

中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资 基金 2017 年半年度报告

2017 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
7.6 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.....	70
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	70
7.8 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.....	70
7.9 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.....	70
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
7.12 投资组合报告附注.....	71
§8 基金份额持有人信息.....	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
8.3 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.....	73
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	74
§9 开放式基金份额变动.....	75
§10 重大事件揭示.....	76
10.1 基金份额持有人大会决议.....	76
10.2 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.....	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
10.4 基金投资策略的改变.....	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
10.8 其他重大事件.....	77
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	80

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§12 备查文件目录.....	82
12.1 备查文件目录.....	82
12.2 存放地点.....	82
12.3 查阅方式.....	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中金沪深 300	
基金主代码	003015	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 22 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,683,713.85 份	
下属分级基金的基金简称:	中金沪深 300A	中金沪深 300C
下属分级基金的交易代码:	003015	003579
报告期末下属分级基金的份额总额	10,518,974.56 份	164,739.29 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金,在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%,年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	<p>1、资产配置策略:本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金,股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%,大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后,对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略:本基金作为股票指数增强型发起式证券投资基金,股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资主要策略为标的指数投资策略,通过复制目标股票指数作为基本投资组合,然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素,找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子,并根</p>

	<p>据因子对应的股票权重调整基本投资组合,最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化,力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。</p> <p>3、债券投资策略:出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量,本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况,采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度,确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率,确定债券资产配置。</p> <p>4、股指期货投资策略:本基金可投资股指期货。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜季柳	郭明
	联系电话	010-63211122	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95588
传真		010-66159121	010-66105798
注册地址		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	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市西城区太平桥大街	北京市西城区复兴门内大街55号

	18 号丰融国际中心北楼 17 层	
邮政编码	100032	100140
法定代表人	林寿康	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普 通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 18 号丰 融国际中心北楼 17 层

§ 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

基金级别	中金沪深 300A	中金沪深 300C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	226,330.70	442.03
本期利润	737,567.79	8,762.05
加权平均基金份额本期利润	0.0723	0.1861
本期加权平均净值利润率	6.88%	17.79%
本期基金份额净值增长率	6.94%	7.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	685,845.00	11,671.88
期末可供分配基金份额利润	0.0652	0.0709
期末基金资产净值	11,528,051.72	181,551.46
期末基金份额净值	1.0959	1.1021
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	9.59%	3.56%

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

中金沪深 300A

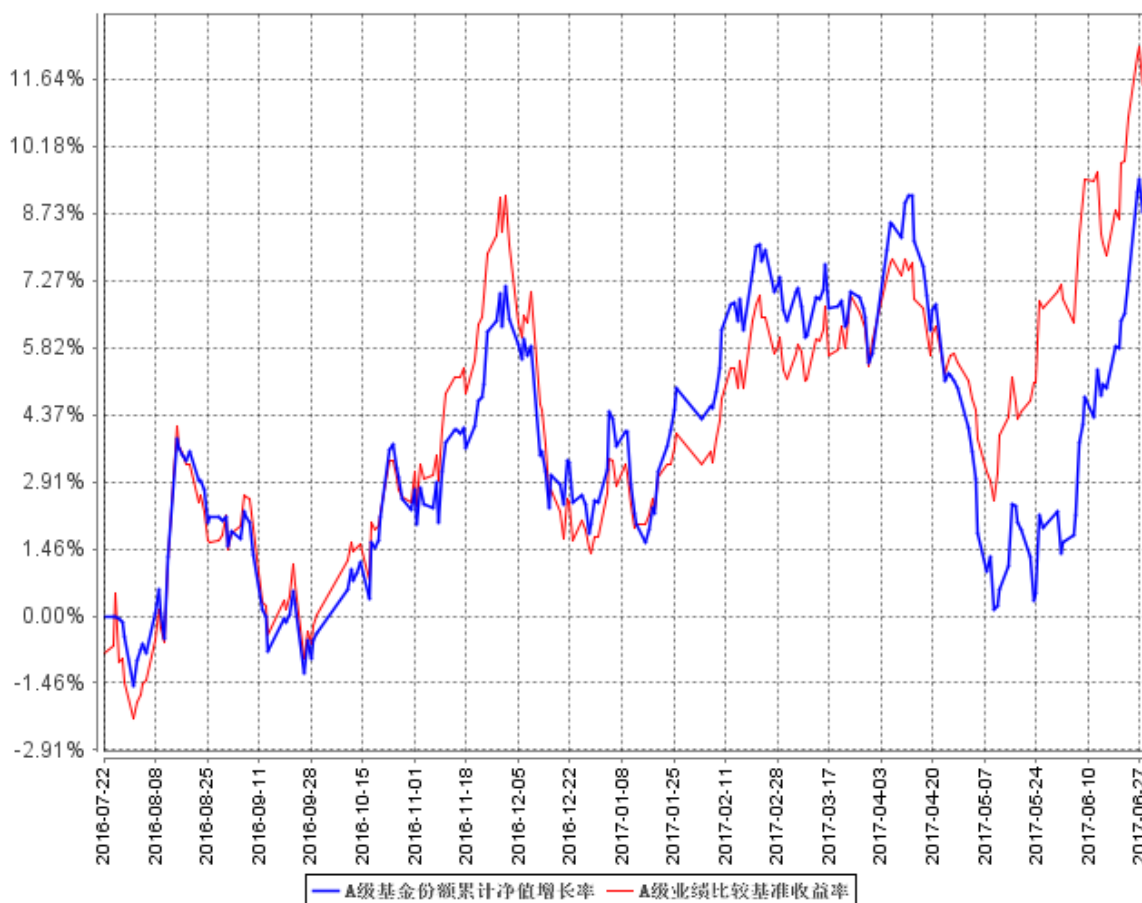
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.16%	0.66%	4.73%	0.64%	2.43%	0.02%
过去三个月	3.68%	0.74%	5.79%	0.59%	-2.11%	0.15%
过去六个月	6.94%	0.64%	10.23%	0.54%	-3.29%	0.10%
自基金合同生效起至今	9.59%	0.64%	12.11%	0.63%	-2.52%	0.01%

