

中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF) 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告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 2019 年 8 月 23 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、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
7.6 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.....	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	56
7.8 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贵金属投资明细.....	56
7.9 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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	金选 300	
场内简称	金选 300	
基金主代码	501060	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2018 年 8 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	
报告期末基金份额总额	145,116,448.37 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
下属分级基金的基金简称:	金选 300A	金选 300C
下属分级基金的交易代码:	501060	501061
报告期末下属分级基金的份额总额	124,303,046.08 份	20,813,402.29 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证中金优选 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型证券投资基金和混合型证券投资基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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
	联系电话	010-63211122
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com
客户服务电话	400-868-1166	010-67595096
传真	010-66159121	010-66275853
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26	北京市西城区金融大街 25 号

	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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100004	100033
法定代表人	楚钢	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	金选 300A	金选 300C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	11,535,416.36	3,196,380.44
本期利润	21,917,278.69	7,490,764.05
加权平均基金份额本期利润	0.2497	0.2803
本期加权平均净值利润率	22.73%	25.96%
本期基金份额净值增长率	26.16%	25.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	15,645,368.30	2,520,219.50
期末可供分配基金份额利润	0.1259	0.1211
期末基金资产净值	146,374,250.05	24,411,231.30
期末基金份额净值	1.1776	1.1729
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	17.76%	17.29%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、本报告所列示的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；

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数；

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

金选 300A

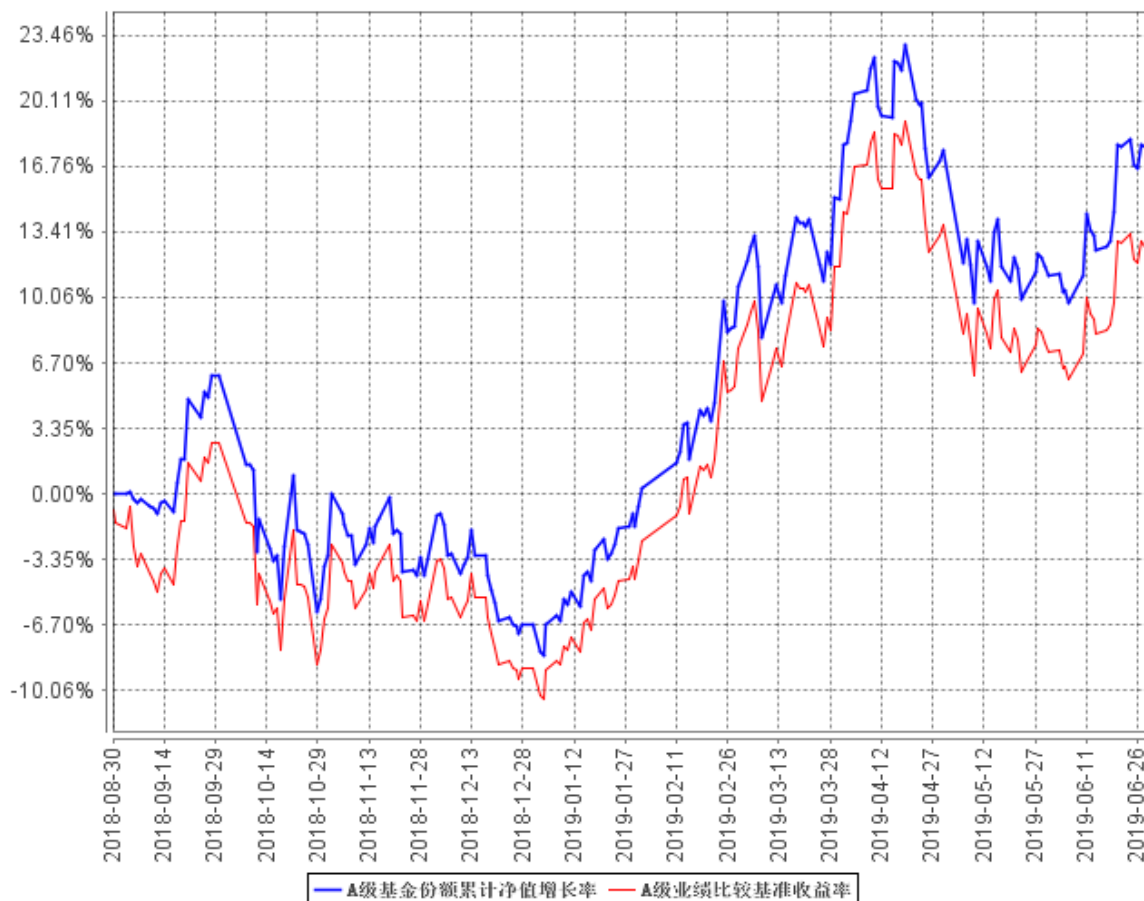
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.91%	1.10%	5.04%	1.08%	0.87%	0.02%
过去三个月	2.28%	1.37%	0.96%	1.38%	1.32%	-0.01%
过去六个月	26.16%	1.35%	23.74%	1.35%	2.42%	0.00%
自基金合同生效起至今	17.76%	1.37%	12.71%	1.39%	5.05%	-0.02%

