

中金沪深 300 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.....	6
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	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
§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.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68

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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中金沪深 300	
基金主代码	003015	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 22 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	14,676,403.98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中金沪深 300A	中金沪深 300C
下属分级基金的交易代码:	003015	003579
报告期末下属分级基金的份额总额	13,599,211.02 份	1,077,192.96 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	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	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	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	北京市西城区复兴门内大街 55

	街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	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	中金沪深 300A	中金沪深 300C
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	-315,659.47	-34,579.57
本期利润	-1,561,941.26	-114,133.79
加权平均基金份额本期利润	-0.1221	-0.1706
本期加权平均净值利润率	-10.18%	-14.24%
本期基金份额净值增长率	-8.35%	-8.17%
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	1,448,525.18	126,537.39
期末可供分配基金份额利润	0.1065	0.1175
期末基金资产净值	15,047,736.20	1,203,730.35
期末基金份额净值	1.1065	1.1175
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	10.65%	5.01%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数；

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金沪深 300A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.12%	1.17%	-7.29%	1.22%	2.17%	-0.05%
过去三个月	-6.13%	1.02%	-9.45%	1.08%	3.32%	-0.06%
过去六个月	-8.35%	1.06%	-12.25%	1.10%	3.90%	-0.04%
过去一年	0.97%	0.86%	-3.97%	0.90%	4.94%	-0.04%
自基金合同	10.65%	0.76%	7.65%	0.78%	3.00%	-0.02%

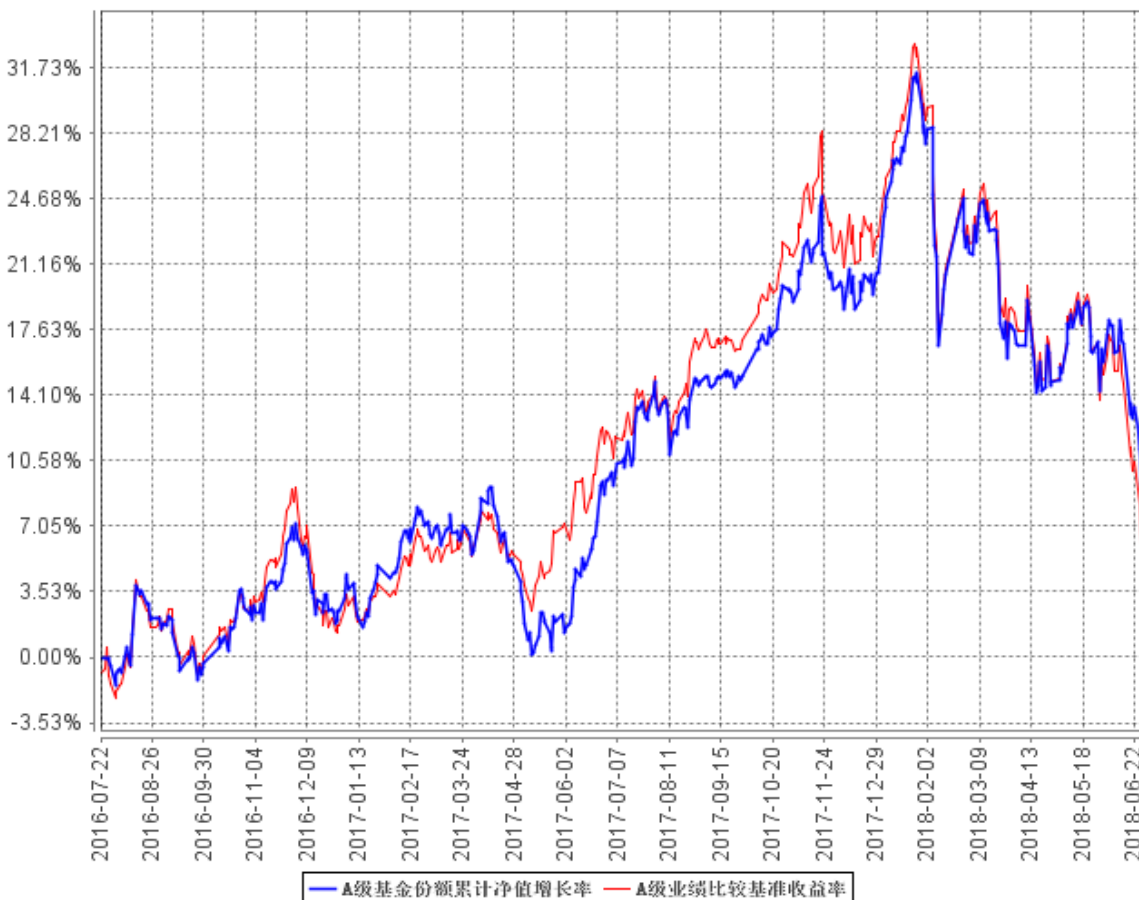
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