中金沪深 300C

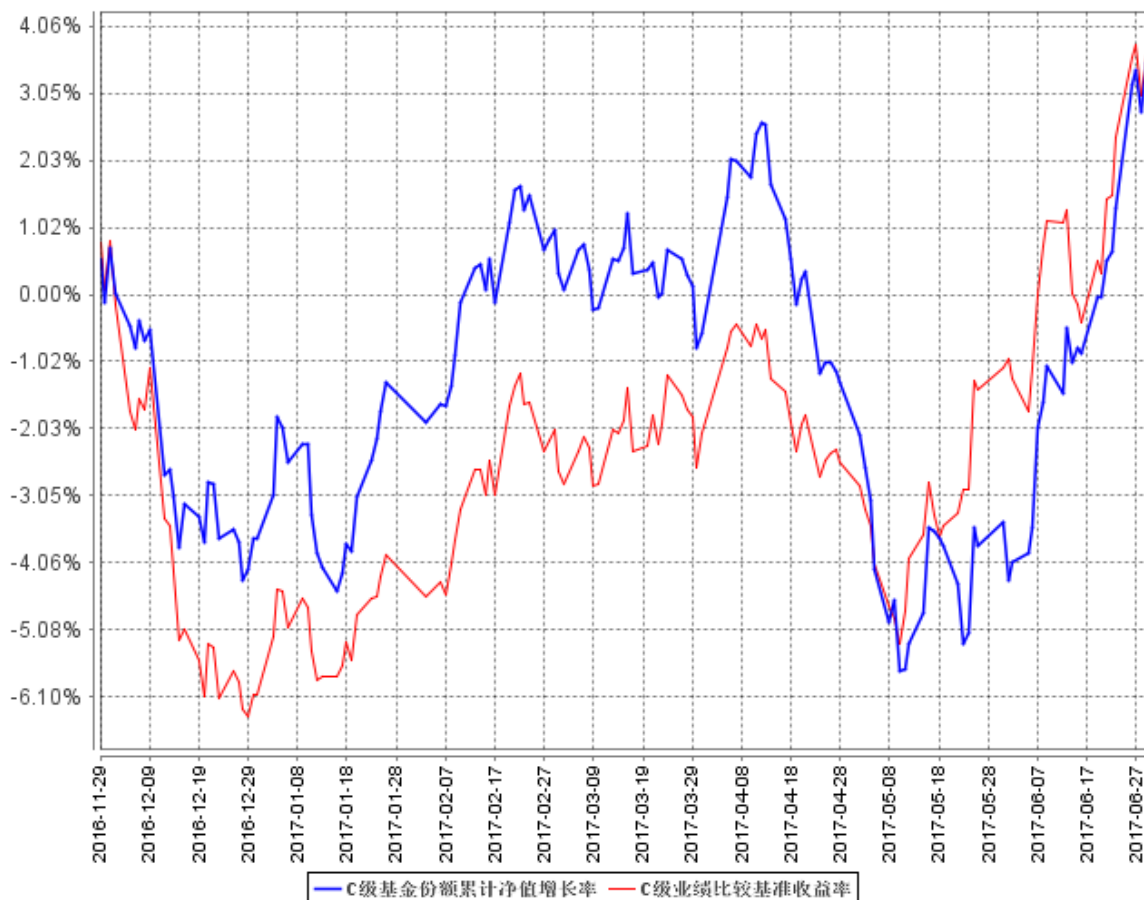
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.27%	0.66%	4.73%	0.64%	2.54%	0.02%
过去三个月	4.19%	0.73%	5.79%	0.59%	-1.60%	0.14%
过去六个月	7.54%	0.63%	10.23%	0.54%	-2.69%	0.09%
自基金合同生效起至今	3.56%	0.64%	3.56%	0.59%	0.00%	0.05%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 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”、“公司”）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”）作为全资股东出资设立，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 2017 年 6 月 30 日，公司旗下管理 10 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、中金消费升级股票型证券投资基金、中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、中金金利债券型证券投资基金、中金新安灵活配置混合型证券投资基金和中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金，证券投资基金管理规模 52.62 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		
魏宇	本基金的基金经理	2017 年 3 月 28 日	-	6	香港大学统计专业博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发，参与管理数十亿人民币的量化投资组合，投资标的包括 A 股及股指期货。2014 年 11 月，加入中金基金管理有限公司

					<p>司，历任高级经理，现任副总经理。2015 年 12 月 25 日至 2017 年 2 月 22 日任量化专户投资经理。2017 年 3 月 28 日至今任下列公募基金的基金经理，基金名称：中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金。</p>
李云琪	本基金的基金经理	2016 年 7 月 22 日	2017 年 3 月 28 日	8	<p>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公司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理。</p>

注：1、本报告期内，本基金基金经理有变更

2、任职日期说明：原任基金经理李云琪先生的任职日期为基金合同生效日，现任基金经理魏宇先生的任职日期为基金经理变更公告确定的任职日期

3、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

4、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合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规规定和基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金采用量化策略进行指数增强。在本报告期内，市场风格转换时，基金相对于指数，产生了一定的跟踪误差。我们在下半年将更加严格的控制风险，密切关注市场变化，应对风格转换，力争能获得超过业绩基准的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金沪深 300A 基金份额净值为 1.0959 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.94%；截至本报告期末中金沪深 300C 基金份额净值为 1.1021 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.54%；同期业绩比较基准收益率为 10.23%。

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 2017 年下半年，预计将会继续坚持金融去杠杆，货币政策维持稳健中性的基调不变，流

动性“中性适度”，下半年经济下行压力将高于上半年。利好在于中央对于经济的发展已经作出了系列重要的部署：设立“雄安新区”，深化“一带一路”战略等，为新一轮的经济增长提供支撑；PPP 项目预计也将继续稳步推进，助力基建。国际上，主要还是关注全球经济复苏的情况，以及美国和欧洲的货币政策。

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验。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《公开募集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。

4.8 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

本基金为发起式基金，截止本报告期末，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的管理人——中金基金管理有限公司在中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	879,068.24	859,686.61
结算备付金		180,770.02	145,927.35
存出保证金		9,839.25	7,304.35
交易性金融资产	6.4.7.2	10,665,372.88	9,406,404.72
其中：股票投资		10,665,372.88	9,406,404.72
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		251,081.61	119,152.43
应收利息	6.4.7.5	248.75	249.88
应收股利		-	-
应收申购款		5,994.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,992,374.75	10,538,725.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	17,662.08
应付赎回款		54,542.72	-
应付管理人报酬		4,557.56	4,443.15
应付托管费		1,367.27	1,332.96
应付销售服务费		92.07	-
应付交易费用	6.4.7.7	182,675.35	68,088.42
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	39,536.60	110,417.17
负债合计		282,771.57	201,943.78
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	10,683,713.85	10,086,780.86
未分配利润	6.4.7.10	1,025,889.33	250,000.70
所有者权益合计		11,709,603.18	10,336,781.56
负债和所有者权益总计		11,992,374.75	10,538,725.34

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，中金沪深 300 A 类基金份额净值为人民币 1.0959 元，中金沪深 300 C 类基金份额净值为人民币 1.1021 元；基金份额总额为 10,683,713.85 份，其中中金沪深 300 A 类基金份额为 10,518,974.56 份，中金沪深 300 C 类基金份额为 164,739.29 份。

6.2 利润表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		1,092,679.07
1.利息收入		4,425.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,425.02
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		566,062.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	494,181.12
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	71,881.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	519,557.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,634.39
减：二、费用		346,349.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,662.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,998.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	92.07
4. 交易费用	6.4.7.18	271,394.61
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-

6. 其他费用	6.4.7.19	40,201.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		746,329.84
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		746,329.84

