中金沪深300指数增强型发起式证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018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:2018年8月28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2018年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中金沪深300	
基金主代码	003015	
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	14,676,403.98份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中金沪深300A	中金沪深300C
下属分级基金的交易代码:	003015	003579
报告期末下属分级基金的份额总额	13,599,211.02份	1,077,192.96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,在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过8.0%。
投资策略	本基金作为股票指数增强型发起式证券投资基金,股票投资策略为本基金的核心策略,通过复制目标股票指数作为基本投资组合以及量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素,找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子,并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合,最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化。其他策略还包括债券投资策略和股指期货投资策略。
业绩比较基准	沪深300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@cbc.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	中金沪深300A	中金沪深300C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	-315,659.47	-34,579.57
本期利润	-1,561,941.26	-114,133.79
加权平均基金份额本期利润	-0.1221	-0.1706
本期基金份额净值增长率	-8.35%	-8.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1065	0.1175
期末基金资产净值	15,047,736.20	1,203,730.35
期末基金份额净值	1.1065	1.1175

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;

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

中金沪深300A

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	-5.12%	1.17%	-7.29%	1.22%	2.17%	-0.05%
过去三个月	-6.13%	1.02%	-9.45%	1.08%	3.32%	-0.06%
过去六个月	-8.35%	1.06%	-12.25%	1.10%	3.90%	-0.04%
过去一年	0.97%	0.86%	-3.97%	0.90%	4.94%	-0.04%
自基金合同生效起至今	10.65%	0.76%	7.65%	0.78%	3.00%	-0.02%

中金沪深300C

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	-5.11%	1.17%	-7.29%	1.22%	2.18%	-0.05%
过去三个月	-6.12%	1.02%	-9.45%	1.08%	3.33%	-0.06%
过去六个月	-8.17%	1.06%	-12.25%	1.10%	4.08%	-0.04%
过去一年	1.40%	0.86%	-3.97%	0.90%	5.37%	-0.04%
自基金合同生效起至今	5.01%	0.79%	7.65%	0.80%	-2.64%	-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

§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,办公地址为北京市西城区太平桥大街18号丰融国际中心北楼17层。

截至2018年6月30日,公司共管理14支开放式基金,证券投资基金管理规模145.22亿。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
魏孛	本基金的基金经理	2017年3月28日	-	8年	魏孛先生,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,现任中金基金管理有限公司量化公募投资部基金经理,副总经理。

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,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》等法律法规规定和基金合同约定,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平等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,本基金采用量化策略进行选股来增强指数,运作正常。作为指数增强型基金,虽然指数趋势向下,但本基金获取了一定的超额收益。量化模型在持续的研发和更新中,力争接下来有更好的表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金沪深300A基金份额净值为1.1065元,本报告期基金份额净值增长率为-8.35%;截至本报告期末中金沪深300C基金份额净值为1.1175元,本报告期基金份额净值增长率为-8.17%;同期业绩比较基准收益率为-12.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年的宏观经济环境非常复杂。第一,名义GDP在高位,一些经济指标显示经济活跃度高。第二,深化供给侧改革,发展民间投资,独角兽回归引导资金流向支持实体经济。第三,以金融"去杠杆"为目的的各项政策继续推进。第四,中美贸易战逐渐升级,对我国传统产业和新兴产业的发展都会产生重要的影响。股市受到各种因素的影响,呈现出震荡向下的趋势。2018年上半年,上证50指数下跌13.30%,沪深300指数下跌12.90%,中证500指数下跌16.53%,中证800指数下跌13.85%,中证1000指数下跌20.08%,创业板指下跌8.33%。展望2018年下半年,国内经济发展的韧性相信能够持续,政策层面大方向依然会延续,中美贸易摩擦的变数较大,总体上我们对股市的看法并不乐观,因此在投资时会更加注重风险控制,尽量减小超额收益的波动。

