

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资
基金
2017 年年度报告

2017 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 30 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 2018 年 3 月 29 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。

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	28
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	57
8.3 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.....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	93
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.....	94
8.7 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.....	94

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	94
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	94
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	94
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	95
8.12	投资组合报告附注	95
§9	基金份额持有人信息	97
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	97
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	97
9.3	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	98
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	98
§10	开放式基金份额变动	99
§11	重大事件揭示	100
11.1	基金份额持有人大会决议	100
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	100
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	100
11.4	基金投资策略的改变	100
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	100
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	101
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	101
11.8	其他重大事件	102
§12	影响投资者决策的其他重要信息	106
12.1	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	106
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	107
§13	备查文件目录	108
13.1	备查文件目录	108
13.2	存放地点	108
13.3	查阅方式	108

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中金中证 500	
基金主代码	003016	
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	14,068,786.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中金中证 500A	中金中证 500C
下属分级基金的交易代码:	003016	003578
报告期末下属分级基金的份额总额	13,218,031.80 份	850,755.00 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，在力求对中证 500 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	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，通过复制目标股票指数作为基本投资组合以及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。其他策略还包括债券投资策略和股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证 500 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	李虹	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 18 号丰融国际中心北楼 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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

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	中国北京东长安街 1 号东方广场东

	通合伙)	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、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	2017 年		2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C	中金中证 500A	中金中证 500C
本期已实现收益	608,224.85	53,744.13	443,915.38	-2.41
本期利润	752,397.25	28,629.90	242,108.70	-5.10
加权平均基金份额本期利润	0.0684	0.0707	0.0239	-0.0551
本期加权平均净值利润率	6.50%	6.48%	2.30%	-5.29%
本期基金份额净值增长率	6.79%	7.64%	2.49%	-5.10%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末	
期末可供分配利润	1,249,313.55	87,529.63	255,314.03	2.28
期末可供分配基金份额利润	0.0945	0.1029	0.0249	0.0246
期末基金资产净值	14,467,345.35	938,284.63	10,525,826.87	94.90
期末基金份额净值	1.0945	1.1029	1.0249	1.0246
3.1.3 累计期末指标	2017 年末		2016 年末	
基金份额累计净值增长率	9.45%	2.15%	2.49%	-5.10%

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 2016 年 7 月 22 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。

3.2 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

中金中证 500A

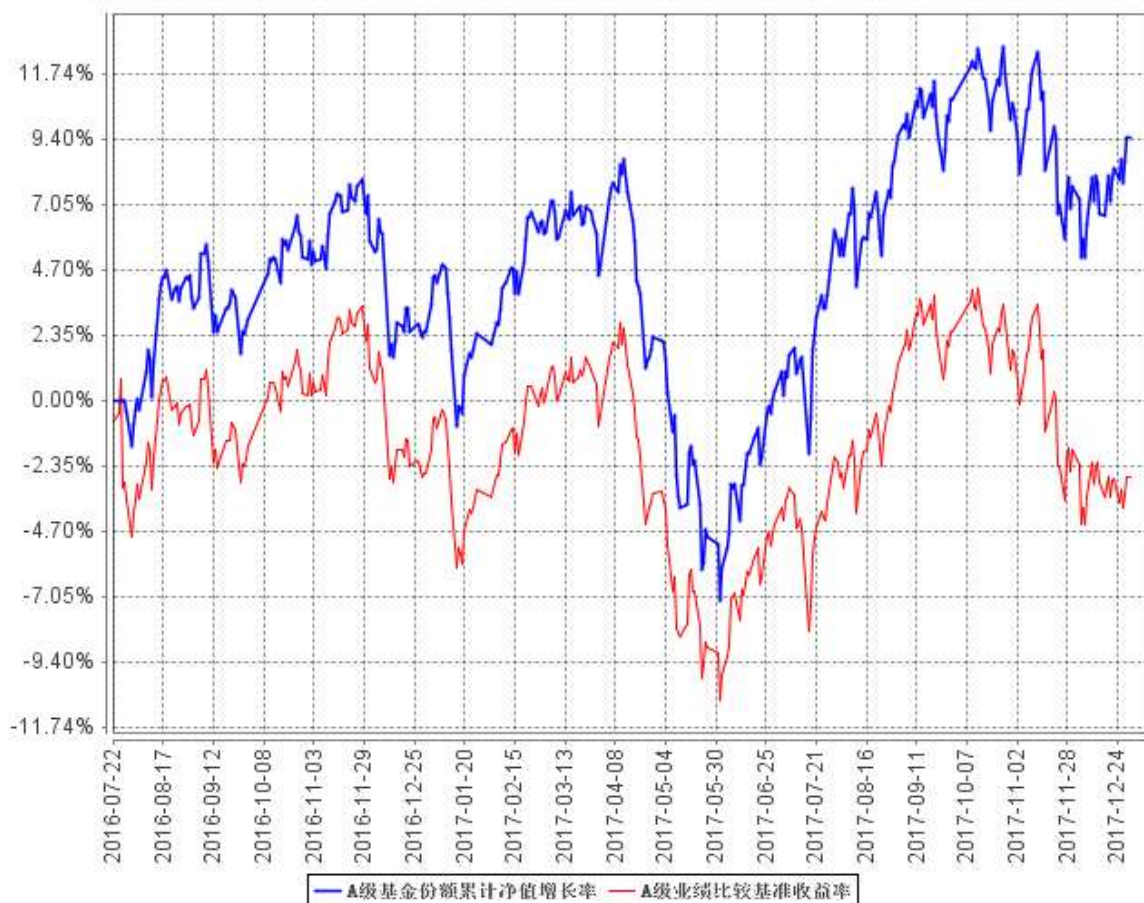
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.24%	0.94%	-5.06%	0.93%	3.82%	0.01%
过去六个月	9.13%	0.93%	1.78%	0.91%	7.35%	0.02%
过去一年	6.79%	0.91%	-0.13%	0.88%	6.92%	0.03%
自基金合同生效起至今	9.45%	0.88%	-2.73%	0.89%	12.18%	-0.01%

中金中证 500C

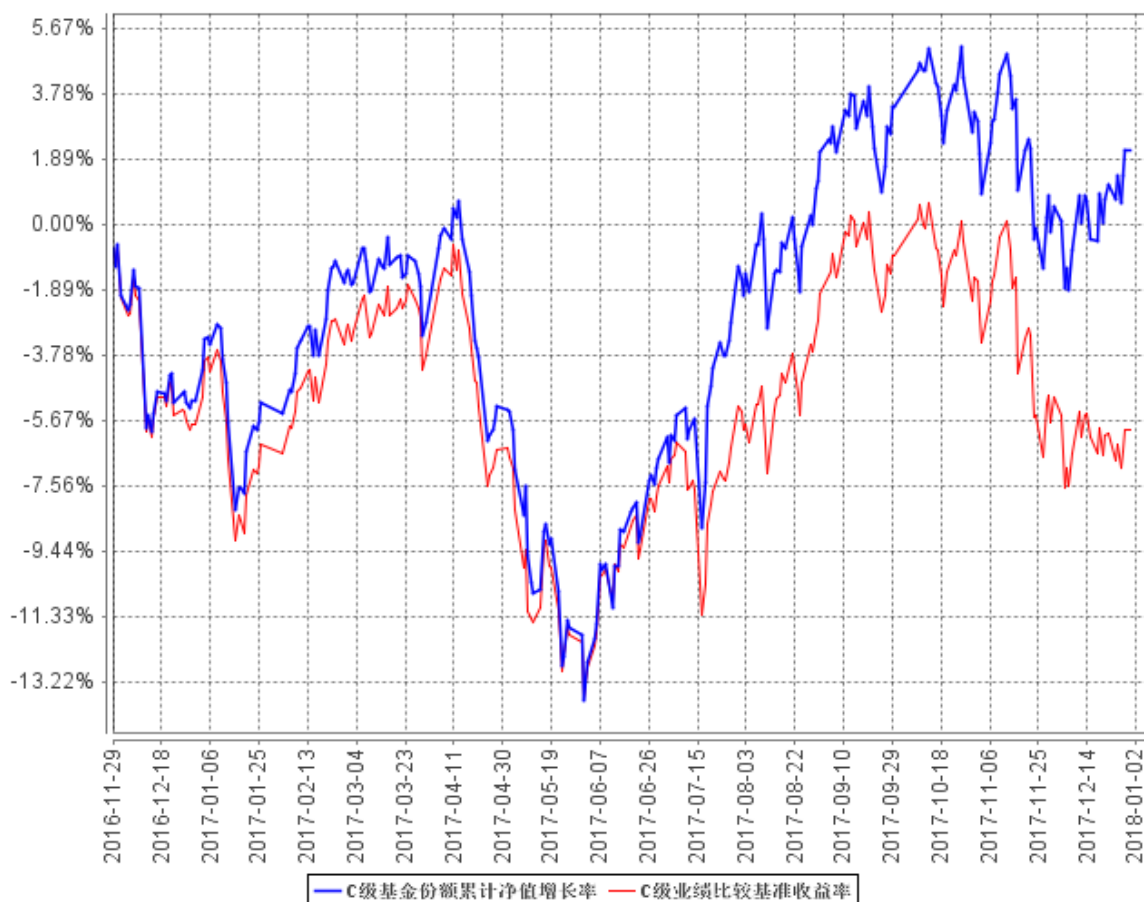
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.18%	0.94%	-5.06%	0.93%	3.88%	0.01%
过去六个月	9.59%	0.94%	1.78%	0.91%	7.81%	0.03%
过去一年	7.64%	0.91%	-0.13%	0.88%	7.77%	0.03%
自基金合同生效起至今	2.15%	0.92%	-5.92%	0.89%	8.07%	0.03%

