

中金中证 500 指数 增强型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 28 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 2018 年 8 月 27 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 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.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	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.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	72
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.....	72
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.....	72
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.....	72
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	72
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.12 投资组合报告附注.....	73
§8 基金份额持有人信息.....	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	75
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.....	75
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	75
§9 开放式基金份额变动.....	77
§10 重大事件揭示.....	78
10.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
10.4 基金投资策略的改变.....	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
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.....	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
10.8 其他重大事件.....	79
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	81

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	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	82
§12 备查文件目录.....	83
12.1 备查文件目录.....	83
12.2 存放地点.....	83
12.3 查阅方式.....	83

§ 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	23,135,009.11 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	19,560,440.92 份	3,574,568.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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%。</p>
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p>

	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。
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	010-66105798
	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	010-66105799
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
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	中金中证 500A	中金中证 500C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-815,486.22	-140,128.23
本期利润	-2,500,281.97	-339,157.70
加权平均基金份额本期利润	-0.1420	-0.1535
本期加权平均净值利润率	-13.24%	-14.28%
本期基金份额净值增长率	-11.25%	-11.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-558,529.70	-68,586.13
期末可供分配基金份额利润	-0.0286	-0.0192
期末基金资产净值	19,001,911.22	3,505,982.06
期末基金份额净值	0.9714	0.9808
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-2.86%	-9.16%

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
过去一个月	-7.54%	1.69%	-8.86%	1.77%	1.32%	-0.08%

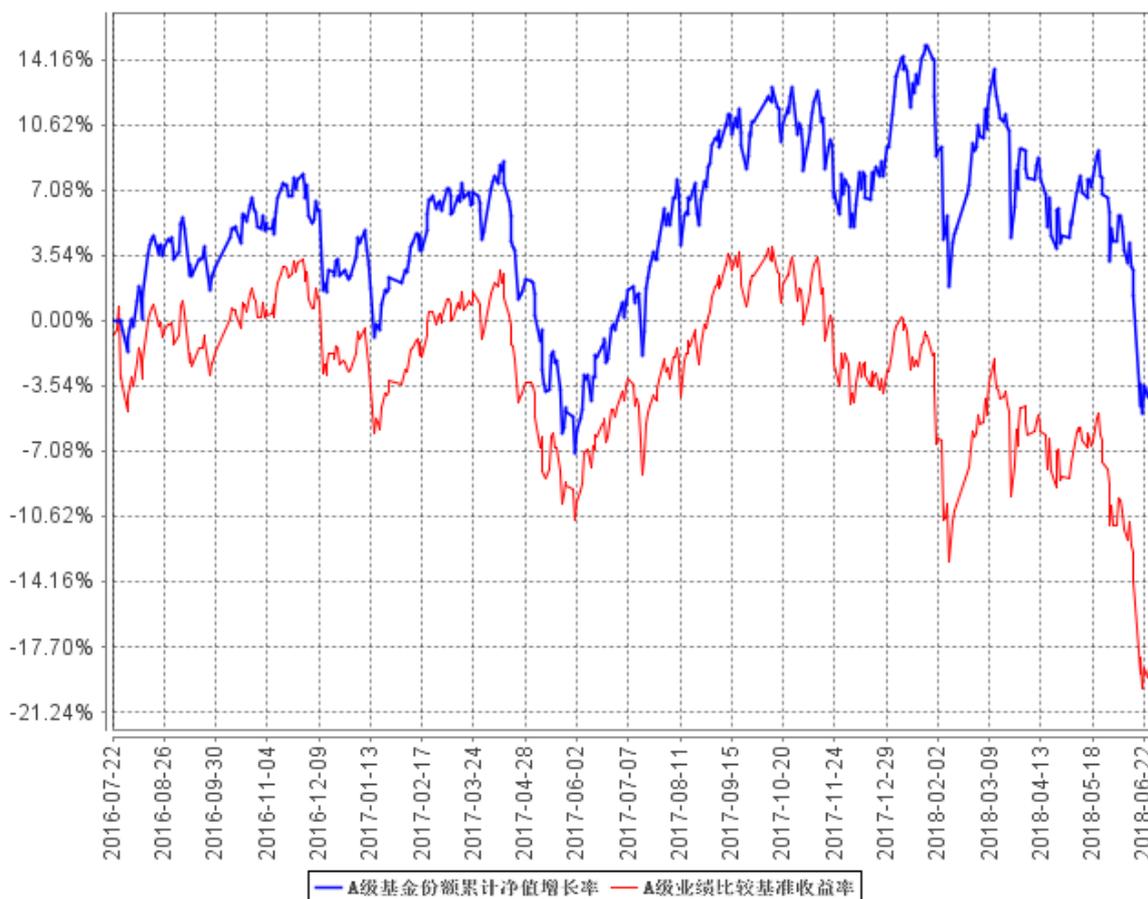
过去三个月	-11.13%	1.26%	-13.96%	1.31%	2.83%	-0.05%
过去六个月	-11.25%	1.34%	-15.71%	1.37%	4.46%	-0.03%
过去一年	-3.14%	1.15%	-14.21%	1.16%	11.07%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-2.86%	1.01%	-18.02%	1.03%	15.16%	-0.02%

中金中证 500C

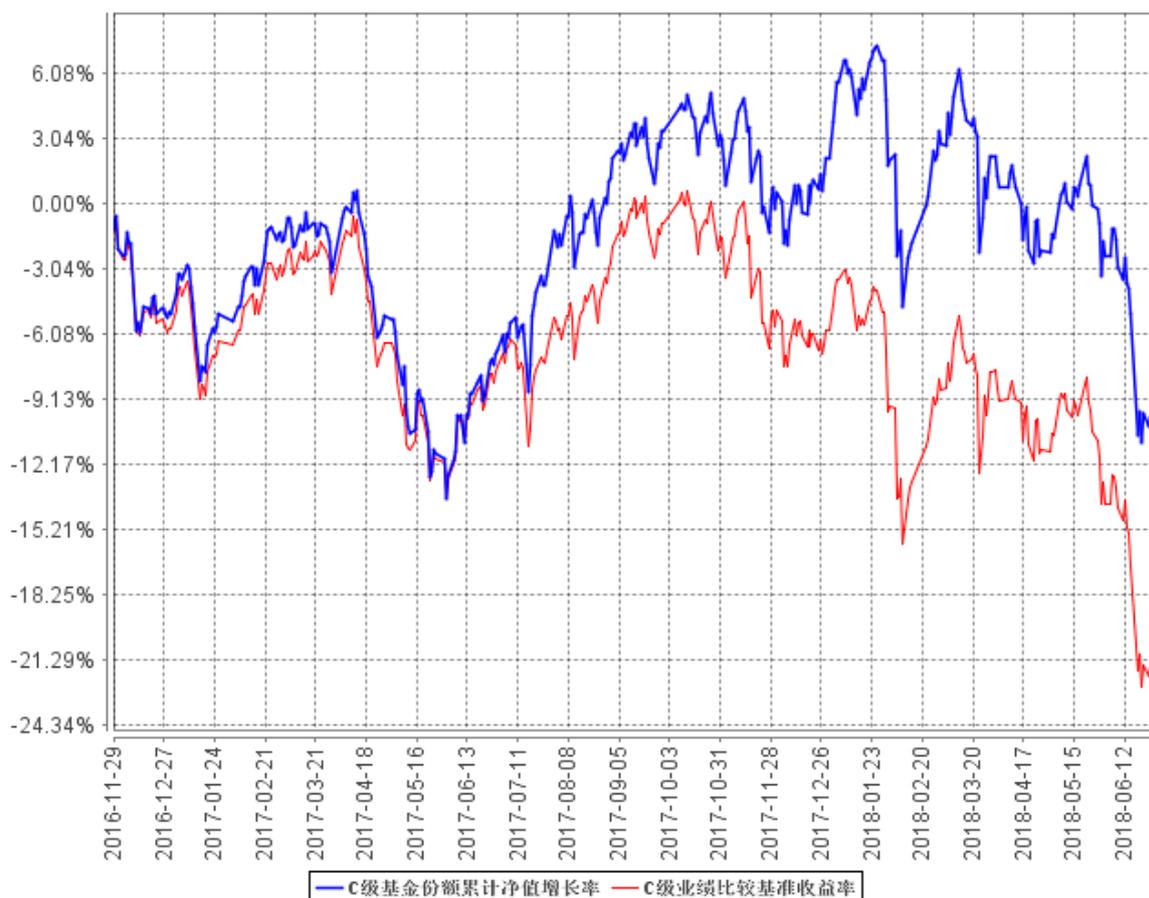
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-7.56%	1.69%	-8.86%	1.77%	1.30%	-0.08%
过去三个月	-11.16%	1.26%	-13.96%	1.31%	2.80%	-0.05%
过去六个月	-11.07%	1.34%	-15.71%	1.37%	4.64%	-0.03%
过去一年	-2.54%	1.15%	-14.21%	1.16%	11.67%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-9.16%	1.07%	-20.70%	1.06%	11.54%	0.01%

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



§ 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 3 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 2018 年 6 月 30 日，公司共管理 14 支开放式基金，证券投资基金管理规模 145.22 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	-	8	魏宇先生，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 股量化策略开发工作。2014 年 11 月，加入中金基金管理有限公司，现任中金基金管理有限公司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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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

在报告期内，本基金采用量化策略进行选股来增强指数，运作正常。作为指数增强型基金，虽然指数趋势向下，但本基金获取了一定的超额收益。量化模型在持续的研发和更新中，力争接下来有更好的表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证 500A 基金份额净值为 0.9714 元，本报告期基金份额净值增长率为 -11.25%；截至本报告期末中金中证 500C 基金份额净值为 0.9808 元，本报告期基金份额净值增长率为 -11.07%；同期业绩比较基准收益率为 -15.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年的宏观经济环境非常复杂。第一，名义 GDP 在高位，一些经济指标显示经济活跃度高。第二，深化供给侧改革，发展巩固新兴产业，独角兽回归引导资金流向支持实体经济。第三，以金融“去杠杆”为目的的各项政策继续推进。第四，中美贸易战逐渐升级，对我国传统产业和新

