

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资 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：中国工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。

基金托管人中国工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1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	59,648,617.94 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	45,428,276.79 份	14,220,341.15 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	<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。本基金力争利用</p>

	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	李虹	郭明
	联系电话	010-63211122	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95588
传真		010-66159121	010-66105798

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	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

§ 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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	4,591,162.14	1,245,060.31
本期利润	5,080,870.24	1,259,656.59
加权平均基金份额本期利润	0.1351	0.1165
本期基金份额净值增长率	21.23%	21.13%
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	-0.0140	-0.0064
期末基金资产净值	44,791,701.96	14,129,459.16
期末基金份额净值	0.9860	0.9936

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	2.05%	1.20%	0.75%	1.32%	1.30%	-0.12%
过去三个月	-6.34%	1.60%	-10.21%	1.72%	3.87%	-0.12%
过去六个月	21.23%	1.58%	17.87%	1.70%	3.36%	-0.12%
过去一年	1.50%	1.52%	-4.70%	1.60%	6.20%	-0.08%
自基金合同	-1.40%	1.21%	-21.87%	1.25%	20.47%	-0.04%

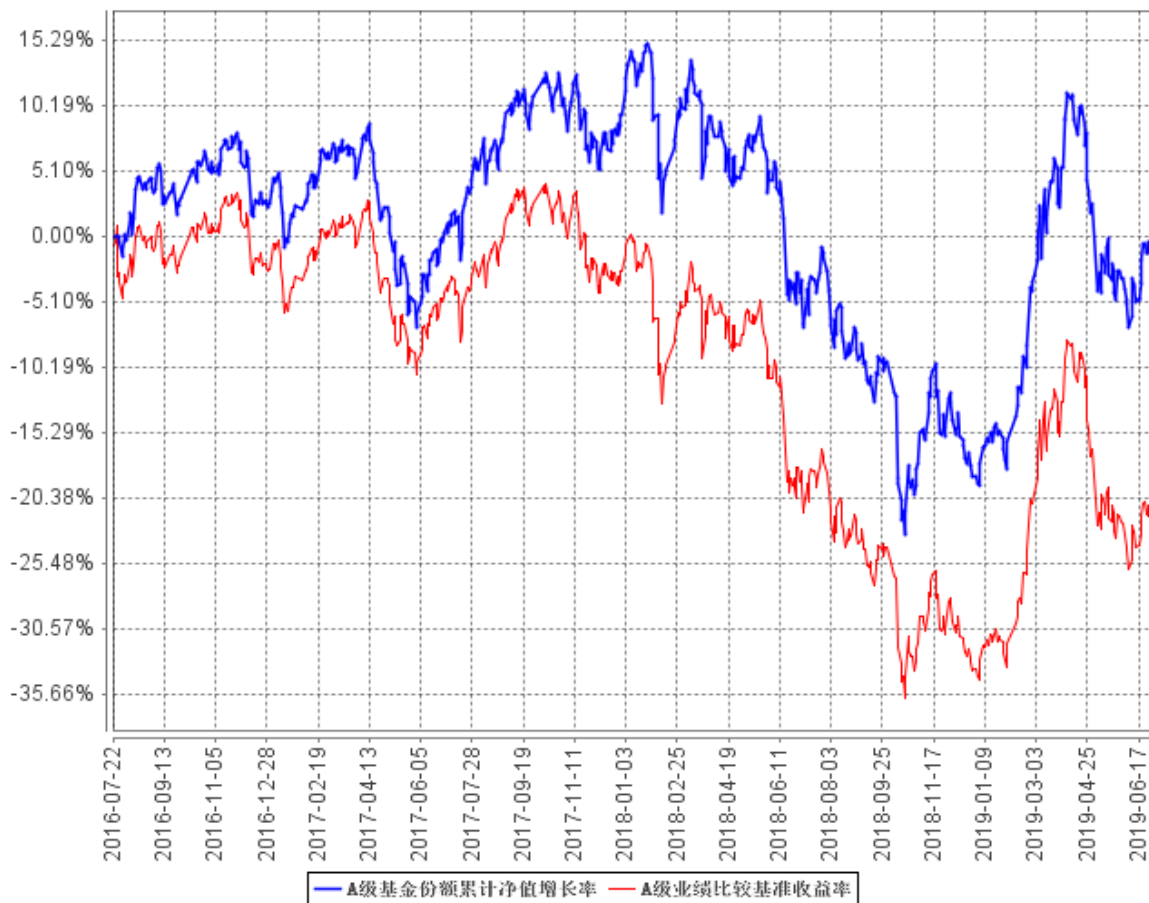
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

