中金中证500指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

(2019年第2号)

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
二〇一九年八月

重要提示

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")的募集申请于2016年7月5日经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")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》注册,并于2016年7月22日经中国证监会证券基金机构监管部部函[2016]1701号《关于中金中证500指数增强型发起式证券投资基金备案确认的函》备案。本基金的基金合同于2016年7月22日生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等做出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场及期货市场,基金净值会因为证券及期货市场波动等因素产生波动,投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于:市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、估值风险、操作及技术风险、合规性风险、本基金特有风险、税负增加风险、其他风险等。本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金,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,属于证券投资基金中高预期风险和高预期收益的品种。

本基金可投资科创板股票,科创板股票的主要风险包括但不限于流动性风险、停牌、退市风险、投资集中度风险、参与战略配售股票风险等。

本基金基金份额分为A、C两类,其中A类基金份额收取认/申购费,C类基金份额不收取申购费,但计提销售服务费;A、C两类基金份额适用不同的赎回费率。

投资人在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

投资有风险,投资人认/申购基金时应认真阅读本招募说明书及其更新。

基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本更新招募说明书已经本基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截止日为2019年7月22日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:中金基金管理有限公司

住所: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:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层

法定代表人:楚钢

成立时间:2014年2月10日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:中国证监会证监许可[2014]97号

组织形式:有限责任公司

注册资本:人民币3.5亿元

存续期间:持续经营

联系人:张显

联系电话:010-63211122

公司的股权结构如下:

股东名称	持股比例
中国国际金融股份有限公司	100%

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

楚钢先生,董事长,理论物理学博士,特许金融分析师。历任花旗集团副总裁、新兴市场风控经理、地方政府债券自营交易员、基金经理、拉丁美洲股票期权交易负责人及另类投资董事总经理等职务。现任中国国际金融股份有限公司首席运营官、管理委员会成员。

黄劲峰先生,董事,机械工程专业学士。历任英国毕马威会计师事务所(英国及香港)审计、核算见习生、副经理,经理等职务;香港汇丰银行资本市场财务经理、货币及外汇市场财务经理职务;高盛(亚洲),高盛集团(日本东京)固定收益外汇及大宗商品产品财务控制负责人、权益类产品财务控制负责人、日本产品财务控制负责人、香港财务控制负责人、执行董事等职务;北京高华证券有限责任公司中后台协调、风险管理岗位;高盛(亚洲)有限责任公司资产管理部亚太区首席营运官、亚太(除日本)首席营运官、产品研发主管和董事总经理职务。现任中国国际金融股份有限公司首席财务官、管理委员会成员。

陈刚先生,董事,法学博士。历任国务院发展研究中心技术经济研究所研究人员;北京世泽律师事务所律师;中国国际金融股份有限公司合规律师、中国国际金融(香港)有限公司合规律师、中金美国证券有限公司法律部负责人;厚朴香港投资咨询有限公司法律合规事务负责人。陈刚先生是美国纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。现任中国国际金融股份有限公司合规总监、董事总经理。

孙菁女士,董事,管理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资本市场部副总经理、公司管理部副总经理、运营支持部执行总经理及负责人等职务。现任中金基金管理有限公司总经理。

赵璧先生,董事,经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司投资银行部经理;中信产业基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司总经理助理。

李永先生,董事,工商管理硕士。历任中国人保资产管理有限公司交易员、风险监控员、投资经理;中国人寿资产管理有限公司养老金及机构业务部投资经理、固定收益团队负责人、固定收益部投资经理、高级投资经理、一级团队负责人;中国人寿资产管理有限公司固定收益投资委员会委员、自有资金投资委员会委员。现任中金基金管理有限公司副总经理。

张春先生,独立董事,经济学和决策科学博士。历任美国明尼苏达大学卡尔森管理学院金融系终身教授;中欧国际工商学院金融和会计系讲席教授、系主任、副教务长。现任上海交通大学上海高级金融学院教授、执行院长,并兼任上海人寿股份有限公司及上海证券有限责任公司独立董事。