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历。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中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沪深300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,中金沪深300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沪深300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,中金沪深300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沪深300指数增强型发起式证券投资基金2018半年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:中金沪深300指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款		401,785.47	1,107,014.41
结算备付金		59,800.41	89,378.41
存出保证金		3,451.45	6,442.42
交易性金融资产		15,937,347.97	12,583,740.46
其中:股票投资		15,265,280.77	12,583,740.46
基金投资		-	-
债券投资		672,067.20	-
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		7,378.06	108,290.50
应收利息		20,460.02	270.47
应收股利		-	-
应收申购款		23,679.15	18,987.01
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		16,453,902.53	13,914,123.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		19,637.34	252,838.51
应付赎回款		99,101.80	-
应付管理人报酬		6,758.47	5,666.74
应付托管费		2,027.53	1,700.04
应付销售服务费		2,300.97	715.57
应付交易费用		28,712.25	178,705.03
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		43,897.62	60,537.86
负债合计		202,435.98	500,163.75
所有者权益:			
实收基金		14,676,403.98	11,108,131.19
未分配利润		1,575,062.57	2,305,828.74
所有者权益合计		16,251,466.55	13,413,959.93
负债和所有者权益总计		16,453,902.53	13,914,123.68

注:1、报告截止日2018年6月30日,中金沪深300A类基金份额净值为人民币1.1065元,中金沪深300C类基金份额净值为人民币1.1175元;基金份额总额为14676403.98份,其中中金沪深300A类基金份额为13599211.02份,中金沪深300C类基金份额为1077192.96份。

6.2 利润表

会计主体:中金沪深300指数增强型发起式证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-1,465,121.38	1,164,560.50
1.利息收入		10,954.16	4,425.02
其中:存款利息收入		2,966.17	4,425.02
债券利息收入		7,987.99	-
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)		-157,234.23	566,062.55
其中:股票投资收益		-332,769.66	494,181.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,105.11	-
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		174,430.32	71,881.43
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-1,325,836.01	519,557.11
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		6,994.70	74,515.82
减:二、费用		210,953.67	346,349.23
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	40,035.67	26,662.24
2. 托管费	6.4.8.2.2	12,010.71	7,998.63
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	1,585.40	92.07
4. 交易费用		122,358.21	271,394.61
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用		34,963.68	40,201.68
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-1,676,075.05	818,211.27
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-1,676,075.05	818,211.27

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中金沪深300指数增强型发起式证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	11,108,131.19	2,305,828.74	13,413,959.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,676,075.05	-1,676,075.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	3,568,272.79	945,308.88	4,513,581.67
其中:1.基金申购款	5,317,703.89	1,316,787.07	6,634,490.96
2.基金赎回款	-1,749,431.10	-371,478.19	-2,120,909.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	14,676,403.98	1,575,062.57	16,251,466.55
项目	**上年度可比期间 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)	10,086,780.86	250,000.70	10,336,781.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	746,329.84	746,329.84
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)	596,932.99	29,558.79	626,491.78
其中:1.基金申购款	1,033,552.72	50,785.06	1,084,337.78
2.基金赎回款	-436,619.73	-21,226.27	-457,846.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	10,683,713.85	1,025,889.33	11,709,603.18

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

中金沪深300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]1516号《关于准予中金沪深300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《中金沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式指数型基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金,托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称"工商银行")。

本基金通过中金基金直销中心公开发售,募集期为2016年7月18日。经向中国证监会备案,《中金沪深300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10,001,300.00份,发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《中金沪深300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,在力求对沪深300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份股及备选成份股。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份股(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、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)。

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及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金2018年06月30日的财务状况、2018上半年度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

6.4.5 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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2017]56号文《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:

(a)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。

(b)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)运营基金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。对基金在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。

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。

(c)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。

(d)对基金取得的股票的股息、红利收入,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,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。

(e)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。

(f)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,暂不征收企业所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
中国工商银行股份有限公司("工商银行")	基金托管人

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期与上年度可比期间无关联方债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期未进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间均无应付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 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	40,035.67	26,662.24
其中:支付销售机构的客户维护费	1,852.82	131.95

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%;

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 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	12,010.71	7,998.63

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。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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 中金沪深300A	中金沪深300C	合计
中金基金	-	68.02	68.02
合计	-	68.02	68.02
获得销售服务费的各关联方名称	**上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 中金沪深300A**	**中金沪深300C**	**合计**
中金基金	-	27.07	27.07
合计	-	27.07	27.07

