

国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 27 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 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。

本报告中的财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

自 2017 年 9 月 1 日起，国金沪深 300 指数分级证券投资基金转型为国金沪深 300 指数增强证券投资基金。原国金沪深 300 指数分级证券投资基金报告期自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日止，国金沪深 300 指数增强证券投资基金报告期自 2017 年 9 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	7
2.2 基金产品说明（转型前）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）.....	9
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	10
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型后）.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 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.....	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 审计报告（转型后）	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§6 审计报告（转型前）	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表（转型后）	22
7.1 资产负债表（转型后）.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25

§7 年度财务报表（转型前）	51
7.1 资产负债表（转型前）	51
7.2 利润表	52
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	53
7.4 报表附注	55
§8 投资组合报告（转型后）	86
8.1 期末基金资产组合情况	86
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	87
8.3 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(转型后)	88
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	97
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	98
8.6 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	98
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	98
8.8 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	99
8.9 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	99
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	99
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	99
8.12 投资组合报告附注	99
§8 投资组合报告（转型前）	100
8.1 期末基金资产组合情况	100
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	101
8.3 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	102
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	111
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	114
8.6 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	114
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	114
8.8 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	114
8.9 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	114
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	114
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	115
8.12 投资组合报告附注	115
§9 基金份额持有人信息（转型后）	116
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	116
9.2 期末上市基金前十名持有人	116
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	117
9.4 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	117
§9 基金份额持有人信息（转型前）	117
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	117
9.2 期末上市基金前十名持有人	118
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	119
9.4 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	119
§10 开放式基金份额变动(转型后)	120
§10 开放式基金份额变动(转型前)	120
§11 重大事件揭示	120
11.1 基金份额持有人大会决议	120

11.2	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	121
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	121
11.4	基金投资策略的改变	121
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	121
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	121
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	121
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	123
11.8	其他重大事件（转型后）	124
11.8	其他重大事件（转型前）	126
§12	影响投资者决策的其他重要信息	130
12.1	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	130
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	131
§13	备查文件目录	131
13.1	备查文件目录	131
13.2	存放地点	131
13.3	查阅方式	131

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	国金沪深 300 指数增强证券投资基金
基金简称	国金 300 指数增强
场内简称	-
基金主代码	167601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 1 日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	184,086,364.18 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注：国金沪深 300 指数增强证券投资基金由国金沪深 300 指数分级证券投资基金变更注册而来，基金合同于 2017 年 9 月 1 日生效。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	国金沪深 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	国金 300		
场内简称	国金 300		
基金主代码	167601		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2013 年 7 月 26 日		
基金管理人	国金基金管理有限公司		
基金托管人	中国光大银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	196,694,895.56 份		
基金合同存续期（若有）	不定期		
基金份额上市的证券交易所（若有）	深圳证券交易所		
上市日期（若有）	2013 年 8 月 23 日		
下属分级基金的基金简称	国金 300A	国金 300B	国金 300
下属分级基金的场内简称	国金 300A	国金 300B	国金 300
下属分级基金的交易代码	150140	150141	167601
报告期末下属分级基金份额总额	78,389,667.00 份	78,389,667.00 份	39,915,561.56 份

注：国金沪深 300 指数分级证券投资基金的基金合同于 2013 年 7 月 26 日生效并于 2017 年 9 月 1 日失效。

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，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%，年化跟踪误差不得超过 8.0%。
投资策略	本基金以指数化投资为主、增强型投资为辅，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

注：国金沪深 300 指数增强证券投资基金由国金沪深 300 指数分级证券投资基金变更注册而来，基金合同于 2017 年 9 月 1 日生效。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深 300 指数，在严格控制基金的日均跟踪误差偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。		
投资策略	本基金采用指数完全复制方法，按照标的指数成份股及其权重构建基金的投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪和复制指数的目的，力争保持日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如遇特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等）致使基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整，并运用股指期货等金融衍生工具，以实现跟踪误差的有效控制。		
业绩比较基准（若有）	本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）。		
风险收益特征（若有）	本基金为股票型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，国金沪深 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；国金沪深 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	从本基金所分离的两类基金份额来看，国金沪深 300A 份额具有低	从本基金所分离的两类基金份额来看，国金沪深 300B 份额具有高	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品

	风险、收益相对稳定的特征。	风险、高预期收益的特征。	种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
--	---------------	--------------	---------------------------------

注：国金沪深 300 指数分级证券投资基金的基金合同于 2013 年 7 月 26 日生效并于 2017 年 9 月 1 日失效。

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		国金基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨海燕	石立平
	联系电话	010-88005970	010-63639180
	电子邮箱	yanghaiyan@gfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4000-2000-18	95595
传真		010-88005666	010-63639132
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		100089	100033
法定代表人		尹庆军	唐双宁

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日)
	转型后
本期已实现收益	13,419,593.96
本期利润	12,907,227.14
加权平均基金份额本期利润	0.0666
本期加权平均净值利润率	6.36%
本期基金份额净值增长率	6.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年12月31日)
期末可供分配利润	-9,486,411.26
期末可供分配基金份额利润	-0.0515
期末基金资产净值	196,299,409.69
期末基金份额净值	1.0663
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年12月31日)
基金份额累计净值增长率	6.63%

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. 期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3. 所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。

3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日至2017年8月31日)	2016年	2015年
	转型前	转型前	转型前
本期已实现收益	8,400,325.51	-1,491,420.74	35,621,165.37
本期利润	31,555,196.09	-3,388,120.30	22,753,145.27
加权平均基金份额本期利润	0.1726	-0.0953	0.2034
本期加权平均净值利润率	18.97%	-11.36%	18.86%
本期基金份额净值增长率	18.76%	-9.92%	4.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017	2016年末	2015年末

	年 8 月 31 日)		
期末可供分配利润	48,153,132.52	8,684,841.14	10,567,553.31
期末可供分配基金份额利润	0.2448	0.2558	0.3091
期末基金资产净值	196,802,728.21	29,431,888.96	34,029,107.82
期末基金份额净值	1.0005	0.8668	0.9954
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 8 月 31 日)	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	68.87%	42.20%	60.37%

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. 期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3. 所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。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

转型后						
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
过去三个月	5.05%	0.80%	4.82%	0.76%	0.23%	0.04%
自基金合同生效起至今	6.63%	0.70%	5.20%	0.67%	1.43%	0.03%

3.2.2. 自基金转型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：图示日期为 2017 年 9 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日。

3.2.3. 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2 基金净值表现（转型前）

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

转型前						
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
过去三个月	5.36%	0.71%	4.04%	0.67%	1.32%	0.04%
过去六个月	13.90%	0.65%	10.07%	0.62%	3.83%	0.03%
过去一年	20.09%	0.63%	16.60%	0.60%	3.49%	0.03%
过去三年	51.73%	1.78%	53.44%	1.68%	-1.71%	0.10%
自基金合同生效起至今	68.87%	1.59%	67.47%	1.51%	1.40%	0.08%

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：图示日期为 2013 年 7 月 26 日至 2017 年 8 月 31 日。

3.2.3. 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金合同生效日为 2013 年 7 月 26 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

注：本基金自 2017 年 9 月 1 日（基金合同生效日）起至 2017 年 12 月 31 日止未进行利润分配。

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发 放总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2017	-	-	-	-	
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	

合计	-	-	-	-
----	---	---	---	---

注：根据本基金基金合同约定，在存续期内，本基金（包括国金沪深 300 份额、国金沪深 300A 份额、国金沪深 300B 份额）不进行收益分配。

§ 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

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。2012年9月，公司的注册资本由1.6亿元人民币增加至2.8亿元人民币。2015年7月，公司名称由“国金通用基金管理有限公司”变更为“国金基金管理有限公司”。公司股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，股权比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。截至2017年12月31日，国金基金管理有限公司共管理11只开放式基金——国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数分级证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金鑫安保本混合型证券投资基金、国金上证50指数分级证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第七天理财债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金民丰回报6个月定期开放混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
宫雪	本基金基金经理，国金鑫安保本、国金上证50、国金鑫新灵活配置（LOF）、国金鑫瑞灵活基金经理，量化投资事	2013年7月26日	-	9	宫雪女士，中国科学院博士。2008年7月至2011年12月在博时基金管理有限公司股票投资部，任产业分析师；2012年2月至今在国金基金管理有限公司，历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理，自2016年4月起任量化投资事

	业三部总经理				业三部总经理。
艾翀	本基金基金经理	2017 年 10 月 26 日	-	4	艾翀先生，美国宾夕法尼亚州立大学博士。2013 年 2 月至 2015 年 8 月历任北京首创期货有限责任公司金融创新部量化和期权分析师、北京派朗科技有限公司金融工程部金融工程师。2015 年 9 月加入国金基金管理公司，任量化投资事业三部基金经理助理；自 2017 年 10 月起任量化投资事业三部基金经理。

注：（1）任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
宫雪	本基金基金经理，国金鑫安保本、国金上证 50、国金鑫新灵活配置（LOF）、国金鑫瑞灵活基金经理，量化投资事业三部总经理	2013 年 7 月 26 日	-	9	宫雪女士，中国科学院博士。2008 年 7 月至 2011 年 12 月在博时基金管理有限公司股票投资部，任产业分析师；2012 年 2 月至今在国金基金管理有限公司，历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理，自 2016 年 4 月起任量化投资事业三部总经理。

注：（1）任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》和其他有关法律法规的规定，以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规，制定了《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。该公平交易管理方法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行（集中竞价及非集中竞价交易）、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

第一，明确公平交易的原则：（1）信息获取公平原则，不同投资组合经理可公平获得研究成果；（2）交易机会公平原则，不同投资组合经理可获得公平交易执行的机会。

第二，对开放式基金和特定客户资产管理计划等不同类型业务，公司分别设立独立的投资部门；研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持；设立独立的基金交易部，实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；设立独立的合规风控部，对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、预警、报告等。

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的执行情况进行审核。（2）产品开发：风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标，在投资交易系统中完成风控参数设置，确保做好公平交易的事前控制。（3）研究与投资：投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为，其中，投资组合经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作，并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理，以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。（4）交易执行：交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度，合规风控部利用投资交易系统对交易执行进行实时监控，确保各

投资组合享有公平的交易执行机会。(5) 事后分析：合规风控部利用公平交易系统对不同投资组合之间的同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。(6) 报告备案：合规风控部根据实时监控及事后分析的结果撰写定期报告，并由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。(7) 信息披露环节：信息披露部门在各投资组合的定期报告中，至少披露公司整体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。(8) 反馈完善：根据事后分析报告及信息披露结果，公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善，以确保公平交易的执行日臻完善。(9) 监督检查：合规风控部监察稽核人员根据法规规定及公司公平交易制度规定，监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况，并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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

报告期，本基金严格遵守基金合同，以指数化投资为主、增强型投资为辅，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。同时为控制大额申购对跟踪误差的影响，本基金适当投资股指期货。基金持仓包括沪深 300 指数成份股、股指期货及现金以及其他优质股票等，其中股票持仓不低于 90%，股指期货市值不高于 10%，现金类资产不低于 5%。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%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0663 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.63%，业绩比较基准收益率为 5.20%。

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 年希望在于转型和创新，中国经济正站在新周期的起点上，世界经济正在复苏，供给侧改革正在积极推进，消费升级、先进制造、环保、对外开放、新兴产业等领域为投资者带来了大量的投资机会，同时金融监管加强、货币政策回归中性也要求投资者更加规范稳健。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法、合规性等进行了监察稽核，通过实时监控、定期检查、专项稽核、日常不定期抽查等方式，及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况，并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层、董事会以及监管部门。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

(1) 进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况不断细化制度流程，及时拟定了相关管理制度，并对原有制度体系进行了持续的更新和完善，截至报告出具日，本基金管理人共制订规章制度 152 项，涵盖公司主要业务范围。

(2) 强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规，将相关规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中，同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式，提高全体员工的合规守法意识。

(3) 有计划地开展监察稽核工作。本报告期内，本基金管理人根据年度监察稽核工作计划、通过日常监察与专项稽核相结合的方式，开展各项监察稽核工作，包括对基金销售、宣传材料、合同、反洗钱工作、基金投资运作、交易（包括公平交易）等方面进行稽核，对于稽核中发现的问题会通过监察稽核报告的形式，及时将潜在风险通报部门负责人、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。通过日常监察与专项稽核的方式，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化内部控制流程，提高了业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品

种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管行代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值委员会的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配，不存在应分配而未分配的情况。

4.9 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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于人民币五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2016 年 5 月 19 日至 2017 年 1 月 18 日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人转换本基金的运作方式，变更为指数增强型基金。自 2017 年 9 月 1 日起，国金沪深 300 指数分级证券投资基金转型为国金沪深 300 指数增强证券投资基金。

§ 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在本基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监

管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2017 年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2018）审字第 61004823_A09 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国金沪深 300 指数增强证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了国金沪深 300 指数增强证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年 9 月 1 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的国金沪深 300 指数增强证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 9 月 1 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间

	的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金沪深 300 指数增强证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>国金沪深 300 指数增强证券投资基金管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国金沪深 300 指数增强证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金沪深 300 指数增强证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报</p>

	<p>表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	徐艳 贺耀
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
审计报告日期	2018 年 3 月 26 日

§ 6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2018）审字第 61004823_A02 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国金沪深 300 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的国金沪深 300 指数分级证券投资基金财务报表，包括 2017 年 8 月 31 日的资产负债表，2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的国金沪深 300 指数分级证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金沪深 300 指数分级证券投资基金 2017 年 8 月 31 日的财务状况以及</p>

