

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	13
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.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	49
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	75
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	75
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	75
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	75
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	75
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	75
7.12 投资组合报告附注.....	76
§8 基金份额持有人信息.....	78
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	78
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	78
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	78
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	79
§9 开放式基金份额变动.....	80
§10 重大事件揭示.....	81
10.1 基金份额持有人大会决议.....	81
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	81
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	81
10.4 基金投资策略的改变.....	81
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	81
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	81
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	81
10.8 其他重大事件.....	83
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	85

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	85
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	86
§12 备查文件目录.....	87
12.1 备查文件目录.....	87
12.2 存放地点.....	87
12.3 查阅方式.....	87

§ 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	10,630,217.33 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	10,405,047.27 份	225,170.06 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</p>

	<p>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。</p>
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
	联系电话	010-63211122
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com
客户服务电话	400-868-1166	95588
传真	010-66159121	010-66105798

注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100032	100140
法定代表人	林寿康	易会满

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	中金中证 500A	中金中证 500C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-534,622.24	-4,081.99
本期利润	-223,441.83	2,525.62
加权平均基金份额本期利润	-0.0217	0.0494
本期加权平均净值利润率	-2.12%	5.01%
本期基金份额净值增长率	-2.15%	-1.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-77,593.28	-927.47
期末可供分配基金份额利润	-0.0075	-0.0041
期末基金资产净值	10,435,470.47	226,599.97
期末基金份额净值	1.0029	1.0064
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	0.29%	-6.79%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金中证 500A

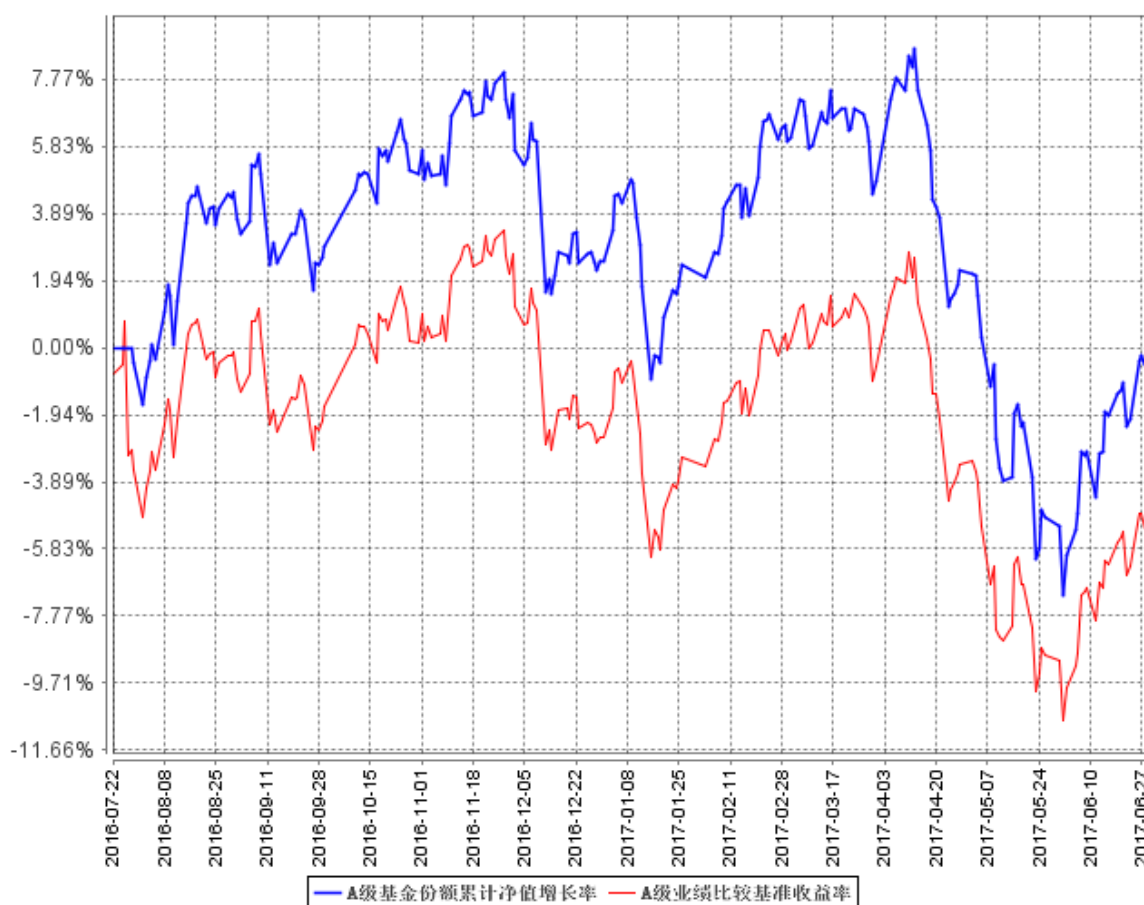
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.75%	0.97%	5.12%	0.89%	0.63%	0.08%
过去三个月	-4.34%	1.03%	-3.90%	0.97%	-0.44%	0.06%
过去六个月	-2.15%	0.89%	-1.87%	0.85%	-0.28%	0.04%
自基金合同生效起至今	0.29%	0.85%	-4.44%	0.87%	4.73%	-0.02%

中金中证 500C

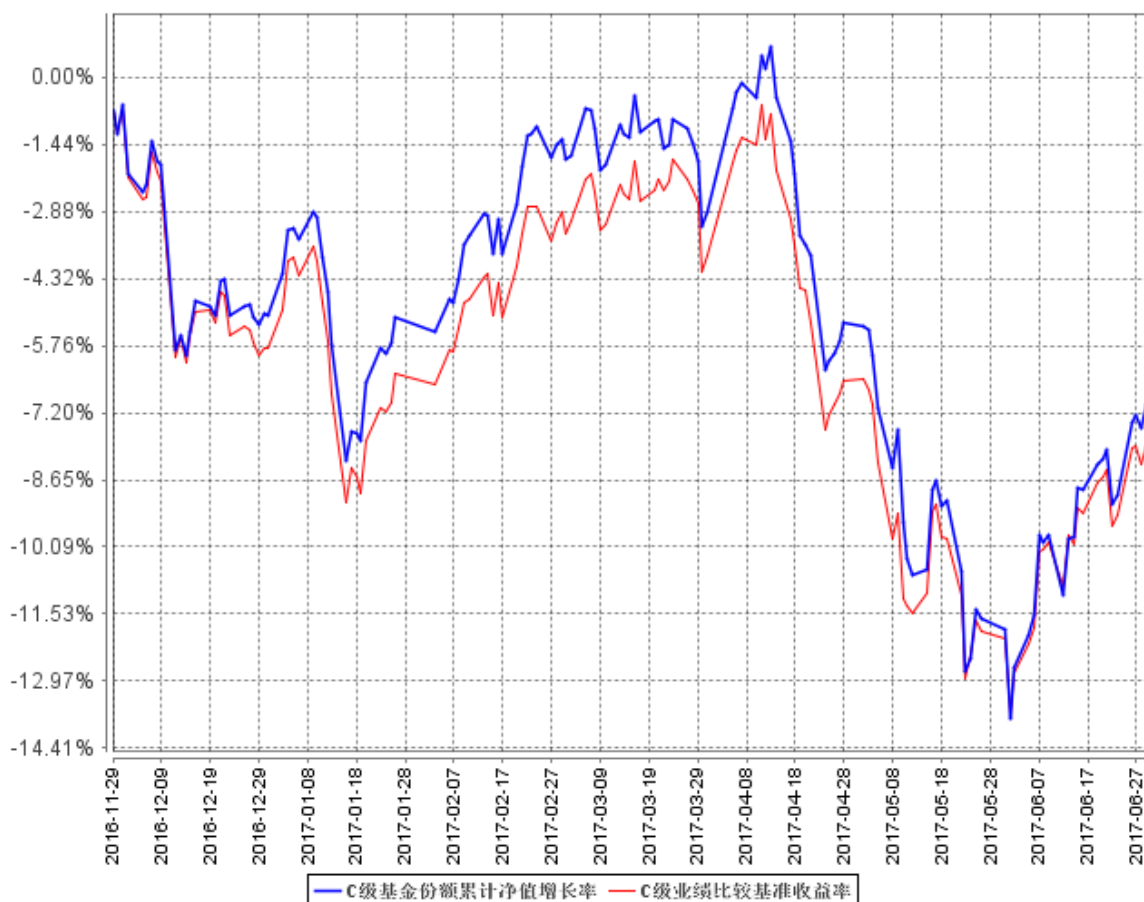
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.77%	0.97%	5.12%	0.89%	0.65%	0.08%
过去三个月	-4.03%	1.04%	-3.90%	0.97%	-0.13%	0.07%
过去六个月	-1.78%	0.89%	-1.87%	0.85%	0.09%	0.04%
自基金合同生效起至今	-6.79%	0.91%	-7.56%	0.87%	0.77%	0.04%