金选 300C

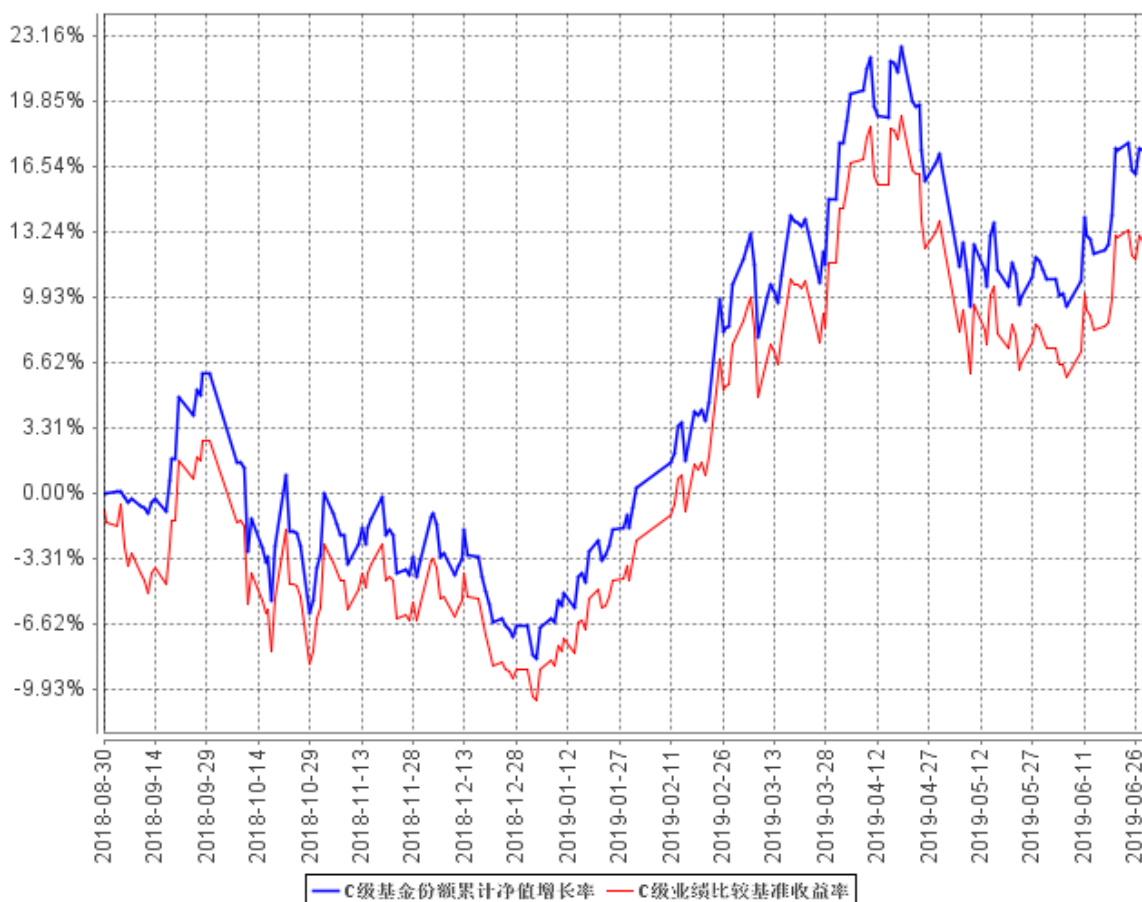
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.89%	1.10%	5.04%	1.08%	0.85%	0.02%
过去三个月	2.08%	1.37%	0.96%	1.38%	1.12%	-0.01%
过去六个月	25.77%	1.35%	23.74%	1.35%	2.03%	0.00%
自基金合同生效起至今	17.29%	1.37%	12.71%	1.39%	4.58%	-0.02%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金的基金合同生效日为 2018 年 8 月 30 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，建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§ 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 3.5 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，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2019 年 6 月 30 日，公司共管理 27 只开放式基金，证券投资基金管理规模 166.33 亿元。

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 8 月 30 日	-	9 年	魏宇先生，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。

注：1、上述基金经理任职日期为本基金基金合同生效日。

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

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本基金合同的约定，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 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》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。

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

本基金自 2018 年 8 月 30 日成立以来，截止 2018 年 9 月 21 日，顺利完成建仓。后续股票保持 95%左右的仓位，采用完全复制中证中金优选 300 指数的策略，余下资金买入一年内到期国债。我们将继续采用完全复制中证中金优选 300 指数的策略，力争更小的跟踪误差。

2018 年，A 股市场呈现震荡下跌的走势。2019 年一季度，A 股市场有较大幅度的反弹，这轮快速上涨，除了 2018 年的下跌已经使多个指数的估值处于历史低位以外，主要是由于造成去年悲观情绪的主要因素“贸易战”和“去杠杆”，在春节前后其预期都得到了较大的改善。2019 年第二季度，4 月上旬市场继续上涨，但之后一直震荡下跌，直到 6 月上旬、6 月中下旬是一波反弹。这期间影响市场的主要因素之一还是中美贸易摩擦的形势不断变化。从年初的乐观预期，到 5 月的直转急下，特朗普宣称对谈判进度及内容不满，要提高 2000 亿美元关税税率至 25%，并采取了包括将华为等中国企业列入出口管制“实体清单”等一系列措施。6 月，国家主席习近平 18 日应约同美国总统特朗普通电话，双方同意在 G20 大阪峰会期间进行会晤；G20 中美两国元首会晤后，同意重启经贸磋商，美方表示不再对中国出口产品加征新的关税，且特朗普表示将允许美国公司向华为出口设备，会谈结果好于预期。近期，中美贸易摩擦阴云再起，市场震荡下行。国内经济

方面，从逐渐披露的中报业绩来看，预计 2019 年上半年 A 股上市公司盈利增速将有所放缓，科创板首批公司中报业绩增速相较去年年底有所放缓，创业板业绩同比增速相比一季度有所回升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末金选 300A 基金份额净值为 1.1776 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.16%；截至本报告期末金选 300C 基金份额净值为 1.1729 元，本报告期基金份额净值增长率为 25.77%；同期业绩比较基准收益率为 23.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，国际环境以及国内经济增长的不确定性较强，需要密切关注：中美经贸关系变化，尤其是关税提升的实际影响；上半年增长疲弱的影响，企业资本开支情况；减税降费的效果；中小银行去杠杆对金融机构的影响。预计下半年市场整体不会强势，相对来说比较看好：业绩超预期的个股；估值低、有积极催化剂或政策预期的板块，如农业、汽车等；消费与产业升级的优质龙头，消费、医药、科技等。

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验。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 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关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：中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	818,112.29	598,233.82
结算备付金		896,882.27	1,044,456.92
存出保证金		63,605.83	115,688.36
交易性金融资产	6.4.7.2	171,516,058.42	115,867,446.07
其中：股票投资		162,390,065.02	109,458,606.07
基金投资		-	-
债券投资		9,125,993.40	6,408,840.00
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	-	-
应收证券清算款		190,659.80	72,408.21
应收利息	6.4.7.5	173,141.85	78,734.14
应收股利		-	-
应收申购款		810,709.88	183,472.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		174,469,170.34	117,960,439.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 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		2,400,000.00	1,800,000.00
应付证券清算款		458,486.58	63,834.47
应付赎回款		456,039.07	97,138.03
应付管理人报酬		58,486.79	46,918.25
应付托管费		17,546.08	14,075.46
应付销售服务费		4,949.66	7,271.92
应付交易费用	6.4.7.7	153,263.17	221,598.80

应交税费		0.03	-
应付利息		-	-435.12
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	134,917.61	200,005.20
负债合计		3,683,688.99	2,450,407.01
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	145,116,448.37	123,781,510.11
未分配利润	6.4.7.10	25,669,032.98	-8,271,477.54
所有者权益合计		170,785,481.35	115,510,032.57
负债和所有者权益总计		174,469,170.34	117,960,439.58