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。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。计算公式为:本基金C类基金日基金销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期本基金未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 中金沪深300A	中金沪深300C
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	73.5300%	-
项目	**上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 中金沪深300A**	**中金沪深300C**
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	95.0600%	-

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。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 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	401,785.47	2,193.32	879,068.24	2,974.04

注:1、本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管,按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金通过"工商银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金,于2018年6月30日的相关余额为人民币63251.86元(于2017年6月30日的相关余额为人民币190609.27元),本期间产生的利息收入为人民币772.85元(上年度可比期间产生的利息收入为人民币1450.98元)。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项	7.47	2018年8月20日	7.25	18,600	138,893.65	138,942.00	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大资产重组	15.03	2018年8月27日	13.47	9,136	172,532.15	137,314.08	-
000415	渤海金控	2018年1月17日	重大资产重组	5.84	2018年7月17日	5.19	21,953	126,621.67	128,205.52	-
002450	康得新	2018年6月4日	重大资产重组	17.08	-	-	5,800	118,889.25	99,064.00	-
000008	神州高铁	2018年6月6日	重大事项	4.96	2018年8月7日	4.46	10,800	61,558.47	53,568.00	-
002602	世纪华通	2018年6月12日	重大资产重组	32.50	-	-	1,500	50,606.11	48,750.00	-
600221	海航控股	2018年1月10日	重大资产重组	3.23	2018年7月20日	2.91	12,769	40,933.07	41,243.87	-
000723	美锦能源	2018年3月27日	重大资产重组	5.43	2018年7月31日	4.89	4,200	25,761.83	22,806.00	-
600811	东方集团	2018年5月30日	重大事项	4.30	-	-	1,100	4,755.00	4,730.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.10 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	15,265,280.77	92.78
	其中:股票	15,265,280.77	92.78
2	固定收益投资	672,067.20	4.08
	其中:债券	672,067.20	4.08
	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	461,585.88	2.81
7	其他各项资产	54,968.68	0.33
8	合计	16,453,902.53	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	-	-
B	采矿业	249,586.38	1.54
C	制造业	6,124,922.42	37.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	500,443.10	3.08
E	建筑业	1,087,103.12	6.69
F	批发和零售业	405,004.86	2.49
G	交通运输、仓储和邮政业	555,572.39	3.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,950.30	0.73
J	金融业	4,187,458.36	25.77
K	房地产业	1,115,549.47	6.86
L	租赁和商务服务业	321,502.12	1.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	128,970.00	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,882.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	331,712.25	2.04
S	综合	-	-
	合计	15,138,656.77	93.15

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	6,544.00	0.04
C	制造业	65,927.00	0.41
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	4,730.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	4,776.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,498.00	0.03
J	金融业	4,998.00	0.03
K	房地产业	35,151.00	0.22
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	126,624.00	0.78

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资产。

7.4 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

7.4.1 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	601318	中国平安	11,900	697,102.00	4.29
2	600519	贵州茅台	813	594,676.98	3.66
3	600016	民生银行	56,351	394,457.00	2.43
4	600015	华夏银行	36,224	269,868.80	1.66
5	000425	徐工机械	62,900	266,696.00	1.64
6	600887	伊利股份	9,460	263,934.00	1.62
7	601006	大秦铁路	32,016	262,851.36	1.62
8	000157	中联重科	63,539	261,145.29	1.61
9	002304	洋河股份	1,951	256,751.60	1.58
10	600369	西南证券	61,900	238,315.00	1.47

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。

7.4.2 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	000008	神州高铁	10,800	53,568.00	0.33
2	600649	城投控股	2,600	15,912.00	0.10
3	600256	广汇能源	1,600	6,544.00	0.04
4	601717	郑煤机	1,100	6,391.00	0.04
5	002244	滨江集团	1,200	6,240.00	0.04