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



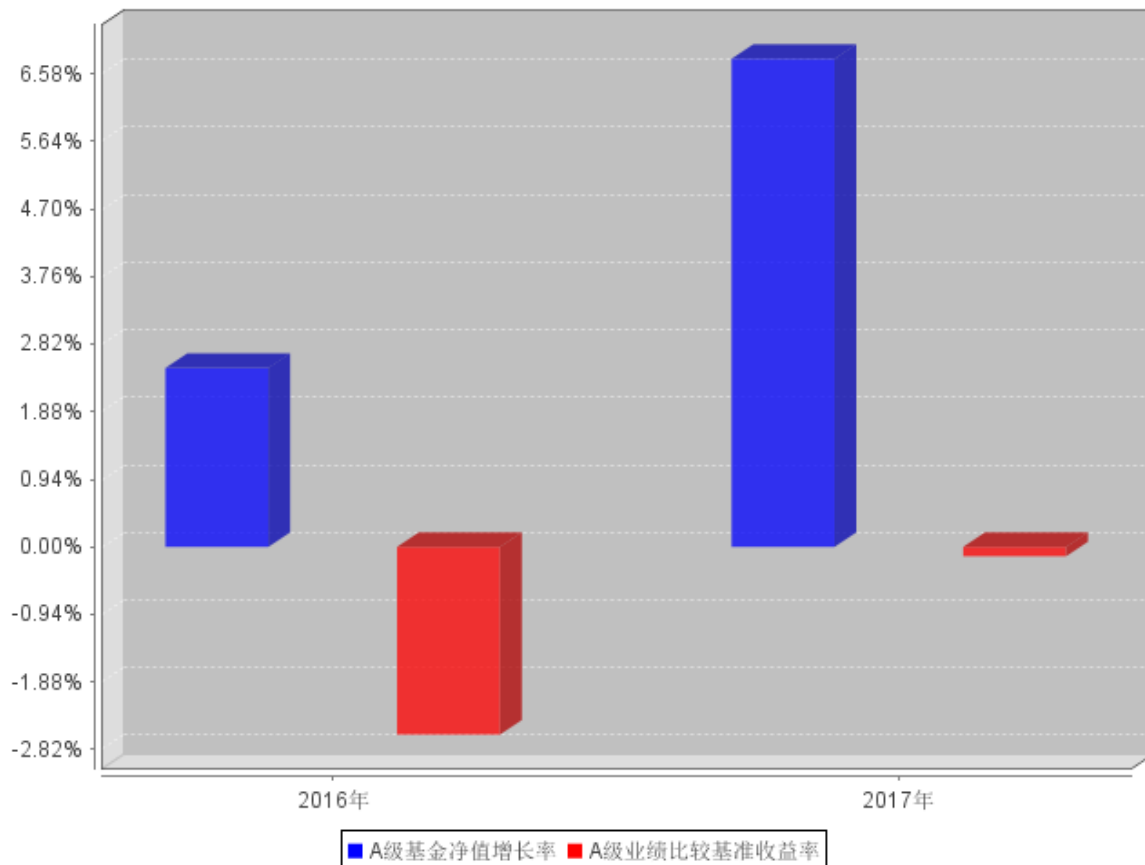
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



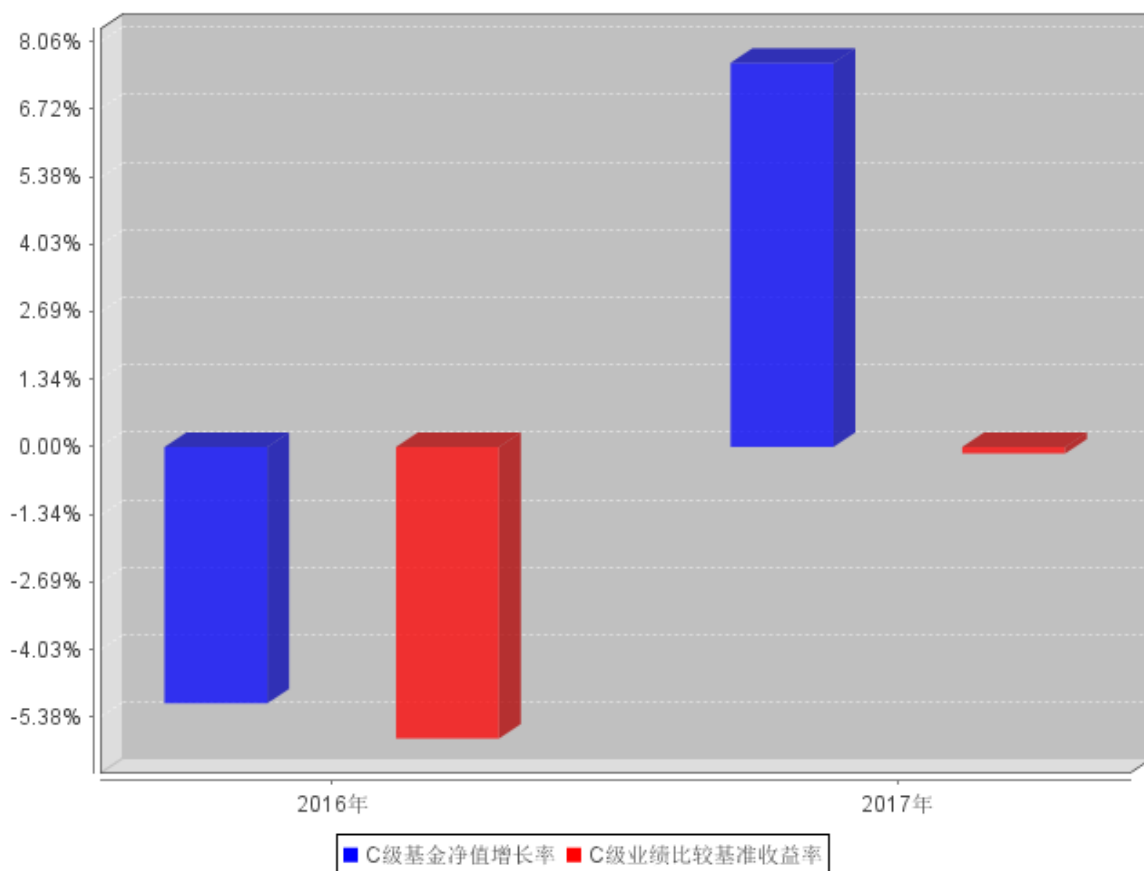
注：本基金的基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日。按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

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

A级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对比图



C级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对比图



注：本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 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”、“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，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 2.5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。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 12 月 31 日，公司共管理 14 支开放式基金，证券投资基金管理规模 78.30 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		
李云琪	本基金的基金经理	2016 年 7 月 22 日	2017 年 3 月 28 日	10	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。
魏宇	本基金的	2017 年 3 月	-	7	香港大学统计专业博

	基金经理	28 日		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 股量化策略开发工作。2014 年 11 月，加入中金基金管理有限公司，现任量化公募投资部副总经理。
--	------	------	--	---

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券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合规守信情况的说明

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》、《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》、基金合同和其他法律法规，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

2017 年，本基金采用量化策略，运作正常。我们使用的投资模型较为有效，基金表现跑赢了业绩基准。我们会持续研发模型，争取为投资者带来更多的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中金中证 500A 类份额净值增长率为 6.79%，同期业绩比较基准收益率为-0.13%，中金中证 500C 类份额净值增长率为 7.64%，同期业绩比较基准收益率为-0.13%。

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 2018 年，总体来看，中国的经济增长无忧。全球经济复苏的趋势将会得到延续，贸易将会有较快增长；制造业投资有望回升；国内消费增速依然平稳；房地产在发展租赁市场的政策导向下，其投资也有超预期的可能。我们还需要重点关注经济增长的结构优化，实体经济去杠杆，供给侧结构性改革，环保目标的推进，以及制造产业结构升级。在未来的投资中，我们将重视宏观经济对市场的影响，尤其是对市场风格的影响，并积极调整投资策略，适应市场，力争取得更好的表现。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作，强化制度完善及对

制度执行情况的监督检查，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，有效保证了基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1) 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，及定期进行有重点的检查。2) 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，对关联交易进行日常维护，定期关注基金持仓流动性风险，并对公平交易执行情况进行检查等。3) 营销与销售方面，本基金管理人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，同时加强对基金销售部门的合规培训。4) 基金运作保障方面，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力度，保证基金运营安全、准确。5) 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。6) 信息披露方面，本基金管理人严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》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。此外，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。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高监察稽核工作的有效性，切实保障基金安全、合规运作。

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《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中证 500 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，中金中证 500 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中证 500 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。

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

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2017 年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 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 1801568 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	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	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、在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“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的规定编制, 公允反映了中金中证 500 指数增强基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果及基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则 (以下简称“审计准则”) 的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于中金中证 500 指数增强基金及其管理人中金基金管理有限公司, 并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括中金中证 500 指数增强基金 2017 年年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。

	<p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、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的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时，中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责评估中金中证 500 指数增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非中金中证 500 指数增强基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司治理层负责监督中金中证 500 指数增强基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗</p>

	<p>漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(3)评价中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中金中证 500 指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中金中证 500 指数增强基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
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)	
注册会计师的姓名	程海良	管祎铭
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	2018 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,202,994.99	863,207.13
结算备付金		148,488.75	170,084.42
存出保证金		7,207.02	4,471.96
交易性金融资产	7.4.7.2	14,361,549.44	9,655,984.06
其中：股票投资		14,351,009.60	9,655,984.06
基金投资		-	-
债券投资		10,539.84	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		25,649.66	19,203.50
应收利息	7.4.7.5	332.57	255.94
应收股利		-	-
应收申购款		31,689.51	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		15,777,911.94	10,713,207.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		47,092.16	11,151.16
应付赎回款		18,799.82	-
应付管理人报酬		6,414.45	4,516.51
应付托管费		1,924.33	1,354.93
应付销售服务费		1,745.59	-
应付交易费用	7.4.7.7	225,720.90	59,832.55
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	70,584.71	110,430.09
负债合计		372,281.96	187,285.24
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	14,068,786.80	10,270,605.46
未分配利润	7.4.7.10	1,336,843.18	255,316.31
所有者权益合计		15,405,629.98	10,525,921.77
负债和所有者权益总计		15,777,911.94	10,713,207.01

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，中金中证 500A 基金份额净值 1.0945 元，中金中证 500C 基金份额净值 1.1029 元；中金中证 500 基金份额总额 14,068,786.80 份（其中 A 类 13,218,031.80 份，C 类 850,755.00 份）。

7.2 利润表

会计主体：中金中证 500 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 7 月 22 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		1,475,489.55	573,440.91
1.利息收入		9,007.15	4,922.10
其中：存款利息收入	7.4.7.11	9,004.14	4,400.85
债券利息收入		3.01	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	521.25
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,337,310.71	769,928.18
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,269,581.06	767,699.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	679.45	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	67,050.20	2,228.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	119,058.17	-201,809.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	10,113.52	400.00
减：二、费用		694,462.40	331,337.31
1. 管理人报酬	7.5.1.2.1	59,870.62	41,134.92
2. 托管费	7.5.1.2.2	17,961.16	6,983.33
3. 销售服务费	7.5.1.2.3	1,745.59	-

4. 交易费用	7.4.7.18	542,167.17	171,953.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	72,717.86	111,265.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		781,027.15	242,103.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		781,027.15	242,103.60

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金中证 500 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	10,270,605.46	255,316.31	10,525,921.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	781,027.15	781,027.15
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）	3,798,181.34	300,499.72	4,098,681.06
其中：1. 基金申购款	6,863,132.98	544,868.10	7,408,001.08
2. 基金赎回款	-3,064,951.64	-244,368.38	-3,309,320.02

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）	14,068,786.80	1,336,843.18	15,405,629.98
项目	上年度可比期间		
	2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 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）	10,001,000.00	-	10,001,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	242,103.60	242,103.60
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）	269,605.46	13,212.71	282,818.17
其中：1. 基金申购款	269,605.46	13,212.71	282,818.17
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	10,270,605.46	255,316.31	10,525,921.77

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

张纳

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

中金中证 500 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] 1517 号《关于准予中金中证 500 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《中金中证 500 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，《中金中证 500 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 10,001,000.00 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。

本基金根据认购 / 申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金销售费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《中金中证 500 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，在力求对中证 500 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）。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注中所列示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的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况、2017 年度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