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金沪深 300 指数分级证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>国金沪深 300 指数分级证券投资基金管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国金沪深 300 指数分级证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金沪深 300 指数分级证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报</p>

	<p>表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	徐艳	贺耀
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2018 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：国金沪深 300 指数增强证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	12,046,300.42
结算备付金		1,658,113.35
存出保证金		1,250,983.91
交易性金融资产	7.4.7.2	178,908,003.19
其中：股票投资		178,908,003.19
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	4,000,000.00
应收证券清算款		622,954.18
应收利息	7.4.7.5	1,775.36
应收股利		-
应收申购款		9,661.97
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		198,497,792.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		1,293,699.30
应付赎回款		12,675.55
应付管理人报酬		170,981.69
应付托管费		34,196.32
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	250,782.06
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	436,047.77
负债合计		2,198,382.69
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	184,086,364.18
未分配利润	7.4.7.10	12,213,045.51
所有者权益合计		196,299,409.69
负债和所有者权益总计		198,497,792.38

注：（1）本基金转型后基金合同生效日为 2017 年 9 月 1 日。

（2）报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.0663 元，基金份额总额为 184,086,364.18 份。

（3）本财务报表的实际编制期间为 2017 年 9 月 1 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：国金沪深 300 指数增强证券投资基金

本报告期：2017 年 9 月 1 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2017 年 9 月 1 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		14,189,394.63
1. 利息收入		84,014.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	34,446.92
债券利息收入		0.45
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		49,566.88
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,598,755.99
其中：股票投资收益	7.4.7.12	13,820,444.10
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	292.75
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	800,400.00
股利收益	7.4.7.16	-22,380.86
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-512,366.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	18,991.21
减：二、费用		1,282,167.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	677,853.51
2. 托管费	7.4.10.2.2	135,570.71
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	313,509.77
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	155,233.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,907,227.14
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,907,227.14

注：本财务报表的实际编制期间为 2017 年 9 月 1 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金沪深 300 指数增强证券投资基金

本报告期：2017 年 9 月 1 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 9 月 1 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 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)	116,470,721.09	80,332,007.12	196,802,728.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,907,227.14	12,907,227.14
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)	67,615,643.09	-81,026,188.75	-13,410,545.66
其中：1.基金申购款	82,700,724.01	-80,197,656.98	2,503,067.03
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-15,085,080.92	-828,531.77	-15,913,612.69
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)	184,086,364.18	12,213,045.51	196,299,409.69

注：本财务报表的实际编制期间为 2017 年 9 月 1 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

<u>尹庆军</u>	<u>聂武鹏</u>	<u>于晓莲</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国金沪深 300 指数增强证券投资基金(以下简称“国金沪深 300 指数增强”)由国金沪深 300 指数分级证券投资基金(以下简称“国金 300 指数分级”)变更注册而来,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)[2017]646 号文《关于准予国金沪深 300 指数分级证券投资基金变更注册的批复》的核准,国金沪深 300 指数分级的基金合同于 2013 年 7 月 26 日生效并于 2017 年 9 月 1 日失效,国金沪深 300 指数增强基金合同于 2017 年 9 月 1 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为国金基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票(含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票),权证、股指期货、国债期货、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换

债券、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具(含同业存单)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）。本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份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及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 9 月 1 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 9 月 1 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将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的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，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，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的

有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1). 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2). 不存在活跃市场的金融工具，应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确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3). 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4). 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金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在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并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后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提；

(3) 基金的标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率逐日计提，标的指数使用许可费收取下限为每季度人民币 5 万元（基金合同生效当季按实际计提金额收取，不设下限）；

(4) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第三位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、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；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的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；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减，

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等

收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	12,046,300.42
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	12,046,300.42

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	160,170,947.41	178,908,003.19	18,737,055.78
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券 交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	160,170,947.41	178,908,003.19	18,737,055.78

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	7,304,340.00	-	-	
其中：股指期货投资	7,304,340.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	7,304,340.00	-	-	

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况如下：

于 2017 年 12 月 31 日，期货合约 IF1801 买入持仓 6 手，期货合约市值为 7,267,320.00 元，公允价值变动-37,020.00 元。公允价值变动合计-37,020.00 元，股指期货投资本期收益 800,400.00 元，股指期货投资本期公允价值变动-378,360.00 元。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	4,000,000.00	-
合计	4,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,837.48
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	393.25
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-1,463.02
应收申购款利息	0.06
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	7.59
合计	1,775.36

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	250,782.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	250,782.06

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	47.77
预提审计费	70,000.00
预提信息披露费	316,000.00
其他应付款-指数使用费	50,000.00
合计	436,047.77

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	196,802,728.21	116,470,721.09
本期申购	2,368,716.89	82,700,724.01
本期赎回(以“-”号填列)	-15,085,080.92	-15,085,080.92
- 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	184,086,364.18	184,086,364.18

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	56,553,458.03	23,778,549.09	80,332,007.12
本期利润	13,419,593.96	-512,366.82	12,907,227.14
本期基金份额交易产生的变动数	-74,416,963.53	-6,609,225.22	-81,026,188.75
其中：基金申购款	-75,493,499.29	-4,704,157.69	-80,197,656.98
基金赎回款	1,076,535.76	-1,905,067.53	-828,531.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,443,911.54	16,656,957.05	12,213,045.51

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日
	活期存款利息收入
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	2,005.99
其他	108.50
合计	34,446.92

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年 12月31日
卖出股票成交总额	118,433,025.64
减：卖出股票成本总额	104,612,581.54
买卖股票差价收入	13,820,444.10

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月1日至2017年12月31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	292.75
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	292.75

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月1日至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,293.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,000.00
减：应收利息总额	0.45
买卖债券差价收入	292.75

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本报告期无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金于本报告期无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金于本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金于本报告期无贵金属买卖差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本报告期无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金于本报告期无贵金属申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日
权证投资收益	-
股指期货-投资收益	800,400.00

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	-22,380.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	-22,380.86

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017 年12月31日
1. 交易性金融资产	-134,006.82
——股票投资	-134,006.82
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-378,360.00
——权证投资	-
——股指期货投资	-378,360.00
3. 其他	-
合计	-512,366.82

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年 12月31日
基金赎回费收入	18,991.21
合计	18,991.21

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年 12月31日
交易所市场交易费用	311,833.90
银行间市场交易费用	-
股指期货市场交易费用	1,675.87
合计	313,509.77

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 9 月 1 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	23,397.46
信息披露费	38,772.17
上市费	-
指数使用费	93,063.87
银行费用	-
合计	155,233.50

7.4.7.21 分部报告

无

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除以上情况及 7.4.6.2 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
上海国金理益财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期关联方各交易类别成交金额及成交比例如下：

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国金证券	25,100,921.40	11.34%

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
国金证券	67,000,000.00	24.81%

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31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
国金证券	18,356.31	10.56%	6,219.13	2.48%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期应支付的管理费	677,853.51

其中：支付销售机构的客户维护费	23,401.97
-----------------	-----------

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 9 月 1 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	135,570.71

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

注：本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	12,046,300.42	32,332.43

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

7.4.11 利润分配情况

注：本基金于本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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	说明
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-

7.4.12.2 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	停牌	停牌原	期末	复牌	复牌	数量(股)	期末	期末	备注
------	----	----	-----	----	----	----	-------	----	----	----

码	名称	日期	因	估值单价	日期	开盘单价		成本总额	估值总额	
300104	乐视网	2017年8月28日	临时停牌	15.33	-	-	49,400	1,011,958.46	757,302.00	-
601600	中国铝业	2017年9月12日	临时停牌	8.09	-	-	82,626	416,751.89	668,444.34	-
600309	万华化学	2017年12月6日	临时停牌	37.94	-	-	16,041	448,025.76	608,595.54	-
002739	万达电影	2017年7月4日	临时停牌	52.04	-	-	10,720	641,463.94	557,868.80	-
600332	白云山	2017年10月31日	临时停牌	32.14	-	-	16,776	450,696.08	539,180.64	-
000540	中天金融	2017年8月21日	临时停牌	7.35	-	-	64,500	433,464.56	474,075.00	-
002470	金正大	2017年10月25日	临时停牌	9.15	-	-	31,880	251,463.16	291,702.00	-
600150	中国船舶	2017年9月27日	临时停牌	24.67	-	-	8,656	258,751.49	213,543.52	-
600157	永泰能源	2017年11月21日	临时停牌	3.36	-	-	58,108	238,287.63	195,242.88	-
601216	君正集团	2017年12月15日	临时停牌	4.71	-	-	41,188	197,280.22	193,995.48	-
600666	奥瑞德	2017年5月31日	临时停牌	17.40	-	-	10,400	188,687.00	180,960.00	-

		日								
600685	中船防务	2017年9月27日	临时停牌	26.66	-	-	4,100	125,449.44	109,306.00	-
600485	信威集团	2017年6月27日	临时停牌	14.59	-	-	4,344	106,667.38	63,378.96	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

7.4.13.3 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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产

的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险等。

7.4.13.4.1 利率风险

利率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市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本报告期内，本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	12,046,300.42	-	-	-	-	-	12,046,300.42
结算备付金	1,658,113.35	-	-	-	-	-	1,658,113.35
存出保证金	15,539.51	-	-	-	-	1,235,444.40	1,250,983.91

交易性金融资产	-	-	-	-	-178,908,003.19	178,908,003.19
买入返售金融资产	4,000,000.00	-	-	-	-	4,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	622,954.18	622,954.18
应收利息	-	-	-	-	1,775.36	1,775.36
应收申购款	-	-	-	-	9,661.97	9,661.97
资产总计	17,719,953.28	-	-	-	-180,777,839.10	198,497,792.38
负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	1,293,699.30	1,293,699.30
应付赎回款	-	-	-	-	12,675.55	12,675.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	170,981.69	170,981.69
应付托管费	-	-	-	-	34,196.32	34,196.32
应付交易费用	-	-	-	-	250,782.06	250,782.06
其他负债	-	-	-	-	436,047.77	436,047.77
负债总计	-	-	-	-	2,198,382.69	2,198,382.69
利率敏感度缺口	17,719,953.28	-	-	-	-178,579,456.41	196,299,409.69

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末未持有交易性金融资产债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，债券投资占基金资产的比例为 0%-100%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	178,908,003.19	91.14
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
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	178,908,003.19	91.14

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数 (000300.SH) 变化 5%，其他变量不变； Beta 系数是根据组合在过去一年所有交易日的净值数据和沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 指数的相关性。	
	分析	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 (2017 年 12 月 31 日)
	相关风险变量的变动	
	+5%	9,566,944.26
	-5%	-9,566,944.26

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末 (2017 年 12 月 31 日)	上年度末 (2016 年 12 月 31 日)

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 174,005,857.29 元，属于第二层次的余额为人民币 4,902,145.90 元，无属于第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：国金沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 8 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 8 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	8,870,156.37	2,199,953.14
结算备付金		1,554,183.07	317,999.18
存出保证金		2,047,417.45	435,989.88
交易性金融资产	7.4.7.2	179,769,842.70	27,064,947.20
其中：股票投资		179,769,842.70	27,064,947.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		14,967,276.24	-
应收利息	7.4.7.5	18,494.39	485.70
应收股利		-	-
应收申购款		2,584.98	495.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		207,229,955.20	30,019,870.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年8月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9,714,224.12	3,539.95
应付管理人报酬		138,358.76	20,522.41
应付托管费		34,589.69	5,130.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	174,541.86	192,775.07
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	365,512.56	366,013.35
负债合计		10,427,226.99	587,981.39
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	116,470,721.09	20,697,923.41
未分配利润	7.4.7.10	80,332,007.12	8,733,965.55
所有者权益合计		196,802,728.21	29,431,888.96
负债和所有者权益总计		207,229,955.20	30,019,870.35

注：（1）报告截止日 2017 年 8 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.0000 元，基金份额总额 196,802,728.21 份。

（2）本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日止。

7.2 利润表

会计主体：国金沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		33,181,596.39	-2,644,302.66
1. 利息收入		83,340.42	20,056.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	60,658.21	20,053.39
债券利息收入		22.74	3.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		22,659.47	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,928,426.97	-829,606.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,524,523.20	-1,526,708.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	19,344.66	1,795.12
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	988,560.00	98,220.00
股利收益	7.4.7.16	3,395,999.11	597,086.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	23,154,870.58	-1,896,699.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	14,958.42	61,947.00
减：二、费用		1,626,400.30	743,817.64
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	877,650.60	237,589.98
2. 托管费	7.4.10.2.2	219,412.61	59,397.61
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	195,835.59	20,830.05
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	333,501.50	426,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,555,196.09	-3,388,120.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,555,196.09	-3,388,120.30

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 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）	20,697,923.41	8,733,965.55	29,431,888.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,555,196.09	31,555,196.09
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）	95,772,797.68	40,042,845.48	135,815,643.16
其中：1. 基金申购款	109,547,096.93	48,874,136.87	158,421,233.80
2. 基金赎回款	-13,774,299.25	-8,831,291.39	-22,605,590.64
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）	116,470,721.09	80,332,007.12	196,802,728.21
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	21,556,946.41	12,472,161.41	34,029,107.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,388,120.30	-3,388,120.30
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）	-859,023.00	-350,075.56	-1,209,098.56
其中：1. 基金申购款	37,466,940.89	11,843,668.45	49,310,609.34
2. 基金赎回款	-38,325,963.89	-12,193,744.01	-50,519,707.90
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）	20,697,923.41	8,733,965.55	29,431,888.96

