

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资
基金
2016 年年度报告 摘要

2016 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：2017 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示

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 2017 年 3 月 30 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。

本报告期自 2016 年 7 月 22 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	10,270,605.46 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	10,270,512.84 份	92.62 份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。</p>
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金作为股票指数增强型发起式证券投资基金，股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资主要策略为标的指数投资策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合，然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化，力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争</p>

	利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜季柳	郭明
	联系电话	010-63211122	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95588
传真		010-66159121	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§ 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	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
本期已实现收益	443,915.38	-2.41
本期利润	242,108.70	-5.10
加权平均基金份额本期利润	0.0239	-0.0551
本期基金份额净值增长率	2.49%	-5.10%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0249	0.0246
期末基金资产净值	10,525,826.87	94.90
期末基金份额净值	1.0249	1.0246

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

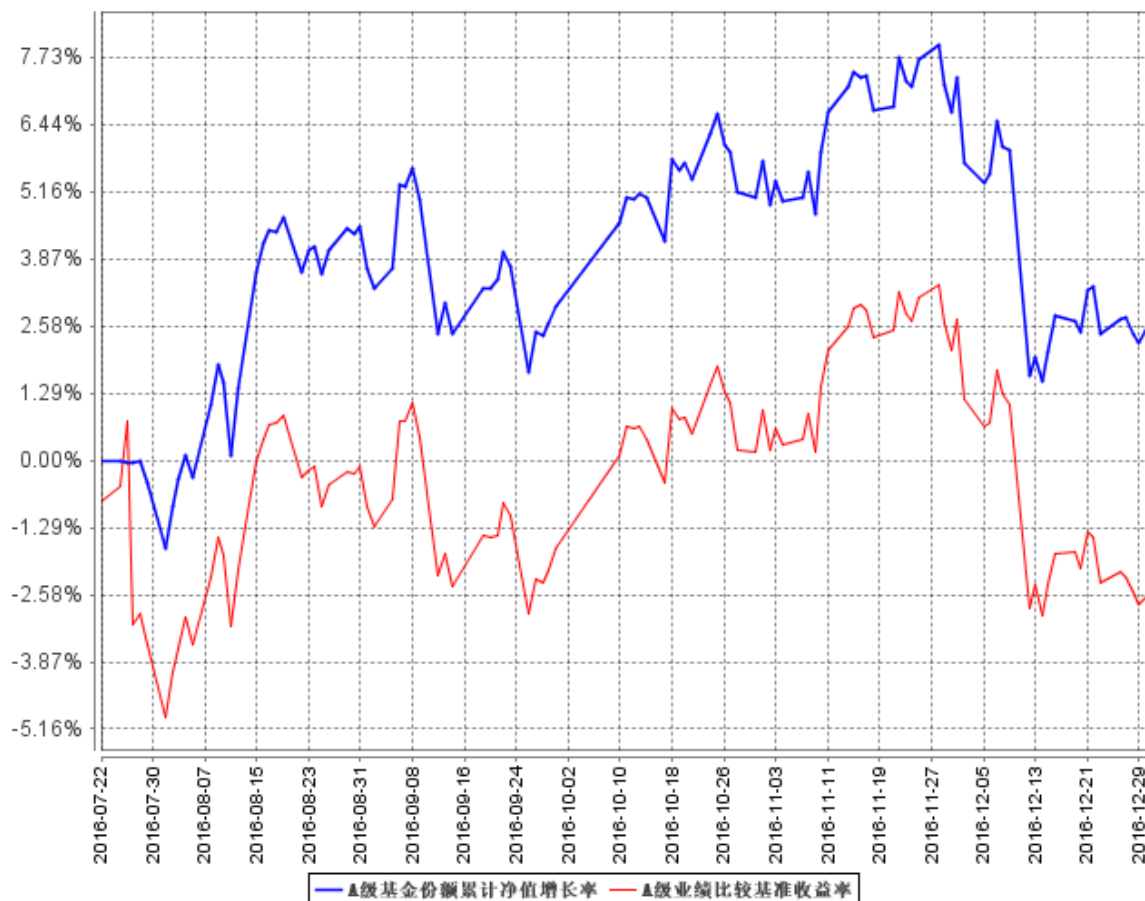
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.44%	0.79%	-0.95%	0.78%	0.51%	0.01%
自基金合同生效起至今	2.49%	0.80%	-2.61%	0.90%	5.10%	-0.10%