冒大卫先生,独立董事,哲学博士,历任北京大学光华管理学院团委书记、党委副书记、党委书记,北京大学医学部副主任、财务部部长,北京大学副总会计师等职务。现任神州泰岳软件股份有限公司董事。

王元先生,法学硕士。历任北京君合律师事务所上海分所、上海市耀良律师事务所、北京市嘉源律师事务所上海分所律师。现任北京市嘉源律师事务所高级合伙人、管委会成员,兼任上海思华科技股份有限公司独立董事。

2、基金管理人监事

白娜女士,执行监事,管理学硕士。历任航天信息股份有限公司内审部审计主管;长盛基金管理有限公司基金会计;中国国际金融股份有限公司资产管理部高级经理。现任中金基金管理有限公司基金运营部负责人。

3、基金管理人高级管理人员

楚钢先生,董事长。简历同上。

孙菁女士,总经理。简历同上。

李永先生,副总经理。简历同上。

汤琰女士,管理学硕士。历任中国工商银行深圳分行高级理财经理,华安基金管理有限公司零售业务部副总经理。现任中金基金管理有限公司副总经理。

李虹女士,督察长,法学硕士。历任美国众达律师事务所北京代表处律师;中国国际金融股份有限公司合规管理部副总经理。李虹女士是美国纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。

夏静女士,理学硕士。历任普华永道(深圳)咨询有限公司北京分公司风险管理及内部控制服务部经理;中国国际金融股份有限公司公司稽核部高级经理。现任中金基金管理有限公司首席信息官、风险管理部负责人。

4、本基金基金经理

魏孛先生,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。

5、投资决策委员会成员

李永先生,副总经理。简历同上。

王雁杰先生,经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部行业研究员,定向资产管理业务投资经理,集合资产管理计划投资经理;中金基金管理有限公司专户投资部投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理、董事总经理。

郭党钰先生,工商管理硕士。历任宁波镇海炼化股份有限公司投资经理;华泰证券股份有限公司项目经理;德恒证券有限责任公司高级经理;华策投资有限公司投资副总经理;招商基金管理有限公司投资经理。2014年4月加入中金基金管理有限公司,现任投资管理部基金经理。

石玉女士,管理学硕士。历任中国科技证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司职员;天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员;中国国际金融股份有限公司资产管理部高级研究员、投资经理助理、投资经理。2016年7月加入中金基金管理有限公司,现任投资管理部基金经理。

朱宝臣先生,理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部投资经理、量化投资总监。2017年10月加入中金基金管理有限公司,现任量化投资团队负责人。

杨立先生,经济学硕士。历任民生证券股份有限公司证券投资助理、证券投资经理;华融证券股份有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:陈四清

注册资本:人民币35,640,625.71万元

联系电话:010-66105799

联系人:郭明

(二)主要人员情况

截至2018年6月,中国工商银行资产托管部共有员工212人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年6月,中国工商银行共托管证券投资基金874只。自2003年以来,本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的61项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

(1)直销柜台

名称:中金基金管理有限公司
住所: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:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层
法定代表人:楚钢
电话:010-63211122
传真:010-66159121
联系人:张显
客户服务电话:400-868-1166
网站:www.ciccfund.com

(2)网上直销

交易系统:中金基金网上交易系统
交易系统网址:trade.ciccfund.com

2、其他销售机构

(1)中国中投证券有限责任公司
客服电话:95532
网址:http://www.china-invs.cn

(2)上海联泰资产管理有限公司
客服电话:021-52822063
网站:http://www.66zichan.com

(3)平安证券有限责任公司
客服电话:95511-8
网站:http://stock.pingan.com

(4)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
联系人:王诗屿
电话:021-20613999
传真:021-68596919
客服电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com

(5)上海万得投资顾问有限公司
客服电话:400-821-0203
网站:www.520fund.com.cn

(6)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人:陈柏青
联系人:韩爱彬
客服电话:4000-766-123
公司网址:www.fund123.cn

(7)上海陆享投资管理有限公司
客服电话:021-33356675
网站:http://www.luxxfund.com/

(8)长城证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:丁益
电话:0755-83516289
传真:0755-83516199
联系人:金夏
网址:www.cgws.com