报告截止日 2019 年 6 月 30 日，金选 300A 基金份额净值 1.1776 元，基金份额总额 124303046.08 份；金选 300C 基金份额净值 1.1729 元，基金份额总额 20813402.29 份。金选 300 份额总额合计为 145116448.37 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		30,459,823.32
1.利息收入		117,900.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,757.57
债券利息收入		103,043.31
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		99.86
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,470,605.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,588,605.17
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	27,636.79
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	1,854,363.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,676,245.94
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	195,071.00

减：二、费用		1,051,780.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	309,811.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	92,943.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	35,931.96
4. 交易费用	6.4.7.19	435,646.38
5. 利息支出		35,932.58
其中：卖出回购金融资产支出		35,932.58
6. 税金及附加		0.24
7. 其他费用	6.4.7.20	141,514.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,408,042.74
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,408,042.74

注：本基金合同生效日为 2018 年 08 月 30 日，无上年度可比区间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	123,781,510.11	-8,271,477.54	115,510,032.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,408,042.74	29,408,042.74
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）	21,334,938.26	4,532,467.78	25,867,406.04
其中：1. 基金申购款	182,385,574.89	24,433,775.15	206,819,350.04
2. 基金赎回款	-161,050,636.63	-19,901,307.37	-180,951,944.00
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	145,116,448.37	25,669,032.98	170,785,481.35

(基金净值)			
--------	--	--	--

注：本基金合同生效日为 2018 年 08 月 30 日，无上年度可比区间。

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

中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) (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 2018 年 4 月 17 日证监许可 [2018] 722 号《关于准予中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 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、《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》和《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 份额发售公告》公开募集。本基金为契约型上市开放式基金, 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、中国中投证券有限责任公司 (以下简称“中投证券”)、中国国际金融股份有限公司 (以下简称“中金公司”)、中国银河证券股份有限公司及招商证券股份有限公司等共同销售, 募集期为 2018 年 7 月 23 日起至 2018 年 8 月 23 日。经向中国证监会备案, 《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2018 年 8 月 30 日正式生效, 基金合同生效日基金实收份额为 274, 597, 597.22 份 (含于 2018 年 9 月 21 日银行结息转份额 63, 842.40 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《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》和《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 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, 但从本类别基金资产中不计提销售服务费的, 称为 A 类基金份额; 不收取认购 / 申购费用, 但从本类别基金资产中计提销售服务费的, 称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同, 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并分别公告, 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、《中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》和《中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为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、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、股票期权、同业存单、银行存款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 2019 年 06 月 30 日的财务状况、2019 上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，本报告期覆盖期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

(2) 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

(3) 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- (2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- (3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- (1) 所转移金融资产的账面价值
- (2) 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- （1）本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- （2）本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基

金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 / (累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告 [2017] 13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发 [2017] 6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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：

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(2)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”）运营资管产品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。对资管产品在2018年1月1日以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、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免

征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(3) 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。

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

(5) 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。

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	818,112.29
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	818,112.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	152,712,200.66	162,390,065.02	9,677,864.36

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,127,141.44	9,125,993.40
	银行间市场	-	-
	合计	9,127,141.44	9,125,993.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	161,839,342.10	171,516,058.42	9,676,716.32

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,475.02
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	403.60
应收债券利息	171,234.63
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	28.60
合计	173,141.85

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	153,263.17
银行间市场应付交易费用	-
合计	153,263.17

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	205.43
预提费用	34,712.18
指数使用费	100,000.00
合计	134,917.61

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

金选 300A		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	88,128,604.83	88,128,604.83
本期申购	169,758,028.79	169,758,028.79
本期赎回(以“-”号填列)	-133,583,587.54	-133,583,587.54
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	124,303,046.08	124,303,046.08

金额单位：人民币元

金选 300C		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,652,905.28	35,652,905.28
本期申购	12,627,546.10	12,627,546.10

本期赎回(以“-”号填列)	-27,467,049.09	-27,467,049.09
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	20,813,402.29	20,813,402.29

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

金选 300A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,017,852.73	-4,852,362.52	-5,870,215.25
本期利润	11,535,416.36	10,381,862.33	21,917,278.69
本期基金份额交易产生的变动数	5,127,804.67	896,335.86	6,024,140.53
其中：基金申购款	12,082,501.92	10,747,538.87	22,830,040.79
基金赎回款	-6,954,697.25	-9,851,203.01	-16,805,900.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,645,368.30	6,425,835.67	22,071,203.97

单位：人民币元

金选 300C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-439,413.23	-1,961,849.06	-2,401,262.29
本期利润	3,196,380.44	4,294,383.61	7,490,764.05
本期基金份额交易产生的变动数	-236,747.71	-1,254,925.04	-1,491,672.75
其中：基金申购款	346,595.99	1,257,138.37	1,603,734.36
基金赎回款	-583,343.70	-2,512,063.41	-3,095,407.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,520,219.50	1,077,609.51	3,597,829.01

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	9,126.22
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,756.29
其他	875.06
合计	14,757.57

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	157,832,910.56
减：卖出股票成本总额	144,244,305.39
买卖股票差价收入	13,588,605.17

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	27,636.79
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	27,636.79

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,739,395.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,632,687.36
减：应收利息总额	79,071.67
买卖债券差价收入	27,636.79

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期末未持有贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,854,363.68
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,854,363.68

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	14,676,245.94
——股票投资	14,681,295.18
——债券投资	-5,049.24
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	14,676,245.94

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	195,071.00
其他	-
合计	195,071.00

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	435,646.38
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	435,646.38

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	14,876.39
其他	400.00
指数使用费	100,000.00
汇划手续费	6,402.32
合计	141,514.50

6.4.7.21 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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	基金管理人、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、基金销售机构
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、基金销售机构

注：1、本基金本报告期关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	338,753,710.44	100.00%

注：本基金合同生效日为2018年8月30日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	6,692,282.72	100.00%

注：本基金合同生效日为2018年8月30日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	343,600,000.00	100.00%

注：本基金合同生效日为2018年8月30日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中金公司	247,732.47	100.00%	153,263.17	100.00%

注：本基金合同生效日为2018年8月30日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	309,811.42
其中：支付销售机构的客户维护费	91,947.15

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0.50%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 × 0.50% / 当年天数