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

§ 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”）作为全资股东出资设立，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。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司旗下管理 10 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、中金金利债券型证券投资基金、中金新安灵活配置混合型证券投资基金和中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金，证券投资基金管理规模 52.62 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	-	6	香港大学统计专业博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发工作。2014 年 11 月，加入中金基金管理有限公司，现任量化公募投资部副总经理。2015 年 12 月 25 日至 2017 年 2 月 22

					<p>日任量化专户投资经理。</p> <p>2017 年 3 月 28 日起，担任下列公募基金的基金经理：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。</p>
李云琪	本基金的基金经理	2016 年 7 月 22 日	-	8	<p>李云琪先生，工学硕士。历任摩根士丹利信息技术（上海）有限公司固定收益部分析员、经理；中国国际金融股份有限公司证券投资部经理、高级经理。现任中金基金管理有限公司量化公募投资部副总经理。李云琪先生自 2017 年 3 月 28 日起不再担任本基金的基金经理。</p>

注：1、本报告期内，本基金基金经理有变更

2、任职日期说明：原任基金经理李云琪先生的任职日期为基金合同生效日，现任基金经理魏宇先生的任职日期为基金经理变更公告确定的任职日期

3、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

4、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 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金采用量化策略进行指数增强。在本报告期内，市场风格转换时，基金相对于指数，产生了一定的跟踪误差。我们在下半年将更加严格的控制风险，密切关注市场变化，应对风格转换，力争获得超过业绩比较基准的收益。

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 1.0029 元，本报告期基金份额净值增长率为 -2.15%；截至本报告期末中金中证 500C 基金份额净值为 1.0064 元，本报告期基金份额净值增长率为 -1.78%；同期业绩比较基准收益率为 -1.87%。

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 年下半年，预计将会继续坚持金融去杠杆，货币政策维持稳健中性的基调不变，流动性“中性适度”，下半年经济下行压力将高于上半年。利好在于中央对于经济的发展已经作出了系列重要的部署：设立“雄安新区”，深化“一带一路”战略等，为新一轮的经济增长提供支撑；PPP 项目预计也将继续稳步推进，助力基建。国际上，主要还是关注全球经济复苏的情况，以及美国和欧洲的货币政策。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的管理人——中金基金管理有限公司在中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	794,199.10	863,207.13
结算备付金		233,004.00	170,084.42
存出保证金		5,069.88	4,471.96
交易性金融资产	6.4.7.2	9,699,384.99	9,655,984.06
其中：股票投资		9,699,384.99	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		138,800.20	19,203.50
应收利息	6.4.7.5	247.61	255.94
应收股利		-	-
应收申购款		36,987.01	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,907,692.79	10,713,207.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	11,151.16
应付赎回款		14,943.73	-
应付管理人报酬		4,205.55	4,516.51
应付托管费		1,261.67	1,354.93
应付销售服务费		94.39	-
应付交易费用	6.4.7.7	185,620.80	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	6.4.7.8	39,496.21	110,430.09
负债合计		245,622.35	187,285.24
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	10,630,217.33	10,270,605.46
未分配利润	6.4.7.10	31,853.11	255,316.31
所有者权益合计		10,662,070.44	10,525,921.77
负债和所有者权益总计		10,907,692.79	10,713,207.01

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，中金中证 500A 基金份额净值 1.0029 元，基金份额总额 10,405,047.27 份；中金中证 500C 基金份额净值 1.0064 元，基金份额总额 225,170.06 份。中金中证 500 份额总额合计为 10,630,217.33 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		132,577.03	-
1.利息收入		4,063.69	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,063.69	-
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-189,786.30	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-234,585.72	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	44,799.42	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	317,788.02	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	511.62	-
减：二、费用		353,493.24	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,217.29	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,865.22	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	94.39	-

4. 交易费用	6.4.7.18	279,152.90	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	40,163.44	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-220,916.21	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-220,916.21	-

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。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,270,605.46	255,316.31	10,525,921.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-220,916.21	-220,916.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	359,611.87	-2,546.99	357,064.88

谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况、自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

本基金目前持有的投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

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。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

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。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

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

- (1) 所转移金融资产的账面价值；
- (2) 因转移而收到的对价。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征

(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等)，并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。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了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，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

量，并于会计期末全额转入“未分配利润 /（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期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。

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期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。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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，每份基金份额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。投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选

择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的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；每一基金份额享有同等分配权。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范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。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

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》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无

6.4.5.3 差错更正的说明

无

6.4.6 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。

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（以下称资管产品运营业务），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。管理人接受投资者委托以及管理人发生的除资管产品运营业务以外的其他增值税应税行为（以下称其他业务），按照现行规定缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额，未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因

此，截至 2017 年 6 月 30 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	794,199.10
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	794,199.10

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
----	------------------------

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		9,583,406.34	9,699,384.99	115,978.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		9,583,406.34	9,699,384.99	115,978.65

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	140.51
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	104.80
应收债券利息	-

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	2.30
合计	247.61

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。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	185,620.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	185,620.80

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。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	39,080.53
指数使用费	415.68
-	-
合计	39,496.21

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。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 500A		
项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,270,512.84	10,270,512.84
本期申购	258,125.82	258,125.82
本期赎回(以“-”号填列)	-123,591.39	-123,591.39
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	10,405,047.27	10,405,047.27

金额单位：人民币元

中金中证 500C		
项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	92.62	92.62
本期申购	299,491.28	299,491.28
本期赎回(以“-”号填列)	-74,413.84	-74,413.84
- 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	225,170.06	225,170.06

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金中证 500A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	457,148.84	-201,834.81	255,314.03
本期利润	-534,622.24	311,180.41	-223,441.83
本期基金份额交易产生的变动数	-119.88	-1,329.12	-1,449.00
其中：基金申购款	-1,573.00	-1,858.95	-3,431.95
基金赎回款	1,453.12	529.83	1,982.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-77,593.28	108,016.48	30,423.20