(9)中国国际金融股份有限公司
住所:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:毕明建(代履职)
客户服务电话:010-65051166
网址:www.cicc.com.cn
联系人:杨涵宇

(10)中国银河证券股份有限公司
客服电话:95551
网站:http://www.chinastock.com.cn

(11)上海基煜基金销售有限公司
客服电话:4008-205-369
网址:https://www.jiyufund.com.cn

(12)和讯信息科技有限公司
客服电话:400-920-0022
网站:licaike.hexun.com

(13)北京蛋卷基金销售有限公司
客服电话:400-061-8518
网站:https://danjuanapp.com/

(14)上海天天基金销售有限公司
客服电话:400-991-8918
网址:http://fund.eastmoney.com

(15)上海挖财金融信息服务有限公司
客服电话:021-50810673
网站:http://www.wacai.com/

(16)通华财富(上海)基金销售有限公司
客服电话:95156转5
网站:https://www.tonghuafund.com

(17)洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司
客服电话:4006706863
网址:www.hongtaiwealth.com

(18)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
客服电话:4008199868
网址:www.tdyhfund.com

(19)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
客服电话:400-098-8511
网站:http://jdd.jr.jd.com/index.html

(20)北京恒天明泽基金销售有限公司
客服电话:400-898-0618
网址:http://www.chtfund.com

(21)包商银行股份有限公司
客服电话:95352
网站:www.bsb.com.cn

(22)北京植信基金销售有限公司
客服电话:010-56075718
网址:www.zhixin-inv.com

(23)南京苏宁基金销售有限公司
客服电话:95177
网址:www.snjijin.com

(24)浙江同花顺基金销售有限公司
客服电话:4008-773-772
网址:www.5ifund.com

(25)济安财富(北京)基金销售有限公司
客服电话:400-673-7010
网址:http://www.jianfortune.com

(26)泰诚财富基金销售(大连)有限公司
网址:www.taichengcaifu.com
电话:400-0411-001

(27)中信建投证券股份有限公司
网址:www.csc108.com
电话:4008-888-108

(28)珠海盈米基金销售有限公司
网址:www.yingmi.cn
电话:020-89629099

(29)阳光人寿保险股份有限公司
网址:fund.sinosig.com
电话:95510

(30)上海长量基金销售投资顾问有限公司
网址:www.erichfund.com
电话:400-820-2899

(31)腾安基金销售(深圳)有限公司
网址:www.tenganxinxi.com
电话:0755-86013388

(32)西藏东方财富证券股份有限公司
网址:http://www.18.cn
电话:95357

其他销售机构详见本基金基金份额发售公告或基金管理人届时发布的变更或增减销售机构的公告。

(二)登记机构

名称:中金基金管理有限公司
住所: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:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层
法定代表人:楚钢
电话:010-63211122
传真:010-66155573
联系人:白娜

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:北京市海问律师事务所
住所:北京市朝阳区东三环中路5号财富金融中心20层
办公地址:北京市朝阳区东三环中路5号财富金融中心20层
负责人:张继平
电话:(+86 10) 8560 6888
传真:(+86 10) 8560 6999
经办律师:魏双娟、高巍
联系人:魏双娟

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层
办公地址:中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层
执行事务合伙人:邹俊
电话:010-85087916
传真:010-85185111
签章注册会计师:张君一、丁时杰
联系人:程海良

四、基金的名称

中金中证500指数增强型发起式证券投资基金。

五、基金的类型及运作方式

(一) 基金的类型

股票指数增强型证券投资基金。

(二) 基金的运作方式

契约开放式。

六、基金的投资目标

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%。

七、基金的投资方向

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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票投资比例范围为基金资产的90%-95%,投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

八、基金的投资策略

(一)资产配置策略

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。

(二)股票投资策略

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。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。

1、标的指数投资策略

指数化被动投资策略参照标的指数的成分股、备选成分股及其权重,初步构建投资组合,并按照标的指数的调整规则作出相应调整。

2、量化增强策略

量化增强策略主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果,基金管理人结合市场环境和股票特性,产出投资组合,以追求超越标的指数表现的业绩水平。

