

# 中金沪深300指数增强型发起式证券投资基金

## 2018年第三季度报告

| 序号    | 项目           | 金额(元)         | 占基金总资产比例(%) |
|-------|--------------|---------------|-------------|
| 1     | 权益投资         | 16,120,172.15 | 93.03       |
| 2     | 其中:股票        | 16,120,172.15 | 93.03       |
| 3     | 基金投资         | -             | -           |
| 3.1   | 固定收益投资       | 704,200.00    | 4.12        |
| 3.1.1 | 其中:债券        | 704,200.00    | 4.12        |
| 4     | 资产支持证券       | -             | -           |
| 5     | 金融衍生品投资      | -             | -           |
| 6     | 买入返售金融资产     | -             | -           |
| 6.1   | 其中:买入返售的金融资产 | -             | -           |
| 7     | 银行存款和拆借资金合计  | 465,573.69    | 2.63        |
| 8     | 其他资产         | 36,262.11     | 0.21        |
| 9     | 合计           | 17,334,237.94 | 100.00      |

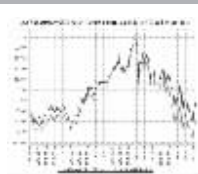


图1: 本基金自2017年7月1日至2018年9月30日止的净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

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。

### 3.3 其他指标

#### 4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金基金经理的期限 | 证券从业年限 | 说明  |
|----|---------|-------------|--------|---|
| 魏华 | 本基金基金经理 | 2017年3月1日至今 | 8年     | 魏华先生, 南开大学统计学专业硕士, 2010年5月至2011年10月, 在北京惠理资产管理有限责任公司从事股票资产管理研究工作, 2011年11月, 加入中金基金管理有限公司, 现任中金基金资产管理部公募基金公募事业部副经理、基金经理。 |

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 管理人对外报告期内本基金运作遵守信情况的说明

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》、基金合同和其他有关法律法规, 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, 在严格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 公平交易专项说明

##### 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。

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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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 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。

#### 2018年的宏观经济主要围绕国内经济形势和中美贸易战两个主题。

从国内经济形势来看, 中国经济有下行的压力, 但国内政策已经开始向积极, 一是稳定当前的预期, 调整去杠杆的节奏, 二是为“中国转型升级以及中长期的经济增长提供政策支持, 例如减税降费、刺激消费等。从国际经济环境来看, 中美关系是一个长期的问题, 中美之间的贸易战有其必然性, 必须对此有充分的认识和准备。2018年前三季度, 上证50指数下跌8.87%, 沪深300指数下跌14.69%, 中证500指数下跌23.20%, 创业板指下跌19.47%。展望2018年最后一个季度, 相信国内经济发展的韧性, 相信国家政策的有效性, 但同时不能低估中美贸易摩擦的影响。总体上我们对市场的看法不乐观, 因此我们会更加重视控制风险, 减少超额收益的波动。

#### 4.5 报告期内基金的投资表现

截至本报告期末中金沪深300A基金份额净值为1.0894元, 本报告期基金份额净值增长率为-1.55%; 截至本报告期末中金沪深300C基金份额净值为1.0995元, 本报告期基金份额净值增长率为-1.61%; 同期业绩比较基准收益率为-1.92%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内, 本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

#### 5. 投资组合报告

##### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号  | 项目           | 金额(元)         | 占基金总资产比例(%) |
|-----|--------------|---------------|-------------|
| 1   | 权益投资         | 21,689,197.04 | 92.62       |
| 2   | 其中:股票        | 21,689,197.04 | 92.62       |
| 3   | 固定收益投资       | 906,400.00    | 3.89        |
| 3.1 | 其中:债券        | 906,400.00    | 3.89        |
| 4   | 资产支持证券       | -             | -           |
| 5   | 金融衍生品投资      | -             | -           |
| 6   | 买入返售金融资产     | -             | -           |
| 6.1 | 其中:买入返售的金融资产 | -             | -           |
| 7   | 银行存款和拆借资金合计  | 681,612.66    | 2.87        |
| 8   | 其他资产         | 62,538.06     | 0.27        |
| 9   | 合计           | 23,259,137.76 | 100.00      |

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 管理人对外报告期内本基金运作遵守信情况的说明

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》和其他有关法律法规及基金合同的约定, 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, 在严格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 公平交易专项说明

##### 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。

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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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 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。

#### 2018年的宏观经济主要围绕国内经济形势和中美贸易战两个主题。

从国内经济形势来看, 中国经济有下行的压力, 但国内政策已经开始向积极, 一是稳定当前的预期, 调整去杠杆的节奏, 二是为“中国转型升级以及中长期的经济增长提供政策支持, 例如减税降费、刺激消费等。从国际经济环境来看, 中美关系是一个长期的问题, 中美之间的贸易战有其必然性, 必须对此有充分的认识和准备。2018年前三季度, 上证50指数下跌8.87%, 沪深300指数下跌14.69%, 中证500指数下跌23.20%, 创业板指下跌19.47%。展望2018年最后一个季度, 相信国内经济发展的韧性, 相信国家政策的有效性, 但同时不能低估中美贸易摩擦的影响。总体上我们对市场的看法不乐观, 因此我们会更加重视控制风险, 减少超额收益的波动。