注：本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	10,086,780.86	250,000.70	10,336,781.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	746,329.84	746,329.84
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）	596,932.99	29,558.79	626,491.78
其中：1.基金申购款	1,033,552.72	50,785.06	1,084,337.78
2.基金赎回款	-436,619.73	-21,226.27	-457,846.00
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)	10,683,713.85	1,025,889.33	11,709,603.18
---------------------	---------------	--------------	---------------

注：本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日，无上年度可比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

<u> 孙菁 </u>	<u> 杜季柳 </u>	<u> 白娜 </u>
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

中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（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 2016 年 7 月 5 日证监许可 [2016] 1516 号《关于准予中金沪深 300 指数增强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》及配套规则和《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式指数型基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）。

本基金通过中金基金直销中心公开发售，募集期为 2016 年 7 月 18 日。经向中国证监会备案，《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 22 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 10,001,300.00 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、《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、债券回购、银行存款等固定收益类

资产，以及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）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表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，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》以及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》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况、自 2017 年 1 月 1 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金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。本基金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。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金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、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金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。本基金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。

本基金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。

6.4.4.4 金融资产和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基金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。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- (1) 所转移金融资产的账面价值；
- (2) 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，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金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。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并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。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了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，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 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：

- (1) 本基金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；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 / (累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具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（如适用）后的净额确认。

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扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）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，在回购期内按

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。

公允价值变动收益核算基金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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

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，在回购期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。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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，本基金根据中国证监会公告〔2008〕38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《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。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字〔2007〕21号《关于证券投

资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

根据财税字 [1998] 55 号文《财政部、国家税务总局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 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《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 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《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 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、《关

于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017] 56 号）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) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），以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。管理人接受投资者委托以及管理人发生的除资管产品运营业务以外的其他增值税应税行为（以下称其他业务），按照现行规定缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额，未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2017 年 6 月 30 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(d) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e) 对基金取得的股票的股息、红利收入，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。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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税所得额；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 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(f) 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。

(g) 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	879,068.24
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	879,068.24

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,328,845.24	10,665,372.88	336,527.64
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	10,328,845.24	10,665,372.88	336,527.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	162.85
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	81.40
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	4.50
合计	248.75

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
----	------------------------

交易所市场应付交易费用	182,675.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	182,675.35

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	22.70
预提费用	39,080.53
指数使用费	433.37
合计	39,536.60

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金沪深 300A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,086,686.89	10,086,686.89
本期申购	726,723.90	726,723.90
本期赎回(以“-”号填列)	-294,436.23	-294,436.23
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	10,518,974.56	10,518,974.56

金额单位：人民币元

中金沪深 300C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	93.97	93.97
本期申购	306,828.82	306,828.82
本期赎回(以“-”号填列)	-142,183.50	-142,183.50
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	164,739.29	164,739.29

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金沪深 300A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	432,816.65	-182,818.28	249,998.37
本期利润	226,330.70	511,237.09	737,567.79
本期基金份额交易产生的变动数	26,697.65	-5,186.65	21,511.00
其中：基金申购款	43,324.70	-6,680.74	36,643.96
基金赎回款	-16,627.05	1,494.09	-15,132.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	685,845.00	323,232.16	1,009,077.16

单位：人民币元

中金沪深 300C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4.02	-1.69	2.33
本期利润	442.03	8,320.02	8,762.05
本期基金份额交易产生的变动数	11,225.83	-3,178.04	8,047.79
其中：基金申购款	18,785.53	-4,644.43	14,141.10
基金赎回款	-7,559.70	1,466.39	-6,093.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,671.88	5,140.29	16,812.17

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,974.04
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,377.18
其他	73.80
合计	4,425.02

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	102,730,535.45
减：卖出股票成本总额	102,236,354.33
买卖股票差价收入	494,181.12

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	71,881.43
基金投资产生的股利收益	-

合计	71,881.43
----	-----------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	519,557.11
——股票投资	519,557.11
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	519,557.11

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,634.39
其他	-
合计	2,634.39

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	271,394.61
银行间市场交易费用	-
合计	271,394.61

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,204.14
信息披露费	14,876.39
指数使用费	853.15
汇划手续费	268.00
合计	40,201.68

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
工商银行	基金托管人

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	26,662.24
其中：支付销售机构的客户维护费	131.95

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 1.00%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：日基本管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数；

2、本基金管理人自 2016 年 11 月 25 日起对本基金实施调整后的基金管理费率，调整后的基金管理费为年费率 0.50%；

3、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,998.63

注：1、支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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×0.15%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金沪深 300A	中金沪深 300C	合计
中金基金	-	27.07	27.07
工商银行	-	-	-
中金公司	-	-	-
合计	-	27.07	27.07

注：中金沪深 300C 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.40% 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 C 类基金份额销售服务费=前一日 C 类基金份额资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	中金沪深 300A	中金沪深 300C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
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	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	95.06%	-

注：1、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。

2、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

3、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	879,068.24	2,974.04

注：1、本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金通过“工商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 2017 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 190,609.27 元，本期间产生的利息收入为人民币 1,450.98 元。

3、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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
600666	奥瑞德	2017年6月1日	临时停牌	17.40	-	-	6,227	107,760.50	108,349.80	-
600795	国电电力	2017年6月5日	临时停牌	3.60	-	-	13,506	46,479.93	48,621.60	-

		日	牌							
002252	上海 莱士	2017 年 6 月 21 日	临 时 停 牌	20.24	-	-	200	4,044.00	4,048.00	-
601919	中国 远洋	2017 年 5 月 17 日	临 时 停 牌	5.35	2017 年 7 月 26 日	5.89	393	2,110.53	2,102.55	-
002426	胜利 精密	2017 年 1 月 16 日	临 时 停 牌	7.68	-	-	132	1,106.87	1,013.76	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型股票基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现

本基金的投资目标。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制控制在合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末无按长期评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	879,068.24	-	-	-	879,068.24
结算备付金	180,770.02	-	-	-	180,770.02
存出保证金	9,839.25	-	-	-	9,839.25
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	10,665,372.88	10,665,372.88
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	251,081.61	251,081.61
应收利息	-	-	-	248.75	248.75
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,994.00	5,994.00
资产总计	1,069,677.51	-	-	10,922,697.24	11,992,374.75
负债					

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	54,542.72	54,542.72
应付管理人报酬	-	-	-	4,557.56	4,557.56
应付托管费	-	-	-	1,367.27	1,367.27
应付交易费用	-	-	-	182,675.35	182,675.35
应付销售服务费	-	-	-	92.07	92.07
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	39,536.60	39,536.60
负债总计	-	-	-	282,771.57	282,771.57
利率敏感度缺口	1,069,677.51	-	-	10,639,925.67	11,709,603.18
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	859,686.61	-	-	-	859,686.61
结算备付金	145,927.35	-	-	-	145,927.35
存出保证金	7,304.35	-	-	-	7,304.35
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	9,406,404.72	9,406,404.72
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	119,152.43	119,152.43
应收利息	-	-	-	249.88	249.88
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	1,012,918.31	-	-	9,525,807.03	10,538,725.34
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	17,662.08	17,662.08
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	4,443.15	4,443.15
应付托管费	-	-	-	1,332.96	1,332.96
应付交易费用	-	-	-	68,088.42	68,088.42
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	110,417.17	110,417.17
负债总计	-	-	-	201,943.78	201,943.78
利率敏感度缺口	1,012,918.31	-	-	9,323,863.25	10,336,781.56