多因子超额收益模型:本模型是基于市场不完全有效地假设,着眼于运用统计方法和金融理论发现证券预期收益的驱动因子以及他们之间的关系,利用历史数据回测和构建量化投资模型,预测并持有概率统计上有极大可能产生正收益的投资组合。预期收益的驱动因子可以和基本面投资相同或类似,例如市盈率,资本市值,公司所处板块以及证券历史表现等,也可以是动量因子等技术面指标或者交易数量等流动性因子。

风险模型:该模型控制投资组合对各类风险因子的敞口,包括基金规模、资产波动率、行业集中度等,力求主动风险以及跟踪误差控制在目标范围内,使其收益需要符合指数收益特征。本模型主要通过控制和优化投资组合相对指数在一些风险因子上的偏离度来实现,常见风险因子如行业因子和基本面因子等。通过调整风险模型,本模型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%。

成本模型:该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花税、佣金等数据预测本基金的交易成本,调整基金的换手率,来达到优化投资组合的目的。

3、模型的应用与调整

在正常的市场情况下,本基金将主要依据量化增强模型的运行结果来进行组合的构建。同时,基金管理人也会定期对模型的有效性进行检验和更新,以反映市场结构趋势的变化。在市场出现非正常波动或基金管理人预测市场可能出现重大非正常波动时,本基金将结合市场情况做出具有一定前瞻性的判断,临时调整各因子类别的具体组成及权重。

(三)债券投资策略

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。

(四)股指期货投资策略

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。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。本基金为指数增强型基金,标的指数为中证500指数,因此业绩比较基准以中证500指数收益率为主要组成部分。

中证500指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场,其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的小市值股票,综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体情况。

本基金管理人认为,该业绩比较基准目前能够忠实反映本基金的风险收益特征。如果指数编制单位停止计算编制该指数、或今后法律法规发生变化或更改指数名称、或有更适当的、更能为市场普遍接受业绩比较基准推出,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,经履行适当程序,调整业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十、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。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定,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。

以下内容摘自中金中证500指数增强型发起式证券投资基金2019年第2季度报告

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	55,823,773.84	91.71
	其中:股票	55,823,773.84	91.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,137,488.00	5.15
	其中:债券	3,137,488.00	5.15
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,293,024.10	2.12
8	其他资产	612,600.50	1.01
9	合计	60,866,886.44	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末指数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	371,351.00	0.63
B	采矿业	2,983,849.34	5.06
C	制造业	21,556,829.55	36.59
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	4,413,045.33	7.49
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
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	2,786,009.56	4.73
S	综合	527,753.00	0.90
	合计	49,209,438.54	83.52

(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	174,035.00	0.30
B	采掘业	53,086.00	0.09
C	制造业	3,923,810.50	6.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	297,507.20	0.50
E	建筑业	149,756.00	0.25
F	批发和零售业	592,366.00	1.01
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	59,502.00	0.10
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	44,100.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	111,204.60	0.19
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	106,584.00	0.18
S	综合	58,863.00	0.10
	合计	6,614,335.30	11.23

(3)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末,本基金未持有港股通投资股票。

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明细

(1)报告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

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	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

(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明细

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	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

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,137,488.00	5.32
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	3,137,488.00	5.32

5. 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债券投资明细

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	019611	19国债01	31,400	3,137,488.00	5.32

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投资明细

本报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

本报告期末,本基金未持有贵金属。

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明细

本报告期末,本基金未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末,本基金未持有股指期货。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末,本基金未持有股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本报告期末,本基金未持有国债期货。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末,本基金未持有国债期货。

(3)本期国债期货投资评价

本报告期末,本基金未持有国债期货。

11. 投资组合报告附注

(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。

(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。

12. 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,185.64
2	应收证券清算款	452,502.69
3	应收股利	-
4	应收利息	33,163.43
5	应收申购款	111,748.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	612,600.50

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

13. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(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。

(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。

14. 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金基金合同生效日为2016年7月22日,基金业绩数据截至2019年6月30日。

