中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金 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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 2 月 6 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	中金金序量化蓝筹	
基金主代码	005405	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年 2 月 6 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	118,626,525.77 份	
下属分级基金的基金简称:	中金金序量化蓝筹 A	中金金序量化蓝筹 C
下属分级基金的交易代码:	005405	005406
报告期末下属分级基金的份额总额	99,596,280.42 份	19,030,245.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重,精选个股,在充分控制投资风险的前提下,力求实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采用数量化技术对投资策略进行优化,将特定投资思想和理念通过具体指标与参数体现在数量模型中,通过数量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制,充分发挥数量化投资的优势。一方面,在偏好大盘蓝筹的基础上,构建最小化市场波动性的投资组合;另一方面,通过量化选股等策略追求超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 *75%+ 中债综合指数收益率 *25%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期的风险和预期收益高于货币市场基金、债券证券投资基金,低于股票型证券投资基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李虹	田青
	联系电话	010- 63211122	010- 67595096
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400- 868- 1166	010- 67595096
传真		010- 66159121	010- 66275853

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	中金金序量化蓝筹 A	中金金序量化蓝筹 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 2 月 6 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 2 月 6 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	- 1,358,330.33	786,656.02
本期利润	- 7,319,329.36	- 432,056.65
加权平均基金份额本期利润	- 0.0693	- 0.0186
本期基金份额净值增长率	- 7.06%	- 2.84%
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	- 0.0706	- 0.0284
期末基金资产净值	92,567,098.98	18,490,326.88
期末基金份额净值	0.9294	0.9716

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

中金金序量化蓝筹 A

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	- 4.86%	1.02%	- 5.63%	0.96%	0.77%	0.06%
过去三个月	- 5.57%	0.84%	- 7.03%	0.85%	1.46%	- 0.01%
自基金合同生效起至今	- 7.06%	0.78%	- 12.86%	0.92%	5.80%	- 0.14%

中金金序量化蓝筹 C

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	- 4.89%	1.02%	- 5.63%	0.96%	0.74%	0.06%
过去三个月	- 5.71%	0.85%	- 7.03%	0.85%	1.32%	0.00%
自基金合同生效起至今	- 2.84%	0.93%	- 12.86%	0.92%	10.02%	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

注:本基金的基金合同生效日为 2018 年 2 月 6 日,按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期,截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

§ 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏宇	本基金基金经理	2018年 2 月 6 日	-	8年	魏宇先生,香港大学统计专业博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月,在北京摩根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。

1、上述基金经理的任职日期为本基金合同生效日。

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,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》的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,本基金采用量化选股的投资策略,运作正常。模型主要在大中盘股里进行选股,同时精选了多只债券进行配置,仓位上保持和业绩比较基准一致。我们会继续在选股模型和配置模型上进行研究和改进,力争更好的表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金金序量化蓝筹 A 基金份额净值为 0.9294 元,本报告期基金份额净值增长率为 -7.06%;截至本报告期末中金金序量化蓝筹 C 基金份额净值为 0.9716 元,本报告期基金份额净值增长率为 -2.84%;同期业绩比较基准收益率为 -12.86%。

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,发展巩固新兴产业,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共同作用,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 20.14%,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,尽量减小净值的波动。

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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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:中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金

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
资产:		
银行存款	6.4.7.1	1,756,789.41
结算备付金		1,251,510.89
存出保证金		34,821.10
交易性金融资产	6.4.7.2	99,644,094.48
其中:股票投资		82,200,044.48
基金投资		-
债券投资		17,444,050.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	9,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	444,445.90
应收股利		-
应收申购款		1,599.85
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		112,133,261.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年 6 月 30 日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		658,155.68
应付赎回款		-
应付管理人报酬		94,140.71
应付托管费		23,535.17
应付销售服务费		6,278.05
应付交易费用	6.4.7.7	206,685.96
应交税费		1,175.66
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	85,864.54
负债合计		1,075,835.77
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	118,626,525.77
未分配利润	6.4.7.10	- 7,569,099.91
所有者权益合计		111,057,425.86
负债和所有者权益总计		112,133,261.63

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,中金金序量化蓝筹 A 基金份额净值 0.9294 元,基金份额总额 99596280.42 份;中金金序量化蓝筹 C 基金份额净值 0.9716 元,基金份额总额 19030245.35 份。中金金序量化蓝筹份额总额合计为 118626525.77 份。

6.2 利润表

会计主体:中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金

本报告期:2018 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018年 6 月 30 日
一、收入		- 6,435,473.08
1.利息收入		436,391.30
其中:存款利息收入	6.4.7.11	65,127.55
债券利息收入		141,256.78
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		230,006.97
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		- 819,898.90
其中:股票投资收益	6.4.7.12	- 1,738,628.43
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	2,033.81
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	916,695.72
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	- 7,179,711.70
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	1,127,746.22
减:二、费用		1,315,912.93
1、管理人报酬	6.4.10.2.1	499,142.34
2、托管费	6.4.10.2.2	124,785.58
3、销售服务费	6.4.10.2.3	35,400.75
4、交易费用	6.4.7.19	566,343.73
5、利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6、税金及附加		339.83
7、其他费用	6.4.7.20	89,900.70
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		- 7,751,386.01
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		- 7,751,386.01

注:本基金合同生效日为 2018 年 2 月 6 日,无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金