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	10,665,372.88	91.08	9,406,404.72	91.00

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	10,665,372.88	91.08	9,406,404.72	91.00

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	10,665,372.88	88.93
	其中：股票	10,665,372.88	88.93
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	1,059,838.26	8.84
7	其他各项资产	267,163.61	2.23
8	合计	11,992,374.75	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	218,522.16	1.87
B	采矿业	803,622.19	6.86
C	制造业	5,100,051.26	43.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	356,198.94	3.04

E	建筑业	279,776.76	2.39
F	批发和零售业	259,857.50	2.22
G	交通运输、仓储和邮政业	333,066.06	2.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	795,779.47	6.80
J	金融业	1,208,767.82	10.32
K	房地产业	657,827.72	5.62
L	租赁和商务服务业	281,052.25	2.40
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	31,362.16	0.27
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	138,324.04	1.18
S	综合	65,140.68	0.56
	合计	10,529,349.01	89.92

7.2.2 期末积极投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	136,023.87	1.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	136,023.87	1.16

7.2.3 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港股通股票资产。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002131	利欧股份	66,551	218,952.79	1.87
2	002714	牧原股份	8,028	218,522.16	1.87
3	000425	徐工机械	56,515	211,931.25	1.81
4	601899	紫金矿业	60,884	208,832.12	1.78

5	600031	三一重工	25,263	205,388.19	1.75
6	000725	京东方 A	48,100	200,096.00	1.71
7	600737	中粮屯河	21,145	199,608.80	1.70
8	000983	西山煤电	22,393	196,386.61	1.68
9	000338	潍柴动力	14,867	196,244.40	1.68
10	000728	国元证券	15,859	193,796.98	1.66
11	002470	金正大	24,966	187,993.98	1.61
12	600688	上海石化	27,564	182,198.04	1.56
13	600188	兖州煤业	14,813	181,311.12	1.55
14	600383	金地集团	15,501	177,796.47	1.52
15	600585	海螺水泥	6,959	158,178.07	1.35
16	002456	欧菲光	8,611	156,461.87	1.34
17	600718	东软集团	9,793	152,281.15	1.30
18	002385	大北农	24,184	152,117.36	1.30
19	002508	老板电器	3,471	150,919.08	1.29
20	600498	烽火通信	5,732	145,306.20	1.24
21	600519	贵州茅台	300	141,555.00	1.21
22	000623	吉林敖东	6,091	139,422.99	1.19
23	600588	用友网络	8,100	138,672.00	1.18
24	600373	中文传媒	5,804	136,452.04	1.17
25	600297	广汇汽车	17,041	128,318.73	1.10
26	600271	航天信息	6,127	126,461.28	1.08
27	002007	华兰生物	3,390	123,735.00	1.06
28	000415	渤海金控	17,896	120,440.08	1.03
29	000718	苏宁环球	20,307	118,999.02	1.02
30	000709	河钢股份	28,163	118,002.97	1.01
31	000630	铜陵有色	41,417	117,624.28	1.00
32	601866	中海集运	31,541	113,547.60	0.97

33	600649	城投控股	10,716	112,625.16	0.96
34	600886	国投电力	14,119	111,540.10	0.95
35	000559	万向钱潮	10,241	108,759.42	0.93
36	601288	农业银行	30,208	106,332.16	0.91
37	002152	广电运通	12,758	106,018.98	0.91
38	600019	宝钢股份	15,153	101,676.63	0.87
39	601997	贵阳银行	6,305	99,682.05	0.85
40	600109	国金证券	8,253	96,725.16	0.83
41	000625	长安汽车	6,579	94,869.18	0.81
42	600023	浙能电力	16,752	91,465.92	0.78
43	601992	金隅股份	14,046	90,877.62	0.78
44	600221	海南航空	27,500	88,550.00	0.76
45	002411	必康股份	3,000	86,760.00	0.74
46	601857	中国石油	11,236	86,404.84	0.74
47	601628	中国人寿	3,187	85,985.26	0.73
48	600362	江西铜业	5,068	85,446.48	0.73
49	002174	游族网络	2,656	84,354.56	0.72
50	002183	怡亚通	9,611	82,942.93	0.71
51	600170	上海建工	21,536	82,267.52	0.70
52	002195	二三四五	11,255	80,473.25	0.69
53	600352	浙江龙盛	8,423	80,271.19	0.69
54	601377	兴业证券	10,716	79,619.88	0.68
55	600208	新湖中宝	17,500	78,750.00	0.67
56	002241	歌尔股份	4,036	77,814.08	0.66
57	600549	厦门钨业	3,504	75,300.96	0.64
58	000060	中金岭南	6,567	73,550.40	0.63
59	601225	陕西煤业	10,363	73,266.41	0.63
60	600705	中航资本	12,900	72,885.00	0.62

61	002424	贵州百灵	3,720	70,159.20	0.60
62	600739	辽宁成大	3,831	69,072.93	0.59
63	600153	建发股份	5,321	68,800.53	0.59
64	601127	小康股份	3,443	68,687.85	0.59
65	601669	中国电建	8,347	66,108.24	0.56
66	600089	特变电工	6,357	65,667.81	0.56
67	000009	中国宝安	8,052	65,140.68	0.56
68	002500	山西证券	6,591	63,141.78	0.54
69	002081	金螳螂	5,615	61,652.70	0.53
70	002465	海格通信	5,683	61,035.42	0.52
71	600309	万华化学	2,101	60,172.64	0.51
72	600522	中天科技	4,897	59,008.85	0.50
73	000963	华东医药	1,165	57,900.50	0.49
74	601985	中国核电	7,056	55,107.36	0.47
75	600111	北方稀土	4,672	52,933.76	0.45
76	600332	白云山	1,800	52,272.00	0.45
77	600415	小商品城	7,106	51,447.44	0.44
78	600919	江苏银行	5,533	51,401.57	0.44
79	600060	海信电器	3,372	51,153.24	0.44
80	002065	东华软件	2,238	48,766.02	0.42
81	600795	国电电力	13,506	48,621.60	0.42
82	000540	中天城投	6,851	47,614.45	0.41
83	601216	君正集团	9,259	45,276.51	0.39
84	000568	泸州老窖	861	43,549.38	0.37
85	001979	招商蛇口	2,030	43,360.80	0.37
86	002202	金风科技	2,748	42,511.56	0.36
87	600021	上海电力	3,500	42,315.00	0.36
88	601788	光大证券	2,810	41,953.30	0.36