中金中证 500C

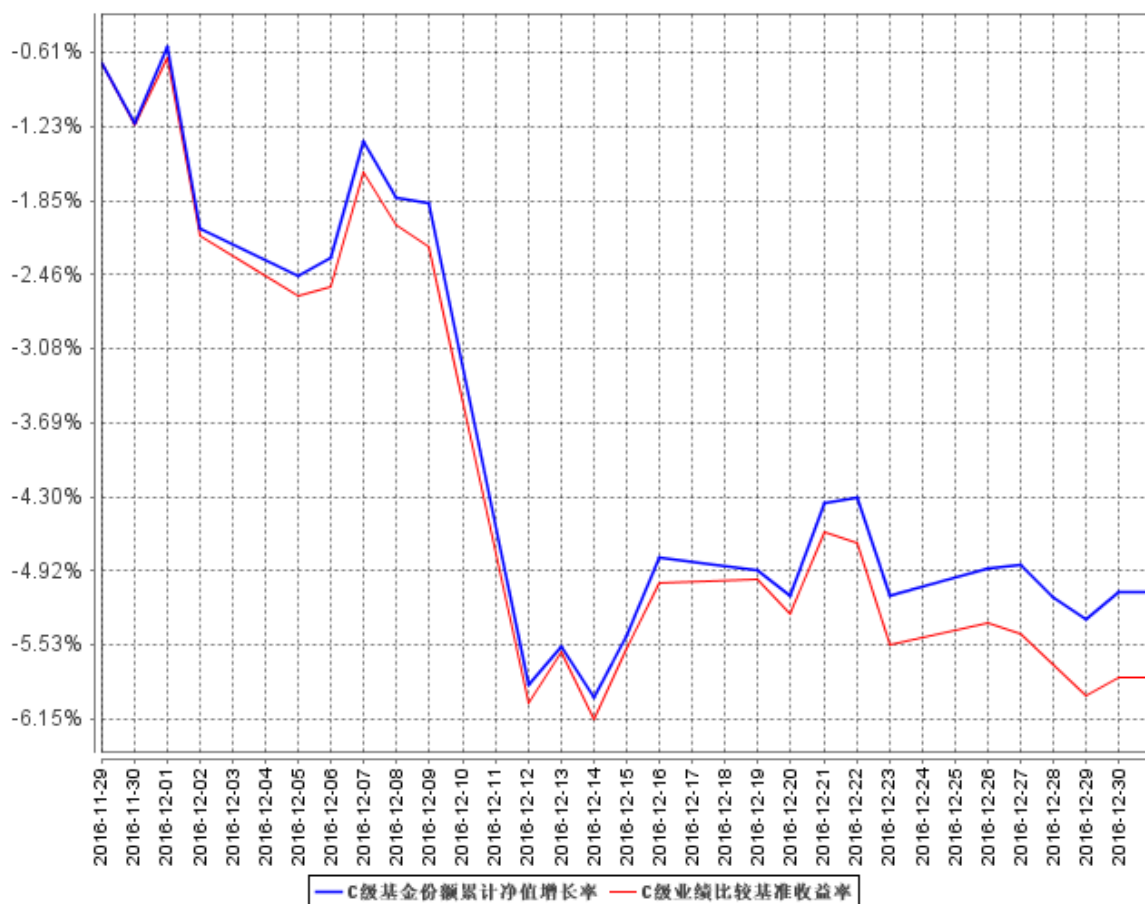
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-5.10%	0.98%	-5.80%	0.94%	0.70%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