注：本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>尹庆军</u>	<u>聂武鹏</u>	<u>于晓莲</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国金沪深 300 指数分级证券投资基金（原名称为“国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金”，以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）[2013]694 号文《关于核准国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由国金基金管理有限公司于 2013 年 7 月 1 日至 2013 年 7 月 19 日向社会公开募集。基金合同于 2013 年 7 月 26 日生效。2015 年 9 月 23 日，本基金名称由“国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金”变更为“国金沪深 300 指数分级证券投资基金”。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次募集规模为 323,127,755.17 份基金份额。根据基金合同的约定，场外认购的全部份额确认为国金沪深 300 份额；场内认购的全部份额按 1:1 的比例确认为国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额。其中场外认购的基金份额确认为 257,031,393.17 份国金沪深 300 份额（含募集期利息结转的份额）；场内认购的基金份额按 1:1 比例确认为 33,048,181.00 份国金沪深 300A 份额和 33,048,181.00 份国金沪深 300B 份额。本基金的基金管理人为国金基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括国金沪深 300 指数分级的基础份额（简称“国金沪深 300 份额”）、国金沪深 300 指数分级的稳健收益类份额（简称“国金沪深 300A 份额”）和国金沪深 300 指数分级的积极收益类份额（简称“国金沪深 300B 份额”）。其中，国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。国金沪深 300 指数分级发售结束后，投资人在募集期通过场内认购的全部国金沪深 300 份额将按照 1:1 的比例自动分离成预期收益与预期风险不同的两个份额类别，即稳健收益类的国金沪深 300A 份额和积极收益类的国金沪深 300B 份额，两类基金份额的基金资产与基础份额对应的基金资产合并运作。基金成立并开放申购赎回后，投资人可在场内申购国金沪深 300 份额，并可选择将其申购的每两份国金沪深 300 份额按 1:1 的比例分拆为国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额各一份。投资人在场外认购和申购的国金沪深 300 份额不进行分拆，该份额通过跨系统转托管至场内后，投资人可选择将其持有的每两份国金沪深 300 份额按 1:1 的比例分拆为国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额各一份。

在国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额存续期内的每个会计年度第一个工作日，本基金进行定期份额折算。折算方式为对国金沪深 300A 份额的应得收益进行定期份额折算，国金沪深

300 份额持有人持有的每 2 份国金沪深 300 份额将按 1 份国金沪深 300A 份额获得应得约定收益的新增折算份额。在基金份额定期折算前与折算后，国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额的份额配比保持 1:1 的比例不变。对于国金沪深 300A 份额期末的约定应得收益，即国金沪深 300A 份额每个会计年度最后一日份额参考净值超出人民币 1.000 元部分，将被折算为场内国金沪深 300 份额分配给国金沪深 300A 份额持有人。国金沪深 300 份额持有人持有的每 2 份国金沪深 300 份额将获得按照 1 份国金沪深 300A 份额应得约定收益分配的新增国金沪深 300 份额。持有场外国金沪深 300 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外国金沪深 300 份额；持有场内国金沪深 300 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内国金沪深 300 份额；经过上述份额折算，国金沪深 300A 份额的参考净值和国金沪深 300B 份额的基金份额净值将相应调整。除此之外，本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算，即：当国金沪深 300 份额的基金份额净值大于或等于人民币 1.500 元时；当国金沪深 300B 份额的参考净值小于或等于人民币 0.250 元时。

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股、备选成份股（包括中小板、创业板及其它中国证监会核准上市的股票）、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、债券回购、资产支持证券、权证、股指期货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）。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 85%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率（税后）}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 8 月 31 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当

确认为当期收益。每日，本基金将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的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，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，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付

的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1). 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应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确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3). 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4). 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金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在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率

差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并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后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提；

(3) 基金的标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率逐日计提，标的指数使用许可费收取下限为每季度人民币 5 万元（基金合同生效当季按实际计提金额收取，不设下限）；

(4) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第三位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在存续期内，本基金（包括国金沪深 300 份额、国金沪深 300A 份额、国金沪深 300B 份额）不进行收益分配；

(2) 经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止国金沪深 300A 份额与国金沪深 300B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。

7.4.4.12 分部报告

无

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充

通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3 . 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 8 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	8,870,156.37	2,199,953.14
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	8,870,156.37	2,199,953.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 8 月 31 日

		成本	公允价值	估值增值
股票		160,898,780.10	179,769,842.70	18,871,062.60
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		160,898,780.10	179,769,842.70	18,871,062.60
项目	上年度末 2016年12月31日			
		成本	公允价值	估值增值
股票		30,960,015.18	27,064,947.20	-3,895,067.98
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		30,960,015.18	27,064,947.20	-3,895,067.98

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年8月31日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	8,845,860.00	-	-	
其中：股指期货投资	8,845,860.00	-	-	
其他衍	-	-	-	

生工具				
合计	8,845,860.00	-	-	
项目	上年度末			
	2016 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
资产		负债		
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	2,022,600.00	-	-	
其中：股指期货投资	2,022,600.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,022,600.00	-	-	

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况如下：

于 2017 年 8 月 31 日，期货合约 IF1709 买入持仓 8 手，期货合约市值为 9,187,200.00 元，公允价值变动 341,340.00 元。公允价值变动合计 341,340.00 元，股指期货投资本期收益 988,560.00 元，股指期货投资本期公允价值变动 388,740.00 元。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：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。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 8 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	17,265.28	485.04
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	1,063.65	-

应收债券利息	-	-
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	165.46	0.66
合计	18,494.39	485.70

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年8月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	174,541.86	192,775.07
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	174,541.86	192,775.07

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年8月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,746.06	13.35
预提审计费	46,602.54	50,000.00
预提信息披露费	310,227.83	266,000.00
其他应付款-指数使用费	6,936.13	50,000.00
合计	365,512.56	366,013.35

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年8月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	33,956,243.12	20,697,923.41
本期申购	2,016.49	1,229.09
本期赎回(以“-”号填列)	-7,895.61	-4,812.51
2017年1月3日 基金拆分/份	33,950,364.00	20,694,339.99

额折算前		
基金拆分/份额折算变动份额	998,527.22	-
本期申购	184,999,441.01	109,545,867.84
本期赎回（以“-”号填列）	-23,253,436.67	-13,769,486.74
本期末	196,694,895.56	116,470,721.09

注：1. 申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

2. 根据本基金的基金合同、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2017 年 1 月 3 日为份额折算基准日，对国金沪深 300 份额、国金沪深 300A 份额进行定期份额折算。根据本基金基金份额持有人大会决议，基金管理人对本基金进行基金份额转换与变更登记，本基金以 2017 年 8 月 31 日为转换基准日，将国金沪深 300、国金沪深 300A、国金沪深 300B 基金份额转换成为国金沪深 300 指数增强证券投资基金。

3. 根据《基金合同》规定，投资人可通过场外或场内两种方式对国金沪深 300 份额进行申购和赎回。国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，不接受申购与赎回。因此上表不再单独披露国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额的情况。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,684,841.14	49,124.41	8,733,965.55
本期利润	8,400,325.51	23,154,870.58	31,555,196.09
本期基金份额交易产生的变动数	39,468,291.38	574,554.10	40,042,845.48
其中：基金申购款	45,806,271.02	3,067,865.85	48,874,136.87
基金赎回款	-6,337,979.64	-2,493,311.75	-8,831,291.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,553,458.03	23,778,549.09	80,332,007.12

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	54,583.00	19,778.17
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	3,101.51	110.75
其他	2,973.70	164.47
合计	60,658.21	20,053.39

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年8月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
卖出股票成交总额	35,659,533.29	7,377,543.76
减：卖出股票成本总额	30,135,010.09	8,904,252.05
买卖股票差价收入	5,524,523.20	-1,526,708.29

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年8 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31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	19,344.66	1,795.12
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	19,344.66	1,795.12

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年8 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	252,367.40	15,298.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	233,000.00	13,500.00
减：应收利息总额	22.74	3.68
买卖债券差价收入	19,344.66	1,795.12

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无贵金属买卖差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无贵金属申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2017年1月1日至2017年8月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
权证投资收益	-	-
股指期货-投资收益	988,560.00	98,220.00

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,395,999.11	597,086.54
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,395,999.11	597,086.54

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	22,766,130.58	-1,819,599.56
——股票投资	22,766,130.58	-1,819,599.56
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	388,740.00	-77,100.00
——权证投资	-	-
股指期货投资	388,740.00	-77,100.00
3. 其他	-	-
合计	23,154,870.58	-1,896,699.56

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	14,958.42	61,947.00
合计	14,958.42	61,947.00

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	193,740.43	19,249.83
银行间市场交易费用	-	-
股指期货市场交易费用	2,095.16	1,580.22

合计	195,835.59	20,830.05
----	------------	-----------

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年8月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
审计费用	46,602.54	50,000.00
信息披露费	77,227.83	116,000.00
上市费	40,000.00	60,000.00
其他	50,000.00	-
指数使用费	106,936.13	200,000.00
公证费	12,000.00	-
银行费用	735.00	-
合计	333,501.50	426,000.00

7.4.7.21 分部报告

无

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
上海国金利益财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期与上年度可比期间关联方各交易类别成交金额及成交比例如下：

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年8月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国金证券	72,168,983.04	37.56%	1,798,622.10	12.54%

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年8月31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
国金证券	52,777.19	37.36%	54,092.59	30.99%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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
国金证券	1,315.40	12.41%	1,315.40	0.68%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务

务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	877,650.60	237,589.98
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	43,064.10	29,457.95

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	219,412.61	59,397.61

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托

管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日			上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	国金 300A	国金 300B	国金 300	国金 300A	国金 300B	国金 300
基金合同生效日持有的基金份额	-	-	-	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	986,187.92	-	-	953,393.37
期间申购/买入总份额	-	-	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	29,005.17	-	-	32,794.55
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	1,015,193.09	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	0.00	-	-	986,187.92
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	0.00%	-	-	2.90%

注：基金管理人持有本基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.4.10.4.2 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

国金 300A		
关联方名称	本期末	上年度末

	2017 年 8 月 31 日		2016 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 (%)

份额单位：份

国金 300B				
关联方名称	本期末 2017 年 8 月 31 日		上年度末 2016 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 (%)

份额单位：份

国金 300				
关联方名称	本期末 2017 年 8 月 31 日		上年度末 2016 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 (%)
上海国金理益财富基金销售有限公司	-	-	4,979,252.94	14.66%
北京千石创富资本管理有限公司	-	2,987,153.34	-	
8.80%				

注：1. 除基金管理人之外的其他关联方于本报告期及上年度可比期间均未持有国际沪深 300A 份额及国金沪深 300B 份额。

2. 除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.4.10.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	8,870,156.37	54,583.00	2,199,953.14	19,778.17

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2017 年 8 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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	说明
300699	光威复材	2017 年 8 月 25 日	2017 年 9 月 1 日	新股流通受限	11.26	11.26	4,392	49,453.92	49,453.92	-
603619	中曼石油	2017 年 8 月 4 日	2017 年 11 月 17 日	新股流通受限	22.61	22.61	1,760	39,793.60	39,793.60	-
603359	东珠景观	2017 年 8 月 24 日	2017 年 9 月 1 日	新股流通受限	18.18	18.18	1,865	33,905.70	33,905.70	-
002897	意华股份	2017 年 8 月 31 日	2017 年 9 月 7 日	新股流通受限	20.68	20.68	1,169	24,174.92	24,174.92	-
603882	金城医学	2017 年 8 月 31 日	2017 年 9 月 8 日	新股流通受限	6.93	6.93	2,763	19,147.59	19,147.59	-
603527	众源新材	2017 年 8 月 28 日	2017 年 9 月 7 日	新股流通受限	13.27	13.27	1,021	13,548.67	13,548.67	-
603500	祥和实业	2017 年 8 月 25 日	2017 年 9 月 4 日	新股流通受限	13.17	13.17	1,004	13,222.68	13,222.68	-
300697	电工合金	2017 年 8 月 28 日	2017 年 9 月 7 日	新股流通受限	7.63	7.63	1,630	12,436.90	12,436.90	-
603725	天安新材	2017 年 8 月 29 日	2017 年 9 月 6 日	新股流通受限	9.64	9.64	1,203	11,596.92	11,596.92	-

603183	建研院	2017年8月28日	2017年9月5日	新股流通受限	13.56	13.56	701	9,505.56	9,505.56	-
--------	-----	------------	-----------	--------	-------	-------	-----	----------	----------	---

7.4.12.1.2 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	说明
------	------	-------	------	--------	------	--------	--------------	--------	--------	----

7.4.12.1.3 受限证券类别：权证

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：份)	期末成本总额	期末估值总额	说明
------	------	-------	------	--------	------	--------	--------------	--------	--------	----

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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
002450	康得新	2017年8月7日	临时停牌	19.40	2017年9月7日	21.34	56,658	1,016,242.76	1,099,165.20	-
601989	中国重工	2017年5月31日	临时停牌	6.21	2017年11月6日	6.67	144,730	1,169,924.83	898,773.30	-
300104	乐视网	2017年8月28日	临时停牌	15.33	2018年1月4日	13.80	49,400	1,011,958.46	757,302.00	-
600795	国电电力	2017年6月5日	临时停牌	3.49	2017年9月1日	3.84	185,799	650,532.68	648,438.51	-
002475	立讯精密	2017年8月31日	临时停牌	20.98	2017年9月1日	21.31	29,217	418,264.07	612,972.66	-
601088	中国神华	2017年6月5日	临时停牌	19.32	2017年9月1日	21.25	31,231	557,067.19	603,382.92	-
002739	万达电影	2017年7月	临时停牌	52.04	-	-	10,720	641,463.94	557,868.80	-