兴产业的发展都会产生重要的影响。股市受到各种因素的共同作用，呈现出震荡向下的趋势。2018 年上半年，上证 50 指数下跌 13.30%，沪深 300 指数下跌 12.90%，中证 500 指数下跌 16.53%，中证 800 指数下跌 13.85%，中证 1000 指数下跌 20.08%，创业板指下跌 8.33%。展望 2018 年下半年，国内经济发展的韧性相信能够持续，政策层面大方向依然会延续，中美贸易摩擦的变数较大，总体上我们对股市的看法并不乐观，因此在投资时会更加注重风险控制，尽量减小超额收益的波动。

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。本报告期内，中金中证 500 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中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2018 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：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	568,053.92	1,202,994.99
结算备付金		142,239.66	148,488.75
存出保证金		7,138.05	7,207.02
交易性金融资产	6.4.7.2	21,786,354.74	14,361,549.44
其中：股票投资		21,086,284.74	14,351,009.60
基金投资		-	-
债券投资		700,070.00	10,539.84
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		-	25,649.66
应收利息	6.4.7.5	21,393.75	332.57
应收股利		-	-
应收申购款		186,584.57	31,689.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		22,711,764.69	15,777,911.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		48,036.53	47,092.16
应付赎回款		36,479.51	18,799.82
应付管理人报酬		9,157.43	6,414.45
应付托管费		2,747.21	1,924.33
应付销售服务费		6,430.91	1,745.59
应付交易费用	6.4.7.7	56,134.43	225,720.90

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	44,885.39	70,584.71
负债合计		203,871.41	372,281.96
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	23,135,009.11	14,068,786.80
未分配利润	6.4.7.10	-627,115.83	1,336,843.18
所有者权益合计		22,507,893.28	15,405,629.98
负债和所有者权益总计		22,711,764.69	15,777,911.94

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，中金中证 500A 基金份额净值 0.9714 元，基金份额总额 19,560,440.92 份；中金中证 500C 基金份额净值 0.9808 元，基金份额总额 3,574,568.19 份。中金中证 500 份额总额合计为 23,135,009.11 份。

6.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-2,508,516.50	132,577.03
1.利息收入		9,080.66	4,063.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,885.80	4,063.69
债券利息收入		3,194.86	-
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）		-650,177.48	-189,786.30
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-855,058.11	-234,585.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,178.49	-
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	203,702.14	44,799.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,883,825.22	317,788.02
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	16,405.54	511.62
减:二、费用		330,923.17	353,493.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	52,666.76	26,217.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,800.05	7,865.22
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,685.32	94.39
4. 交易费用	6.4.7.18	222,439.18	279,152.90
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	35,331.86	40,163.44
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,839,439.67	-220,916.21
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2,839,439.67	-220,916.21

6.3 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: 2018年1月1日至2018年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	14,068,786.80	1,336,843.18	15,405,629.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,839,439.67	-2,839,439.67
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)	9,066,222.31	875,480.66	9,941,702.97
其中: 1.基金申购款	13,396,255.01	1,305,547.55	14,701,802.56
2.基金赎回款	-4,330,032.70	-430,066.89	-4,760,099.59
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)	23,135,009.11	-627,115.83	22,507,893.28
项目	上年度可比期间 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)	10,270,605.46	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)	-	-220,916.21	-220,916.21
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)	359,611.87	-2,546.99	357,064.88
其中：1.基金申购款	557,617.10	-5,781.63	551,835.47
2.基金赎回款	-198,005.23	3,234.64	-194,770.59
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)	10,630,217.33	31,853.11	10,662,070.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 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，于 2016 年 7 月 18 日募集。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。

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）。

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。

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 2018 年 6 月 30 日的财务状况、自 2018 年 1 月 1 日至 2018 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。本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日。

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：

(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。

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。

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 / (未弥补亏损)”。

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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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。

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 [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。

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

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	568,053.92
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	568,053.92

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,051,671.16	21,086,284.74	-1,965,386.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	701,260.00	700,070.00
	银行间市场	-	-
	合计	701,260.00	700,070.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	23,752,931.16	21,786,354.74	-1,966,576.42

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	124.03
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	64.00
应收债券利息	21,202.52
应收资产支持证券利息	-
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	3.20
合计	21,393.75

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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	56,134.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	56,134.43

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8.53
预提费用	43,191.54
指数使用费	1,685.32
合计	44,885.39

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 500A		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,218,031.80	13,218,031.80
本期申购	7,973,241.43	7,973,241.43
本期赎回(以“-”号填列)	-1,630,832.31	-1,630,832.31
- 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	19,560,440.92	19,560,440.92

金额单位：人民币元

中金中证 500C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	850,755.00	850,755.00
本期申购	5,423,013.58	5,423,013.58
本期赎回(以“-”号填列)	-2,699,200.39	-2,699,200.39
- 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	3,574,568.19	3,574,568.19

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	1,315,347.40	-66,033.85	1,249,313.55
本期利润	-815,486.22	-1,684,795.75	-2,500,281.97
本期基金份额交易产生的变动数	785,190.39	-92,751.67	692,438.72
其中：基金申购款	968,881.74	-112,594.54	856,287.20
基金赎回款	-183,691.35	19,842.87	-163,848.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,285,051.57	-1,843,581.27	-558,529.70

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	91,766.53	-4,236.90	87,529.63
本期利润	-140,128.23	-199,029.47	-339,157.70
本期基金份额交易产生的变动数	319,655.17	-136,613.23	183,041.94
其中：基金申购款	651,162.66	-201,902.31	449,260.35
基金赎回款	-331,507.49	65,289.08	-266,218.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	271,293.47	-339,879.60	-68,586.13

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	4,550.51
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	1,269.66
其他	65.63
合计	5,885.80

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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	81,309,443.95
减：卖出股票成本总额	82,164,502.06
买卖股票差价收入	-855,058.11

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

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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	1,178.49
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	1,178.49

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	14,082.63

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	12,897.70
减：应收利息总额	6.44
买卖债券差价收入	1,178.49

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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	203,702.14
基金投资产生的股利收益	-
合计	203,702.14

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,883,825.22
——股票投资	-1,881,895.38
——债券投资	-1,929.84

——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预 估增值税	-
合计	-1,883,825.22

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	15,991.74
基金转换费收入-003016	413.80
基金转换费收入-003578	-
合计	16,405.54

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	222,439.18
银行间市场交易费用	-
合计	222,439.18

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	18,315.15
信息披露费	14,876.39
指数使用费	1,685.32
汇划手续费	455.00
其他	-

合计	35,331.86
----	-----------

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

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	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	52,666.76	26,217.29
其中：支付销售机构的客户维护费	4,674.76	50.70

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、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，本基金本报告期支付销售服务机构的客户维护费为4,674.76元，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	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	15,800.05	7,865.22

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。

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 2018年1月1日至2018年6月30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	-	98.55	98.55
合计	-	98.55	98.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	32.62	32.62
合计	-	32.62	32.62

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。

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

本基金本报告期末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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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	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	51.1236%	-

项目	上年度可比期间
----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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	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	96.1072%	-

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。

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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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	568,053.92	4,550.51	794,199.10	2,689.75

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 2018 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 149,377.71 元, 本期产生的利息收入为人民币 1,335.29 元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

无

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（2018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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

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
002051	中工国际	2018年4月5日	重大事项停牌	15.27	-	-	11,968	202,254.19	182,751.36	-
000669	金鸿能源	2018年5月18日	重大事项停牌	7.25	2018年8月6日	6.53	24,360	190,334.34	176,610.00	-
300266	兴源环境	2018年2月5日	重大事项停牌	19.99	2018年7月2日	17.99	7,100	175,416.68	141,929.00	-
600022	山东钢铁	2018年3月27日	重大事项停牌	2.02	2018年8月16日	1.83	62,500	136,884.27	126,250.00	-
002426	胜利精密	2018年6月19日	重大事项停牌	3.60	2018年7月3日	3.26	24,800	97,436.00	89,280.00	-
600750	江中药业	2018年4月30日	重大事项停牌	17.75	2018年8月1日	16.12	4,319	79,838.69	76,662.25	-
002699	美盛文化	2018年2月5日	重大事项停牌	18.76	2018年7月2日	16.88	3,700	66,160.00	69,412.00	-
600751	天海投资	2018年1月16日	重大事项停牌	6.49	-	-	9,900	63,087.00	64,251.00	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大事项停牌	9.49	-	-	4,915	51,051.75	46,643.35	-

000825	太钢不锈	2018年4月16日	重大事项停牌	6.00	-	-	7,629	42,555.01	45,774.00	-
002359	北讯集团	2018年5月21日	重大事项停牌	19.58	2018年8月21日	17.62	1,800	47,601.89	35,244.00	-
600811	东方集团	2018年5月30日	重大事项停牌	4.30	-	-	6,600	29,215.44	28,380.00	-
600759	洲际油气	2018年3月27日	重大事项停牌	3.94	-	-	4,900	17,985.50	19,306.00	-
002437	誉衡药业	2018年6月11日	重大事项停牌	6.20	2018年8月13日	5.57	2,400	15,834.00	14,880.00	-
002011	盾安环境	2018年5月2日	重大事项停牌	6.40	-	-	2,300	15,880.32	14,720.00	-
002512	达华智能	2018年6月19日	重大事项停牌	9.70	-	-	1,500	15,956.76	14,550.00	-
300146	汤臣倍健	2018年1月31日	重大事项停牌	16.60	2018年7月31日	16.50	600	9,994.00	9,960.00	-
600221	海航控股	2018年1月11日	重大事项停牌	3.23	2018年7月20日	2.91	3,000	9,720.00	9,690.00	-
600678	四川金顶	2018年4月18日	重大事项停牌	10.24	-	-	800	8,224.40	8,192.00	-
600850	华东电脑	2018年5月15日	重大事项停牌	18.99	2018年8月15日	18.00	400	7,924.00	7,596.00	-
300603	立昂技术	2018年5月2日	重大事项停牌	35.73	2018年8月24日	32.07	200	5,710.00	7,146.00	-
600687	刚泰控股	2018年6月11日	重大事项停牌	9.09	2018年8月20日	8.18	700	6,895.97	6,363.00	-
600641	万业企业	2018年4月17日	重大事项停牌	12.18	2018年8月9日	10.96	500	6,375.00	6,090.00	-