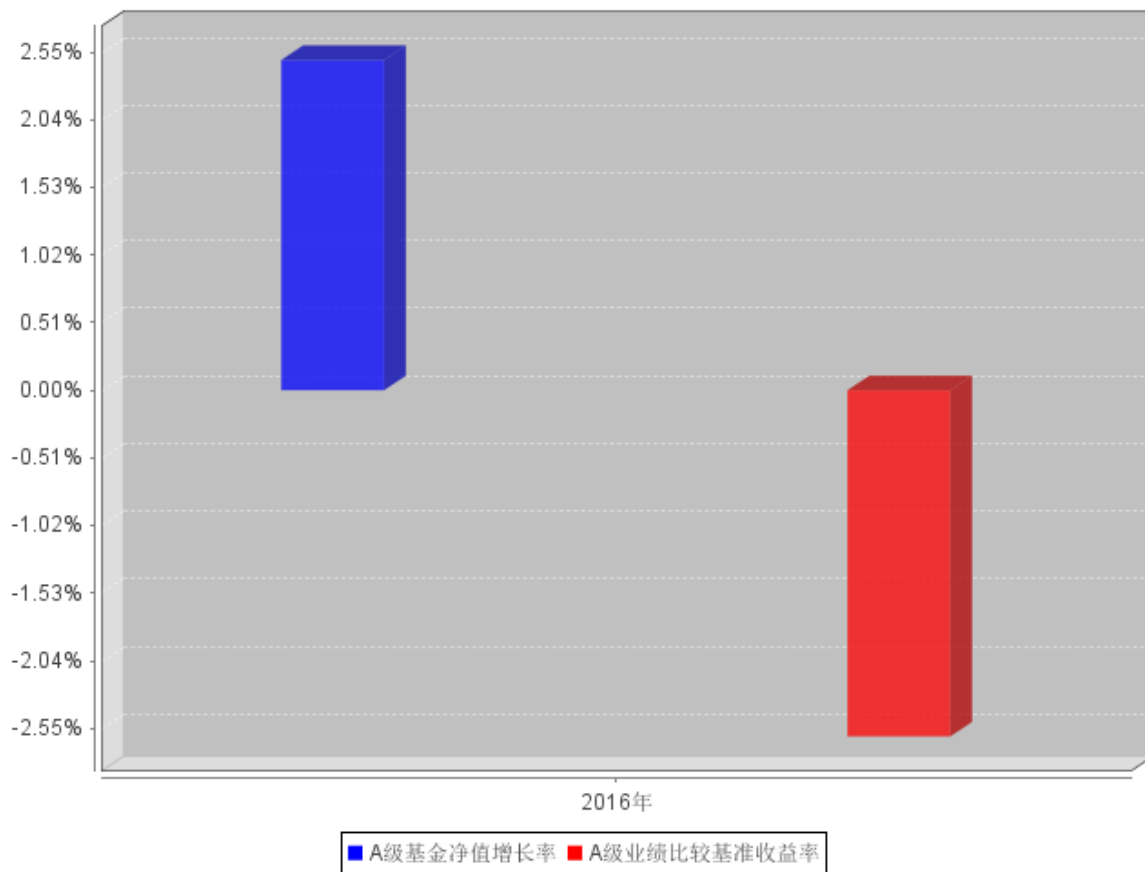
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



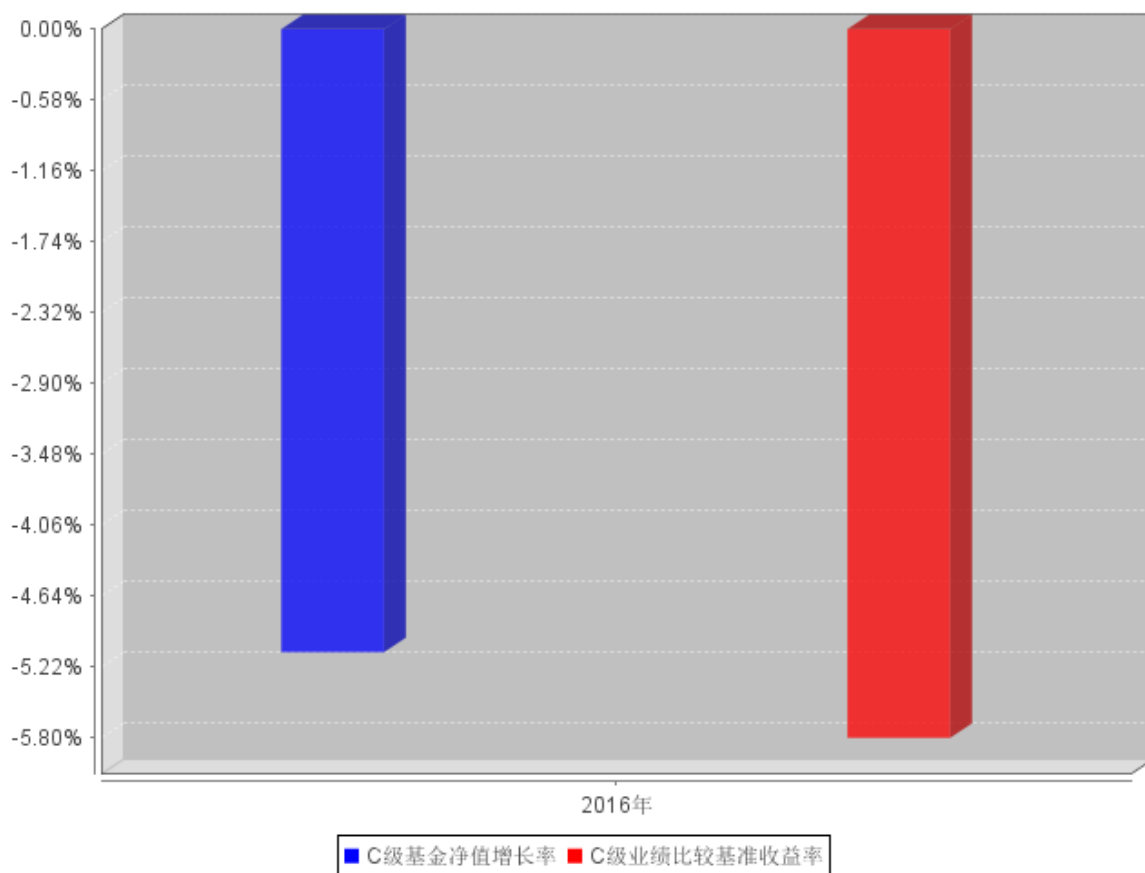
注：本基金的基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日。按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