89	601939	建设银行	6,759	41,567.85	0.35
90	600703	三安光电	2,080	40,976.00	0.35
91	000001	平安银行	4,355	40,893.45	0.35
92	601006	大秦铁路	4,847	40,666.33	0.35
93	600741	华域汽车	1,666	40,383.84	0.34
94	603993	洛阳钼业	7,963	40,292.78	0.34
95	000402	金融街	3,421	40,094.12	0.34
96	000959	首钢股份	5,710	39,912.90	0.34
97	000738	中航动控	1,935	37,867.95	0.32
98	601998	中信银行	5,900	37,111.00	0.32
99	600115	东方航空	4,824	32,803.20	0.28
100	600037	歌华有线	2,213	32,221.28	0.28
101	600016	民生银行	3,859	31,720.98	0.27
102	000826	启迪桑德	893	31,362.16	0.27
103	600018	上港集团	4,749	30,108.66	0.26
104	601966	玲珑轮胎	1,328	29,787.04	0.25
105	601988	中国银行	7,801	28,863.70	0.25
106	002074	国轩高科	904	28,521.20	0.24
107	002024	苏宁云商	2,496	28,080.00	0.24
108	600196	复星医药	900	27,891.00	0.24
109	000008	神州高铁	3,828	27,867.84	0.24
110	600446	金证股份	1,564	27,495.12	0.23
111	601888	中国国旅	870	26,221.80	0.22
112	600535	天士力	630	26,170.20	0.22
113	600010	包钢股份	11,905	26,071.95	0.22
114	600958	东方证券	1,849	25,719.59	0.22
115	601600	中国铝业	5,646	25,519.92	0.22
116	601336	新华保险	400	20,560.00	0.18

117	601009	南京银行	1,599	17,924.79	0.15
118	000671	阳光城	2,800	16,296.00	0.14
119	600704	物产中大	2,211	16,118.19	0.14
120	600893	中航动力	590	16,107.00	0.14
121	600048	保利地产	1,602	15,971.94	0.14
122	600068	葛洲坝	1,376	15,466.24	0.13
123	601018	宁波港	2,477	13,995.05	0.12
124	600820	隧道股份	1,326	13,392.60	0.11
125	000876	新希望	1,554	12,773.88	0.11
126	600028	中国石化	2,029	12,031.97	0.10
127	601933	永辉超市	1,645	11,646.60	0.10
128	601618	中国中冶	2,276	11,402.76	0.10
129	601818	光大银行	2,798	11,331.90	0.10
130	601166	兴业银行	661	11,144.46	0.10
131	000917	电广传媒	905	10,226.50	0.09
132	601333	广深铁路	2,259	10,210.68	0.09
133	000961	中南建设	1,539	10,034.28	0.09
134	601611	中国核建	835	9,994.95	0.09
135	601117	中国化学	1,353	9,457.47	0.08
136	000768	中航飞机	500	9,220.00	0.08
137	000166	申万宏源	1,600	8,960.00	0.08
138	600827	百联股份	507	8,238.75	0.07
139	002142	宁波银行	395	7,623.50	0.07
140	600674	川投能源	728	7,148.96	0.06
141	601555	东吴证券	632	7,097.36	0.06
142	000686	东北证券	629	6,321.45	0.05
143	601601	中国太保	157	5,317.59	0.05
144	600256	广汇能源	1,231	5,096.34	0.04

145	000750	国海证券	862	4,741.00	0.04
146	002252	上海莱士	200	4,048.00	0.03
147	000783	长江证券	400	3,788.00	0.03
148	600030	中信证券	203	3,455.06	0.03
149	002146	荣盛发展	300	2,961.00	0.03
150	601718	际华集团	329	2,891.91	0.02
151	600177	雅戈尔	265	2,681.80	0.02
152	600118	中国卫星	86	2,394.24	0.02
153	002555	三七互娱	90	2,301.30	0.02
154	600606	绿地控股	292	2,283.44	0.02
155	601919	中国远洋	393	2,102.55	0.02
156	000157	中联重科	417	1,872.33	0.02
157	600977	中国电影	100	1,872.00	0.02
158	000776	广发证券	100	1,725.00	0.01
159	002736	国信证券	104	1,378.00	0.01
160	600009	上海机场	29	1,081.99	0.01
161	601155	新城控股	58	1,075.32	0.01
162	002426	胜利精密	132	1,013.76	0.01
163	002304	洋河股份	6	520.86	0.00
164	601877	正泰电器	11	220.99	0.00
165	600804	鹏博士	2	35.50	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600666	奥瑞德	6,227	108,349.80	0.93

2	600089	特变电工	2,679	27,674.07	0.24
---	--------	------	-------	-----------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002424	贵州百灵	1,176,257.18	11.38
2	000568	泸州老窖	1,110,477.00	10.74
3	601866	中海集运	995,829.00	9.63
4	601225	陕西煤业	951,445.00	9.20
5	601601	中国太保	951,307.00	9.20
6	601318	中国平安	940,770.00	9.10
7	600060	海信电器	923,093.00	8.93
8	601818	光大银行	916,994.00	8.87
9	600783	鲁信创投	900,068.05	8.71
10	600170	上海建工	898,057.00	8.69
11	600383	金地集团	881,122.00	8.52
12	601009	南京银行	864,282.00	8.36
13	600309	万华化学	843,553.00	8.16
14	002456	欧菲光	829,298.00	8.02
15	000718	苏宁环球	822,999.00	7.96
16	601899	紫金矿业	815,537.00	7.89
17	000559	万向钱潮	801,629.60	7.76
18	600188	兖州煤业	800,775.00	7.75
19	002241	歌尔股份	795,552.00	7.70
20	002131	利欧股份	794,823.00	7.69
21	600737	中粮屯河	794,274.00	7.68

22	000858	五 粮 液	780,857.00	7.55
23	002202	金风科技	780,334.00	7.55
24	601669	中国电建	774,687.00	7.49
25	600016	民生银行	765,980.00	7.41
26	601127	小康股份	765,890.00	7.41
27	601988	中国银行	756,420.00	7.32
28	002142	宁波银行	733,168.00	7.09
29	600804	鹏博士	721,781.00	6.98
30	600074	保千里	715,555.99	6.92
31	002183	怡 亚 通	710,417.00	6.87
32	600352	浙江龙盛	699,306.92	6.77
33	601006	大秦铁路	695,909.00	6.73
34	600221	海南航空	689,843.00	6.67
35	600839	四川长虹	687,141.00	6.65
36	000623	吉林敖东	676,448.00	6.54
37	601216	君正集团	672,978.00	6.51
38	000725	京东方 A	672,036.00	6.50
39	000060	中金岭南	668,774.00	6.47
40	600585	海螺水泥	668,091.00	6.46
41	600900	长江电力	665,609.00	6.44
42	600718	东软集团	665,389.00	6.44
43	000009	中国宝安	663,595.30	6.42
44	002714	牧原股份	657,372.00	6.36
45	600036	招商银行	656,794.00	6.35
46	002470	金正大	654,199.00	6.33
47	600820	隧道股份	649,381.00	6.28
48	600023	浙能电力	637,838.00	6.17
49	600015	华夏银行	630,627.00	6.10