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 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	601318	中国平安	1,362,378.62	10.16
2	000651	格力电器	920,749.32	6.86
3	000333	美的集团	631,171.00	4.71
4	600887	伊利股份	630,156.00	4.70
5	600519	贵州茅台	609,303.00	4.54
6	600016	民生银行	595,417.00	4.44
7	600000	浦发银行	590,484.00	4.40
8	601166	兴业银行	570,381.00	4.25
9	600104	上汽集团	552,186.00	4.12
10	601601	中国太保	537,197.00	4.00
11	600383	金地集团	529,266.00	3.95
12	600036	招商银行	498,050.00	3.71
13	601328	交通银行	479,254.00	3.57
14	600015	华夏银行	474,922.00	3.54
15	601288	农业银行	457,365.00	3.41
16	600919	江苏银行	456,355.00	3.40
17	000002	万科A	451,052.00	3.36
18	600606	绿地控股	446,935.00	3.33
19	600170	上海建工	435,910.00	3.25
20	000423	东阿阿胶	432,416.00	3.22
21	000858	五粮液	430,774.00	3.21
22	002304	洋河股份	424,705.00	3.17
23	600376	首开股份	421,914.37	3.15
24	600674	川投能源	417,166.00	3.11
25	600089	特变电工	409,553.00	3.05
26	601169	北京银行	405,829.00	3.03
27	601088	中国神华	404,368.00	3.01
28	600208	新湖中宝	397,535.00	2.96
29	600820	隧道股份	391,699.00	2.92
30	002146	荣盛发展	383,167.00	2.86
31	600332	白云山	381,366.00	2.84
32	600340	华夏幸福	380,322.00	2.84
33	601006	大秦铁路	364,350.00	2.72
34	000725	京东方A	355,097.00	2.65
35	601186	中国铁建	351,213.00	2.62
36	000898	鞍钢股份	350,095.00	2.61
37	600585	海螺水泥	349,181.00	2.60
38	000625	长安汽车	344,539.00	2.57
39	600153	建发股份	339,074.00	2.53
40	601155	新城控股	338,795.00	2.53
41	601668	中国建筑	336,168.00	2.51
42	002294	信立泰	334,177.00	2.49
43	601211	国泰君安	329,358.37	2.46
44	002508	老板电器	327,031.00	2.44
45	000157	中联重科	325,317.00	2.43
46	600031	三一重工	324,126.00	2.42
47	600741	华域汽车	323,446.00	2.41
48	000425	徐工机械	314,261.00	2.34
49	600219	南山铝业	312,800.00	2.33
50	000402	金融街	311,147.00	2.32
51	600066	宇通客车	310,670.00	2.32
52	600028	中国石化	309,960.00	2.31
53	000568	泸州老窖	306,755.00	2.29
54	600369	西南证券	297,982.00	2.22
55	600704	物产中大	296,580.00	2.21
56	600177	雅戈尔	294,939.87	2.20
57	300144	宋城演艺	291,883.00	2.18
58	002142	宁波银行	291,597.00	2.17
59	000001	平安银行	290,439.00	2.17
60	600690	青岛海尔	288,488.00	2.15
61	601628	中国人寿	282,601.00	2.11
62	000623	吉林敖东	281,370.00	2.10
63	601009	南京银行	280,566.00	2.09
64	601788	光大证券	278,854.67	2.08
65	001979	招商蛇口	277,810.00	2.07
66	600705	中航资本	277,334.00	2.07
67	300027	华谊兄弟	276,664.00	2.06
68	000876	新希望	273,516.00	2.04
69	000069	华侨城A	272,815.00	2.03
70	002024	苏宁易购	272,734.00	2.03