中金沪深 300C

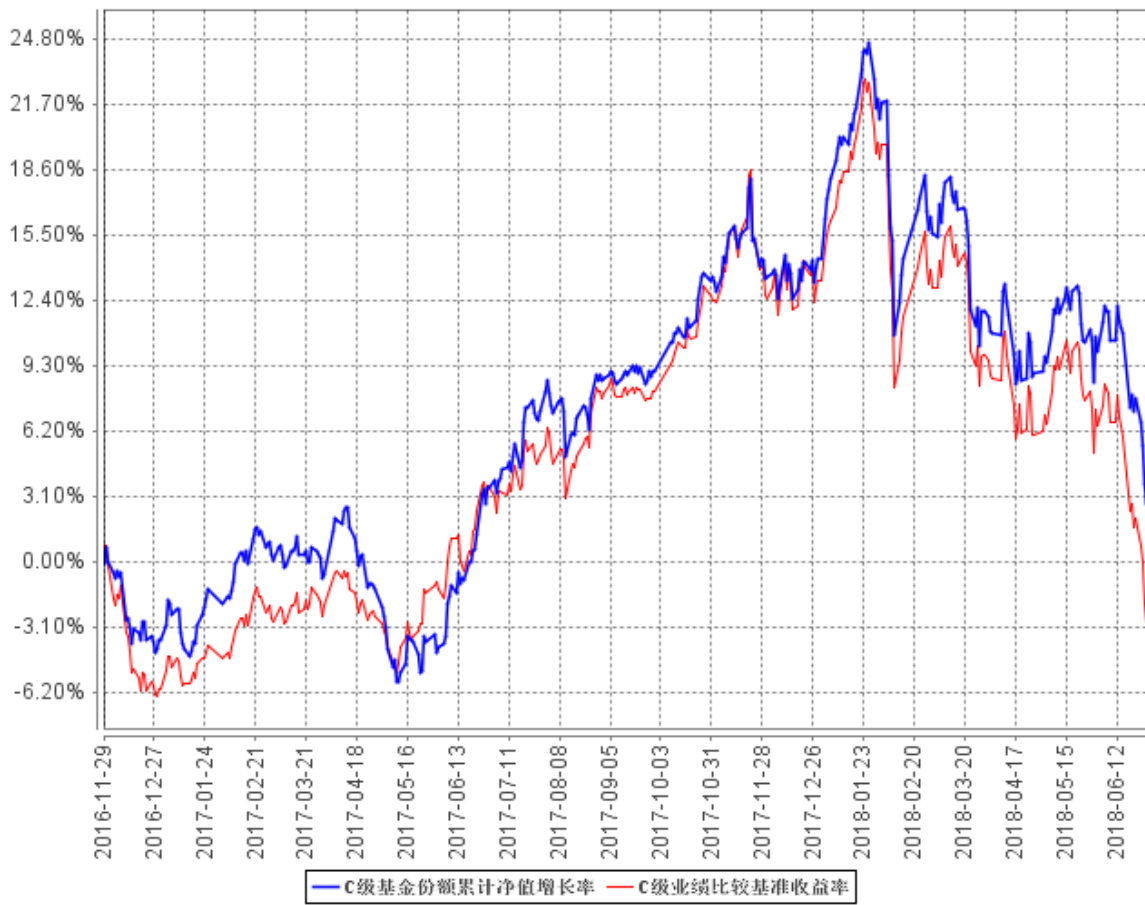
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.11%	1.17%	-7.29%	1.22%	2.18%	-0.05%
过去三个月	-6.12%	1.02%	-9.45%	1.08%	3.33%	-0.06%
过去六个月	-8.17%	1.06%	-12.25%	1.10%	4.08%	-0.04%
过去一年	1.40%	0.86%	-3.97%	0.90%	5.37%	-0.04%
自基金合同生效起至今	5.01%	0.79%	7.65%	0.80%	-2.64%	-0.01%

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 年	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基金经理、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合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规规定和基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利

益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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沪深 300A 基金份额净值为 1.1065 元，本报告期基金份额净值增长率为 -8.35%；截至本报告期末中金沪深 300C 基金份额净值为 1.1175 元，本报告期基金份额净值增长率为 -8.17%；同期业绩比较基准收益率为 -12.25%。

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中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2018 半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：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	401,785.47	1,107,014.41
结算备付金		59,800.41	89,378.41
存出保证金		3,451.45	6,442.42
交易性金融资产	6.4.7.2	15,937,347.97	12,583,740.46
其中：股票投资		15,265,280.77	12,583,740.46
基金投资		-	-
债券投资		672,067.20	-
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		7,378.06	108,290.50
应收利息	6.4.7.5	20,460.02	270.47
应收股利		-	-
应收申购款		23,679.15	18,987.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,453,902.53	13,914,123.68
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		19,637.34	252,838.51
应付赎回款		99,101.80	-
应付管理人报酬		6,758.47	5,666.74
应付托管费		2,027.53	1,700.04
应付销售服务费		2,300.97	715.57
应付交易费用	6.4.7.7	28,712.25	178,705.03
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	43,897.62	60,537.86
负债合计		202,435.98	500,163.75
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	14,676,403.98	11,108,131.19
未分配利润	6.4.7.10	1,575,062.57	2,305,828.74
所有者权益合计		16,251,466.55	13,413,959.93
负债和所有者权益总计		16,453,902.53	13,914,123.68

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，中金沪深 300 A 类基金份额净值为人民币 1.1065 元，中金沪深 300 C 类基金份额净值为人民币 1.1175 元；基金份额总额为 14676403.98 份，其中中金沪深 300 A 类基金份额为 13599211.02 份，中金沪深 300 C 类基金份额为 1077192.96 份。

