

(上接B427版)

7.4.8.1.3 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。
7.4.8.1.4 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。
7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金
本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。
7.4.8.2 关联方报酬
7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	112,262.47	59,870.62
其中:支付销售机构的客户维护费	13,886.21	1,904.69

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%。
7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	33,687.83	17,961.16

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。
7.4.8.2.3 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12月31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	-	218.93	218.93
中金公司	-	67.12	67.12
合计	-	286.05	286.05
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12月31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	-	180.11	180.11
中金公司	-	180.11	180.11

注：1 本基金A类基金份额不收取销售服务费，本基金C类

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。
7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。
7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
7.4.8.4.1 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12月31日	上期 2017年1月1日至2017年12月31日
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	32.99%	-

注:1、报告期内基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金赎回份额含转换转出份额;
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。
7.4.8.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。
7.4.8.5 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12月31日	上期 2017年1月1日至2017年12月31日
工商银行	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09

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”转存于中国银联登记结算有限责任公司结算备付金和存出保证金,于2018年12月31日的相关余额为人民币194,823.25元(2017年12月31日:人民币155,695.77元),本期期间产生的利息收入为人民币2,374.72元(自2017年1月1日至2017年12月31日止期间:人民币2,889.89元)。
7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与认购关联方承销的证券。
7.4.8.7 其他关联交易事项的说明
7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
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证券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,流动性受限而不能自由转让的上市。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2018年12月31日,本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。
7.4.9.2 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	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601678 流化股份	133,069	561,334.30	1.83
2	002004 华建集团	119,500	560,886.00	1.79
3	600689 卧龙电气	83,588	528,124.40	1.72
4	002292 友阿控股	103,000	423,270.00	1.37
5	002049 华翔控股	26,273	276,216.08	1.23
6	601717 招商局	67,158	271,528.88	1.22
7	002223 瀚蓝环保	36,700	269,142.00	1.17
8	601016 节能风电	150,500	249,160.00	1.14
9	600694 大新股份	13,900	236,241.00	1.09
10	000778 新兴铸管	73,588	217,151.36	1.03

注:1、报告期内基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金赎回份额含转换转出份额;
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。
7.4.8.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。
7.4.8.5 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12月31日	上期 2017年1月1日至2017年12月31日
工商银行	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09

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”转存于中国银联登记结算有限责任公司结算备付金和存出保证金,于2018年12月31日的相关余额为人民币194,823.25元(2017年12月31日:人民币155,695.77元),本期期间产生的利息收入为人民币2,374.72元(自2017年1月1日至2017年12月31日止期间:人民币2,889.89元)。
7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与认购关联方承销的证券。
7.4.8.7 其他关联交易事项的说明
7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
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证券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,流动性受限而不能自由转让的上市。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2018年12月31日,本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。
7.4.9.2 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	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601678 流化股份	133,069	561,334.30	1.83
2	002004 华建集团	119,500	560,886.00	1.79
3	600689 卧龙电气	83,588	528,124.40	1.72
4	002292 友阿控股	103,000	423,270.00	1.37
5	002049 华翔控股	26,273	276,216.08	1.23
6	601717 招商局	67,158	271,528.88	1.22
7	002223 瀚蓝环保	36,700	269,142.00	1.17
8	601016 节能风电	150,500	249,160.00	1.14
9	600694 大新股份	13,900	236,241.00	1.09
10	000778 新兴铸管	73,588	217,151.36	1.03

注:1、报告期内基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金赎回份额含转换转出份额;
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。
7.4.8.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。
7.4.8.5 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12月31日	上期 2017年1月1日至2017年12月31日
工商银行	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09

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”转存于中国银联登记结算有限责任公司结算备付金和存出保证金,于2018年12月31日的相关余额为人民币194,823.25元(2017年12月31日:人民币155,695.77元),本期期间产生的利息收入为人民币2,374.72元(自2017年1月1日至2017年12月31日止期间:人民币2,889.89元)。
7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与认购关联方承销的证券。
7.4.8.7 其他关联交易事项的说明
7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
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证券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,流动性受限而不能自由转让的上市。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2018年12月31日,本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。
7.4.9.2 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	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601678 流化股份	133,069	561,334.30	1.83
2	002004 华建集团	119,500	560,886.00	1.79
3	600689 卧龙电气	83,588	528,124.40	1.72
4	002292 友阿控股	103,000	423,270.00	1.37
5	002049 华翔控股	26,273	276,216.08	1.23
6	601717 招商局	67,158	271,528.88	1.22
7	002223 瀚蓝环保	36,700	269,142.00	1.17
8	601016 节能风电	150,500	249,160.00	1.14
9	600694 大新股份	13,900	236,241.00	1.09
10	000778 新兴铸管	73,588	217,151.36	1.03