单位：人民币元

中金中证 500C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4.11	-1.83	2.28
本期利润	-4,081.99	6,607.61	2,525.62
本期基金份额交易产生的变动数	3,150.41	-4,248.40	-1,097.99
其中：基金申购款	3,875.87	-6,225.55	-2,349.68
基金赎回款	-725.46	1,977.15	1,251.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-927.47	2,357.38	1,429.91

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	2,689.75
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,339.50
其他	34.44
合计	4,063.69

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。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	105,751,255.64
减：卖出股票成本总额	105,985,841.36
买卖股票差价收入	-234,585.72

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。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	44,799.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	44,799.42

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。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	317,788.02
——股票投资	317,788.02
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	317,788.02

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。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	477.22
基金转换费收入	34.40
其他	-
合计	511.62

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	279,152.90
银行间市场交易费用	-
合计	279,152.90

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。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,204.14
信息披露费	14,876.39
指数使用费	838.91
汇划手续费	244.00
其他	-
合计	40,163.44

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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：1、本基金本报告期关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	26,217.29
其中：支付销售机构的客户维护费	50.70

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

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

3、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，本基金本报告期支付销售服务机构的客户维护费为 50.70 元，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于基金资产中列支的费用项目；

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,865.22

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	32.62	32.62
工商银行	-	-	-
中金公司	-	-	-
合计	-	32.62	32.62

- 注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；
 2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-

期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	96.11%	-

- 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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	794,199.10	2,689.75

- 注：1、本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。
2、本基金通过“工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于 2017 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 238,073.88 元，本期间产生的利息收入为人民币 1,373.94 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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601717	郑煤机	2017年4月24日	重大事项停牌	7.79	-	-	13,300	113,524.48	103,607.00	-
002505	大康农业	2017年3月13日	重大事项停牌	3.50	-	-	20,742	73,675.49	72,597.00	-
600468	百利电气	2017年5月16日	重大事项停牌	6.50	-	-	10,916	78,447.57	70,954.00	-
002025	航天电器	2016年9月12日	重大事项停牌	24.95	2017年7月4日	22.46	2,549	62,621.85	63,597.55	-
600657	信达地产	2017年2月20日	重大事项停牌	5.76	2017年8月10日	6.19	9,167	54,682.50	52,801.92	-
002122	天马	2017	重大	10.30	2017	11.15	4,604	48,686.46	47,421.20	-

	股份	年 4 月 24 日	事项 停牌		年 7 月 24 日					
600277	亿利 洁能	2017 年 3 月 6 日	重大 事项 停牌	7.83	-	-	5,400	42,952.00	42,282.00	-
600460	士兰 微	2017 年 5 月 12 日	重大 事项 停牌	6.07	2017 年 8 月 15 日	6.68	6,300	39,606.00	38,241.00	-
002128	露天 煤业	2017 年 3 月 17 日	重大 事项 停牌	8.70	2017 年 8 月 14 日	9.57	3,558	31,857.69	30,954.60	-
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	15.75	2017 年 8 月 9 日	14.50	1,800	28,746.58	28,350.00	-
002013	中航 机电	2017 年 5 月 12 日	重大 事项 停牌	10.33	2017 年 8 月 2 日	11.36	2,250	22,606.00	23,242.50	-
600655	豫园 商城	2016 年 12 月	重大 事项	11.32	-	-	1,500	16,806.00	16,980.00	-

		月 20 日	停牌							
601001	大同 煤业	2017 年 6 月 22 日	重大 事项 停牌	5.25	2017 年 7 月 21 日	5.78	659	3,419.94	3,459.75	-
002681	奋达 科技	2017 年 6 月 22 日	重大 事项 停牌	12.59	2017 年 7 月 3 日	12.70	96	1,185.60	1,208.64	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而

下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末无按长期评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。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。本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	794,199.10	-	-	-	794,199.10
结算备付金	233,004.00	-	-	-	233,004.00
存出保证金	5,069.88	-	-	-	5,069.88
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-9,699,384.99	9,699,384.99
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	138,800.20	138,800.20
应收利息	-	-	-	247.61	247.61
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	36,987.01	36,987.01
资产总计	1,032,272.98	-	-	-9,875,419.81	10,907,692.79
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	14,943.73	14,943.73
应付管理人报酬	-	-	-	4,205.55	4,205.55
应付托管费	-	-	-	1,261.67	1,261.67
应付交易费用	-	-	-	185,620.80	185,620.80

应付销售服务费	-	-	-	94.39	94.39
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	39,496.21	39,496.21
负债总计	-	-	-	245,622.35	245,622.35
利率敏感度缺口	1,032,272.98	-	-	-9,629,797.46	10,662,070.44
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	863,207.13	-	-	-	863,207.13
结算备付金	170,084.42	-	-	-	170,084.42
存出保证金	4,471.96	-	-	-	4,471.96
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-9,655,984.06	9,655,984.06
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	19,203.50	19,203.50
应收利息	-	-	-	255.94	255.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	1,037,763.51	-	-	-9,675,443.50	10,713,207.01
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	11,151.16	11,151.16
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	4,516.51	4,516.51
应付托管费	-	-	-	1,354.93	1,354.93
应付交易费用	-	-	-	59,832.55	59,832.55
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	110,430.09	110,430.09
负债总计	-	-	-	187,285.24	187,285.24

利率敏感度缺口	1,037,763.51	-	-9,488,158.26	10,525,921.77
---------	--------------	---	---------------	---------------

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	9,699,384.99	90.97	9,655,984.06	91.74
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	9,699,384.99	90.97	9,655,984.06	91.74

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,699,384.99	88.92
	其中：股票	9,699,384.99	88.92
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	1,027,203.10	9.42
7	其他各项资产	181,104.70	1.66
8	合计	10,907,692.79	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	232,674.81	2.18
B	采矿业	234,644.40	2.20
C	制造业	6,014,591.37	56.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	325,592.86	3.05

E	建筑业	240,199.20	2.25
F	批发和零售业	728,384.48	6.83
G	交通运输、仓储和邮政业	219,060.33	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	590,777.94	5.54
J	金融业	7,546.57	0.07
K	房地产业	615,642.48	5.77
L	租赁和商务服务业	19,695.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	71,741.84	0.67
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	205,236.67	1.92
S	综合	-	-
	合计	9,505,787.95	89.16

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	134,551.55	1.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	59,045.49	0.55
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	193,597.04	1.82

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002463	沪电股份	35,724	162,544.20	1.52
2	002315	焦点科技	5,770	143,903.80	1.35
3	002063	远光软件	12,719	132,531.98	1.24