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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：

(1) 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；

(2) 应收款项以实际利率法按摊余成本计量；

(3) 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。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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。

7.4.4.5 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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生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，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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 / (未弥补亏损) ”。

7.4.4.9 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，在资金实际占用期间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 /（损失）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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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，在资金实际占用期间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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》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，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后两类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类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；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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。

7.4.4.13 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 [2017] 13 号《中国证券监督管理委员会关于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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发 [2017] 6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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》，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。

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

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税 [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 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》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：

(1) 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。

(2) 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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，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。对基金在 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。

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。

(3) 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。

(4) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司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。

(5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 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，暂不征收企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
活期存款	1,202,994.99	863,207.13
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,202,994.99	863,207.13

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2017 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	14,434,500.64	14,351,009.60	-83,491.04	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	9,800.00	10,539.84	739.84
	银行间市场	-	-	-
	合计	9,800.00	10,539.84	739.84
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	14,444,300.64	14,361,549.44	-82,751.20	
项目	上年度末			
	2016 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	9,857,793.43	9,655,984.06	-201,809.37	
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		9,857,793.43	9,655,984.06	-201,809.37

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	253.03	169.48
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	73.48	84.26
应收债券利息	2.43	-
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	3.63	2.20
合计	332.57	255.94

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	225,720.90	59,832.55
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	225,720.90	59,832.55

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	70,000.00	110,000.00
指数使用费	584.71	430.09
合计	70,584.71	110,430.09

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 500A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,270,512.84	10,270,512.84
本期申购	4,069,083.49	4,069,083.49
本期赎回（以“-”号填列）	-1,121,564.53	-1,121,564.53
- 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	13,218,031.80	13,218,031.80

金额单位：人民币元

中金中证 500C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	92.62	92.62
本期申购	2,794,049.49	2,794,049.49
本期赎回（以“-”号填列）	-1,943,387.11	-1,943,387.11
- 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	850,755.00	850,755.00

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

（2）本基金于 2016 年 7 月 18 日向社会公开募集，截至 2016 年 7 月 22 日（基金合同生效日）止，募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 10,001,000.00 元，折合为 10,001,000.00 份基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金中证 500A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	457,148.84	-201,834.81	255,314.03
本期利润	608,224.85	144,172.40	752,397.25
本期基金份额交易产生的变动数	249,973.71	-8,371.44	241,602.27
其中：基金申购款	336,535.86	-15,645.94	320,889.92

基金赎回款	-86,562.15	7,274.50	-79,287.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,315,347.40	-66,033.85	1,249,313.55

单位：人民币元

中金中证 500C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4.11	-1.83	2.28
本期利润	53,744.13	-25,114.23	28,629.90
本期基金份额交易产生的变动数	38,018.29	20,879.16	58,897.45
其中：基金申购款	221,800.73	2,177.45	223,978.18
基金赎回款	-183,782.44	18,701.71	-165,080.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	91,766.53	-4,236.90	87,529.63

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	6,114.25	3,579.91
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	2,800.35	795.84
其他	89.54	25.10
合计	9,004.14	4,400.85

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	204,338,893.02	62,308,909.46
减: 卖出股票成本总额	203,069,311.96	61,541,210.16
买卖股票差价收入	1,269,581.06	767,699.30

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位: 人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年7月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付) 差价收入	679.45	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	679.45	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年7月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付) 成交总额	4,080.03	-
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付) 成本总额	3,400.00	-
减: 应收利息总额	0.58	-

买卖债券差价收入	679.45	-
----------	--------	---

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无其他衍生工具投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年7月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	67,050.20	2,228.88
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	67,050.20	2,228.88

7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2016年7月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	119,058.17	-201,809.37
——股票投资	118,318.33	-201,809.37
——债券投资	739.84	-

——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	119,058.17	-201,809.37

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年7月22日(基金合同生 效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	9,764.95	-
基金转换费收入-003016	35.47	-
基金转换费收入-003578	313.10	-
其他	-	400.00
合计	10,113.52	400.00

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年7月22日(基金合同生 效日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	542,167.17	171,953.17
银行间市场交易费用	-	-
合计	542,167.17	171,953.17

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017	上年度可比期间 2016年7月22日(基金合同

	年 12 月 31 日	生效日)至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	50,000.00
信息披露费	30,000.00	60,000.00
指数使用费	1,915.86	744.89
汇划手续费	802.00	121.00
其他	-	400.00
合计	72,717.86	111,265.89

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 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
中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中投证券有限责任公司	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构
中金资本运营有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金浦成投资有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金期货有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中国国际金融（香港）有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年7月22日(基金合同生效日)至 2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
中金公司	-	-	32,132,473.27	24.03%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年7月22日(基金合同生效日)至 2016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	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
中金公司	-	-	9,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年7月22日(基金合同生效日)至2016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	23,498.93	24.03%	-	0.00%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险金后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场服务信息。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年7月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	59,870.62	41,134.92
其中：支付销售机构的客户维护费	1,904.69	0.00

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%。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,961.16	6,983.33

注：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。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	180.11	180.11
合计	-	180.11	180.11
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	-	-
合计	-	-	-

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；
2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40%的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末。其计算公式为：C 类基金份额每日应计提的销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 12 月 31 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
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	-	-
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	75.65%	-

项目	上年度可比期间 2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
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	-	-
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	97.37%	-

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。

7.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 7 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	工商银行	1,202,994.99	6,114.25	863,207.13

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 12 月 31 日的相关余额为人民币 155,695.77 元(2016 年 12 月 31 日：人民币 174,556.38 元)，本期间产生的利息收入为人民币 2,889.89 元（自 2016 年 7 月 22 日至 2016 年 12 月 31 日止期间：人民币 820.94 元）。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未实施利润分配。

7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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 12 月 31 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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
600525	长园集团	2017 年 12 月 25 日	重大事项停牌	15.79	2018 年 1 月 10 日	17.30	17,929	305,574.07	283,098.91	-
600664	哈药股份	2017 年 9 月 28 日	重大事项停牌	5.81	2018 年 2 月 27 日	6.00	29,446	173,191.98	171,081.26	-
002366	台海核电	2017 年 12 月 6 日	重大事项停牌	26.45	-	-	3,200	91,116.00	84,640.00	-
000547	航天发展	2017 年 10 月 30 日	重大事项停牌	10.83	2018 年 3 月 29 日	11.80	3,900	42,042.00	42,237.00	-
601216	君正集团	2017 年 12 月 15 日	重大事项停牌	4.71	-	-	2,431	12,132.24	11,450.01	-
600309	万华化学	2017 年 12 月	重大事项	37.94	-	-	200	7,660.00	7,588.00	-

		月 6 日	停牌							
600686	金龙汽车	2017 年 12 月 29 日	重大事项停牌	13.03	2018 年 1 月 10 日	13.03	400	5,064.00	5,212.00	-
000156	华数传媒	2017 年 12 月 26 日	重大事项停牌	11.40	-	-	375	5,286.80	4,275.00	-
000031	中粮地产	2017 年 7 月 24 日	重大事项停牌	8.00	-	-	300	2,199.00	2,400.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末及上年度末均无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末及上年度末均无交易所市场债券正回购余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资（上年度末：同）。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	10,539.84	-
未评级	-	-
合计	10,539.84	-

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，针对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性风险预警及危机的处理、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司风险控制指标管

理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性风险指标进行监控。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，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%，在行业 and 个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	1,202,994.99	-	-	-	1,202,994.99
结算备付金	148,488.75	-	-	-	148,488.75
存出保证金	7,207.02	-	-	-	7,207.02

交易性金融资产-股票投资	-	-	-	14,351,009.60	14,351,009.60
交易性金融资产-债券投资	-	-	10,539.84	-	10,539.84
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	25,649.66	25,649.66
应收利息	-	-	-	332.57	332.57
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	31,689.51	31,689.51
资产总计	1,358,690.76	-	10,539.84	14,408,681.34	15,777,911.94
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	47,092.16	47,092.16
应付赎回款	-	-	-	18,799.82	18,799.82
应付管理人报酬	-	-	-	6,414.45	6,414.45
应付托管费	-	-	-	1,924.33	1,924.33
应付交易费用	-	-	-	225,720.90	225,720.90
应付销售服务费	-	-	-	1,745.59	1,745.59
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	70,584.71	70,584.71
负债总计	-	-	-	372,281.96	372,281.96
利率敏感度缺口	1,358,690.76	-	10,539.84	14,036,399.38	15,405,629.98
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	863,207.13	-	-	-	863,207.13
结算备付金	170,084.42	-	-	-	170,084.42
存出保证金	4,471.96	-	-	-	4,471.96
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	9,655,984.06	9,655,984.06
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	-	-	-	19,203.50	19,203.50
应收利息	-	-	-	255.94	255.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	1,037,763.51	-	-	9,675,443.50	10,713,207.01
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	11,151.16	11,151.16

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	4,516.51	4,516.51
应付托管费	-	-	-	1,354.93	1,354.93
应付交易费用	-	-	-	59,832.55	59,832.55
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	110,430.09	110,430.09
负债总计	-	-	-	187,285.24	187,285.24
利率敏感度缺口	1,037,763.51	-	-	9,488,158.26	10,525,921.77

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0684%(上年度末 0%)，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）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 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	14,351,009.60	93.15	9,655,984.06	91.74

资				
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	10,539.84	0.07	-	-
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	14,361,549.44	93.22	9,655,984.06	91.74

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年12月 31日）	上年度末（2016年12 月31日）
	业绩比较基准上升 5%	776,968.89	-
	业绩比较基准下降 5%	-776,968.89	-

注：1、本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95% + 银行活期存款利率（税后）*5%。

2、于上年度末，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(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。

单位：人民币元

	2017 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	13,739,027.42	611,982.18	-	14,351,009.60
债券投资	-	10,539.84	-	10,539.84
合计	13,739,027.42	622,522.02	-	14,361,549.44

单位：人民币元

	2016 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	9,061,742.20	594,241.86	-	9,655,984.06
合计	9,061,742.20	594,241.86	-	9,655,984.06

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次，账面价值为人民币 611,982.18 元（2016 年 12 月 31 日：594,241.86 元）。于 2017 年 12 月 31 日及 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的资产三个层次之间没有发生其他重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b) 第二层次及第三层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2016 年 12 月 31 日：无）。

(2) 其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具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	14,351,009.60	90.96
	其中：股票	14,351,009.60	90.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,539.84	0.07
	其中：债券	10,539.84	0.07
	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	1,351,483.74	8.57
8	其他各项资产	64,878.76	0.41
9	合计	15,777,911.94	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	72,528.64	0.47
C	制造业	8,638,696.12	56.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供	222,700.59	1.45

	应业		
E	建筑业	319,146.12	2.07
F	批发和零售业	1,122,008.37	7.28
G	交通运输、仓储和邮政业	462,120.15	3.00
H	住宿和餐饮业	25,832.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	977,263.12	6.34
J	金融业	431,103.62	2.80
K	房地产业	535,849.94	3.48
L	租赁和商务服务业	48,205.42	0.31
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	230,550.39	1.50
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	225,201.60	1.46
S	综合	-	-
	合计	13,311,206.08	86.40

