

# 中金中证 500 指数增强型发起式 证券投资基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 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 2019 年 3 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。

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

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	27
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	56
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	89
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	90
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	90

8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	90
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	90
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	90
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	90
8.12	投资组合报告附注 .....	91
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>93</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	93
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	93
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	93
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	94
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>95</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>96</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	96
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	96
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	96
11.4	基金投资策略的改变 .....	96
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	96
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	96
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	97
11.8	其他重大事件 .....	98
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>102</b>
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	102
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	103
<b>§13</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>104</b>
13.1	备查文件目录 .....	104
13.2	存放地点 .....	104
13.3	查阅方式 .....	104

## § 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	37,715,250.86 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	30,788,524.27 份	6,926,726.59 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	本基金作为股票指数增强型发起式证券投资基金，股票投资策略为本基金的核心策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合以及量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化。其他策略还包括债券投资策略和股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金，属于较高预期风险、较高

	预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
--	---

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李虹	郭明
	联系电话	010-63211122	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95588
传真		010-66159121	010-66105798
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100004	100140
法定代表人		孙菁（代）	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	2018 年		2017 年		2016 年 7 月 22 日(基金合同 生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C	中金中证 500A	中金中证 500C	中金中证 500A	中金中 证 500C
本期已实现收 益	-4,542,207.24	-1,000,831.36	608,224.85	53,744.13	443,915.38	-2.41
本期利润	-5,987,463.18	-1,106,822.86	752,397.25	28,629.90	242,108.70	-5.10
加权平均基金 份额本期利润	-0.3030	-0.3069	0.0684	0.0707	0.0239	-0.0551
本期加权平均 净值利润率	-31.38%	-32.52%	6.50%	6.48%	2.30%	-5.29%
本期基金份额 净值增长率	-25.69%	-25.62%	6.79%	7.64%	2.49%	-5.10%
3.1.2 期末数 据和指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
期末可供分配 利润	-5,748,514.36	-1,245,040.26	1,249,313.55	87,529.63	255,314.03	2.28
期末可供分配 基金份额利润	-0.1867	-0.1797	0.0945	0.1029	0.0249	0.0246
期末基金资产 净值	25,040,009.91	5,681,686.33	14,467,345.35	938,284.63	10,525,826.87	94.90
期末基金份额 净值	0.8133	0.8203	1.0945	1.1029	1.0249	1.0246
3.1.3 累计期 末指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
基金份额累计	-18.67%	-24.03%	9.45%	2.15%	2.49%	-5.10%

净值增长率						
-------	--	--	--	--	--	--

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

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

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

4、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金中证 500A

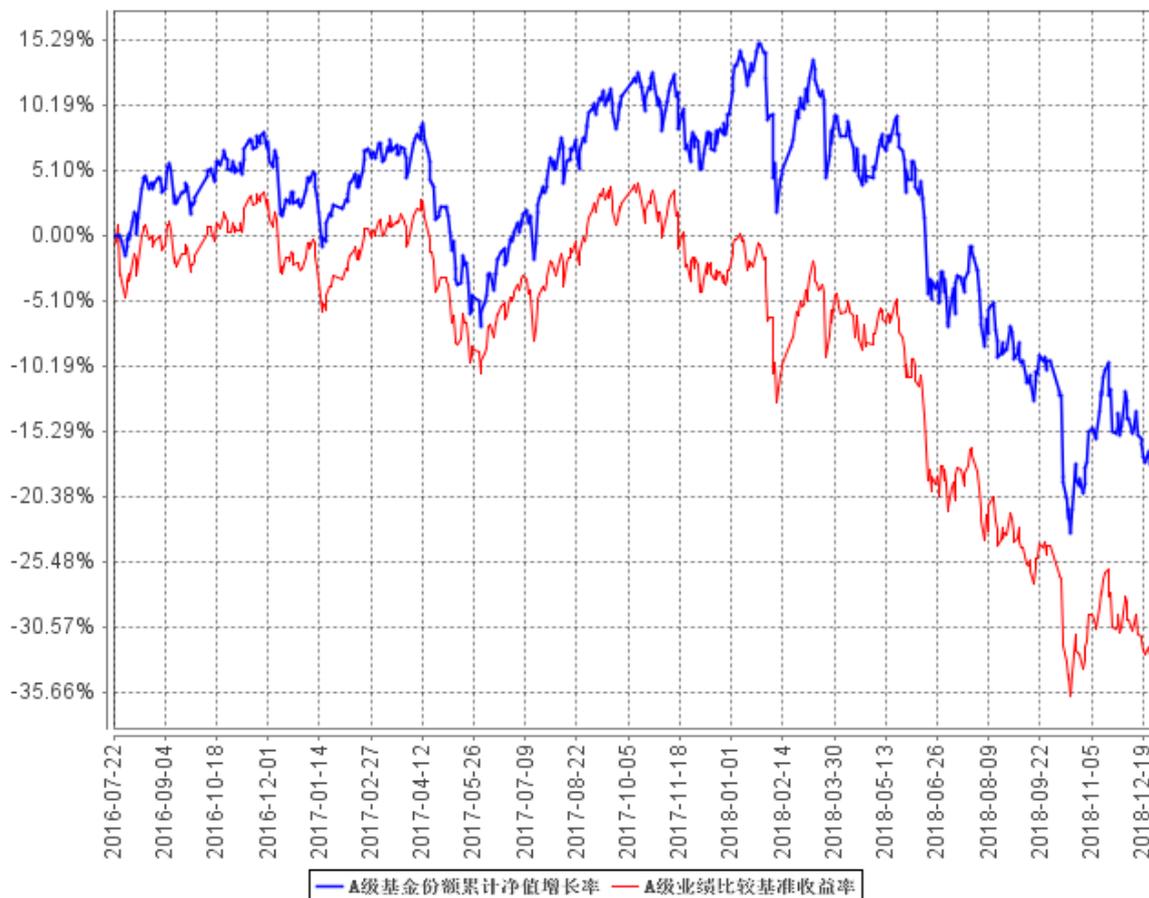
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.80%	1.73%	-12.52%	1.74%	2.72%	-0.01%
过去六个月	-16.28%	1.46%	-19.15%	1.50%	2.87%	-0.04%
过去一年	-25.69%	1.40%	-31.85%	1.43%	6.16%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-18.67%	1.12%	-33.71%	1.14%	15.04%	-0.02%

中金中证 500C

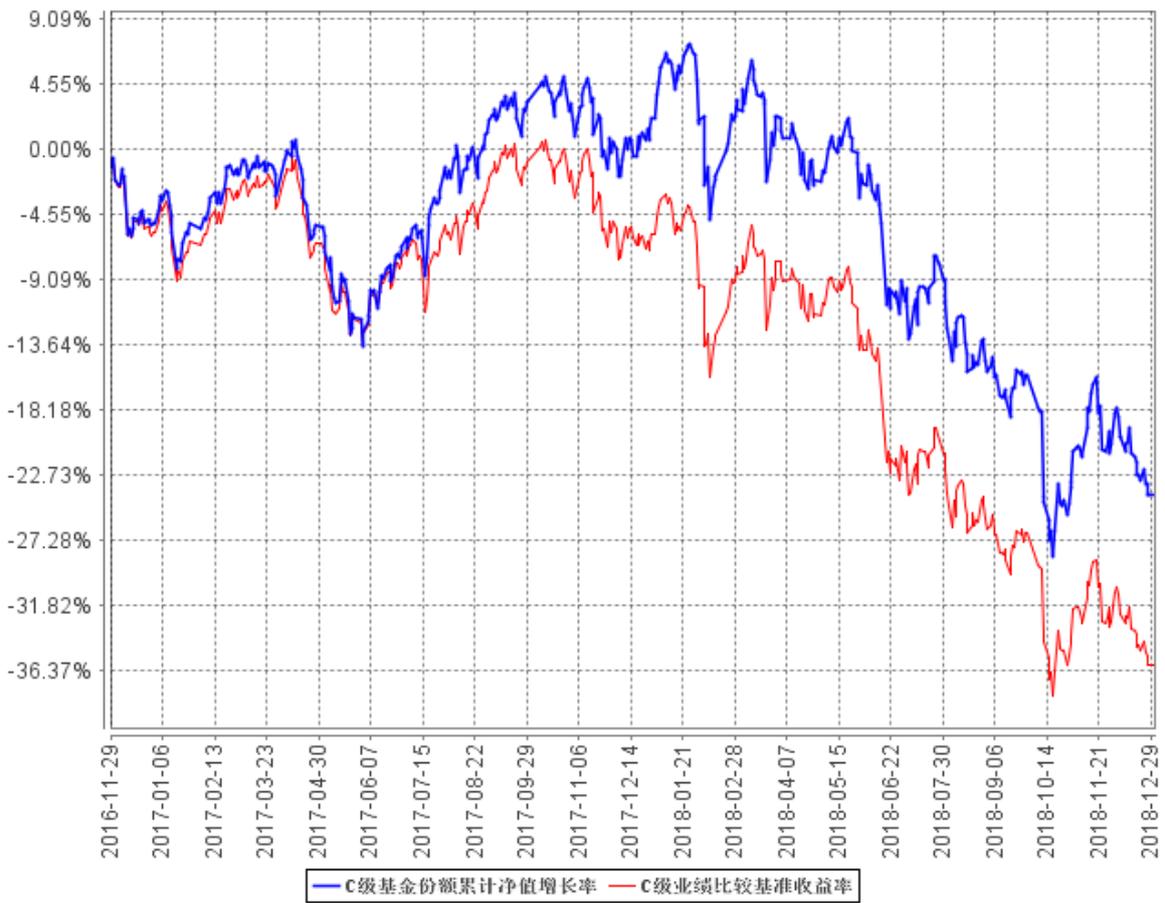
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.82%	1.73%	-12.52%	1.74%	2.70%	-0.01%
过去六个月	-16.36%	1.46%	-19.15%	1.50%	2.79%	-0.04%
过去一年	-25.62%	1.40%	-31.85%	1.43%	6.23%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-24.03%	1.17%	-35.88%	1.18%	11.85%	-0.01%