4	600586	金晶科技	26,262	128,421.18	1.20
5	002371	七星电子	5,214	124,718.88	1.17
6	000417	合肥百货	14,633	120,722.25	1.13
7	002601	佰利联	7,348	120,360.24	1.13
8	600169	太原重工	29,790	114,989.40	1.08
9	600466	蓝光发展	13,227	114,149.01	1.07
10	000536	华映科技	19,424	112,853.44	1.06
11	600220	江苏阳光	31,748	108,895.64	1.02
12	601002	晋亿实业	12,584	108,851.60	1.02
13	600862	中航高科	11,069	107,258.61	1.01
14	603025	大豪科技	4,049	106,893.60	1.00
15	002589	瑞康医药	6,823	105,074.20	0.99
16	601717	郑煤机	13,300	103,607.00	0.97
17	000939	凯迪生态	20,140	102,714.00	0.96
18	603328	依顿电子	7,000	99,050.00	0.93
19	002217	合力泰	9,879	97,604.52	0.92
20	000612	焦作万方	11,903	95,819.15	0.90
21	600409	三友化工	9,500	95,665.00	0.90
22	000680	山推股份	17,045	92,895.25	0.87
23	002277	友阿股份	14,181	91,467.45	0.86
24	600307	酒钢宏兴	31,161	88,808.85	0.83
25	002308	威创股份	6,800	88,740.00	0.83
26	002073	软控股份	10,368	87,920.64	0.82
27	002317	众生药业	6,990	86,815.80	0.81
28	603005	晶方科技	3,100	86,769.00	0.81
29	002064	华峰氨纶	17,877	86,167.14	0.81
30	600881	亚泰集团	16,767	85,176.36	0.80
31	000979	中弘股份	32,365	84,796.30	0.80

32	600300	维维股份	15,768	84,201.12	0.79
33	600458	时代新材	7,271	83,252.95	0.78
34	600108	亚盛集团	19,051	82,109.81	0.77
35	002354	天神娱乐	3,818	82,087.00	0.77
36	601811	新华文轩	5,200	80,912.00	0.76
37	002588	史丹利	10,458	80,422.02	0.75
38	002477	雏鹰农牧	17,600	77,968.00	0.73
39	000761	本钢板材	14,887	77,859.01	0.73
40	603883	老百姓	1,600	77,840.00	0.73
41	600039	四川路桥	18,472	76,843.52	0.72
42	600582	天地科技	16,741	76,841.19	0.72
43	600936	广西广电	9,509	76,737.63	0.72
44	000528	柳工	8,806	76,083.84	0.71
45	002416	爱施德	7,006	75,594.74	0.71
46	600499	科达洁能	9,452	75,048.88	0.70
47	600776	东方通信	11,005	74,613.90	0.70
48	002002	鸿达兴业	9,399	73,594.17	0.69
49	002194	武汉凡谷	8,283	73,304.55	0.69
50	002505	大康农业	20,742	72,597.00	0.68
51	600826	兰生股份	4,000	72,400.00	0.68
52	002285	世联行	8,984	72,051.68	0.68
53	600348	阳泉煤业	10,595	71,834.10	0.67
54	002573	清新环境	3,812	71,741.84	0.67
55	600787	中储股份	9,015	71,308.65	0.67
56	002048	宁波华翔	3,392	70,757.12	0.66
57	600428	中远航运	11,373	70,740.06	0.66
58	600580	卧龙电气	10,353	70,607.46	0.66
59	000681	视觉中国	4,500	70,470.00	0.66

60	600517	置信电气	9,291	70,332.87	0.66
61	603866	桃李面包	1,965	69,914.70	0.66
62	000685	中山公用	6,384	69,904.80	0.66
63	600917	重庆燃气	7,291	68,754.13	0.64
64	600565	迪马股份	11,929	65,728.79	0.62
65	000090	天健集团	5,867	65,123.70	0.61
66	600584	长电科技	4,013	64,408.65	0.60
67	000786	北新建材	4,000	63,360.00	0.59
68	600267	海正药业	5,385	62,896.80	0.59
69	600765	中航重机	4,553	62,740.34	0.59
70	600022	山东钢铁	30,269	62,354.14	0.58
71	600831	广电网络	6,087	60,565.65	0.57
72	002340	格林美	9,900	59,895.00	0.56
73	002005	德豪润达	12,522	59,729.94	0.56
74	600839	四川长虹	16,254	58,839.48	0.55
75	600325	华发股份	6,990	58,366.50	0.55
76	600282	南钢股份	15,685	58,191.35	0.55
77	600594	益佰制药	3,756	57,316.56	0.54
78	002269	美邦服饰	15,339	57,214.47	0.54
79	000969	安泰科技	6,432	56,151.36	0.53
80	600801	华新水泥	5,820	55,464.60	0.52
81	600971	恒源煤电	6,777	55,097.01	0.52
82	600184	光电股份	2,900	54,404.00	0.51
83	000758	中色股份	7,719	54,110.19	0.51
84	600751	天海投资	9,498	54,043.62	0.51
85	600879	航天电子	6,042	53,109.18	0.50
86	600657	信达地产	9,167	52,801.92	0.50
87	600284	浦东建设	4,921	52,753.12	0.49

88	002078	太阳纸业	7,140	52,479.00	0.49
89	600073	上海梅林	5,439	51,942.45	0.49
90	600141	兴发集团	4,184	51,756.08	0.49
91	000543	皖能电力	8,865	51,682.95	0.48
92	000778	新兴铸管	7,600	50,920.00	0.48
93	600614	鼎立股份	4,500	49,500.00	0.46
94	600566	济川药业	1,300	49,439.00	0.46
95	002249	大洋电机	7,401	48,698.58	0.46
96	002491	通鼎互联	3,615	48,585.60	0.46
97	000997	新大陆	2,132	48,375.08	0.45
98	002122	天马股份	4,604	47,421.20	0.44
99	600416	湘电股份	3,444	47,182.80	0.44
100	603567	珍宝岛	2,777	46,736.91	0.44
101	601678	滨化股份	6,621	46,015.95	0.43
102	000816	智慧农业	6,126	45,577.44	0.43
103	002191	劲嘉股份	4,800	44,928.00	0.42
104	600770	综艺股份	5,816	43,620.00	0.41
105	000652	泰达股份	8,122	43,046.60	0.40
106	600277	亿利洁能	5,400	42,282.00	0.40
107	002414	高德红外	2,303	42,144.90	0.40
108	000830	鲁西化工	5,769	39,806.10	0.37
109	600460	士兰微	6,300	38,241.00	0.36
110	000620	新华联	5,360	38,109.60	0.36
111	600757	长江传媒	5,077	37,925.19	0.36
112	000930	中粮生化	3,499	37,719.22	0.35
113	000078	海王生物	6,144	37,048.32	0.35
114	600664	哈药股份	6,283	36,504.23	0.34
115	600335	国机汽车	2,942	35,186.32	0.33

116	600171	上海贝岭	3,305	33,611.85	0.32
117	000726	鲁泰A	2,774	32,899.64	0.31
118	601233	桐昆股份	2,323	32,196.78	0.30
119	002128	露天煤业	3,558	30,954.60	0.29
120	000878	云南铜业	2,307	30,429.33	0.29
121	002244	滨江集团	4,300	29,756.00	0.28
122	002118	紫鑫药业	4,348	29,696.84	0.28
123	600673	东阳光科	4,000	29,160.00	0.27
124	603658	安图生物	673	29,006.30	0.27
125	000066	长城电脑	3,160	28,471.60	0.27
126	300088	长信科技	1,800	28,350.00	0.27
127	000732	泰禾集团	1,678	27,989.04	0.26
128	603188	亚邦股份	1,500	26,160.00	0.25
129	600743	华远地产	6,071	25,619.62	0.24
130	002635	安洁科技	700	25,354.00	0.24
131	600596	新安股份	2,970	25,096.50	0.24
132	002051	中工国际	1,209	25,062.57	0.24
133	002503	搜于特	3,490	24,534.70	0.23
134	600894	广日股份	2,043	24,189.12	0.23
135	600628	新世界	2,092	24,162.60	0.23
136	000418	小天鹅A	500	23,395.00	0.22
137	002013	中航机电	2,250	23,242.50	0.22
138	601000	唐山港	4,400	22,968.00	0.22
139	002690	美亚光电	1,136	21,788.48	0.20
140	000572	海马汽车	4,000	20,680.00	0.19
141	600166	福田汽车	7,250	20,590.00	0.19
142	002482	广田集团	2,271	20,416.29	0.19
143	000031	中粮地产	2,700	20,331.00	0.19