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	净值收益率①	净值收益率标准差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
2016年7月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日	2.49%	0.80%	-2.61%	0.90%	5.10%	-0.10%
2017年1月1日至2017年12月31日	6.79%	0.91%	-0.13%	0.88%	6.92%	0.03%
2018年1月1日至2018年12月31日	-25.69%	1.40%	-31.85%	1.43%	6.16%	-0.03%
2019年1月1日至2019年6月30日	21.23%	1.58%	17.87%	1.70%	3.36%	-0.12%
基金合同生效日起至2019年6月30日	-1.40%	1.21%	-21.87%	1.25%	20.47%	-0.04%

中金中证500C

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
2016年11月29日(分级开始日)至2016年12月31日	-5.10%	0.98%	-5.80%	0.94%	0.70%	0.04%
2017年1月1日至2017年12月31日	7.64%	0.91%	-0.13%	0.88%	7.77%	0.03%
2018年1月1日至2018年12月31日	-25.62%	1.40%	-31.85%	1.43%	6.23%	-0.03%
2019年1月1日至2019年6月30日	21.13%	1.58%	17.87%	1.70%	3.26%	-0.12%
2016年11月29日(分级开始日)至2019年6月30日	-7.97%	1.26%	-24.42%	1.30%	16.45%	-0.04%

注:上述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。

十三、基金的费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)C类份额的销售服务费

(4)《基金合同》生效后与基金相关标的指数许可使用费;

(5)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

(6)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

(7)基金份额持有人大会费用;

(8)基金的证券、期货交易费用;

(9)基金的银行汇划费用;

(10)基金相关账户的开户及维护费用;

(11)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 0.50\% \div$ 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初2个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.15\% \div$ 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初2个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(3)基金销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

$H = E \times 0.40\% \div$ 当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

C类基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初2个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(4)基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中,基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。在通常情况下,指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.016%的年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 0.016\% \div$ 当年天数

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提,按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定,标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民币10,000元,计费区间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令,经基金托管人复核后于每年1月,4月,7月,10月首日起10个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述"一、基金费用的种类中第5-11项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(二) 与基金销售有关的费用

1、申购费率

本基金A类基金份额收取申购费,C类基金份额不收取申购费。A类基金份额的申购费率按照申购金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低。投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体如下:

基金的申购费率结构表

申购金额(M)	A类基金份额申购费率	C类基金份额申购费率
M<100万	1.00%	0%
100万≤M<200万	0.60%	
200万≤M<500万	0.20%	
M≥500万	1000元/笔	

本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用,不列入基金财产。

2、赎回费率

本基金对基金份额收取赎回费,赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在投资人赎回基金份额时收取。基金份额的赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低。本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。本基金基金份额的赎回费率具体如下:

基金的赎回费率表

持有期限(T)	A类基金份额赎回费率	C类基金份额赎回费率
T<7日	1.50%	1.50%
7日≤T<30日	0.75%	0.50%
30日≤T<90日	0.50%	0.00%
90日≤T<180日	0.50%	
T≥180日	0.00%	

A类基金份额赎回费计入基金财产的比例:对持续持有期少于30的投资人,将赎回费全额计入基金财产;对持续持有期大于等于30日少于90日的投资人,将赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期大于等于90日少于180日的投资人,将赎回费总额的50%计入基金财产。

C类基金份额赎回费计入基金财产比例:对持续持有期少于30日的投资人,将赎回费全额计入基金财产。

前述未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金管理人于2019年3月8日刊登的《中金中证500指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书》进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:

1、在"重要提示"部分更新了相关内容;

2、在"第三部分基金管理人"中,对基金管理人的情况进行了更新;

3、在"第五部分相关服务机构"中,增加了部分销售机构并更新了相关服务机构的内容;

4、在"第九部分基金的投资"中,更新了"基金投资组合报告"内容;

5、更新了"第十部分基金的业绩";

6、在"第十七部分风险揭示"更新了科创板投资的风险揭示;

7、在"第二十部分托管协议的内容摘要"中,更新了相关内容;

8、在"第二十二部分其他应披露事项"中,更新了其他应当披露的事项。

中金基金管理有限公司
2019年8月31日