					日						
600796	钱江生化	2018年5月3日	重大事项停牌	6.08	-	-	900	5,565.00	5,472.00	-	
300118	东方日升	2018年5月7日	重大事项停牌	10.80	2018年8月7日	9.63	500	5,347.00	5,400.00	-	
002431	棕榈股份	2018年5月30日	重大事项停牌	6.71	-	-	800	5,996.00	5,368.00	-	
000415	渤海金控	2018年1月17日	重大事项停牌	5.84	2018年7月17日	5.26	900	5,238.00	5,256.00	-	
002573	清新环境	2018年6月19日	重大事项停牌	11.55	-	-	444	6,538.18	5,128.20	-	
300108	吉药控股	2018年6月12日	重大事项停牌	7.84	-	-	500	4,151.43	3,920.00	-	
002408	齐翔腾达	2018年6月19日	重大事项停牌	12.28	-	-	300	4,139.23	3,684.00	-	
002665	首航节能	2018年5月29日	重大事项停牌	5.80	-	-	600	3,964.21	3,480.00	-	
600768	宁波富邦	2018年6月14日	重大事项停牌	11.04	-	-	300	3,353.00	3,312.00	-	
601727	上海电气	2018年6月7日	重大事项停牌	6.34	2018年8月7日	5.71	400	2,309.38	2,536.00	-	
002171	楚江新材	2018年6月7日	重大事项停牌	6.78	-	-	300	2,031.31	2,034.00	-	
300343	联创互联	2018年6月19日	重大事项停牌	10.00	-	-	200	2,016.00	2,000.00	-	
002477	雏鹰农牧	2018年6月14日	重大事项停牌	3.31	-	-	500	1,778.83	1,655.00	-	
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大事项停牌	5.37	-	-	300	2,000.99	1,611.00	-	
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项停牌	7.47	2018年8月20日	7.25	100	744.00	747.00	-	
300131	英唐智控	2018年5月29日	重大事项停牌	5.67	-	-	100	580.00	567.00	-	
600724	宁波富达	2018年5月3日	重大事项停牌	3.29	2018年8	3.05	100	328.00	329.00	-	

					月 24 日					
002102	冠福 股份	2018 年 6 月 1 日	重大事项停牌	3.72	-	-	1,800	7,703.32	6,696.00	-

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.4 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	10,539.84
未评级	-	-
合计	-	10,539.84

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 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。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，二是来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的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。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。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%。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。本基金所持有的大部分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。

6.4.13.4 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 2018 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	568,053.92	-	-	-	568,053.92
结算备付金	142,239.66	-	-	-	142,239.66
存出保证金	7,138.05	-	-	-	7,138.05
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-21,086,284.74	21,086,284.74
交易性金融资产-债券投资	700,070.00	-	-	-	700,070.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	21,393.75	21,393.75
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	186,584.57	186,584.57
资产总计	1,417,501.63	-	-	-21,294,263.06	22,711,764.69
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	48,036.53	48,036.53
应付赎回款	-	-	-	36,479.51	36,479.51
应付管理人报酬	-	-	-	9,157.43	9,157.43
应付托管费	-	-	-	2,747.21	2,747.21
应付交易费用	-	-	-	56,134.43	56,134.43
应付销售服务费	-	-	-	6,430.91	6,430.91
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	44,885.39	44,885.39
负债总计	-	-	-	203,871.41	203,871.41
利率敏感度缺口	1,417,501.63	-	-	-21,090,391.65	22,507,893.28
上年度末 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

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

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风
----	--

	险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降25个基点	167.32	-
	市场利率上升25个基点	-167.32	-

注：上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%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

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 2018年6月30日		上年度末 2017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	21,086,284.74	93.68	14,351,009.60	93.15
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	700,070.00	3.11	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	21,786,354.74	96.79	14,361,549.44	93.22

6.4.13.4.3.2 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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	1,098,506.43	776,968.89
	业绩比较基准下降 5%	-1,098,506.43	-776,968.89

注：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%

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	21,086,284.74	92.84
	其中：股票	21,086,284.74	92.84
2	固定收益投资	700,070.00	3.08
	其中：债券	700,070.00	3.08
	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	710,293.58	3.13
7	其他各项资产	215,116.37	0.95
8	合计	22,711,764.69	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	102,760.00	0.46
B	采矿业	1,000,718.14	4.45
C	制造业	10,730,508.95	47.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	529,417.05	2.35
E	建筑业	367,162.92	1.63
F	批发和零售业	1,631,327.65	7.25
G	交通运输、仓储和邮政业	543,655.15	2.42
H	住宿和餐饮业	7,392.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,412,256.89	6.27
J	金融业	205,337.92	0.91
K	房地产业	1,283,955.52	5.70
L	租赁和商务服务业	216,821.50	0.96

M	科学研究和技术服务业	7,704.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	247,720.20	1.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,802.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	637,585.02	2.83
S	综合	86,168.00	0.38
	合计	19,014,292.91	84.48

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	24,924.00	0.11
B	采矿业	38,559.00	0.17
C	制造业	1,082,493.34	4.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	252,025.00	1.12
E	建筑业	50,652.40	0.23
F	批发和零售业	143,991.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	74,640.00	0.33
H	住宿和餐饮业	3,656.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	101,166.01	0.45
J	金融业	69,724.00	0.31
K	房地产业	146,545.00	0.65
L	租赁和商务服务业	14,842.08	0.07
M	科学研究和技术服务业	10,333.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	14,402.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,420.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	38,619.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	2,071,991.83	9.21

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	601168	西部矿业	53,100	333,468.00	1.48
2	300039	上海凯宝	55,246	320,426.80	1.42
3	002603	以岭药业	22,900	320,142.00	1.42
4	600557	康缘药业	25,515	315,110.25	1.40
5	603188	亚邦股份	29,800	303,960.00	1.35
6	000718	苏宁环球	81,600	299,472.00	1.33
7	601717	郑煤机	49,386	286,932.66	1.27
8	600611	大众交通	58,600	233,228.00	1.04
9	600422	昆药集团	30,000	232,500.00	1.03
10	002317	众生药业	21,700	229,369.00	1.02
11	600978	宜华生活	33,571	229,289.93	1.02
12	000848	承德露露	20,600	218,154.00	0.97
13	600655	豫园股份	22,400	211,680.00	0.94
14	600216	浙江医药	16,200	206,874.00	0.92
15	002233	塔牌集团	17,100	195,624.00	0.87
16	000528	柳工	18,106	193,915.26	0.86
17	000581	威孚高科	8,592	189,969.12	0.84
18	600757	长江传媒	32,676	185,926.44	0.83
19	002051	中工国际	11,968	182,751.36	0.81
20	600694	大商股份	5,600	182,056.00	0.81
21	600729	重庆百货	5,400	177,930.00	0.79
22	600500	中化国际	26,000	177,320.00	0.79
23	600064	南京高科	23,060	169,260.40	0.75
24	603444	吉比特	1,300	166,127.00	0.74
25	600572	康恩贝	23,014	165,010.38	0.73
26	000031	中粮地产	27,100	156,638.00	0.70
27	002463	沪电股份	41,100	153,714.00	0.68
28	000887	中鼎股份	10,500	151,305.00	0.67
29	601016	节能风电	52,300	150,101.00	0.67
30	600073	上海梅林	22,400	148,736.00	0.66
31	601311	骆驼股份	12,760	146,357.20	0.65
32	600648	外高桥	8,000	146,240.00	0.65
33	601678	滨化股份	23,265	143,777.70	0.64

34	300266	兴源环境	7,100	141,929.00	0.63
35	600597	光明乳业	13,800	136,206.00	0.61
36	600017	日照港	42,000	134,820.00	0.60
37	000598	兴蓉环境	32,046	130,106.76	0.58
38	000999	华润三九	4,600	128,018.00	0.57
39	600022	山东钢铁	62,500	126,250.00	0.56
40	600167	联美控股	12,600	126,000.00	0.56
41	000778	新兴铸管	28,885	123,627.80	0.55
42	002280	联络互动	21,600	123,552.00	0.55
43	600664	哈药股份	30,800	122,276.00	0.54
44	601928	凤凰传媒	19,400	117,952.00	0.52
45	000501	鄂武商A	9,500	116,755.00	0.52
46	600256	广汇能源	28,450	116,360.50	0.52
47	600649	城投控股	19,000	116,280.00	0.52
48	601001	大同煤业	23,327	115,701.92	0.51
49	002152	广电运通	18,900	111,132.00	0.49
50	000997	新大陆	7,000	110,250.00	0.49
51	603198	迎驾贡酒	6,000	110,220.00	0.49
52	601801	皖新传媒	14,400	109,584.00	0.49
53	002002	鸿达兴业	22,600	104,186.00	0.46
54	300026	红日药业	27,800	101,470.00	0.45
55	600201	生物股份	5,800	99,122.00	0.44
56	600056	中国医药	5,400	98,658.00	0.44
57	000552	靖远煤电	29,900	97,773.00	0.43
58	000547	航天发展	12,400	96,844.00	0.43
59	000758	中色股份	21,100	94,950.00	0.42
60	600639	浦东金桥	7,600	94,848.00	0.42
61	601689	拓普集团	4,800	93,312.00	0.41
62	000488	晨鸣纸业	7,209	93,140.28	0.41
63	000049	德赛电池	3,300	93,126.00	0.41
64	000926	福星股份	12,800	92,032.00	0.41
65	000661	长春高新	400	91,080.00	0.40
66	000006	深振业A	15,500	90,830.00	0.40
67	600618	氯碱化工	10,600	90,206.00	0.40
68	002426	胜利精密	24,800	89,280.00	0.40
69	002004	华邦健康	17,500	88,900.00	0.39
70	600062	华润双鹤	3,600	88,380.00	0.39
71	002056	横店东磁	12,336	86,475.36	0.38
72	600143	金发科技	16,500	86,130.00	0.38