8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	9,990.00	0.06
B	采矿业	4,243.20	0.03
C	制造业	642,705.71	4.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,960.02	0.54
E	建筑业	43,330.08	0.28

F	批发和零售业	43,162.15	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	16,981.39	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,227.60	0.27
J	金融业	46,837.27	0.30
K	房地产业	55,835.17	0.36
L	租赁和商务服务业	17,340.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,392.98	0.13
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	13,797.95	0.09
S	综合	-	-
	合计	1,039,803.52	6.75

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末，本基金未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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	600580	卧龙电气	38,096	305,148.96	1.98
2	600525	长园集团	17,929	283,098.91	1.84
3	002048	宁波华翔	11,347	270,058.60	1.75
4	600380	健康元	24,076	269,410.44	1.75

5	600160	巨化股份	24,904	264,729.52	1.72
6	002195	二三四五	45,148	263,664.32	1.71
7	000488	晨鸣纸业	15,216	253,650.72	1.65
8	000039	中集集团	10,723	245,020.55	1.59
9	600392	盛和资源	12,490	237,310.00	1.54
10	600750	江中药业	9,268	236,148.64	1.53
11	600335	国机汽车	20,660	232,218.40	1.51
12	002573	清新环境	10,143	230,550.39	1.50
13	000732	泰禾集团	11,183	223,883.66	1.45
14	600037	歌华有线	17,235	223,882.65	1.45
15	000598	兴蓉环境	41,013	222,700.59	1.45
16	600757	长江传媒	31,788	220,926.60	1.43
17	600270	外运发展	12,719	219,784.32	1.43
18	601128	常熟银行	30,734	219,133.42	1.42
19	603589	口子窖	4,693	216,112.65	1.40
20	000587	金洲慈航	30,871	216,097.00	1.40
21	600516	方大炭素	7,463	215,531.44	1.40
22	300182	捷成股份	25,018	215,404.98	1.40
23	600755	厦门国贸	21,323	215,362.30	1.40
24	600079	人福医药	11,962	213,402.08	1.39
25	600787	中储股份	19,173	210,903.00	1.37
26	000786	北新建材	9,338	210,105.00	1.36
27	600643	爱建集团	18,890	209,301.20	1.36
28	300274	阳光电源	11,144	209,172.88	1.36
29	000513	丽珠集团	3,117	207,124.65	1.34
30	600694	大商股份	6,100	205,753.00	1.34
31	600765	中航重机	16,900	203,138.00	1.32
32	600835	上海机电	8,232	201,684.00	1.31

33	600557	康缘药业	14,627	197,171.96	1.28
34	300287	飞利信	24,794	183,723.54	1.19
35	000418	小天鹅 A	2,700	183,195.00	1.19
36	002416	爱施德	19,114	181,009.58	1.17
37	600808	马钢股份	43,485	179,593.05	1.17
38	600970	中材国际	17,948	177,505.72	1.15
39	600582	天地科技	37,578	174,737.70	1.13
40	600388	龙净环保	9,933	171,840.90	1.12
41	600664	哈药股份	29,446	171,081.26	1.11
42	601233	桐昆股份	7,200	161,928.00	1.05
43	000581	威孚高科	6,108	146,592.00	0.95
44	002019	亿帆医药	6,457	143,668.25	0.93
45	600511	国药股份	5,132	142,669.60	0.93
46	603225	新凤鸣	3,942	141,123.60	0.92
47	000825	太钢不锈	27,868	138,225.28	0.90
48	000050	深天马 A	6,939	136,767.69	0.89
49	002092	中泰化学	10,191	135,642.21	0.88
50	000656	金科股份	26,965	133,476.75	0.87
51	603025	大豪科技	4,350	127,977.00	0.83
52	002051	中工国际	6,860	126,429.80	0.82
53	002179	中航光电	3,128	123,180.64	0.80
54	600183	生益科技	7,064	121,924.64	0.79
55	000012	南玻 A	14,200	119,990.00	0.78
56	603328	依顿电子	8,227	118,057.45	0.77
57	002056	横店东磁	10,861	116,212.70	0.75
58	000990	诚志股份	6,674	115,193.24	0.75
59	002503	搜于特	20,600	114,124.00	0.74
60	002366	台海核电	3,200	84,640.00	0.55

61	002078	太阳纸业	8,150	75,632.00	0.49
62	600438	通威股份	6,176	74,791.36	0.49
63	600565	迪马股份	18,669	74,676.00	0.48
64	601717	郑煤机	11,336	74,590.88	0.48
65	000661	长春高新	400	73,200.00	0.48
66	600141	兴发集团	4,309	72,822.10	0.47
67	600346	恒力股份	5,100	62,883.00	0.41
68	000528	柳工	6,629	56,545.37	0.37
69	600859	王府井	2,757	56,242.80	0.37
70	000778	新兴铸管	10,378	54,173.16	0.35
71	000158	常山股份	6,533	51,872.02	0.34
72	000596	古井贡酒	700	45,969.00	0.30
73	600122	宏图高科	4,685	45,397.65	0.29
74	601001	大同煤业	7,338	44,394.90	0.29
75	600594	益佰制药	4,269	43,629.18	0.28
76	000547	航天发展	3,900	42,237.00	0.27
77	002332	仙琚制药	4,827	39,436.59	0.26
78	600409	三友化工	3,860	37,017.40	0.24
79	002127	南极电商	3,028	36,911.32	0.24
80	600260	凯乐科技	1,164	33,884.04	0.22
81	600657	信达地产	6,041	33,708.78	0.22
82	600428	中远海特	5,603	31,432.83	0.20
83	002517	恺英网络	1,200	26,652.00	0.17
84	000830	鲁西化工	1,658	26,395.36	0.17
85	002273	水晶光电	1,097	25,878.23	0.17
86	600754	锦江股份	800	25,832.00	0.17
87	002390	信邦制药	2,900	24,505.00	0.16
88	600743	华远地产	5,973	21,861.18	0.14

89	603369	今世缘	1,382	21,434.82	0.14
90	000021	深科技	2,196	21,367.08	0.14
91	002544	杰赛科技	1,336	21,015.28	0.14
92	600572	康恩贝	2,947	20,835.29	0.14
93	000718	苏宁环球	4,721	20,441.93	0.13
94	600872	中炬高新	800	19,808.00	0.13
95	002642	荣之联	1,395	18,288.45	0.12
96	002384	东山精密	634	18,043.64	0.12
97	000612	焦作万方	1,908	17,935.20	0.12
98	000501	鄂武商 A	1,099	17,540.04	0.11
99	601678	滨化股份	2,057	16,702.84	0.11
100	000703	恒逸石化	764	16,479.48	0.11
101	000090	天健集团	1,515	15,210.60	0.10
102	002440	闰土股份	737	14,511.53	0.09
103	000997	新大陆	800	14,344.00	0.09
104	002342	巨力索具	2,381	14,262.19	0.09
105	600366	宁波韵升	774	13,560.48	0.09
106	600655	豫园股份	1,250	13,425.00	0.09
107	002551	尚荣医疗	1,429	13,089.64	0.08
108	002635	安洁科技	500	13,045.00	0.08
109	002128	露天煤业	1,161	12,863.88	0.08
110	000078	海王生物	2,100	12,390.00	0.08
111	601777	力帆股份	1,644	11,935.44	0.08
112	002434	万里扬	1,100	11,550.00	0.07
113	600801	华新水泥	800	11,304.00	0.07
114	002183	怡亚通	1,602	11,294.10	0.07
115	000761	本钢板材	2,148	11,169.60	0.07
116	002022	科华生物	800	10,888.00	0.07

117	002308	威创股份	872	10,638.40	0.07
118	002123	梦网荣信	994	10,287.90	0.07
119	600967	内蒙一机	851	10,254.55	0.07
120	600325	华发股份	1,325	9,752.00	0.06
121	600282	南钢股份	1,967	9,520.28	0.06
122	002002	鸿达兴业	1,359	9,295.56	0.06
123	600266	北京城建	700	9,198.00	0.06
124	000816	智慧农业	2,600	8,346.00	0.05
125	002191	劲嘉股份	866	8,010.50	0.05
126	002064	华峰氨纶	1,600	7,840.00	0.05
127	600823	世茂股份	1,306	6,451.64	0.04
128	000937	冀中能源	1,100	6,402.00	0.04
129	600348	阳泉煤业	690	5,092.20	0.03
130	000156	华数传媒	375	4,275.00	0.03
131	600971	恒源煤电	362	3,775.66	0.02
132	000563	陕国投 A	628	2,669.00	0.02
133	000031	中粮地产	300	2,400.00	0.02
134	002466	天齐锂业	30	1,596.30	0.01

8.3.2 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	000338	潍柴动力	7,055	58,838.70	0.38
2	600008	首创股份	10,593	54,448.02	0.35
3	000559	万向钱潮	2,840	28,826.00	0.19
4	000605	渤海股份	1,600	28,512.00	0.19
5	002241	歌尔股份	1,501	26,042.35	0.17

6	000959	首钢股份	4,252	25,426.96	0.17
7	000060	中金岭南	2,257	25,210.69	0.16
8	600031	三一重工	2,469	22,393.83	0.15
9	002572	索菲亚	600	22,080.00	0.14
10	600208	新湖中宝	4,105	21,428.10	0.14
11	002456	欧菲光	1,027	21,145.93	0.14
12	002236	大华股份	900	20,781.00	0.13
13	000069	华侨城 A	2,402	20,392.98	0.13
14	600297	广汇汽车	2,446	19,616.92	0.13
15	600820	隧道股份	2,128	17,790.08	0.12
16	000709	河钢股份	4,450	17,355.00	0.11
17	600415	小商品城	3,000	17,340.00	0.11
18	000630	铜陵有色	5,788	16,900.96	0.11
19	600535	天士力	468	16,651.44	0.11
20	002146	荣盛发展	1,739	16,572.67	0.11
21	600570	恒生电子	346	16,054.40	0.10
22	002385	大北农	2,484	15,053.04	0.10
23	000725	京东方 A	2,524	14,613.96	0.09
24	600373	中文传媒	815	13,797.95	0.09
25	601628	中国人寿	451	13,732.95	0.09
26	002065	东华软件	1,646	13,497.20	0.09
27	002365	永安药业	400	13,236.00	0.09
28	000568	泸州老窖	200	13,200.00	0.09
29	000402	金融街	1,182	13,132.02	0.09
30	600153	建发股份	1,108	12,320.96	0.08
31	002396	星网锐捷	546	11,788.14	0.08
32	601216	君正集团	2,431	11,450.01	0.07
33	601966	玲珑轮胎	619	10,807.74	0.07

