)新疆富丽达收到新疆库尔勒经济技术开发区财政局拨付的2018年第三季度电费补 贴资金23.62万元,2018年第二季度转移就业补贴资金42.28万元,共计65.90万元。

(二)巴州金富收到新疆库尔勒经济技术开发区财政局拨付的2018年第二季度转移就业 补贴资金37.84万元,2018年第三季度运费补贴资金1,000.00万元,共计1,037.84万元。 (三)富丽震纶收到新疆库尔勒经济技术开发区财政局拨付的2018年第一、二季度社保

补贴资金139.10万元,2018年第三季度运费补贴资金1,000.00万元,共计1,139.10万元。 (四)阿拉尔富丽达收到阿拉尔经济技术开发区财政局拨付2018年10月厂房补贴资金 600.00万元,2018年10月污水补贴资金106.34万元,共计706.34万元。

二、补助的类型及对上市公司的影响

根据《企业会计准则第16号一政府补助》的规定,与资产相关的政府补助是指企业取得 的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助;与收益相关的政府补助是指除与资产 相关的政府补助之外的政府补助。上述公司获得的政府补助不用于购建或以其他方式形成长 期资产,故均为与收益相关的政府补助。

(二)补助的确认和计量 按照《企业会计准则第16号一政府补助》的规定,与日常活动相关的政府补助,应当按照

经济业务实质,计人其他收益或冲减相关成本费用;与企业日常活动无关的政府补助,应当计 入营业外收支。最终结果以会计师事务所审计结果为准。 (三)补助对上市公司的影响

根据《企业会计准则第16号一政府补助》的规定,收到的上述专项补贴资金中的2,623.62 万元前期已经计提,本期收到对当期损益没有影响,其余补贴资金325.56万元计入与日常活 动相关的政府补助,冲减相关成本费用。上述政府补助将对公司经营业绩产生积极影响,具体 会计处理以会计师年度审计确认的结果为准。

(四)风险提示和其他说明

本次所披露政府补助的具体会计处理以会计师事务所审计结果为准,请投资者注意投资

新疆中泰化学股份有限公司 董事会

二〇一八年十二月五日