注:1、报告期内基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金赎回份额含转换转出份额;
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。
7.4.8.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。
7.4.8.5 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12月31日	上期 2017年1月1日至2017年12月31日
工商银行	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09

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”转存于中国银联登记结算有限责任公司结算备付金和存出保证金,于2018年12月31日的相关余额为人民币194,823.25元(2017年12月31日:人民币155,695.77元),本期期间产生的利息收入为人民币2,374.72元(自2017年1月1日至2017年12月31日止期间:人民币2,889.89元)。
7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与认购关联方承销的证券。
7.4.8.7 其他关联交易事项的说明
7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
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证券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,流动性受限而不能自由转让的上市。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2018年12月31日,本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。
7.4.9.2 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	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601678 流化股份	133,069	561,334.30	1.83
2	002004 华建集团	119,500	560,886.00	1.79
3	600689 卧龙电气	83,588	528,124.40	1.72
4	002292 友阿控股	103,000	423,270.00	1.37
5	002049 华翔控股	26,273	276,216.08	1.23
6	601717 招商局	67,158	271,528.88	1.22
7	002223 瀚蓝环保	36,700	269,142.00	1.17
8	601016 节能风电	150,500	249,160.00	1.14
9	600694 大新股份	13,900	236,241.00	1.09
10	000778 新兴铸管	73,588	217,151.36	1.03

注:1、报告期内基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金赎回份额含转换转出份额;
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。
7.4.8.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。
7.4.8.5 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12月31日	上期 2017年1月1日至2017年12月31日
工商银行	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09

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”转存于中国银联登记结算有限责任公司结算备付金和存出保证金,于2018年12月31日的相关余额为人民币194,823.25元(2017年12月31日:人民币155,695.77元),本期期间产生的利息收入为人民币2,374.72元(自2017年1月1日至2017年12月31日止期间:人民币2,889.89元)。
7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与认购关联方承销的证券。
7.4.8.7 其他关联交易事项的说明
7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
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证券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,流动性受限而不能自由转让的上市。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2018年12月31日,本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。
7.4.9.2 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	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601678 流化股份	133,069	561,334.30	1.83
2	002004 华建集团	119,500	560,886.00	1.79
3	600689 卧龙电气	83,588	528,124.40	1.72
4	002292 友阿控股	103,000	423,270.00	1.37
5	002049 华翔控股	26,273	276,216.08	1.23
6	601717 招商局	67,158	271,528.88	1.22
7	002223 瀚蓝环保	36,700	269,142.00	1.17
8	601016 节能风电	150,500	249,160.00	1.14
9	600694 大新股份	13,900	236,241.00	1.09
10	000778 新兴铸管	73,588	217,151.36	1.03

注:1、报告期内基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金赎回份额含转换转出份额;
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。
7.4.8.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。
7.4.8.5 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12月31日	上期 2017年1月1日至2017年12月31日
工商银行	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09

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”转存于中国银联登记结算有限责任公司结算备付金和存出保证金,于2018年12月31日的相关余额为人民币194,823.25元(2017年12月31日:人民币155,695.77元),本期期间产生的利息收入为人民币2,374.72元(自2017年1月1日至2017年12月31日止期间:人民币2,889.89元)。
7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与认购关联方承销的证券。
7.4.8.7 其他关联交易事项的说明
7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
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证券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,流动性受限而不能自由转让的上市。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2018年12月31日,本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。
7.4.9.2 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	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601678 流化股份	133,069	561,334.30	1.83
2	002004 华建集团	119,500	560,886.00	1.79
3	600689 卧龙电气	83,588	528,124.40	1.72
4	002292 友阿控股	103,000	423,270.00	1.37
5	002049 华翔控股	26,273	276,216.08	1.23
6	601717 招商局	67,158	271,528.88	1.22
7	002223 瀚蓝环保	36,700	269,142.00	1.17
8	601016 节能风电	150,500	249,160.00	1.14
9	600694 大新股份	13,900	236,241.00	1.09
10	000778 新兴铸管	73,588	217,151.36	1.03

注:1、报告期内基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金赎回份额含转换转出份额;
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。
7.4.8.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。
7.4.8.5 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12月31日	上期 2017年1月1日至2017年12月31日
工商银行	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09	期末余额 6,897,976.28 当期利息收入 1,262,084.09

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”转存于中国银联登记结算有限责任公司结算备付金和存出保证金,于2018年12月31日的相关余额为人民币194,823.25元(2017年12月31日:人民币155,695.77元),本期期间产生的利息收入为人民币2,374.72元(自2017年1月1日至2017年12月31日止期间:人民币2,889.89元)。
7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与认购关联方承销的证券。
7.4.8.7 其他关联交易事项的说明
7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
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证券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,流动性受限而不能自由转让