34	002466	天齐锂业	201	10,695.21	0.07
35	000413	东旭光电	1,093	10,252.34	0.07
36	601118	海南橡胶	1,800	9,990.00	0.06
37	002008	大族激光	200	9,880.00	0.06
38	600109	国金证券	1,033	9,854.82	0.06
39	601288	农业银行	2,533	9,701.39	0.06
40	600104	上汽集团	300	9,612.00	0.06
41	601018	宁波港	1,700	9,027.00	0.06
42	600074	ST 保千里	900	8,883.00	0.06
43	002555	三七互娱	400	8,216.00	0.05
44	002310	东方园林	400	8,068.00	0.05
45	002007	华兰生物	300	8,064.00	0.05
46	601006	大秦铁路	877	7,954.39	0.05
47	601800	中国交建	600	7,680.00	0.05
48	002601	佰利联	477	7,641.54	0.05
49	600309	万华化学	200	7,588.00	0.05
50	002102	冠福股份	1,756	7,550.80	0.05
51	600567	山鹰纸业	1,718	7,456.12	0.05
52	002448	中原内配	800	7,200.00	0.05
53	600704	物产中大	1,000	6,820.00	0.04
54	000876	新希望	881	6,563.45	0.04
55	600507	方大特钢	505	6,408.45	0.04
56	002068	黑猫股份	600	5,814.00	0.04
57	600809	山西汾酒	100	5,699.00	0.04
58	600569	安阳钢铁	1,211	5,691.70	0.04
59	000065	北方国际	300	5,460.00	0.04
60	601992	金隅股份	965	5,239.95	0.03
61	002562	兄弟科技	320	5,235.20	0.03

62	600686	金龙汽车	400	5,212.00	0.03
63	002536	西泵股份	357	5,180.07	0.03
64	002334	英威腾	582	4,947.00	0.03
65	000898	鞍钢股份	777	4,933.95	0.03
66	002121	科陆电子	549	4,913.55	0.03
67	002766	索菱股份	345	4,881.75	0.03
68	002675	东诚药业	400	4,716.00	0.03
69	002016	世荣兆业	433	4,702.38	0.03
70	600779	水井坊	100	4,680.00	0.03
71	002567	唐人神	600	4,644.00	0.03
72	000738	中航动控	300	4,587.00	0.03
73	000910	大亚圣象	200	4,580.00	0.03
74	600619	海立股份	398	4,537.20	0.03
75	000822	山东海化	499	4,515.95	0.03
76	002174	游族网络	200	4,460.00	0.03
77	002091	江苏国泰	491	4,404.27	0.03
78	601669	中国电建	600	4,332.00	0.03
79	600990	四创电子	74	4,298.66	0.03
80	002643	万润股份	400	4,276.00	0.03
81	601225	陕西煤业	520	4,243.20	0.03
82	002496	辉丰股份	795	4,189.65	0.03
83	002067	景兴纸业	660	3,887.40	0.03
84	000666	经纬纺机	200	3,884.00	0.03
85	603299	井神股份	400	3,812.00	0.02
86	600308	华泰股份	600	3,768.00	0.02
87	002211	宏达新材	500	3,570.00	0.02
88	000716	黑芝麻	631	3,533.60	0.02
89	002518	科士达	200	3,274.00	0.02

90	002036	联创电子	200	3,246.00	0.02
91	600114	东睦股份	200	3,166.00	0.02
92	002149	西部材料	322	3,094.42	0.02
93	002136	安纳达	200	2,848.00	0.02
94	000001	平安银行	200	2,660.00	0.02
95	002623	亚玛顿	100	2,253.00	0.01
96	600705	中航资本	400	2,208.00	0.01
97	000686	东北证券	235	2,060.95	0.01
98	002500	山西证券	200	1,844.00	0.01
99	601997	贵阳银行	136	1,816.96	0.01
100	600390	五矿资本	139	1,640.20	0.01
101	600061	国投资本	100	1,318.00	0.01

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	600808	马钢股份	1,657,598.00	15.75
2	601233	桐昆股份	1,405,206.00	13.35
3	601699	潞安环能	1,274,446.00	12.11
4	600801	华新水泥	1,202,718.00	11.43
5	000830	鲁西化工	1,173,012.94	11.14
6	600335	国机汽车	1,124,562.04	10.68
7	002479	富春环保	1,123,625.00	10.67
8	002078	太阳纸业	1,111,807.00	10.56
9	000418	小天鹅 A	1,101,052.00	10.46
10	002396	星网锐捷	1,070,488.21	10.17
11	600580	卧龙电气	1,063,812.35	10.11

12	002048	宁波华翔	1,061,319.00	10.08
13	600183	生益科技	1,025,863.50	9.75
14	600565	迪马股份	1,024,960.00	9.74
15	600380	健康元	992,287.00	9.43
16	000786	北新建材	984,176.44	9.35
17	300274	阳光电源	974,755.00	9.26
18	600525	长园集团	970,179.40	9.22
19	600141	兴发集团	958,626.00	9.11
20	002601	佰利联	954,054.00	9.06
21	002463	沪电股份	928,865.00	8.82
22	002244	滨江集团	911,827.00	8.66
23	600282	南钢股份	909,370.00	8.64
24	600160	巨化股份	903,406.00	8.58
25	002019	亿帆医药	901,383.00	8.56
26	600499	科达洁能	899,181.00	8.54
27	600409	三友化工	888,326.00	8.44
28	600325	华发股份	877,587.00	8.34
29	002416	爱施德	871,520.00	8.28
30	600219	南山铝业	869,720.00	8.26
31	000761	本钢板材	864,955.00	8.22
32	000726	鲁泰A	855,949.81	8.13
33	600348	阳泉煤业	852,466.00	8.10
34	600597	光明乳业	850,317.00	8.08
35	002589	瑞康医药	849,017.00	8.07
36	000878	云南铜业	837,294.00	7.95
37	603589	口子窖	830,883.00	7.89
38	600338	西藏珠峰	812,462.00	7.72
39	603766	隆鑫通用	812,242.00	7.72

40	000960	锡业股份	803,956.00	7.64
41	002217	合力泰	798,145.75	7.58
42	600073	上海梅林	798,009.00	7.58
43	000997	新大陆	796,799.00	7.57
44	600809	山西汾酒	787,826.00	7.48
45	002056	横店东磁	785,405.00	7.46
46	601678	滨化股份	785,358.00	7.46
47	600694	大商股份	781,005.00	7.42
48	000400	许继电气	776,463.00	7.38
49	600978	宜华生活	775,862.00	7.37
50	002064	华峰氨纶	766,024.00	7.28
51	600757	长江传媒	763,760.00	7.26
52	600835	上海机电	762,867.00	7.25
53	000501	鄂武商 A	759,526.88	7.22
54	002106	莱宝高科	749,896.00	7.12
55	000528	柳工	746,730.00	7.09
56	002503	搜于特	743,841.00	7.07
57	002092	中泰化学	729,279.00	6.93
58	600596	新安股份	727,582.00	6.91
59	603328	依顿电子	715,661.00	6.80
60	002482	广田集团	714,087.00	6.78
61	000426	兴业矿业	708,749.00	6.73
62	600039	四川路桥	706,211.75	6.71
63	002354	天神娱乐	706,098.84	6.71
64	000598	兴蓉环境	705,151.00	6.70
65	600872	中炬高新	700,726.00	6.66
66	000049	德赛电池	697,413.00	6.63
67	000703	恒逸石化	693,610.88	6.59

68	002573	清新环境	693,354.00	6.59
69	600563	法拉电子	690,954.00	6.56
70	000488	晨鸣纸业	690,886.00	6.56
71	000021	深科技	679,613.00	6.46
72	600664	哈药股份	679,570.00	6.46
73	600260	凯乐科技	677,456.72	6.44
74	000513	丽珠集团	672,760.00	6.39
75	000090	天健集团	672,005.50	6.38
76	002002	鸿达兴业	669,138.00	6.36
77	601231	环旭电子	664,417.00	6.31
78	002050	三花智控	664,017.00	6.31
79	603025	大豪科技	651,705.98	6.19
80	600582	天地科技	651,318.00	6.19
81	002281	光迅科技	650,658.00	6.18
82	000988	华工科技	646,069.00	6.14
83	600392	盛和资源	645,277.00	6.13
84	600750	江中药业	645,135.00	6.13
85	600971	恒源煤电	642,162.00	6.10
86	002332	仙琚制药	640,488.00	6.08
87	600466	蓝光发展	635,003.00	6.03
88	600970	中材国际	634,089.44	6.02
89	000039	中集集团	627,474.06	5.96
90	600195	中牧股份	623,137.00	5.92
91	002315	焦点科技	622,833.96	5.92
92	603799	华友钴业	615,248.00	5.85
93	000825	太钢不锈	612,128.00	5.82
94	600720	祁连山	610,531.00	5.80
95	000066	长城电脑	609,893.00	5.79

96	000661	长春高新	604,789.52	5.75
97	600831	广电网络	593,053.00	5.63
98	600881	亚泰集团	592,430.84	5.63
99	600056	中国医药	580,337.00	5.51
100	002195	二三四五	578,129.00	5.49
101	000581	威孚高科	576,908.16	5.48
102	002249	大洋电机	576,555.00	5.48
103	002194	武汉凡谷	575,328.00	5.47
104	600787	中储股份	574,215.00	5.46
105	000417	合肥百货	573,758.00	5.45
106	002317	众生药业	573,018.00	5.44
107	600300	维维股份	572,755.00	5.44
108	002155	湖南黄金	572,733.00	5.44
109	600270	外运发展	569,866.00	5.41
110	600298	安琪酵母	563,809.00	5.36
111	600586	金晶科技	562,152.00	5.34
112	603369	今世缘	558,811.00	5.31
113	600516	方大炭素	557,716.00	5.30
114	000612	焦作万方	556,107.00	5.28
115	600062	华润双鹤	554,443.10	5.27
116	000667	美好置业	552,798.00	5.25
117	600388	龙净环保	551,769.00	5.24
118	603198	迎驾贡酒	547,486.00	5.20
119	600511	国药股份	547,420.00	5.20
120	600755	厦门国贸	542,976.46	5.16
121	000636	风华高科	542,882.00	5.16
122	002233	塔牌集团	542,673.00	5.16
123	600307	酒钢宏兴	542,520.00	5.15

124	600859	王府井	541,879.00	5.15
125	601012	隆基股份	541,336.00	5.14
126	600312	平高电气	539,701.00	5.13
127	601689	拓普集团	538,468.00	5.12
128	002444	巨星科技	537,857.42	5.11
129	000587	金洲慈航	536,238.00	5.09
130	601001	大同煤业	532,428.00	5.06
131	002118	紫鑫药业	532,396.00	5.06
132	600138	中青旅	528,831.00	5.02
133	600776	东方通信	528,698.86	5.02
134	000860	顺鑫农业	522,836.00	4.97
135	300287	飞利信	521,506.00	4.95
136	002366	台海核电	518,001.00	4.92
137	002051	中工国际	515,777.85	4.90
138	000596	古井贡酒	515,482.00	4.90
139	002179	中航光电	510,803.88	4.85
140	002309	中利科技	506,907.00	4.82
141	603866	桃李面包	500,228.14	4.75
142	002440	闰土股份	499,114.34	4.74
143	002414	高德红外	498,965.00	4.74
144	600201	生物股份	496,045.62	4.71
145	002311	海大集团	490,045.00	4.66
146	000547	航天发展	488,578.00	4.64
147	600053	九鼎投资	484,590.00	4.60
148	600862	中航高科	483,036.00	4.59
149	600600	青岛啤酒	481,457.00	4.57
150	002285	世联行	479,418.40	4.55
151	600517	置信电气	479,375.00	4.55