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，是证监会批准设立的第 90 家公募基金公司，也是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 2.00 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金管理有限公司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 2016 年 12 月 31 日，公司旗下管理 8 支开放式基金--中金现金管家货币市场基金、中金纯债债券型证券投资基金、中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中金消费升级股票型证券投资基金、中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金和中金金利债券型证券投资基金，证券投资基金管理规模 35.64 亿。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李云琪	本基金的基金经理	2016 年 7 月 22 日	-	9	李云琪先生，工学硕士。历任摩根士丹利信息技术（上海）有限公司固定收益部分析员、经理；中国国际金融股份有限公司证券投资部经理、高级经理。现任中金基金管理有限公司量化公募投资部副总经理。2015 年 4 月起任中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2016 年 7 月起任中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理和中金沪深 300 指数增

					强型发起式证券投资基金基金经理。2016 年 11 月起任中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期说明：任职日期为基金合同生效日

2、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定

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

进入 2016 年以来，国际政治经济形势不确定性进一步增多。中国经济改革出现积极变化，但是结构性问题仍然较为突出。A 股市场在年初经历较大波动之后，总体表现稳健，以结构性行情为主。本报告期为基金成立之后的第 1 个年度报告期。在本报告期内，本基金严格遵守基金合同，采用量化策略进行产品的正常运作。在运用量化增强策略的同时，本基金对相对于指数的市值等因子进行了相应的风险控制，力求在跟踪指数的同时获得更佳的风险收益比，截止本年度末，量化策略表现理想，获得了较为明显的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中金中证 500A 类份额净值增长率为 2.49%，同期业绩比较基准收益率为-2.61%，中金中证 500C 类份额净值增长率为-5.10%，同期业绩比较基准收益率为-5.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，我们认为货币政策将从相对宽松转向稳健中性，更加强调金融风险，同时需要高度关注通胀预期变化对政策的影响。A 股市场短期受到新股发行节奏加快，增量资金不足的影响，导致股指的向上动力不足。长期来看，企业盈利状况的实质性改善有望带动市场的向上突破和情绪改善，全年来看，我们认为仍将以结构性行情为主。从国际宏观形势来看，需要重点关注美元的加息步伐给国内带来的经济扰动以及特朗普政府的贸易保护主义政策对中国的影响。管理人将结合宏观经济的复苏节奏，继续坚持量化研究，精选个股，同时注意控制指数偏离度等风险指标，进一步改进指数增强策略，力争增厚基金收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人进一步健全了风险控制和监察稽核机制，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。

首先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。在持续关注《季度监察稽核项目》表中识别的风险点进行自查的同时，还定期进行有重点的检查。在研究投资交易环节，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，对关联交易的日常维护，对基金持仓流动性风险定期关注，并对公平交易执行情况进行检查等；在营销与销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值业务的检查来确保本基金财务数据的准确性；在法律合规方面，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。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。

本报告期内，本基金管理人严格按照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。

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。

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 2016 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 1701521 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
引言段	我们审计了中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表,自 2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是该基金管理人中金基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1) 按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和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财务报表,并使其实现公允反映;(2) 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。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评价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的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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>
审计意见段	我们认为,该基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表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

	操作的规定编制，公允反映了该基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2016 年 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	程海良	管祎铭
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)	
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	2017 年 3 月 30 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款		863,207.13
结算备付金		170,084.42
存出保证金		4,471.96
交易性金融资产		9,655,984.06
其中：股票投资		9,655,984.06
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		19,203.50
应收利息		255.94
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		10,713,207.01
负 债 和 所 有 者 权 益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		11,151.16
应付赎回款		-
应付管理人报酬		4,516.51
应付托管费		1,354.93
应付销售服务费		-
应付交易费用		59,832.55
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		110,430.09
负债合计		187,285.24
所有者权益：		
实收基金		10,270,605.46
未分配利润		255,316.31
所有者权益合计		10,525,921.77
负债和所有者权益总计		10,713,207.01

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，中金中证 500A 基金份额净值 1.0249 元，中金中证 500C 基金份额净值 1.0246 元；中金中证 500 基金份额总额 10,270,605.46 份（其中 A 类 10,270,512.84 份，C 类 92.62 份）。

2、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日，无上年度对比数据。

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：2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		573,440.91
1.利息收入		4,922.10
其中：存款利息收入		4,400.85
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		521.25
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		769,928.18
其中：股票投资收益		767,699.30
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		2,228.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-201,809.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入（损失以“-”号填列）		400.00
减：二、费用		331,337.31
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	41,134.92
2. 托管费	7.4.8.2.2	6,983.33
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-
4. 交易费用		171,953.17
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用		111,265.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		242,103.60
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		242,103.60