### 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

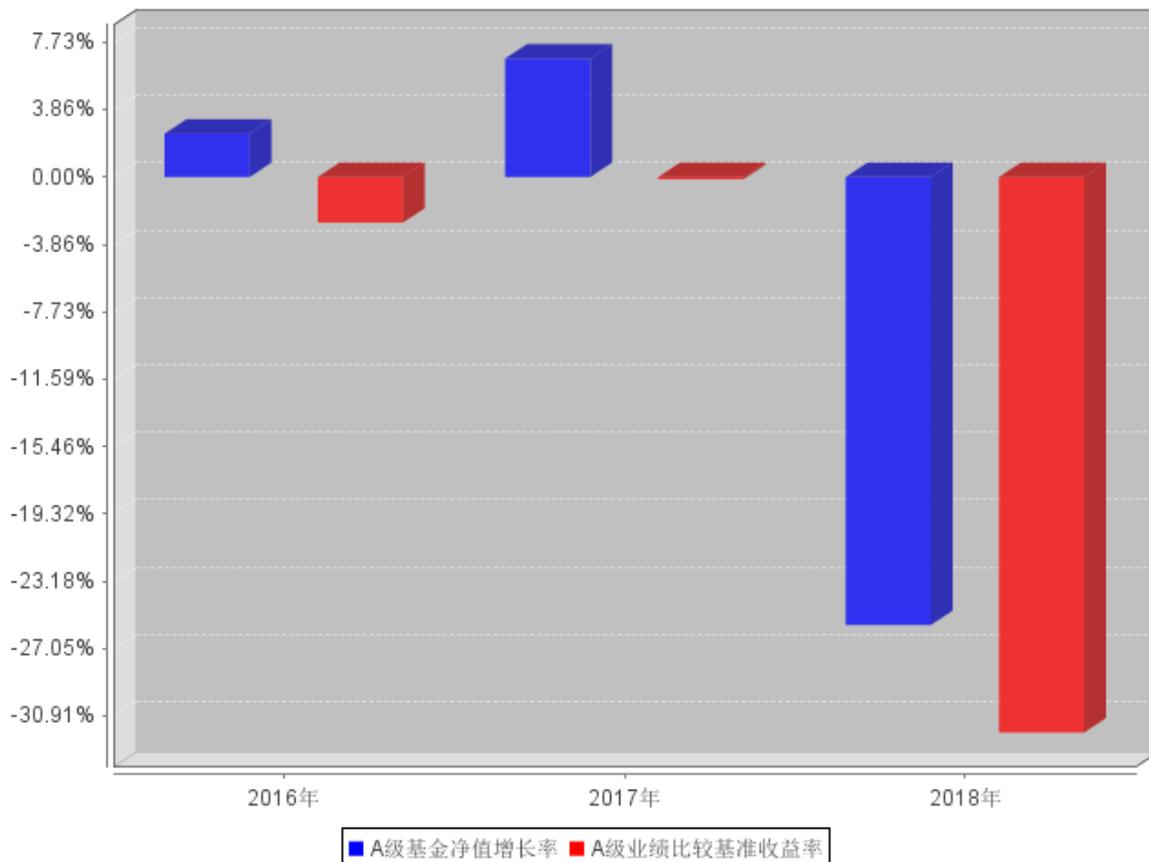


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

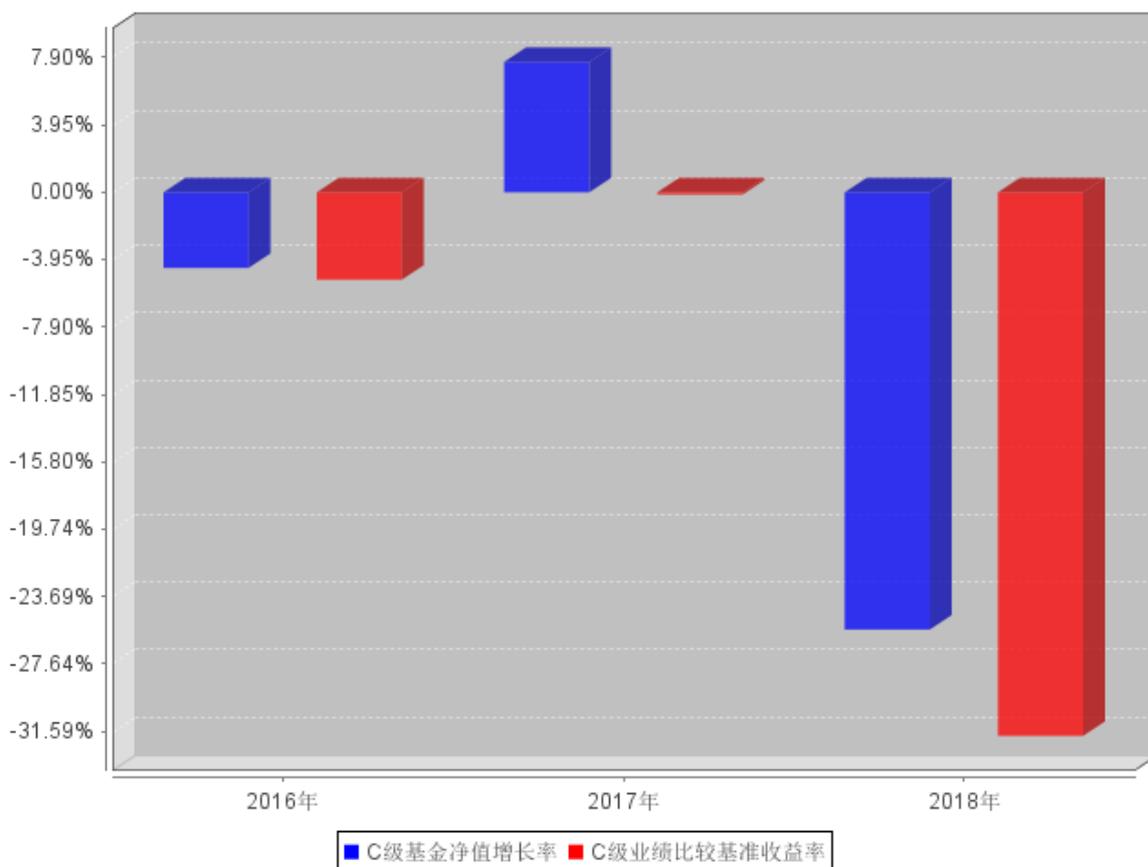


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，自成立以来本基金未进行收益分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家单一股东发起设立的基金公司，注册资本 3.5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2018 年 12 月 31 日，公司共管理 27 只开放式基金，证券投资基金管理规模 153.48 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，统计学博士，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。2014 年 11 月加入公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任公司量化公募投资部基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《中金基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施效果评估、信息披露与报告制度等多方面进行了规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，公司建立了科学合理的投资运作体系和规范的投资流程，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，本基金采用量化模型进行选股来增强指数。2018 年指数跌幅较大，本基金虽然也随指数下跌，但还是获取了一定的超额收益。新的模型在不断地研发和更新中，我们会努力在控制跟踪误差的情况下力争带来更多的超额收益。

2018 年中国经济的形势较为严峻。第一 A 股上市公司盈利同比增速在 2018 年上半年见顶后开始向下，短期的经济下行压力较大。第二经济结构性调整和升级，在短期对市场造成一定的压力。第三中美贸易摩擦带来国际政治经济环境的不稳定性上升，中国经济发展的外部环境形势不容乐观。2018 年 A 股全年上证 50 指数下跌 19.83%，沪深 300 指数下跌 25.31%，中证 500 指数下跌 33.32%，创业板指下跌 28.65%。

#### 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 0.8133 元，本报告期基金份额净值增长率为 -25.69%；截至本报告期末中金中证 500C 基金份额净值为 0.8203 元，本报告期基金份额净值增长率为 -25.62%；同期业绩比较基准收益率为 -31.85%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，中国经济增长在国际周期及国内因素共同作用下可能继续下行，尽管 2018 年下半年至今市场预期已经在调低，但是考虑到增长下行风险仍未体现充分，2019 年股票资产仍可能承受较大压力。在 2019 年最初的 1 个多月里，A 股各大指数都有较大幅度的反弹，这主要是因为中美贸易谈判呈现出乐观的预期以及 2018 年的下跌已经使多个指数的估值处于历史低位。这就更加说明了以中美关系为代表的国际政治经济环境是影响中国经济以及 A 股市场的重要因素，2019 年必须密切关注并迅速反应。如果中美谈判取得阶段性成果，那么必须认真分析其对各个行业的影响。而对个股而言，其自身的业绩以及随之而来的估值、成长预期等指标将成为影响其股价在行业中相对表现的重要指标。2019 年风险和机遇共存。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作，强化制度完善及对制度执行情况的监督检查，根据不同的基金特点与发展情况，及时界定新的风险点，评价风险级别，并纳入稽核计划，有效保证了基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

- 1) 本基金管理人以中国证监会《季度监察稽核项目表》为基础，对本基金的投资、研究、交

易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，及定期进行有重点的检查。2) 研究、投资交易环节，本基金管理人对投资对象建立筛选流程、对投资对象池（库）进行日常维护与更新，并对基金的投资比例进行日常监控，对关联交易进行日常维护，定期关注基金持仓流动性风险，并对公平交易执行情况进行检查等。3) 营销与销售方面，本基金管理人对本基金宣传推介材料、销售服务协议合规性等进行检查，同时加强对基金销售部门的合规培训。4) 基金运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、资金清算业务的检查力度，保证基金运营安全、准确。5) 法律合规方面，本基金管理人对公司制度规范、合同协议、产品方案、对外文件等进行合规性审核。6) 信息披露方面，本基金管理人严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露内容的真实、准确、完整、及时。此外，本基金管理人对监察稽核工作流程进行了完善和优化，并按照既定的稽核计划开展内部稽核，对检查出来的问题及时提出改进意见并督促相关部门有效落实。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的管理人——中金基金管理有限公司在中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。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 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1901210 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“中金中证 500 指数增强基金”)财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了中金中证 500 指数增强基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中金中证 500 指数增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层

	<p>对其他信息负责。其他信息包括中金中证 500 指数增强基金 2018 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责评估中金中证 500 指数增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 (如适用)，并运用持续经营假设，除非中金中证 500 指数增强基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司治理层负责监督中金中证 500 指数增强基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设</p>

	<p>计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对中金中证 500 指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致中金中证 500 指数增强基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	奚霞	刘珊珊
会计师事务所的地址	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层	
审计报告日期	2019 年 3 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	537,286.57	1,202,994.99
结算备付金		190,805.99	148,488.75
存出保证金		4,017.26	7,207.02
交易性金融资产	7.4.7.2	30,794,935.29	14,361,549.44
其中：股票投资		29,087,455.29	14,351,009.60
基金投资		-	-
债券投资		1,707,480.00	10,539.84
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	25,649.66
应收利息	7.4.7.5	47,741.77	332.57
应收股利		-	-
应收申购款		90,344.64	31,689.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		31,665,131.52	15,777,911.94

负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		500,000.00	-
应付证券清算款		173,694.42	47,092.16
应付赎回款		57,775.92	18,799.82
应付管理人报酬		11,710.04	6,414.45
应付托管费		3,513.03	1,924.33
应付销售服务费		15,278.25	1,745.59
应付交易费用	7.4.7.7	120,600.10	225,720.90
应交税费		-	-
应付利息		-139.71	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	61,003.23	70,584.71
负债合计		943,435.28	372,281.96
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	37,715,250.86	14,068,786.80
未分配利润	7.4.7.10	-6,993,554.62	1,336,843.18
所有者权益合计		30,721,696.24	15,405,629.98
负债和所有者权益总计		31,665,131.52	15,777,911.94