2、本基金合同生效日为 2018 年 8 月 30 日，无上年度可比期间数据。

3、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，本基金本报告期支付销售服务机构的客户维护费为 91,947.15 元，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	92,943.50

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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数

2、本基金合同生效日为 2018 年 8 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 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		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金选 300A	金选 300C	合计
中金基金	-	1.81	1.81
中金公司	-	16,562.96	16,562.96
中投证券	-	8,756.48	8,756.48
合计	-	25,321.25	25,321.25

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 0.25% 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，按月支付。其计算公式为：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×0.25% / 当年天数。

3、本基金合同生效日为 2018 年 8 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

金选 300A				
关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中金公司	5,337,477.00	4.2939%	11,907,408.00	13.5114%

份额单位：份

金选 300C				
关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中金公司	10,677,670.00	51.3019%	7,272,628.00	20.3984%

6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	818,112.29	9,126.22

- 1、本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。
- 2、本基金通过“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2019年06月30日的相关余额为人民币960,488.1元，本期间产生的利息收入为人民币5,631.35元。

3、本基金合同生效日为 2018 年 8 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项说明

序号	基金名称	关联方	关联方代码	总买入量	总卖出量
1.	中金中证优选 300 指数证券投资基金	中国建设银行股份有限公司	601939	131,100	140,100

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 140,900 股建设银行 A 股普通股，占基金资产净值比例为 0.61%。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113028	环境转债	2019 年 6 月 20 日	2019 年 7 月	新债未上市	100.00	100.00	370.00	37,000.00	37,000.00	-

		日	08 日						
--	--	---	------	--	--	--	--	--	--

注：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股票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。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,400,000.00 元，于 2019 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债和/或在新质押式回购下转入库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票指数型基金，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，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形

成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	37,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	37,000.00	-

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风

险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，针对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性风险预警及危机的处理、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性风险指标进行监控。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	818,112.29	-	-	-	818,112.29
结算备付金	896,882.27	-	-	-	896,882.27
存出保证金	63,605.83	-	-	-	63,605.83
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-162,390,065.02	162,390,065.02
交易性金融资产-债券投资	9,088,993.40	-	37,000.00	-	9,125,993.40
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	190,659.80	190,659.80
应收利息	-	-	-	173,141.85	173,141.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	810,709.88	810,709.88
资产总计	10,867,593.79	-	37,000.00	163,564,576.55	174,469,170.34
负债					
卖出回购金融资产款	2,400,000.00	-	-	-	2,400,000.00
应付证券清算款	-	-	-	458,486.58	458,486.58
应付赎回款	-	-	-	456,039.07	456,039.07
应付管理人报酬	-	-	-	58,486.79	58,486.79
应付托管费	-	-	-	17,546.08	17,546.08
应付交易费用	-	-	-	153,263.17	153,263.17
应付销售服务费	-	-	-	4,949.66	4,949.66
应交税费	-	-	-	0.03	0.03
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	134,917.61	134,917.61
负债总计	2,400,000.00	-	-	1,283,688.99	3,683,688.99
利率敏感度缺口	8,467,593.79	-	37,000.00	162,280,887.56	170,785,481.35
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	598,233.82	-	-	-	598,233.82
结算备付金	1,044,456.92	-	-	-	1,044,456.92
存出保证金	115,688.36	-	-	-	115,688.36
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-109,458,606.07	109,458,606.07
交易性金融资产-债券投资	6,408,840.00	-	-	-	6,408,840.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	72,408.21	72,408.21
应收利息	-	-	-	78,734.14	78,734.14
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	183,472.06	183,472.06
资产总计	8,167,219.10	-	-	-109,793,220.48	117,960,439.58

负债					
卖出回购金融资产款	1,800,000.00	-	-	-	1,800,000.00
应付证券清算款	-	-	-	63,834.47	63,834.47
应付赎回款	-	-	-	97,138.03	97,138.03
应付管理人报酬	-	-	-	46,918.25	46,918.25
应付托管费	-	-	-	14,075.46	14,075.46
应付交易费用	-	-	-	221,598.80	221,598.80
应付销售服务费	-	-	-	7,271.92	7,271.92
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-435.12	-435.12
其他负债	-	-	-	200,005.20	200,005.20
负债总计	1,800,000.00	-	-	650,407.01	2,450,407.01
利率敏感度缺口	6,367,219.10	-	-	-109,142,813.47	115,510,032.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	7,543.11	9,510.86
市场利率上升 25 个基点	-7,543.11	-9,510.86	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体

自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	162,390,065.02	95.08	109,458,606.07	94.76
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	9,125,993.40	5.34	6,408,840.00	5.55
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	171,516,058.42	100.43	115,867,446.07	100.31

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	162,390,065.02	93.08
	其中：股票	162,390,065.02	93.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,125,993.40	5.23
	其中：债券	9,125,993.40	5.23
	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	1,714,994.56	0.98
8	其他各项资产	1,238,117.36	0.71
9	合计	174,469,170.34	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	160,950.00	0.09
B	采矿业	3,470,619.00	2.03
C	制造业	58,671,621.47	34.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,610,812.30	3.29
E	建筑业	7,346,145.64	4.30
F	批发和零售业	4,167,404.78	2.44
G	交通运输、仓储和邮政业	4,159,596.00	2.44
H	住宿和餐饮业	148,263.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,309,313.90	0.77
J	金融业	63,575,992.24	37.23
K	房地产业	10,569,677.95	6.19

L	租赁和商务服务业	2,148,442.00	1.26
M	科学研究和技术服务业	44,505.00	0.03
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	76,400.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	754,494.72	0.44
S	综合	-	-
	合计	162,214,238.00	94.98

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	79,246.72	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.02
J	金融业	33,869.94	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	175,827.02	0.10