144	600195	中牧股份	1,033	20,029.87	0.19
145	002707	众信旅游	1,500	19,695.00	0.18
146	600863	内蒙华电	6,528	19,649.28	0.18
147	000547	航天发展	1,842	19,248.90	0.18
148	000552	靖远煤电	5,375	19,188.75	0.18
149	002106	莱宝高科	1,839	18,629.07	0.17
150	603355	莱克电气	315	18,512.55	0.17
151	600516	方大炭素	1,294	18,400.68	0.17
152	000050	深天马 A	873	17,957.61	0.17
153	002345	潮宏基	1,650	17,935.50	0.17
154	600655	豫园商城	1,500	16,980.00	0.16
155	002242	九阳股份	801	15,755.67	0.15
156	600059	古越龙山	1,700	15,725.00	0.15
157	002699	美盛文化	1,085	14,973.00	0.14
158	000729	燕京啤酒	2,191	14,723.52	0.14
159	600266	北京城建	1,000	14,540.00	0.14
160	002479	富春环保	1,083	12,887.70	0.12
161	600058	五矿发展	1,000	12,410.00	0.12
162	600872	中炬高新	637	11,657.10	0.11
163	600201	生物股份	314	11,168.98	0.10
164	600736	苏州高新	1,306	9,233.42	0.09
165	600639	浦东金桥	500	9,060.00	0.08
166	600993	马应龙	400	8,712.00	0.08
167	000712	锦龙股份	461	7,546.57	0.07
168	000636	风华高科	741	6,305.91	0.06
169	600388	龙净环保	400	6,212.00	0.06
170	000012	南玻 A	648	6,045.84	0.06
171	002727	一心堂	300	5,520.00	0.05

172	603528	多伦科技	300	4,311.00	0.04
173	000596	古井贡酒	70	3,566.50	0.03
174	002489	浙江永强	556	3,547.28	0.03
175	601001	大同煤业	659	3,459.75	0.03
176	600618	氯碱化工	300	3,204.00	0.03
177	002093	国脉科技	336	2,956.80	0.03
178	002672	东江环保	175	2,955.75	0.03
179	002468	艾迪西	100	2,541.00	0.02
180	600122	宏图高科	200	2,220.00	0.02
181	000960	锡业股份	156	2,123.16	0.02
182	000541	佛山照明	229	2,086.19	0.02
183	002551	尚荣医疗	100	1,613.00	0.02
184	002681	奋达科技	96	1,208.64	0.01
185	002276	万马股份	100	1,009.00	0.01
186	601928	凤凰传媒	98	956.48	0.01
187	600869	智慧能源	100	673.00	0.01
188	002332	仙琚制药	10	86.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600468	百利电气	10,916	70,954.00	0.67
2	002025	航天电器	2,549	63,597.55	0.60
3	000631	顺发恒业	13,389	59,045.49	0.55

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002463	沪电股份	753,547.00	7.16
2	002315	焦点科技	622,833.96	5.92
3	002479	富春环保	597,851.00	5.68
4	600831	广电网络	593,053.00	5.63
5	600596	新安股份	580,797.00	5.52
6	002064	华峰氨纶	579,060.00	5.50
7	600183	生益科技	576,789.00	5.48
8	000417	合肥百货	573,758.00	5.45
9	002194	武汉凡谷	572,673.00	5.44
10	601678	滨化股份	567,754.00	5.39
11	002249	大洋电机	566,216.00	5.38
12	600801	华新水泥	563,665.00	5.36
13	600971	恒源煤电	563,195.00	5.35
14	601233	桐昆股份	552,281.00	5.25
15	600141	兴发集团	551,840.00	5.24
16	000761	本钢板材	547,655.00	5.20
17	002317	众生药业	542,041.00	5.15
18	600776	东方通信	528,698.86	5.02
19	002118	紫鑫药业	514,638.00	4.89
20	002332	仙琚制药	505,826.00	4.81
21	002414	高德红外	498,965.00	4.74
22	000878	云南铜业	498,672.00	4.74
23	600195	中牧股份	498,402.00	4.73
24	000426	兴业矿业	497,061.00	4.72
25	002106	莱宝高科	496,754.00	4.72
26	600282	南钢股份	496,722.00	4.72

27	000726	鲁 泰 A	493,456.81	4.69
28	600586	金晶科技	492,493.00	4.68
29	600565	迪马股份	490,015.00	4.66
30	002503	搜于特	487,530.00	4.63
31	000612	焦作万方	483,493.00	4.59
32	600862	中航高科	483,036.00	4.59
33	600053	九鼎投资	481,091.00	4.57
34	002589	瑞康医药	479,934.00	4.56
35	002285	世联行	479,418.40	4.55
36	600517	置信电气	479,375.00	4.55
37	600267	海正药业	478,081.00	4.54
38	600575	皖江物流	475,388.00	4.52
39	600300	维维股份	475,015.00	4.51
40	600433	冠豪高新	472,910.00	4.49
41	002078	太阳纸业	472,815.00	4.49
42	000049	德赛电池	470,554.00	4.47
43	002217	合力泰	468,206.00	4.45
44	600808	马钢股份	468,054.00	4.45
45	600499	科达洁能	465,978.00	4.43
46	002281	光迅科技	464,181.00	4.41
47	600220	江苏阳光	461,498.00	4.38
48	002396	星网锐捷	457,158.00	4.34
49	600881	亚泰集团	456,062.84	4.33
50	600216	浙江医药	455,096.00	4.32
51	002588	史丹利	454,827.00	4.32
52	600720	祁连山	449,177.00	4.27
53	000960	锡业股份	446,969.00	4.25
54	600348	阳泉煤业	446,693.00	4.24

55	000997	新大陆	442,603.00	4.20
56	002155	湖南黄金	442,217.00	4.20
57	000681	视觉中国	440,885.00	4.19
58	601010	文峰股份	438,900.00	4.17
59	600073	上海梅林	437,716.00	4.16
60	002371	七星电子	437,288.00	4.15
61	600335	国机汽车	436,923.04	4.15
62	002005	德豪润达	436,142.00	4.14
63	002482	广田集团	433,073.00	4.11
64	002354	天神娱乐	431,461.84	4.10
65	600601	方正科技	427,222.00	4.06
66	002416	爱施德	426,282.00	4.05
67	603567	珍宝岛	422,513.00	4.01
68	600059	古越龙山	420,726.00	4.00
69	600307	酒钢宏兴	419,392.00	3.98
70	000528	柳工	415,016.00	3.94
71	603025	大豪科技	413,444.00	3.93
72	600088	中视传媒	412,114.08	3.92
73	000703	恒逸石化	410,042.88	3.90
74	600039	四川路桥	409,083.35	3.89
75	603868	飞科电器	405,361.00	3.85
76	600312	平高电气	405,027.00	3.85
77	600466	蓝光发展	403,778.00	3.84
78	002056	横店东磁	399,474.00	3.80
79	600917	重庆燃气	398,626.00	3.79
80	600325	华发股份	397,796.00	3.78
81	000969	安泰科技	397,527.00	3.78
82	603198	迎驾贡酒	395,263.00	3.76