中金中证 500C

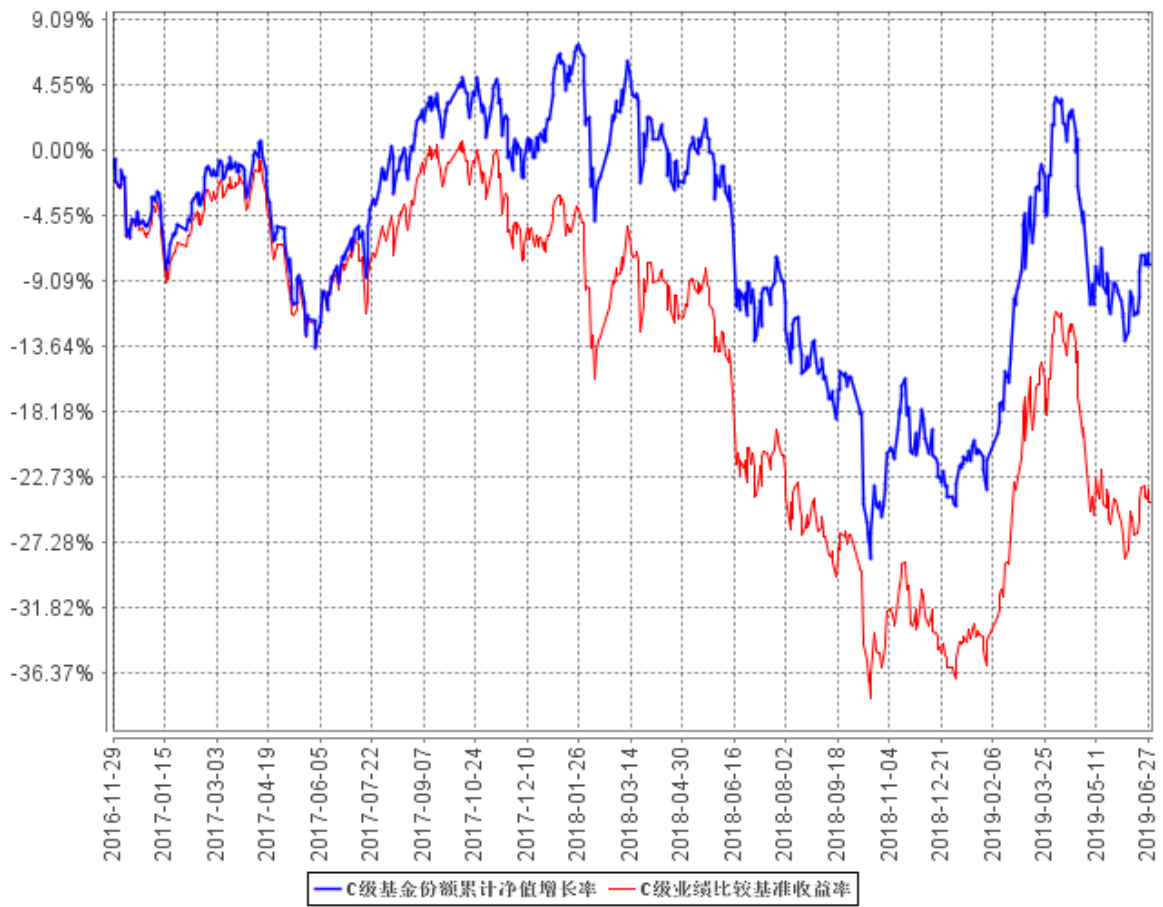
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.03%	1.19%	0.75%	1.32%	1.28%	-0.13%
过去三个月	-6.40%	1.60%	-10.21%	1.72%	3.81%	-0.12%
过去六个月	21.13%	1.58%	17.87%	1.70%	3.26%	-0.12%
过去一年	1.31%	1.52%	-4.70%	1.60%	6.01%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-7.97%	1.26%	-24.42%	1.30%	16.45%	-0.04%

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



§ 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		
魏宇	本基金的基金经理	2017 年 3 月 28 日	-	9 年	魏宇先生，统计学博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发。2014 年 11 月加入中金基金管理有限公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任量化公募投资部基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券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遵规守信情况的说明

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

在报告期内，本基金采用量化模型进行选股来增强指数。2019 年上半年，相对于业绩基准，获取了一定的超额收益。我们将继续努力开发和改进选股模型，争取在超额收益方面有更好的表现。