6.2 利润表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：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		-1,465,121.38	1,164,560.50
1.利息收入		10,954.16	4,425.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,966.17	4,425.02
债券利息收入		7,987.99	-
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）		-157,234.23	566,062.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-332,769.66	494,181.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,105.11	-
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	174,430.32	71,881.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,325,836.01	519,557.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,994.70	74,515.82
减：二、费用		210,953.67	346,349.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	40,035.67	26,662.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	12,010.71	7,998.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,585.40	92.07
4. 交易费用	6.4.7.18	122,358.21	271,394.61
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	34,963.68	40,201.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,676,075.05	818,211.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,676,075.05	818,211.27

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：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）	11,108,131.19	2,305,828.74	13,413,959.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,676,075.05	-1,676,075.05
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）	3,568,272.79	945,308.88	4,513,581.67
其中：1.基金申购款	5,317,703.89	1,316,787.07	6,634,490.96
2. 基金赎回款	-1,749,431.10	-371,478.19	-2,120,909.29
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)	14,676,403.98	1,575,062.57	16,251,466.55
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)	10,086,780.86	250,000.70	10,336,781.56
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	746,329.84	746,329.84
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动 数 (净值减少以“-”号 填列)	596,932.99	29,558.79	626,491.78
其中：1.基金申购款	1,033,552.72	50,785.06	1,084,337.78
2.基金赎回款	-436,619.73	-21,226.27	-457,846.00
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的 基金净值变动(净值减 少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	10,683,713.85	1,025,889.33	11,709,603.18

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 _____

基金管理人负责人

_____ 张纳 _____

主管会计工作负责人

_____ 白娜 _____

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2016 年 7 月 5 日证监许可 [2016] 1516 号《关于准予中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金沪深 300 指

数增强型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式指数型基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）。

本基金通过中金基金直销中心公开发售，募集期为 2016 年 7 月 18 日。经向中国证监会备案，《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 22 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 10,001,300.00 份，发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

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。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券

投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及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 2018 年 06 月 30 日的财务状况、2018

上半年度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,本报告期覆盖期间为 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和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在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《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于

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该类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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未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：

(a) 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。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 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。

(f) 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	401,785.47
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：	401,785.47

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	16,548,987.83	15,265,280.77	-1,283,707.06
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	673,209.60	672,067.20
	银行间市场	-	-
	合计	673,209.60	672,067.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	17,222,197.43	15,937,347.97	-1,284,849.46

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	77.10
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	26.90
应收债券利息	20,354.42
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	1.60
合计	20,460.02

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	28,712.25
银行间市场应付交易费用	-
合计	28,712.25

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	57.87
应付审计费用	18,315.15
应付信息披露费用	24,876.39
指数使用费	648.21
合计	43,897.62

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金沪深 300A		
项目	本期 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	10,839,298.31	10,839,298.31
本期申购	3,613,305.87	3,613,305.87
本期赎回(以“-”号填列)	-853,393.16	-853,393.16
- 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	13,599,211.02	13,599,211.02

金额单位：人民币元

中金沪深 300C		
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	268,832.88	268,832.88
本期申购	1,704,398.02	1,704,398.02
本期赎回(以“-”号填列)	-896,037.94	-896,037.94
- 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	1,077,192.96	1,077,192.96

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金沪深 300A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,194,234.25	53,275.36	2,247,509.61
本期利润	-315,659.47	-1,246,281.79	-1,561,941.26
本期基金份额交易产生的变动数	603,381.05	159,575.78	762,956.83
其中：基金申购款	792,787.48	154,986.68	947,774.16
基金赎回款	-189,406.43	4,589.10	-184,817.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,481,955.83	-1,033,430.65	1,448,525.18

单位：人民币元

中金沪深 300C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	56,920.07	1,399.06	58,319.13
本期利润	-34,579.57	-79,554.22	-114,133.79
本期基金份额交易产生的变动数	186,621.65	-4,269.60	182,352.05
其中：基金申购款	388,884.64	-19,871.73	369,012.91
基金赎回款	-202,262.99	15,602.13	-186,660.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	208,962.15	-82,424.76	126,537.39

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	2,193.32
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	736.32
其他	36.53
合计	2,966.17

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	44,993,165.58
减：卖出股票成本总额	45,325,935.24
买卖股票差价收入	-332,769.66

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	1,105.11
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	1,105.11

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）成交总额	735,696.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	710,440.00
减：应收利息总额	24,151.59
买卖债券差价收入	1,105.11

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	174,430.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	174,430.32

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	-1,325,836.01
——股票投资	-1,324,693.61
——债券投资	-1,142.40
——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	-1,325,836.01

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	6,994.70
合计	6,994.70

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	122,358.21
银行间市场交易费用	-
合计	122,358.21

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	1,281.14
汇划手续费	491.00
合计	34,963.68

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金管理有限公司(“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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人

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。

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**

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期与上年度可比期间无关联方债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间均无应付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	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	40,035.67	26,662.24
其中：支付销售机构的客户维护费	1,852.82	131.95

注：1、支付基金管理人中金基金管理有限公司的基本管理费按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基本管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数；