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	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	600519	贵州茅台	8,701	8,561,784.00	5.01
2	601318	中国平安	95,500	8,462,255.00	4.95
3	600036	招商银行	217,404	7,822,195.92	4.58
4	601166	兴业银行	304,200	5,563,818.00	3.26
5	000651	格力电器	100,900	5,549,500.00	3.25
6	000333	美的集团	97,458	5,054,171.88	2.96
7	000858	五粮液	40,800	4,812,360.00	2.82
8	600887	伊利股份	127,979	4,275,778.39	2.50
9	600030	中信证券	165,300	3,935,793.00	2.30
10	601328	交通银行	575,400	3,521,448.00	2.06
11	600016	民生银行	519,700	3,300,095.00	1.93
12	601288	农业银行	802,300	2,888,280.00	1.69
13	600000	浦发银行	245,310	2,865,220.80	1.68
14	000002	万科 A	102,097	2,839,317.57	1.66
15	601398	工商银行	453,100	2,668,759.00	1.56
16	601668	中国建筑	438,700	2,522,525.00	1.48
17	600900	长江电力	138,467	2,478,559.30	1.45
18	600837	海通证券	169,700	2,408,043.00	1.41
19	601601	中国太保	65,700	2,398,707.00	1.40
20	600048	保利地产	149,500	1,907,620.00	1.12
21	600104	上汽集团	73,200	1,866,600.00	1.09
22	601169	北京银行	309,500	1,829,145.00	1.07
23	601888	中国国旅	20,400	1,808,460.00	1.06
24	600585	海螺水泥	41,900	1,738,850.00	1.02
25	601211	国泰君安	94,300	1,730,405.00	1.01
26	601688	华泰证券	76,361	1,704,377.52	1.00
27	600009	上海机场	20,200	1,692,356.00	0.99
28	601988	中国银行	442,300	1,654,202.00	0.97
29	601766	中国中车	203,700	1,647,933.00	0.96

30	002304	洋河股份	12,706	1,544,541.36	0.90
31	600028	中国石化	279,700	1,529,959.00	0.90
32	601088	中国神华	69,300	1,412,334.00	0.83
33	600690	海尔智家	76,800	1,327,872.00	0.78
34	002142	宁波银行	54,700	1,325,928.00	0.78
35	601818	光大银行	332,400	1,266,444.00	0.74
36	000568	泸州老窖	15,500	1,252,865.00	0.73
37	600340	华夏幸福	37,900	1,234,403.00	0.72
38	000338	潍柴动力	100,300	1,232,687.00	0.72
39	601939	建设银行	140,900	1,048,296.00	0.61
40	600999	招商证券	60,300	1,030,527.00	0.60
41	601390	中国中铁	156,300	1,019,076.00	0.60
42	601006	大秦铁路	124,900	1,010,441.00	0.59
43	600015	华夏银行	128,800	991,760.00	0.58
44	601628	中国人寿	35,000	991,200.00	0.58
45	601186	中国铁建	96,700	962,165.00	0.56
46	601336	新华保险	17,400	957,522.00	0.56
47	000166	申万宏源	189,100	947,391.00	0.55
48	600352	浙江龙盛	55,000	867,350.00	0.51
49	000776	广发证券	62,100	853,254.00	0.50
50	601933	永辉超市	80,800	824,968.00	0.48
51	000876	新希望	44,700	776,439.00	0.45
52	000100	TCL 集团	227,400	757,242.00	0.44
53	002736	国信证券	52,000	684,320.00	0.40
54	600660	福耀玻璃	29,300	665,989.00	0.39
55	600383	金地集团	47,500	566,675.00	0.33
56	601800	中国交建	49,200	556,944.00	0.33
57	600886	国投电力	71,500	555,555.00	0.33
58	601985	中国核电	97,700	543,212.00	0.32
59	600271	航天信息	23,500	541,675.00	0.32
60	000895	双汇发展	20,800	517,712.00	0.30
61	600332	白云山	11,800	483,446.00	0.28
62	000963	华东医药	18,300	475,068.00	0.28
63	600177	雅戈尔	73,660	467,741.00	0.27
64	600018	上港集团	68,200	465,124.00	0.27
65	600637	东方明珠	43,485	458,331.90	0.27
66	601618	中国中冶	149,900	455,696.00	0.27
67	601607	上海医药	24,200	439,230.00	0.26
68	601998	中信银行	64,200	383,274.00	0.22

69	600809	山西汾酒	5,500	379,775.00	0.22
70	600023	浙能电力	85,400	377,468.00	0.22
71	600600	青岛啤酒	7,400	369,482.00	0.22
72	600066	宇通客车	28,000	364,560.00	0.21
73	600068	葛洲坝	58,100	361,963.00	0.21
74	300146	汤臣倍健	18,500	358,900.00	0.21
75	600170	上海建工	93,200	350,432.00	0.21
76	600642	申能股份	57,400	344,974.00	0.20
77	600398	海澜之家	37,900	343,753.00	0.20
78	002146	荣盛发展	36,600	343,674.00	0.20
79	601198	东兴证券	28,900	343,332.00	0.20
80	000540	中天金融	88,600	339,338.00	0.20
81	000623	吉林敖东	19,600	321,244.00	0.19
82	000975	银泰资源	24,200	319,198.00	0.19
83	600535	天士力	19,200	317,760.00	0.19
84	603369	今世缘	10,500	292,845.00	0.17
85	600663	陆家嘴	18,320	283,960.00	0.17
86	000656	金科股份	44,700	269,541.00	0.16
87	601992	金隅集团	69,600	261,696.00	0.15
88	600635	大众公用	40,500	260,010.00	0.15
89	601117	中国化学	41,500	249,830.00	0.15
90	600820	隧道股份	39,404	248,639.24	0.15
91	600376	首开股份	27,186	242,770.98	0.14
92	603858	步长制药	9,300	239,661.00	0.14
93	000999	华润三九	8,100	237,654.00	0.14
94	600236	桂冠电力	38,100	230,886.00	0.14
95	600755	厦门国贸	26,600	229,558.00	0.13
96	601799	星宇股份	2,900	228,984.00	0.13
97	002372	伟星新材	13,140	228,636.00	0.13
98	002191	劲嘉股份	18,400	228,344.00	0.13
99	600315	上海家化	7,000	218,050.00	0.13
100	600873	梅花生物	45,500	217,945.00	0.13
101	600094	大名城	33,600	211,344.00	0.12
102	600037	歌华有线	20,500	210,125.00	0.12
103	600273	嘉化能源	18,000	208,080.00	0.12
104	600566	济川药业	6,900	207,759.00	0.12
105	000402	金融街	25,200	197,568.00	0.12
106	600704	物产中大	36,300	196,746.00	0.12
107	000513	丽珠集团	5,900	196,057.00	0.11