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 大阪峰会期间进行会晤；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中证 500A 基金份额净值为 0.9860 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.23%；截至本报告期末中金中证 500C 基金份额净值为 0.9936 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.13%；同期业绩比较基准收益率为 17.87%。

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 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

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 2019 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：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
资产：			
银行存款		284,254.74	537,286.57
结算备付金		1,008,769.36	190,805.99
存出保证金		15,185.64	4,017.26
交易性金融资产		58,961,261.84	30,794,935.29
其中：股票投资		55,823,773.84	29,087,455.29
基金投资		-	-
债券投资		3,137,488.00	1,707,480.00
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		452,502.69	-
应收利息		33,163.43	47,741.77
应收股利		-	-
应收申购款		111,748.74	90,344.64
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		60,866,886.44	31,665,131.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		900,000.00	500,000.00
应付证券清算款		372,547.89	173,694.42
应付赎回款		230,058.86	57,775.92
应付管理人报酬		23,648.60	11,710.04
应付托管费		7,094.55	3,513.03
应付销售服务费		4,638.44	15,278.25
应付交易费用		384,081.04	120,600.10

应交税费		-	-
应付利息		-	-139.71
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		23,655.94	61,003.23
负债合计		1,945,725.32	943,435.28
所有者权益：			
实收基金		59,648,617.94	37,715,250.86
未分配利润		-727,456.82	-6,993,554.62
所有者权益合计		58,921,161.12	30,721,696.24
负债和所有者权益总计		60,866,886.44	31,665,131.52

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，中金中证 500A 基金份额净值 0.9860 元，基金份额总额 45,428,276.79 份；中金中证 500C 基金份额净值 0.9936 元，基金份额总额 14,220,341.15 份。中金中证 500 份额总额合计为 59,648,617.94 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：2019 年 1 月 1 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 1 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
一、收入		7,210,793.38	-2,508,516.50
1.利息收入		42,804.05	9,080.66
其中：存款利息收入		6,869.71	5,885.80
债券利息收入		35,934.34	3,194.86
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）		6,573,729.75	-650,177.48
其中：股票投资收益		5,976,957.11	-855,058.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-2,059.91	1,178.49
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		598,832.55	203,702.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		504,304.38	-1,883,825.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）		89,955.20	16,405.54
减：二、费用		870,266.55	330,923.17
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	116,018.17	52,666.76
2. 托管费	6.4.7.2.2	34,805.38	15,800.05
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	20,942.93	4,685.32
4. 交易费用		660,444.64	222,439.18
5. 利息支出		13,842.00	-
其中：卖出回购金融资产支出		13,842.00	-
6. 税金及附加		0.06	-
7. 其他费用		24,213.37	35,331.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,340,526.83	-2,839,439.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,340,526.83	-2,839,439.67

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 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）	37,715,250.86	-6,993,554.62	30,721,696.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,340,526.83	6,340,526.83
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）	21,933,367.08	-74,429.03	21,858,938.05
其中：1.基金申购款	49,232,950.39	-133,552.27	49,099,398.12
2.基金赎回款	-27,299,583.31	59,123.24	-27,240,460.07
五、期末所有者权益（基金净值）	59,648,617.94	-727,456.82	58,921,161.12

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	14,068,786.80	1,336,843.18	15,405,629.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,839,439.67	-2,839,439.67
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)	9,066,222.31	875,480.66	9,941,702.97
其中：1.基金申购款	13,396,255.01	1,305,547.55	14,701,802.56
2.基金赎回款	-4,330,032.70	-430,066.89	-4,760,099.59
五、期末所有者权益 (基金净值)	23,135,009.11	-627,115.83	22,507,893.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 孙菁	_____ 张纳	_____ 白娜
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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。

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 1 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
中金基金管理有限公司（“中金基金”）	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期末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

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	116,018.17	52,666.76
其中：支付销售机构的客户维护费	23,415.52	4,674.76

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 23,415.52 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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	34,805.38	15,800.05

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

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1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	541.12	541.12
中金公司	-	573.14	573.14
中投证券	-	2,085.18	2,085.18
合计	-	3,199.44	3,199.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	98.55	98.55
中金公司	-	-	-
中投证券	-	-	-
合计	-	98.55	98.55

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；
2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40%的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末。其计算公式为：C 类基金份额每日应计提的销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40% / 当年天数。

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1日至2019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	0.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	0.00
期末持有的基金份额	10,000,000.00	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	22.0127%	0.0000%