50	600489	中金黄金	624,324.00	6.04
51	600031	三一重工	617,097.00	5.97
52	002304	洋河股份	614,357.74	5.94
53	000338	潍柴动力	612,774.00	5.93
54	001979	招商蛇口	610,058.00	5.90
55	601998	中信银行	604,234.00	5.85
56	002385	大北农	598,578.00	5.79
57	300002	神州泰岳	595,398.00	5.76
58	000425	徐工机械	591,367.00	5.72
59	600029	南方航空	591,214.00	5.72
60	000963	华东医药	585,687.00	5.67
61	000750	国海证券	581,282.00	5.62
62	601288	农业银行	580,991.00	5.62
63	000069	华侨城 A	580,186.00	5.61
64	002007	华兰生物	576,257.00	5.57
65	600153	建发股份	575,163.00	5.56
66	600873	梅花生物	572,187.00	5.54
67	002074	国轩高科	570,699.00	5.52
68	002065	东华软件	569,581.40	5.51
69	601328	交通银行	568,099.00	5.50
70	600741	华域汽车	564,275.00	5.46
71	000630	铜陵有色	563,085.00	5.45
72	601390	中国中铁	562,779.00	5.44
73	300124	汇川技术	543,728.31	5.26
74	600297	广汇汽车	538,938.00	5.21
75	000001	平安银行	535,918.00	5.18
76	600518	康美药业	532,675.00	5.15
77	002146	荣盛发展	530,243.00	5.13

78	600688	上海石化	524,835.00	5.08
79	000983	西山煤电	523,724.00	5.07
80	600582	天地科技	519,624.00	5.03
81	600089	特变电工	519,564.02	5.03
82	600816	安信信托	514,265.00	4.98
83	002195	二三四五	511,185.00	4.95
84	600028	中国石化	503,750.00	4.87
85	600373	中文传媒	497,479.68	4.81
86	000100	TCL 集团	496,461.00	4.80
87	000686	东北证券	487,031.00	4.71
88	600000	浦发银行	486,600.00	4.71
89	601877	正泰电器	485,576.00	4.70
90	000503	海虹控股	485,559.00	4.70
91	000415	渤海金控	480,525.00	4.65
92	601169	北京银行	480,334.00	4.65
93	600498	烽火通信	473,184.00	4.58
94	600795	国电电力	465,349.00	4.50
95	600648	外高桥	462,366.03	4.47
96	600038	中直股份	460,327.00	4.45
97	600519	贵州茅台	458,929.99	4.44
98	300251	光线传媒	454,564.00	4.40
99	600019	宝钢股份	454,003.04	4.39
100	600252	中恒集团	452,865.00	4.38
101	601800	中国交建	452,855.00	4.38
102	601336	新华保险	450,977.00	4.36
103	002152	广电运通	447,920.24	4.33
104	000402	金融街	445,658.00	4.31
105	000039	中集集团	445,474.00	4.31

106	600887	伊利股份	444,498.00	4.30
107	601600	中国铝业	432,324.00	4.18
108	601166	兴业银行	427,735.00	4.14
109	600867	通化东宝	426,024.00	4.12
110	000540	中天城投	425,279.00	4.11
111	002594	比亚迪	425,171.00	4.11
112	600332	白云山	423,537.00	4.10
113	600606	绿地控股	417,640.00	4.04
114	000826	启迪桑德	415,911.00	4.02
115	300182	捷成股份	413,710.00	4.00
116	600588	用友网络	412,438.00	3.99
117	000778	新兴铸管	411,782.00	3.98
118	000783	长江证券	409,546.17	3.96
119	000876	新希望	408,220.00	3.95
120	600068	葛洲坝	407,108.00	3.94
121	600886	国投电力	405,401.00	3.92
122	600104	上汽集团	405,059.10	3.92
123	000712	锦龙股份	404,005.35	3.91
124	000625	长安汽车	402,130.00	3.89
125	601377	兴业证券	401,188.00	3.88
126	601155	新城控股	401,136.97	3.88
127	601985	中国核电	399,975.00	3.87
128	600549	厦门钨业	392,527.00	3.80
129	002081	金螳螂	387,717.00	3.75
130	002252	上海莱士	386,571.00	3.74
131	000157	中联重科	384,404.00	3.72
132	000776	广发证券	383,464.00	3.71
133	300058	蓝色光标	380,199.00	3.68

134	601258	庞大集团	378,092.00	3.66
135	600009	上海机场	374,487.00	3.62
136	601333	广深铁路	374,468.00	3.62
137	601018	宁波港	374,327.00	3.62
138	600157	永泰能源	364,896.00	3.53
139	002024	苏宁云商	363,814.00	3.52
140	300070	碧水源	358,468.00	3.47
141	300015	爱尔眼科	357,561.17	3.46
142	600674	川投能源	351,437.00	3.40
143	601668	中国建筑	351,206.00	3.40
144	002174	游族网络	350,584.00	3.39
145	000671	阳光城	349,629.00	3.38
146	000627	天茂集团	344,763.00	3.34
147	002008	大族激光	341,145.00	3.30
148	600018	上港集团	326,515.00	3.16
149	600208	新湖中宝	326,228.00	3.16
150	000977	浪潮信息	325,298.00	3.15
151	600875	东方电气	324,407.00	3.14
152	000728	国元证券	316,271.00	3.06
153	600362	江西铜业	315,070.00	3.05
154	603993	洛阳钼业	313,416.00	3.03
155	600066	宇通客车	309,048.00	2.99
156	000800	一汽轿车	306,025.00	2.96
157	601628	中国人寿	296,271.00	2.87
158	601928	凤凰传媒	295,214.00	2.86
159	000002	万科 A	290,642.00	2.81
160	600037	歌华有线	288,456.00	2.79
161	600010	包钢股份	287,193.00	2.78

162	601111	中国国航	284,836.00	2.76
163	300072	三聚环保	284,178.00	2.75
164	300146	汤臣倍健	283,719.00	2.74
165	601888	中国国旅	273,573.00	2.65
166	000008	神州高铁	270,456.00	2.62
167	002466	天齐锂业	268,057.00	2.59
168	000709	河钢股份	258,388.00	2.50
169	000027	深圳能源	254,542.00	2.46
170	600739	辽宁成大	252,097.00	2.44
171	600021	上海电力	251,654.00	2.43
172	601186	中国铁建	249,890.00	2.42
173	002500	山西证券	246,179.00	2.38
174	000423	东阿阿胶	244,280.00	2.36
175	000063	中兴通讯	240,816.00	2.33
176	601857	中国石油	238,340.00	2.31
177	600649	城投控股	232,720.00	2.25
178	601118	海南橡胶	231,918.00	2.24
179	600666	奥瑞德	228,053.00	2.21
180	600893	中航动力	221,178.00	2.14
181	600827	百联股份	214,878.00	2.08
182	002153	石基信息	213,058.00	2.06
183	000895	双汇发展	210,063.00	2.03
184	601088	中国神华	207,925.00	2.01
185	600008	首创股份	206,742.00	2.00