7.5.2 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	000651	格力电器	979,500.74	7.30
2	601288	农业银行	811,297.26	6.05
3	000725	京东方A	586,950.59	4.38
4	600606	绿地控股	563,324.73	4.20
5	601186	中国铁建	547,493.10	4.08
6	002146	荣盛发展	535,091.69	3.99
7	000333	美的集团	528,315.91	3.94
8	601328	交通银行	518,308.02	3.86
9	601088	中国神华	500,471.00	3.73
10	000898	鞍钢股份	488,969.17	3.65
11	601166	兴业银行	483,656.38	3.61
12	601601	中国太保	478,397.74	3.57
13	600383	金地集团	476,549.98	3.55
14	601155	新城控股	476,523.59	3.55
15	600000	浦发银行	476,330.28	3.55
16	601318	中国平安	466,108.00	3.47
17	600887	伊利股份	438,775.86	3.27
18	600066	宇通客车	433,151.47	3.23
19	600332	白云山	427,456.94	3.19
20	601211	国泰君安	425,832.15	3.17
21	601225	陕西煤业	423,616.45	3.16
22	000568	泸州老窖	422,221.47	3.15
23	601668	中国建筑	419,471.95	3.13
24	600688	上海石化	411,399.72	3.07
25	000876	新希望	404,339.79	3.01
26	600219	南山铝业	380,921.60	2.84
27	600104	上汽集团	380,875.56	2.84
28	600177	雅戈尔	379,965.43	2.83
29	601006	大秦铁路	371,844.01	2.77
30	600340	华夏幸福	365,706.00	2.73
31	601988	中国银行	358,916.99	2.68
32	000001	平安银行	355,574.34	2.65
33	002008	大族激光	349,805.93	2.61
34	601628	中国人寿	346,230.36	2.58
35	600028	中国石化	335,864.30	2.50
36	600535	天士力	334,794.34	2.50
37	601818	光大银行	330,848.37	2.47
38	002304	洋河股份	328,273.00	2.45
39	002385	大北农	328,037.08	2.45
40	600390	五矿资本	324,469.04	2.42
41	600690	青岛海尔	318,965.04	2.38
42	000423	东阿阿胶	317,961.00	2.37
43	600886	国投电力	316,784.92	2.36
44	000002	万科A	313,187.05	2.33
45	600089	特变电工	312,565.61	2.33
46	000338	潍柴动力	312,237.00	2.33
47	600036	招商银行	309,345.00	2.31
48	600031	三一重工	308,587.93	2.30
49	600153	建发股份	307,274.18	2.29
50	600674	川投能源	302,385.20	2.25
51	300144	宋城演艺	295,523.00	2.20
52	600519	贵州茅台	295,026.24	2.20
53	600016	民生银行	286,259.47	2.13
54	002065	东华软件	281,362.15	2.10
55	000625	长安汽车	281,195.36	2.10
56	002024	苏宁易购	275,624.00	2.05
57	002236	大华股份	274,525.95	2.05
58	600919	江苏银行	274,520.00	2.05
59	002142	宁波银行	270,549.00	2.02

7.5.3 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	49,332,169.16
卖出股票收入(成交)总额	44,993,165.58

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

7.6 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	672,067.20	4.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	672,067.20	4.14

7.7 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	019571	17国债17	6,720	672,067.20	4.14

7.8 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。

7.9 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投资。

7.10 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投资。

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

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。

7.13.2

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。

7.13.3 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	3,451.45
2	应收证券清算款	7,378.06
3	应收股利	-
4	应收利息	20,460.02
5	应收申购款	23,679.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,968.68

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.5.2 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	000008	神州高铁	53,568.00	0.33	重大事项

7.13.6 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 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
中金沪深300A	161	84,467.15	10,000,000.00	73.53%	3,599,211.02	26.47%
中金沪深300C	123	8,757.67	0.00	0.00%	1,077,192.96	100.00%
合计	284	51,677.48	10,000,000.00	68.14%	4,676,403.98	31.86%

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	中金沪深300A	114,980.86	0.8455%
	中金沪深300C	4,304.50	0.3996%
	合计	119,285.36	0.8128%

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	中金沪深300A	10~50
	中金沪深300C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中金沪深300A	0
	中金沪深300C	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	68.14	10,000,000.00	68.14	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	68.14	10,000,000.00	68.14	-

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中金沪深300A	中金沪深300C
基金合同生效日(2016年7月22日)基金份额总额	10,001,300.00	-
本报告期期初基金份额总额	10,839,298.31	268,832.88
本报告期基金总申购份额	3,613,305.87	1,704,398.02
减:本报告期基金总赎回份额	853,393.16	896,037.94
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	13,599,211.02	1,077,192.96

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,基金管理人与股东中国国际金融股份有限公司就侵犯商标权及不正当竞争事项,联合向北京市朝阳区人民法院起诉南京中金基金管理有限公司。截至2018年6月30日,该案已获法院受理,尚未开庭。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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
兴业证券	2	67,493,355.54	71.55%	49,358.52	71.55%	-
长江证券	2	26,831,979.20	28.45%	19,621.98	28.45%	-
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、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的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

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	1,384,196.30	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
自有资金	1	2018年1月1日至2018年6月30日	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	68.14%

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。

中金基金管理有限公司

2018年8月28日