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	0.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	0.00
期末持有的基金份额	10,000,000.00	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	51.1236%	0.0000%

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

6.4.7.4.2 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1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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	284,254.74	2,714.81	568,053.92	4,550.51

- 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2019年6月30日的相关余额为人民币1,023,955.00元，本

期间产生的利息收入为人民币 4,154.90 元。

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。

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。

6.4.8.2 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
002323	雅百特	2018年8月17日	重大事项停牌	1.31	-	-	200	1,071.80	262.00	-

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 900,000.00 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	55,823,773.84	91.71
	其中：股票	55,823,773.84	91.71
3	固定收益投资	3,137,488.00	5.15
	其中：债券	3,137,488.00	5.15
7	银行存款和结算备付金合计	1,293,024.10	2.12
8	其他各项资产	612,600.50	1.01
9	合计	60,866,886.44	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	371,351.00	0.63
B	采矿业	2,983,849.34	5.06
C	制造业	21,319,433.55	36.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,210,438.82	5.45
E	建筑业	1,281,994.40	2.18
F	批发和零售业	4,719,159.40	8.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,276,898.00	3.86
H	住宿和餐饮业	308,000.00	0.52
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,650,441.33	7.89
J	金融业	1,108,458.00	1.88
K	房地产业	2,830,572.14	4.80
L	租赁和商务服务业	835,080.00	1.42
R	文化、体育和娱乐业	2,786,009.56	4.73
S	综合	527,753.00	0.90
	合计	49,209,438.54	83.52

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	174,035.00	0.30
B	采矿业	53,086.00	0.09
C	制造业	3,812,577.50	6.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	297,507.20	0.50
E	建筑业	103,316.00	0.18
F	批发和零售业	641,105.00	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	160,694.00	0.27
H	住宿和餐饮业	85,374.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	230,966.00	0.39
J	金融业	121,752.00	0.21
K	房地产业	526,235.00	0.89
L	租赁和商务服务业	40,252.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	90,784.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	111,204.60	0.19
R	文化、体育和娱乐业	106,584.00	0.18
S	综合	58,863.00	0.10
	合计	6,614,335.30	11.23

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	601717	郑煤机	180,386	1,030,004.06	1.75
2	600633	浙数文化	89,400	835,890.00	1.42
3	603444	吉比特	3,541	743,468.36	1.26
4	600757	长江传媒	108,776	740,764.56	1.26
5	002489	浙江永强	216,400	722,776.00	1.23
6	600694	大商股份	24,500	683,795.00	1.16

7	603355	莱克电气	30,653	659,652.56	1.12
8	600557	康缘药业	43,815	651,090.90	1.11
9	601928	凤凰传媒	77,900	628,653.00	1.07
10	603883	老百姓	10,100	590,648.00	1.00

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

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	000524	岭南控股	10,200	85,374.00	0.14
2	000573	粤宏远A	22,700	76,045.00	0.13
3	002208	合肥城建	9,420	75,265.80	0.13
4	600533	栖霞建设	20,700	74,934.00	0.13
5	603689	皖天然气	6,600	72,666.00	0.12

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	603806	福斯特	1,603,210.00	5.22
2	600801	华新水泥	1,601,018.40	5.21
3	600466	蓝光发展	1,573,461.00	5.12
4	600779	水井坊	1,529,719.00	4.98
5	002831	裕同科技	1,516,737.00	4.94
6	000877	天山股份	1,489,081.00	4.85
7	600580	卧龙电驱	1,474,155.00	4.80
8	000021	深科技	1,470,326.00	4.79
9	000049	德赛电池	1,469,292.00	4.78
10	603444	吉比特	1,454,914.77	4.74
11	601717	郑煤机	1,423,469.00	4.63
12	002332	仙琚制药	1,414,113.00	4.60
13	600557	康缘药业	1,395,285.80	4.54