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，中金中证 500A 基金份额净值 0.8133 元，中金中证 500C 基金份额净值 0.8203 元；中金中证 500 基金份额总额 37,715,250.86 份（其中 A 类 30,788,524.27 份，C 类 6,926,726.59 份）。

## 7.2 利润表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-6,459,758.38	1,475,489.55
1.利息收入		31,122.13	9,007.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	9,232.67	9,004.14
债券利息收入		21,841.13	3.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		48.33	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,970,733.20	1,337,310.71
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-5,260,745.19	1,269,581.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-81.51	679.45
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	290,093.50	67,050.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,551,247.44	119,058.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	31,100.13	10,113.52
<b>减：二、费用</b>		634,527.66	694,462.40
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	112,292.47	59,870.62
2. 托管费	7.4.10.2.2	33,687.83	17,961.16
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	13,532.66	1,745.59
4. 交易费用	7.4.7.18	408,123.68	542,167.17

5. 利息支出		2,446.71	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,446.71	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.19	64,444.31	72,717.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-7,094,286.04</b>	<b>781,027.15</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-7,094,286.04</b>	<b>781,027.15</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-7,094,286.04	-7,094,286.04
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）	23,646,464.06	-1,236,111.76	22,410,352.30
其中：1.基金申购款	32,904,038.15	-1,388,930.14	31,515,108.01
2.基金赎回款	-9,257,574.09	152,818.38	-9,104,755.71
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)	37,715,250.86	-6,993,554.62	30,721,696.24
项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	10,270,605.46	255,316.31	10,525,921.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	781,027.15	781,027.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	3,798,181.34	300,499.72	4,098,681.06
其中：1.基金申购款	6,863,132.98	544,868.10	7,408,001.08
2.基金赎回款	-3,064,951.64	-244,368.38	-3,309,320.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	14,068,786.80	1,336,843.18	15,405,629.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

孙菁

张纳

白娜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 (以下简称“本基金”) 依据中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 于 2016 年 7 月 5 日证监许可 [2016] 1517 号《关于准予中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准, 由中金基金依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式指数型基金, 存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金, 托管人为中国工商银行股份有限公司 (以下简称“工商银行”)。

本基金通过中金基金直销中心公开发售, 募集期为 2016 年 7 月 18 日。经向中国证监会备案, 《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 22 日正式生效, 合同生效日基金实收份额为 10,001,000.00 份, 发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙) 审验并出具验资报告。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定, 本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金, 在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上, 通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制, 力争实现超越目标指数的投资收益, 谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%, 年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外, 为更好地实现投资目标, 本基金可少量投资于部分非成分股 (包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具 (权证、股指期货等)、债券资产 (国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、债券回购、银行存款等固定收益类资产, 以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会的相关规定)。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

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

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

(2) 应收款项以实际利率法按摊余成本计量；

(3) 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

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

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

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

(1) 所转移金融资产的账面价值；

(2) 因转移而收到的对价。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支

持有的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税 (如适用) 后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税 (如适用) 后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次

性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益 / (损失) 核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后两类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活

跃) 等情况, 本基金根据中国证监会公告 [2017] 13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》, 根据具体情况采用《关于发布中基协 (AMAC) 基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关

于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(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”）运营资管产品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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(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) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

(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) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
活期存款	537,286.57	1,202,994.99
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：	537,286.57	1,202,994.99

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2018 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	30,718,953.93	29,087,455.29	-1,631,498.64	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,709,980.00	1,707,480.00	-2,500.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,709,980.00	1,707,480.00	-2,500.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	32,428,933.93	30,794,935.29	-1,633,998.64	
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日			

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		14,434,500.64	14,351,009.60	-83,491.04
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	9,800.00	10,539.84	739.84
	银行间市场	-	-	-
	合计	9,800.00	10,539.84	739.84
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		14,444,300.64	14,361,549.44	-82,751.20

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	110.51	253.03
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	94.49	73.48
应收债券利息	47,534.79	2.43

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	1.98	3.63
合计	47,741.77	332.57

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	120,600.10	225,720.90
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	120,600.10	225,720.90

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	13.01	-
预提费用	60,000.00	70,000.00
指数使用费	990.22	584.71
合计	61,003.23	70,584.71

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 500A	
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	20,948,655.83	20,948,655.83
本期赎回（以“-”号填列）	-3,378,163.36	-3,378,163.36
- 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	30,788,524.27	30,788,524.27

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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	850,755.00	850,755.00
本期申购	11,955,382.32	11,955,382.32
本期赎回（以“-”号填列）	-5,879,410.73	-5,879,410.73
- 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	6,926,726.59	6,926,726.59

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

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

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金中证 500A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,315,347.40	-66,033.85	1,249,313.55
本期利润	-4,542,207.24	-1,445,255.94	-5,987,463.18
本期基金份额交易产生的变动数	-196,296.69	-814,068.04	-1,010,364.73
其中：基金申购款	-89,712.20	-963,529.37	-1,053,241.57
基金赎回款	-106,584.49	149,461.33	42,876.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,423,156.53	-2,325,357.83	-5,748,514.36

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	-1,000,831.36	-105,991.50	-1,106,822.86
本期基金份额交易产生的变动数	192,010.90	-417,757.93	-225,747.03
其中：基金申购款	363,273.87	-698,962.44	-335,688.57
基金赎回款	-171,262.97	281,204.51	109,941.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-717,053.93	-527,986.33	-1,245,040.26

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	6,857.95	6,114.25

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,275.10	2,800.35
其他	99.62	89.54
合计	9,232.67	9,004.14

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	147,884,545.17	204,338,893.02
减：卖出股票成本总额	153,145,290.36	203,069,311.96
买卖股票差价收入	-5,260,745.19	1,269,581.06

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-81.51	679.45
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-81.51	679.45

### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	737,392.63	4,080.03
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	714,157.70	3,400.00
减：应收利息总额	23,316.44	0.58
买卖债券差价收入	-81.51	679.45

### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无赎回差价收入。

### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无申购差价收入。

### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.14 衍生工具收益

#### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.14.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无其他衍生工具投资收益。

### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

股票投资产生的股利收益	290,093.50	67,050.20
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	290,093.50	67,050.20

#### 7.4.7.16 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-1,551,247.44	119,058.17
——股票投资	-1,548,007.60	118,318.33
——债券投资	-3,239.84	739.84
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-1,551,247.44	119,058.17

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	30,439.35	9,764.95
基金转换费收入-003016	660.78	35.47

基金转换费收入-003578	-	313.10
合计	31,100.13	10,113.52

#### 7.4.7.18 交易费用

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 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	408,123.68	542,167.17
银行间市场交易费用	-	-
合计	408,123.68	542,167.17

#### 7.4.7.19 其他费用

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 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	40,000.00
信息披露费	30,000.00	30,000.00
指数使用费	3,593.31	1,915.86
汇划手续费	851.00	802.00
其他	-	-
合计	64,444.31	72,717.86

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中金基金管理有限公司（以下简称“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（以下简称“工商银行”）	基金托管人
中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中投证券有限责任公司	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构
中金资本运营有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金浦成投资有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金期货有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中国国际金融（香港）有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

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。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

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。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	112,292.47	59,870.62
其中：支付销售机构的客户维护费	13,895.21	1,904.69

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

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	33,687.83	17,961.16

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计

中金基金	-	218.80	218.80
中金公司	-	67.12	67.12
合计	-	285.92	285.92
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	180.11	180.11
合计	-	180.11	180.11

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
期初持有的基金份额	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	32.4796%	-

项目	上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
期初持有的基金份额	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	75.6542%	-

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金总赎回份额含转换出份额；  
2、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	537,286.57	6,857.95	1,202,994.99	6,114.25

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 12 月 31 日的相关余额为人民币 194,823.25 元(2017 年 12

月 31 日：人民币 155,695.77 元)，本期间产生的利息收入为人民币 2,374.72 元（自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日止期间：人民币 2,889.89 元）。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000708	大冶特钢	2018 年 12 月 25 日	重大事项停牌	8.77	2019 年 1 月 3 日	9.65	2,300	21,505.97	20,171.00	-
000987	越秀金控	2018 年 12 月 25 日	重大事项停牌	7.97	2019 年 1 月 10 日	8.77	100	794.00	797.00	-

002323	雅百特	2018 年 8 月 17 日	重大 事项 停牌	1.31	-	-	200	1,071.80	262.00	-
--------	-----	-----------------------	----------------	------	---	---	-----	----------	--------	---

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末及上年度末均无银行间市场债券正回购余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 500,000.00 元，于 2019 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

### 7.4.13.2 信用风险

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

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资（上年度末：同）。

#### 7.4.13.2.2 按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）

#### 7.4.13.2.3 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）

#### 7.4.13.2.4 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 12 月 31 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：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 7.4.13.2.5 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）

#### 7.4.13.2.6 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）

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，针对基金组合的流动性管

理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性风险预警及危机的处理、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性风险指标进行监控。

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在行业 and 个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	537,286.57	-	-	-	537,286.57
结算备付金	190,805.99	-	-	-	190,805.99
存出保证金	4,017.26	-	-	-	4,017.26
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	29,087,455.29	29,087,455.29
交易性金融资产-债券投资	1,707,480.00	-	-	-	1,707,480.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	47,741.77	47,741.77
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	90,344.64	90,344.64
资产总计	2,439,589.82	-	-	29,225,541.70	31,665,131.52
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	500,000.00	-	-	-	500,000.00
应付证券清算款	-	-	-	173,694.42	173,694.42
应付赎回款	-	-	-	57,775.92	57,775.92
应付管理人报酬	-	-	-	11,710.04	11,710.04
应付托管费	-	-	-	3,513.03	3,513.03
应付交易费用	-	-	-	120,600.10	120,600.10
应付销售服务费	-	-	-	15,278.25	15,278.25
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-139.71	-139.71
其他负债	-	-	-	61,003.23	61,003.23
负债总计	500,000.00	-	-	443,435.28	943,435.28
利率敏感度缺口	1,939,589.82	-	-	28,782,106.42	30,721,696.24
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账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	103.01	-
	市场利率上升 25 个基点	-103.01	-

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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 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	29,087,455.29	94.68	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	1,707,480.00	5.56	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	30,794,935.29	100.24	14,361,549.44	93.22

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,485,163.59	776,968.89

	业绩比较基准下降 5%	-1,485,163.59	-776,968.89
--	-------------	---------------	-------------

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 公允价值计量的层次

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

	2018 年 12 月 31 日			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	29,066,225.29	21,230.00	-	29,087,455.29
债券投资	-	1,707,480.00	-	1,707,480.00
合计	29,066,225.29	1,728,710.00	-	30,794,935.29

单位：人民币元

	2017 年 12 月 31 日			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	13,739,027.42	611,982.18	-	14,351,009.60
债券投资	-	10,539.84	-	10,539.84
合计	13,739,027.42	622,522.02	-	14,361,549.44