		月 4 日									
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	临时停牌	7.35	-	-	64,500	433,464.56	474,075.00	-	
000503	海虹控股	2017 年 5 月 11 日	临时停牌	24.93	2017 年 12 月 4 日	27.42	17,311	715,668.01	431,563.23	-	
002252	上海莱士	2017 年 4 月 21 日	临时停牌	20.24	2017 年 9 月 21 日	19.90	20,656	443,586.86	418,077.44	-	
600100	同方股份	2017 年 4 月 21 日	临时停牌	13.87	2017 年 9 月 21 日	14.68	24,923	357,579.37	345,682.01	-	
002183	怡亚通	2017 年 8 月 7 日	临时停牌	8.06	2017 年 9 月 5 日	8.30	33,900	365,193.97	273,234.00	-	
600959	江苏有线	2017 年 6 月 19 日	临时停牌	10.57	2017 年 10 月 11 日	11.63	24,240	272,525.27	256,216.80	-	
002555	三七互娱	2017 年 8 月 29 日	临时停牌	21.62	2017 年 9 月 5 日	22.30	9,600	232,947.96	207,552.00	-	
600666	奥瑞德	2017 年 4 月 27 日	临时停牌	17.40	-	-	10,400	188,687.00	180,960.00	-	
600074	保千里	2017 年 7 月 25 日	临时停牌	10.39	2017 年 12 月 29 日	9.87	15,300	206,279.67	158,967.00	-	
601872	招商轮船	2017 年 5 月 2 日	临时停牌	5.06	2017 年 9 月 12 日	5.57	29,800	165,984.19	150,788.00	-	
000555	神州信息	2017 年 7 月	临时停牌	16.73	2017 年 12 月	17.50	6,700	137,093.75	112,091.00	-	

		月 5 日			15 日					
600871	石化油服	2017 年 8 月 11 日	临时停牌	3.20	2017 年 9 月 21 日	3.39	28,600	109,190.01	91,520.00	-
601966	玲珑轮胎	2017 年 8 月 30 日	临时停牌	19.95	2017 年 12 月 20 日	16.62	3,800	76,128.00	75,810.00	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	临时停牌	14.59	-	-	4,344	106,667.38	63,378.96	-
002892	科力尔	2017 年 8 月 30 日	临时停牌	54.21	2017 年 9 月 1 日	59.63	765	13,433.40	41,470.65	-
002426	胜利精密	2017 年 1 月 16 日	临时停牌	7.65	2017 年 10 月 27 日	7.26	5,000	47,976.00	38,250.00	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	临时停牌	8.24	2017 年 11 月 29 日	9.06	4,029	55,512.78	33,198.96	-
600654	*ST 中	2017 年 6 月 7 日	临时停牌	13.48	2017 年 9 月 13 日	12.81	2,300	43,259.00	31,004.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后

完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

7.4.13.3 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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险等。

7.4.13.4.1 利率风险

利率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市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本报告期内，本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2017年8月31日	1个月以内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	8,870,156.37	-	-	-	-	-	8,870,156.37
结算备付金	1,554,183.07	-	-	-	-	-	1,554,183.07
存出保证金	26,233.45	-	-	-	-	2,021,184.00	2,047,417.45
交易性金融资产	-	-	-	-	-	179,769,842.70	179,769,842.70
应收证券清算款	-	-	-	-	-	14,967,276.24	14,967,276.24
应收利息	-	-	-	-	-	18,494.39	18,494.39
应收申购款	-	-	-	-	-	2,584.98	2,584.98
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	10,450,572.89	-	-	-	-	196,779,382.31	207,229,955.20
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,714,224.12	9,714,224.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	138,358.76	138,358.76
应付托管费	-	-	-	-	-	34,589.69	34,589.69
应付交易费用	-	-	-	-	-	174,541.86	174,541.86
其他负债	-	-	-	-	-	365,512.56	365,512.56
负债总计	-	-	-	-	-	10,427,226.99	10,427,226.99
利率敏感度缺口	10,450,572.89	-	-	-	-	186,352,155.32	196,802,728.21
上年度末 2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,199,953.14	-	-	-	-	-	2,199,953.14

结算备付金	317,999.18	-	-	-	-	-	317,999.18
存出保证金	1,445.88	-	-	-	-	434,544.00	435,989.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	27,064,947.20	27,064,947.20
应收利息	-	-	-	-	-	485.70	485.70
应收申购款	-	-	-	-	-	495.25	495.25
资产总计	2,519,398.20	-	-	-	-	27,500,472.15	30,019,870.35
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,539.95	3,539.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,522.41	20,522.41
应付托管费	-	-	-	-	-	5,130.61	5,130.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	192,775.07	192,775.07
其他负债	-	-	-	-	-	366,013.35	366,013.35
负债总计	-	-	-	-	-	587,981.39	587,981.39
利率敏感度缺口	2,519,398.20	-	-	-	-	26,912,490.76	29,431,888.96

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末未持有交易性金融资产债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，债券投资占基金资产的比例为 0%-100%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年8月31日		上年度末 2016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	179,769,842.70	91.35	27,064,947.20	91.96
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	179,769,842.70	91.35	27,064,947.20	91.96

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数 (000300.SH) 变化 5%，其他变量不变； Beta 系数是根据组合在过去一年所有交易日的净值数据和沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 指数的相关性。		
	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 (2017年8月31日)			上年度末 (2016年12月31日)
+5%			9,574,208.40
-5%	-9,574,208.40	-1,469,655.76	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末 (2017年12月31日)	上年度末 (2016年12月31日)

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 170,981,313.80 元，属于第二层次的余额为人民币 8,788,528.90 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次人民币 26,306,530.20，第二层次人民币 758,417.00 元，无属于第三层次的余额）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（上年度：无）。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告（转型后）

8.1 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	178,908,003.19	90.13
	其中：股票	178,908,003.19	90.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	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	4,000,000.00	2.02
	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	13,704,413.77	6.90
8	其他各项资产	1,885,375.42	0.95
9	合计	198,497,792.38	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	679,201.05	0.35
B	采矿业	6,012,173.85	3.06
C	制造业	75,901,435.60	38.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,321,526.30	1.69
E	建筑业	5,332,117.32	2.72
F	批发和零售业	3,873,465.20	1.97
G	交通运输、仓储和邮政业	4,495,122.91	2.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,974,842.43	3.55
J	金融业	51,490,460.79	26.23
K	房地产业	8,352,088.76	4.25
L	租赁和商务服务业	2,300,023.38	1.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,305,653.16	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	352,107.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	1,550,583.25	0.79
S	综合	124,410.00	0.06
	合计	172,065,211.00	87.65

注：以上行业分类以 2017 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	399,828.00	0.20
C	制造业	4,694,650.99	2.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	602,197.00	0.31
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	169,225.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	271,026.00	0.14
J	金融业	112,982.00	0.06
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	32,323.20	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	560,560.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,842,792.19	3.49

注：以上行业分类以 2017 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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(转型后)**8.3.1 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	601318	中国平安	137,172	9,599,296.56	4.89
2	600519	贵州茅台	13,041	9,095,967.09	4.63
3	600887	伊利股份	162,014	5,215,230.66	2.66
4	000858	五粮液	61,809	4,937,302.92	2.52
5	000333	美的集团	76,179	4,222,601.97	2.15
6	600036	招商银行	143,312	4,158,914.24	2.12
7	000651	格力电器	74,432	3,252,678.40	1.66
8	000002	万科A	83,551	2,595,094.06	1.32
9	002415	海康威视	62,187	2,425,293.00	1.24
10	601166	兴业银行	139,732	2,374,046.68	1.21
11	000725	京东方A	399,764	2,314,633.56	1.18
12	600016	民生银行	264,993	2,223,291.27	1.13
13	600000	浦发银行	161,772	2,036,709.48	1.04
14	601288	农业银行	531,026	2,033,829.58	1.04
15	002304	洋河股份	17,580	2,021,700.00	1.03
16	600030	中信证券	109,145	1,975,524.50	1.01
17	601328	交通银行	308,003	1,912,698.63	0.97
18	601398	工商银行	299,793	1,858,716.60	0.95
19	000001	平安银行	132,746	1,765,521.80	0.90
20	601601	中国太保	39,623	1,641,184.66	0.84
21	601668	中国建筑	168,161	1,516,812.22	0.77
22	000063	中兴通讯	40,367	1,467,744.12	0.75
23	000568	泸州老窖	21,457	1,416,162.00	0.72
24	600048	保利地产	99,487	1,407,741.05	0.72
25	002027	分众传媒	99,400	1,399,552.00	0.71
26	600276	恒瑞医药	18,984	1,309,516.32	0.67
27	600900	长江电力	82,405	1,284,693.95	0.65
28	600104	上汽集团	39,303	1,259,268.12	0.64
29	601766	中国中车	97,827	1,184,684.97	0.60
30	601169	北京银行	163,622	1,169,897.30	0.60
31	600837	海通证券	90,719	1,167,553.53	0.59
32	601988	中国银行	292,953	1,163,023.41	0.59
33	000776	广发证券	65,791	1,097,393.88	0.56
34	601933	永辉超市	106,936	1,080,053.60	0.55
35	002594	比亚迪	16,048	1,043,922.40	0.53
36	600028	中国石化	169,609	1,039,703.17	0.53
37	600019	宝钢股份	115,101	994,472.64	0.51

38	002230	科大讯飞	16,668	985,745.52	0.50
39	601211	国泰君安	52,000	963,040.00	0.49
40	601818	光大银行	221,479	896,989.95	0.46
41	601688	华泰证券	50,713	875,306.38	0.45
42	600585	海螺水泥	28,941	848,839.53	0.43
43	601857	中国石油	104,453	845,024.77	0.43
44	600703	三安光电	32,586	827,358.54	0.42
45	601899	紫金矿业	179,413	823,505.67	0.42
46	000538	云南白药	8,058	820,223.82	0.42
47	600015	华夏银行	88,971	800,739.00	0.41
48	601088	中国神华	34,531	800,083.27	0.41
49	600690	青岛海尔	42,460	799,946.40	0.41
50	000895	双汇发展	29,041	769,586.50	0.39
51	002008	大族激光	15,448	763,131.20	0.39
52	300104	乐视网	49,400	757,302.00	0.39
53	600518	康美药业	33,326	745,169.36	0.38
54	601336	新华保险	10,488	736,257.60	0.38
55	002450	康得新	32,758	727,227.60	0.37
56	601939	建设银行	93,284	716,421.12	0.36
57	001979	招商蛇口	36,616	716,208.96	0.36
58	002024	苏宁云商	57,541	707,178.89	0.36
59	002142	宁波银行	39,184	697,867.04	0.36
60	601006	大秦铁路	76,353	692,521.71	0.35
61	601989	中国重工	113,830	686,394.90	0.35
62	600031	三一重工	75,452	684,349.64	0.35
63	000425	徐工机械	145,731	674,734.53	0.34
64	600196	复星医药	15,096	671,772.00	0.34
65	601600	中国铝业	82,626	668,444.34	0.34
66	002475	立讯精密	28,117	659,062.48	0.34
67	600741	华域汽车	21,876	649,498.44	0.33
68	000423	东阿阿胶	10,722	646,214.94	0.33
69	600050	中国联通	101,699	643,754.67	0.33
70	300124	汇川技术	22,176	643,547.52	0.33
71	601628	中国人寿	21,117	643,012.65	0.33
72	000338	潍柴动力	74,920	624,832.80	0.32
73	002236	大华股份	26,825	619,389.25	0.32
74	600309	万华化学	16,041	608,595.54	0.31
75	002456	欧菲科技	29,345	604,213.55	0.31
76	300059	东方财富	46,380	600,621.00	0.31

77	002202	金风科技	31,462	593,058.70	0.30
78	300070	碧水源	34,101	592,334.37	0.30
79	000413	东旭光电	62,757	588,660.66	0.30
80	002714	牧原股份	11,000	581,460.00	0.30
81	601186	中国铁建	51,561	574,389.54	0.29
82	600919	江苏银行	77,600	570,360.00	0.29
83	000728	国元证券	51,143	562,573.00	0.29
84	600029	南方航空	47,063	560,990.96	0.29
85	601888	中国国旅	12,890	559,297.10	0.28
86	002739	万达电影	10,720	557,868.80	0.28
87	002508	老板电器	11,400	548,340.00	0.28
88	600089	特变电工	55,008	545,129.28	0.28
89	600332	白云山	16,776	539,180.64	0.27
90	601390	中国中铁	62,736	526,355.04	0.27
91	601225	陕西煤业	64,468	526,058.88	0.27
92	002241	歌尔股份	30,190	523,796.50	0.27
93	000166	申万宏源	92,891	498,824.67	0.25
94	300072	三聚环保	13,950	490,063.50	0.25
95	000100	TCL 集	125,371	488,946.90	0.25
96	600009	上海机场	10,790	485,657.90	0.25
97	002466	天齐锂业	9,100	484,211.00	0.25
98	600958	东方证券	34,900	483,714.00	0.25
99	000503	海虹控股	11,111	479,550.76	0.24
100	000540	中天金融	64,500	474,075.00	0.24
101	000783	长江证券	59,790	470,547.30	0.24
102	000876	新希望	61,810	460,484.50	0.23
103	002252	上海莱士	23,056	457,661.60	0.23
104	600660	福耀玻璃	15,779	457,591.00	0.23
105	000630	铜陵有色	156,335	456,498.20	0.23
106	600115	东方航空	55,355	454,464.55	0.23
107	601009	南京银行	57,109	442,023.66	0.23
108	600999	招商证券	25,570	438,781.20	0.22
109	000069	华侨城 A	50,637	429,908.13	0.22
110	600208	新湖中宝	81,215	423,942.30	0.22
111	002310	东方园林	20,700	417,519.00	0.21
112	600340	华夏幸福	13,238	415,540.82	0.21
113	002736	国信证券	38,100	413,385.00	0.21
114	600795	国电电力	132,299	412,772.88	0.21
115	600221	海航控股	128,952	411,356.88	0.21

