

# 中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

## 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	9
4.1 基金经理及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	52
7.7 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	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
8.3 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情况 .....	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中金沪深 300 指数增强	
基金主代码	003015	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 22 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	649,838,221.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金沪深 300 指数增强 A	中金沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	003015	003579
报告期末下属分级基金的份额总额	500,513,646.43 份	149,324,574.61 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	本基金股票投资主要策略为标的指数投资策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合，然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化，力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券投资策略；5、股指期货投资策略；6、参与转融通证券出借业务投资策略。详见《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 × 95% + 银行活期存款利率（税后）× 5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中金基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 席晓峰	郭明
联系人	联系电话 010-63211122	010-66105799

电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-868-1166	95588
传真	010-66159121	010-66105798
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100004	100140
法定代表人	李金泽	廖林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2025年1月1日-2025年6月30日)	
	中金沪深 300A	中金沪深 300C
本期已实现收益	24,410,645.07	12,614,170.59
本期利润	6,248,597.12	16,486,329.62
加权平均基金份额本期利润	0.0125	0.0731
本期加权平均净值利润率	0.76%	4.42%
本期基金份额净值增长率	2.05%	1.86%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025年6月30日)	
	290,833,433.20	86,931,027.60
期末可供分配利润	0.5811	0.5822

基金份额利润		
期末基金资产净值	852, 599, 206. 77	254, 884, 662. 32
期末基金份额净值	1. 7034	1. 7069
3. 1. 3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	70. 34%	60. 39%

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

2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

### 3. 2 基金净值表现

#### 3. 2. 1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金沪深 300A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3. 12%	0. 53%	2. 37%	0. 55%	0. 75%	-0. 02%
过去三个月	2. 67%	1. 07%	1. 21%	1. 04%	1. 46%	0. 03%
过去六个月	2. 05%	0. 97%	0. 07%	0. 97%	1. 98%	0. 00%
过去一年	13. 74%	1. 28%	13. 12%	1. 32%	0. 62%	-0. 04%
过去三年	-1. 81%	1. 01%	-11. 43%	1. 05%	9. 62%	-0. 04%
自基金合同生效起至今	70. 34%	1. 08%	20. 90%	1. 11%	49. 44%	-0. 03%

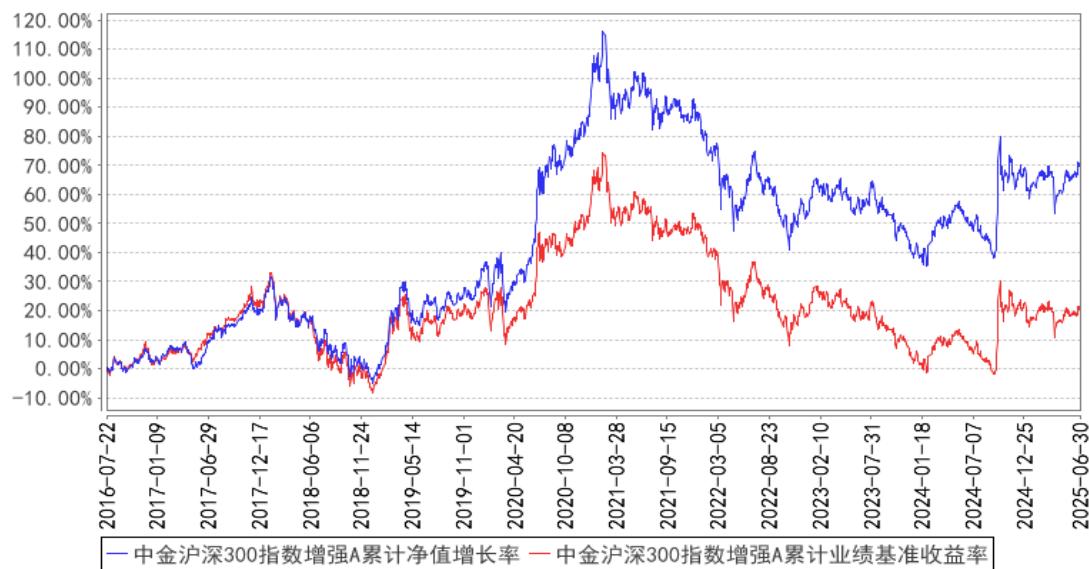
中金沪深 300C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3. 09%	0. 53%	2. 37%	0. 55%	0. 72%	-0. 02%
过去三个月	2. 58%	1. 07%	1. 21%	1. 04%	1. 37%	0. 03%
过去六个月	1. 86%	0. 97%	0. 07%	0. 97%	1. 79%	0. 00%