73	600126	杭钢股份	14,236	84,988.92	0.38
74	300297	蓝盾股份	10,400	84,344.00	0.37
75	603025	大豪科技	4,284	82,852.56	0.37
76	601811	新华文轩	8,400	81,648.00	0.36
77	002221	东华能源	8,153	79,654.81	0.35
78	002373	千方科技	5,900	76,995.00	0.34
79	600750	江中药业	4,319	76,662.25	0.34
80	600160	巨化股份	10,398	76,113.36	0.34
81	600260	凯乐科技	2,800	75,152.00	0.33
82	002078	太阳纸业	7,535	73,014.15	0.32
83	002440	闰土股份	6,200	72,478.00	0.32
84	002110	三钢闽光	4,500	72,135.00	0.32
85	002332	仙琚制药	8,143	71,251.25	0.32
86	600755	厦门国贸	9,579	69,830.91	0.31
87	002128	露天煤业	7,700	69,762.00	0.31
88	002699	美盛文化	3,700	69,412.00	0.31
89	600426	华鲁恒升	3,900	68,601.00	0.30
90	002174	游族网络	3,400	67,660.00	0.30
91	000830	鲁西化工	3,950	67,466.00	0.30
92	600006	东风汽车	16,400	67,076.00	0.30
93	002589	瑞康医药	4,799	65,458.36	0.29
94	600079	人福医药	4,927	65,134.94	0.29
95	600751	天海投资	9,900	64,251.00	0.29
96	002191	劲嘉股份	8,600	64,242.00	0.29
97	600282	南钢股份	14,508	64,125.36	0.28
98	002815	崇达技术	3,900	62,790.00	0.28
99	002277	友阿股份	13,600	62,696.00	0.28
100	600511	国药股份	2,318	62,470.10	0.28
101	600808	马钢股份	17,376	62,379.84	0.28
102	601128	常熟银行	10,891	62,296.52	0.28
103	300182	捷成股份	8,201	62,163.58	0.28
104	600737	中粮糖业	8,156	61,496.24	0.27
105	000541	佛山照明	10,050	60,199.50	0.27
106	002064	华峰氨纶	14,310	59,100.30	0.26
107	300287	飞利信	8,216	59,073.04	0.26
108	601000	唐山港	25,000	58,750.00	0.26
109	300088	长信科技	10,100	58,580.00	0.26
110	002640	跨境通	3,900	58,578.00	0.26
111	000975	银泰资源	5,740	58,203.60	0.26

112	002344	海宁皮城	11,700	56,862.00	0.25
113	002416	爱施德	9,599	56,346.13	0.25
114	601200	上海环境	3,500	55,405.00	0.25
115	000553	沙隆达A	3,500	55,335.00	0.25
116	000028	国药一致	1,100	54,890.00	0.24
117	600939	重庆建工	11,100	54,834.00	0.24
118	600580	卧龙电气	7,088	54,010.56	0.24
119	000980	金马股份	7,500	53,325.00	0.24
120	600863	内蒙华电	23,327	52,952.29	0.24
121	002354	天神娱乐	5,700	52,782.00	0.23
122	601179	中国西电	14,900	50,958.00	0.23
123	300002	神州泰岳	12,200	50,874.00	0.23
124	000012	南玻A	10,202	50,499.90	0.22
125	603019	中科曙光	1,100	50,457.00	0.22
126	002410	广联达	1,800	49,914.00	0.22
127	600748	上实发展	9,840	49,593.60	0.22
128	002407	多氟多	3,500	49,070.00	0.22
129	600908	无锡银行	8,200	48,298.00	0.21
130	000977	浪潮信息	2,000	47,700.00	0.21
131	300324	旋极信息	4,915	46,643.35	0.21
132	002261	拓维信息	10,100	46,460.00	0.21
133	600458	时代新材	6,300	46,368.00	0.21
134	600499	科达洁能	6,700	45,962.00	0.20
135	000825	太钢不锈	7,629	45,774.00	0.20
136	600195	中牧股份	2,300	44,735.00	0.20
137	600643	爱建集团	4,736	44,518.40	0.20
138	600839	四川长虹	15,500	44,330.00	0.20
139	600881	亚泰集团	11,650	43,454.50	0.19
140	600325	华发股份	5,500	42,515.00	0.19
141	000078	海王生物	8,728	41,981.68	0.19
142	002176	江特电机	4,300	41,796.00	0.19
143	000009	中国宝安	8,500	41,650.00	0.19
144	002022	科华生物	3,500	41,475.00	0.18
145	002701	奥瑞金	7,400	40,404.00	0.18
146	002491	通鼎互联	3,600	39,852.00	0.18
147	002505	大康农业	18,600	39,804.00	0.18
148	600545	卓郎智能	5,010	39,779.40	0.18
149	002400	省广股份	12,200	39,406.00	0.18
150	300315	掌趣科技	9,400	39,292.00	0.17

151	002375	亚厦股份	7,200	38,448.00	0.17
152	600859	王府井	1,800	38,286.00	0.17
153	600060	海信电器	2,811	37,639.29	0.17
154	600872	中炬高新	1,338	37,464.00	0.17
155	300253	卫宁健康	3,000	37,170.00	0.17
156	600885	宏发股份	1,240	37,100.80	0.16
157	002019	亿帆医药	2,087	36,835.55	0.16
158	000703	恒逸石化	2,440	36,307.20	0.16
159	600993	马应龙	2,100	35,721.00	0.16
160	000766	通化金马	3,000	35,640.00	0.16
161	000066	长城电脑	5,000	35,550.00	0.16
162	000596	古井贡酒	400	35,512.00	0.16
163	002359	北讯集团	1,800	35,244.00	0.16
164	603328	依顿电子	3,241	35,164.85	0.16
165	002583	海能达	4,200	35,070.00	0.16
166	002268	卫士通	1,600	34,928.00	0.16
167	600277	亿利洁能	6,640	34,793.60	0.15
168	002709	天赐材料	900	34,686.00	0.15
169	000860	顺鑫农业	900	33,750.00	0.15
170	300055	万邦达	2,900	33,321.00	0.15
171	600936	广西广电	7,000	33,320.00	0.15
172	002183	怡亚通	5,000	33,250.00	0.15
173	002180	艾派克	1,200	32,952.00	0.15
174	601127	小康股份	1,900	32,851.00	0.15
175	600395	盘江股份	5,300	32,171.00	0.14
176	000813	德展健康	3,800	31,312.00	0.14
177	600169	太原重工	13,300	31,122.00	0.14
178	000685	中山公用	3,900	31,083.00	0.14
179	600970	中材国际	4,653	31,082.04	0.14
180	600565	迪马股份	10,478	30,910.10	0.14
181	600582	天地科技	8,384	30,769.28	0.14
182	002707	众信旅游	3,200	30,720.00	0.14
183	002195	二三四五	7,156	30,627.68	0.14
184	600300	维维股份	9,300	30,318.00	0.13
185	600717	天津港	4,000	30,120.00	0.13
186	300308	中际装备	500	30,020.00	0.13
187	600108	亚盛集团	10,300	29,767.00	0.13
188	600528	中铁工业	2,900	29,638.00	0.13
189	600895	张江高科	2,500	28,750.00	0.13

190	600718	东软集团	2,200	28,732.00	0.13
191	600811	东方集团	6,600	28,380.00	0.13
192	600380	健康元	2,383	28,262.38	0.13
193	600875	东方电气	3,800	28,158.00	0.13
194	000418	小天鹅A	400	27,740.00	0.12
195	002439	启明星辰	1,300	27,586.00	0.12
196	300159	新研股份	3,800	26,904.00	0.12
197	600094	大名城	4,612	26,565.12	0.12
198	300166	东方国信	1,800	26,514.00	0.12
199	300113	顺网科技	1,500	26,115.00	0.12
200	002916	深南电路	400	25,404.00	0.11
201	600410	华胜天成	2,900	25,375.00	0.11
202	603568	伟明环保	1,000	25,300.00	0.11
203	603589	口子窖	409	25,133.05	0.11
204	001696	宗申动力	5,100	24,990.00	0.11
205	002244	滨江集团	4,800	24,960.00	0.11
206	600329	中新药业	1,300	24,700.00	0.11
207	600594	益佰制药	2,700	24,192.00	0.11
208	000513	丽珠集团	550	24,172.50	0.11
209	600869	智慧能源	5,100	24,072.00	0.11
210	002073	软控股份	4,000	23,000.00	0.10
211	603369	今世缘	1,000	22,830.00	0.10
212	600317	营口港	10,000	22,600.00	0.10
213	601777	力帆股份	4,100	21,443.00	0.10
214	600563	法拉电子	430	21,280.70	0.09
215	600614	鹏起科技	3,700	21,127.00	0.09
216	600743	华远地产	8,190	21,048.30	0.09
217	600801	华新水泥	1,400	21,042.00	0.09
218	002093	国脉科技	2,700	20,817.00	0.09
219	300010	立思辰	1,700	20,808.00	0.09
220	601020	华钰矿业	1,500	20,685.00	0.09
221	600292	远达环保	3,400	19,958.00	0.09
222	002251	步步高	1,700	19,346.00	0.09
223	600759	洲际油气	4,900	19,306.00	0.09
224	600348	阳泉煤业	2,700	19,305.00	0.09
225	002503	搜于特	5,500	19,250.00	0.09
226	601966	玲珑轮胎	1,200	18,924.00	0.08
227	600521	华海药业	700	18,683.00	0.08
228	603766	隆鑫通用	3,400	18,462.00	0.08