116	300027	华谊兄弟	46,767	408,275.91	0.21
117	000768	中航飞机	24,152	407,927.28	0.21
118	603993	洛阳钼业	59,270	407,777.60	0.21
119	000839	中信国安	42,500	407,575.00	0.21
120	000963	华东医药	7,460	401,944.80	0.20
121	002385	大北农	65,423	396,463.38	0.20
122	601985	中国核电	52,400	385,140.00	0.20
123	000625	长安汽车	30,206	380,595.60	0.19
124	601377	兴业证券	52,019	378,698.32	0.19
125	600010	包钢股份	153,169	376,795.74	0.19
126	002081	金螳螂	24,528	375,768.96	0.19
127	601669	中国电建	51,502	371,844.44	0.19
128	600297	广汇汽车	44,940	360,418.80	0.18
129	600066	宇通客车	14,911	358,907.77	0.18
130	600111	北方稀土	24,482	357,192.38	0.18
131	601155	新城控股	12,100	354,530.00	0.18
132	600406	国电南瑞	19,366	354,010.48	0.18
133	002044	美年健康	16,100	352,107.00	0.18
134	002558	巨人网络	9,340	343,712.00	0.18
135	600674	川投能源	33,654	342,597.72	0.17
136	600522	中天科技	24,000	334,560.00	0.17
137	600886	国投电力	45,554	334,366.36	0.17
138	002673	西部证券	26,997	332,603.04	0.17
139	000983	西山煤电	32,200	326,508.00	0.17
140	000623	吉林敖东	14,390	323,775.00	0.16
141	600383	金地集团	25,252	318,932.76	0.16
142	601901	方正证券	46,208	318,373.12	0.16
143	300024	机器人	16,897	318,001.54	0.16
144	002797	第一创业	32,420	317,716.00	0.16
145	601607	上海医药	12,976	313,889.44	0.16
146	601333	广深铁路	55,315	308,104.55	0.16
147	600023	浙能电力	57,735	307,727.55	0.16
148	000157	中联重科	67,271	300,701.37	0.15
149	000792	盐湖股份	21,565	299,969.15	0.15
150	600606	绿地控股	40,900	298,570.00	0.15
151	600352	浙江龙盛	25,496	298,558.16	0.15
152	601788	光大证券	21,900	294,117.00	0.15
153	002470	金正大	31,880	291,702.00	0.15
154	601618	中国中冶	59,943	290,124.12	0.15

155	601919	中远海控	42,800	289,756.00	0.15
156	000060	中金岭南	25,785	288,018.45	0.15
157	000826	启迪桑德	8,583	283,410.66	0.14
158	600705	中航资本	50,404	278,230.08	0.14
159	601099	太平洋	76,300	276,206.00	0.14
160	601111	中国国航	22,356	275,425.92	0.14
161	600804	鹏博士	16,072	273,706.16	0.14
162	600893	航发动力	10,116	272,221.56	0.14
163	600827	百联股份	20,113	271,324.37	0.14
164	600271	航天信息	12,536	270,025.44	0.14
165	600816	安信信托	20,420	267,093.60	0.14
166	601727	上海电气	39,500	264,255.00	0.13
167	600372	中航电子	19,115	261,684.35	0.13
168	601555	东吴证券	26,921	261,672.12	0.13
169	600535	天士力	7,306	259,947.48	0.13
170	600547	山东黄金	8,301	258,825.18	0.13
171	000709	河钢股份	65,921	257,091.90	0.13
172	600177	雅戈尔	28,019	256,934.23	0.13
173	600570	恒生电子	5,512	255,756.80	0.13
174	002146	荣盛发展	26,818	255,575.54	0.13
175	600068	葛洲坝	30,920	253,544.00	0.13
176	600637	东方明珠	14,788	246,368.08	0.13
177	600739	辽宁成大	13,715	241,384.00	0.12
178	002500	山西证券	26,180	241,379.60	0.12
179	600482	中国动力	9,700	240,657.00	0.12
180	002465	海格通信	25,010	239,845.90	0.12
181	002065	东华软件	29,110	238,702.00	0.12
182	300017	网宿科技	22,242	236,654.88	0.12
183	002074	国轩高科	10,560	235,065.60	0.12
184	601018	宁波港	44,233	234,877.23	0.12
185	600362	江西铜业	11,637	234,718.29	0.12
186	002007	华兰生物	8,677	233,237.76	0.12
187	601877	正泰电器	8,700	227,505.00	0.12
188	000008	神州高铁	26,000	227,500.00	0.12
189	600109	国金证券	23,778	226,842.12	0.12
190	600018	上港集团	33,678	223,958.70	0.11
191	000750	国海证券	45,555	223,219.50	0.11
192	600188	兖州煤业	15,256	221,517.12	0.11
193	600583	海油工程	35,787	220,090.05	0.11

194	601800	中国交建	17,154	219,571.20	0.11
195	000559	万向钱潮	21,293	216,123.95	0.11
196	000938	紫光股份	3,000	216,090.00	0.11
197	600436	片仔癀	3,400	214,880.00	0.11
198	000671	阳光城	27,300	214,851.00	0.11
199	600150	中国船舶	8,656	213,543.52	0.11
200	601998	中信银行	34,237	212,269.40	0.11
201	300144	宋城演艺	11,200	208,992.00	0.11
202	601997	贵阳银行	15,400	205,744.00	0.10
203	000402	金融街	18,381	204,212.91	0.10
204	601992	金隅股份	37,500	203,625.00	0.10
205	600085	同仁堂	6,158	198,533.92	0.10
206	600100	同方股份	19,923	195,245.40	0.10
207	600157	永泰能源	58,108	195,242.88	0.10
208	002174	游族网络	8,700	194,010.00	0.10
209	601216	君正集团	41,188	193,995.48	0.10
210	600489	中金黄金	19,436	192,222.04	0.10
211	000686	东北证券	21,776	190,975.52	0.10
212	300315	掌趣科技	34,200	190,152.00	0.10
213	600682	南京新百	5,000	188,950.00	0.10
214	002153	石基信息	6,958	185,500.28	0.09
215	600170	上海建工	49,840	185,404.80	0.09
216	002426	胜利精密	31,800	185,394.00	0.09
217	000961	中南建设	28,600	183,326.00	0.09
218	000627	天茂集团	22,900	183,200.00	0.09
219	600498	烽火通信	6,200	178,746.00	0.09
220	601198	东兴证券	12,400	178,560.00	0.09
221	600820	隧道股份	21,200	177,232.00	0.09
222	600153	建发股份	15,850	176,252.00	0.09
223	600415	小商品城	30,426	175,862.28	0.09
224	600588	用友网络	8,144	172,245.60	0.09
225	002352	顺丰控股	3,400	171,224.00	0.09
226	600118	中国卫星	6,624	167,256.00	0.09
227	000415	渤海金控	28,700	165,312.00	0.08
228	300033	同花顺	3,300	164,934.00	0.08
229	002602	世纪华通	4,800	163,104.00	0.08
230	600663	陆家嘴	8,291	157,777.73	0.08
231	600008	首创股份	30,256	155,515.84	0.08
232	601633	长城汽车	13,510	155,229.90	0.08

233	600074	ST 保千里	15,300	151,011.00	0.08
234	601117	中国化学	22,200	149,850.00	0.08
235	600688	上海石化	23,620	149,514.60	0.08
236	000959	首钢股份	24,500	146,510.00	0.07
237	600369	西南证券	31,616	146,382.08	0.07
238	600959	江苏有线	17,340	141,841.20	0.07
239	300251	光线传媒	13,540	141,493.00	0.07
240	601229	上海银行	9,620	136,411.60	0.07
241	600376	首开股份	14,400	133,776.00	0.07
242	600704	物产中大	19,365	132,069.30	0.07
243	600977	中国电影	8,400	129,360.00	0.07
244	600549	厦门钨业	4,900	126,126.00	0.06
245	002411	必康股份	4,700	125,349.00	0.06
246	600061	国投资本	9,500	125,210.00	0.06
247	600038	中直股份	2,684	124,886.52	0.06
248	600895	张江高科	8,700	124,410.00	0.06
249	600649	城投控股	14,128	124,326.40	0.06
250	601866	中远海发	34,611	118,023.51	0.06
251	002292	奥飞娱乐	8,068	115,291.72	0.06
252	600685	中船防务	4,100	109,306.00	0.06
253	000738	航发控制	7,100	108,559.00	0.06
254	600373	中文传媒	6,178	104,593.54	0.05
255	601872	招商轮船	23,800	104,482.00	0.05
256	002555	三七互娱	5,000	102,700.00	0.05
257	002424	贵州百灵	6,600	101,640.00	0.05
258	601021	春秋航空	2,700	100,629.00	0.05
259	601718	际华集团	14,800	99,604.00	0.05
260	600021	上海电力	10,800	98,712.00	0.05
261	601118	海南橡胶	17,611	97,741.05	0.05
262	601966	玲珑轮胎	5,400	94,284.00	0.05
263	601611	中国核建	8,800	90,376.00	0.05
264	600909	华安证券	12,200	88,694.00	0.05
265	601608	中信重工	19,300	79,516.00	0.04
266	601958	金钼股份	10,814	78,185.22	0.04
267	600871	石化油服	29,000	77,430.00	0.04
268	601881	中国银河	7,200	75,672.00	0.04
269	600233	圆通速递	3,800	63,650.00	0.03
270	600485	信威集团	4,344	63,378.96	0.03
271	000977	浪潮信息	3,000	59,640.00	0.03

272	601375	中原证券	9,000	55,530.00	0.03
273	601163	三角轮胎	2,700	55,026.00	0.03
274	600926	杭州银行	4,500	51,885.00	0.03
275	603160	汇顶科技	500	48,470.00	0.02
276	002841	视源股份	600	43,500.00	0.02
277	603858	步长制药	800	40,688.00	0.02
278	002831	裕同科技	700	39,116.00	0.02
279	002839	张家港行	3,100	36,332.00	0.02
280	002049	紫光国芯	500	23,995.00	0.01

8.3.2 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	601012	隆基股份	17,466	636,461.04	0.32
2	300136	信维通信	12,200	618,540.00	0.32
3	002460	赣锋锂业	7,900	566,825.00	0.29
4	300015	爱尔眼科	18,200	560,560.00	0.29
5	002294	信立泰	10,500	474,495.00	0.24
6	601898	中煤能源	69,900	399,828.00	0.20
7	300003	乐普医疗	16,500	398,640.00	0.20
8	002572	索菲亚	8,600	316,480.00	0.16
9	600011	华能国际	47,100	290,607.00	0.15
10	002624	完美世界	8,100	271,026.00	0.14
11	603799	华友钴业	3,300	264,759.00	0.13
12	600219	南山铝业	62,200	228,896.00	0.12
13	601991	大唐发电	50,600	209,990.00	0.11
14	300122	智飞生物	7,400	207,718.00	0.11
15	000898	鞍钢股份	28,700	182,245.00	0.09
16	600666	奥瑞德	10,400	180,960.00	0.09
17	000723	美锦能源	25,200	173,628.00	0.09
18	002601	龙鳞佰利	9,600	153,792.00	0.08
19	002468	申通快递	4,800	118,512.00	0.06
20	002608	江苏国信	10,000	101,600.00	0.05
21	002466	天齐锂业	1,530	81,411.30	0.04
22	601878	浙商证券	4,100	68,142.00	0.03
23	603833	欧派家居	500	59,025.00	0.03
24	601212	白银有色	8,600	58,136.00	0.03

25	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.03
26	601228	广州港	8,300	50,713.00	0.03
27	600390	五矿资本	3,800	44,840.00	0.02
28	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.02
29	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
30	002923	润都股份	954	16,227.54	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	6,975,220.00	3.55
2	600887	伊利股份	4,491,533.00	2.29
3	000858	五粮液	3,051,130.00	1.55
4	601318	中国平安	2,940,457.00	1.50
5	600276	恒瑞医药	2,337,170.96	1.19
6	002304	洋河股份	1,525,863.00	0.78
7	600028	中国石化	1,417,505.00	0.72
8	600036	招商银行	1,336,803.90	0.68
9	000568	泸州老窖	1,257,818.00	0.64
10	601857	中国石油	1,185,569.00	0.60
11	600196	复星医药	1,184,055.00	0.60
12	600518	康美药业	1,153,358.00	0.59
13	601933	永辉超市	1,127,742.00	0.57
14	000538	云南白药	1,086,131.00	0.55
15	601088	中国神华	1,030,538.00	0.52
16	002027	分众传媒	999,132.00	0.51
17	000895	双汇发展	901,027.00	0.46
18	000725	京东方 A	890,353.00	0.45
19	000063	中兴通讯	889,417.00	0.45
20	601997	贵阳银行	865,755.00	0.44