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次，账面价值为人民币 21,230.00 元（2017 年 12 月 31 日：611,982.18 元）。于 2018 年 12 月 31 日及 2017 年 12 月 31 日，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的三个层次之间没有发生其他重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

##### (b) 第二层次及第三层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售

期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2017 年 12 月 31 日：无)。

(2) 其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	29,087,455.29	91.86
	其中：股票	29,087,455.29	91.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,707,480.00	5.39
	其中：债券	1,707,480.00	5.39
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	728,092.56	2.30
8	其他各项资产	142,103.67	0.45
9	合计	31,665,131.52	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	29,090.00	0.09
B	采矿业	1,424,687.63	4.64
C	制造业	16,372,549.15	53.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,144,044.75	3.72

E	建筑业	423,143.35	1.38
F	批发和零售业	1,936,192.03	6.30
G	交通运输、仓储和邮政业	1,087,870.00	3.54
H	住宿和餐饮业	80,340.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,070,047.26	3.48
J	金融业	421,864.64	1.37
K	房地产业	1,061,405.60	3.45
L	租赁和商务服务业	235,710.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	43,328.32	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	98,709.00	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,204.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	717,920.56	2.34
S	综合	109,825.00	0.36
	合计	26,274,931.29	85.53

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	49,257.00	0.16
B	采矿业	1,348.00	0.00
C	制造业	1,821,875.00	5.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	94,952.00	0.31
E	建筑业	17,510.00	0.06
F	批发和零售业	150,986.00	0.49

G	交通运输、仓储和邮政业	139,550.00	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	77,334.00	0.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	302,790.00	0.99
L	租赁和商务服务业	26,280.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	21,103.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	22,560.00	0.07
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	80,007.00	0.26
S	综合	6,972.00	0.02
	合计	2,812,524.00	9.15

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末，本基金未持有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601678	滨化股份	133,065	561,534.30	1.83
2	002004	华邦健康	119,500	550,895.00	1.79
3	600580	卧龙电气	83,988	529,124.40	1.72
4	603766	隆鑫通用	103,000	421,270.00	1.37
5	002048	宁波华翔	36,272	378,316.96	1.23

6	601717	郑煤机	67,186	371,538.58	1.21
7	002233	塔牌集团	35,700	359,142.00	1.17
8	601016	节能风电	150,500	349,160.00	1.14
9	600694	大商股份	13,900	336,241.00	1.09
10	000778	新兴铸管	73,585	317,151.35	1.03
11	300026	红日药业	102,900	313,845.00	1.02
12	600195	中牧股份	29,420	313,028.80	1.02
13	600597	光明乳业	37,000	309,320.00	1.01
14	600782	新钢股份	59,600	303,364.00	0.99
15	603225	新凤鸣	15,951	299,081.25	0.97
16	600881	亚泰集团	90,350	299,058.50	0.97
17	601001	大同煤业	66,227	282,789.29	0.92
18	000598	兴蓉环境	70,146	282,688.38	0.92
19	601005	重庆钢铁	131,300	254,722.00	0.83
20	601928	凤凰传媒	30,900	245,346.00	0.80
21	000552	靖远煤电	95,300	243,968.00	0.79
22	600618	氯碱化工	37,262	241,830.38	0.79
23	600808	马钢股份	66,976	231,736.96	0.75
24	600971	恒源煤电	41,106	231,426.78	0.75
25	600611	大众交通	57,900	231,021.00	0.75
26	000039	中集集团	21,713	229,723.54	0.75
27	000501	鄂武商 A	24,000	227,520.00	0.74
28	000877	天山股份	31,300	222,543.00	0.72
29	600017	日照港	80,300	221,628.00	0.72
30	600623	华谊集团	26,700	215,736.00	0.70
31	600863	内蒙华电	93,127	215,123.37	0.70
32	002440	闰土股份	23,900	215,100.00	0.70
33	300088	长信科技	51,600	214,140.00	0.70

34	600908	无锡银行	40,400	211,696.00	0.69
35	600657	信达地产	52,800	207,504.00	0.68
36	600801	华新水泥	12,400	207,328.00	0.67
37	600282	南钢股份	59,508	203,517.36	0.66
38	600582	天地科技	58,084	198,647.28	0.65
39	002317	众生药业	23,700	197,895.00	0.64
40	002332	仙琚制药	32,143	197,036.59	0.64
41	000999	华润三九	7,922	196,940.92	0.64
42	600006	东风汽车	54,500	196,200.00	0.64
43	000848	承德露露	24,100	193,764.00	0.63
44	600266	北京城建	24,100	190,872.00	0.62
45	600743	华远地产	76,600	185,372.00	0.60
46	002092	中泰化学	26,200	184,710.00	0.60
47	600567	山鹰纸业	58,800	183,456.00	0.60
48	600557	康缘药业	17,615	181,082.20	0.59
49	600765	中航重机	24,200	180,048.00	0.59
50	600655	豫园股份	24,200	179,080.00	0.58
51	002444	巨星科技	18,320	173,673.60	0.57
52	002128	露天煤业	23,600	168,976.00	0.55
53	000887	中鼎股份	16,400	165,968.00	0.54
54	600811	东方集团	45,000	164,700.00	0.54
55	000623	吉林敖东	11,100	160,173.00	0.52
56	600737	中粮糖业	21,700	159,712.00	0.52
57	600348	阳泉煤业	31,200	157,248.00	0.51
58	000729	燕京啤酒	27,600	155,664.00	0.51
59	002589	瑞康医药	21,999	153,333.03	0.50
60	000049	德赛电池	5,200	149,136.00	0.49
61	600143	金发科技	29,700	147,015.00	0.48

62	600160	巨化股份	21,898	145,183.74	0.47
63	601866	中远海发	63,000	143,640.00	0.47
64	000685	中山公用	20,400	142,800.00	0.46
65	002345	潮宏基	31,400	140,358.00	0.46
66	002152	广电运通	25,000	140,250.00	0.46
67	600633	浙数文化	16,800	136,920.00	0.45
68	000636	风华高科	12,600	135,324.00	0.44
69	601801	皖新传媒	20,100	134,268.00	0.44
70	002640	跨境通	12,400	133,920.00	0.44
71	600757	长江传媒	19,676	128,287.52	0.42
72	002251	步步高	17,200	127,624.00	0.42
73	603866	桃李面包	2,800	126,448.00	0.41
74	600058	五矿发展	19,400	126,294.00	0.41
75	603198	迎驾贡酒	8,900	125,579.00	0.41
76	600426	华鲁恒升	10,400	125,528.00	0.41
77	600594	益佰制药	22,700	125,304.00	0.41
78	600022	山东钢铁	78,000	122,460.00	0.40
79	300010	立思辰	16,500	119,790.00	0.39
80	601689	拓普集团	8,100	119,718.00	0.39
81	600820	隧道股份	19,000	118,940.00	0.39
82	601231	环旭电子	13,000	117,000.00	0.38
83	600970	中材国际	21,053	115,159.91	0.37
84	000930	中粮生化	15,400	114,268.00	0.37
85	600307	酒钢宏兴	59,400	113,454.00	0.37
86	000937	冀中能源	29,448	111,018.96	0.36
87	002244	滨江集团	27,700	110,246.00	0.36
88	600859	王府井	8,100	109,836.00	0.36
89	600777	新潮能源	57,500	109,825.00	0.36

90	600827	百联股份	12,900	109,005.00	0.35
91	601608	中信重工	41,700	108,420.00	0.35
92	600060	海信电器	12,400	107,632.00	0.35
93	000541	佛山照明	20,050	103,859.00	0.34
94	601966	玲珑轮胎	7,600	103,740.00	0.34
95	002276	万马股份	20,500	103,320.00	0.34
96	600835	上海机电	7,100	103,305.00	0.34
97	600428	中远海特	30,500	99,125.00	0.32
98	000021	深科技	17,200	98,900.00	0.32
99	603556	海兴电力	7,440	96,720.00	0.31
100	600062	华润双鹤	7,920	95,752.80	0.31
101	601019	山东出版	12,100	94,622.00	0.31
102	600056	中国医药	7,500	94,275.00	0.31
103	002195	二三四五	25,356	93,563.64	0.30
104	600572	康恩贝	15,414	91,405.02	0.30
105	002064	华峰氨纶	21,610	90,545.90	0.29
106	603355	莱克电气	4,200	90,300.00	0.29
107	000528	柳 工	14,378	87,274.46	0.28
108	000537	广宇发展	11,400	85,386.00	0.28
109	002603	以岭药业	7,849	82,100.54	0.27
110	002375	亚厦股份	16,000	80,640.00	0.26
111	600565	迪马股份	30,978	80,542.80	0.26
112	600388	龙净环保	7,800	79,170.00	0.26
113	603328	依顿电子	7,841	77,625.90	0.25
114	000926	福星股份	12,500	76,500.00	0.25
115	600141	兴发集团	7,300	75,117.00	0.24
116	002818	富森美	3,600	74,844.00	0.24
117	002221	东华能源	9,200	74,152.00	0.24

118	600478	科力远	18,800	73,320.00	0.24
119	600258	首旅酒店	4,500	71,820.00	0.23
120	600584	长电科技	8,700	71,688.00	0.23
121	002503	搜于特	30,500	71,675.00	0.23
122	000028	国药一致	1,700	70,448.00	0.23
123	601200	上海环境	5,200	69,004.00	0.22
124	600409	三友化工	11,603	66,369.16	0.22
125	002563	森马服饰	7,400	66,008.00	0.21
126	002426	胜利精密	28,400	65,888.00	0.21
127	000581	威孚高科	3,592	63,434.72	0.21
128	600507	方大特钢	6,200	61,938.00	0.20
129	002308	威创股份	13,918	61,935.10	0.20
130	000878	云南铜业	7,700	61,061.00	0.20
131	600642	申能股份	12,400	60,512.00	0.20
132	000060	中金岭南	15,100	59,796.00	0.19
133	600169	太原重工	26,800	59,764.00	0.19
134	000488	晨鸣纸业	10,613	59,538.93	0.19
135	600717	天津港	8,300	58,681.00	0.19
136	000830	鲁西化工	5,950	58,310.00	0.19
137	600787	中储股份	11,500	57,500.00	0.19
138	000612	焦作万方	14,400	57,024.00	0.19
139	603888	新华网	4,400	56,496.00	0.18
140	601168	西部矿业	9,700	56,454.00	0.18
141	600125	铁龙物流	8,000	56,000.00	0.18
142	002344	海宁皮城	12,300	55,965.00	0.18
143	600563	法拉电子	1,300	54,782.00	0.18
144	600037	歌华有线	6,261	53,781.99	0.18
145	600291	西水股份	5,200	53,508.00	0.17