229	600598	北大荒	2,000	18,320.00	0.08
230	603355	莱克电气	600	18,030.00	0.08
231	000062	深圳华强	900	17,640.00	0.08
232	002368	太极股份	600	17,442.00	0.08
233	000519	江南红箭	2,200	17,094.00	0.08
234	002308	威创股份	2,018	16,749.40	0.07
235	002600	江粉磁材	3,200	16,608.00	0.07
236	600183	生益科技	1,790	16,396.40	0.07
237	600765	中航重机	2,200	16,368.00	0.07
238	000878	云南铜业	1,700	16,218.00	0.07
239	600179	安通控股	1,600	16,208.00	0.07
240	600125	铁龙物流	1,900	15,903.00	0.07
241	600525	长园集团	1,500	15,855.00	0.07
242	002818	富森美	600	15,828.00	0.07
243	600777	新潮能源	7,200	15,768.00	0.07
244	002807	江阴银行	2,800	15,736.00	0.07
245	002038	双鹭药业	400	15,196.00	0.07
246	600536	中国软件	700	15,141.00	0.07
247	600161	天坛生物	780	15,093.00	0.07
248	002437	誉衡药业	2,400	14,880.00	0.07
249	002011	盾安环境	2,300	14,720.00	0.07
250	603816	顾家家居	200	14,702.00	0.07
251	600240	华业资本	2,000	14,660.00	0.07
252	002512	达华智能	1,500	14,550.00	0.06
253	600827	百联股份	1,400	14,280.00	0.06
254	002345	潮宏基	1,600	13,760.00	0.06
255	000563	陕国投A	4,000	13,600.00	0.06
256	002092	中泰化学	1,400	13,496.00	0.06
257	002479	富春环保	2,300	12,995.00	0.06
258	600657	信达地产	2,976	12,648.00	0.06
259	600184	光电股份	1,000	12,390.00	0.06
260	600350	山东高速	3,000	12,150.00	0.05
261	000750	国海证券	3,400	12,138.00	0.05
262	600773	西藏城投	1,700	11,764.00	0.05
263	000937	冀中能源	2,848	11,705.28	0.05
264	002223	鱼跃医疗	600	11,694.00	0.05
265	300273	和佳股份	1,700	11,526.00	0.05
266	600575	皖江物流	3,100	11,501.00	0.05
267	300058	蓝色光标	2,000	11,400.00	0.05

268	600823	世茂股份	2,700	11,286.00	0.05
269	600640	号百控股	1,100	11,187.00	0.05
270	002657	中科金财	700	11,088.00	0.05
271	000400	许继电气	1,400	10,934.00	0.05
272	002249	大洋电机	2,500	10,775.00	0.05
273	002841	视源股份	200	10,682.00	0.05
274	002242	九阳股份	600	10,614.00	0.05
275	600120	浙江东方	780	10,569.00	0.05
276	002635	安洁科技	600	10,320.00	0.05
277	002118	紫鑫药业	1,400	10,010.00	0.04
278	300146	汤臣倍健	600	9,960.00	0.04
279	002048	宁波华翔	800	9,864.00	0.04
280	002588	史丹利	1,900	9,842.00	0.04
281	000543	皖能电力	2,200	9,702.00	0.04
282	002340	格林美	1,600	9,680.00	0.04
283	002041	登海种业	1,400	9,548.00	0.04
284	600039	四川路桥	2,900	9,512.00	0.04
285	300418	昆仑万维	500	9,440.00	0.04
286	002642	荣之联	1,000	9,190.00	0.04
287	002517	恺英网络	1,270	9,131.30	0.04
288	603806	福斯特	400	8,804.00	0.04
289	300043	星辉娱乐	2,200	8,800.00	0.04
290	002482	广田集团	1,416	8,453.52	0.04
291	300274	阳光电源	936	8,395.92	0.04
292	603658	安图生物	100	8,246.00	0.04
293	600623	华谊集团	800	7,984.00	0.04
294	600315	上海家化	200	7,926.00	0.04
295	600037	歌华有线	761	7,853.52	0.03
296	600835	上海机电	413	7,789.18	0.03
297	600645	中源协和	400	7,704.00	0.03
298	600754	锦江股份	200	7,392.00	0.03
299	600312	平高电气	1,310	7,388.40	0.03
300	600267	海正药业	500	7,270.00	0.03
301	600466	蓝光发展	1,160	7,192.00	0.03
302	600971	恒源煤电	1,006	7,182.84	0.03
303	603569	长久物流	500	7,140.00	0.03
304	002127	南极电商	750	7,042.50	0.03
305	600642	申能股份	1,400	7,028.00	0.03
306	603225	新凤鸣	351	7,009.47	0.03

307	000021	深科技	1,000	6,820.00	0.03
308	002030	达安基因	440	6,784.80	0.03
309	600058	五矿发展	800	6,648.00	0.03
310	002399	海普瑞	300	6,642.00	0.03
311	603556	海兴电力	360	6,541.20	0.03
312	000761	本钢板材	1,600	6,464.00	0.03
313	600687	刚泰控股	700	6,363.00	0.03
314	601098	中南传媒	500	6,320.00	0.03
315	300202	聚龙股份	600	6,258.00	0.03
316	601233	桐昆股份	357	6,147.54	0.03
317	000829	天音控股	800	5,864.00	0.03
318	002444	巨星科技	520	5,725.20	0.03
319	300199	翰宇药业	400	5,712.00	0.03
320	002431	棕榈股份	800	5,368.00	0.02
321	600053	九鼎投资	300	5,151.00	0.02
322	002573	清新环境	444	5,128.20	0.02
323	002390	信邦制药	700	5,124.00	0.02
324	600155	宝硕股份	700	5,033.00	0.02
325	601608	中信重工	1,800	4,680.00	0.02
326	000970	中科三环	500	4,675.00	0.02
327	000156	华数传媒	475	4,579.00	0.02
328	002424	贵州百灵	400	4,544.00	0.02
329	600166	福田汽车	2,200	4,466.00	0.02
330	600428	中远海特	1,253	4,448.15	0.02
331	002250	联化科技	500	4,410.00	0.02
332	300376	易事特	800	4,296.00	0.02
333	000039	中集集团	313	4,156.64	0.02
334	600338	西藏珠峰	200	4,144.00	0.02
335	600138	中青旅	200	3,986.00	0.02
336	002672	东江环保	300	3,927.00	0.02
337	600004	白云机场	300	3,927.00	0.02
338	600967	内蒙一机	300	3,822.00	0.02
339	300244	迪安诊断	200	3,802.00	0.02
340	600335	国机汽车	362	3,775.66	0.02
341	002408	齐翔腾达	300	3,684.00	0.02
342	002665	首航节能	600	3,480.00	0.02
343	600917	重庆燃气	500	3,405.00	0.02
344	002465	海格通信	400	3,212.00	0.01
345	000667	美好置业	1,500	3,195.00	0.01

346	600578	京能电力	1,000	3,120.00	0.01
347	002299	圣农发展	200	3,098.00	0.01
348	600862	中航高科	500	3,075.00	0.01
349	600366	宁波韵升	500	3,050.00	0.01
350	002920	德赛西威	100	2,990.00	0.01
351	600996	贵广网络	400	2,968.00	0.01
352	000988	华工科技	200	2,890.00	0.01
353	002366	台海核电	200	2,852.00	0.01
354	600879	航天电子	400	2,812.00	0.01
355	000877	天山股份	400	2,700.00	0.01
356	600409	三友化工	303	2,608.83	0.01
357	600418	江淮汽车	400	2,604.00	0.01
358	002839	张家港行	400	2,436.00	0.01
359	000656	金科股份	500	2,400.00	0.01
360	000600	建投能源	400	2,228.00	0.01
361	300134	大富科技	200	1,788.00	0.01
362	002663	普邦股份	600	1,782.00	0.01
363	002477	雏鹰农牧	500	1,655.00	0.01
364	300197	铁汉生态	300	1,611.00	0.01
365	002013	中航机电	200	1,514.00	0.01
366	002266	浙富控股	400	1,500.00	0.01
367	002509	天广中茂	500	1,455.00	0.01
368	000686	东北证券	200	1,282.00	0.01
369	000979	中弘股份	700	707.00	0.00
370	000690	宝新能源	100	696.00	0.00
371	000592	平潭发展	200	568.00	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	000669	金鸿能源	24,360	176,610.00	0.78
2	000537	广宇发展	2,000	19,280.00	0.09
3	000040	东旭蓝天	1,700	17,170.00	0.08
4	601231	环旭电子	1,800	16,326.00	0.07
5	600051	宁波联合	2,500	15,600.00	0.07
6	600376	首开股份	2,100	14,763.00	0.07
7	000016	深康佳 A	2,800	14,700.00	0.07

8	600708	光明地产	3,370	14,491.00	0.06
9	000059	华锦股份	2,100	14,469.00	0.06
10	002247	帝龙文化	1,700	13,940.00	0.06
11	002203	海亮股份	1,700	13,770.00	0.06
12	600516	方大炭素	541	13,189.58	0.06
13	300406	九强生物	900	12,960.00	0.06
14	300174	元力股份	600	12,708.00	0.06
15	000046	泛海控股	2,200	12,518.00	0.06
16	000662	天夏智慧	1,923	12,364.89	0.05
17	000885	同力水泥	1,200	12,192.00	0.05
18	002568	百润股份	900	12,159.00	0.05
19	601088	中国神华	600	11,964.00	0.05
20	002080	中材科技	1,400	11,900.00	0.05
21	000070	特发信息	1,600	11,600.00	0.05
22	601238	广汽集团	1,040	11,585.60	0.05
23	000034	神州数码	700	11,186.00	0.05
24	601003	柳钢股份	1,400	11,088.00	0.05
25	600873	梅花生物	2,600	10,868.00	0.05
26	603986	兆易创新	100	10,852.00	0.05
27	000892	星美联合	2,300	10,833.00	0.05
28	300272	开能环保	1,000	10,830.00	0.05
29	600153	建发股份	1,200	10,788.00	0.05
30	600966	博汇纸业	2,500	10,775.00	0.05
31	601579	会稽山	1,100	10,769.00	0.05
32	600180	瑞茂通	1,100	10,659.00	0.05
33	002061	*ST江化	1,000	10,470.00	0.05
34	600372	中航电子	800	10,448.00	0.05
35	002528	英飞拓	2,500	10,425.00	0.05
36	002626	金达威	600	10,410.00	0.05
37	000921	海信科龙	1,000	10,360.00	0.05
38	002493	荣盛石化	1,000	10,320.00	0.05
39	600897	厦门空港	500	10,310.00	0.05
40	600373	中文传媒	800	10,280.00	0.05
41	002275	桂林三金	700	10,220.00	0.05
42	000918	嘉凯城	2,200	10,010.00	0.04
43	000631	顺发恒业	2,900	9,947.00	0.04
44	600221	海航控股	3,000	9,690.00	0.04
45	002422	科伦药业	300	9,630.00	0.04
46	603660	苏州科达	420	9,513.00	0.04