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

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：2016 年 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,001,000.00	-	10,001,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	242,103.60	242,103.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	269,605.46	13,212.71	282,818.17
其中：1. 基金申购款	269,605.46	13,212.71	282,818.17
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	10,270,605.46	255,316.31	10,525,921.77

注：本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日，无上年度对比数据。

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：

<u>孙菁</u>	<u>杜季柳</u>	<u>白娜</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

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

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基

金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。

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的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况、自 2016 年 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间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

7.4.5 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

无

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无

7.4.5.3 差错更正的说明

无

7.4.6 税项

根据财税字 [1998] 55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税 [2002] 128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税

[2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》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) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 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。

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

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

2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(4) 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。

(5) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(6) 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。

(7) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税。

和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
工商银行	基金托管人
中金公司	基金管理人的股东

注：1、本基金本报告期关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中金公司	32,132,473.27	24.03%

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

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中金公司	9,000,000.00	100.00%

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

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年7月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中金公司	23,498.93	24.03%	0.00	0.00%

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

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

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

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月22日(基金合同生效日)至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	41,134.92
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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

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

3、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，本基金本报告期无销售服务机构的客户维护费；

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月22日(基金合同生效日)至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,983.33

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

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

7.4.8.2.3 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 2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	-	-
工商银行	-	-	-
中金公司	-	-	-
合计	-	-	-

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

2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。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；

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（ 2016 年 7 月 22 日）持有的 基金份额	10,000,000.00	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	97.37%	-

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金总赎回份额含转换出份额；

- 2、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。
- 3、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日，无上年度可比期间数据。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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 2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	863,207.13	3,579.91

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 2016 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 174,556.38 元，本期间产生的利息收入为人民币 820.94 元。

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

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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
600151	航天机电	2016 年 11 月 11 日	重大事项停牌	10.97	-	-	8,320	91,660.71	91,270.40	-
600551	时代出版	2016 年 11 月 28 日	重大事项停牌	20.32	-	-	3,500	71,800.75	71,120.00	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	重大事项停牌	25.20	-	-	2,549	62,621.85	64,234.80	-

002681	奋达科技	2016 年 12 月 19 日	重大 事项 停牌	12.93	-	-	4,937	65,600.30	63,835.41	-
002396	星网锐捷	2016 年 9 月 12 日	重大 事项 停牌	19.70	2017 年 2 月 21 日	19.01	2,200	43,385.86	43,340.00	-
002727	一心堂	2016 年 12 月 28 日	重大 事项 停牌	21.20	2017 年 1 月 5 日	20.95	1,793	38,489.54	38,011.60	-
600859	王府井	2016 年 9 月 27 日	重大 事项 停牌	16.28	-	-	2,300	37,882.00	37,444.00	-
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大 事项 停牌	7.29	-	-	4,000	28,906.00	29,160.00	-
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大 事项 停牌	15.80	-	-	1,800	28,746.58	28,440.00	-
000050	深天马 A	2016 年 9 月 12 日	重大 事项 停牌	18.82	2017 年 3 月 23 日	20.70	1,500	28,481.38	28,230.00	-
002440	闰土股份	2016 年 10 月 24 日	重大 事项 停牌	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.40	1,588	24,471.50	25,947.92	-
600655	豫园商城	2016 年 12 月 20 日	重大 事项 停牌	11.42	-	-	1,500	16,806.00	17,130.00	-
002491	通鼎互联	2016 年 12 月 22 日	重大 事项 停牌	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.50	1,000	15,163.08	15,540.00	-
600161	天坛生物	2016 年 12 月 6 日	重大 事项 停牌	39.40	2017 年 3 月 24 日	43.34	378	14,986.86	14,893.20	-
600537	亿晶光电	2016 年 12 月 27 日	重大 事项 停牌	7.43	2017 年 1 月 13 日	7.54	1,496	11,673.37	11,115.28	-
601168	西部矿业	2016 年 12 月 19 日	重大 事项 停牌	7.83	-	-	975	7,986.08	7,634.25	-
002400	省广股份	2016 年 11 月 28 日	重大 事项 停牌	13.79	-	-	500	6,759.00	6,895.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

7.4.10 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

	2016 年 12 月 31 日			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	9,061,742.20	594,241.86	-	9,655,984.06
合计	9,061,742.20	594,241.86	-	9,655,984.06

对于在资产负债表日以公允价值计量的交易性金融资产的公允价值信息，本基金在估计公允价值时运用的主要方法和假设参见财务报表附注。

(b) 公允价值所属层次间的重大变动

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

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的流通受限的股票由于公开价格无法正常获取而从第一层次调整至第二层次，账面价值为人民币 594,241.86 元。于报告期期末，本基金持有的以公允