14	600062	华润双鹤	1,365,427.00	4.44
15	603568	伟明环保	1,359,647.00	4.43
16	603355	莱克电气	1,348,920.36	4.39
17	600993	马应龙	1,323,439.80	4.31
18	600565	迪马股份	1,309,232.00	4.26
19	601928	凤凰传媒	1,307,407.00	4.26
20	600699	均胜电子	1,290,727.00	4.20
21	002463	沪电股份	1,286,235.00	4.19
22	000090	天健集团	1,278,331.00	4.16
23	002444	巨星科技	1,263,063.00	4.11
24	600754	锦江股份	1,246,796.00	4.06
25	002416	爱施德	1,243,859.00	4.05
26	600312	平高电气	1,219,141.00	3.97
27	600167	联美控股	1,216,381.71	3.96
28	600633	浙数文化	1,190,255.00	3.87
29	600143	金发科技	1,179,131.00	3.84
30	002399	海普瑞	1,177,148.00	3.83
31	300058	蓝色光标	1,176,027.00	3.83
32	000988	华工科技	1,169,969.00	3.81
33	600329	中新药业	1,160,518.00	3.78
34	600642	申能股份	1,123,628.78	3.66
35	600694	大商股份	1,107,604.00	3.61
36	600037	歌华有线	1,104,643.00	3.60
37	000999	华润三九	1,104,261.00	3.59
38	600017	日照港	1,093,856.00	3.56
39	603328	依顿电子	1,079,045.33	3.51
40	002299	圣农发展	1,072,720.00	3.49
41	600757	长江传媒	1,071,707.00	3.49
42	000690	宝新能源	1,059,156.00	3.45
43	600750	江中药业	1,045,021.00	3.40
44	601811	新华文轩	1,044,475.53	3.40
45	000596	古井贡酒	1,042,619.00	3.39
46	603233	大参林	1,039,584.50	3.38
47	300166	东方国信	1,036,308.00	3.37
48	000623	吉林敖东	1,029,523.49	3.35
49	002635	安洁科技	1,025,419.00	3.34

50	002242	九阳股份	1,023,985.00	3.33
51	600970	中材国际	1,020,117.00	3.32
52	603556	海兴电力	1,018,905.80	3.32
53	002152	广电运通	1,018,101.00	3.31
54	600971	恒源煤电	1,017,575.00	3.31
55	601001	大同煤业	1,016,491.00	3.31
56	600053	九鼎投资	1,015,995.00	3.31
57	002916	深南电路	1,014,211.20	3.30
58	300088	长信科技	1,002,636.00	3.26
59	600863	内蒙华电	1,002,333.00	3.26
60	002233	塔牌集团	994,655.00	3.24
61	002048	宁波华翔	988,251.52	3.22
62	603883	老百姓	987,384.00	3.21
63	600597	光明乳业	983,430.00	3.20
64	601958	金钼股份	980,417.00	3.19
65	000600	建投能源	976,766.00	3.18
66	000848	承德露露	974,611.00	3.17
67	601872	招商轮船	966,212.00	3.15
68	000997	新大陆	963,172.00	3.14
69	601966	玲珑轮胎	962,184.00	3.13
70	600787	中储股份	958,293.00	3.12
71	600376	首开股份	953,800.00	3.10
72	000528	柳工	953,421.00	3.10
73	300115	长盈精密	950,320.00	3.09
74	603866	桃李面包	939,314.00	3.06
75	600073	上海梅林	931,681.00	3.03
76	000543	皖能电力	930,300.00	3.03
77	002195	二三四五	929,930.00	3.03
78	000031	大悦城	929,314.00	3.02
79	600820	隧道股份	923,274.00	3.01
80	600410	华胜天成	918,057.00	2.99
81	600373	中文传媒	916,926.00	2.98
82	002028	思源电气	910,031.00	2.96
83	000156	华数传媒	908,213.00	2.96
84	601100	恒立液压	907,352.40	2.95
85	002489	浙江永强	901,556.00	2.93

86	002690	美亚光电	900,736.00	2.93
87	300010	立思辰	900,508.00	2.93
88	600657	信达地产	892,270.00	2.90
89	601689	拓普集团	891,255.00	2.90
90	600978	宜华生活	884,892.00	2.88
91	600765	中航重机	875,474.00	2.85
92	002818	富森美	873,031.00	2.84
93	002056	横店东磁	871,979.00	2.84
94	002603	以岭药业	870,687.00	2.83
95	002345	潮宏基	868,824.80	2.83
96	002563	森马服饰	867,300.00	2.82
97	601200	上海环境	855,262.03	2.78
98	603056	德邦股份	854,196.00	2.78
99	600511	国药股份	848,460.00	2.76
100	600673	东阳光	843,894.00	2.75
101	603198	迎驾贡酒	840,660.80	2.74
102	601179	中国西电	839,643.00	2.73
103	000685	中山公用	835,596.00	2.72
104	002273	水晶光电	834,269.55	2.72
105	002277	友阿股份	831,522.00	2.71
106	000636	风华高科	830,169.00	2.70
107	600169	太原重工	822,139.00	2.68
108	601311	骆驼股份	818,963.00	2.67
109	300315	掌趣科技	817,438.00	2.66
110	600582	天地科技	816,729.00	2.66
111	000061	农产品	809,838.00	2.64
112	002317	众生药业	802,346.00	2.61
113	600388	龙净环保	799,510.00	2.60
114	002482	广田集团	799,453.00	2.60
115	300459	金科文化	799,195.00	2.60
116	300418	昆仑万维	793,589.00	2.58
117	601098	中南传媒	791,555.00	2.58
118	600350	山东高速	791,429.00	2.58
119	002251	步步高	789,155.00	2.57
120	600985	淮北矿业	786,440.00	2.56
121	600655	豫园股份	786,230.00	2.56