本报告期:2018 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2018年 2 月 6 日(基金合同生效日)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)	203,049,881.65	-	203,049,881.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	- 7,751,386.01	- 7,751,386.01
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)	- 84,423,355.88	182,286.10	- 84,241,069.78
其中:1.基金申购款	1,971,104.64	97,675.31	2,068,779.95
2.基金赎回款	- 86,394,460.52	84,610.79	- 86,309,849.73
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)	118,626,525.77	- 7,569,099.91	111,057,425.86

注:本基金合同生效日为 2018 年 2 月 6 日,无上年度可比期间数据。

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

中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金(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 2017 年 6 月 16 日证监许可[2017]936 号《关于准予中金金序量化蓝筹混合型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、《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金招募说明书》和《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金,托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称"建设银行")。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台及中国银河证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司及包商银行股份有限公司等共同销售,募集期为 2017 年 12 月 5 日起至 2018 年 1 月 30 日。经向中国证监会备案,《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 203,049,881.65 份(含利息转份额 8.28 份以及待下一季度银行结息的 55.87 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。

根据经中国证监会备案的《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金合同》和《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容,本基金根据认购费、申购费、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,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,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认购 / 申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用的,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、《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金合同》和《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券、中期票据等)、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、同业存单以及法律法规或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 6 月 30 日的财务状况、自 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动的情况。

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

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间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《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、基金注册登记机构及基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("建设银行")	基金托管人
中国国际金融股份有限公司("中金公司")	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中投证券有限责任公司("中投证券")	基金管理人股东的一级全资子公司

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中金公司	325,104,723.11	70.19%
中投证券	138,080,317.29	29.81%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中金公司	18,568,601.43	75.52%
中投证券	6,018,379.20	24.48%

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018年 6 月 30 日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中金公司	1,081,000,000.00	75.41%
中投证券	352,500,000.00	24.59%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期无关联方权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金金额	占期末应付佣金总额的比例
中金公司	237,761.78	70.19%	105,716.26	51.15%
中投证券	100,969.70	29.81%	100,969.70	48.85%

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 2 月 6 日(基金合同生效日)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	499,142.34	-
其中,支付销售机构的客户维护费	3,523.96	-

注:1、支付基金管理人中金基金的基金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。计算公式为:日基金管理费 = 前一日基金资产净值× 1.00% / 当年天数。

2、本基金合同生效日为 2018 年 2 月 6 日,无上年度可比期间数据。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年 2 月 6 日(基金合同生效日)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	124,785.58	-

注:1、支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金托管费 = 前一日基金资产净值× 0.25% / 当年天数。

2、本基金合同生效日为 2018 年 2 月 6 日,无上年度可比期间数据。

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 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金金序量化蓝筹 A	中金金序量化蓝筹 C	合计
中金基金	0.00	33,537.92	33,537.92
合计	0.00	33,537.92	33,537.92

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。C 类基金份额每日应计提的销售服务费＝C 类基金份额前一日基金资产净值× 0.40% / 当年天数。

3、本基金合同生效日为 2018 年 2 月 6 日,无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期没有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

项目	本期 2018年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018年 6 月 30 日	
	中金金序量化蓝筹 A	中金金序量化蓝筹 C
基金合同生效日(2018 年 2 月 6 日)持有的基金份额	14,000,000.00	-
期初持有的基金份额	14,000,000.00	-
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	14,000,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.0567%	-

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。

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

除基金管理人之外的其他关联方于本期末未持有本基金。

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 2 月 6 日(基金合同生效日)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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,756,789.41	51,315.71	-	-

注:本基金通过"中国建设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 1,286,331.99 元,当期产生的利息收入为人民币 15,513.63 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

金额单位:人民币元

本期 2018年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2018年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
中金公司	601138	工业富联	网上发行	2,000	27,540.00

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
002310	东方园林	2018年 5 月 25 日	重大事项	15.03	2018年 8 月 27 日	13.47	37,370	702,462.83	561,671.10	-
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	73,120	543,127.06	546,206.40	-
002450	康得新	2018年 6 月 4 日	重大事项	17.08	-	-	23,200	478,001.35	396,256.00	-
000669	金鸿能源	2018年 6 月 13 日	重大事项	7.25	2018年 8 月 6 日	6.53	42,840	334,121.27	310,590.00	-
000008	神州高铁	2018年 6 月 8 日	重大事项	4.96	2018年 8 月 7 日	4.46	42,802	243,533.11	212,297.92	-
002051	中工国际	2018年 6 月 14 日	重大事项	15.27	-	-	12,300	196,371.57	187,821.00	-
002426	胜利精密	2018年 6 月 19 日	重大事项	3.60	2018年 7 月 3 日	3.26	38,700	151,627.00	139,320.00	-
002602	世纪华通	2018年 6 月 12 日	重大事项	32.50	-	-	3,900	134,093.43	126,750.00	-
000723	美锦能源	2018年 3 月 27 日	重大事项	5.43	2018年 7 月 31 日	4.89	20,200	122,385.00	109,686.00	-
600750	江中药业	2018年 6 月 21 日	重大事项	17.75	2018年 8 月 1 日	16.12	4,760	82,670.26	84,490.00	-
300324	旋极信息	2018年 5 月 30 日	重大事项	9.49	-	-	6,619	68,438.00	62,814.31	-
000825	太钢不锈	2018年 4 月 16 日	重大事项	6.00	-	-	10,000	56,133.46	60,000.00	-
600022	山东钢铁	2018年 3 月 27 日	重大事项	2.02