108	600143	金发科技	39,700	194,530.00	0.11
109	600064	南京高科	18,140	194,279.40	0.11
110	600266	北京城建	23,680	190,860.80	0.11
111	601098	中南传媒	15,000	189,600.00	0.11
112	002563	森马服饰	17,100	189,126.00	0.11
113	603444	吉比特	900	188,964.00	0.11
114	600021	上海电力	21,700	188,356.00	0.11
115	002690	美亚光电	5,700	185,820.00	0.11
116	000046	泛海控股	32,500	181,350.00	0.11
117	600373	中文传媒	14,400	180,864.00	0.11
118	002595	豪迈科技	8,400	176,484.00	0.10
119	002233	塔牌集团	15,000	175,200.00	0.10
120	002152	广电运通	25,500	174,675.00	0.10
121	600252	中恒集团	58,800	172,284.00	0.10
122	000732	泰禾集团	10,400	171,600.00	0.10
123	601000	唐山港	62,000	170,500.00	0.10
124	601966	玲珑轮胎	9,900	168,300.00	0.10
125	600008	首创股份	47,500	167,200.00	0.10
126	600827	百联股份	16,900	165,789.00	0.10
127	600648	外高桥	7,900	165,742.00	0.10
128	600039	四川路桥	45,500	165,620.00	0.10
129	002004	华邦健康	33,200	161,352.00	0.09
130	600598	北大荒	15,000	160,950.00	0.09
131	000685	中山公用	18,600	158,844.00	0.09
132	300418	昆仑万维	12,200	157,014.00	0.09
133	300058	蓝色光标	36,200	154,574.00	0.09
134	600633	浙数文化	16,500	154,275.00	0.09
135	000415	渤海租赁	38,800	152,096.00	0.09
136	600120	浙江东方	11,850	150,969.00	0.09
137	600507	方大特钢	15,300	149,634.00	0.09
138	000902	新洋丰	13,700	147,001.00	0.09
139	002020	京新药业	12,200	140,544.00	0.08
140	002812	恩捷股份	3,000	140,250.00	0.08
141	002701	奥瑞金	29,800	139,166.00	0.08
142	600597	光明乳业	12,800	137,600.00	0.08
143	600580	卧龙电驱	16,300	137,083.00	0.08
144	002449	国星光电	10,300	136,784.00	0.08
145	000090	天健集团	27,260	134,664.40	0.08
146	002244	滨江集团	32,400	134,460.00	0.08

147	002727	一心堂	4,700	133,903.00	0.08
148	002557	洽洽食品	5,300	133,825.00	0.08
149	002242	九阳股份	6,400	133,184.00	0.08
150	002419	天虹股份	10,100	131,906.00	0.08
151	000650	仁和药业	18,200	131,222.00	0.08
152	000156	华数传媒	11,900	131,019.00	0.08
153	600422	昆药集团	11,300	130,289.00	0.08
154	600312	平高电气	16,935	130,230.15	0.08
155	601928	凤凰传媒	16,096	129,894.72	0.08
156	002128	露天煤业	15,000	129,750.00	0.08
157	600284	浦东建设	16,400	126,280.00	0.07
158	600754	锦江股份	5,100	125,664.00	0.07
159	600185	格力地产	25,800	125,646.00	0.07
160	300068	南都电源	11,100	125,430.00	0.07
161	601588	北辰实业	33,400	125,250.00	0.07
162	603368	柳药股份	3,800	124,944.00	0.07
163	603816	顾家家居	3,840	122,572.80	0.07
164	300115	长盈精密	11,600	121,684.00	0.07
165	000739	普洛药业	12,300	120,909.00	0.07
166	000921	海信家电	9,500	118,560.00	0.07
167	002436	兴森科技	18,100	118,555.00	0.07
168	601058	赛轮轮胎	39,600	117,612.00	0.07
169	603866	桃李面包	2,800	116,620.00	0.07
170	600563	法拉电子	2,830	116,511.10	0.07
171	600612	老凤祥	2,600	116,220.00	0.07
172	603658	安图生物	1,700	116,212.00	0.07
173	600565	迪马股份	31,000	115,630.00	0.07
174	603708	家家悦	5,060	115,469.20	0.07
175	002643	万润股份	11,400	115,140.00	0.07
176	002444	巨星科技	11,400	113,772.00	0.07
177	600317	营口港	41,000	113,160.00	0.07
178	600993	马应龙	6,400	112,960.00	0.07
179	600377	宁沪高速	10,500	112,770.00	0.07
180	000926	福星股份	16,100	111,412.00	0.07
181	002028	思源电气	11,100	110,556.00	0.06
182	600337	美克家居	26,100	107,532.00	0.06
183	600269	赣粤高速	24,200	107,448.00	0.06
184	600611	大众交通	23,000	106,950.00	0.06
185	600197	伊力特	5,500	106,150.00	0.06

186	600761	安徽合力	10,900	104,640.00	0.06
187	000672	上峰水泥	8,500	104,295.00	0.06
188	600517	置信电气	14,200	103,944.00	0.06
189	000900	现代投资	22,200	103,452.00	0.06
190	000848	承德露露	12,300	102,459.00	0.06
191	600020	中原高速	18,800	98,700.00	0.06
192	600577	精达股份	32,400	98,172.00	0.06
193	002635	安洁科技	7,200	97,128.00	0.06
194	601311	骆驼股份	8,800	95,480.00	0.06
195	601010	文峰股份	27,300	93,912.00	0.05
196	002737	葵花药业	6,100	93,879.00	0.05
197	600668	尖峰集团	7,200	92,160.00	0.05
198	001696	宗申动力	14,600	90,958.00	0.05
199	000726	鲁泰A	9,500	90,820.00	0.05
200	603026	石大胜华	3,000	90,780.00	0.05
201	000951	中国重汽	5,600	89,880.00	0.05
202	603766	隆鑫通用	21,400	89,666.00	0.05
203	603198	迎驾贡酒	5,000	89,550.00	0.05
204	000777	中核科技	6,400	88,000.00	0.05
205	603888	新华网	4,400	87,824.00	0.05
206	600162	香江控股	35,600	86,864.00	0.05
207	600694	大商股份	3,100	86,521.00	0.05
208	002117	东港股份	8,200	85,690.00	0.05
209	600750	江中药业	6,500	84,565.00	0.05
210	601567	三星医疗	14,400	83,520.00	0.05
211	002498	汉缆股份	28,000	82,880.00	0.05
212	600285	羚锐制药	9,800	82,614.00	0.05
213	000903	云内动力	28,900	81,787.00	0.05
214	603806	福斯特	2,200	80,806.00	0.05
215	000603	盛达矿业	7,100	79,378.00	0.05
216	000810	创维数字	8,900	78,676.00	0.05
217	002705	新宝股份	6,800	78,200.00	0.05
218	002698	博实股份	8,550	77,292.00	0.05
219	002318	久立特材	10,500	76,755.00	0.04
220	603377	东方时尚	5,000	76,400.00	0.04
221	002003	伟星股份	11,200	75,712.00	0.04
222	002083	孚日股份	13,400	75,710.00	0.04
223	600987	航民股份	11,365	75,122.65	0.04
224	002206	海利得	18,100	74,753.00	0.04