122	000158	常山北明	784,965.00	2.56
123	600266	北京城建	776,224.00	2.53
124	603569	长久物流	770,964.00	2.51
125	600755	厦门国贸	768,531.00	2.50
126	300055	万邦达	763,560.00	2.49
127	002583	海能达	762,634.00	2.48
128	600827	百联股份	754,181.00	2.45
129	002414	高德红外	747,891.00	2.43
130	002373	千方科技	733,411.00	2.39
131	600141	兴发集团	725,973.00	2.36
132	603658	安图生物	722,829.00	2.35
133	600184	光电股份	721,619.00	2.35
134	600478	科力远	719,735.00	2.34
135	600881	亚泰集团	717,742.00	2.34
136	000732	泰禾集团	717,645.00	2.34
137	603885	吉祥航空	715,800.24	2.33
138	002250	联化科技	714,168.00	2.32
139	000778	新兴铸管	708,285.00	2.31
140	000738	航发控制	706,907.00	2.30
141	600026	中远海能	705,389.00	2.30
142	600064	南京高科	704,584.00	2.29
143	600428	中远海特	698,945.00	2.28
144	601168	西部矿业	692,163.00	2.25
145	000887	中鼎股份	688,479.00	2.24
146	600639	浦东金桥	687,459.00	2.24
147	600098	广州发展	681,483.00	2.22
148	000501	鄂武商A	679,467.00	2.21
149	601000	唐山港	678,859.00	2.21
150	000008	神州高铁	678,281.12	2.21
151	002128	露天煤业	667,751.00	2.17
152	002191	劲嘉股份	662,830.80	2.16
153	601801	皖新传媒	657,008.00	2.14
154	600885	宏发股份	656,868.00	2.14
155	600643	爱建集团	650,522.00	2.12
156	002701	奥瑞金	640,499.00	2.08
157	600862	中航高科	640,323.00	2.08

158	600307	酒钢宏兴	638,933.00	2.08
159	300413	芒果超媒	635,073.00	2.07
160	600563	法拉电子	632,997.00	2.06
161	002375	亚厦股份	632,761.00	2.06
162	002276	万马股份	632,102.00	2.06
163	600171	上海贝岭	629,162.00	2.05
164	300257	开山股份	628,865.00	2.05
165	002004	华邦健康	627,792.00	2.04
166	300026	红日药业	627,527.00	2.04
167	603369	今世缘	627,250.00	2.04
168	600008	首创股份	626,509.00	2.04
169	002353	杰瑞股份	626,078.00	2.04
170	002372	伟星新材	625,391.23	2.04
171	000656	金科股份	624,309.00	2.03
172	000028	国药一致	622,048.00	2.02
173	601866	中远海发	617,313.00	2.01

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600801	华新水泥	1,859,450.00	6.05
2	600580	卧龙电驱	1,748,563.28	5.69
3	600466	蓝光发展	1,553,689.00	5.06
4	000021	深科技	1,544,546.00	5.03
5	000877	天山股份	1,503,264.00	4.89
6	603568	伟明环保	1,497,263.00	4.87
7	000049	德赛电池	1,481,807.00	4.82
8	600565	迪马股份	1,474,894.00	4.80
9	002831	裕同科技	1,299,494.00	4.23
10	600779	水井坊	1,289,286.00	4.20
11	002233	塔牌集团	1,237,136.00	4.03
12	002332	仙琚制药	1,228,156.00	4.00
13	000988	华工科技	1,152,237.00	3.75
14	600017	日照港	1,150,773.00	3.75
15	002463	沪电股份	1,149,924.00	3.74