价值计量的资产的第一层次与第二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。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 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。

(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)

不以公允价值计量的金融资产和金融负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,655,984.06	90.13
	其中：股票	9,655,984.06	90.13
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,033,291.55	9.65
7	其他各项资产	23,931.40	0.22
8	合计	10,713,207.01	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	34,536.00	0.33
B	采矿业	409,638.31	3.89

C	制造业	5,713,404.86	54.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	347,982.58	3.31
E	建筑业	160,254.96	1.52
F	批发和零售业	1,014,362.89	9.64
G	交通运输、仓储和邮政业	281,210.75	2.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	546,043.04	5.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	711,059.12	6.76
L	租赁和商务服务业	28,023.08	0.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	126,315.09	1.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	225,998.35	2.15
S	综合	57,155.03	0.54
	合计	9,655,984.06	91.74

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	600335	国机汽车	8,858	107,624.70	1.02
2	002309	中利科技	7,238	102,851.98	0.98
3	600458	时代新材	6,947	98,300.05	0.93
4	002368	太极股份	3,044	93,176.84	0.89
5	600586	金晶科技	19,800	91,674.00	0.87
6	600151	航天机电	8,320	91,270.40	0.87
7	600729	重庆百货	3,845	90,088.35	0.86
8	600180	瑞茂通	6,520	88,280.80	0.84
9	601002	晋亿实业	8,762	83,414.24	0.79
10	600743	华远地产	18,373	81,759.85	0.78

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600335	国机汽车	366,764.00	3.48
2	600750	江中药业	350,307.00	3.33
3	600056	中国医药	349,218.00	3.32
4	600240	华业资本	339,575.00	3.23
5	000418	小天鹅 A	334,172.00	3.17
6	600743	华远地产	315,293.00	3.00
7	300274	阳光电源	313,831.00	2.98
8	300043	星辉娱乐	313,562.00	2.98
9	600282	南钢股份	312,708.00	2.97
10	002589	瑞康医药	304,676.00	2.89
11	600874	创业环保	302,201.00	2.87
12	000543	皖能电力	297,332.00	2.82
13	000552	靖远煤电	295,608.00	2.81
14	600755	厦门国贸	289,499.00	2.75

15	600664	哈药股份	289,072.00	2.75
16	600079	人福医药	288,608.00	2.74
17	002551	尚荣医疗	288,038.00	2.74
18	000501	鄂武商 A	287,013.00	2.73
19	002250	联化科技	285,053.00	2.71
20	002078	太阳纸业	281,196.00	2.67
21	600312	平高电气	279,930.00	2.66
22	600409	三友化工	277,841.00	2.64
23	601666	平煤股份	276,875.64	2.63
24	002414	高德红外	276,266.00	2.62
25	600736	苏州高新	275,619.00	2.62
26	002050	三花智控	275,520.00	2.62
27	600872	中炬高新	273,722.00	2.60
28	002048	宁波华翔	273,433.00	2.60
29	000636	风华高科	273,359.00	2.60
30	000926	福星股份	272,012.00	2.58
31	600978	宜华生活	271,779.00	2.58
32	600183	生益科技	271,406.00	2.58
33	002238	天威视讯	269,978.00	2.56
34	600831	广电网络	269,592.00	2.56
35	600748	上实发展	269,070.00	2.56
36	000703	恒逸石化	264,077.00	2.51
37	002384	东山精密	261,175.00	2.48
38	002001	新 和 成	261,045.00	2.48
39	002179	中航光电	260,927.00	2.48
40	600971	恒源煤电	259,360.00	2.46
41	002317	众生药业	257,983.00	2.45
42	603077	和邦生物	257,829.00	2.45
43	000970	中科三环	257,249.00	2.44
44	002242	九阳股份	256,641.00	2.44
45	002244	滨江集团	256,234.00	2.43
46	600823	世茂股份	255,994.00	2.43
47	000417	合肥百货	254,710.00	2.42
48	000030	富奥股份	252,241.55	2.40
49	000969	安泰科技	252,147.78	2.40
50	300182	捷成股份	251,544.00	2.39