225	000957	中通客车	9,900	74,250.00	0.04
226	600657	信达地产	18,000	74,160.00	0.04
227	002228	合兴包装	14,700	73,941.00	0.04
228	002367	康力电梯	10,000	73,800.00	0.04
229	600626	申达股份	10,600	72,504.00	0.04
230	000811	冰轮环境	8,100	71,523.00	0.04
231	300303	聚飞光电	21,400	70,834.00	0.04
232	600894	广日股份	9,030	70,704.90	0.04
233	601116	三江购物	4,600	70,104.00	0.04
234	002677	浙江美大	5,300	69,748.00	0.04
235	601886	江河集团	9,700	68,967.00	0.04
236	600681	百川能源	9,200	68,448.00	0.04
237	300034	钢研高纳	4,600	68,264.00	0.04
238	002043	兔宝宝	11,300	68,252.00	0.04
239	601158	重庆水务	12,100	67,760.00	0.04
240	600350	山东高速	14,100	67,680.00	0.04
241	603188	ST 亚邦	8,500	66,725.00	0.04
242	600261	阳光照明	18,100	66,427.00	0.04
243	603328	依顿电子	6,400	65,728.00	0.04
244	000601	韶能股份	13,700	65,623.00	0.04
245	600479	千金药业	7,000	65,240.00	0.04
246	601515	东风股份	8,420	65,086.60	0.04
247	600481	双良节能	17,300	64,010.00	0.04
248	603989	艾华集团	3,300	62,304.00	0.04
249	002029	七匹狼	9,500	61,370.00	0.04
250	600007	中国国贸	4,200	61,278.00	0.04
251	601965	中国汽研	8,200	60,926.00	0.04
252	002478	常宝股份	10,000	60,500.00	0.04
253	000417	合肥百货	11,400	59,166.00	0.03
254	603699	纽威股份	4,700	56,400.00	0.03
255	600548	深高速	6,000	56,340.00	0.03
256	000906	浙商中拓	8,700	56,028.00	0.03
257	601107	四川成渝	13,500	54,675.00	0.03
258	603393	新天然气	2,320	54,288.00	0.03
259	600278	东方创业	4,400	52,976.00	0.03
260	603869	新智认知	2,900	52,780.00	0.03
261	002335	科华恒盛	2,900	51,185.00	0.03
262	601789	宁波建工	12,300	50,922.00	0.03
263	600743	华远地产	19,900	49,949.00	0.03

264	000531	穗恒运 A	7,100	49,629.00	0.03
265	600826	兰生股份	4,400	49,192.00	0.03
266	002543	万和电气	3,600	48,312.00	0.03
267	600723	首商股份	7,000	48,020.00	0.03
268	300425	环能科技	8,395	46,088.55	0.03
269	601566	九牧王	3,700	45,584.00	0.03
270	002756	永兴特钢	3,100	45,260.00	0.03
271	002441	众业达	5,700	45,258.00	0.03
272	002062	宏润建设	11,700	45,162.00	0.03
273	002616	长青集团	6,200	44,950.00	0.03
274	000719	中原传媒	6,300	44,730.00	0.03
275	000530	大冷股份	10,300	44,702.00	0.03
276	002116	中国海诚	4,300	44,505.00	0.03
277	002533	金杯电工	8,500	43,605.00	0.03
278	002391	长青股份	5,650	43,448.50	0.03
279	002605	姚记扑克	4,100	43,050.00	0.03
280	601339	百隆东方	9,500	43,035.00	0.03
281	002208	合肥城建	5,380	42,986.20	0.03
282	002300	太阳电缆	5,600	42,728.00	0.03
283	002394	联发股份	4,300	41,839.00	0.02
284	600327	大东方	10,860	41,159.40	0.02
285	002454	松芝股份	7,800	40,482.00	0.02
286	601811	新华文轩	3,300	40,293.00	0.02
287	603868	飞科电器	1,000	39,150.00	0.02
288	600551	时代出版	4,200	38,094.00	0.02
289	603355	莱克电气	1,700	36,584.00	0.02
290	600386	北巴传媒	8,500	34,595.00	0.02
291	002712	思美传媒	4,800	33,312.00	0.02
292	603969	银龙股份	7,200	33,264.00	0.02
293	600814	杭州解百	6,100	32,086.00	0.02
294	300393	中来股份	3,019	32,031.59	0.02
295	600248	延长化建	5,800	27,260.00	0.02
296	600828	茂业商业	5,109	25,647.18	0.02
297	600829	人民同泰	3,600	25,452.00	0.01
298	000524	岭南控股	2,700	22,599.00	0.01
299	300428	四通新材	1,600	17,328.00	0.01

7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	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	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
2	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
3	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
4	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.02
5	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
6	603863	松炆资源	887	20,471.96	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	8,474,387.91	7.34
2	600036	招商银行	6,854,405.00	5.93
3	601318	中国平安	6,328,822.00	5.48
4	000651	格力电器	5,589,820.00	4.84
5	601166	兴业银行	5,359,117.28	4.64
6	000858	五粮液	4,551,128.14	3.94
7	000333	美的集团	4,293,794.00	3.72
8	600887	伊利股份	4,273,907.00	3.70
9	600030	中信证券	3,715,212.28	3.22
10	601328	交通银行	3,444,678.00	2.98
11	000002	万科 A	3,026,179.88	2.62
12	600016	民生银行	2,901,850.00	2.51
13	601288	农业银行	2,678,722.00	2.32
14	600000	浦发银行	2,667,989.90	2.31
15	601668	中国建筑	2,562,714.00	2.22
16	600900	长江电力	2,419,222.00	2.09
17	601601	中国太保	2,362,087.00	2.04
18	600837	海通证券	2,326,950.00	2.01
19	601398	工商银行	2,302,145.00	1.99