47	002567	唐人神	2,100	9,513.00	0.04
48	600781	辅仁药业	600	9,420.00	0.04
49	300194	福安药业	2,000	9,400.00	0.04
50	600713	南京医药	1,900	9,291.00	0.04
51	000606	*ST 易桥	1,400	9,240.00	0.04
52	002736	国信证券	1,000	9,100.00	0.04
53	600309	万华化学	200	9,084.00	0.04
54	000908	景峰医药	1,900	8,949.00	0.04
55	300498	温氏股份	400	8,808.00	0.04
56	601991	大唐发电	2,900	8,787.00	0.04
57	601958	金钼股份	1,400	8,778.00	0.04
58	600602	云赛智联	1,500	8,700.00	0.04
59	601360	三六零	300	8,670.00	0.04
60	601186	中国铁建	1,000	8,620.00	0.04
61	002314	南山控股	2,100	8,463.00	0.04
62	600230	沧州大化	380	8,420.80	0.04
63	600018	上港集团	1,400	8,344.00	0.04
64	000883	湖北能源	2,000	8,220.00	0.04
65	002099	海翔药业	1,600	8,208.00	0.04
66	603603	博天环境	400	8,196.00	0.04
67	600678	四川金顶	800	8,192.00	0.04
68	600828	茂业商业	1,600	8,160.00	0.04
69	000625	长安汽车	900	8,100.00	0.04
70	600459	贵研铂业	750	8,100.00	0.04
71	300384	三联虹普	200	8,054.00	0.04
72	601677	明泰铝业	800	8,032.00	0.04
73	000411	英特集团	600	8,010.00	0.04
74	002206	海利得	1,600	7,984.00	0.04
75	601666	平煤股份	1,900	7,942.00	0.04
76	600829	人民同泰	1,100	7,876.00	0.03
77	600782	新钢股份	1,400	7,812.00	0.03
78	300219	鸿利智汇	800	7,744.00	0.03
79	000736	中房地产	700	7,735.00	0.03
80	601515	东风股份	1,000	7,720.00	0.03
81	002091	江苏国泰	1,200	7,620.00	0.03
82	600850	华东电脑	400	7,596.00	0.03
83	600261	阳光照明	2,000	7,520.00	0.03
84	600488	天药股份	1,800	7,398.00	0.03
85	600105	永鼎股份	2,020	7,352.80	0.03

86	600420	现代制药	700	7,280.00	0.03
87	300083	劲胜精密	1,500	7,230.00	0.03
88	600612	老凤祥	200	7,188.00	0.03
89	300603	立昂技术	200	7,146.00	0.03
90	600894	广日股份	1,200	7,116.00	0.03
91	601158	重庆水务	1,300	7,046.00	0.03
92	002454	松芝股份	1,200	7,044.00	0.03
93	600723	首商股份	1,000	6,990.00	0.03
94	002595	豪迈科技	400	6,956.00	0.03
95	601908	京运通	1,500	6,870.00	0.03
96	002705	新宝股份	700	6,839.00	0.03
97	601998	中信银行	1,100	6,831.00	0.03
98	002501	利源精制	1,100	6,820.00	0.03
99	600658	电子城	1,300	6,799.00	0.03
100	000539	粤电力 A	1,600	6,784.00	0.03
101	000525	红太阳	400	6,780.00	0.03
102	002534	杭锅股份	1,000	6,770.00	0.03
103	000919	金陵药业	900	6,741.00	0.03
104	603567	珍宝岛	500	6,700.00	0.03
105	002102	冠福股份	1,800	6,696.00	0.03
106	600279	重庆港九	1,500	6,660.00	0.03
107	601567	三星医疗	900	6,552.00	0.03
108	600816	安信信托	900	6,516.00	0.03
109	300204	舒泰神	600	6,492.00	0.03
110	603160	汇顶科技	100	6,489.00	0.03
111	300546	雄帝科技	300	6,462.00	0.03
112	002636	金安国纪	800	6,456.00	0.03
113	300448	浩云科技	560	6,412.00	0.03
114	600697	欧亚集团	300	6,387.00	0.03
115	300150	世纪瑞尔	1,300	6,279.00	0.03
116	600775	南京熊猫	1,100	6,226.00	0.03
117	601866	中远海发	2,500	6,225.00	0.03
118	002057	中钢天源	900	6,165.00	0.03
119	600691	阳煤化工	2,000	6,120.00	0.03
120	600641	万业企业	500	6,090.00	0.03
121	600081	东风科技	600	6,060.00	0.03
122	000719	大地传媒	900	6,021.00	0.03
123	600308	华泰股份	1,200	5,976.00	0.03
124	300657	弘信电子	200	5,920.00	0.03

125	002483	润邦股份	1,400	5,880.00	0.03
126	002851	麦格米特	200	5,856.00	0.03
127	600299	安迪苏	500	5,820.00	0.03
128	000557	西部创业	1,800	5,796.00	0.03
129	000069	华侨城A	800	5,784.00	0.03
130	002164	宁波东力	1,000	5,780.00	0.03
131	000521	美菱电器	1,500	5,760.00	0.03
132	002287	奇正藏药	200	5,758.00	0.03
133	603612	索通发展	200	5,720.00	0.03
134	600688	上海石化	1,000	5,690.00	0.03
135	601137	博威合金	700	5,656.00	0.03
136	600812	华北制药	1,300	5,642.00	0.03
137	000617	*ST 济柴	500	5,620.00	0.02
138	600613	神奇制药	900	5,517.00	0.02
139	600483	福能股份	800	5,496.00	0.02
140	002777	久远银海	200	5,494.00	0.02
141	600796	钱江生化	900	5,472.00	0.02
142	002232	启明信息	700	5,467.00	0.02
143	000150	宜华健康	200	5,420.00	0.02
144	300118	东方日升	500	5,400.00	0.02
145	300130	新国都	400	5,396.00	0.02
146	002238	天威视讯	800	5,384.00	0.02
147	002581	未名医药	500	5,325.00	0.02
148	000895	双汇发展	200	5,282.00	0.02
149	000861	海印股份	2,100	5,271.00	0.02
150	000601	韶能股份	1,200	5,268.00	0.02
151	000415	渤海金控	900	5,256.00	0.02
152	002531	天顺风能	1,200	5,220.00	0.02
153	600188	兖州煤业	400	5,216.00	0.02
154	002380	科远股份	400	5,200.00	0.02
155	600173	卧龙地产	1,200	5,160.00	0.02
156	601126	四方股份	1,000	5,090.00	0.02
157	600998	九州通	300	5,088.00	0.02
158	600676	交运股份	1,000	4,970.00	0.02
159	002686	亿利达	700	4,935.00	0.02
160	600851	海欣股份	600	4,932.00	0.02
161	601006	大秦铁路	600	4,926.00	0.02
162	300082	奥克股份	1,000	4,880.00	0.02
163	600438	通威股份	700	4,830.00	0.02

164	002653	海思科	400	4,800.00	0.02
165	300042	朗科科技	200	4,788.00	0.02
166	002001	新和成	251	4,758.96	0.02
167	600741	华域汽车	200	4,744.00	0.02
168	603566	普莱柯	300	4,743.00	0.02
169	600663	陆家嘴	300	4,737.00	0.02
170	603609	禾丰牧业	500	4,720.00	0.02
171	002688	金河生物	900	4,716.00	0.02
172	002295	精艺股份	700	4,704.00	0.02
173	300410	正业科技	200	4,702.00	0.02
174	601618	中国中冶	1,400	4,662.00	0.02
175	300415	伊之密	500	4,660.00	0.02
176	000785	武汉中商	600	4,620.00	0.02
177	300158	振东制药	900	4,608.00	0.02
178	000902	新洋丰	500	4,600.00	0.02
179	002372	伟星新材	260	4,599.40	0.02
180	600236	桂冠电力	800	4,568.00	0.02
181	000672	上峰水泥	500	4,505.00	0.02
182	601628	中国人寿	200	4,504.00	0.02
183	601222	林洋能源	900	4,482.00	0.02
184	300511	雪榕生物	500	4,440.00	0.02
185	300381	溢多利	500	4,355.00	0.02
186	002599	盛通股份	400	4,172.00	0.02
187	601058	赛轮金宇	1,700	4,131.00	0.02
188	002217	合力泰	500	4,125.00	0.02
189	002349	精华制药	700	4,088.00	0.02
190	600383	金地集团	400	4,076.00	0.02
191	300196	长海股份	400	4,076.00	0.02
192	600677	航天通信	500	4,035.00	0.02
193	603688	石英股份	300	4,032.00	0.02
194	300129	泰胜风能	1,100	3,971.00	0.02
195	300358	楚天科技	400	3,964.00	0.02
196	300108	吉药控股	500	3,920.00	0.02
197	600075	新疆天业	600	3,900.00	0.02
198	601999	出版传媒	700	3,885.00	0.02
199	002462	嘉事堂	200	3,880.00	0.02
200	600390	五矿资本	500	3,875.00	0.02
201	600000	浦发银行	400	3,824.00	0.02
202	600015	华夏银行	500	3,725.00	0.02

