

## 中金沪深300指数增强型发起式证券投资基金

## 2018年第四季度报告

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:2019年1月22日  
§ 1 重要提示  
基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、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，于2019年1月21日复核了本报告中的各项内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
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。  
本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资有风险，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。

本报告告期内财务数据未经审计。

本报告告期自2018年10月1日起至2018年12月31止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 中金沪深300 指数增强型发起式证券投资基金

基金代码 000315

交易网站 www.cicifund.com

基金运作方式 管理型开放式

基金合同生效日 2016年7月22日

报告期末基金份额总额 21,115,484.96份

基金投资目标 本基金主要投资于沪深300指数成份股，通过量化模型精选股票，力争在严格控制风险的前提下，实现超越标的指数的收益水平，为基金份额持有人创造稳定增值。

基金投资策略 本基金主要投资于沪深300指数成份股，通过量化模型精选股票，力争在严格控制风险的前提下，实现超越标的指数的收益水平，为基金份额持有人创造稳定增值。

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。投资人投资有风险，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。

本报告告期内财务数据未经审计。

本报告告期自2018年10月1日起至2018年12月31止。

§ 3 基金产品概况

基金名称 中金沪深300 指数增强型发起式证券投资基金

基金代码 000315

交易网站 www.cicifund.com

基金运作方式 管理型开放式

基金合同生效日 2016年7月22日

报告期末基金份额总额 21,115,484.96份

基金投资目标 本基金主要投资于沪深300指数成份股，通过量化模型精选股票，力争在严格控制风险的前提下，实现超越标的指数的收益水平，为基金份额持有人创造稳定增值。

基金投资策略 本基金主要投资于沪深300指数成份股，通过量化模型精选股票，力争在严格控制风险的前提下，实现超越标的指数的收益水平，为基金份额持有人创造稳定增值。

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。投资人投资有风险，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。

本报告告期内财务数据未经审计。

本报告告期自2018年10月1日起至2018年12月31止。

§ 4 管理人报告

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

魏宇 本基金的基金经理 2017年3月 - 8年 魏宇先生，香港大学统计专业学士，北京大学金融学硕士，现就职于本公司，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，历任量化研究员、量化策略研究员、量化策略经理、量化总监。

1. 上述任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义从《证券业从业人员资格管理办法》的规定。

3. 本基金管理人高级管理人员、基金经理和基金经理助理等人员的证券从业经历，不包括担任本公司基金经理及基金经理助理期间的经历。

4. 期末基金资产净值占净资产比例、年内最高净值和年内最低净值的计算方法。

5. 本报告期内基金的平均净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

报告期(2018年10月1日 - 2018年12月31日)

中金沪深300A 1,694,136.23 1,347,704.91

中金沪深300C -906,164.94 -128,201.63

净值增长率为-0.55%，年内最高净值为1.00%，年内最低净值为0.99%。

6. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

7. 基金净值表现

8. 其他费用

9. 报告期未出现赎回金额低于五十万元的情形。

10. 本报告期内基金的平均净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

11. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

12. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

13. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

14. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

15. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

16. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

17. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

18. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

19. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

20. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

21. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

22. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

23. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

24. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

25. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

26. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

27. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

28. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

29. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

30. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

31. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

32. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

33. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

34. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

35. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

36. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

37. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

38. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

39. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

40. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

41. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

42. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

43. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

44. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

45. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

46. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

47. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

48. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

49. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

50. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

51. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

52. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

53. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

54. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

55. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

56. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

57. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

58. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

59. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

60. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

61. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

62. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

63. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

64. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

65. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

66. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

67. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

68. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

69. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

70. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

71. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

72. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

73. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

74. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

75. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

76. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

77. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

78. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

79. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

80. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

81. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

82. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

83. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。

84. 本报告期所列的各项基金费用指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用，计人费用后实际收益水平低于所有假设。</p