20	600104	上汽集团	2,171,615.28	1.88
----	--------	------	--------------	------

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	5,750,346.98	4.98
2	600036	招商银行	5,670,120.20	4.91
3	601318	中国平安	5,409,992.25	4.68
4	601166	兴业银行	4,878,811.00	4.22
5	000333	美的集团	4,526,460.15	3.92
6	000858	五粮液	4,474,234.45	3.87
7	600887	伊利股份	4,333,203.00	3.75
8	601328	交通银行	3,689,295.00	3.19
9	000002	万科 A	3,172,563.09	2.75
10	600016	民生银行	3,121,435.00	2.70
11	601288	农业银行	2,874,646.00	2.49
12	600000	浦发银行	2,829,808.00	2.45
13	601668	中国建筑	2,746,971.00	2.38
14	600900	长江电力	2,551,802.12	2.21
15	601398	工商银行	2,447,261.00	2.12
16	600104	上汽集团	2,392,532.00	2.07
17	600048	保利地产	2,169,586.00	1.88
18	002304	洋河股份	2,034,417.14	1.76
19	601169	北京银行	1,923,071.00	1.66
20	001979	招商蛇口	1,879,181.00	1.63

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	182,494,469.16
卖出股票收入（成交）总额	157,832,910.56

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	3,896,880.00	2.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,192,113.40	3.04
	其中：政策性金融债	5,192,113.40	3.04
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）	37,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,125,993.40	5.34

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	108603	国开 1804	51,890	5,192,113.40	3.04
2	019611	19 国债 01	39,000	3,896,880.00	2.28
3	113028	环境转债	370	37,000.00	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	63,605.83
2	应收证券清算款	190,659.80

3	应收股利	-
4	应收利息	173,141.85
5	应收申购款	810,709.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,238,117.36

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.02	新股锁定
2	300788	中信出版	23,106.60	0.01	新股锁定

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
金选 300A	7,747	16,045.31	82,585,249.25	66.44%	41,717,796.83	33.56%
金选 300C	629	33,089.67	10,677,670.00	51.30%	10,135,732.29	48.70%
合计	8,376	17,325.27	93,262,919.25	64.27%	51,853,529.12	35.73%

8.2 期末上市基金前十名持有人

金选 300A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中国国际金融股份有限公司	5,337,477.00	42.22%
2	永安国富资产管理有限公司 —永安国富—永富8号资产 管理计划	4,999,225.00	39.54%
3	沈再新	396,897.00	3.14%
4	黎结宽	238,039.00	1.88%
5	卢锦欢	130,000.00	1.03%
6	罗小玲	100,000.00	0.79%
7	王德才	99,210.00	0.78%
8	阎瑄	90,000.00	0.71%
9	赵峰	82,300.00	0.65%
10	罗强	78,800.00	0.62%

金选 300C

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中国国际金融股份有限公司	10,677,670.00	87.82%
2	方华山	150,000.00	1.23%
3	宋雪云	148,006.00	1.22%
4	李永红	145,418.00	1.20%

5	马葵	142,500.00	1.17%
6	戴梅新	140,000.00	1.15%
7	李文燕	80,081.00	0.66%
8	陈敏	50,022.00	0.41%
9	胡广明	50,013.00	0.41%
10	潘守清	50,011.00	0.41%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	金选 300A	155,458.49	0.1300%
	金选 300C	1,366.61	0.0100%
	合计	156,825.10	0.1100%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	金选 300A	0~10
	金选 300C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	金选 300A	0
	金选 300C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金选 300A	金选 300C
基金合同生效日（2018 年 8 月 30 日）基金份额总额	196,888,672.87	77,708,924.35
本报告期期初基金份额总额	88,128,604.83	35,652,905.28
本报告期期间基金总申购份额	169,758,028.79	12,627,546.10
减：本报告期期间基金总赎回份额	133,583,587.54	27,467,049.09
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	124,303,046.08	20,813,402.29

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2019年1月19日,本基金管理人发布公告,楚钢先生自2019年1月18日起担任公司董事长,同日起总经理孙菁不再代为履行董事长职务。

2019年5月6日,本基金管理人发布公告,王元先生自2019年5月5日起接替颜羽女士担任公司独立董事。

2019年6月18日,本基金管理人发布公告,夏静女士自2019年6月17日起担任公司首席信息官,分管信息技术及风险管理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告,聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人与股东中金公司就南京中金基金管理有限公司(以下简称“南京中金基金”)侵犯商标权及不正当竞争事项,联合向南京市中级人民法院(以下简称“南京中院”)起诉,南京中院于2018年10月22日立案。2019年5月20日,南京中院出具(2018)苏01民初2710号民事调解书,确认基金管理人及股东中金公司与南京中金基金2019年5月17日签署的调解协议内容。截至本报告期末,南京中金基金已根据调解协议完成更名并支付赔偿款项。除前述事项外,本报告期无涉及基金管理人的其他诉讼事项。

本报告期无涉及本基金基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙),该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务,无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	338,753,710.44	100.00%	247,732.47	100.00%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

中金公司	6,692,282.72	100.00%	343,600,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司董事长任职公告	《中国证券报》及/或公司网站	2019年1月19日
2	中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 2018 年第 4 季度报告	《上海证券报》及/或公司网站	2019年1月22日
3	关于中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) A 类份额新增建设银行销售机构的公告	《上海证券报》及/或公司网站	2019年2月1日
4	关于旗下部分基金新增蚂蚁 (杭州) 基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2019年2月27日
5	关于中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) A 类份额新增腾安基金为销售机构的公告	《上海证券报》及/或公司网站	2019年3月8日
6	中金基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及/或公司网站	2019年3月12日
7	中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 2018 年度报告及其摘要	《上海证券报》及/或公司网站	2019年3月28日
8	中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书及其摘要 (2019 年第 1 号)	《上海证券报》及/或公司网站	2019年4月13日
9	中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 2019 年第 1 季度报告	《上海证券报》及/或公司网站	2019年4月19日
10	中金基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购及定投申购数额限制的公告	《上海证券报》及/或公司网站	2019年4月24日
11	关于新增西藏东方财富证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2019年5月8日

12	中金基金管理有限公司首席信息官任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及/或公司网站	2019年6月18日
13	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险揭示的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及/或公司网站	2019年6月25日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190620-20190630	0.00	50,912,176.50	-	50,912,176.50	35.08%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形。如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，从而可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2019 年 6 月组织了监事换届选举工作。根据选举结果，由公司基金运营部负责人白娜女士自 2019 年 6 月 17 日起接替夏静女士担任执行监事。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 募集注册的文件
- 2、《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》
- 3、《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》
- 4、中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 申请募集注册的法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 7、报告期内中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 在指定媒介上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件和复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2019年8月26日