203	000030	富奥股份	500	3,710.00	0.02
204	000786	北新建材	200	3,706.00	0.02
205	600176	中国巨石	360	3,682.80	0.02
206	300396	迪瑞医疗	200	3,680.00	0.02
207	600704	物产中大	700	3,661.00	0.02
208	300449	汉邦高科	200	3,658.00	0.02
209	000524	岭南控股	400	3,656.00	0.02
210	600973	宝胜股份	1,000	3,650.00	0.02
211	603676	卫信康	200	3,648.00	0.02
212	000001	平安银行	400	3,636.00	0.02
213	601010	文峰股份	1,200	3,636.00	0.02
214	600761	安徽合力	400	3,632.00	0.02
215	002305	南国置业	1,200	3,624.00	0.02
216	600295	鄂尔多斯	400	3,596.00	0.02
217	000903	云内动力	1,400	3,584.00	0.02
218	002323	雅百特	700	3,556.00	0.02
219	600665	天地源	1,000	3,550.00	0.02
220	603669	灵康药业	300	3,546.00	0.02
221	600551	时代出版	400	3,536.00	0.02
222	603380	易德龙	200	3,526.00	0.02
223	600297	广汇汽车	600	3,516.00	0.02
224	600016	民生银行	500	3,500.00	0.02
225	000100	TCL 集团	1,200	3,480.00	0.02
226	600131	岷江水电	600	3,474.00	0.02
227	600615	丰华股份	400	3,468.00	0.02
228	600089	特变电工	500	3,465.00	0.02
229	600444	国机通用	300	3,459.00	0.02
230	600057	厦门象屿	692	3,453.08	0.02
231	300119	瑞普生物	400	3,420.00	0.02
232	601800	中国交建	300	3,417.00	0.02
233	300218	安利股份	500	3,395.00	0.02
234	000850	华茂股份	900	3,384.00	0.02
235	603399	吉翔股份	200	3,380.00	0.02
236	601368	绿城水务	500	3,375.00	0.01
237	300248	新开普	551	3,372.12	0.01
238	600780	通宝能源	900	3,357.00	0.01
239	002336	*ST 人乐	300	3,342.00	0.01
240	000900	现代投资	800	3,328.00	0.01
241	000811	烟台冰轮	700	3,325.00	0.01

242	600768	宁波富邦	300	3,312.00	0.01
243	002383	合众思壮	200	3,310.00	0.01
244	002376	新北洋	200	3,308.00	0.01
245	300389	艾比森	200	3,306.00	0.01
246	603869	北部湾旅	200	3,298.00	0.01
247	002361	神剑股份	800	3,288.00	0.01
248	002150	通润装备	500	3,280.00	0.01
249	600617	国新能源	600	3,258.00	0.01
250	300061	康耐特	300	3,210.00	0.01
251	600919	江苏银行	500	3,205.00	0.01
252	002119	康强电子	280	3,164.00	0.01
253	600864	哈投股份	700	3,150.00	0.01
254	002613	北玻股份	1,000	3,150.00	0.01
255	300087	荃银高科	300	3,144.00	0.01
256	600385	山东金泰	300	3,132.00	0.01
257	000862	银星能源	1,000	3,130.00	0.01
258	300346	南大光电	240	3,127.20	0.01
259	000880	潍柴重机	400	3,076.00	0.01
260	002016	世荣兆业	200	3,014.00	0.01
261	603606	东方电缆	400	2,976.00	0.01
262	300221	银禧科技	300	2,970.00	0.01
263	000949	新乡化纤	1,000	2,950.00	0.01
264	600114	东睦股份	300	2,931.00	0.01
265	601818	光大银行	800	2,928.00	0.01
266	000591	太阳能	800	2,928.00	0.01
267	000421	南京公用	600	2,916.00	0.01
268	002533	金杯电工	600	2,910.00	0.01
269	002033	丽江旅游	400	2,908.00	0.01
270	002209	达意隆	400	2,896.00	0.01
271	601166	兴业银行	200	2,880.00	0.01
272	601328	交通银行	500	2,870.00	0.01
273	000739	普洛药业	400	2,864.00	0.01
274	601599	鹿港文化	700	2,849.00	0.01
275	002726	龙大肉食	400	2,816.00	0.01
276	000898	鞍钢股份	500	2,785.00	0.01
277	300045	华力创通	300	2,781.00	0.01
278	600132	重庆啤酒	100	2,769.00	0.01
279	600569	安阳钢铁	700	2,758.00	0.01
280	600683	京投发展	600	2,754.00	0.01

281	300267	尔康制药	600	2,712.00	0.01
282	002724	海洋王	480	2,683.20	0.01
283	600961	株冶集团	400	2,672.00	0.01
284	600586	金晶科技	800	2,616.00	0.01
285	300189	神农基因	700	2,597.00	0.01
286	002601	佰利联	200	2,586.00	0.01
287	002678	珠江钢琴	300	2,556.00	0.01
288	600398	海澜之家	200	2,548.00	0.01
289	601727	上海电气	400	2,536.00	0.01
290	600843	上工申贝	300	2,517.00	0.01
291	600136	当代明诚	200	2,420.00	0.01
292	002425	凯撒文化	500	2,375.00	0.01
293	300492	山鼎设计	100	2,279.00	0.01
294	002679	福建金森	100	2,241.00	0.01
295	002166	莱茵生物	300	2,196.00	0.01
296	002496	辉丰股份	800	2,184.00	0.01
297	300184	力源信息	200	2,144.00	0.01
298	600475	华光股份	200	2,138.00	0.01
299	002449	国星光电	200	2,128.00	0.01
300	002641	永高股份	600	2,070.00	0.01
301	000756	新华制药	200	2,064.00	0.01
302	000959	首钢股份	500	2,055.00	0.01
303	002171	楚江新材	300	2,034.00	0.01
304	002405	四维图新	100	2,025.00	0.01
305	600965	福成股份	200	2,020.00	0.01
306	300237	美晨科技	280	2,010.40	0.01
307	300343	联创互联	200	2,000.00	0.01
308	002279	久其软件	200	1,982.00	0.01
309	601898	中煤能源	400	1,932.00	0.01
310	600011	华能国际	300	1,908.00	0.01
311	600061	国投资本	200	1,856.00	0.01
312	002107	沃华医药	200	1,842.00	0.01
313	603123	翠微股份	300	1,830.00	0.01
314	600273	嘉化能源	200	1,812.00	0.01
315	601988	中国银行	500	1,805.00	0.01
316	300366	创意信息	200	1,796.00	0.01
317	601111	中国国航	200	1,778.00	0.01
318	002772	众兴菌业	200	1,674.00	0.01
319	002187	广百股份	200	1,648.00	0.01

320	000607	华媒控股	400	1,644.00	0.01
321	601225	陕西煤业	200	1,644.00	0.01
322	600219	南山铝业	600	1,626.00	0.01
323	002421	达实智能	400	1,620.00	0.01
324	000851	高鸿股份	300	1,614.00	0.01
325	002429	兆驰股份	600	1,488.00	0.01
326	000502	绿景控股	200	1,470.00	0.01
327	002487	大金重工	400	1,464.00	0.01
328	600250	南纺股份	200	1,454.00	0.01
329	002090	金智科技	100	1,446.00	0.01
330	300261	雅本化学	300	1,437.00	0.01
331	002045	国光电器	200	1,430.00	0.01
332	601288	农业银行	400	1,376.00	0.01
333	300395	菲利华	100	1,360.00	0.01
334	601636	旗滨集团	300	1,335.00	0.01
335	002014	永新股份	200	1,330.00	0.01
336	300440	运达科技	200	1,306.00	0.01
337	000639	西王食品	100	1,283.00	0.01
338	002555	三七互娱	100	1,215.00	0.01
339	601169	北京银行	200	1,206.00	0.01
340	000561	烽火电子	200	1,184.00	0.01
341	600208	新潮中宝	300	1,146.00	0.01
342	601899	紫金矿业	300	1,083.00	0.00
343	600331	宏达股份	400	1,036.00	0.00
344	002241	歌尔股份	100	1,019.00	0.00
345	300527	华舟应急	100	1,006.00	0.00
346	300232	洲明科技	100	988.00	0.00
347	002084	海鸥卫浴	200	952.00	0.00
348	300034	钢研高纳	100	936.00	0.00
349	600023	浙能电力	200	932.00	0.00
350	002671	龙泉股份	200	892.00	0.00
351	000404	华意压缩	200	866.00	0.00
352	600415	小商品城	200	862.00	0.00
353	000518	四环生物	200	826.00	0.00
354	000899	赣能股份	200	818.00	0.00
355	000402	金融街	100	805.00	0.00
356	601390	中国中铁	100	747.00	0.00
357	002196	方正电机	100	735.00	0.00
358	300290	荣科科技	100	722.00	0.00

359	300131	英唐智控	100	567.00	0.00
360	300230	永利股份	100	515.00	0.00
361	601028	玉龙股份	100	502.00	0.00
362	000565	渝三峡A	100	475.00	0.00
363	600705	中航资本	100	467.00	0.00
364	002498	汉缆股份	200	442.00	0.00
365	600589	广东榕泰	100	442.00	0.00
366	601018	宁波港	100	421.00	0.00
367	600386	北巴传媒	100	389.00	0.00
368	600724	宁波富达	100	329.00	0.00
369	600252	中恒集团	100	324.00	0.00
370	300303	聚飞光电	100	274.00	0.00