51	600835	上海机电	251,397.00	2.39
52	600507	方大特钢	250,738.00	2.38
53	002461	珠江啤酒	250,692.00	2.38
54	600298	安琪酵母	248,103.00	2.36
55	002327	富安娜	247,570.00	2.35
56	600510	黑牡丹	247,417.00	2.35
57	000726	鲁泰 A	245,351.00	2.33
58	000786	北新建材	243,881.00	2.32
59	002309	中利科技	242,563.00	2.30
60	000810	创维数字	242,455.00	2.30
61	000973	佛塑科技	242,163.00	2.30
62	300001	特锐德	242,093.00	2.30
63	600521	华海药业	241,862.00	2.30
64	600580	卧龙电气	240,355.00	2.28
65	000997	新大陆	240,236.00	2.28
66	002004	华邦健康	239,991.00	2.28
67	002221	东华能源	239,311.00	2.27
68	002267	陕天然气	238,658.00	2.27
69	600073	上海梅林	238,478.00	2.27
70	002503	搜于特	237,947.00	2.26
71	002308	威创股份	237,352.52	2.25
72	601000	唐山港	237,307.00	2.25
73	600729	重庆百货	236,921.00	2.25
74	600699	均胜电子	236,200.00	2.24
75	600270	外运发展	234,267.00	2.23
76	002463	沪电股份	233,675.00	2.22
77	600138	中青旅	233,558.06	2.22
78	600517	置信电气	232,301.00	2.21
79	600426	华鲁恒升	231,782.00	2.20
80	000830	鲁西化工	231,696.00	2.20
81	600597	光明乳业	231,533.00	2.20
82	600879	航天电子	230,980.00	2.19
83	600277	亿利洁能	230,441.00	2.19
84	600563	法拉电子	227,652.00	2.16
85	600869	智慧能源	227,307.00	2.16
86	300039	上海凯宝	226,931.00	2.16

87	300199	翰宇药业	226,383.00	2.15
88	600062	华润双鹤	226,296.00	2.15
89	000028	国药一致	225,012.00	2.14
90	002572	索菲亚	224,612.00	2.13
91	600993	马应龙	224,572.00	2.13
92	600216	浙江医药	224,326.11	2.13
93	600201	生物股份	223,865.00	2.13
94	600059	古越龙山	222,620.00	2.11
95	601886	江河集团	221,864.60	2.11
96	000877	天山股份	221,737.00	2.11
97	002681	奋达科技	221,452.00	2.10
98	600850	华东电脑	220,652.80	2.10
99	600587	新华医疗	220,477.00	2.09
100	000861	海印股份	219,285.00	2.08
101	603567	珍宝岛	218,495.00	2.08
102	600757	长江传媒	218,353.00	2.07
103	600586	金晶科技	217,911.00	2.07
104	600894	广日股份	217,733.00	2.07
105	600808	马钢股份	216,978.00	2.06
106	002191	劲嘉股份	216,844.00	2.06
107	002479	富春环保	216,770.00	2.06
108	600717	天津港	215,329.00	2.05
109	600511	国药股份	214,974.00	2.04
110	002573	清新环境	214,811.00	2.04
111	600094	大名城	214,013.00	2.03
112	600416	湘电股份	213,441.00	2.03
113	002311	海大集团	213,337.00	2.03
114	002261	拓维信息	212,634.00	2.02
115	600260	凯乐科技	212,387.00	2.02
116	300113	顺网科技	212,296.00	2.02
117	600458	时代新材	212,201.00	2.02
118	002595	豪迈科技	211,411.00	2.01

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600750	江中药业	329,730.64	3.13
2	600282	南钢股份	308,989.53	2.94
3	600056	中国医药	303,527.27	2.88
4	000501	鄂武商 A	297,092.13	2.82
5	600240	华业资本	287,486.35	2.73
6	000703	恒逸石化	281,729.35	2.68
7	601666	平煤股份	276,453.62	2.63
8	600079	人福医药	274,731.44	2.61
9	000418	小天鹅 A	271,284.37	2.58
10	600409	三友化工	269,667.36	2.56
11	000926	福星股份	269,634.98	2.56
12	600755	厦门国贸	268,035.45	2.55
13	000552	靖远煤电	267,828.36	2.54
14	002384	东山精密	266,627.84	2.53
15	000636	风华高科	265,564.73	2.52
16	002078	太阳纸业	265,389.13	2.52
17	600748	上实发展	262,185.80	2.49
18	600183	生益科技	261,483.02	2.48
19	600507	方大特钢	260,202.95	2.47
20	002001	新 和 成	259,422.33	2.46
21	002414	高德红外	259,028.34	2.46
22	600335	国机汽车	257,060.04	2.44
23	600510	黑牡丹	254,648.53	2.42
24	002238	天威视讯	254,449.88	2.42
25	300182	捷成股份	251,441.00	2.39
26	000786	北新建材	251,252.26	2.39
27	000726	鲁 泰 A	251,238.01	2.39
28	000030	富奥股份	249,767.98	2.37
29	300274	阳光电源	249,316.17	2.37
30	002589	瑞康医药	248,063.38	2.36
31	600312	平高电气	247,979.05	2.36
32	002461	珠江啤酒	247,693.99	2.35
33	002179	中航光电	246,594.69	2.34
34	002250	联化科技	246,056.84	2.34
35	002503	搜于特	243,780.16	2.32
36	000997	新 大 陆	241,810.39	2.30