146	002273	水晶光电	5,537	52,933.72	0.17
147	600138	中青旅	3,900	50,271.00	0.16
148	601179	中国西电	14,800	49,728.00	0.16
149	603000	人民网	6,800	49,640.00	0.16
150	600053	九鼎投资	2,100	49,434.00	0.16
151	600879	航天电子	9,000	48,690.00	0.16
152	601326	秦港股份	15,400	48,356.00	0.16
153	002410	广联达	2,300	47,863.00	0.16
154	300055	万邦达	6,200	47,554.00	0.15
155	603885	吉祥航空	3,700	46,361.00	0.15
156	300002	神州泰岳	14,000	46,200.00	0.15
157	300253	卫宁健康	3,700	46,102.00	0.15
158	600329	中新药业	3,700	46,028.00	0.15
159	600759	洲际油气	19,400	45,784.00	0.15
160	000997	新大陆	3,100	45,384.00	0.15
161	600645	中源协和	2,668	43,328.32	0.14
162	000563	陕国投 A	15,900	42,612.00	0.14
163	600098	广州发展	7,400	41,884.00	0.14
164	300182	捷成股份	9,501	40,759.29	0.13
165	601880	大连港	22,000	40,700.00	0.13
166	002831	裕同科技	1,000	40,060.00	0.13
167	002373	千方科技	3,600	40,032.00	0.13
168	002439	启明星辰	1,900	39,064.00	0.13
169	600978	宜华生活	9,171	37,601.10	0.12
170	300168	万达信息	3,100	37,169.00	0.12
171	000089	深圳机场	4,600	35,834.00	0.12
172	600466	蓝光发展	6,660	35,830.80	0.12
173	603877	太平鸟	1,900	35,701.00	0.12

174	600750	江中药业	2,100	35,553.00	0.12
175	000062	深圳华强	2,100	34,986.00	0.11
176	000990	诚志股份	2,900	34,829.00	0.11
177	000519	江南红箭	5,500	34,595.00	0.11
178	002690	美亚光电	1,600	34,048.00	0.11
179	002268	卫士通	1,900	33,934.00	0.11
180	600718	东软集团	2,900	33,495.00	0.11
181	000656	金科股份	5,400	33,426.00	0.11
182	600673	东阳光科	4,500	32,760.00	0.11
183	600256	广汇能源	8,600	32,336.00	0.11
184	000758	中色股份	8,800	32,120.00	0.10
185	601958	金铂股份	5,400	31,968.00	0.10
186	000066	长城电脑	6,600	31,284.00	0.10
187	002385	大北农	9,500	30,400.00	0.10
188	603568	伟明环保	1,300	29,705.00	0.10
189	000061	农产品	6,000	29,100.00	0.09
190	300297	蓝盾股份	5,800	29,000.00	0.09
191	601003	柳钢股份	4,300	28,251.00	0.09
192	000564	西安民生	10,900	27,577.00	0.09
193	000980	金马股份	6,300	27,279.00	0.09
194	600823	世茂股份	7,200	27,072.00	0.09
195	300166	东方国信	2,500	25,900.00	0.08
196	600021	上海电力	3,100	25,110.00	0.08
197	603228	景旺电子	500	24,995.00	0.08
198	002299	圣农发展	1,500	24,810.00	0.08
199	000158	常山股份	4,700	24,534.00	0.08
200	002051	中工国际	2,200	24,376.00	0.08
201	600410	华胜天成	4,100	24,026.00	0.08

202	601100	恒立液压	1,200	23,772.00	0.08
203	000932	华菱钢铁	3,900	23,634.00	0.08
204	002110	三钢闽光	1,800	23,022.00	0.07
205	600885	宏发股份	1,000	22,560.00	0.07
206	002078	太阳纸业	3,935	22,429.50	0.07
207	002437	誉衡药业	7,900	22,120.00	0.07
208	600862	中航高科	3,900	21,840.00	0.07
209	300058	蓝色光标	4,900	21,266.00	0.07
210	600183	生益科技	2,100	21,126.00	0.07
211	000717	*ST 韶钢	4,600	20,930.00	0.07
212	600536	中国软件	1,000	20,930.00	0.07
213	000031	中粮地产	4,200	20,496.00	0.07
214	300115	长盈精密	2,500	20,475.00	0.07
215	002280	联络互动	5,200	20,124.00	0.07
216	603077	和邦生物	12,400	20,088.00	0.07
217	601311	骆驼股份	2,260	19,955.80	0.06
218	300324	旋极信息	3,515	19,719.15	0.06
219	600373	中文传媒	1,500	19,515.00	0.06
220	603868	飞科电器	500	19,090.00	0.06
221	600901	江苏租赁	3,200	18,912.00	0.06
222	600350	山东高速	4,100	18,696.00	0.06
223	601811	新华文轩	2,000	18,620.00	0.06
224	002368	太极股份	800	18,560.00	0.06
225	300244	迪安诊断	1,200	18,204.00	0.06
226	000761	本钢板材	5,400	18,144.00	0.06
227	300159	新研股份	3,700	17,057.00	0.06
228	601000	唐山港	7,100	16,898.00	0.06
229	000012	南玻 A	4,202	16,765.98	0.05

230	002583	海能达	2,100	16,569.00	0.05
231	000960	锡业股份	1,700	16,218.00	0.05
232	000600	建投能源	3,200	16,064.00	0.05
233	603169	兰石重装	3,700	15,799.00	0.05
234	600643	爱建集团	1,836	15,587.64	0.05
235	000559	万向钱潮	3,000	15,360.00	0.05
236	601020	华钰矿业	1,800	15,228.00	0.05
237	002482	广田集团	2,616	15,146.64	0.05
238	603899	晨光文具	500	15,125.00	0.05
239	002807	江阴银行	2,900	14,732.00	0.05
240	300291	华录百纳	3,300	14,685.00	0.05
241	000970	中科三环	2,000	14,660.00	0.05
242	600126	杭钢股份	3,200	14,432.00	0.05
243	300287	飞利信	3,816	14,424.48	0.05
244	002242	九阳股份	900	14,409.00	0.05
245	300316	晶盛机电	1,400	14,028.00	0.05
246	000426	兴业矿业	2,800	13,944.00	0.05
247	600277	亿利洁能	2,440	13,810.40	0.04
248	002635	安洁科技	1,200	13,596.00	0.04
249	603816	顾家家居	300	13,500.00	0.04
250	002505	大康农业	8,100	13,122.00	0.04
251	600335	国机汽车	2,100	13,104.00	0.04
252	002588	史丹利	3,300	12,837.00	0.04
253	600161	天坛生物	600	12,750.00	0.04
254	600179	安通控股	1,900	12,635.00	0.04
255	601098	中南传媒	1,000	12,500.00	0.04
256	600751	海航科技	4,600	12,466.00	0.04
257	600839	四川长虹	5,200	12,012.00	0.04

258	002512	达华智能	2,200	11,682.00	0.04
259	603369	今世缘	800	11,592.00	0.04
260	600458	时代新材	1,700	11,526.00	0.04
261	002663	普邦股份	4,500	11,115.00	0.04
262	000969	安泰科技	2,400	10,920.00	0.04
263	000723	美锦能源	3,400	10,914.00	0.04
264	600079	人福医药	1,027	10,413.78	0.03
265	002642	荣之联	1,600	10,304.00	0.03
266	002672	东江环保	900	10,296.00	0.03
267	600184	光电股份	1,000	9,770.00	0.03
268	600500	中化国际	1,400	9,576.00	0.03
269	000156	华数传媒	1,175	9,317.75	0.03
270	002056	横店东磁	1,636	9,047.08	0.03
271	603025	大豪科技	777	8,663.55	0.03
272	600754	锦江股份	400	8,520.00	0.03
273	600729	重庆百货	300	8,490.00	0.03
274	603806	福斯特	300	8,040.00	0.03
275	002249	大洋电机	2,400	7,920.00	0.03
276	601128	常熟银行	1,200	7,368.00	0.02
277	600499	科达洁能	1,800	7,272.00	0.02
278	601718	际华集团	2,100	7,035.00	0.02
279	600699	均胜电子	300	7,008.00	0.02
280	601106	中国一重	2,600	6,942.00	0.02
281	600648	外高桥	500	6,870.00	0.02
282	000813	德展健康	700	6,426.00	0.02
283	300315	掌趣科技	1,800	6,354.00	0.02
284	600869	智慧能源	1,300	6,305.00	0.02
285	000090	天健集团	1,293	5,947.80	0.02

286	300202	聚龙股份	900	5,796.00	0.02
287	002266	浙富控股	1,400	5,698.00	0.02
288	000543	皖能电力	1,100	5,269.00	0.02
289	600298	安琪酵母	200	5,046.00	0.02
290	002489	浙江永强	1,900	5,016.00	0.02
291	002028	思源电气	500	4,935.00	0.02
292	002277	友阿股份	1,500	4,740.00	0.02
293	300459	金科娱乐	600	4,410.00	0.01
294	002463	沪电股份	600	4,302.00	0.01
295	600598	北大荒	500	4,280.00	0.01
296	600039	四川路桥	1,300	4,264.00	0.01
297	000712	锦龙股份	400	3,632.00	0.01
298	000738	航发控制	300	3,618.00	0.01
299	600416	湘电股份	700	3,612.00	0.01
300	002701	奥瑞金	700	3,542.00	0.01
301	600639	浦东金桥	300	3,378.00	0.01
302	600875	东方电气	400	3,156.00	0.01
303	600525	长园集团	700	3,066.00	0.01
304	002500	山西证券	500	2,960.00	0.01
305	002815	崇达技术	200	2,922.00	0.01
306	600993	马应龙	200	2,684.00	0.01
307	000027	深圳能源	500	2,625.00	0.01
308	002424	贵州百灵	300	2,625.00	0.01
309	000006	深振业 A	500	2,590.00	0.01
310	600664	哈药股份	600	2,370.00	0.01
311	002400	省广股份	800	2,368.00	0.01
312	600917	重庆燃气	300	2,136.00	0.01
313	300376	易事特	500	2,105.00	0.01

314	300257	开山股份	200	1,998.00	0.01
315	002707	众信旅游	300	1,896.00	0.01
316	600260	凯乐科技	100	1,697.00	0.01
317	000718	苏宁环球	500	1,590.00	0.01
318	000975	银泰资源	140	1,426.60	0.00
319	300113	顺网科技	100	1,271.00	0.00
320	002002	鸿达兴业	300	864.00	0.00
321	000987	越秀金控	100	797.00	0.00
322	000690	宝新能源	100	673.00	0.00
323	000686	东北证券	100	626.00	0.00
324	600773	西藏城投	100	600.00	0.00
325	600575	皖江物流	200	426.00	0.00
326	601872	招商轮船	100	369.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000036	华联控股	5,900	32,509.00	0.11
2	600308	华泰股份	7,200	31,320.00	0.10
3	002394	联发股份	3,000	30,240.00	0.10
4	600097	开创国际	2,800	28,812.00	0.09
5	600668	尖峰集团	2,400	28,320.00	0.09
6	600469	风神股份	7,800	27,534.00	0.09
7	600173	卧龙地产	7,100	26,767.00	0.09
8	600449	宁夏建材	3,600	26,532.00	0.09
9	600720	祁连山	4,100	26,445.00	0.09
10	000415	渤海金控	7,300	26,280.00	0.09