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

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	12,010.71	7,998.63

注：1、支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

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		
	中金沪深 300A	中金沪深 300C	合计
中金基金	-	68.02	68.02
合计	-	68.02	68.02

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		
	中金沪深 300A	中金沪深 300C	合计
中金基金	-	27.07	27.07
合计	-	27.07	27.07

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。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。计算公式为：本基金 C 类基金日基金销售服务费=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

本报告期本基金未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	中金沪深 300A	中金沪深 300C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	73.5300%	-

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	中金沪深 300A	中金沪深 300C
基金合同生效日(2016 年 7 月 22 日) 持有的基金份额	10,000,000.00	-
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	95.0600%	-

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	401,785.47	2,193.32	879,068.24	2,974.04

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

2、本基金通过“工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金, 于 2018 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 63251.86 元(于 2017 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 190609.27 元), 本期间产生的利息收入为人民币 772.85 元(上年度可比期间产生的利息收入为人民币 1450.98 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

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（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/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项	7.47	2018年8月20日	7.25	18,600	138,893.65	138,942.00	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大资产重组	15.03	2018年8月27日	13.47	9,136	172,532.15	137,314.08	-
000415	渤海金控	2018年1月17日	重大资产重组	5.84	2018年7月17日	5.19	21,953	126,621.67	128,205.52	-
002450	康得新	2018年6月4日	重大资产重组	17.08	-	-	5,800	118,889.25	99,064.00	-

000008	神州高铁	2018年6月6日	重大事项	4.96	2018年8月7日	4.46	10,800	61,558.47	53,568.00	-
002602	世纪华通	2018年6月12日	重大资产重组	32.50	-	-	1,500	50,606.11	48,750.00	-
600221	海航控股	2018年1月10日	重大资产重组	3.23	2018年7月20日	2.91	12,769	40,933.07	41,243.87	-
000723	美锦能源	2018年3月27日	重大资产重组	5.43	2018年7月31日	4.89	4,200	25,761.83	22,806.00	-
600811	东方集团	2018年5月30日	重大事项	4.30	-	-	1,100	4,755.00	4,730.00	-

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

本报告期末本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型股票基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其

预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

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

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

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	401,785.47	-	-	-	401,785.47
结算备付金	59,800.41	-	-	-	59,800.41
存出保证金	3,451.45	-	-	-	3,451.45
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	15,265,280.77	15,265,280.77
交易性金融资产-债券投资	672,067.20	-	-	-	672,067.20
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	7,378.06	7,378.06
应收利息	-	-	-	20,460.02	20,460.02
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	23,679.15	23,679.15
资产总计	1,137,104.53	-	-	15,316,798.00	16,453,902.53
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	19,637.34	19,637.34
应付赎回款	-	-	-	99,101.80	99,101.80
应付管理人报酬	-	-	-	6,758.47	6,758.47
应付托管费	-	-	-	2,027.53	2,027.53
应付交易费用	-	-	-	28,712.25	28,712.25
应付销售服务费	-	-	-	2,300.97	2,300.97
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	43,897.62	43,897.62
负债总计	-	-	-	202,435.98	202,435.98

利率敏感度缺口	1,137,104.53	-	-	-15,114,362.02	16,251,466.55
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	1,107,014.41	-	-	-	1,107,014.41
结算备付金	89,378.41	-	-	-	89,378.41
存出保证金	6,442.42	-	-	-	6,442.42
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-12,583,740.46	12,583,740.46
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	-	-	-	108,290.50	108,290.50
应收利息	-	-	-	270.47	270.47
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	18,987.01	18,987.01
资产总计	1,202,835.24	-	-	-12,711,288.44	13,914,123.68
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	252,838.51	252,838.51
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	5,666.74	5,666.74
应付托管费	-	-	-	1,700.04	1,700.04
应付交易费用	-	-	-	178,705.03	178,705.03
应付销售服务费	-	-	-	715.57	715.57
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	60,537.86	60,537.86
负债总计	-	-	-	500,163.75	500,163.75
利率敏感度缺口	1,202,835.24	-	-	-12,211,124.69	13,413,959.93

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）

			日)
	市场利率下降 25 个基点	160.62	-
	市场利率上升 25 个基点	-160.62	-

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

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	15,265,280.77	93.93	12,583,740.46	93.81
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	672,067.20	4.14	-	-
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	15,937,347.97	98.07	12,583,740.46	93.81

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%	755,525.99	616,290.43
	业绩比较基准下降 5%	-755,525.99	-616,290.43

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 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	15,265,280.77	92.78
	其中：股票	15,265,280.77	92.78
2	固定收益投资	672,067.20	4.08
	其中：债券	672,067.20	4.08
	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	461,585.88	2.81
7	其他各项资产	54,968.68	0.33
8	合计	16,453,902.53	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	-	-
B	采矿业	249,586.38	1.54
C	制造业	6,124,922.42	37.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	500,443.10	3.08
E	建筑业	1,087,103.12	6.69
F	批发和零售业	405,004.86	2.49
G	交通运输、仓储和邮政业	555,572.39	3.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,950.30	0.73
J	金融业	4,187,458.36	25.77
K	房地产业	1,115,549.47	6.86
L	租赁和商务服务业	321,502.12	1.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	128,970.00	0.79