37	600298	安琪酵母	241,697.29	2.30
38	600426	华鲁恒升	241,622.81	2.30
39	600743	华远地产	239,321.52	2.27
40	600699	均胜电子	238,310.52	2.26
41	002308	威创股份	234,904.51	2.23
42	002050	三花智控	233,081.77	2.21
43	002267	陕天然气	232,790.41	2.21
44	000543	皖能电力	231,572.28	2.20
45	002479	富春环保	230,072.70	2.19
46	600874	创业环保	229,740.40	2.18
47	600416	湘电股份	229,717.98	2.18
48	600831	广电网络	228,068.33	2.17
49	000810	创维数字	227,497.61	2.16
50	300043	星辉娱乐	226,838.42	2.16
51	002242	九阳股份	225,780.56	2.14
52	600993	马应龙	223,072.48	2.12
53	600587	新华医疗	222,708.85	2.12
54	000861	海印股份	221,904.10	2.11
55	002463	沪电股份	221,494.50	2.10
56	600138	中青旅	221,020.89	2.10
57	002244	滨江集团	219,880.60	2.09
58	300039	上海凯宝	219,788.67	2.09
59	002048	宁波华翔	218,253.48	2.07
60	603077	和邦生物	217,291.17	2.06
61	600664	哈药股份	216,358.23	2.06
62	600511	国药股份	215,834.18	2.05
63	600808	马钢股份	215,031.78	2.04
64	000830	鲁西化工	214,953.43	2.04
65	002551	尚荣医疗	213,394.44	2.03
66	600835	上海机电	213,183.96	2.03
67	600869	智慧能源	212,685.61	2.02
68	000417	合肥百货	212,004.84	2.01
69	000969	安泰科技	211,032.14	2.00
70	600201	生物股份	210,820.24	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	71,399,003.59
卖出股票收入（成交）总额	62,308,909.46

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,471.96
2	应收证券清算款	19,203.50
3	应收股利	-
4	应收利息	255.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,931.40

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600151	航天机电	91,270.40	0.87	重大事项停牌

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	15	684,700.86	10,000,000.00	97.37%	270,512.84	2.63%
中金中证 500C	1	92.62	-	-	92.62	100.00%
合计	16	641,912.84	10,000,000.00	97.37%	270,605.46	2.63%

9.3 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	99,289.54	0.97%
	中金中证 500C	92.62	100.00%
	合计	99,382.16	0.97%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金中证 500A	0~10
	中金中证 500C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 500A	0
	中金中证 500C	0
	合计	0

9.5 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	发起份额总数	发起份额占基金总份额	发起份额承诺持有期限

		比例 (%)		比例 (%)	
基金管理人固有资金	10,000,000.00	97.37	10,000,000.00	97.37	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	85,143.75	0.83	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,085,143.75	98.19	10,000,000.00	97.37	-

§ 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	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	269,512.84	92.62
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	10,270,512.84	92.62

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

本报告期间，基金管理人经与基金托管人协商一致，以通讯方式组织召开了基金份额持有人大会，由基金份额持有人对本基金增加 C 类份额、调整管理费率、调整赎回费率事项进行审议。

2016 年 10 月 25 日至 11 月 24 日期间，参加会议的基金份额持有人对《关于修改中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同及调整赎回费率有关事项的议案》进行了投票表决。2016 年 11 月 25 日，本次基金份额持有人大会在基金托管人授权代表监督、上海通力律师事务所的见证下进行，北京市方正公证处对计票过程及结果进行了公证。根据投票表决结果，2016 年 11 月 25 日基金份额持有人大会表决通过了《关于修改中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同及调整赎回费率有关事项的议案》，自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。

基金管理人已将基金份额持有人大会表决通过事项报中国证券监督管理委员会备案，并在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站发布了相关决议生效公告。

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

2016 年 1 月 6 日，根据中金基金股东中金公司股东决定，同意黄晓衡先生辞去中金基金独立董事职务，任命张龙先生为中金基金第一届董事会独立董事。

本报告期内，公司无董事长、法定代表人、其他高级管理人员和执行监事变动情况。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。本基金本报告期内应支付审计费用 50,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	32,132,473.27	24.03%	23,498.93	24.03%	-
华创证券	2	35,094,478.48	26.25%	25,665.84	26.25%	-
兴业证券	2	51,836,994.62	38.77%	37,908.22	38.77%	-
长江证券	2	14,643,966.68	10.95%	10,709.28	10.95%	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	-	-	9,000,000.00	100.00%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

中金基金管理有限公司
2017 年 3 月 31 日