16	603806	福斯特	1,133,997.70	3.69
17	601689	拓普集团	1,124,314.00	3.66
18	002004	华邦健康	1,120,155.00	3.65
19	002416	爱施德	1,113,680.22	3.63
20	000596	古井贡酒	1,095,189.00	3.56
21	000778	新兴铸管	1,090,827.95	3.55
22	600597	光明乳业	1,085,698.00	3.53
23	600557	康缘药业	1,085,149.00	3.53
24	000090	天健集团	1,083,785.03	3.53
25	603866	桃李面包	1,063,679.80	3.46
26	300088	长信科技	1,055,247.00	3.43
27	603766	隆鑫通用	1,052,117.00	3.42
28	300010	立思辰	1,045,216.00	3.40
29	600143	金发科技	1,039,012.00	3.38
30	000636	风华高科	1,023,951.00	3.33
31	002345	潮宏基	1,017,539.40	3.31
32	600863	内蒙华电	1,007,560.92	3.28
33	600970	中材国际	991,408.65	3.23
34	002690	美亚光电	989,167.00	3.22
35	002916	深南电路	988,900.00	3.22
36	000848	承德露露	985,401.00	3.21
37	002048	宁波华翔	980,611.00	3.19
38	000999	华润三九	977,126.70	3.18
39	002818	富森美	973,018.00	3.17
40	601200	上海环境	966,563.69	3.15
41	600765	中航重机	954,996.00	3.11
42	600754	锦江股份	953,890.26	3.10
43	600978	宜华生活	947,897.77	3.09
44	601928	凤凰传媒	946,767.00	3.08
45	600655	豫园股份	945,286.00	3.08
46	600881	亚泰集团	940,890.50	3.06
47	002444	巨星科技	940,158.00	3.06
48	601678	滨化股份	933,020.90	3.04
49	600062	华润双鹤	932,670.00	3.04
50	600478	科力远	931,233.00	3.03
51	600782	新钢股份	929,513.00	3.03
52	002242	九阳股份	916,254.88	2.98
53	002563	森马服饰	915,195.00	2.98

54	002056	横店东磁	904,088.24	2.94
55	600195	中牧股份	903,134.60	2.94
56	000887	中鼎股份	900,694.00	2.93
57	600623	华谊集团	899,361.00	2.93
58	002317	众生药业	899,209.00	2.93
59	002273	水晶光电	894,223.00	2.91
60	002092	中泰化学	892,308.74	2.90
61	002299	圣农发展	888,724.00	2.89
62	000623	吉林敖东	881,538.00	2.87
63	002399	海普瑞	880,719.28	2.87
64	600642	申能股份	880,718.00	2.87
65	600373	中文传媒	879,960.00	2.86
66	600329	中新药业	879,937.00	2.86
67	600388	龙净环保	876,223.00	2.85
68	601005	重庆钢铁	874,956.00	2.85
69	002482	广田集团	859,230.12	2.80
70	002373	千方科技	854,331.00	2.78
71	601966	玲珑轮胎	844,863.00	2.75
72	000997	新大陆	829,282.00	2.70
73	601001	大同煤业	827,945.00	2.69
74	600694	大商股份	826,845.00	2.69
75	002583	海能达	825,789.00	2.69
76	600743	华远地产	823,792.00	2.68
77	603233	大参林	822,871.00	2.68
78	002128	露天煤业	822,799.00	2.68
79	603444	吉比特	820,580.00	2.67
80	600410	华胜天成	820,019.00	2.67
81	300058	蓝色光标	816,956.00	2.66
82	601958	金铂股份	816,246.00	2.66
83	603885	吉祥航空	812,825.80	2.65
84	600167	联美控股	811,979.00	2.64
85	601866	中远海发	811,332.00	2.64
86	603556	海兴电力	808,628.90	2.63
87	600820	隧道股份	808,255.48	2.63
88	600787	中储股份	806,817.00	2.63
89	600141	兴发集团	802,949.00	2.61
90	600266	北京城建	802,763.00	2.61
91	000729	燕京啤酒	802,355.00	2.61