83	600067	冠城大通	395,130.00	3.75
84	002408	齐翔腾达	392,650.00	3.73
85	600757	长江传媒	391,560.00	3.72
86	002048	宁波华翔	391,164.00	3.72
87	000830	鲁西化工	390,216.94	3.71
88	603328	依顿电子	386,289.00	3.67
89	600458	时代新材	386,101.51	3.67
90	002244	滨江集团	384,149.00	3.65
91	002277	友阿股份	379,620.00	3.61
92	002269	美邦服饰	377,872.00	3.59
93	600338	西藏珠峰	377,796.00	3.59
94	600580	卧龙电气	375,844.00	3.57
95	600022	山东钢铁	372,904.00	3.54
96	002368	太极股份	372,268.00	3.54
97	002073	软控股份	372,044.00	3.53
98	600058	五矿发展	370,750.55	3.52
99	000667	美好置业	366,502.00	3.48
100	002551	尚荣医疗	365,557.00	3.47
101	600770	综艺股份	365,291.00	3.47
102	002498	汉缆股份	361,557.00	3.43
103	000400	许继电气	355,941.00	3.38
104	600748	上实发展	355,686.94	3.38
105	000021	深科技	354,210.00	3.37
106	000961	中南建设	345,249.00	3.28
107	600468	百利电气	344,154.00	3.27
108	600409	三友化工	343,787.00	3.27
109	600618	氯碱化工	342,444.00	3.25
110	002491	通鼎互联	341,061.95	3.24

111	000090	天健集团	340,621.00	3.24
112	000541	佛山照明	339,452.55	3.22
113	002063	远光软件	337,676.86	3.21
114	000543	皖能电力	337,578.00	3.21
115	600872	中炬高新	336,581.00	3.20
116	603866	桃李面包	335,529.14	3.19
117	000919	金陵药业	333,525.92	3.17
118	601002	晋亿实业	331,857.81	3.15
119	002002	鸿达兴业	331,130.00	3.15
120	000636	风华高科	331,044.00	3.15
121	600138	中青旅	330,196.00	3.14
122	000652	泰达股份	328,066.00	3.12
123	002366	台海核电	322,654.00	3.07
124	002440	闰土股份	322,251.34	3.06
125	002029	七匹狼	321,248.94	3.05
126	000401	冀东水泥	320,508.00	3.04
127	603766	隆鑫通用	319,217.00	3.03
128	603883	老百姓	318,625.70	3.03
129	600525	长园集团	318,464.00	3.03
130	002093	国脉科技	317,983.00	3.02
131	601311	骆驼股份	317,911.00	3.02
132	002233	塔牌集团	316,375.00	3.01
133	000501	鄂武商A	316,073.88	3.00
134	600284	浦东建设	314,963.00	2.99
135	600664	哈药股份	312,972.00	2.97
136	600751	天海投资	310,971.00	2.95
137	000930	中粮生化	309,421.00	2.94
138	000861	海印股份	308,554.00	2.93

139	600584	长电科技	305,925.00	2.91
140	601699	潞安环能	304,420.00	2.89
141	600497	驰宏锌锗	301,492.00	2.86
142	600169	太原重工	298,361.00	2.83
143	600967	北方创业	296,480.90	2.82
144	600219	南山铝业	293,756.00	2.79
145	000031	中粮地产	293,251.08	2.79
146	600460	士兰微	289,150.00	2.75
147	601001	大同煤业	286,345.00	2.72
148	600597	光明乳业	285,133.00	2.71
149	600380	健康元	284,834.00	2.71
150	601886	江河集团	283,661.00	2.69
151	600397	安源煤业	283,250.00	2.69
152	002308	威创股份	281,678.00	2.68
153	002011	盾安环境	281,070.00	2.67
154	600894	广日股份	280,435.00	2.66
155	600628	新世界	280,089.00	2.66
156	601717	郑煤机	275,173.00	2.61
157	603005	晶方科技	274,123.00	2.60
158	000685	中山公用	271,055.00	2.58
159	000939	凯迪生态	270,497.00	2.57
160	000727	华东科技	269,568.00	2.56
161	600108	亚盛集团	269,474.00	2.56
162	600516	方大炭素	269,069.00	2.56
163	600259	广晟有色	267,648.80	2.54
164	600835	上海机电	267,361.00	2.54
165	601908	京运通	267,210.00	2.54
166	601016	节能风电	266,697.00	2.53

167	000552	靖远煤电	265,680.00	2.52
168	600180	瑞茂通	265,621.71	2.52
169	600587	新华医疗	265,391.00	2.52
170	000926	福星股份	264,696.00	2.51
171	002092	中泰化学	263,587.00	2.50
172	002345	潮宏基	263,299.00	2.50
173	000758	中色股份	262,796.00	2.50
174	002640	跨境通	262,440.00	2.49
175	002698	博实股份	262,280.00	2.49
176	600175	美都能源	260,958.00	2.48
177	002444	巨星科技	260,486.42	2.47
178	002672	东江环保	258,232.00	2.45
179	300032	金龙机电	256,138.00	2.43
180	002242	九阳股份	254,858.00	2.42
181	000547	航天发展	254,336.00	2.42
182	002238	天威视讯	253,159.00	2.41
183	002573	清新环境	251,826.00	2.39
184	600422	昆药集团	251,294.00	2.39
185	000690	宝新能源	251,060.00	2.39
186	000517	荣安地产	251,010.00	2.38
187	600773	西藏城投	249,108.00	2.37
188	600978	宜华生活	247,667.00	2.35
189	002309	中利科技	245,511.00	2.33
190	000988	华工科技	242,677.00	2.31
191	600848	上海临港	241,694.00	2.30
192	000078	海王生物	238,103.00	2.26
193	600537	亿晶光电	237,484.00	2.26
194	002392	北京利尔	235,944.00	2.24

195	600270	外运发展	235,055.00	2.23
196	002176	江特电机	234,003.00	2.22
197	601689	拓普集团	233,948.00	2.22
198	300202	聚龙股份	231,742.00	2.20
199	000587	金洲慈航	230,688.00	2.19
200	600765	中航重机	229,106.00	2.18
201	603355	莱克电气	228,752.00	2.17
202	002340	格林美	228,099.00	2.17
203	002004	华邦健康	227,528.00	2.16
204	600694	大商股份	226,037.00	2.15
205	000572	海马汽车	225,803.00	2.15
206	600166	福田汽车	223,915.00	2.13
207	600395	盘江股份	222,314.00	2.11
208	603806	福斯特	222,312.68	2.11
209	002022	科华生物	221,739.00	2.11
210	600981	汇鸿集团	219,511.00	2.09
211	600826	兰生股份	218,582.00	2.08
212	000931	中关村	218,274.20	2.07
213	002595	豪迈科技	215,777.14	2.05
214	000810	创维数字	213,629.00	2.03
215	600635	大众公用	211,934.00	2.01

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600183	生益科技	604,367.37	5.74
2	002463	沪电股份	591,536.29	5.62