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,882.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	331,712.25	2.04
S	综合	-	-
	合计	15,138,656.77	93.15

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,544.00	0.04
C	制造业	65,927.00	0.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,730.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	4,776.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,498.00	0.03
J	金融业	4,998.00	0.03
K	房地产业	35,151.00	0.22
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	126,624.00	0.78

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股票资产。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	11,900	697,102.00	4.29
2	600519	贵州茅台	813	594,676.98	3.66
3	600016	民生银行	56,351	394,457.00	2.43
4	600015	华夏银行	36,224	269,868.80	1.66
5	000425	徐工机械	62,900	266,696.00	1.64
6	600887	伊利股份	9,460	263,934.00	1.62
7	601006	大秦铁路	32,016	262,851.36	1.62
8	000157	中联重科	63,539	261,145.29	1.61
9	002304	洋河股份	1,951	256,751.60	1.58
10	600369	西南证券	61,900	238,315.00	1.47
11	000858	五粮液	3,100	235,600.00	1.45
12	600170	上海建工	74,300	225,872.00	1.39
13	601169	北京银行	37,400	225,522.00	1.39
14	600208	新湖中宝	58,742	224,394.44	1.38
15	000651	格力电器	4,577	215,805.55	1.33
16	600585	海螺水泥	6,416	214,807.68	1.32
17	600376	首开股份	30,259	212,720.77	1.31
18	600104	上汽集团	6,079	212,704.21	1.31
19	601166	兴业银行	14,458	208,195.20	1.28
20	300027	华谊兄弟	33,400	205,744.00	1.27
21	000333	美的集团	3,917	204,545.74	1.26
22	600919	江苏银行	30,908	198,120.28	1.22
23	600741	华域汽车	8,007	189,926.04	1.17
24	000069	华侨城A	26,210	189,498.30	1.17
25	601888	中国国旅	2,900	186,789.00	1.15
26	000338	潍柴动力	21,337	186,698.75	1.15
27	600153	建发股份	20,407	183,458.93	1.13
28	600089	特变电工	25,066	173,707.38	1.07
29	601668	中国建筑	28,401	155,069.46	0.95
30	600383	金地集团	14,958	152,422.02	0.94
31	601328	交通银行	25,985	149,153.90	0.92
32	000895	双汇发展	5,553	146,654.73	0.90
33	600674	川投能源	16,400	143,008.00	0.88

34	601009	南京银行	18,200	140,686.00	0.87
35	000568	泸州老窖	2,300	139,978.00	0.86
36	000623	吉林敖东	7,770	139,704.60	0.86
37	601601	中国太保	4,378	139,439.30	0.86
38	600219	南山铝业	51,369	139,209.99	0.86
39	600309	万华化学	3,061	139,030.62	0.86
40	601390	中国中铁	18,600	138,942.00	0.85
41	002310	东方园林	9,136	137,314.08	0.84
42	601211	国泰君安	9,158	134,988.92	0.83
43	600036	招商银行	5,000	132,200.00	0.81
44	000100	TCL 集团	45,300	131,370.00	0.81
45	000415	渤海金控	21,953	128,205.52	0.79
46	000625	长安汽车	13,698	123,282.00	0.76
47	002294	信立泰	3,300	122,661.00	0.75
48	000826	启迪桑德	6,900	120,612.00	0.74
49	600820	隧道股份	20,100	118,791.00	0.73
50	603288	海天味业	1,600	117,824.00	0.73
51	600795	国电电力	44,400	116,328.00	0.72
52	601229	上海银行	7,300	115,048.00	0.71
53	601818	光大银行	31,306	114,579.96	0.71
54	601997	贵阳银行	9,202	113,736.72	0.70
55	601607	上海医药	4,700	112,330.00	0.69
56	600028	中国石化	17,000	110,330.00	0.68
57	601288	农业银行	32,032	110,190.08	0.68
58	002572	索菲亚	3,400	109,412.00	0.67
59	601186	中国铁建	11,959	103,086.58	0.63
60	600516	方大炭素	4,200	102,396.00	0.63
61	002450	康得新	5,800	99,064.00	0.61
62	600705	中航资本	20,900	97,603.00	0.60
63	600867	通化东宝	4,000	95,880.00	0.59
64	600276	恒瑞医药	1,260	95,457.60	0.59
65	600398	海澜之家	7,300	93,002.00	0.57
66	601333	广深铁路	21,800	92,650.00	0.57
67	601021	春秋航空	2,500	87,575.00	0.54
68	600518	康美药业	3,600	82,368.00	0.51
69	600031	三一重工	9,045	81,133.65	0.50
70	600886	国投电力	11,100	80,697.00	0.50
71	600837	海通证券	8,363	79,197.61	0.49
72	000002	万科 A	3,172	78,031.20	0.48