152	600267	海正药业	478,081.00	4.54
153	002273	水晶光电	477,939.00	4.54
154	002368	太极股份	477,316.00	4.53
155	600575	皖江物流	475,388.00	4.52
156	000758	中色股份	474,969.00	4.51
157	600433	冠豪高新	472,910.00	4.49
158	002308	威创股份	472,811.00	4.49
159	002672	东江环保	466,641.00	4.43
160	600216	浙江医药	465,004.00	4.42
161	002408	齐翔腾达	462,028.00	4.39
162	600220	江苏阳光	461,498.00	4.38
163	601811	新华文轩	460,303.00	4.37
164	600751	天海投资	457,122.00	4.34
165	600765	中航重机	455,306.00	4.33
166	002588	史丹利	454,827.00	4.32
167	601002	晋亿实业	451,570.81	4.29
168	603567	珍宝岛	450,988.00	4.28
169	603568	伟明环保	448,237.00	4.26
170	002371	七星电子	446,280.00	4.24
171	600557	康缘药业	441,980.00	4.20
172	000078	海王生物	441,460.00	4.19
173	000681	视觉中国	440,885.00	4.19
174	600754	锦江股份	440,634.00	4.19
175	601010	文峰股份	438,900.00	4.17
176	600594	益佰制药	438,627.00	4.17
177	002063	远光软件	437,599.86	4.16
178	002005	德豪润达	436,142.00	4.14
179	601717	郑煤机	433,587.00	4.12

180	000926	福星股份	427,760.00	4.06
181	600601	方正科技	427,222.00	4.06
182	002277	友阿股份	426,074.00	4.05
183	000969	安泰科技	425,623.00	4.04
184	600176	中国巨石	424,985.00	4.04
185	600059	古越龙山	420,726.00	4.00
186	601886	江河集团	419,683.00	3.99
187	600022	山东钢铁	417,744.00	3.97
188	000778	新兴铸管	414,767.00	3.94
189	600088	中视传媒	412,114.08	3.92
190	600240	华业资本	409,582.00	3.89
191	000401	冀东水泥	406,622.00	3.86
192	600628	新世界	406,279.28	3.86
193	603868	飞科电器	405,361.00	3.85
194	600291	西水股份	404,671.00	3.84
195	600067	冠城大通	403,386.00	3.83
196	600017	日照港	402,797.00	3.83
197	600917	重庆燃气	398,626.00	3.79
198	000652	泰达股份	397,603.00	3.78
199	600584	长电科技	397,303.00	3.77
200	600487	亨通光电	396,394.00	3.77
201	000541	佛山照明	396,172.55	3.76
202	002551	尚荣医疗	393,765.00	3.74
203	600458	时代新材	391,816.51	3.72
204	600058	五矿发展	390,622.55	3.71
205	601168	西部矿业	390,252.00	3.71
206	002242	九阳股份	386,364.00	3.67
207	601016	节能风电	386,316.00	3.67

208	600428	中远海特	385,789.00	3.67
209	000552	靖远煤电	385,167.00	3.66
210	600967	内蒙一机	384,847.90	3.66
211	002073	软控股份	384,471.00	3.65
212	600657	信达地产	382,238.00	3.63
213	600161	天坛生物	381,674.76	3.63
214	002491	通鼎互联	381,258.95	3.62
215	002269	美邦服饰	377,872.00	3.59
216	600618	氯碱化工	376,755.00	3.58
217	600770	综艺股份	375,067.00	3.56
218	300116	坚瑞沃能	373,083.00	3.54
219	000338	潍柴动力	372,563.00	3.54
220	600748	上实发展	371,570.94	3.53
221	000930	中粮生化	371,148.00	3.53
222	600108	亚盛集团	369,639.00	3.51
223	600729	重庆百货	368,035.00	3.50
224	603883	老百姓	368,015.70	3.50
225	002690	美亚光电	367,413.00	3.49
226	600651	飞乐音响	365,943.00	3.48
227	600884	杉杉股份	365,070.00	3.47
228	603355	莱克电气	363,850.00	3.46
229	002498	汉缆股份	361,557.00	3.43
230	600743	华远地产	360,103.00	3.42
231	000425	徐工机械	354,664.00	3.37
232	000961	中南建设	352,087.00	3.34
233	002392	北京利尔	351,696.00	3.34
234	600284	浦东建设	349,555.00	3.32
235	000543	皖能电力	347,442.00	3.30

236	600643	爱建集团	347,328.00	3.30
237	600171	上海贝岭	345,429.00	3.28
238	002128	露天煤业	345,395.00	3.28
239	600468	百利电气	344,154.00	3.27
240	600079	人福医药	344,031.00	3.27
241	000519	江南红箭	343,332.00	3.26
242	002093	国脉科技	340,258.00	3.23
243	000685	中山公用	340,101.00	3.23
244	000725	京东方 A	335,889.00	3.19
245	601311	骆驼股份	334,622.00	3.18
246	600572	康恩贝	334,589.00	3.18
247	000919	金陵药业	333,525.92	3.17
248	600426	华鲁恒升	332,970.00	3.16
249	002640	跨境通	332,279.00	3.16
250	000959	首钢股份	324,311.00	3.08
251	300146	汤臣倍健	321,457.00	3.05
252	002029	七匹狼	321,248.94	3.05
253	600037	歌华有线	320,106.00	3.04
254	000006	深振业 A	316,068.00	3.00
255	002431	棕榈股份	314,917.00	2.99
256	600863	内蒙华电	314,611.00	2.99
257	600460	士兰微	310,757.00	2.95
258	000732	泰禾集团	309,633.00	2.94
259	002174	游族网络	308,856.00	2.93
260	000861	海印股份	308,554.00	2.93
261	002572	索菲亚	306,799.00	2.91
262	600169	太原重工	303,083.00	2.88
263	300039	上海凯宝	302,704.00	2.88

264	600497	驰宏锌锗	301,492.00	2.86
265	601928	凤凰传媒	301,204.00	2.86
266	600687	刚泰控股	300,924.00	2.86
267	000158	常山股份	299,885.00	2.85
268	000028	国药一致	299,381.00	2.84
269	001696	宗申动力	296,762.00	2.82
270	000031	中粮地产	296,212.08	2.81
271	002001	新和成	296,062.00	2.81
272	000690	宝新能源	294,758.00	2.80
273	600537	亿晶光电	294,747.00	2.80
274	002384	东山精密	294,274.00	2.80
275	603188	亚邦股份	292,554.12	2.78
276	002642	荣之联	292,368.70	2.78
277	000727	华东科技	292,019.00	2.77
278	002727	一心堂	288,197.00	2.74
279	600031	三一重工	286,788.00	2.72
280	603005	晶方科技	285,995.00	2.72
281	002701	奥瑞金	285,961.00	2.72
282	600416	湘电股份	285,773.00	2.71
283	000572	海马汽车	285,151.00	2.71
284	600894	广日股份	284,979.00	2.71
285	600397	安源煤业	283,250.00	2.69
286	002013	中航机电	281,893.11	2.68
287	002011	盾安环境	281,070.00	2.67
288	002544	杰赛科技	280,140.00	2.66
289	002477	雏鹰农牧	278,381.00	2.64
290	000939	凯迪生态	278,372.00	2.64
291	002583	海能达	276,598.18	2.63

292	002345	潮宏基	275,476.00	2.62
293	600166	福田汽车	275,109.00	2.61
294	300297	蓝盾股份	274,884.00	2.61
295	601908	京运通	272,603.00	2.59
296	000050	深天马 A	268,597.00	2.55
297	600259	广晟有色	267,648.80	2.54
298	600297	广汇汽车	267,368.00	2.54
299	000089	深圳机场	266,341.00	2.53
300	000998	隆平高科	265,831.00	2.53
301	600180	瑞茂通	265,621.71	2.52
302	600587	新华医疗	265,391.00	2.52
303	002223	鱼跃医疗	264,286.00	2.51
304	002698	博实股份	262,280.00	2.49
305	600395	盘江股份	260,999.00	2.48
306	600175	美都能源	260,958.00	2.48
307	000630	铜陵有色	257,995.00	2.45
308	300032	金龙机电	256,138.00	2.43
309	000656	金科股份	254,991.00	2.42
310	000999	华润三九	254,700.56	2.42
311	000680	山推股份	253,222.00	2.41
312	002238	天威视讯	253,159.00	2.41
313	000012	南玻 A	252,959.00	2.40
314	002176	江特电机	252,875.00	2.40
315	600422	昆药集团	251,294.00	2.39
316	000517	荣安地产	251,010.00	2.38
317	600773	西藏城投	249,108.00	2.37
318	300182	捷成股份	248,026.00	2.36
319	002271	东方雨虹	246,861.00	2.35

320	600522	中天科技	246,381.00	2.34
321	002004	华邦健康	246,368.00	2.34
322	002131	利欧股份	244,524.00	2.32
323	600251	冠农股份	242,571.00	2.30
324	600848	上海临港	241,694.00	2.30
325	002261	拓维信息	239,400.00	2.27
326	000069	华侨城 A	237,811.00	2.26
327	000620	新华联	237,143.00	2.25
328	600826	兰生股份	234,926.00	2.23
329	002657	中科金财	234,674.00	2.23
330	002022	科华生物	232,731.00	2.21
331	300202	聚龙股份	231,742.00	2.20
332	600500	中化国际	231,627.00	2.20
333	600823	世茂股份	228,445.00	2.17
334	002340	格林美	228,099.00	2.17
335	002410	广联达	226,670.00	2.15
336	601128	常熟银行	225,800.00	2.15
337	603001	奥康国际	223,724.56	2.13
338	000877	天山股份	223,039.00	2.12
339	603806	福斯特	222,312.68	2.11
340	600309	万华化学	220,413.00	2.09
341	600981	汇鸿集团	219,511.00	2.09
342	000931	中关村	218,274.20	2.07
343	002122	天马股份	218,213.00	2.07
344	002595	豪迈科技	215,777.14	2.05
345	600064	南京高科	215,465.00	2.05
346	600122	宏图高科	214,462.00	2.04
347	000810	创维数字	213,629.00	2.03