#### 4.5 报告期内基金的投资表现

截至本报告期末中金中证500A基金份额净值为0.9017元, 本报告期基金份额净值增长率为-7.18%; 截至本报告期末中金中证500C基金份额净值为0.9096元, 本报告期基金份额净值增长率为-7.26%; 同期业绩比较基准收益率为-7.58%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内, 本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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               | 164,062.30    | 3.30         |
| C  | 制造业               | 6,983,622.37  | 40.05        |
| D  | 电力、热力、燃气及生产和服务供应业 | 42,008.00     | 0.49         |
| E  | 建筑业               | 589,499.34    | 3.44         |
| F  | 批发和零售业            | 562,759.20    | 3.28         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业       | 447,699.68    | 2.82         |
| H  | 住宿和餐饮业            | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业   | 162,448.00    | 0.96         |
| J  | 金融业               | 4,326,171.03  | 26.81        |
| K  | 房地产业              | 1,283,062.43  | 7.56         |
| L  | 科学研究和技术服务业        | 391,779.69    | 2.36         |
| M  | 软件和信息技术服务业        | 489,962.28    | 2.95         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业     | 130,960.00    | 0.77         |
| O  | 国防军工、其他综合类        | -             | -            |
| P  | 教育                | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作           | 6,450.00      | 0.04         |
| R  | 文化、体育和娱乐业         | 98,462.75     | 0.58         |
| S  | 综合                | -             | -            |
| 合计 |                   | 16,766,479.13 | 93.03        |

#### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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               | 37,702.40 | 0.23         |
| D  | 电力、热力、燃气及生产和服务供应业 | -         | -            |
| E  | 建筑业               | -         | -            |
| F  | 批发和零售业            | -         | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业       | 5,394.00  | 0.03         |
| H  | 住宿和餐饮业            | -         | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业   | -         | -            |
| J  | 金融业               | -         | -            |
| K  | 房地产业              | 28,458.04 | 0.17         |
| L  | 科学研究和技术服务业        | -         | -            |
| M  | 软件和信息技术服务业        | -         | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业     | -         | -            |
| O  | 国防军工、其他综合类        | -         | -            |
| 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 |                   | 71,462.04 | 0.42         |

### 5.2.3 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。

#### 5.3 报告期末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组合

5.3.1 报告期末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组合

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|------------|--------------|
| 1  | 000333 | 中联重科 | 6,690   | 607,400.00 | 3.04         |
| 2  | 000019 | 贵州茅台 | 813     | 505,400.00 | 2.67         |
| 3  | 600034 | 民生银行 | 76,381  | 484,265.64 | 2.43         |
| 4  | 000318 | 光大银行 | 123,796 | 483,000.87 | 2.43         |
| 5  | 600028 | 中国石化 | 65,100  | 435,320.07 | 2.25         |
| 6  | 000308 | 华泰证券 | 51,249  | 423,776.89 | 2.20         |
| 7  | 001186 | 国开证券 | 36,258  | 418,253.35 | 2.16         |
| 8  | 000058 | 海螺水泥 | 19,716  | 394,241.64 | 2.00         |
| 9  | 000061 | 格力电器 | 9,177   | 388,956.81 | 2.11         |
| 10 | 601398 | 工商银行 | 99,794  | 384,787.01 | 2.00         |

#### 5.3.2 报告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组合

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元)  | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|----------|--------------|
| 1  | 000025 | 万科A  | 1,000 | 5,000.00 | 0.03         |
| 2  | 000029 | 招商银行 | 1,200 | 5,364.00 | 0.03         |
| 3  | 000040 | 旭辉控股 | 800   | 5,320.00 | 0.03         |
| 4  | 000088 | 韩建集团 | 800   | 5,320.00 | 0.03         |
| 5  | 600022 | 山东钢铁 | 2,000 | 5,000.00 | 0.03         |

### 5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

| 序号 | 债券代码   | 债券名称  | 数量(张) | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 000008 | 华泰债   | 9,300 | 43,488.00 | 0.19         |
| 2  | 000059 | 华泰债01 | 5,000 | 41,454.00 | 0.19         |
| 3  | 000097 | 开元债   | 3,700 | 38,570.00 | 0.17         |
| 4  | 000078 | 开明债   | 3,000 | 30,150.00 | 0.13         |
| 5  | 000719 | 大地转债  | 5,000 | 30,046.00 | 0.13         |

### 5.4 报告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组合

| 序号 | 证券代码   | 证券名称   | 数量(张) | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|-------|------------|--------------|
| 1  | 010006 | 国开1701 | 7,000 | 704,200.00 | 4.12         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 5.8 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权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 5.9.1 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投资。

### 5.9.2 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投资。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存保证金    | 2,300.63  |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 13,000.00 |
| 5  | 应收申购款   | 29,860.02 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 38,260.11 |

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末, 本基金指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末, 本基金积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

### 5.11.6 报告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

报告期末, 本基金资产支持证券不存在流通受限的情况。

### 5.11.7 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权证

报告期末, 本基金权证投资不存在流通受限的情况。

### 5.11.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属

报告期末, 本基金贵金属投资不存在流通受限的情况。

### 5.11.9 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权证

报告期末, 本基金权证投资不存在流通受限的情况。

### 5.11.10 报告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

报告期末, 本基金资产支持证券不存在流通受限的情况。

### 5.11.11 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权证

报告期末, 本基金权证投资不存在流通受限的情况。

### 5.11.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属

报告期末, 本基金贵金属投资不存在流通受限的情况。

### 5.11.13 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权证

报告期末, 本基金权证投资不存在流通受限的情况。

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  
报告送出日期: 2018年10月24日

### §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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责任。

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10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本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。