

# 中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证 券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 26 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 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 2019 年 1 月 25 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中金 MSCI 价值	
基金主代码	006349	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 25 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	15,039,937.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中金 MSCI 价值 A	中金 MSCI 价值 C
下属分级基金的交易代码:	006349	006350
报告期末下属分级基金的份额总额	13,791,882.01 份	1,248,055.27 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际价值指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型证券投资基金和混合型证券投资基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 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	招商银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	李虹	张燕
	联系电话	010-63211122	0755-83199084
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	400-868-1166	95555	
传真	010-66159121	0755-83195201	

### 2.4 信息披露方式

登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	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 MSCI 价值 A	中金 MSCI 价值 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月25日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月25日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	1,620,655.27	164,223.39
本期利润	1,734,414.86	77,761.69
加权平均基金份额本期利润	0.1389	0.0719
本期基金份额净值增长率	16.87%	16.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1218	0.1211
期末基金资产净值	16,119,075.92	1,457,857.23
期末基金份额净值	1.1687	1.1681

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2019年1月25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 MSCI 价值 A

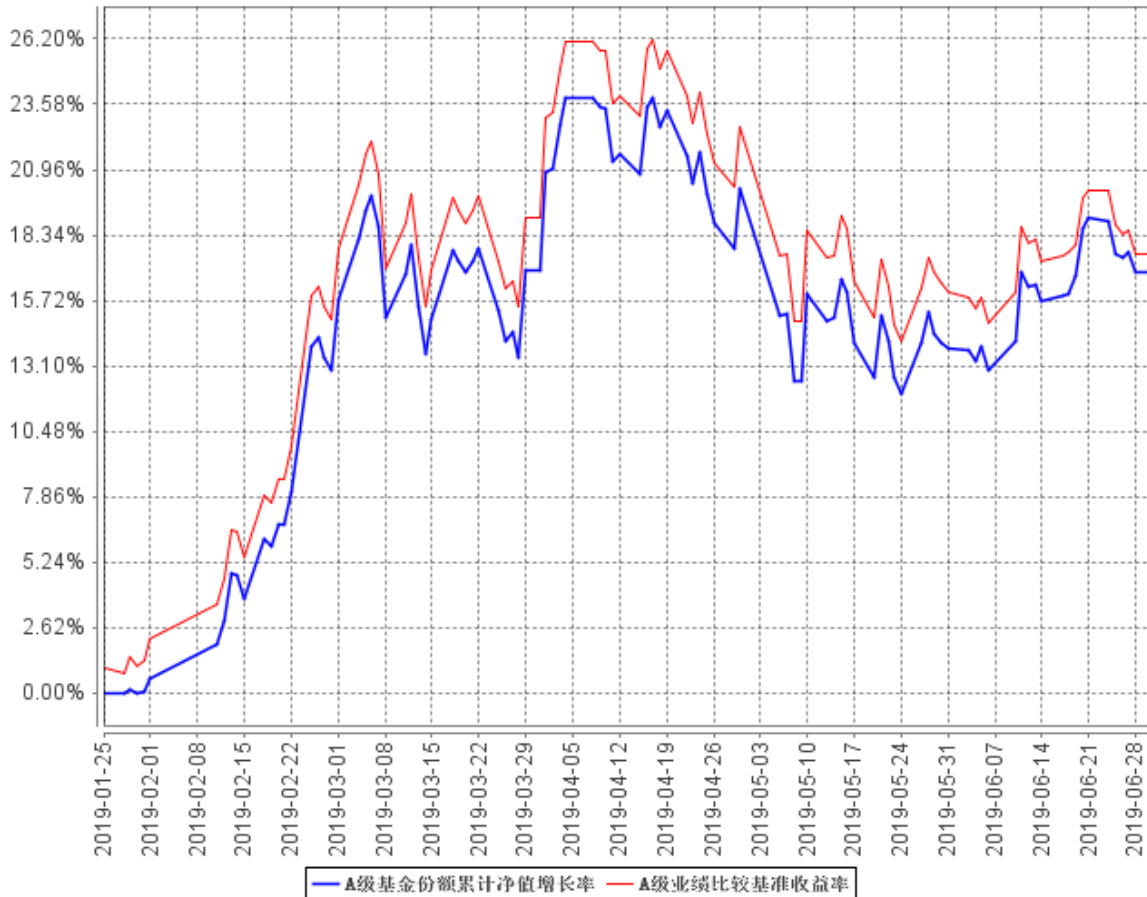
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.70%	0.83%	1.32%	0.81%	1.38%	0.02%
过去三个月	-0.04%	1.30%	-1.19%	1.29%	1.15%	0.01%
自基金合同生效起至今	16.87%	1.40%	17.61%	1.41%	-0.74%	-0.01%