348	600635	大众公用	211,934.00	2.01
349	600737	中粮糖业	211,686.00	2.01

8.4.2 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	600808	马钢股份	1,522,096.21	14.46
2	601699	潞安环能	1,338,406.22	12.72
3	600801	华新水泥	1,291,168.71	12.27
4	000830	鲁西化工	1,290,787.92	12.26
5	601233	桐昆股份	1,284,401.64	12.20
6	002479	富春环保	1,118,736.86	10.63
7	002078	太阳纸业	1,103,273.69	10.48
8	002396	星网锐捷	1,098,906.77	10.44
9	000418	小天鹅A	1,036,002.25	9.84
10	600335	国机汽车	1,012,185.80	9.62
11	600183	生益科技	980,853.05	9.32
12	600499	科达洁能	973,429.97	9.25
13	002244	滨江集团	958,983.24	9.11
14	002601	佰利联	948,916.68	9.02
15	600282	南钢股份	945,643.48	8.98
16	000761	本钢板材	934,883.36	8.88
17	600597	光明乳业	931,802.36	8.85
18	002463	沪电股份	929,982.75	8.84
19	600565	迪马股份	916,906.70	8.71
20	002589	瑞康医药	911,548.74	8.66
21	600338	西藏珠峰	895,785.01	8.51

22	600348	阳泉煤业	873,261.56	8.30
23	300274	阳光电源	872,846.75	8.29
24	600219	南山铝业	867,653.93	8.24
25	000786	北新建材	865,728.84	8.22
26	600141	兴发集团	864,868.87	8.22
27	600325	华发股份	854,170.35	8.11
28	600409	三友化工	850,966.69	8.08
29	002048	宁波华翔	849,168.39	8.07
30	000726	鲁泰 A	847,481.41	8.05
31	000878	云南铜业	842,268.88	8.00
32	600073	上海梅林	834,042.03	7.92
33	600809	山西汾酒	832,306.39	7.91
34	002106	莱宝高科	825,579.71	7.84
35	600978	宜华生活	822,054.32	7.81
36	000960	锡业股份	817,274.60	7.76
37	002217	合力泰	815,321.15	7.75
38	600580	卧龙电气	814,484.95	7.74
39	603766	隆鑫通用	813,235.75	7.73
40	002019	亿帆医药	786,591.26	7.47
41	000997	新大陆	785,671.28	7.46
42	601678	滨化股份	779,890.43	7.41
43	600872	中炬高新	777,105.16	7.38
44	000426	兴业矿业	769,029.55	7.31
45	000400	许继电气	768,384.38	7.30
46	002064	华峰氨纶	758,419.11	7.21
47	000501	鄂武商 A	752,617.83	7.15
48	601231	环旭电子	746,342.35	7.09
49	002050	三花智控	737,302.11	7.00

50	600971	恒源煤电	732,036.53	6.95
51	600380	健康元	729,262.13	6.93
52	000049	德赛电池	724,018.82	6.88
53	002354	天神娱乐	723,115.67	6.87
54	600596	新安股份	722,972.21	6.87
55	600563	法拉电子	716,302.97	6.81
56	002482	广田集团	716,006.01	6.80
57	000528	柳 工	710,426.94	6.75
58	600195	中牧股份	693,918.70	6.59
59	600525	长园集团	689,700.72	6.55
60	002056	横店东磁	685,917.89	6.52
61	600039	四川路桥	684,777.42	6.51
62	600260	凯乐科技	682,589.80	6.48
63	000703	恒逸石化	681,171.53	6.47
64	000090	天健集团	676,360.69	6.43
65	002416	爱施德	673,780.42	6.40
66	002002	鸿达兴业	665,094.74	6.32
67	000988	华工科技	662,978.19	6.30
68	002315	焦点科技	662,605.79	6.29
69	600586	金晶科技	657,549.75	6.25
70	603799	华友钴业	656,473.88	6.24
71	002281	光迅科技	655,533.06	6.23
72	002332	仙琚制药	651,235.21	6.19
73	600160	巨化股份	642,996.79	6.11
74	600466	蓝光发展	640,581.73	6.09
75	002503	搜于特	638,546.58	6.07
76	000021	深科技	632,179.35	6.01
77	002092	中泰化学	631,850.43	6.00

78	600056	中国医药	627,290.56	5.96
79	603589	口子窖	626,768.51	5.95
80	002317	众生药业	625,557.78	5.94
81	000417	合肥百货	624,239.16	5.93
82	600835	上海机电	622,015.38	5.91
83	600831	广电网络	619,804.76	5.89
84	600881	亚泰集团	619,486.69	5.89
85	000066	长城电脑	608,403.64	5.78
86	600300	维维股份	607,783.56	5.77
87	600694	大商股份	607,053.00	5.77
88	603328	依顿电子	605,388.19	5.75
89	603198	迎驾贡酒	603,520.92	5.73
90	002309	中利科技	602,292.53	5.72
91	600720	祁连山	600,516.38	5.71
92	600062	华润双鹤	597,199.84	5.67
93	600757	长江传媒	592,651.82	5.63
94	600298	安琪酵母	591,406.32	5.62
95	601012	隆基股份	589,981.77	5.61
96	000667	美好置业	586,939.55	5.58
97	002249	大洋电机	585,249.86	5.56
98	002233	塔牌集团	581,446.99	5.52
99	600664	哈药股份	578,889.55	5.50
100	002155	湖南黄金	577,948.62	5.49
101	000636	风华高科	573,546.43	5.45
102	601002	晋亿实业	569,991.63	5.42
103	002368	太极股份	562,934.23	5.35
104	600307	酒钢宏兴	562,469.84	5.34
105	600312	平高电气	561,141.63	5.33

106	002311	海大集团	556,646.93	5.29
107	603369	今世缘	556,418.25	5.29
108	002194	武汉凡谷	554,361.20	5.27
109	002444	巨星科技	551,442.22	5.24
110	000661	长春高新	550,750.21	5.23
111	600138	中青旅	546,475.92	5.19
112	600859	王府井	542,356.78	5.15
113	000825	太钢不锈	537,526.10	5.11
114	601689	拓普集团	535,588.66	5.09
115	002573	清新环境	534,184.35	5.07
116	601001	大同煤业	530,530.56	5.04
117	002118	紫鑫药业	530,141.14	5.04
118	600517	置信电气	527,890.69	5.02
119	600267	海正药业	527,287.60	5.01
120	600776	东方通信	525,341.94	4.99
121	600862	中航高科	524,752.53	4.99
122	000860	顺鑫农业	520,276.41	4.94
123	000612	焦作万方	514,378.54	4.89
124	600600	青岛啤酒	513,268.76	4.88
125	600201	生物股份	510,027.89	4.85
126	002440	闰土股份	509,121.59	4.84
127	603567	珍宝岛	504,785.81	4.80
128	002414	高德红外	504,037.65	4.79
129	603025	大豪科技	503,466.69	4.78
130	603866	桃李面包	503,422.57	4.78
131	002285	世联行	500,613.68	4.76
132	600970	中材国际	497,957.53	4.73
133	000596	古井贡酒	495,503.63	4.71

134	600433	冠豪高新	494,485.78	4.70
135	600220	江苏阳光	493,183.11	4.69
136	600053	九鼎投资	490,649.77	4.66
137	600751	天海投资	489,340.89	4.65
138	000758	中色股份	488,380.03	4.64
139	600458	时代新材	485,556.37	4.61
140	002371	七星电子	485,432.08	4.61
141	600216	浙江医药	484,269.10	4.60
142	601886	江河集团	478,810.45	4.55
143	002005	德豪润达	476,808.12	4.53
144	000513	丽珠集团	474,504.18	4.51
145	600582	天地科技	471,441.69	4.48
146	000681	视觉中国	470,742.72	4.47
147	000401	冀东水泥	468,777.92	4.45
148	002408	齐翔腾达	467,981.22	4.45
149	002672	东江环保	466,459.45	4.43
150	000488	晨鸣纸业	465,888.88	4.43
151	600240	华业资本	465,432.96	4.42
152	600067	冠城大通	463,452.04	4.40
153	600729	重庆百货	460,192.81	4.37
154	600022	山东钢铁	459,622.27	4.37
155	600487	亨通光电	457,678.46	4.35
156	002273	水晶光电	457,264.74	4.34
157	601811	新华文轩	455,105.09	4.32
158	603568	伟明环保	455,070.44	4.32
159	000969	安泰科技	454,781.52	4.32
160	600575	皖江物流	451,786.73	4.29
161	002588	史丹利	450,799.49	4.28

162	600059	古越龙山	450,687.53	4.28
163	002308	威创股份	449,783.66	4.27
164	603868	飞科电器	449,502.31	4.27
165	000541	佛山照明	447,650.98	4.25
166	601010	文峰股份	445,556.45	4.23
167	600388	龙净环保	441,033.52	4.19
168	000547	航天发展	440,283.61	4.18
169	002551	尚荣医疗	439,783.58	4.18
170	000652	泰达股份	439,484.99	4.18
171	600017	日照港	438,180.95	4.16
172	600291	西水股份	437,893.33	4.16
173	002063	远光软件	437,232.89	4.15
174	000598	兴蓉环境	435,768.42	4.14
175	600754	锦江股份	435,756.59	4.14
176	000039	中集集团	434,859.68	4.13
177	601016	节能风电	434,500.88	4.13
178	000581	威孚高科	431,583.66	4.10
179	002366	台海核电	429,541.75	4.08
180	603883	老百姓	424,302.10	4.03
181	000926	福星股份	424,196.84	4.03
182	002179	中航光电	423,712.51	4.03
183	002277	友阿股份	423,691.09	4.03
184	002242	九阳股份	421,378.69	4.00
185	600176	中国巨石	420,721.70	4.00
186	600743	华远地产	419,659.07	3.99
187	000078	海王生物	419,595.08	3.99
188	600392	盛和资源	418,210.34	3.97
189	600584	长电科技	415,808.18	3.95

190	600601	方正科技	414,607.02	3.94
191	600270	外运发展	413,776.31	3.93
192	601168	西部矿业	412,594.86	3.92
193	600628	新世界	410,899.12	3.90
194	600058	五矿发展	408,229.00	3.88
195	600088	中视传媒	406,900.17	3.87
196	002392	北京利尔	406,209.45	3.86
197	000587	金洲慈航	405,274.25	3.85
198	000552	靖远煤电	403,852.41	3.84
199	002498	汉缆股份	395,372.08	3.76
200	002491	通鼎互联	395,274.66	3.76
201	000543	皖能电力	393,084.11	3.73
202	600511	国药股份	391,926.47	3.72
203	002128	露天煤业	390,934.87	3.71
204	600651	飞乐音响	389,973.06	3.70
205	600594	益佰制药	388,078.42	3.69
206	601717	郑煤机	386,412.96	3.67
207	600750	江中药业	385,433.84	3.66
208	600967	内蒙一机	382,192.22	3.63
209	000028	国药一致	381,804.81	3.63
210	002029	七匹狼	380,288.98	3.61
211	002690	美亚光电	377,165.58	3.58
212	600657	信达地产	377,022.91	3.58
213	600516	方大炭素	376,890.07	3.58
214	600161	天坛生物	375,116.40	3.56
215	600787	中储股份	374,877.10	3.56
216	002073	软控股份	374,482.06	3.56
217	002051	中工国际	374,382.24	3.56