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	3,686,331.00	1.88
2	600519	贵州茅台	3,042,856.00	1.55
3	600276	恒瑞医药	2,403,596.00	1.22
4	000002	万科A	2,365,388.00	1.20
5	600887	伊利股份	2,155,547.00	1.10
6	000333	美的集团	1,807,267.00	0.92
7	000858	五粮液	1,581,711.00	0.81
8	000725	京东方A	1,503,110.00	0.77
9	000651	格力电器	1,454,934.00	0.74
10	600036	招商银行	1,429,860.00	0.73
11	002415	海康威视	1,397,416.00	0.71
12	000538	云南白药	1,369,364.00	0.70
13	600518	康美药业	1,355,325.00	0.69
14	601166	兴业银行	1,324,204.00	0.67
15	600016	民生银行	1,294,317.00	0.66
16	600028	中国石化	1,284,213.00	0.65
17	000063	中兴通讯	1,210,090.00	0.62
18	600196	复星医药	1,112,452.00	0.57
19	002304	洋河股份	1,033,338.00	0.53
20	002450	康得新	1,009,739.00	0.51

8.4.3 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	103,825,935.65
卖出股票收入（成交）总额	118,433,025.64

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1801	IF1801	6	7,267,320.00	-37,020.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-37,020.00
股指期货投资本期收益（元）					800,400.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-378,360.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期，本基金运用股指期货来控制预期大额申购赎回等情况下的流动性风险，有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距，确保投资组合对指数跟踪的效果。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体，本期没有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。

8.12.2

本期基金投资组合前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,250,983.91
2	应收证券清算款	622,954.18
3	应收股利	-
4	应收利息	1,775.36
5	应收申购款	9,661.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,885,375.42

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期前十名指数投资股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期前五名积极投资股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 8 投资组合报告（转型前）

8.1 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	179,769,842.70	86.75
	其中：股票	179,769,842.70	86.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	10,424,339.44	5.03
8	其他资产	17,035,773.06	8.22
9	合计	207,229,955.20	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	633,348.82	0.32
B	采矿业	5,177,812.90	2.63
C	制造业	67,979,024.84	34.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,966,722.72	2.02
E	建筑业	7,319,825.58	3.72
F	批发和零售业	3,625,736.07	1.84
G	交通运输、仓储和邮政业	4,589,952.68	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,529,356.29	5.35
J	金融业	58,318,133.03	29.63
K	房地产业	10,368,205.95	5.27
L	租赁和商务服务业	1,595,615.02	0.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,158,677.84	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	435,791.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	2,545,175.10	1.29
S	综合	592,637.98	0.30
	合计	178,836,015.82	90.87

注：以上行业分类以 2017 年 8 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

8.2.2 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	501,103.05	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	33,905.70	0.02
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	162,631.44	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	26,461.47	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	29,175.93	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	19,147.59	0.01
R	文化、体育和娱乐业	161,401.70	0.08
S	综合	-	-
	合计	933,826.88	0.47

注：以上行业分类以 2017 年 8 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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**8.3.1 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	601318	中国平安	153,072	8,576,624.16	4.36
2	000651	格力电器	104,932	4,055,621.80	2.06
3	000333	美的集团	98,779	4,049,939.00	2.06
4	600036	招商银行	145,782	3,899,668.50	1.98
5	600519	贵州茅台	7,141	3,507,302.15	1.78
6	000002	万科A	148,551	3,450,839.73	1.75
7	601166	兴业银行	176,132	3,108,729.80	1.58
8	600016	民生银行	334,093	2,806,381.20	1.43
9	002415	海康威视	80,487	2,587,657.05	1.31
10	601328	交通银行	388,403	2,555,691.74	1.30
11	000858	五粮液	41,409	2,297,785.41	1.17
12	601668	中国建筑	211,961	2,117,490.39	1.08
13	000001	平安银行	187,346	2,113,262.88	1.07
14	601288	农业银行	540,126	2,036,275.02	1.03
15	600030	中信证券	111,245	2,027,996.35	1.03
16	600000	浦发银行	158,872	2,019,263.12	1.03
17	600887	伊利股份	85,914	2,003,514.48	1.02
18	000725	京东方A	518,664	1,986,483.12	1.01
19	601398	工商银行	304,793	1,798,278.70	0.91
20	600837	海通证券	114,419	1,749,466.51	0.89
21	601601	中国太保	44,423	1,697,847.06	0.86
22	601169	北京银行	206,422	1,577,064.08	0.80
23	600104	上汽集团	49,503	1,471,724.19	0.75
24	600900	长江电力	93,305	1,397,708.90	0.71
25	601211	国泰君安	63,800	1,376,804.00	0.70
26	601766	中国中车	137,427	1,366,024.38	0.69
27	600276	恒瑞医药	23,884	1,293,079.76	0.66
28	601988	中国银行	297,953	1,260,341.19	0.64
29	000063	中兴通讯	51,867	1,237,546.62	0.63
30	000776	广发证券	64,591	1,229,166.73	0.62
31	002230	科大讯飞	21,168	1,206,787.68	0.61
32	002304	洋河股份	13,180	1,177,633.00	0.60
33	002450	康得新	56,658	1,099,165.20	0.56
34	601688	华泰证券	46,113	1,058,293.35	0.54
35	600048	保利地产	100,587	1,037,051.97	0.53
36	600019	宝钢股份	124,901	1,024,188.20	0.52
37	000538	云南白药	11,358	988,146.00	0.50

38	001979	招商蛇口	51,716	981,052.52	0.50
39	002024	苏宁云商	81,241	967,580.31	0.49
40	600050	中国联通	119,899	963,987.96	0.49
41	601818	光大银行	225,079	945,331.80	0.48
42	601390	中国中铁	105,336	928,010.16	0.47
43	002241	歌尔股份	42,490	917,784.00	0.47
44	002466	天齐锂业	13,000	907,660.00	0.46
45	601989	中国重工	144,730	898,773.30	0.46
46	600028	中国石化	148,509	892,539.09	0.45
47	002456	欧菲光	41,445	883,192.95	0.45
48	002142	宁波银行	55,384	881,159.44	0.45
49	600518	康美药业	41,926	872,060.80	0.44
50	600015	华夏银行	90,571	862,235.92	0.44
51	000568	泸州老窖	15,257	843,406.96	0.43
52	300059	东方财富	56,080	832,227.20	0.42
53	601186	中国铁建	64,961	809,414.06	0.41
54	000166	申万宏源	131,291	798,249.28	0.41
55	300070	碧水源	41,101	779,685.97	0.40
56	002236	大华股份	31,625	778,923.75	0.40
57	601006	大秦铁路	84,053	768,244.42	0.39
58	002736	国信证券	53,700	767,910.00	0.39
59	000338	潍柴动力	105,720	761,184.00	0.39
60	300104	乐视网	49,400	757,302.00	0.38
61	601600	中国铝业	93,026	745,138.26	0.38
62	600958	东方证券	44,000	739,640.00	0.38
63	002008	大族激光	18,648	730,815.12	0.37
64	000783	长江证券	72,290	728,683.20	0.37
65	601336	新华保险	11,788	724,490.48	0.37
66	000423	东阿阿胶	11,422	712,275.92	0.36
67	600309	万华化学	19,341	696,856.23	0.35
68	601628	中国人寿	23,517	688,342.59	0.35
69	600703	三安光电	34,586	678,577.32	0.34
70	601939	建设银行	94,984	663,938.16	0.34
71	600585	海螺水泥	28,241	663,098.68	0.34
72	600795	国电电力	185,799	648,438.51	0.33
73	000839	中信国安	59,800	645,840.00	0.33
74	600999	招商证券	32,370	632,509.80	0.32
75	300072	三聚环保	19,550	630,292.00	0.32
76	000069	华侨城 A	71,537	622,371.90	0.32

77	002673	西部证券	38,097	615,647.52	0.31
78	002475	立讯精密	29,217	612,972.66	0.31
79	600690	青岛海尔	43,160	605,534.80	0.31
80	601088	中国神华	31,231	603,382.92	0.31
81	000625	长安汽车	42,606	586,258.56	0.30
82	601009	南京银行	72,009	580,392.54	0.29
83	300124	汇川技术	21,876	577,526.40	0.29
84	002594	比亚迪	11,848	574,509.52	0.29
85	000768	中航飞机	30,252	573,577.92	0.29
86	000100	TCL 集	160,071	571,453.47	0.29
87	601377	兴业证券	66,219	568,821.21	0.29
88	000728	国元证券	38,543	562,342.37	0.29
89	002739	万达电影	10,720	557,868.80	0.28
90	600111	北方稀土	30,782	556,846.38	0.28
91	601857	中国石油	68,653	556,775.83	0.28
92	601899	紫金矿业	146,513	549,423.75	0.28
93	600340	华夏幸福	16,738	543,315.48	0.28
94	600010	包钢股份	193,369	539,499.51	0.27
95	300024	机器人	23,897	535,292.80	0.27
96	600089	特变电工	52,908	531,196.32	0.27
97	601901	方正证券	58,208	530,856.96	0.27
98	601669	中国电建	64,802	530,728.38	0.27
99	002202	金风科技	44,262	530,701.38	0.27
100	600009	上海机场	13,590	530,689.50	0.27
101	000413	东旭光电	51,257	521,796.26	0.27
102	601985	中国核电	66,000	509,520.00	0.26
103	000963	华东医药	10,560	498,854.40	0.25
104	000895	双汇发展	21,541	483,380.04	0.25
105	000540	中天金融	64,500	474,075.00	0.24
106	000793	华闻传媒	44,098	474,053.50	0.24
107	000060	中金岭南	36,285	472,067.85	0.24
108	000623	吉林敖东	20,290	468,496.10	0.24
109	600741	华域汽车	22,276	467,573.24	0.24
110	600660	福耀玻璃	19,779	454,323.63	0.23
111	002500	山西证券	37,080	453,117.60	0.23
112	000709	河钢股份	92,921	444,162.38	0.23
113	601788	光大证券	27,600	439,392.00	0.22
114	000157	中联重科	95,671	439,129.89	0.22
115	002044	美年健康	26,300	435,791.00	0.22

116	600029	南方航空	49,663	435,544.51	0.22
117	002310	东方园林	23,400	435,240.00	0.22
118	601555	东吴证券	34,021	432,066.70	0.22
119	000503	海虹控股	17,311	431,563.23	0.22
120	000630	铜陵有色	137,435	428,797.20	0.22
121	600886	国投电力	57,554	428,201.76	0.22
122	600031	三一重工	54,052	423,227.16	0.22
123	601919	中远海控	53,900	419,881.00	0.21
124	002252	上海莱士	20,656	418,077.44	0.21
125	600068	葛洲坝	39,120	415,845.60	0.21
126	601099	太平洋	96,200	415,584.00	0.21
127	600196	复星医药	14,196	415,374.96	0.21
128	601888	中国国旅	13,790	413,286.30	0.21
129	002065	东华软件	41,110	411,100.00	0.21
130	600893	航发动力	13,816	405,775.92	0.21
131	002508	老板电器	10,300	404,275.00	0.21
132	000009	中国宝安	46,931	402,667.98	0.20
133	000750	国海证券	64,555	401,532.10	0.20
134	002465	海格通信	35,210	397,168.80	0.20
135	600637	东方明珠	18,688	394,316.80	0.20
136	600606	绿地控股	51,500	392,430.00	0.20
137	002081	金螳螂	34,628	390,257.56	0.20
138	600705	中航资本	63,404	389,300.56	0.20
139	600066	宇通客车	18,711	388,814.58	0.20
140	002146	荣盛发展	37,918	386,763.60	0.20
141	601618	中国中冶	75,743	384,017.01	0.20
142	601607	上海医药	16,276	379,230.80	0.19
143	000826	启迪桑德	11,183	378,991.87	0.19
144	000983	西山煤电	34,500	378,465.00	0.19
145	600383	金地集团	31,952	374,477.44	0.19
146	601933	永辉超市	54,136	368,666.16	0.19
147	601727	上海电气	44,300	366,804.00	0.19
148	601225	陕西煤业	42,468	363,950.76	0.18
149	600570	恒生电子	7,012	359,996.08	0.18
150	600109	国金证券	29,978	359,136.44	0.18
151	600522	中天科技	30,400	357,808.00	0.18
152	600352	浙江龙盛	32,196	357,697.56	0.18
153	300017	网宿科技	31,442	354,036.92	0.18
154	000792	盐湖股份	30,365	353,448.60	0.18

155	000425	徐工机械	91,731	349,495.11	0.18
156	600535	天士力	9,206	349,367.70	0.18
157	002027	分众传媒	37,200	348,564.00	0.18
158	600406	国电南瑞	20,566	347,976.72	0.18
159	002195	二三四五	42,900	347,919.00	0.18
160	601800	中国交建	21,654	347,113.62	0.18
161	002074	国轩高科	11,500	347,070.00	0.18
162	000876	新希望	45,810	345,865.50	0.18
163	600100	同方股份	24,923	345,682.01	0.18
164	002007	华兰生物	12,177	343,513.17	0.17
165	600547	山东黄金	10,501	342,752.64	0.17
166	000686	东北证券	30,676	336,822.48	0.17
167	601018	宁波港	55,933	336,157.33	0.17
168	300027	华谊兄弟	36,467	334,037.72	0.17
169	300315	掌趣科技	42,300	332,901.00	0.17
170	600816	安信信托	25,720	332,045.20	0.17
171	601992	金隅股份	47,200	327,096.00	0.17
172	600739	辽宁成大	17,315	323,790.50	0.16
173	002714	牧原股份	7,600	317,452.00	0.16
174	000559	万向钱潮	29,893	316,267.94	0.16
175	600023	浙能电力	57,735	315,810.45	0.16
176	600271	航天信息	15,836	312,602.64	0.16
177	000402	金融街	26,081	309,059.85	0.16
178	600177	雅戈尔	30,319	308,647.42	0.16
179	600221	海航控股	92,852	306,411.60	0.16
180	300144	宋城演艺	15,900	305,280.00	0.16
181	600674	川投能源	31,154	301,882.26	0.15
182	600018	上港集团	45,878	299,124.56	0.15
183	601198	东兴证券	15,600	298,896.00	0.15
184	000977	浪潮信息	17,040	296,496.00	0.15
185	000008	神州高铁	36,700	295,802.00	0.15
186	600115	东方航空	41,555	290,053.90	0.15
187	600362	江西铜业	14,637	286,006.98	0.15
188	000415	渤海金控	40,500	283,095.00	0.14
189	300033	同花顺	4,700	282,940.00	0.14
190	601998	中信银行	43,237	282,337.61	0.14
191	603993	洛阳钼业	37,370	281,396.10	0.14
192	002470	金正大	34,380	280,884.60	0.14
193	002385	大北农	44,923	280,768.75	0.14