中金 MSCI 价值 C

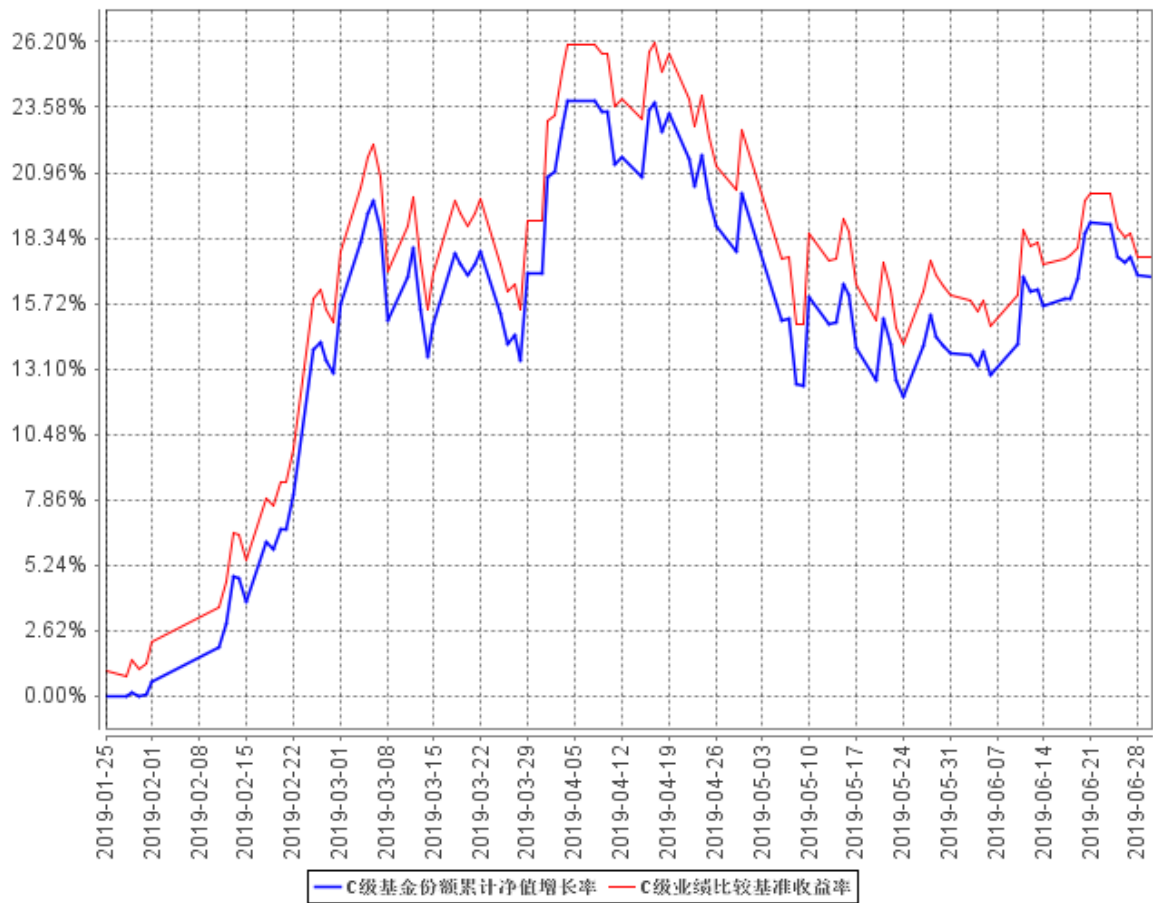
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.68%	0.83%	1.32%	0.81%	1.36%	0.02%
过去三个月	-0.09%	1.30%	-1.19%	1.29%	1.10%	0.01%
自基金合同生效起至今	16.81%	1.40%	17.61%	1.41%	-0.80%	-0.01%

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



注：本基金的基金合同生效日为 2019 年 1 月 25 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，截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于2014年2月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本3.5亿元人民币。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2019年6月30日，公司共管理27只开放式基金，证券投资基金管理规模166.33亿元。