11	601588	北辰实业	9,600	26,016.00	0.08
12	600697	欧亚集团	1,400	25,746.00	0.08
13	002541	鸿路钢构	3,600	25,272.00	0.08
14	000900	现代投资	6,400	24,896.00	0.08
15	600479	千金药业	3,200	24,832.00	0.08
16	600051	宁波联合	4,600	24,794.00	0.08
17	000791	甘肃电投	4,700	23,782.00	0.08
18	601677	明泰铝业	2,700	23,733.00	0.08
19	000910	大亚圣象	2,300	23,713.00	0.08
20	600665	天地源	6,700	23,048.00	0.08
21	002088	鲁阳节能	2,700	22,869.00	0.07
22	000069	华侨城 A	3,600	22,860.00	0.07
23	603886	元祖股份	1,300	22,750.00	0.07
24	002101	广东鸿图	2,800	22,652.00	0.07
25	002335	科华恒盛	1,500	22,605.00	0.07
26	002087	新野纺织	6,400	22,592.00	0.07
27	603869	新智认知	1,500	22,560.00	0.07
28	002150	通润装备	3,600	22,320.00	0.07
29	002082	栋梁新材	3,000	22,140.00	0.07
30	600383	金地集团	2,300	22,126.00	0.07
31	000965	天保基建	5,700	21,945.00	0.07
32	601900	南方传媒	2,600	21,892.00	0.07
33	601126	四方股份	4,300	21,887.00	0.07
34	000789	万年青	2,000	21,780.00	0.07
35	603669	灵康药业	2,200	21,780.00	0.07
36	002083	孚日股份	4,400	21,692.00	0.07
37	002316	键桥通讯	3,100	21,669.00	0.07
38	603855	华荣股份	2,700	21,276.00	0.07

39	603980	吉华集团	1,800	21,186.00	0.07
40	002533	金杯电工	4,800	21,168.00	0.07
41	002398	建研集团	4,700	21,103.00	0.07
42	000898	鞍钢股份	4,100	21,033.00	0.07
43	603599	广信股份	2,000	21,000.00	0.07
44	000043	中航地产	2,800	20,944.00	0.07
45	000828	东莞控股	2,800	20,916.00	0.07
46	603385	惠达卫浴	2,600	20,826.00	0.07
47	600035	楚天高速	7,000	20,650.00	0.07
48	002435	长江润发	3,900	20,631.00	0.07
49	601058	赛轮轮胎	9,200	20,516.00	0.07
50	000892	星美联合	4,300	20,468.00	0.07
51	600067	冠城大通	5,500	20,460.00	0.07
52	600422	昆药集团	3,300	20,394.00	0.07
53	000672	上峰水泥	2,400	20,256.00	0.07
54	000708	大冶特钢	2,300	20,171.00	0.07
55	000731	四川美丰	4,000	20,080.00	0.07
56	600382	广东明珠	2,600	20,072.00	0.07
57	300338	开元仪器	2,900	20,039.00	0.07
58	300446	乐凯新材	1,300	19,942.00	0.06
59	000716	黑芝麻	7,100	19,809.00	0.06
60	002728	特一药业	1,500	19,680.00	0.06
61	300121	阳谷华泰	2,300	19,642.00	0.06
62	000059	华锦股份	3,300	19,602.00	0.06
63	600985	淮北矿业	2,100	19,530.00	0.06
64	601233	桐昆股份	2,000	19,520.00	0.06
65	603811	诚意药业	1,200	19,476.00	0.06
66	601137	博威合金	2,800	19,096.00	0.06

67	000589	黔轮胎 A	5,700	19,095.00	0.06
68	000948	南天信息	2,000	19,080.00	0.06
69	000153	丰原药业	3,700	19,055.00	0.06
70	601616	广电电气	6,000	19,020.00	0.06
71	600033	福建高速	6,400	19,008.00	0.06
72	600239	云南城投	6,600	19,008.00	0.06
73	002391	长青股份	1,800	18,990.00	0.06
74	000951	中国重汽	1,700	18,938.00	0.06
75	002100	天康生物	4,500	18,900.00	0.06
76	000719	大地传媒	2,400	18,888.00	0.06
77	300250	初灵信息	1,700	18,870.00	0.06
78	600279	重庆港九	4,800	18,768.00	0.06
79	601999	出版传媒	3,700	18,759.00	0.06
80	600356	恒丰纸业	3,400	18,666.00	0.06
81	002314	南山控股	6,500	18,655.00	0.06
82	601567	三星医疗	3,300	18,579.00	0.06
83	600873	梅花生物	4,400	18,568.00	0.06
84	600513	联环药业	3,100	18,445.00	0.06
85	000620	新华联	4,700	18,377.00	0.06
86	300120	经纬电材	3,000	18,210.00	0.06
87	002039	黔源电力	1,400	18,200.00	0.06
88	002322	理工环科	2,000	18,160.00	0.06
89	600012	皖通高速	3,000	18,090.00	0.06
90	300082	奥克股份	3,000	18,000.00	0.06
91	002406	远东传动	3,400	17,986.00	0.06
92	600361	华联综超	5,300	17,967.00	0.06
93	002637	赞宇科技	2,500	17,850.00	0.06
94	603020	爱普股份	2,400	17,832.00	0.06

95	600261	阳光照明	5,200	17,732.00	0.06
96	002315	焦点科技	1,500	17,715.00	0.06
97	002487	大金重工	5,300	17,702.00	0.06
98	603968	醋化股份	1,400	17,696.00	0.06
99	300447	全信股份	1,900	17,632.00	0.06
100	002171	楚江新材	3,800	17,594.00	0.06
101	002091	江苏国泰	3,100	17,360.00	0.06
102	603360	百傲化学	1,400	17,304.00	0.06
103	002713	东易日盛	1,100	17,248.00	0.06
104	603611	诺力股份	1,400	17,192.00	0.06
105	603609	禾丰牧业	2,200	17,050.00	0.06
106	000529	广弘控股	3,800	17,024.00	0.06
107	000921	海信科龙	2,400	16,968.00	0.06
108	300200	高盟新材	2,400	16,920.00	0.06
109	000863	三湘印象	4,300	16,813.00	0.05
110	603801	志邦家居	700	16,807.00	0.05
111	600780	通宝能源	5,200	16,796.00	0.05
112	002483	润邦股份	4,600	16,790.00	0.05
113	600269	赣粤高速	4,300	16,770.00	0.05
114	002334	英威腾	3,900	16,692.00	0.05
115	002449	国星光电	1,600	16,608.00	0.05
116	603100	川仪股份	2,200	16,544.00	0.05
117	600461	洪城水业	3,000	16,500.00	0.05
118	300218	安利股份	2,700	16,443.00	0.05
119	603809	豪能股份	1,100	16,346.00	0.05
120	000419	通程控股	4,000	16,320.00	0.05
121	002111	威海广泰	1,600	15,584.00	0.05
122	002772	众兴菌业	2,400	15,528.00	0.05

123	603898	好莱客	1,000	15,330.00	0.05
124	300461	田中精机	800	14,256.00	0.05
125	300423	鲁亿通	800	14,104.00	0.05
126	002396	星网锐捷	800	13,776.00	0.04
127	300371	汇中股份	1,100	13,607.00	0.04
128	600708	光明地产	3,800	13,262.00	0.04
129	002296	辉煌科技	2,600	13,260.00	0.04
130	000591	太阳能	4,400	13,024.00	0.04
131	002462	嘉事堂	900	13,005.00	0.04
132	600596	新安股份	1,200	12,828.00	0.04
133	002884	凌霄泵业	600	12,438.00	0.04
134	600211	西藏药业	400	11,804.00	0.04
135	002068	黑猫股份	2,000	11,800.00	0.04
136	000726	鲁泰 A	1,100	10,681.00	0.03
137	002833	弘亚数控	300	10,200.00	0.03
138	002685	华东重机	2,000	9,840.00	0.03
139	603686	龙马环卫	900	9,774.00	0.03
140	002283	天润曲轴	2,900	9,715.00	0.03
141	002724	海洋王	1,800	9,378.00	0.03
142	600987	航民股份	1,000	8,180.00	0.03
143	002187	广百股份	1,000	8,150.00	0.03
144	002788	鹭燕医药	600	7,572.00	0.02
145	002206	海利得	1,900	7,239.00	0.02
146	603037	凯众股份	400	7,160.00	0.02
147	603589	口子窖	200	7,014.00	0.02
148	000551	创元科技	1,200	6,972.00	0.02
149	002791	坚朗五金	700	6,902.00	0.02
150	600101	明星电力	1,000	6,650.00	0.02

151	603208	江山欧派	200	5,322.00	0.02
152	002106	莱宝高科	700	4,242.00	0.01
153	600371	万向德农	500	3,125.00	0.01
154	300569	天能重工	200	2,570.00	0.01
155	000553	沙隆达 A	200	1,826.00	0.01
156	002696	百洋股份	200	1,792.00	0.01
157	000762	西藏矿业	200	1,348.00	0.00
158	300273	和佳股份	200	920.00	0.00
159	002073	软控股份	200	906.00	0.00
160	600317	营口港	200	452.00	0.00
161	002323	雅百特	200	262.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601678	滨化股份	1,419,345.00	9.21
2	601717	郑煤机	1,198,944.00	7.78
3	601233	桐昆股份	1,077,426.00	6.99
4	000778	新兴铸管	1,002,862.00	6.51
5	600881	亚泰集团	1,001,431.00	6.50
6	600525	长园集团	967,707.00	6.28
7	600557	康缘药业	938,813.00	6.09
8	600978	宜华生活	930,341.00	6.04
9	601016	节能风电	929,333.00	6.03
10	600694	大商股份	918,974.00	5.97
11	002048	宁波华翔	918,007.96	5.96

12	300026	红日药业	911,296.00	5.92
13	600195	中牧股份	908,009.00	5.89
14	600611	大众交通	905,738.54	5.88
15	000049	德赛电池	893,755.00	5.80
16	600580	卧龙电气	849,771.15	5.52
17	600094	大名城	821,538.00	5.33
18	000039	中集集团	808,175.00	5.25
19	600801	华新水泥	795,890.27	5.17
20	002603	以岭药业	788,726.00	5.12
21	600266	北京城建	786,832.00	5.11
22	000848	承德露露	781,336.00	5.07
23	600422	昆药集团	774,708.89	5.03
24	600808	马钢股份	769,077.00	4.99
25	002317	众生药业	767,326.00	4.98
26	002332	仙琚制药	763,034.00	4.95
27	002233	塔牌集团	753,609.98	4.89
28	600481	双良节能	752,541.00	4.88
29	600282	南钢股份	748,933.00	4.86
30	603766	隆鑫通用	742,449.21	4.82
31	002004	华邦健康	729,735.00	4.74
32	603225	新风鸣	704,243.60	4.57
33	601811	新华文轩	697,156.00	4.53
34	600755	厦门国贸	696,282.00	4.52
35	000598	兴蓉环境	693,242.00	4.50
36	600597	光明乳业	688,314.00	4.47
37	000999	华润三九	683,132.66	4.43
38	600655	豫园股份	677,573.00	4.40
39	600572	康恩贝	673,317.00	4.37