92	603328	依顿电子	797,286.00	2.60
93	600618	氯碱化工	796,475.10	2.59
94	600737	中粮糖业	793,548.89	2.58
95	000690	宝新能源	789,940.00	2.57
96	603355	莱克电气	784,885.90	2.55
97	601168	西部矿业	778,220.00	2.53
98	603198	迎驾贡酒	776,042.00	2.53
99	300459	金科文化	775,637.00	2.52
100	300166	东方国信	774,234.00	2.52
101	600312	平高电气	771,804.00	2.51
102	600971	恒源煤电	770,499.00	2.51
103	000685	中山公用	767,822.00	2.50
104	600993	马应龙	766,640.00	2.50
105	300026	红日药业	766,481.00	2.49
106	600184	光电股份	766,458.00	2.49
107	002152	广电运通	766,402.00	2.49
108	002603	以岭药业	761,760.98	2.48
109	601717	郑煤机	758,898.00	2.47
110	002277	友阿股份	754,348.00	2.46
111	603056	德邦股份	750,069.00	2.44
112	002414	高德红外	742,460.00	2.42
113	603658	安图生物	738,466.00	2.40
114	600376	首开股份	736,193.00	2.40
115	600160	巨化股份	733,122.09	2.39
116	000656	金科股份	721,244.00	2.35
117	000039	中集集团	716,784.98	2.33
118	600307	酒钢宏兴	714,930.00	2.33
119	600073	上海梅林	712,169.00	2.32
120	601872	招商轮船	705,994.00	2.30
121	000501	鄂武商A	704,099.00	2.29
122	600657	信达地产	702,211.00	2.29
123	002635	安洁科技	701,381.00	2.28
124	002276	万马股份	699,480.00	2.28
125	600037	歌华有线	695,418.98	2.26
126	600859	王府井	695,011.00	2.26
127	600426	华鲁恒升	693,485.00	2.26
128	600750	江中药业	693,266.00	2.26
129	300115	长盈精密	682,462.00	2.22

130	600862	中航高科	682,325.00	2.22
131	600053	九鼎投资	682,195.00	2.22
132	000552	靖远煤电	679,696.00	2.21
133	002191	劲嘉股份	679,120.00	2.21
134	603569	长久物流	678,498.00	2.21
135	600582	天地科技	678,014.00	2.21
136	600885	宏发股份	672,603.00	2.19
137	300055	万邦达	672,503.00	2.19
138	600639	浦东金桥	670,234.99	2.18
139	600567	山鹰纸业	665,496.00	2.17
140	002195	二三四五	658,411.00	2.14
141	600777	新潮能源	652,704.00	2.12
142	002353	杰瑞股份	646,495.00	2.10
143	000156	华数传媒	644,276.50	2.10
144	600699	均胜电子	642,147.00	2.09
145	603369	今世缘	639,518.00	2.08
146	601100	恒立液压	638,593.00	2.08
147	600827	百联股份	638,544.00	2.08
148	600125	铁龙物流	637,104.00	2.07
149	002640	跨境通	636,865.00	2.07
150	000062	深圳华强	635,339.00	2.07
151	002308	威创股份	635,282.00	2.07
152	600808	马钢股份	632,565.56	2.06
153	000598	兴蓉环境	631,414.26	2.06
154	002589	瑞康医药	629,170.59	2.05
155	300413	芒果超媒	625,539.00	2.04
156	600138	中青旅	621,702.00	2.02
157	002372	伟星新材	616,439.16	2.01

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	264,361,764.43
卖出股票收入（成交）总额	244,121,287.24

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	3,137,488.00	5.32
10	合计	3,137,488.00	5.32

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	31,400	3,137,488.00	5.32

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	15,185.64
2	应收证券清算款	452,502.69
4	应收利息	33,163.43
5	应收申购款	111,748.74
9	合计	612,600.50

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
中金中证500A	1,293	35,134.01	16,048,447.47	35.33%	29,379,829.32	64.67%
中金中证500C	995	14,291.80	0.00	0.00%	14,220,341.15	100.00%
合计	2,288	26,070.20	16,048,447.47	26.90%	43,600,170.47	73.10%

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	156,075.13	0.3436%
	中金中证500C	34,648.52	0.2437%
	合计	190,723.65	0.3197%

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	中金中证500A	10~50
	中金中证500C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证500A	0
	中金中证500C	0
	合计	0

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	16.76	10,000,000.00	16.76	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	16.76	10,000,000.00	16.76	-

§ 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	30,788,524.27	6,926,726.59
本报告期期间基金总申购份额	27,662,488.64	21,570,461.75
减：本报告期期间基金总赎回份额	13,022,736.12	14,276,847.19
本报告期期末基金份额总额	45,428,276.79	14,220,341.15

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	
兴业证券	2	440,514,290.66	86.64%	321,793.52	86.62%	-
长江证券	4	67,942,766.49	13.36%	49,687.73	13.38%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-

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

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

2、基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	6,509,067.31	90.90%	107,600,000.00	83.80%	-	-
长江证券	651,380.00	9.10%	20,800,000.00	16.20%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

§ 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

本报告期内，本基金单一投资者持有份额比例没有超过总份额 20%的情况。

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