#### 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		
朱宝臣	本基金基金经理	2019年1月25日	-	12年	朱宝臣先生，理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部投资经理、量化投资总监。2017年10月加入中金基金管理有限公司，现任量化投资团队负责人。

注：1、上述基金经理任职日期为本基金基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，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

本基金自 2019 年 1 月 25 日成立以来，截止 2019 年 2 月 11 日，顺利完成建仓。后续股票保持 95%左右的仓位，采用完全复制 MSCI 价值 SmartBeta 指数的策略，余下资金买入一年内到期国债。我们将继续采用完全复制 MSCI 价值 SmartBeta 指数的策略，力争更小的跟踪误差。

2018 年，A 股市场呈现震荡下跌的走势。2019 年一季度，A 股市场有较大幅度的反弹，这轮快速上涨，除了 2018 年的下跌已经使多个指数的估值处于历史低位以外，主要是由于造成去年悲观情绪的主要因素“贸易战”和“去杠杆”，在春节前后其预期都得到了较大的改善。2019 年第二季度，4 月上旬市场继续上涨，但之后一直震荡下跌，直到 6 月上旬、6 月中下旬是一波反弹。这期间影响市场的主要因素之一还是中美贸易摩擦的形势不断变化。从年初的乐观预期，到 5 月的直转急下，特朗普宣称对谈判进度及内容不满，要提高 2000 亿美元关税税率至 25%，并采取了包括将华为等中国企业列入出口管制“实体清单”等一系列措施。6 月，国家主席习近平 18 日应约同美国总统特朗普通电话，双方同意在 G20 大阪峰会期间举行会晤；G20 中美两国元首会晤后，同意重启经贸磋商，美方表示不再对中国出口产品加征新的关税，且特朗普表示将允许美国公司向华为出口设备，会谈结果好于预期。近期，中美贸易摩擦阴云再起，市场震荡下行。国内经济方面，从逐渐披露的中报业绩来看，预计 2019 年上半年 A 股上市公司盈利增速将有所放缓，科创



板首批公司中报业绩增速较去年年底有所放缓，创业板业绩同比增速相比一季度有所回升。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金 MSCI 价值 A 基金份额净值为 1.1687 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.87%；截至本报告期末中金 MSCI 价值 C 基金份额净值为 1.1681 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.81%；同期业绩比较基准收益率为 17.61%。

#### 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 年下半年，国际环境以及国内经济增长的不确定性较强，需要密切关注：中美经贸关系变化，尤其是关税提升的实际影响；上半年增长疲弱的影响，企业资本开支情况；减税降费的效果；中小银行去杠杆对金融机构的影响。预计下半年市场整体不会强势，相对来说比较看好：业绩超预期的个股；估值低、有积极催化剂或政策预期的板块，如农业、汽车等；消费与产业升级的优质龙头，消费、医药、科技等。

#### 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		109,660.54	-
结算备付金		111,152.08	-
存出保证金		8,532.17	-
交易性金融资产		17,675,024.40	-
其中：股票投资		16,720,570.00	-
基金投资		-	-
债券投资		954,454.40	-
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		126,048.21	-
应收利息		12,358.79	-
应收股利		-	-
应收申购款		49,798.57	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		18,092,574.76	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		300,000.00	-
应付证券清算款		36,176.22	-
应付赎回款		89,474.39	-
应付管理人报酬		10,208.18	-
应付托管费		2,187.46	-
应付销售服务费		335.75	-
应付交易费用		4,938.15	-

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		72,321.46	-
负债合计		515,641.61	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		15,039,937.28	-
未分配利润		2,536,995.87	-
所有者权益合计		17,576,933.15	-
负债和所有者权益总计		18,092,574.76	-

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，中金 MSCI 价值 A 基金份额净值 1.1687 元，基金份额总额 13,791,882.01 份；中金 MSCI 价值 C 基金份额净值 1.1681 元，基金份额总额 1,248,055.27 份。中金 MSCI 价值份额总额合计为 15,039,937.28 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 25 日(基 金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,970,205.01	-
1.利息收入		16,520.27	-
其中：存款利息收入		3,248.91	-
债券利息收入		8,503.54	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,767.82	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,920,583.22	-
其中：股票投资收益		1,619,036.58	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,411.72	-
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		299,134.92	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		27,297.89	-