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000568	泸州老窖	1,303,285.96	12.61
2	002424	贵州百灵	1,118,079.83	10.82
3	600309	万华化学	1,026,471.77	9.93
4	601009	南京银行	1,007,281.26	9.74
5	601318	中国平安	974,621.83	9.43
6	601601	中国太保	968,778.15	9.37
7	600783	鲁信创投	968,719.10	9.37
8	002142	宁波银行	968,507.36	9.37
9	601225	陕西煤业	936,194.42	9.06
10	600804	鹏博士	911,800.96	8.82
11	601818	光大银行	905,488.30	8.76
12	600060	海信电器	886,535.72	8.58
13	601866	中海集运	880,529.13	8.52
14	002241	歌尔股份	865,830.50	8.38
15	000718	苏宁环球	857,829.46	8.30
16	600016	民生银行	854,319.34	8.26
17	600015	华夏银行	842,273.06	8.15
18	000559	万向钱潮	836,321.56	8.09
19	000858	五粮液	814,230.69	7.88
20	600170	上海建工	814,140.84	7.88
21	600029	南方航空	807,978.04	7.82
22	600900	长江电力	802,272.27	7.76
23	300002	神州泰岳	775,807.48	7.51
24	002074	国轩高科	731,297.25	7.07
25	002146	荣盛发展	730,956.82	7.07
26	601988	中国银行	729,450.64	7.06

27	002202	金风科技	725,833.81	7.02
28	600074	保千里	724,533.46	7.01
29	002183	怡亚通	723,175.80	7.00
30	601669	中国电建	713,348.90	6.90
31	600873	梅花生物	705,519.24	6.83
32	002456	欧菲光	704,873.19	6.82
33	600383	金地集团	694,943.95	6.72
34	601127	小康股份	677,784.42	6.56
35	600000	浦发银行	672,854.63	6.51
36	600839	四川长虹	672,309.43	6.50
37	600036	招商银行	670,012.44	6.48
38	601877	正泰电器	669,337.68	6.48
39	601169	北京银行	669,299.82	6.47
40	002714	牧原股份	667,527.80	6.46
41	600028	中国石化	662,275.30	6.41
42	601006	大秦铁路	661,803.25	6.40
43	002007	华兰生物	649,130.35	6.28
44	601216	君正集团	644,435.24	6.23
45	600188	兖州煤业	641,255.36	6.20
46	600489	中金黄金	630,821.67	6.10
47	600820	隧道股份	624,060.88	6.04
48	600352	浙江龙盛	616,751.35	5.97
49	002304	洋河股份	614,667.14	5.95
50	601166	兴业银行	612,741.22	5.93
51	600104	上汽集团	612,624.83	5.93
52	600221	海南航空	606,495.46	5.87
53	601899	紫金矿业	602,853.74	5.83
54	600867	通化东宝	600,276.62	5.81

55	000069	华侨城 A	597,728.38	5.78
56	000060	中金岭南	592,140.48	5.73
57	600373	中文传媒	590,227.93	5.71
58	600648	外高桥	585,325.55	5.66
59	600737	中粮屯河	577,049.47	5.58
60	001979	招商蛇口	576,759.93	5.58
61	601390	中国中铁	572,495.99	5.54
62	601328	交通银行	571,310.68	5.53
63	000750	国海证券	570,991.98	5.52
64	000009	中国宝安	570,212.49	5.52
65	601998	中信银行	568,366.67	5.50
66	002131	利欧股份	565,148.46	5.47
67	002594	比亚迪	557,645.07	5.39
68	000425	徐工机械	554,508.57	5.36
69	300124	汇川技术	553,444.38	5.35
70	600023	浙能电力	548,848.58	5.31
71	600816	安信信托	548,281.86	5.30
72	300058	蓝色光标	548,122.82	5.30
73	000623	吉林敖东	547,856.34	5.30
74	601668	中国建筑	545,907.49	5.28
75	002081	金螳螂	543,166.26	5.25
76	000963	华东医药	535,860.00	5.18
77	600518	康美药业	534,544.10	5.17
78	600741	华域汽车	533,371.42	5.16
79	600585	海螺水泥	532,859.23	5.15
80	002065	东华软件	527,944.39	5.11
81	600674	川投能源	524,835.36	5.08
82	600153	建发股份	516,905.62	5.00

83	300251	光线传媒	514,423.69	4.98
84	600066	宇通客车	514,265.79	4.98
85	600718	东软集团	513,405.72	4.97
86	000725	京东方 A	505,051.66	4.89
87	600582	天地科技	496,374.56	4.80
88	000100	TCL 集团	494,836.84	4.79
89	000001	平安银行	493,735.98	4.78
90	300072	三聚环保	493,674.68	4.78
91	000540	中天城投	491,936.98	4.76
92	002466	天齐锂业	485,923.92	4.70
93	600886	国投电力	484,342.26	4.69
94	601288	农业银行	481,278.81	4.66
95	000686	东北证券	477,868.99	4.62
96	000503	海虹控股	477,636.61	4.62
97	600208	新湖中宝	474,001.88	4.59
98	002470	金正大	468,307.29	4.53
99	002195	二三四五	464,760.63	4.50
100	000338	潍柴动力	463,471.74	4.48
101	000039	中集集团	462,800.10	4.48
102	600038	中直股份	454,413.43	4.40
103	002385	大北农	452,742.58	4.38
104	601800	中国交建	448,098.17	4.33
105	601111	中国国航	445,383.50	4.31
106	600887	伊利股份	442,947.80	4.29
107	601336	新华保险	441,899.34	4.28
108	600031	三一重工	437,394.39	4.23
109	600252	中恒集团	432,706.05	4.19
110	000778	新兴铸管	432,206.00	4.18