194	002411	必康股份	10,100	279,366.00	0.14
195	600804	鹏博士	15,972	277,753.08	0.14
196	600415	小商品城	38,426	277,435.72	0.14
197	002183	怡亚通	33,900	273,234.00	0.14
198	600489	中金黄金	24,336	271,346.40	0.14
199	600820	隧道股份	26,700	270,471.00	0.14
200	000627	天茂集团	27,800	266,880.00	0.14
201	600208	新湖中宝	60,615	266,706.00	0.14
202	000917	电广传媒	24,798	266,330.52	0.14
203	601111	中国国航	28,056	260,079.12	0.13
204	600061	国投安信	15,700	259,521.00	0.13
205	600157	永泰能源	70,308	258,733.44	0.13
206	600153	建发股份	20,050	257,442.00	0.13
207	601216	君正集团	47,688	257,038.32	0.13
208	600959	江苏有线	24,240	256,216.80	0.13
209	000959	首钢股份	34,600	256,040.00	0.13
210	600663	陆家嘴	10,391	254,371.68	0.13
211	601333	广深铁路	48,015	250,638.30	0.13
212	600085	同仁堂	7,758	250,350.66	0.13
213	600150	中国船舶	9,756	246,729.24	0.13
214	600369	西南证券	39,916	246,680.88	0.13
215	002352	顺丰控股	4,800	243,936.00	0.12
216	600170	上海建工	62,840	243,190.80	0.12
217	300168	万达信息	15,600	239,772.00	0.12
218	600297	广汇汽车	30,340	237,865.60	0.12
219	600682	南京新百	6,200	235,662.00	0.12
220	600436	片仔癀	4,300	235,167.00	0.12
221	002558	巨人网络	5,340	229,780.20	0.12
222	601229	上海银行	12,120	229,310.40	0.12
223	600118	中国卫星	8,324	228,826.76	0.12
224	002602	世纪华通	6,700	228,604.00	0.12
225	601155	新城控股	12,700	227,965.00	0.12
226	600008	首创股份	34,056	226,131.84	0.11
227	002049	紫光国芯	7,900	222,780.00	0.11
228	600332	白云山	7,976	221,334.00	0.11
229	600588	用友网络	10,344	215,879.28	0.11
230	601633	长城汽车	17,110	215,414.90	0.11
231	600549	厦门钨业	6,100	210,389.00	0.11
232	002152	广电运通	26,500	209,615.00	0.11

233	600718	东软集团	12,260	207,684.40	0.11
234	002555	三七互娱	9,600	207,552.00	0.11
235	000671	阳光城	35,300	207,211.00	0.11
236	601117	中国化学	28,000	207,200.00	0.11
237	600583	海油工程	31,287	200,236.80	0.10
238	600688	上海石化	30,820	199,097.20	0.10
239	600498	烽火通信	7,400	198,098.00	0.10
240	000738	航发控制	10,000	195,000.00	0.10
241	002174	游族网络	7,500	194,925.00	0.10
242	600895	张江高科	11,000	189,970.00	0.10
243	600256	广汇能源	44,211	189,665.19	0.10
244	000156	华数传媒	12,588	189,071.76	0.10
245	300133	华策影视	15,157	188,249.94	0.10
246	002131	利欧股份	61,100	186,355.00	0.09
247	000938	紫光股份	3,200	186,112.00	0.09
248	600649	城投控股	17,828	184,876.36	0.09
249	600704	物产中大	24,365	184,686.70	0.09
250	600373	中文传媒	7,778	183,638.58	0.09
251	000718	苏宁环球	32,900	182,595.00	0.09
252	601866	中远海发	44,811	181,036.44	0.09
253	600666	奥瑞德	10,400	180,960.00	0.09
254	002292	奥飞娱乐	11,468	175,804.44	0.09
255	600909	华安证券	15,400	173,866.00	0.09
256	600827	百联股份	11,313	171,957.60	0.09
257	300251	光线传媒	19,240	168,734.80	0.09
258	002299	圣农发展	9,700	168,198.00	0.09
259	601718	际华集团	18,600	164,610.00	0.08
260	600376	首开股份	14,600	164,396.00	0.08
261	600060	海信电器	11,069	160,389.81	0.08
262	002153	石基信息	6,958	159,964.42	0.08
263	600074	保千里	15,300	158,967.00	0.08
264	600919	江苏银行	18,000	158,220.00	0.08
265	002424	贵州百灵	9,200	155,388.00	0.08
266	601997	贵阳银行	9,800	154,448.00	0.08
267	601872	招商轮船	29,800	150,788.00	0.08
268	600037	歌华有线	9,900	148,104.00	0.08
269	601118	海南橡胶	22,311	147,698.82	0.08
270	000961	中南建设	24,300	147,015.00	0.07
271	601881	中国银河	9,100	144,872.00	0.07

272	600977	中国电影	8,000	144,240.00	0.07
273	600737	中粮糖业	14,400	143,568.00	0.07
274	600038	中直股份	3,384	142,094.16	0.07
275	600021	上海电力	12,100	139,029.00	0.07
276	601608	中信重工	24,500	128,870.00	0.07
277	600685	中船防务	4,600	127,512.00	0.06
278	600446	金证股份	7,000	127,050.00	0.06
279	600482	中国动力	4,900	125,881.00	0.06
280	601958	金铂股份	13,614	124,023.54	0.06
281	600372	中航电子	7,515	123,772.05	0.06
282	601021	春秋航空	3,400	117,368.00	0.06
283	601877	正泰电器	6,000	115,320.00	0.06
284	000555	神州信息	6,700	112,091.00	0.06
285	601375	中原证券	11,300	111,757.00	0.06
286	002797	第一创业	8,520	98,150.40	0.05
287	601611	中国核建	7,400	93,832.00	0.05
288	600871	石化油服	28,600	91,520.00	0.05
289	600926	杭州银行	5,700	85,215.00	0.04
290	601163	三角轮胎	3,400	84,320.00	0.04
291	603858	步长制药	1,100	76,549.00	0.04
292	601966	玲珑轮胎	3,800	75,810.00	0.04
293	600188	兖州煤业	5,456	73,601.44	0.04
294	002841	视源股份	1,000	73,510.00	0.04
295	002831	裕同科技	1,000	68,980.00	0.04
296	002839	张家港行	4,400	67,276.00	0.03
297	603160	汇顶科技	700	63,749.00	0.03
298	600485	信威集团	4,344	63,378.96	0.03
299	601127	小康股份	2,600	51,844.00	0.03
300	002426	胜利精密	5,000	38,250.00	0.02
301	002129	中环股份	4,029	33,198.96	0.02
302	600654	*ST 中	2,300	31,004.00	0.02

8.3.2 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	601326	秦港股份	16,888	162,631.44	0.08
2	601949	中国出版	12,687	130,676.10	0.07

3	603129	春风动力	1,075	49,761.75	0.03
4	300699	光威复材	4,392	49,453.92	0.03
5	002891	中宠股份	1,011	48,244.92	0.02
6	603181	皇马科技	1,946	46,781.84	0.02
7	603557	起步股份	1,664	43,663.36	0.02
8	002892	科力尔	765	41,470.65	0.02
9	603619	中曼石油	1,760	39,793.60	0.02
10	603976	正川股份	964	38,743.16	0.02
11	300693	盛弘股份	863	34,908.35	0.02
12	603359	东珠景观	1,865	33,905.70	0.02
13	603721	中广天择	796	30,725.60	0.02
14	300692	中环环保	1,077	29,175.93	0.01
15	002897	意华股份	1,169	24,174.92	0.01
16	002895	川恒股份	1,461	21,637.41	0.01
17	603882	金城医学	2,763	19,147.59	0.01
18	603127	昭衍新药	643	16,955.91	0.01
19	603527	众源新材	1,021	13,548.67	0.01
20	603500	祥和实业	1,004	13,222.68	0.01
21	300697	电工合金	1,630	12,436.90	0.01
22	300698	N 万马	1,350	11,664.00	0.01
23	603725	天安新材	1,203	11,596.92	0.01
24	603183	建研院	701	9,505.56	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601318	中国平安	5,173,356.00	17.58
2	000002	万科A	3,115,389.00	10.59
3	000333	美的集团	3,059,821.00	10.40
4	000651	格力电器	2,884,008.00	9.80
5	601166	兴业银行	2,855,173.87	9.70
6	600016	民生银行	2,776,598.00	9.43
7	600036	招商银行	2,535,485.24	8.61
8	600519	贵州茅台	2,392,695.45	8.13
9	601328	交通银行	2,163,645.00	7.35

10	600000	浦发银行	1,846,323.60	6.27
11	000725	京东方 A	1,832,430.00	6.23
12	000001	平安银行	1,749,256.00	5.94
13	601668	中国建筑	1,737,543.00	5.90
14	600837	海通证券	1,710,652.00	5.81
15	600030	中信证券	1,683,638.00	5.72
16	002415	海康威视	1,680,975.00	5.71
17	000858	五 粮 液	1,644,072.00	5.59
18	601288	农业银行	1,606,694.00	5.46
19	601169	北京银行	1,568,452.00	5.33
20	600887	伊利股份	1,439,484.00	4.89
21	601398	工商银行	1,299,020.00	4.41
22	601766	中国中车	1,292,871.00	4.39
23	600104	上汽集团	1,180,660.00	4.01
24	601601	中国太保	1,164,996.00	3.96
25	000776	广发证券	1,134,019.00	3.85
26	600900	长江电力	1,130,992.00	3.84
27	601211	国泰君安	1,116,553.00	3.79
28	002304	洋河股份	1,006,992.00	3.42
29	002450	康 得 新	1,000,036.00	3.40
30	601988	中国银行	978,597.00	3.32
31	002024	苏宁云商	908,508.00	3.09
32	600276	恒瑞医药	901,840.00	3.06
33	001979	招商蛇口	898,310.00	3.05
34	601989	中国重工	884,943.00	3.01
35	000538	云南白药	872,871.00	2.97
36	300104	乐 视 网	870,947.00	2.96
37	601390	中国中铁	866,505.00	2.94
38	600048	保利地产	865,022.24	2.94
39	600019	宝钢股份	854,690.00	2.90
40	601818	光大银行	838,063.00	2.85
41	000166	申万宏源	828,807.00	2.82
42	000063	中兴通讯	825,532.00	2.80
43	002736	国信证券	811,435.00	2.76
44	600028	中国石化	799,753.00	2.72
45	600015	华夏银行	782,171.00	2.66

46	002142	宁波银行	772,365.00	2.62
47	601688	华泰证券	771,052.91	2.62
48	300059	东方财富	749,671.56	2.55
49	601186	中国铁建	745,133.00	2.53
50	000783	长江证券	727,515.00	2.47
51	300070	碧水源	715,058.05	2.43
52	000768	中航飞机	694,942.00	2.36
53	600518	康美药业	690,591.00	2.35
54	002673	西部证券	685,092.60	2.33
55	000503	海虹控股	677,072.00	2.30
56	000625	长安汽车	668,470.00	2.27
57	300072	三聚环保	658,386.50	2.24
58	000423	东阿阿胶	645,670.00	2.19
59	600050	中国联通	624,077.00	2.12
60	600958	东方证券	614,747.00	2.09
61	002230	科大讯飞	609,590.00	2.07
62	002739	万达电影	601,677.40	2.04
63	002241	歌尔股份	597,379.00	2.03
64	000338	潍柴动力	591,908.00	2.01

8.4.2 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	601318	中国平安	1,085,494.00	3.69
2	000651	格力电器	598,126.00	2.03
3	601166	兴业银行	591,236.00	2.01
4	000333	美的集团	573,997.00	1.95
5	000002	万科A	518,192.00	1.76
6	600036	招商银行	494,789.00	1.68
7	600519	贵州茅台	439,131.00	1.49
8	002085	万丰奥威	410,709.30	1.40
9	600016	民生银行	374,760.00	1.27
10	000778	新兴铸管	360,955.20	1.23
11	601328	交通银行	336,642.00	1.14
12	000858	五粮液	321,506.00	1.09

13	600867	通化东宝	321,476.04	1.09
14	300015	爱尔眼科	320,175.65	1.09
15	000725	京东方 A	317,506.00	1.08
16	000039	中集集团	308,680.48	1.05
17	300002	神州泰岳	289,195.60	0.98
18	300058	蓝色光标	280,746.68	0.95
19	601668	中国建筑	279,862.00	0.95
20	000001	平安银行	279,088.00	0.95

8.4.3 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	159,977,951.62
卖出股票收入（成交）总额	35,659,533.29

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1709	IF1709	8	9,187,200.00	341,340.00	报告期内，本基金运用股指期货是出于追求基金

					充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的,总体风险可控且符合既定的投资政策和投资目标。
公允价值变动总额合计 (元)					341,340.00
股指期货投资本期收益 (元)					988,560.00
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					388,740.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期,本基金运用股指期货来控制预期大额申购赎回等情况下的流动性风险,有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距,确保投资组合对指数跟踪的效果。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体,本期没有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。