40	000552	靖远煤电	651,886.00	4.23
41	300039	上海凯宝	644,480.00	4.18
42	002589	瑞康医药	644,309.00	4.18
43	601001	大同煤业	643,784.05	4.18
44	600618	氯碱化工	639,641.62	4.15
45	000541	佛山照明	634,303.00	4.12
46	601928	凤凰传媒	626,038.00	4.06
47	600765	中航重机	606,271.00	3.94
48	600143	金发科技	603,072.00	3.91
49	000528	柳 工	602,639.00	3.91
50	600064	南京高科	601,039.80	3.90
51	600056	中国医药	590,666.00	3.83
52	603198	迎驾贡酒	578,009.55	3.75
53	600743	华远地产	576,041.00	3.74
54	000830	鲁西化工	572,205.00	3.71
55	600017	日照港	570,948.00	3.71
56	002092	中泰化学	569,968.92	3.70
57	000501	鄂武商 A	567,881.00	3.69
58	600582	天地科技	565,667.00	3.67
59	000581	威孚高科	565,162.00	3.67
60	300088	长信科技	564,572.00	3.66
61	600594	益佰制药	558,857.00	3.63
62	000887	中鼎股份	548,956.00	3.56
63	000028	国药一致	547,653.00	3.55
64	603556	海兴电力	546,674.60	3.55
65	600657	信达地产	543,452.00	3.53
66	600971	恒源煤电	539,910.00	3.50
67	600079	人福医药	537,962.00	3.49

68	002152	广电运通	534,840.50	3.47
69	002440	闰土股份	534,089.00	3.47
70	000661	长春高新	531,534.06	3.45
71	600757	长江传媒	528,668.00	3.43
72	000877	天山股份	528,491.00	3.43
73	600201	生物股份	527,131.00	3.42
74	600126	杭钢股份	527,104.00	3.42
75	603188	亚邦股份	524,991.00	3.41
76	601311	骆驼股份	522,854.00	3.39
77	002221	东华能源	519,060.00	3.37
78	000031	中粮地产	510,887.00	3.32
79	002482	广田集团	506,893.00	3.29
80	600633	浙数文化	497,315.00	3.23
81	000718	苏宁环球	494,752.00	3.21
82	601168	西部矿业	494,410.00	3.21
83	603568	伟明环保	492,708.00	3.20
84	600292	远达环保	491,777.00	3.19
85	002056	横店东磁	490,876.00	3.19
86	603444	吉比特	488,877.00	3.17
87	600060	海信电器	487,742.00	3.17
88	600754	锦江股份	487,131.00	3.16
89	600141	兴发集团	486,479.00	3.16
90	000685	中山公用	485,676.00	3.15
91	600325	华发股份	484,150.00	3.14
92	600737	中粮糖业	482,611.00	3.13
93	000401	冀东水泥	473,675.21	3.07
94	600863	内蒙华电	471,364.00	3.06
95	600563	法拉电子	471,045.00	3.06

96	600565	迪马股份	471,013.00	3.06
97	002195	二三四五	470,252.00	3.05
98	002308	威创股份	460,401.00	2.99
99	000488	晨鸣纸业	459,270.00	2.98
100	002064	华峰氨纶	459,184.00	2.98
101	000926	福星股份	454,988.00	2.95
102	600022	山东钢铁	450,685.00	2.93
103	600628	新世界	448,498.00	2.91
104	600409	三友化工	445,834.00	2.89
105	603328	依顿电子	445,410.00	2.89
106	000012	南玻 A	443,655.00	2.88
107	600859	王府井	435,218.00	2.83
108	601689	拓普集团	434,678.00	2.82
109	002563	森马服饰	426,238.00	2.77
110	600835	上海机电	421,825.00	2.74
111	600160	巨化股份	415,859.00	2.70
112	603025	大豪科技	415,290.00	2.70
113	600426	华鲁恒升	415,165.00	2.69
114	000612	焦作万方	412,226.00	2.68
115	600073	上海梅林	412,068.00	2.67
116	600388	龙净环保	411,039.00	2.67
117	600908	无锡银行	407,694.10	2.65
118	600256	广汇能源	405,554.50	2.63
119	000729	燕京啤酒	403,855.00	2.62
120	002078	太阳纸业	403,141.00	2.62
121	002128	露天煤业	401,625.00	2.61
122	002019	亿帆医药	400,302.00	2.60
123	300182	捷成股份	399,904.00	2.60

124	600787	中储股份	398,512.00	2.59
125	600395	盘江股份	397,721.00	2.58
126	000656	金科股份	397,060.00	2.58
127	600970	中材国际	393,074.00	2.55
128	600500	中化国际	388,333.00	2.52
129	002273	水晶光电	388,232.38	2.52
130	600216	浙江医药	387,814.00	2.52
131	000513	丽珠集团	387,307.00	2.51
132	002022	科华生物	383,050.00	2.49
133	600823	世茂股份	382,772.00	2.48
134	600348	阳泉煤业	381,556.00	2.48
135	002503	搜于特	380,367.00	2.47
136	600651	飞乐音响	380,256.00	2.47
137	002815	崇达技术	377,917.70	2.45
138	600729	重庆百货	375,706.00	2.44
139	000078	海王生物	374,140.00	2.43
140	002818	富森美	371,583.00	2.41
141	600643	爱建集团	369,153.00	2.40
142	000990	诚志股份	369,046.00	2.40
143	002444	巨星科技	367,192.00	2.38
144	002242	九阳股份	366,391.00	2.38
145	002463	沪电股份	364,698.00	2.37
146	002416	爱施德	362,844.00	2.36
147	600006	东风汽车	361,202.00	2.34
148	300043	星辉娱乐	360,432.00	2.34
149	000418	小天鹅 A	360,013.00	2.34
150	002051	中工国际	357,184.00	2.32
151	002373	千方科技	356,668.00	2.32

152	600872	中炬高新	353,546.00	2.29
153	002690	美亚光电	353,539.00	2.29
154	600782	新钢股份	352,739.00	2.29
155	000400	许继电气	346,102.00	2.25
156	000825	太钢不锈	343,142.00	2.23
157	000761	本钢板材	341,827.00	2.22
158	600516	方大炭素	341,410.00	2.22
159	600062	华润双鹤	340,204.00	2.21
160	601801	皖新传媒	339,320.00	2.20
161	600284	浦东建设	337,978.00	2.19
162	600277	亿利洁能	335,922.00	2.18
163	001696	宗申动力	333,004.22	2.16
164	000090	天健集团	332,436.50	2.16
165	601966	玲珑轮胎	332,059.00	2.16
166	000021	深科技	330,941.00	2.15
167	600260	凯乐科技	330,866.00	2.15
168	002640	跨境通	330,224.00	2.14
169	600545	卓郎智能	327,394.00	2.13
170	002191	劲嘉股份	327,259.00	2.12
171	600623	华谊集团	323,537.00	2.10
172	000786	北新建材	322,849.00	2.10
173	000680	山推股份	322,788.00	2.10
174	603589	口子窖	320,401.00	2.08
175	002244	滨江集团	319,145.00	2.07
176	600649	城投控股	317,605.00	2.06
177	600567	山鹰纸业	317,273.00	2.06
178	600718	东软集团	315,892.00	2.05
179	600138	中青旅	315,106.00	2.05

180	002426	胜利精密	314,823.00	2.04
181	300297	蓝盾股份	313,792.00	2.04
182	600748	上实发展	313,325.00	2.03

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600525	长园集团	1,175,107.57	7.63
2	601233	桐昆股份	1,168,192.51	7.58
3	600557	康缘药业	895,791.60	5.81
4	601717	郑煤机	893,925.72	5.80
5	600755	厦门国贸	857,170.79	5.56
6	601678	滨化股份	844,912.14	5.48
7	000039	中集集团	781,888.48	5.08
8	600094	大名城	777,196.82	5.04
9	600481	双良节能	742,389.00	4.82
10	000049	德赛电池	728,310.00	4.73
11	000778	新兴铸管	722,403.06	4.69
12	600694	大商股份	715,697.47	4.65
13	002048	宁波华翔	713,895.50	4.63
14	600808	马钢股份	682,211.93	4.43
15	600079	人福医药	682,074.69	4.43
16	600978	宜华生活	668,806.38	4.34
17	601811	新华文轩	666,539.00	4.33
18	600422	昆药集团	647,075.00	4.20
19	600881	亚泰集团	645,170.50	4.19
20	002195	二三四五	642,423.71	4.17

21	600611	大众交通	637,742.84	4.14
22	002603	以岭药业	631,774.46	4.10
23	000661	长春高新	626,264.00	4.07
24	600765	中航重机	621,125.28	4.03
25	000488	晨鸣纸业	613,268.90	3.98
26	000513	丽珠集团	612,707.15	3.98
27	600757	长江传媒	611,512.54	3.97
28	600801	华新水泥	604,416.85	3.92
29	600580	卧龙电气	603,516.30	3.92
30	002332	仙琚制药	602,382.84	3.91
31	000581	威孚高科	601,365.20	3.90
32	600195	中牧股份	593,246.00	3.85
33	000598	兴蓉环境	592,959.92	3.85
34	600266	北京城建	587,909.88	3.82
35	000528	柳 工	578,293.37	3.75
36	600380	健康元	577,564.64	3.75
37	300039	上海凯宝	572,518.12	3.72
38	600643	爱建集团	570,642.87	3.70
39	600572	康恩贝	558,920.86	3.63
40	000786	北新建材	558,463.76	3.63
41	600516	方大炭素	554,024.52	3.60
42	300026	红日药业	553,604.00	3.59
43	600064	南京高科	550,623.20	3.57
44	603589	口子窖	549,602.06	3.57
45	601016	节能风电	545,272.00	3.54
46	000848	承德露露	538,535.85	3.50
47	600160	巨化股份	534,674.60	3.47
48	300182	捷成股份	531,000.16	3.45