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		5,803.63	-
<b>减：二、费用</b>		158,028.46	-
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	46,282.35	-
2. 托管费	6.4.7.2.2	9,917.63	-
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	1,302.21	-
4. 交易费用		24,775.78	-
5. 利息支出		3,104.43	-
其中：卖出回购金融资产支出		3,104.43	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用		72,646.06	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,812,176.55	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,812,176.55	-

注：本基金合同生效日为2019年1月25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MSCI中国A股国际价值指数发起式证券投资基金

本报告期：2019年1月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日（基金合同生效日）至2019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）	10,561,944.88	-	10,561,944.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,812,176.55	1,812,176.55
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）	4,477,992.40	724,819.32	5,202,811.72
其中：1.基金申购款	9,340,138.83	1,606,926.24	10,947,065.07

2. 基金赎回款	-4,862,146.43	-882,106.92	-5,744,253.35
五、期末所有者权益 (基金净值)	15,039,937.28	2,536,995.87	17,576,933.15

注：本基金合同生效日为 2019 年 1 月 25 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>孙菁</u>	<u>张纳</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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数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 2018 年 6 月 22 日证监许可 [2018] 1017 号《关于准予中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数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 MSCI 中国 A 股国际价值指数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，托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

本基金通过中金基金直销中心和公司指定的其他销售机构公开发售，募集期为 2018 年 12 月 21 日至 2019 年 3 月 20 日。经向中国证监会备案，《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 1 月 25 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 10,561,944.88 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 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金合同》和《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金为股票指数型发起式证券投资基金，跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，实现对标的指数的有效跟踪。本基金投资范围主要为标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债券、短期融资券、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、

权证、资产支持证券、股指期货、股票期权、同业存单、银行存款以及法律法规或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2019年6月30日的财务状况、自2019年1月25日至2019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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.4.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

##### **6.4.4.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

##### **6.4.4.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

#### **6.4.5 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。

## 6.4.6 关联方关系

### 6.4.6.1 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。

### 6.4.6.2 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
招商银行	基金托管人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司（“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（“中投证券”）	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中金公司	39,402,513.83	100.00%

注：本基金合同生效日为 2019 年 1 月 25 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
中金公司	1,162,883.20	100.00%

注：本基金合同生效日为2019年1月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30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	44,400,000.00	100.00%

注：本基金合同生效日为2019年1月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.1.4 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。

#### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30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	9,115.85	100.00%	4,938.15	100.00%

注：本基金合同生效日为2019年1月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.2 关联方报酬

##### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	46,282.35
其中：支付销售机构的客户维护费	5,545.54

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0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月末，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×0.70%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2019 年 1 月 25 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,917.63

注：1、支付基金托管人招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，逐日累计至每月月末，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 2019 年 1 月 25 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.2.3 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		
	2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金 MSCI 价值 A	中金 MSCI 价值 C	合计
招商银行	-	292.85	292.85
中金基金	-	88.13	88.13
合计	-	380.98	380.98

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 0.25%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×0.25% / 当年天数；

3、本基金合同生效日为 2019 年 1 月 25 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.3 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。

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.4.1 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	
	2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	中金 MSCI 价值 A	中金 MSCI 价值 C

基金合同生效日（2019年1月25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	72.5064%	-

- 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2019年1月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 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 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	109,660.54	2,616.54

- 注：1、本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。
- 2、本基金通过“招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2019年6月30日的相关余额为人民币119,684.25元，本期间产生的利息收入为人民币632.37元。
- 3、本基金合同生效日为2019年1月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.6 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。

#### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.8 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发/增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

#### **6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.8.3.1 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。

##### **6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 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 300,000.00 元，于 2019 年 7 月 1 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。

#### **6.4.9 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	16,720,570.00	92.42
	其中：股票	16,720,570.00	92.42
3	固定收益投资	954,454.40	5.28
	其中：债券	954,454.40	5.28
7	银行存款和结算备付金合计	220,812.62	1.22
8	其他各项资产	196,737.74	1.09
9	合计	18,092,574.76	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 (%)
B	采矿业	453,196.00	2.58
C	制造业	4,809,420.60	27.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	490,537.00	2.79
E	建筑业	1,649,250.00	9.38
F	批发和零售业	1,929,546.00	10.98
G	交通运输、仓储和邮政业	415,017.00	2.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	269,575.00	1.53
J	金融业	4,766,327.00	27.12
K	房地产业	1,874,901.40	10.67
R	文化、体育和娱乐业	62,800.00	0.36
	合计	16,720,570.00	95.13