8.12.2

本期基金投资组合前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	2,047,417.45

2	应收证券清算款	14,967,276.24
3	应收股利	-
4	应收利息	18,494.39
5	应收申购款	2,584.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,035,773.06

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期前十名指数投资股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 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	300699	光威复材	49,453.92	0.03	新股锁定

§ 9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
745	247,095.79	172,310,096.60	93.60%	11,776,267.58	6.40%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	-	84,677,829.00	46.00%

2	国金慧睿多策略-国金鑫丰 3 号集合资产管理计划	29,165,935.30	15.84%
3	中融国际信托有限公司-中融-绝对收益策略 2 号单一资金信托	19,444,952.30	10.56%
4	建信基金建信贵宾 3 号资产管理计划	16,008,771.00	8.70%
5	建信基金-光大银行-中融国际信托-中融-绝对收益策略 1 号单一资金	8,004,386.00	4.35%
6	建信基金建信贵宾 1 号资产管理计划	6,003,289.00	3.26%
7	建信基金建信贵宾 4 号资产管理计划	6,003,289.00	3.26%
8	华泰柏瑞基金-平安银行-中融国际信托-中融-绝对收益策略 1 号单一	3,001,645.00	1.63%
9	闫剑华	1,485,198.22	0.81%
10	彭洪亮	675,258.54	0.37%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	335,113.54	0.1820%

9.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 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	

国金 300A	101	776,135.32	69,887,453.00	89.15%	8,502,214.00	10.85%
国金 300B	301	260,430.79	74,513,955.00	95.06%	3,875,712.00	4.94%
国金 300	831	48,033.17	29,232,110.66	73.23%	10,683,450.90	26.77%
合计	1,233	159,525.46	173,633,518.66	88.28%	23,061,376.90	11.72%

9.2 期末上市基金前十名持有人

国金 300A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	景顺长城基金—工商银行—景顺长城—混合策略 2 号资产管理计	17,019,118.00	21.71%
2	华富基金—光大银行—中融国际信托—中融—绝对收益策略 1 号	15,000,000.00	19.14%
3	建信基金—光大银行—中融国际信托—中融—绝对收益策略 1 号	8,000,000.00	10.21%
4	中融国际信托有限公司—中融—绝对收益策略 2 号单一资金信托	7,672,624.00	9.79%
5	建信基金—光大银行—中融国际信托—中融—绝对收益策略 1 号单一	4,000,000.00	5.10%
6	建信基金—光大银行—中融国际信托—中融—绝对收益策略 1 号单一	3,000,000.00	3.83%
7	建信基金—光大银行—中融国际信托—中融—绝对收益策略 1 号单一	3,000,000.00	3.83%
8	建信基金—民生银行—中融国际信托—中融—融晨绝对收益策略 3 号	2,988,800.00	3.81%
9	长城基金—华夏银行—中融国际信托—中融—绝对收益策略 1 号单一	2,987,100.00	3.81%
10	中融国际信托有限公司—中融—融晨 3 号证券投资集合资金信托计划	2,757,500.00	3.52%

国金 300B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	景顺长城基金—工商银行—景顺长城—混合策略 2 号资产管理计	22,052,555.00	28.13%
2	华富基金—光大银行—中融国际信托—中融—绝对收益策略 1 号	15,000,000.00	19.14%
3	中融国际信托有限公司—中融—绝对收益策略 2 号单一资金信托	11,900,000.00	15.18%
4	建信基金—光大银行—中融国际信托—中融—绝对收益策略 1 号	8,000,000.00	10.21%

5	建信基金—光大银行—中融国际信托—中融—绝对收益策略 1 号单一	4,000,000.00	5.10%
6	长城基金—华夏银行—中融国际信托—中融—绝对收益策略 1 号单一	3,000,000.00	3.83%
7	建信基金—光大银行—中融国际信托—中融—绝对收益策略 1 号单一	3,000,000.00	3.83%
8	建信基金—光大银行—中融国际信托—中融—绝对收益策略 1 号单一	3,000,000.00	3.83%
9	建信基金—民生银行—中融国际信托—中融—融晨绝对收益策略 3 号	3,000,000.00	3.83%
10	华泰柏瑞基金—平安银行—中融国际信托—中融—绝对收益策略 1 号	1,500,000.00	1.91%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	362,633.54	0.1844%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数的分母采用期末基金份额总额。

9.4 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	国金 300A	0
	国金 300B	0
	国金 300	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国金 300A	0
	国金 300B	0
	国金 300	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	国金 300 指数增强
基金合同生效日 (2017 年 9 月 1 日) 基金份额总额	196,802,728.21
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,368,716.89
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	15,085,080.92
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	184,086,364.18

注：1. 总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

2. 本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 9 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日止。

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

项目	国金 300A	国金 300B	国金 300
基金转型日 (2017 年 9 月 1 日) 基金份额总额	33,048,181.00	33,048,181.00	257,031,393.17
本报告期期初基金份额总额	6,603,521.00	6,603,521.00	20,749,201.12
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	185,001,457.50
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	23,261,332.28
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	71,786,146.00	71,786,146.00	-142,573,764.78
本报告期期末基金份额总额	78,389,667.00	78,389,667.00	39,915,561.56

注：1. 变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算中调整的份额。

2. 本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 8 月 31 日止。

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

本基金于 2017 年 7 月 12 日至 2017 年 8 月 11 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决时间于 2017 年 8 月 11 日 17:00 截止，会议期间审议了《关于国金沪深 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。本次基金份额持有人大会于 2017 年 8

月 14 日表决通过了《关于国金沪深 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，本次大会决议自该日起正式生效。

11.2 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

本报告期内无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期，本基金由采取对标的沪深 300 指数完全复制的投资策略变为沪深 300 指数增强投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 70,000.00 元人民币。截至本报告期末，该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 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	
中信证券	1	59,756,368.53	27.01%	55,651.62	32.03%	-
国融证券	1	39,689,172.81	17.94%	29,024.37	16.70%	-
招商证券	2	34,821,220.48	15.74%	25,464.95	14.65%	-
国金证券	2	25,100,921.40	11.34%	18,356.31	10.56%	-
方正证券	1	22,881,316.40	10.34%	16,733.39	9.63%	-
申万宏源	1	19,994,855.04	9.04%	14,622.33	8.41%	-
东方证券	1	19,033,242.10	8.60%	13,919.09	8.01%	-
财达证券	1	-	-	-	-	-

银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

（1）基金专用交易席位的选择标准如下：

- ① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③ 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需要；
- ④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；
- ⑤ 交易佣金收取标准合理。

（2）基金专用交易席位的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

2. 本期新增天风证券一个交易单元。

11.7.2 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
中信证券	-	-	107,000,000.00	39.63%	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	4,293.20	100.00%	76,000,000.00	28.15%	-	-
国金证券	-	-	67,000,000.00	24.81%	-	-
方正证券	-	-	20,000,000.00	7.41%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 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	
中信证券	1	3,819,867.19	1.99%	3,557.65	2.52%	-
国融证券	1	23,008,131.85	11.97%	16,826.02	11.91%	-
国金证券	2	72,168,983.04	37.55%	52,777.19	37.36%	-
方正证券	1	93,140,191.86	48.80%	68,113.62	48.21%	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

（1）基金专用交易席位的选择标准如下：

- ① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③ 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需要；
- ④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；
- ⑤ 交易佣金收取标准合理。

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

11.7.2 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
中信证券	82,038.00	32.51%	52,000,000.00	33.30%	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	170,329.40	67.49%	102,000,000.00	66.23%	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同（摘要）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 9 月 1 日
2	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 9 月 1 日
3	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同等法律文件生效的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 9 月 1 日
4	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金托管协议》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 9 月 1 日
5	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金招募说明书》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 9 月 1 日

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
6	《国金基金管理有限公司关于增加和讯信息科技有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 9 月 1 日
7	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额转换结果公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 9 月 2 日
8	《关于国金沪深 300 指数增强证券投资基金恢复申购、赎回等业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 9 月 15 日
9	《国金基金管理有限公司关于增加天津万家财富资产管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 10 月 16 日
10	《国金基金管理有限公司关于增加上海朝阳财富基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 10 月 17 日
11	《关于国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金经理变更的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 10 月 27 日
12	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2017 年第 3 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 10 月 27 日
13	《国金基金管理有限公司关于增加上海万得基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 10 月 30 日
14	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2017 年第 3 季度报告更正公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 10 月 31 日
15	《国金基金管理有限公司关于增加上海大智慧财富管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 10 月 31 日
16	《国金基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参与费率优惠的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 11 月 15 日
17	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金（原国金沪深 300 指数分级证券投资基金）基金份额“确权”登记指引》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 11 月 23 日
18	《关于国金基金管理有限公司	指定披露媒体和本基金基金	2017 年 12 月 30 日

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
	旗下产品实施增值税政策的公告》	管理人网站	

注：本报告期内，基金管理人按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定每个开放日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

11.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金基金管理有限公司 2016 年 12 月 31 日旗下基金净值公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 1 月 3 日
2	《国金基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 1 月 4 日
3	《国金沪深 300A 份额 2017 年度约定年基准收益率的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 1 月 4 日
4	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间国金 300A 份额停复牌的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 1 月 4 日
5	《国金沪深 300A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 1 月 5 日
6	《国金沪深 300 分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 1 月 5 日
7	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 1 月 21 日
8	《国金基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 1 月 25 日
9	《国金基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职责的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 2 月 13 日
10	《国金基金管理有限公司参加北京钱景财富投资管理有限公司基金申购费率优惠的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 2 月 16 日
11	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金投资基金托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 3 月 4 日

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
12	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金投资基金托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 3 月 11 日
13	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 3 月 11 日
14	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 3 月 11 日
15	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金投资基金托管人发行债券的关联交易公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 3 月 22 日
16	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 3 月 28 日
17	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年年度报告摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 3 月 28 日
18	《国金基金管理有限公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 4 月 13 日
19	《国金基金管理有限公司关于服务器升级维护的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 4 月 13 日
20	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金 2017 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 4 月 22 日
21	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金关于〈深圳证券交易所分级基金业务管理指引〉实施的风险提示公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 4 月 25 日
22	《国金基金管理有限公司关于〈深圳证券交易所分级基金业务管理指引〉实施的风险提示公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 4 月 26 日
23	《国金基金管理有限公司关于〈深圳证券交易所分级基金业务管理指引〉实施的风险提示公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 4 月 27 日
24	《国金基金管理有限公司关于〈深圳证券交易所分级基金业务管理指引〉实施的风险提示公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 4 月 28 日
25	《国金基金管理有限公司关于〈深圳证券交易所分级基金业	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 4 月 29 日

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
	务管理指引>实施的风险提示公告》		
26	《国金基金管理有限公司关于旗下基金参加中泰证券股份有限公司基金申购费率优惠的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017年5月18日
27	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金投资基金托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017年6月1日
28	《国金基金管理有限公司关于直销交易系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017年6月24日
29	《国金基金 2017 年 6 月 30 日旗下基金净值公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017年7月1日
30	《关于以通讯方式召开国金沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017年7月10日
31	《关于以通讯方式召开国金沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017年7月11日
32	《关于以通讯方式召开国金沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017年7月12日
33	《国金基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017年7月18日
34	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金 2017 年第 2 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017年7月19日
35	《国金基金管理有限公司关于旗下基金参加华泰证券股份有限公司基金申购费率优惠的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017年7月31日
36	《国金基金管理有限公司关于增加上海云湾投资管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017年8月9日
37	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金自基金份额持有人大会会计票日开始停牌的提示性公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017年8月14日
38	《关于国金沪深 300 指数分级	指定披露媒体和本基金基	2017年8月15日

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
	证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》	金管理人网站	
39	《关于国金沪深 300 指数分级证券投资基金实施转型的提示性公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 15 日
40	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 25 日
41	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 25 日
42	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 26 日
43	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 26 日
44	《关于国金沪深 300 指数分级证券投资基金基金转型份额转换与变更登记的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 28 日
45	《关于国金沪深 300 指数分级证券投资基金终止场内申购赎回暨基金份额转换业务期间暂停相关业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 28 日
46	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金终止上市公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 28 日
47	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 30 日
48	《国金沪深 300 指数分级证券投资基金终止上市提示性公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 30 日

注：本报告期内，基金管理人按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定每个开放日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2017 年 3 月 14 日至 2017 年 7 月 1 日	0.00	80,000,000.00	78,000,000.00	2,000,000.00	1.09%
	2	2017 年 1 月 19 日至 2017 年 1 月 22 日	0.00	117,784,452.30	117,784,452.00	0.30	0.00%
	3	2017 年 1 月 23 日至 2017 年 4 月 11 日	0.00	304,012,992.00	304,012,992.00	0.00	0.00%
	4	2017 年 7 月 1 日至 2017 年 9 月 1 日	0.00	29,165,935.30	0.00	29,165,935.30	15.84%
	5	2017 年 12 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	0.00	149,895,337.00	65,217,508.00	84,677,829.00	46.00%
	6	2017 年 10 月 19 日至 2017 年 11 月 30 日	0.00	38,928,301.00	38,928,301.00	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过 20%的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准国金沪深 300 指数分级证券投资基金募集的文件；
- 2、中国证监会准予国金沪深 300 指数分级证券投资基金变更注册的批复；
- 3、国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同；
- 4、国金沪深 300 指数增强证券投资基金托管协议；
- 5、国金沪深 300 指数增强证券投资基金招募说明书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内披露的各项公告。

13.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。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或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司
2018 年 3 月 27 日