49	603025	大豪科技	529,806.34	3.44
50	000418	小天鹅 A	529,438.00	3.44
51	000012	南玻 A	527,699.76	3.43
52	002056	横店东磁	527,683.78	3.43
53	600582	天地科技	525,770.82	3.41
54	600787	中储股份	525,696.88	3.41
55	000830	鲁西化工	522,002.65	3.39
56	600754	锦江股份	521,773.16	3.39
57	002416	爱施德	519,563.68	3.37
58	603225	新凤鸣	518,888.47	3.37
59	000656	金科股份	517,412.80	3.36
60	002482	广田集团	509,675.10	3.31
61	002019	亿帆医药	508,146.30	3.30
62	600388	龙净环保	505,010.88	3.28
63	600835	上海机电	504,714.32	3.28
64	603188	亚邦股份	502,022.00	3.26
65	600282	南钢股份	501,283.89	3.25
66	000825	太钢不锈	500,976.24	3.25
67	000999	华润三九	498,685.00	3.24
68	600750	江中药业	496,526.60	3.22
69	000541	佛山照明	489,853.60	3.18
70	600126	杭钢股份	488,239.01	3.17
71	603328	依顿电子	484,937.80	3.15
72	600655	豫园股份	484,881.40	3.15
73	600594	益佰制药	480,695.50	3.12
74	600325	华发股份	477,151.95	3.10
75	002092	中泰化学	474,242.31	3.08
76	002317	众生药业	473,613.00	3.07

77	600292	远达环保	473,380.00	3.07
78	000718	苏宁环球	472,768.88	3.07
79	601311	骆驼股份	470,831.17	3.06
80	603568	伟明环保	470,153.74	3.05
81	600037	歌华有线	469,056.20	3.04
82	000401	冀东水泥	466,759.78	3.03
83	000028	国药一致	461,684.00	3.00
84	600201	生物股份	460,783.00	2.99
85	600141	兴发集团	460,393.35	2.99
86	300274	阳光电源	458,193.34	2.97
87	603198	迎驾贡酒	456,607.91	2.96
88	603444	吉比特	451,091.00	2.93
89	600143	金发科技	450,758.00	2.93
90	600056	中国医药	448,145.69	2.91
91	002078	太阳纸业	447,868.68	2.91
92	000031	中粮地产	446,682.00	2.90
93	000990	诚志股份	442,843.68	2.87
94	600970	中材国际	440,185.67	2.86
95	002573	清新环境	435,975.13	2.83
96	600565	迪马股份	429,574.55	2.79
97	600392	盛和资源	428,753.10	2.78
98	600628	新世界	420,391.48	2.73
99	601928	凤凰传媒	419,530.00	2.72
100	002051	中工国际	416,412.94	2.70
101	600563	法拉电子	413,907.92	2.69
102	002221	东华能源	413,374.48	2.68
103	600073	上海梅林	413,351.00	2.68
104	300287	飞利信	409,158.79	2.66

105	002815	崇达技术	407,712.00	2.65
106	600183	生益科技	403,121.04	2.62
107	600664	哈药股份	398,994.73	2.59
108	601168	西部矿业	394,204.00	2.56
109	002503	搜于特	392,993.60	2.55
110	600256	广汇能源	392,529.50	2.55
111	002589	瑞康医药	392,482.37	2.55
112	601128	常熟银行	392,079.57	2.55
113	002152	广电运通	386,073.00	2.51
114	600872	中炬高新	385,915.71	2.51
115	600335	国机汽车	385,718.89	2.50
116	002233	塔牌集团	383,529.77	2.49
117	002308	威创股份	383,155.52	2.49
118	000587	金洲慈航	382,594.98	2.48
119	600743	华远地产	382,545.43	2.48
120	600511	国药股份	380,901.42	2.47
121	000732	泰禾集团	379,345.12	2.46
122	600500	中化国际	376,171.00	2.44
123	000552	靖远煤电	374,068.00	2.43
124	002022	科华生物	373,663.00	2.43
125	002463	沪电股份	372,026.00	2.41
126	600409	三友化工	371,644.17	2.41
127	600859	王府井	371,474.02	2.41
128	600395	盘江股份	370,026.00	2.40
129	601001	大同煤业	369,115.58	2.40
130	603556	海兴电力	368,211.50	2.39
131	000050	深天马 A	363,220.14	2.36
132	002064	华峰氨纶	362,834.73	2.36

133	600060	海信电器	362,098.20	2.35
134	002563	森马服饰	361,898.00	2.35
135	600729	重庆百货	357,690.00	2.32
136	600823	世茂股份	357,682.88	2.32
137	600657	信达地产	346,829.85	2.25
138	000078	海王生物	345,634.88	2.24
139	002127	南极电商	345,383.87	2.24
140	600618	氯碱化工	343,984.00	2.23
141	600633	浙数文化	342,895.00	2.23
142	002242	九阳股份	342,805.00	2.23
143	000926	福星股份	340,071.20	2.21
144	000612	焦作万方	339,096.57	2.20
145	600597	光明乳业	338,791.00	2.20
146	600260	凯乐科技	338,785.14	2.20
147	002273	水晶光电	336,704.91	2.19
148	002191	劲嘉股份	336,095.56	2.18
149	300043	星辉娱乐	334,136.00	2.17
150	002690	美亚光电	332,351.00	2.16
151	603369	今世缘	331,911.78	2.15
152	600270	外运发展	330,422.83	2.14
153	001696	宗申动力	330,420.10	2.14
154	600737	中粮糖业	329,263.70	2.14
155	600536	中国软件	324,473.00	2.11
156	000090	天健集团	321,596.21	2.09
157	600277	亿利洁能	318,787.20	2.07
158	600649	城投控股	316,488.00	2.05
159	000685	中山公用	314,616.00	2.04
160	000400	许继电气	314,091.00	2.04

161	600284	浦东建设	313,423.91	2.03
162	000887	中鼎股份	312,641.00	2.03
163	000860	顺鑫农业	310,519.00	2.02
164	600017	日照港	309,221.72	2.01

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	169,416,986.15
卖出股票收入（成交）总额	147,884,545.17

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,707,480.00	5.56
	其中：政策性金融债	1,707,480.00	5.56
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	1,707,480.00	5.56

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开 1701	17,000	1,707,480.00	5.56

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除新兴铸管（000778）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018 年 7 月 21 日，河北省环境保护厅对公司武安工业区进行了调查，对其以下环境违法行为进行了公开处罚并责令改正：1、3 号烧结机引风风力不足，无负压，烟尘未经收集处理排放。2、钢渣磁选场露天作业，无污染防治设施；3 号烧结北料场上料口无集尘罩，露天作业；1280 立方米高炉焦炭上料口无集尘罩，露天作业；3 号烧结机落料点与环式冷却机之间的输送廊道未密闭，露天输送烧结矿，造成扬尘污染。3、高线车间南侧临时料场露天堆存铁精粉，苫盖不严，无防风抑尘设施；3 号烧结北料场料棚未密闭；厂门口南侧焦炭料场焦炭露天堆放，苫盖不严，球团料场未密闭，露天作业，造成扬尘污染。

本基金根据量化模型选股来构建投资组合，大部分仓位集中在中证 500 指数成分股中，新兴铸管（000778）是中证 500 指数成分股，根据量化模型入选前十大持仓，虽其因环境违法行为而受到了公开处罚并责令改正，但其所受处罚以及整改行为并未对正常的生产经营产生重大影响，也未对公司经营业绩产生重大不利影响，我们判断其投资价值不会因所受处罚而产生重大改变，因此依然按照模型持有该股。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,017.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	47,741.77
5	应收申购款	90,344.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	142,103.67

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
中 金 中 证 500A	553	55,675.45	16,048,447.47	52.12%	14,740,076.80	47.88%
中 金 中 证 500C	469	14,769.14	0.00	0.00%	6,926,726.59	100.00%
合计	1,022	36,903.38	16,048,447.47	42.55%	21,666,803.39	57.45%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	中金中证 500A	273,021.46	0.8868%
	中金中证 500C	34,648.52	0.5002%
	合计	307,669.98	0.8158%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	中金中证 500A	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

#### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额总 数	发起份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资 金	10,000,000.00	26.51	10,000,000.00	26.51	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	26.51	10,000,000.00	26.51	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）基金份额总额	10,001,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	13,218,031.80	850,755.00
本报告期期间基金总申购份额	20,948,655.83	11,955,382.32
减:本报告期期间基金总赎回份额	3,378,163.36	5,879,410.73
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	30,788,524.27	6,926,726.59

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人中金基金原董事长林寿康先生离职，2018 年 10 月 18 日起总经理孙菁女士代为履行中金基金董事长（法定代表人）职务。2019 年 1 月 18 日起，楚钢先生担任中金基金董事长（法定代表人）。

2018 年 9 月 3 日起，汤琰女士担任基金管理人中金基金副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已按照相关规定向监管部门报告并履行信息披露程序。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，基金管理人与股东中金公司就侵犯商标权及不正当竞争事项，联合向南京市中级人民法院起诉，截至报告期末本案尚无判决。

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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。本基金本报告期内应支付审计费用 30,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	188,608,193.96	59.44%	137,926.51	59.44%	-
兴业证券	2	128,693,337.36	40.56%	94,111.11	40.56%	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	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。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
长江证券	1,721,270.63	70.88%	18,200,000.00	100.00%	-	-
兴业证券	707,152.00	29.12%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司关于调整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 1 月 18 日
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

		或公司网站	
8	中金基金管理有限公司关于网上直销通联支付农业银行渠道暂停服务的通知	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 3 月 27 日
9	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
10	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
11	中金基金管理有限公司关于网上直销通联支付华夏银行渠道暂停服务的通知	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 4 月 2 日
12	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
13	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
14	中金基金：关于网上直销通联支付招商银行通道暂停服务的通知	《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
15	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
16	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2018 年第 2 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 7 月 19 日
17	关于新增济安财富(北京)基金销售有	《中国证券报》、《上海证	2018 年 7 月 21 日

	限公司为销售机构的公告	券报》、《证券时报》及/ 或公司网站	
18	中金基金管理有限公司关于公司独立董事变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/ 或公司网站	2018 年 8 月 17 日
19	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 8 月 21 日
20	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金半年报及其摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/ 或公司网站	2018 年 8 月 28 日
21	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书及其摘要（2018 年第 2 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/ 或公司网站	2018 年 9 月 4 日
22	中金基金管理有限公司副总经理任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/ 或公司网站	2018 年 9 月 4 日
23	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 9 月 6 日
24	中金基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/ 或公司网站	2018 年 9 月 22 日
25	关于新增泰诚财富基金销售（大连）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 9 月 28 日
26	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2018 年第 3 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 10 月 24 日

27	关于新增珠海盈米基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 12 月 17 日
28	关于新增阳光人寿保险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 12 月 21 日
29	关于新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2018 年 12 月 27 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
自有资金	1	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	26.51%

#### 产品特有风险

##### (1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

##### (2) 目标指数波动的风险

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

##### (3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

a. 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；

b. 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；

c. 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差；

d. 由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差；

e. 在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度；

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

#### （4）目标指数变更的风险

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

#### （5）主动增强投资的风险

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

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、本报告期内在指定媒介上披露的有关本基金的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人和/或基金托管人住所。

### 13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：（86）010-63211122 400-868-1166

传真：（86）010-66159121

中金基金管理有限公司

2019 年 3 月 28 日