73	000876	新希望	12,300	77,982.00	0.48
74	000423	东阿阿胶	1,400	75,334.00	0.46
75	601099	太平洋	30,600	71,604.00	0.44
76	600373	中文传媒	5,525	70,996.25	0.44
77	002415	海康威视	1,900	70,547.00	0.43
78	601336	新华保险	1,500	64,320.00	0.40
79	601788	光大证券	5,758	63,222.84	0.39
80	601898	中煤能源	12,800	61,824.00	0.38
81	600009	上海机场	1,092	60,584.16	0.37
82	600000	浦发银行	6,200	59,272.00	0.36
83	000961	中南建设	9,300	58,683.00	0.36
84	601991	大唐发电	19,300	58,479.00	0.36
85	600926	杭州银行	5,100	56,559.00	0.35
86	000963	华东医药	1,150	55,487.50	0.34
87	300251	光线传媒	5,400	54,972.00	0.34
88	600352	浙江龙盛	4,584	54,778.80	0.34
89	601088	中国神华	2,700	53,838.00	0.33
90	601117	中国化学	7,900	53,167.00	0.33
91	600340	华夏幸福	2,000	51,500.00	0.32
92	000627	天茂集团	7,300	51,246.00	0.32
93	601618	中国中冶	15,200	50,616.00	0.31
94	002602	世纪华通	1,500	48,750.00	0.30
95	000898	鞍钢股份	8,701	48,464.57	0.30
96	002146	荣盛发展	5,438	47,473.74	0.29
97	000725	京东方A	12,845	45,471.30	0.28
98	000001	平安银行	4,875	44,313.75	0.27
99	600704	物产中大	8,241	43,100.43	0.27
100	600535	天士力	1,613	41,647.66	0.26
101	600221	海航控股	12,769	41,243.87	0.25
102	600606	绿地控股	6,300	41,202.00	0.25
103	601988	中国银行	11,100	40,071.00	0.25
104	000413	东旭光电	5,900	35,754.00	0.22
105	600023	浙能电力	7,600	35,416.00	0.22
106	600048	保利地产	2,900	35,380.00	0.22
107	600690	青岛海尔	1,816	34,976.16	0.22
108	000783	长江证券	6,400	34,752.00	0.21
109	600019	宝钢股份	4,200	32,718.00	0.20
110	600061	国投资本	3,500	32,480.00	0.20
111	001979	招商蛇口	1,700	32,385.00	0.20

112	600030	中信证券	1,900	31,483.00	0.19
113	600050	中国联通	5,600	27,552.00	0.17
114	600522	中天科技	3,100	27,311.00	0.17
115	601985	中国核电	4,800	27,120.00	0.17
116	600177	雅戈尔	3,470	26,719.00	0.16
117	600332	白云山	700	26,635.00	0.16
118	601377	兴业证券	4,900	25,823.00	0.16
119	002508	老板电器	800	24,496.00	0.15
120	600688	上海石化	4,300	24,467.00	0.15
121	600011	华能国际	3,700	23,532.00	0.14
122	600959	江苏有线	4,600	23,460.00	0.14
123	000060	中金岭南	4,800	23,328.00	0.14
124	000723	美锦能源	4,200	22,806.00	0.14
125	603858	步长制药	500	21,395.00	0.13
126	601939	建设银行	3,100	20,305.00	0.12
127	601225	陕西煤业	2,329	19,144.38	0.12
128	002385	大北农	4,085	16,871.05	0.10
129	601800	中国交建	1,400	15,946.00	0.10
130	002608	江苏国信	2,299	15,863.10	0.10
131	601669	中国电建	2,700	14,472.00	0.09
132	300122	智飞生物	300	13,722.00	0.08
133	600809	山西汾酒	200	12,578.00	0.08
134	600390	五矿资本	1,600	12,400.00	0.08
135	600703	三安光电	600	11,532.00	0.07
136	300059	东方财富	860	11,334.80	0.07
137	002008	大族激光	213	11,329.47	0.07
138	002230	科大讯飞	350	11,224.50	0.07
139	601111	中国国航	1,200	10,668.00	0.07
140	600637	东方明珠	700	10,542.00	0.06
141	600482	中国动力	600	10,470.00	0.06
142	000402	金融街	1,300	10,465.00	0.06
143	600068	葛洲坝	1,400	10,094.00	0.06
144	002236	大华股份	440	9,922.00	0.06
145	600682	南京新百	600	9,864.00	0.06
146	002475	立讯精密	400	9,016.00	0.06
147	600816	安信信托	1,200	8,688.00	0.05
148	300070	碧水源	600	8,358.00	0.05
149	600196	复星医药	200	8,278.00	0.05
150	002142	宁波银行	500	8,145.00	0.05

151	600271	航天信息	300	7,581.00	0.05
152	300003	乐普医疗	200	7,336.00	0.05
153	000671	阳光城	1,200	7,164.00	0.04
154	002027	分众传媒	680	6,507.60	0.04
155	300015	爱尔眼科	200	6,458.00	0.04
156	002456	欧菲科技	400	6,452.00	0.04
157	000503	国新健康	200	6,356.00	0.04
158	601155	新城控股	200	6,194.00	0.04
159	600066	宇通客车	300	5,757.00	0.04
160	601238	广汽集团	500	5,570.00	0.03
161	002044	美年健康	240	5,424.00	0.03
162	600570	恒生电子	100	5,295.00	0.03
163	002241	歌尔股份	500	5,095.00	0.03
164	002081	金螳螂	500	5,050.00	0.03
165	600588	用友网络	200	4,902.00	0.03
166	600804	鹏博士	400	4,800.00	0.03
167	002558	巨人网络	200	4,756.00	0.03
168	600157	永泰能源	2,500	4,450.00	0.03
169	600100	同方股份	500	4,390.00	0.03
170	000166	申万宏源	1,000	4,370.00	0.03
171	002065	东华软件	500	4,300.00	0.03
172	002470	金正大	600	4,128.00	0.03
173	300017	网宿科技	300	3,213.00	0.02
174	000063	中兴通讯	200	2,606.00	0.02
175	002555	三七互娱	100	1,215.00	0.01
176	601933	永辉超市	100	764.00	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	000008	神州高铁	10,800	53,568.00	0.33
2	600649	城投控股	2,600	15,912.00	0.10
3	600256	广汇能源	1,600	6,544.00	0.04
4	601717	郑煤机	1,100	6,391.00	0.04
5	002244	滨江集团	1,200	6,240.00	0.04
6	600881	亚泰集团	1,600	5,968.00	0.04
7	000718	苏宁环球	1,600	5,872.00	0.04