111	000630	铜陵有色	430,507.65	4.16
112	601258	庞大集团	423,496.76	4.10
113	000709	河钢股份	423,107.19	4.09
114	600795	国电电力	422,115.40	4.08
115	600297	广汇汽车	420,404.16	4.07
116	300182	捷成股份	417,819.04	4.04
117	600089	特变电工	416,787.17	4.03
118	000402	金融街	416,562.57	4.03
119	600606	绿地控股	414,433.49	4.01
120	000783	长江证券	410,438.72	3.97
121	601155	新城控股	409,398.93	3.96
122	600068	葛洲坝	404,615.30	3.91
123	601600	中国铝业	402,800.62	3.90
124	000712	锦龙股份	400,095.56	3.87
125	000876	新希望	393,169.52	3.80
126	600498	烽火通信	389,291.13	3.77
127	300017	网宿科技	388,553.50	3.76
128	000826	启迪桑德	383,393.59	3.71
129	000157	中联重科	381,552.45	3.69
130	000776	广发证券	381,497.87	3.69
131	600009	上海机场	381,361.09	3.69
132	002252	上海莱士	380,518.08	3.68
133	600332	白云山	377,048.34	3.65
134	300070	碧水源	375,220.71	3.63
135	601021	春秋航空	373,164.83	3.61
136	300015	爱尔眼科	370,941.76	3.59
137	000415	渤海金控	369,800.94	3.58
138	000895	双汇发展	367,633.80	3.56

139	600157	永泰能源	367,453.87	3.55
140	601018	宁波港	362,301.92	3.50
141	601333	广深铁路	357,536.09	3.46
142	600019	宝钢股份	355,444.88	3.44
143	002008	大族激光	354,027.56	3.42
144	601985	中国核电	348,456.16	3.37
145	002152	广电运通	343,004.06	3.32
146	600688	上海石化	342,468.00	3.31
147	000983	西山煤电	341,166.67	3.30
148	600340	华夏幸福	340,970.18	3.30
149	002024	苏宁云商	334,825.59	3.24
150	000627	天茂集团	334,195.33	3.23
151	000671	阳光城	332,454.07	3.22
152	600519	贵州茅台	331,380.86	3.21
153	603885	吉祥航空	327,201.19	3.17
154	000977	浪潮信息	325,747.89	3.15
155	600875	东方电气	322,450.31	3.12
156	600549	厦门钨业	321,016.97	3.11
157	601377	兴业证券	320,753.34	3.10
158	000625	长安汽车	299,474.48	2.90
159	000800	一汽轿车	296,892.97	2.87
160	600018	上港集团	296,538.68	2.87
161	002174	游族网络	293,374.32	2.84
162	601928	凤凰传媒	289,035.13	2.80
163	000061	农产品	281,418.06	2.72
164	603993	洛阳钼业	280,590.08	2.71
165	000002	万科 A	280,171.67	2.71
166	300146	汤臣倍健	279,256.28	2.70

167	600588	用友网络	268,338.68	2.60
168	600010	包钢股份	265,484.46	2.57
169	300144	宋城演艺	264,037.28	2.55
170	601186	中国铁建	260,541.42	2.52
171	600037	歌华有线	257,685.05	2.49
172	600008	首创股份	257,508.32	2.49
173	000027	深圳能源	257,333.19	2.49
174	601888	中国国旅	253,858.35	2.46
175	000423	东阿阿胶	253,344.62	2.45
176	000063	中兴通讯	242,707.25	2.35
177	000008	神州高铁	236,335.95	2.29
178	601628	中国人寿	228,652.97	2.21
179	601118	海南橡胶	225,527.30	2.18
180	600196	复星医药	224,386.04	2.17
181	600362	江西铜业	223,123.10	2.16
182	002299	圣农发展	217,804.60	2.11
183	600827	百联股份	215,779.45	2.09
184	601088	中国神华	215,631.91	2.09
185	002153	石基信息	214,924.79	2.08
186	601872	招商轮船	211,606.39	2.05
187	600021	上海电力	208,631.28	2.02

7.4.3 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	102,975,765.38
卖出股票收入（成交）总额	102,730,535.45

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。

7.5 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投资组合。

7.6 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投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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投资。

7.9 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投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	9,839.25
2	应收证券清算款	251,081.61
3	应收股利	-
4	应收利息	248.75
5	应收申购款	5,994.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	267,163.61

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五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	600666	奥瑞德	108,349.80	0.93	临时停牌

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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
中 金 沪 深 300A	93	113,107.25	10,000,000.00	95.07%	518,974.56	4.93%
中 金 沪 深 300C	34	4,845.27	0.00	0.00%	164,739.29	100.00%
合计	127	84,123.73	10,000,000.00	93.60%	683,713.85	6.40%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中金沪深 300A	109,303.02	1.04%
	中金沪深 300C	10,382.75	6.30%
	合计	119,685.77	1.12%

8.3 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	份额级别	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	中金沪深 300A	10~50

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金沪深 300C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中金沪深 300A	0
	中金沪深 300C	0
	合计	0

8.4 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	10,000,000.00	93.60	10,000,000.00	93.60	自基金合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	114,189.56	1.07	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,114,189.56	94.67	10,000,000.00	93.60	自基金合同生效之日起不少于三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金沪深 300A	中金沪深 300C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）基金份额总额	10,001,300.00	-
本报告期期初基金份额总额	10,086,686.89	93.97
本报告期基金总申购份额	726,723.90	306,828.82
减：本报告期基金总赎回份额	294,436.23	142,183.50
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,518,974.56	164,739.29

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本基金本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 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到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
		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

中金公司	2	-	-	-	-
华创证券	2	81,179,709.69	39.47%	59,366.86	39.47%
兴业证券	2	32,910,575.26	16.00%	24,067.47	16.00%
长江证券	2	91,596,807.45	44.53%	66,985.74	44.53%

注：1、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，具有开发量化投资组合模型的能力；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。

2、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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 1 月 20 日
2	中金基金管理有限公司督察长离任公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 2 月 13 日
3	关于新增平安证券股份有限	《中国证券报》、《上	2017 年 2 月 28 日

	公司为销售机构的公告	海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	
4	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书及其摘要（2017 年第 1 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 8 日
5	关于放下部分基金新增上海好买基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 15 日
6	关于新增上海万得投资顾问有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 15 日
7	关于新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 18 日
8	关于新增上海陆享投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 22 日
9	中金基金管理有限公司督察长任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 25 日
10	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 28 日
11	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2016 年度报告及其摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 31 日
12	中金沪深 300 指数增强发起式证券投资基金 2017 年第 1	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 4 月 21 日

	季度报告	报》及/或公司网站	
13	关于新增长城证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 5 月 19 日
14	关于新增中国国际金融股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 5 月 23 日
15	关于新增中国银河证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 5 月 26 日
16	关于中金基金管理有限公司调整旗下基金最低持有份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 6 月 29 日
17	关于中金基金管理有限公司旗下基金调整直销中心最低申购金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	93.60%

产品特有风险

(1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

(2) 目标指数波动的风险

目标指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

(3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

- a. 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；
- b. 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；
- c. 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差；
- d. 由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差；
- e. 在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入

卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度；

f. 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（4）目标指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

（5）主动增强投资的风险

根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。这种基于对基本面的深度研究作出优化调整投资组合的决策，最终结果仍然存在一定的不确定性，其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金募集的注册文件
- 2、《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人和/或基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：010-63211122 400-868-1166

传真：010-66159121

中金基金管理有限公司

2017 年 8 月 29 日