3	600971	恒源煤电	588,634.91	5.59
4	002479	富春环保	581,901.81	5.53
5	600596	新安股份	564,872.91	5.37
6	600801	华新水泥	564,202.24	5.36
7	600831	广电网络	559,543.46	5.32
8	002332	仙琚制药	559,531.90	5.32
9	000426	兴业矿业	557,494.29	5.30
10	600195	中牧股份	552,113.57	5.25
11	002106	莱宝高科	548,917.60	5.21
12	000761	本钢板材	543,640.66	5.16
13	601678	滨化股份	531,093.79	5.05
14	600335	国机汽车	530,420.96	5.04
15	002249	大洋电机	526,153.85	5.00
16	002315	焦点科技	517,622.90	4.92
17	002317	众生药业	511,423.27	4.86
18	000417	合肥百货	502,151.77	4.77
19	000049	德赛电池	502,092.01	4.77
20	601233	桐昆股份	498,118.88	4.73
21	600141	兴发集团	496,194.16	4.71
22	002396	星网锐捷	495,371.01	4.71
23	600433	冠豪高新	494,485.78	4.70
24	002064	华峰氨纶	491,423.69	4.67
25	600053	九鼎投资	487,147.77	4.63
26	002118	紫鑫药业	482,894.74	4.59
27	600808	马钢股份	480,539.02	4.57
28	002194	武汉凡谷	478,487.48	4.55
29	600216	浙江医药	474,345.68	4.51
30	002281	光迅科技	467,876.05	4.44

31	000878	云南铜业	467,736.62	4.44
32	002503	搜于特	466,092.45	4.43
33	600267	海正药业	463,442.30	4.40
34	002414	高德红外	461,806.26	4.39
35	600586	金晶科技	460,489.78	4.37
36	000726	鲁泰A	458,650.50	4.36
37	002368	太极股份	457,863.23	4.35
38	600282	南钢股份	457,702.55	4.35
39	600517	置信电气	456,936.31	4.34
40	600067	冠城大通	455,412.04	4.33
41	000960	锡业股份	452,472.36	4.30
42	600575	皖江物流	451,786.73	4.29
43	600776	东方通信	450,368.34	4.28
44	603868	飞科电器	449,502.31	4.27
45	002078	太阳纸业	447,968.69	4.26
46	601010	文峰股份	445,556.45	4.23
47	603198	迎驾贡酒	445,038.27	4.23
48	002155	湖南黄金	444,881.98	4.23
49	600499	科达洁能	441,248.26	4.19
50	600720	祁连山	438,870.38	4.17
51	002589	瑞康医药	435,943.86	4.14
52	600059	古越龙山	435,047.53	4.13
53	600338	西藏珠峰	435,044.93	4.13
54	600312	平高电气	432,616.38	4.11
55	603567	珍宝岛	430,154.22	4.09
56	002285	世联行	429,100.48	4.08
57	600073	上海梅林	427,936.73	4.07
58	600300	维维股份	427,123.67	4.06

59	002551	尚荣医疗	423,909.54	4.03
60	002056	横店东磁	417,309.84	3.96
61	002005	德豪润达	417,203.40	3.96
62	600862	中航高科	416,956.58	3.96
63	600565	迪马股份	416,871.41	3.96
64	600757	长江传媒	414,803.89	3.94
65	600601	方正科技	414,607.02	3.94
66	002482	广田集团	413,599.29	3.93
67	600872	中炬高新	412,985.16	3.92
68	000703	恒逸石化	408,435.57	3.88
69	600088	中视传媒	406,900.17	3.87
70	000997	新大陆	402,417.50	3.82
71	000681	视觉中国	399,170.16	3.79
72	002244	滨江集团	398,719.71	3.79
73	000667	美好置业	398,251.67	3.78
74	600881	亚泰集团	397,921.53	3.78
75	002408	齐翔腾达	397,885.40	3.78
76	600458	时代新材	397,244.81	3.77
77	002217	合力泰	396,039.46	3.76
78	002498	汉缆股份	395,372.08	3.76
79	000830	鲁西化工	393,699.37	3.74
80	000541	佛山照明	389,039.21	3.70
81	600220	江苏阳光	383,737.35	3.65
82	002048	宁波华翔	383,255.85	3.64
83	002029	七匹狼	380,288.98	3.61
84	000401	冀东水泥	379,001.02	3.60
85	600058	五矿发展	376,041.00	3.57
86	000528	柳工	374,502.73	3.56

87	600348	阳泉煤业	371,477.64	3.53
88	002354	天神娱乐	370,831.72	3.52
89	000969	安泰科技	370,556.84	3.52
90	002588	史丹利	370,165.75	3.52
91	000919	金陵药业	366,724.88	3.48
92	600580	卧龙电气	366,416.22	3.48
93	000400	许继电气	365,969.90	3.48
94	600397	安源煤业	363,928.22	3.46
95	000612	焦作万方	363,536.49	3.45
96	002011	盾安环境	357,562.14	3.40
97	600748	上实发展	357,504.87	3.40
98	600180	瑞茂通	356,695.38	3.39
99	002416	爱施德	354,442.04	3.37
100	601311	骆驼股份	352,210.66	3.35
101	600325	华发股份	351,467.27	3.34
102	002371	七星电子	350,031.98	3.33
103	000021	深科技	349,193.55	3.32
104	600664	哈药股份	348,073.80	3.31
105	600138	中青旅	348,041.34	3.31
106	002440	闰土股份	347,422.21	3.30
107	600022	山东钢铁	346,804.66	3.29
108	002233	塔牌集团	346,345.83	3.29
109	601886	江河集团	345,216.85	3.28
110	601001	大同煤业	343,498.48	3.26
111	600307	酒钢宏兴	339,502.47	3.23
112	000961	中南建设	339,073.21	3.22
113	002309	中利科技	337,533.39	3.21
114	600525	长园集团	333,361.30	3.17

115	600597	光明乳业	331,832.02	3.15
116	000543	皖能电力	331,541.61	3.15
117	000636	风华高科	330,166.05	3.14
118	600618	氯碱化工	329,503.14	3.13
119	603766	隆鑫通用	329,408.38	3.13
120	601002	晋亿实业	328,938.04	3.13
121	000652	泰达股份	328,545.70	3.12
122	002366	台海核电	323,961.79	3.08
123	000501	鄂武商 A	321,426.12	3.05
124	600039	四川路桥	315,497.97	3.00
125	601016	节能风电	315,022.42	2.99
126	600770	综艺股份	312,769.02	2.97
127	000861	海印股份	308,771.27	2.93
128	002093	国脉科技	308,447.67	2.93
129	002269	美邦服饰	306,888.63	2.92
130	000587	金洲慈航	306,817.67	2.91
131	600270	外运发展	306,427.03	2.91
132	002491	通鼎互联	305,451.95	2.90
133	600835	上海机电	304,973.13	2.90
134	600978	宜华生活	304,844.96	2.90
135	600967	北方创业	304,614.49	2.89
136	600917	重庆燃气	302,757.19	2.88
137	600894	广日股份	302,263.03	2.87
138	600981	汇鸿集团	298,547.76	2.84
139	600259	广晟有色	297,692.29	2.83
140	603883	老百姓	297,211.10	2.82
141	603328	依顿电子	295,162.06	2.80
142	603025	大豪科技	293,831.84	2.79