8	600823	世茂股份	1,400	5,852.00	0.04
9	000750	国海证券	1,400	4,998.00	0.03
10	600611	大众交通	1,200	4,776.00	0.03
11	600811	东方集团	1,100	4,730.00	0.03
12	300315	掌趣科技	600	2,508.00	0.02
13	002174	游族网络	100	1,990.00	0.01
14	600657	信达地产	300	1,275.00	0.01

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	601318	中国平安	1,362,378.62	10.16
2	000651	格力电器	920,749.32	6.86
3	000333	美的集团	631,171.00	4.71
4	600887	伊利股份	630,156.00	4.70
5	600519	贵州茅台	609,303.00	4.54
6	600016	民生银行	595,417.00	4.44
7	600000	浦发银行	590,484.00	4.40
8	601166	兴业银行	570,381.00	4.25
9	600104	上汽集团	552,186.00	4.12
10	601601	中国太保	537,197.00	4.00
11	600383	金地集团	529,266.00	3.95
12	600036	招商银行	498,050.00	3.71
13	601328	交通银行	479,254.00	3.57
14	600015	华夏银行	474,922.00	3.54
15	601288	农业银行	457,365.00	3.41
16	600919	江苏银行	456,355.00	3.40
17	000002	万科 A	451,052.00	3.36
18	600606	绿地控股	446,935.00	3.33
19	600170	上海建工	435,910.00	3.25
20	000423	东阿阿胶	432,416.00	3.22
21	000858	五粮液	430,774.00	3.21
22	002304	洋河股份	424,705.00	3.17
23	600376	首开股份	421,914.37	3.15

24	600674	川投能源	417,166.00	3.11
25	600089	特变电工	409,553.00	3.05
26	601169	北京银行	405,829.00	3.03
27	601088	中国神华	404,368.00	3.01
28	600208	新湖中宝	397,535.00	2.96
29	600820	隧道股份	391,699.00	2.92
30	002146	荣盛发展	383,167.00	2.86
31	600332	白云山	381,366.00	2.84
32	600340	华夏幸福	380,322.00	2.84
33	601006	大秦铁路	364,350.00	2.72
34	000725	京东方 A	355,097.00	2.65
35	601186	中国铁建	351,213.00	2.62
36	000898	鞍钢股份	350,095.00	2.61
37	600585	海螺水泥	349,181.00	2.60
38	000625	长安汽车	344,539.00	2.57
39	600153	建发股份	339,074.00	2.53
40	601155	新城控股	338,795.00	2.53
41	601668	中国建筑	336,168.00	2.51
42	002294	信立泰	334,177.00	2.49
43	601211	国泰君安	329,358.37	2.46
44	002508	老板电器	327,031.00	2.44
45	000157	中联重科	325,317.00	2.43
46	600031	三一重工	324,126.00	2.42
47	600741	华域汽车	323,446.00	2.41
48	000425	徐工机械	314,261.00	2.34
49	600219	南山铝业	312,800.00	2.33
50	000402	金融街	311,147.00	2.32
51	600066	宇通客车	310,670.00	2.32
52	600028	中国石化	309,960.00	2.31
53	000568	泸州老窖	306,755.00	2.29
54	600369	西南证券	297,982.00	2.22
55	600704	物产中大	296,580.00	2.21
56	600177	雅戈尔	294,939.87	2.20
57	300144	宋城演艺	291,883.00	2.18
58	002142	宁波银行	291,597.00	2.17
59	000001	平安银行	290,439.00	2.17

60	600690	青岛海尔	288,488.00	2.15
61	601628	中国人寿	282,601.00	2.11
62	000623	吉林敖东	281,370.00	2.10
63	601009	南京银行	280,566.00	2.09
64	601788	光大证券	278,854.67	2.08
65	001979	招商蛇口	277,810.00	2.07
66	600705	中航资本	277,334.00	2.07
67	300027	华谊兄弟	276,664.00	2.06
68	000876	新希望	273,516.00	2.04
69	000069	华侨城 A	272,815.00	2.03
70	002024	苏宁易购	272,734.00	2.03