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	601678	滨化股份	553,474.00	3.59
2	600266	北京城建	534,786.00	3.47
3	601717	郑煤机	532,798.00	3.46
4	600801	华新水泥	531,892.27	3.45
5	600557	康缘药业	523,608.00	3.40
6	600611	大众交通	498,192.00	3.23
7	600881	亚泰集团	485,788.00	3.15
8	600978	宜华生活	483,820.00	3.14
9	603188	亚邦股份	465,450.00	3.02
10	600094	大名城	459,947.00	2.99
11	000528	柳工	449,074.00	2.91
12	600201	生物股份	449,060.00	2.91
13	300039	上海凯宝	448,758.00	2.91
14	600628	新世界	438,684.00	2.85
15	603568	伟明环保	438,267.00	2.84
16	000661	长春高新	424,349.06	2.75
17	000848	承德露露	421,871.00	2.74
18	000581	威孚高科	418,550.00	2.72

19	600755	厦门国贸	418,125.00	2.71
20	000049	德赛电池	411,311.00	2.67
21	601233	桐昆股份	404,798.00	2.63
22	600754	锦江股份	403,941.00	2.62
23	601168	西部矿业	394,633.00	2.56
24	600655	豫园股份	390,368.00	2.53
25	002603	以岭药业	383,884.00	2.49
26	600282	南钢股份	381,873.00	2.48
27	600651	飞乐音响	380,256.00	2.47
28	600757	长江传媒	380,112.00	2.47
29	000541	佛山照明	376,247.00	2.44
30	600056	中国医药	374,272.00	2.43
31	600126	杭钢股份	370,549.00	2.41
32	000513	丽珠集团	370,510.00	2.41
33	600064	南京高科	365,403.00	2.37
34	600618	氯碱化工	365,049.00	2.37
35	600808	马钢股份	363,554.00	2.36
36	600572	康恩贝	360,368.00	2.34
37	000012	南玻A	360,360.00	2.34
38	002019	亿帆医药	359,883.00	2.34
39	600565	迪马股份	359,017.00	2.33
40	000039	中集集团	357,901.00	2.32
41	000718	苏宁环球	357,769.00	2.32
42	603556	海兴电力	350,628.00	2.28
43	000830	鲁西化工	350,297.00	2.27
44	000598	兴蓉环境	346,214.00	2.25
45	603444	吉比特	345,974.00	2.25
46	002463	沪电股份	341,225.00	2.21
47	600422	昆药集团	340,699.00	2.21
48	601311	骆驼股份	339,489.00	2.20
49	600516	方大炭素	338,957.00	2.20
50	600141	兴发集团	338,746.00	2.20
51	600284	浦东建设	337,978.00	2.19
52	000552	靖远煤电	337,387.00	2.19
53	002195	二三四五	336,770.00	2.19
54	600525	长园集团	335,321.00	2.18

55	002332	仙琚制药	334,943.00	2.17
56	600079	人福医药	332,407.00	2.16
57	601811	新华文轩	331,498.00	2.15
58	600743	华远地产	326,706.00	2.12
59	600872	中炬高新	326,564.00	2.12
60	000786	北新建材	322,849.00	2.10
61	000680	山推股份	322,788.00	2.10
62	300026	红日药业	322,539.00	2.09
63	002233	塔牌集团	321,133.98	2.08
64	000612	焦作万方	320,256.00	2.08
65	600563	法拉电子	320,078.00	2.08
66	603225	新风鸣	319,868.60	2.08
67	600729	重庆百货	319,426.00	2.07
68	000418	小天鹅A	319,158.00	2.07
69	601001	大同煤业	315,269.05	2.05
70	002308	威创股份	315,061.00	2.05
71	601016	节能风电	313,002.00	2.03
72	002221	东华能源	312,532.00	2.03
73	002051	中工国际	310,315.00	2.01
74	000400	许继电气	309,874.00	2.01

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	600525	长园集团	637,249.57	4.14
2	601233	桐昆股份	599,760.00	3.89
3	002195	二三四五	579,796.71	3.76
4	000513	丽珠集团	573,905.15	3.73
5	000039	中集集团	566,003.48	3.67
6	000786	北新建材	554,963.76	3.60
7	600380	健康元	546,585.25	3.55
8	600801	华新水泥	540,415.85	3.51
9	600516	方大炭素	539,403.90	3.50
10	600266	北京城建	525,074.88	3.41
11	600755	厦门国贸	514,255.07	3.34

12	600580	卧龙电气	478,485.30	3.11
13	600787	中储股份	468,922.88	3.04
14	000418	小天鹅A	468,735.00	3.04
15	600808	马钢股份	464,160.93	3.01
16	600160	巨化股份	455,239.60	2.96
17	603225	新凤鸣	451,468.47	2.93
18	600754	锦江股份	447,442.16	2.90
19	002019	亿帆医药	446,643.16	2.90
20	002048	宁波华翔	443,242.57	2.88
21	601678	滨化股份	437,400.14	2.84
22	000661	长春高新	436,297.00	2.83
23	600079	人福医药	435,579.69	2.83
24	600392	盛和资源	428,753.10	2.78
25	603568	伟明环保	420,651.74	2.73
26	300274	阳光电源	418,973.02	2.72
27	000488	晨鸣纸业	418,717.90	2.72
28	000990	诚志股份	411,763.68	2.67
29	000012	南玻A	411,042.76	2.67
30	600628	新世界	410,739.48	2.67
31	600881	亚泰集团	409,690.00	2.66
32	600765	中航重机	407,319.28	2.64
33	002416	爱施德	405,693.52	2.63
34	000598	兴蓉环境	403,137.92	2.62
35	600094	大名城	397,584.06	2.58
36	600557	康缘药业	396,919.60	2.58
37	600141	兴发集团	396,729.35	2.58
38	600582	天地科技	393,248.82	2.55
39	600757	长江传媒	385,446.54	2.50
40	300182	捷成股份	382,630.16	2.48
41	600643	爱建集团	380,855.87	2.47
42	600335	国机汽车	377,609.43	2.45
43	600037	歌华有线	374,034.20	2.43
44	600388	龙净环保	372,296.88	2.42
45	600565	迪马股份	369,748.55	2.40
46	002573	清新环境	369,043.33	2.40
47	000587	金洲慈航	363,592.98	2.36
48	000050	深天马A	363,220.14	2.36
49	000581	威孚高科	362,752.20	2.35

50	603589	口子窖	358,683.59	2.33
51	600750	江中药业	354,220.44	2.30
52	600835	上海机电	343,793.96	2.23
53	603025	大豪科技	342,296.34	2.22
54	000656	金科股份	335,653.80	2.18
55	000528	柳工	334,671.37	2.17
56	600970	中材国际	334,485.67	2.17
57	000732	泰禾集团	329,508.12	2.14
58	002332	仙琚制药	327,384.84	2.13
59	000830	鲁西化工	324,146.65	2.10
60	603328	依顿电子	319,667.80	2.08
61	600872	中炬高新	319,643.81	2.07
62	600183	生益科技	315,071.64	2.05
63	600282	南钢股份	314,998.89	2.04
64	600594	益佰制药	314,156.50	2.04
65	002092	中泰化学	313,601.31	2.04
66	600284	浦东建设	313,423.91	2.03
67	600536	中国软件	311,516.00	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	90,775,935.08
卖出股票收入（成交）总额	81,309,443.95

注：7.4.1项“买入金额”、7.4.2项“卖出金额”及7.4.3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

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	700,070.00	3.11
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	700,070.00	3.11

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

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	019571	17 国债 17	7,000	700,070.00	3.11

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。

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。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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	7,138.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,393.75
5	应收申购款	186,584.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	215,116.37

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

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	000669	金鸿能源	176,610.00	0.78	重大事项停牌

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
中金中证 500A	321	60,935.95	10,000,000.00	51.12%	9,560,440.92	48.88%
中金中证 500C	328	10,898.07	0.00	0.00%	3,574,568.19	100.00%
合计	649	35,647.16	10,000,000.00	43.22%	13,135,009.11	56.78%

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	中金中证 500A	156,075.13	0.7979%
	中金中证 500C	34,648.52	0.9693%
	合计	190,723.65	0.8244%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金中证 500A	10~50
	中金中证 500C	0
	合计	10~50
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

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	发起份额总数	发起份额占	发起份额承

		基金总份额 比例 (%)		基金总份额 比例 (%)	诺持有期限
基金管理人固有 资金	10,000,000.00	43.22	10,000,000.00	43.22	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	43.22	10,000,000.00	43.22	-

§ 9 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	13,218,031.80	850,755.00
本报告期基金总申购份额	7,973,241.43	5,423,013.58
减：本报告期基金总赎回份额	1,630,832.31	2,699,200.39
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	19,560,440.92	3,574,568.19

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，基金管理人与股东中国国际金融股份有限公司就侵犯商标权及不正当竞争事项，联合向北京市朝阳区人民法院起诉南京中金基金管理有限公司。截至 2018 年 6 月 30 日，该案已获法院受理，尚未开庭。除前述事项外，本报告期无涉及基金管理人的其他诉讼事项。

本报告期无涉及本基金基金财产、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		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
兴业证券	2	120,279,822.21	69.90%	87,958.02	69.89%	-
长江证券	2	51,805,556.82	30.10%	37,886.17	30.11%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-

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

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
兴业证券	707,152.00	98.43%	-	-	-	-
长江证券	11,290.63	1.57%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

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	中金基金管理有限公司关于	《中国证券报》、《上	2018年1月18日

	调整长期停牌股票估值方法的公告	海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	
2	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2017 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	2018 年 1 月 19 日
3	中金基金管理有限公司关于调整旗下基金所持长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 2 月 7 日
4	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽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	2018 年 3 月 7 日
5	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（2018 年第 1 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 7 日
6	关于旗下部分基金新增包商银行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	2018 年 3 月 15 日
7	关于新增北京植信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	2018 年 3 月 22 日
8	中金基金管理有限公司关于修改旗下部分开放式基金《基金合同》、《托管协议》等法律文件的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 30 日
9	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2017 年度报告及摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 30 日
10	关于新增南京苏宁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	2018 年 4 月 11 日
11	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 4 月 23 日
12	关于新增浙江同花顺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	2018 年 5 月 31 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
自有资金	1	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	43.22%

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

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。

§ 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中证 500 指数增强型发起式证券投资基金募集的注册文件
- 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、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

2018 年 8 月 28 日