#### 7.2.2 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。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 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前十名股票投资明细

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	600873	梅花生物	248,100	1,188,399.00	6.76
2	600827	百联股份	119,900	1,176,219.00	6.69
3	000725	京东方A	295,500	1,016,520.00	5.78
4	000069	华侨城A	145,100	1,008,445.00	5.74
5	601668	中国建筑	164,300	944,725.00	5.37
6	601166	兴业银行	43,400	793,786.00	4.52
7	600000	浦发银行	67,300	786,064.00	4.47
8	600016	民生银行	92,100	584,835.00	3.33
9	601328	交通银行	94,300	577,116.00	3.28
10	601288	农业银行	159,900	575,640.00	3.27

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

### 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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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	000876	新希望	2,940,939.00	16.73
2	000725	京东方A	1,314,467.00	7.48
3	000069	华侨城A	1,300,339.00	7.40
4	600873	梅花生物	1,296,583.73	7.38
5	601668	中国建筑	1,279,719.00	7.28



6	600827	百联股份	1,278,729.00	7.28
7	601166	兴业银行	1,137,397.00	6.47
8	000002	万科A	999,857.00	5.69
9	600000	浦发银行	995,251.00	5.66
10	601288	农业银行	758,454.00	4.32
11	601607	上海医药	749,233.00	4.26
12	601328	交通银行	746,767.00	4.25
13	000625	长安汽车	737,810.00	4.20
14	600016	民生银行	687,848.00	3.91
15	601186	中国铁建	643,426.00	3.66
16	601006	大秦铁路	585,598.00	3.33
17	600348	阳泉煤业	575,788.00	3.28
18	600642	申能股份	571,132.00	3.25
19	601988	中国银行	550,640.00	3.13
20	600675	中华企业	478,922.00	2.72
21	601818	光大银行	474,334.00	2.70
22	002146	荣盛发展	471,853.00	2.68
23	600037	歌华有线	471,375.00	2.68
24	000623	吉林敖东	468,144.00	2.66
25	000709	河钢股份	415,354.00	2.36
26	600015	华夏银行	355,323.00	2.02

#### 7.4.2 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	000876	新希望	4,210,327.78	23.95
2	000002	万科A	997,130.28	5.67
3	000625	长安汽车	695,073.00	3.95
4	601166	兴业银行	409,598.00	2.33
5	000725	京东方A	405,665.00	2.31
6	000069	华侨城A	336,197.24	1.91
7	601668	中国建筑	290,285.80	1.65
8	600000	浦发银行	259,202.00	1.47
9	600348	阳泉煤业	237,987.00	1.35
10	600642	申能股份	237,082.00	1.35

11	600438	通威股份	233,686.00	1.33
12	601607	上海医药	227,967.00	1.30
13	600037	歌华有线	223,320.00	1.27
14	601988	中国银行	208,712.00	1.19
15	002001	新和成	179,606.00	1.02
16	601360	三六零	178,681.00	1.02
17	601186	中国铁建	171,730.00	0.98
18	600060	海信电器	164,871.00	0.94
19	601288	农业银行	163,187.00	0.93
20	601328	交通银行	160,949.00	0.92

### 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	27,237,964.73
卖出股票收入（成交）总额	12,164,549.10

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	798,360.80	4.54
3	金融债券	156,093.60	0.89
	其中：政策性金融债	156,093.60	0.89
10	合计	954,454.40	5.43

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19国债01	7,990	798,360.80	4.54
2	108603	国开1804	1,560	156,093.60	0.89

## **7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除浦发银行（600000）、民生银行（600016）、交通银行（601328）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9月30日，中国银行业监督管理委员会盐城监管分局发布行政处罚决定书（盐银监罚决字〔2018〕1号），对浦发银行违规转让信贷资产等违法违规事实进行处罚。2018年7月26日，中国人民银行发布行政处罚决定书（银反洗罚决字〔2018〕3号），对浦发银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等违法违规事实进行处罚。