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000651	格力电器	979,500.74	7.30
2	601288	农业银行	811,297.26	6.05
3	000725	京东方 A	586,950.59	4.38
4	600606	绿地控股	563,324.73	4.20
5	601186	中国铁建	547,493.10	4.08
6	002146	荣盛发展	535,091.69	3.99
7	000333	美的集团	528,315.91	3.94
8	601328	交通银行	518,308.02	3.86
9	601088	中国神华	500,471.00	3.73
10	000898	鞍钢股份	488,969.17	3.65
11	601166	兴业银行	483,656.38	3.61
12	601601	中国太保	478,397.74	3.57
13	600383	金地集团	476,549.98	3.55
14	601155	新城控股	476,523.59	3.55
15	600000	浦发银行	476,330.28	3.55
16	601318	中国平安	466,108.00	3.47
17	600887	伊利股份	438,775.86	3.27
18	600066	宇通客车	433,151.47	3.23
19	600332	白云山	427,456.94	3.19
20	601211	国泰君安	425,832.15	3.17

21	601225	陕西煤业	423,616.45	3.16
22	000568	泸州老窖	422,221.47	3.15
23	601668	中国建筑	419,471.95	3.13
24	600688	上海石化	411,399.72	3.07
25	000876	新希望	404,339.79	3.01
26	600219	南山铝业	380,921.60	2.84
27	600104	上汽集团	380,875.56	2.84
28	600177	雅戈尔	379,965.43	2.83
29	601006	大秦铁路	371,844.01	2.77
30	600340	华夏幸福	365,706.00	2.73
31	601988	中国银行	358,916.99	2.68
32	000001	平安银行	355,574.34	2.65
33	002008	大族激光	349,805.93	2.61
34	601628	中国人寿	346,230.36	2.58
35	600028	中国石化	335,864.30	2.50
36	600535	天士力	334,794.34	2.50
37	601818	光大银行	330,848.37	2.47
38	002304	洋河股份	328,273.00	2.45
39	002385	大北农	328,037.08	2.45
40	600390	五矿资本	324,469.04	2.42
41	600690	青岛海尔	318,965.04	2.38
42	000423	东阿阿胶	317,961.00	2.37
43	600886	国投电力	316,784.92	2.36
44	000002	万科 A	313,187.05	2.33
45	600089	特变电工	312,565.61	2.33
46	000338	潍柴动力	312,237.00	2.33
47	600036	招商银行	309,345.00	2.31
48	600031	三一重工	308,587.93	2.30
49	600153	建发股份	307,274.18	2.29
50	600674	川投能源	302,385.20	2.25
51	300144	宋城演艺	295,523.00	2.20
52	600519	贵州茅台	295,026.24	2.20
53	600016	民生银行	286,259.47	2.13
54	002065	东华软件	281,362.15	2.10
55	000625	长安汽车	281,195.36	2.10
56	002024	苏宁易购	275,624.00	2.05
57	002236	大华股份	274,525.95	2.05
58	600919	江苏银行	274,520.00	2.05

59	002142	宁波银行	270,549.00	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	49,332,169.16
卖出股票收入（成交）总额	44,993,165.58

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	672,067.20	4.14
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	672,067.20	4.14

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	6,720	672,067.20	4.14

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,451.45
2	应收证券清算款	7,378.06
3	应收股利	-
4	应收利息	20,460.02
5	应收申购款	23,679.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,968.68

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000008	神州高铁	53,568.00	0.33	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中金沪深 300A	161	84,467.15	10,000,000.00	73.53%	3,599,211.02	26.47%
中金沪深 300C	123	8,757.67	0.00	0.00%	1,077,192.96	100.00%
合计	284	51,677.48	10,000,000.00	68.14%	4,676,403.98	31.86%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金沪深 300A	114,980.86	0.8455%
	中金沪深 300C	4,304.50	0.3996%
	合计	119,285.36	0.8128%

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	中金沪深 300A	10~50
	中金沪深 300C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中金沪深 300A	0
	中金沪深 300C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	68.14	10,000,000.00	68.14	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	68.14	10,000,000.00	68.14	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金沪深 300A	中金沪深 300C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）基金份额总额	10,001,300.00	-
本报告期期初基金份额总额	10,839,298.31	268,832.88
本报告期基金总申购份额	3,613,305.87	1,704,398.02
减：本报告期基金总赎回份额	853,393.16	896,037.94
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	13,599,211.02	1,077,192.96

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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	67,493,355.54	71.55%	49,358.52	71.55%	-

长江证券	2	26,831,979.20	28.45%	19,621.98	28.45%	-
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	1,384,196.30	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
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	中金沪深 300 指数增强型发起	《中国证券报》、《上海	2018 年 1 月 19 日

	式证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	证券报》、《证券时报》及/或公司网站	
2	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
3	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书及其摘要（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
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	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
6	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
7	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
8	中金沪深 300 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
9	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
10	中金沪深 300 指数增强型发起	《中国证券报》、《上海	2018 年 4 月 23 日

	式证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	证券报》、《证券时报》及/或公司网站	
11	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	68.14%
产品特有风险							
<p>(1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险</p> <p>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。</p> <p>(2) 目标指数波动的风险</p> <p>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。</p> <p>(3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险</p> <p>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：</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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。</p> <p>(4) 目标指数变更的风险</p> <p>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。</p> <p>(5) 主动增强投资的风险</p> <p>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</p>							

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沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金沪深 300 指数指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金沪深 300 指数指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金沪深 300 指数指数增强型发起式证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金沪深 300 指数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

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