218	600748	上实发展	373,234.87	3.55
219	000930	中粮生化	371,739.09	3.53
220	600917	重庆燃气	371,652.73	3.53
221	600108	亚盛集团	370,363.85	3.52
222	601311	骆驼股份	368,845.84	3.50
223	600884	杉杉股份	368,012.30	3.50
224	600618	氯碱化工	367,889.18	3.50
225	300116	坚瑞沃能	367,153.36	3.49
226	600770	综艺股份	366,921.78	3.49
227	000919	金陵药业	366,724.88	3.48
228	600468	百利电气	364,986.07	3.47
229	002269	美邦服饰	364,864.67	3.47
230	600397	安源煤业	363,928.22	3.46
231	603355	莱克电气	361,616.33	3.44
232	002011	盾安环境	357,562.14	3.40
233	600180	瑞茂通	356,695.38	3.39
234	603188	亚邦股份	356,547.97	3.39
235	000425	徐工机械	353,584.07	3.36
236	000778	新兴铸管	350,736.93	3.33
237	002640	跨境通	348,984.66	3.32
238	002431	棕榈股份	348,337.28	3.31
239	000519	江南红箭	347,723.54	3.30
240	600755	厦门国贸	347,645.15	3.30
241	600428	中远海特	346,017.99	3.29
242	000961	中南建设	345,822.03	3.29
243	600171	上海贝岭	343,276.74	3.26
244	600284	浦东建设	340,922.55	3.24
245	000685	中山公用	340,249.97	3.23

246	000725	京东方 A	338,189.37	3.21
247	000089	深圳机场	337,100.48	3.20
248	600426	华鲁恒升	336,752.30	3.20
249	002093	国脉科技	333,659.71	3.17
250	300146	汤臣倍健	331,791.64	3.15
251	600894	广日股份	331,379.70	3.15
252	002701	奥瑞金	326,636.75	3.10
253	002727	一心堂	326,040.05	3.10
254	000006	深振业 A	323,235.38	3.07
255	000338	潍柴动力	322,593.06	3.06
256	600863	内蒙华电	322,327.98	3.06
257	300039	上海凯宝	318,396.74	3.02
258	000959	首钢股份	317,265.23	3.01
259	600460	士兰微	315,949.04	3.00
260	300287	飞利信	312,581.12	2.97
261	600572	康恩贝	311,131.17	2.96
262	000861	海印股份	308,771.27	2.93
263	600169	太原重工	308,501.49	2.93
264	002477	雏鹰农牧	307,157.33	2.92
265	002572	索菲亚	304,051.00	2.89
266	000690	宝新能源	302,736.76	2.88
267	002261	拓维信息	302,364.36	2.87
268	002271	东方雨虹	298,899.60	2.84
269	001696	宗申动力	298,752.29	2.84
270	600981	汇鸿集团	298,547.76	2.84
271	002642	荣之联	297,973.31	2.83
272	600259	广晟有色	297,692.29	2.83
273	600687	刚泰控股	297,467.62	2.83

274	002001	新 和 成	297,313.76	2.82
275	002174	游族网络	297,199.49	2.82
276	600823	世茂股份	295,541.68	2.81
277	600765	中航重机	294,053.89	2.79
278	000031	中粮地产	293,652.74	2.79
279	600251	冠农股份	292,831.45	2.78
280	002195	二三四五	291,716.60	2.77
281	600497	驰宏锌锗	291,654.23	2.77
282	600537	亿晶光电	291,297.99	2.77
283	601928	凤凰传媒	289,883.06	2.75
284	002583	海能达	289,554.36	2.75
285	002384	东山精密	289,149.24	2.75
286	600773	西藏城投	288,548.15	2.74
287	603806	福斯特	288,007.68	2.74
288	002013	中航机电	287,980.06	2.74
289	002004	华邦健康	287,158.69	2.73
290	002698	博实股份	287,034.88	2.73
291	603005	晶方科技	285,834.12	2.72
292	000572	海马汽车	283,732.52	2.70
293	000727	华东科技	283,073.23	2.69
294	600416	湘电股份	280,849.29	2.67
295	002223	鱼跃医疗	280,485.35	2.66
296	002345	潮宏基	278,875.20	2.65
297	000939	凯迪生态	278,609.86	2.65
298	000680	山推股份	278,041.71	2.64
299	600292	远达环保	277,151.74	2.63
300	300032	金龙机电	277,121.36	2.63
301	000877	天山股份	275,756.89	2.62

302	600826	兰生股份	275,251.79	2.61
303	002238	天威视讯	274,904.04	2.61
304	600175	美都能源	274,145.24	2.60
305	300297	蓝盾股份	271,706.56	2.58
306	600031	三一重工	271,657.08	2.58
307	600166	福田汽车	271,622.99	2.58
308	600395	盘江股份	270,750.16	2.57
309	601908	京运通	270,555.79	2.57
310	000998	隆平高科	270,483.54	2.57
311	600587	新华医疗	266,768.89	2.53
312	000158	常山股份	264,510.04	2.51
313	600736	苏州高新	263,388.22	2.50
314	002221	东华能源	263,253.92	2.50
315	600557	康缘药业	262,158.75	2.49
316	002410	广联达	262,043.50	2.49
317	000517	荣安地产	253,773.93	2.41
318	002544	杰赛科技	253,419.13	2.41
319	002657	中科金财	250,408.63	2.38
320	600522	中天科技	249,835.28	2.37
321	000999	华润三九	249,541.56	2.37
322	600422	昆药集团	249,540.85	2.37
323	600297	广汇汽车	249,375.77	2.37
324	002022	科华生物	249,172.91	2.37
325	300043	星辉娱乐	246,287.49	2.34
326	600064	南京高科	244,296.56	2.32
327	002325	洪涛股份	244,055.54	2.32
328	002176	江特电机	241,919.15	2.30
329	600848	上海临港	241,700.73	2.30

330	000630	铜陵有色	239,310.07	2.27
331	000931	中关村	238,845.41	2.27
332	002131	利欧股份	237,936.63	2.26
333	000620	新华联	237,092.88	2.25
334	002340	格林美	236,387.54	2.25
335	600500	中化国际	235,817.45	2.24
336	002595	豪迈科技	232,361.11	2.21
337	000810	创维数字	232,158.31	2.21
338	603001	奥康国际	222,617.97	2.11
339	600635	大众公用	222,297.31	2.11
340	000600	建投能源	221,133.33	2.10
341	600309	万华化学	220,908.36	2.10
342	002122	天马股份	217,748.24	2.07
343	300202	聚龙股份	217,642.63	2.07
344	000069	华侨城 A	216,276.07	2.05
345	601000	唐山港	216,229.53	2.05
346	000616	海航投资	214,325.90	2.04
347	600737	中粮糖业	210,584.06	2.00

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	207,645,687.37
卖出股票收入（成交）总额	204,338,893.02

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,539.84	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,539.84	0.07

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110040	生益转债	90	9,745.20	0.06
2	128021	兄弟转债	8	794.64	0.01

8.7 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。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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、处罚的情况。

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	7,207.02
2	应收证券清算款	25,649.66
3	应收股利	-
4	应收利息	332.57
5	应收申购款	31,689.51
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,878.76

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600525	长园集团	283,098.91	1.84	重大事项停牌

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

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

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 中 证 500A	106	124,698.41	10,000,000.00	75.65%	3,218,031.80	24.35%
中 金 中 证 500C	116	7,334.09	-	0.00%	850,775.00	100.00%
合计	222	63,372.91	10,000,000.00	71.08%	4,068,806.80	28.92%

9.2 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	中金中证 500A	105,620.92	0.7991%
	中金中证 500C	92.62	0.0109%
	合计	105,713.54	0.7514%

9.3 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 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	中金中证 500A	0~10
	中金中证 500C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开 放式基金	中金中证 500A	0
	中金中证 500C	0
	合计	0

9.4 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	71.08	10,000,000.00	71.08	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	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	71.08	10,000,000.00	71.08	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）基金份额总额	10,001,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	10,270,512.84	92.62
本报告期基金总申购份额	4,069,083.49	2,794,049.49
减:本报告期基金总赎回份额	1,121,564.53	1,943,387.11
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	13,218,031.80	850,755.00

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

2017 年 1 月 20 日，公司股东作出决定，任命林寿康先生、黄劲峰先生、陈刚先生、孙菁女士、杜季柳女士、赵璧先生、张春先生、张龙先生、颜羽女士担任公司第二届董事会董事，任期三年；其中，林寿康先生担任董事长，张春先生、张龙先生和颜羽女士担任独立董事。刘健女士自 2017 年 2 月 10 日起不再担任公司董事。杜季柳女士自 2017 年 10 月 10 日起不再担任公司董事，由李永先生接替杜季柳女士担任公司第二届董事会董事职务。

沈芸女士自 2017 年 2 月 10 日任期届满之日起不再担任公司督察长，由公司副总经理杜季柳女士代为履行督察长职务。李虹女士自 2017 年 3 月 24 日起担任公司督察长职务，公司副总经理杜季柳女士不再代为履行督察长职务。李永先生自 2017 年 8 月 4 日起担任公司副总经理。杜季柳女士自 2017 年 9 月 30 日起不再担任公司副总经理。

2017 年 3 月 15 日，公司执行监事夏静女士任期届满连任公司执行监事。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 40,000.00 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到任何稽查或处罚。

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	
中金公司	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	130,352,531.35	31.64%	95,327.88	31.64%	-
兴业证券	2	150,235,004.57	36.47%	109,868.85	36.47%	-
长江证券	2	131,397,044.47	31.89%	95,526.66	31.89%	-

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。

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
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	4,080.03	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	2017 年春节假期期间交易及服务提示	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 1 月 23 日
2	关于新增平安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 2 月 28 日
3	中金中证 500 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
4	关于旗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
5	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
6	关于新增蚂蚁(杭州)基金销售有限公司为销售机构的公	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时	2017 年 3 月 18 日

	告	报》及/或公司网站	
7	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
8	中金中证 500 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
9	中金中证 500 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
10	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2017 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 4 月 21 日
11	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
12	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
13	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
14	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 28 日
15	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
16	关于新增上海基煜基金销售	《中国证券报》、《上	2017 年 7 月 4 日

	有限公司为销售机构的公告	海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	
17	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2017 年第二季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 7 月 21 日
18	关于新增北京肯特瑞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 8 月 3 日
19	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京肯特瑞投资管理费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 8 月 3 日
20	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告及其摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 8 月 29 日
21	中金中证 500 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 2 号)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 9 月 4 日
22	关于新增和讯信息科技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 9 月 8 日
23	关于新增北京蛋卷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 9 月 16 日
24	关于旗下部分基金新增上海天天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 10 月 23 日
25	关于新增上海挖财金融信息	《中国证券报》、《上	2017 年 10 月 25 日

	服务有限公司 为销售机构的公告	海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	
26	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2017 年第三季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 10 月 26 日
27	关于新增通华财富（上海）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 11 月 3 日
28	关于新增洪泰财富（青岛）基金销售有限责任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 12 月 2 日
29	中金基金管理有限公司关于旗下公募基金及特定客户资产管理计划实施增值税政策的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 12 月 31 日	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	71.08

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。

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金中证 500 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、本报告期内在指定媒介上披露的有关本基金的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

13.2 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。

13.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/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和复印件。

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：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2018 年 3 月 30 日