2019年4月2日，中国银行保险监督管理委员会大连监管局发布行政处罚决定书（大银保监罚决字〔2019〕76号）、（大银保监罚决字〔2019〕78号）、（大银保监罚决字〔2019〕80号），对民生银行以贷收贷，掩盖资产真实质量；以贷转存，虚增存贷款规模；贷后管理不到位，银行承兑汇票保证金来源审查不严格，贷款回流作银行承兑汇票保证金；贷后管理不到位，以贷收贷，掩盖资产真实质量；贴现资金回流作银行承兑汇票保证金，滚动循环签发银行承兑汇票等违法违规事实进行处罚。2018年12月7日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监银罚决字〔2018〕5号），对民生银行贷款业务严重违反审慎经营规则等违法违规事实进行处罚。同日，（银保监银罚决字〔2018〕8号）对民生银行内控管理严重违反审慎经营规则；同业投资违规接受担保；同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；本行理财产品之间风险隔离不到位；个人理财资金违规投资；票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；为非保本理财产品提供保本承诺等违法违规事实进行处罚。

2018年12月7日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监银罚决字〔2018〕12号），对交通银行不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权；未尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产；档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞；理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；违规向土地储备机构提供融资；信贷资金违规承接本行表外理财资产；理财资金违规投资项目资本金；部分理财产品信息披露不合规；现场检查配合不力等违法违规事实进行处罚。同日，（银保监银罚决字〔2018〕13号）对交通银行并购贷款占并购交易价款比例不合规；并购贷款尽职调查和风险评估不到位等违法违规事实进行处罚。2018年10月24日，中国保险监督管理委员会上海保监局发布行政处罚决定书（沪保监罚〔2018〕46

号),对交通银行欺骗投保人、向投保人隐瞒与合同有关的重要情况等违法违规事实进行处罚。2018年7月26日,中国人民银行发布行政处罚决定书(银反洗罚决字〔2018〕1号),对交通银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户等违法违规事实进行处罚。

本基金采用完全复制 MSCI 价值 Smart Beta 指数的策略,浦发银行(600000)、民生银行(600016)、交通银行(601328)是 MSCI 价值 Smart Beta 指数的前十大成分股,我们判断所列处罚对其投资价值不会产生重大影响,故依然按照完全复制指数的投资策略持有该股。

## 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	8,532.17
2	应收证券清算款	126,048.21
4	应收利息	12,358.79
5	应收申购款	49,798.57
9	合计	196,737.74

### 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

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

### 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MSCI价值A	469	29,407.00	10,605,717.98	76.90%	3,186,164.03	23.10%
中金MSCI价值C	201	6,209.23	-	0.00%	1,248,055.27	100.00%
合计	670	22,447.67	10,605,717.98	70.52%	4,434,219.30	29.48%

### 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MSCI价值A	19,400.34	0.1407%
	中金MSCI价值C	4,367.55	0.3499%
	合计	23,767.89	0.1580%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

#### 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	66.49	10,000,000.00	66.49	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	66.49	10,000,000.00	66.49	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金 MSCI 价值 A	中金 MSCI 价值 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 25 日）基金份额总额	10,386,809.21	175,135.67
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,227,281.28	3,112,857.55
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,822,208.48	2,039,937.95
本报告期期末基金份额总额	13,791,882.01	1,248,055.27

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

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

2019年1月19日，本基金管理人发布公告，楚钢先生自2019年1月18日起担任公司董事长，同日起总经理孙菁不再代为履行董事长职务。

2019年5月6日，本基金管理人发布公告，王元先生自2019年5月5日起接替颜羽女士担任公司独立董事。

2019年6月18日，本基金管理人发布公告，夏静女士自2019年6月17日起担任公司首席信息官，分管信息技术及风险管理。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，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

基金管理人与股东中金公司就南京中金基金管理有限公司（以下简称“南京中金基金”）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（以下简称“南京中院”）起诉，南京中院于2018年10月22日立案。2019年5月20日，南京中院出具（2018）苏01民初2710号民事调解书，确认基金管理人及股东中金公司与南京中金基金2019年5月17日签署的调解协议内容。截至本报告期末，南京中金基金已根据调解协议完成更名并支付赔偿款项。除前述事项外，本报告期无涉及基金管理人的其他诉讼事项。

本报告期无涉及本基金基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	39,402,513.83	100.00%	9,115.85	100.00%	-

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；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	1,162,883.20	100.00%	44,400,000.00	100.00%	-	-

## § 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
	管理人自有资金	1	2019 年 1 月 25 日至 2019 年 6 月 30 日	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形。如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，从而可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2019 年 6 月组织了监事换届选举工作。根据选举结果，由公司基金运营部负责人白娜女士自 2019 年 6 月 17 日起接替夏静女士担任执行监事。

中金基金管理有限公司

2019 年 8 月 26 日