143	600219	南山铝业	292,384.70	2.78
144	601699	潞安环能	292,125.63	2.78
145	600497	驰宏锌锗	291,654.23	2.77
146	600466	蓝光发展	290,837.20	2.76
147	600773	西藏城投	288,548.15	2.74
148	603806	福斯特	288,007.68	2.74
149	600380	健康元	287,367.84	2.73
150	600751	天海投资	287,088.64	2.73
151	002698	博实股份	287,034.88	2.73
152	600468	百利电气	286,936.67	2.73
153	000090	天健集团	286,044.49	2.72
154	002392	北京利尔	285,820.01	2.72
155	002277	友阿股份	285,232.15	2.71
156	002640	跨境通	277,855.66	2.64
157	300032	金龙机电	277,121.36	2.63
158	002242	九阳股份	275,692.42	2.62
159	600409	三友化工	274,920.26	2.61
160	002238	天威视讯	274,904.04	2.61
161	600729	重庆百货	274,740.43	2.61
162	600175	美都能源	274,145.24	2.60
163	002073	软控股份	273,979.10	2.60
164	600292	远达环保	272,799.74	2.59
165	000031	中粮地产	272,428.74	2.59
166	002444	巨星科技	270,350.67	2.57
167	000552	靖远煤电	268,731.22	2.55
168	002004	华邦健康	268,126.69	2.55
169	600587	新华医疗	266,768.89	2.53
170	000930	中粮生化	266,130.03	2.53

171	603866	桃李面包	265,831.74	2.53
172	000418	小天鹅A	265,543.62	2.52
173	601908	京运通	265,065.28	2.52
174	600516	方大炭素	264,737.63	2.52
175	002092	中泰化学	263,420.78	2.50
176	000926	福星股份	262,021.75	2.49
177	600694	大商股份	261,308.47	2.48
178	000727	华东科技	260,796.00	2.48
179	002002	鸿达兴业	260,567.47	2.48
180	600628	新世界	259,759.66	2.47
181	000690	宝新能源	258,552.76	2.46
182	002672	东江环保	257,196.94	2.44
183	000089	深圳机场	256,645.61	2.44
184	600736	苏州高新	254,128.68	2.41
185	000517	荣安地产	253,773.93	2.41
186	600823	世茂股份	253,549.52	2.41
187	600284	浦东建设	252,809.70	2.40
188	600584	长电科技	252,518.16	2.40
189	000825	太钢不锈	252,471.55	2.40
190	600460	士兰微	252,072.04	2.39
191	600422	昆药集团	249,540.85	2.37
192	002022	科华生物	249,172.91	2.37
193	002345	潮宏基	248,088.51	2.36
194	600537	亿晶光电	246,813.29	2.34
195	300043	星辉娱乐	246,287.49	2.34
196	601231	环旭电子	245,512.10	2.33
197	600743	华远地产	244,993.72	2.33
198	002325	洪涛股份	244,055.54	2.32

199	000028	国药一致	243,879.01	2.32
200	002573	清新环境	243,167.16	2.31
201	000988	华工科技	242,705.97	2.31
202	601689	拓普集团	242,032.15	2.30
203	600848	上海临港	241,700.73	2.30
204	002701	奥瑞金	240,827.26	2.29
205	002050	三花智控	240,177.90	2.28
206	000931	中关村	238,845.41	2.27
207	600240	华业资本	236,899.69	2.25
208	600395	盘江股份	233,997.82	2.22
209	002595	豪迈科技	232,361.11	2.21
210	000810	创维数字	232,158.31	2.21
211	000547	航天发展	231,919.85	2.20
212	000959	首钢股份	228,541.86	2.17
213	002176	江特电机	223,103.15	2.12
214	600635	大众公用	222,297.31	2.11
215	002384	东山精密	218,848.22	2.08
216	300202	聚龙股份	217,642.63	2.07
217	601012	隆基股份	217,509.67	2.07
218	002431	棕榈股份	216,704.89	2.06
219	600765	中航重机	212,738.57	2.02
220	000519	江南红箭	212,407.12	2.02
221	603355	莱克电气	211,381.56	2.01
222	002657	中科金财	210,791.63	2.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	105,711,454.27
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	105,751,255.64
--------------	----------------

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,069.88
2	应收证券清算款	138,800.20
3	应收股利	-
4	应收利息	247.61
5	应收申购款	36,987.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	181,104.70

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600468	百利电气	70,954.00	0.67	重大事项停牌
2	002025	航天电器	63,597.55	0.60	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
中 金 中 证 500A	54	192,686.06	10,000,000.00	96.11%	405,047.27	3.89%
中 金 中 证 500C	37	6,085.68	-	0.00%	225,170.06	100.00%
合计	91	116,815.58	10,000,000.00	94.07%	630,217.33	5.93%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	中金中证 500A	139,128.76	1.3371%
	中金中证 500C	39,447.98	17.5192%
	合计	178,576.74	1.6799%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金	中金中证 500A	10~50

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	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	94.07	10,000,000.00	94.07	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	154,743.25	1.46	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,154,743.25	95.53	10,000,000.00	94.07	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）基金份额总额	10,001,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	10,270,512.84	92.62
本报告期基金总申购份额	258,125.82	299,491.28
减：本报告期基金总赎回份额	123,591.39	74,413.84
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,405,047.27	225,170.06

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
中金公司	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	99,027,220.56	46.83%	72,419.68	46.83%	-
兴业证券	2	29,487,745.76	13.94%	21,564.96	13.94%	-
长江证券	2	82,947,743.59	39.23%	60,660.30	39.23%	-

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

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

2、基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2016 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	2017 年 1 月 20 日
2	关于新增平安证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 2 月 28 日
3	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书及其摘要（2017 年第 1 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 8 日
4	关于放下部分基金新增上海好买基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 15 日
5	关于新增上海万得投资顾问有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 15 日
6	关于新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 18 日
7	关于新增上海陆享投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 22 日
8	中金基金管理有限公司督察长任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017 年 3 月 25 日
9	中金中证 500 指数增强型发	《中国证券报》、《上	2017 年 3 月 28 日

	起式证券投资基金基金经理 变更公告	海证券报》、《证券时 报》及/或公司网站	
10	中金中证 500 指数增强型发 起式证券投资基金 2016 年度 报告及其摘要	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》及/或公司网站	2017 年 3 月 31 日
11	中金中证 500 指数增强发起 式证券投资基金 2017 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	2017 年 4 月 21 日
12	关于新增长城证券股份有限 公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》及/或公司网站	2017 年 5 月 19 日
13	关于新增中国国际金融股份 有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》及/或公司网站	2017 年 5 月 23 日
14	关于新增中国银河证券股份 有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》及/或公司网站	2017 年 5 月 26 日
15	关于中金基金管理有限公司 调整旗下基金最低持有份额 的公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》及/或公司网站	2017 年 6 月 29 日
16	关于中金基金管理有限公司 旗下基金调整直销中心最低 申购金额的公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》及/或公司网站	2017 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
自有资金	1	2017 年 4 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	94.07

产品特有风险

(1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

(2) 目标指数波动的风险

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

(3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

- a. 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；
- b. 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；
- c. 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差；

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

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

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

（4）目标指数变更的风险

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

（5）主动增强投资的风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金募集的注册文件
- 2、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人和/或基金托管人住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：010-63211122 400-868-1166

传真：010-66159121

中金基金管理有限公司

2017 年 8 月 29 日