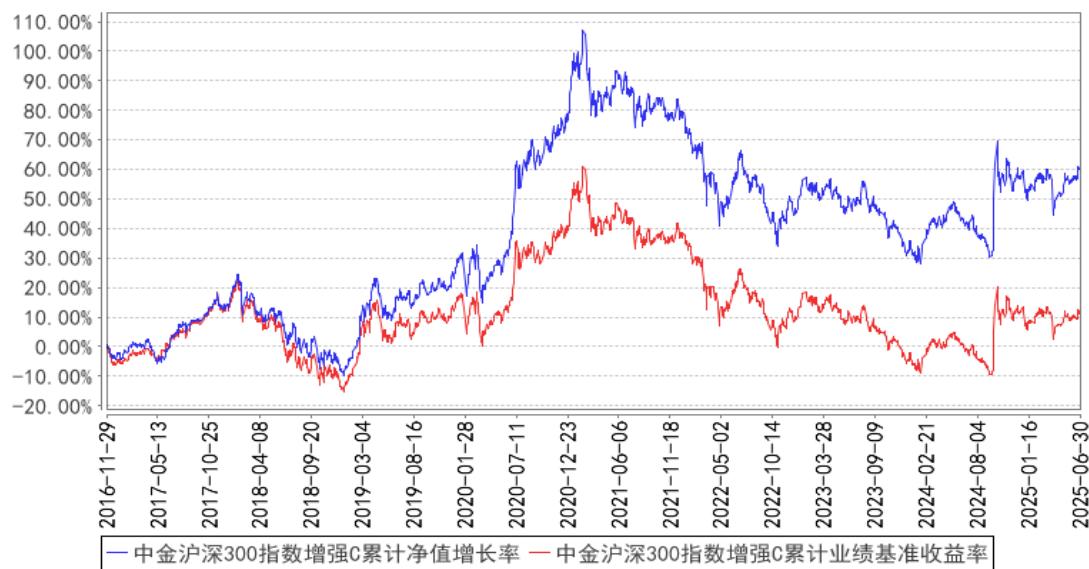
过去一年	13.29%	1.28%	13.12%	1.32%	0.17%	-0.04%
过去三年	-2.97%	1.01%	-11.43%	1.05%	8.46%	-0.04%
自基金合同生效起 至今	60.39%	1.09%	11.69%	1.12%	48.70%	-0.03%

### 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

中金沪深300指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中金沪深300指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 7 亿元人民币。母公司中金公司致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 60 只公募基金，证券投资基金管理规模 2,201.82 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
耿帅军	本基金基 金经理	2020 年 10 月 29 日	-	14 年	耿帅军先生，理学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所金融工程分析师；中信证券股份有限公司研究部副总裁、金融工程分析师；中国国际金融股份有限公司研究部执行总经理、金融工程分析师。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。
王阳峰	本基金基 金经理	2022 年 1 月 14 日	-	12 年	王阳峰先生，理学硕士。历任泰达宏利基金管理有限公司金融工程部投资经理；嘉实基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人作出决定确定的任免日期填写；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2、本基金无基金经理助理。

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、

研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规规定和基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，中国经济运行稳中有进，生产稳定增长，需求继续恢复，新动能成长壮大。虽然二季度以来，美国关税政策推出对全球金融市场造成扰动，也对中国经济外部需求造成冲击，但国内经济支持政策对内需继续改善起到了有效的支撑和提振作用，经济增速延续了一季度以来的复苏态势。上半年，GDP 同比增长 5.3%，CPI 同比下降 0.1%，M2 同比增长 8.3%。

经济平稳增长，结构亮点增多，流动性合理充裕，资本市场风险偏好持续改善。在此背景下，A 股市场上半年始终不乏投资主线，体现出了不错的赚钱效应。虽然二季度初在外部冲击下出现快速调整，但市场迅速企稳，逐步反弹，截至年中，主要宽基均基本收复回撤。沪深 300、中证 500、中证 1000 和中证 A500 等代表性规模宽基指数，上半年分别上涨 0.03%、3.31%、6.69% 和 0.47%。风格上，价值相对成长占优，小盘相对表现突出。行业方面，综合金融、有色金属、银行等涨幅较多，食品饮料、房地产、煤炭等相对落后。

在报告期内，本组合严格遵守基金合同的约定，基于深入的研究和完备的风控流程进行组合管理，在严格控制组合偏离度的基础上，利用量化选股策略精选个股，在控制组合跟踪误差的同时增强基金阿尔法收益。未来将继续努力开发和改进选股策略，在遵守合同和法律法规的前提下管理组合，争取在超额收益方面有更好的表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金沪深 300A 基金份额净值为 1.7034 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.05%，同期业绩基准收益率为 0.07%；中金沪深 300C 基金份额净值为 1.7069 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.86%，同期业绩基准收益率为 0.07%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，全球贸易环境不确定性上升已逐渐成为基准假设，预计国内仍将保持战略定力，延续“坚定不移办好自己的事，坚定不移扩大高水平对外开放”的政策基调，宏观经济有望在政策发力见效的支持下延续平稳增长，经济结构调整深化则将为市场提供较多的投资机遇。上市公司盈利能力有机会延续上半年的改善势头，从而支撑中国资产的内在价值持续提升。当前市场风险溢价处于中性水平，预计未来市场将更多定价基本面的边际变化。

在组合管理过程中，我们将更加注重在不确定性中寻找相对确定性，坚持系统化投资理念，坚守投资规则和纪律，加强策略跟踪和归因，继续努力开发和改进选股策略，不断储备具备长期风险溢价的投资策略，并基于策略特点动态调整各类风险溢价的配置结构，努力为投资人获取长期稳健超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

基金管理人建立并执行基金估值相关管理制度，设置估值委员会研究、指导基金估值业务。各估值委员会委员和基金会计均具有相关工作经历和专业胜任能力。参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金管理办法》的规定以及本基金基金合同中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——中金基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6. 4. 7. 1	7,900,081.22	5,604,257.64
结算备付金		4,185,821.86	5,020,200.63
存出保证金		240,537.79	460,373.43
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	1,104,677,200.13	1,159,646,885.56
其中：股票投资		1,043,634,592.07	1,095,097,652.87
基金投资		-	-
债券投资		61,042,608.06	64,549,232.69
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6. 4. 7. 3	-	-
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	-	-
债权投资	6. 4. 7. 5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6. 4. 7. 6	-	-
其他权益工具投资	6. 4. 7. 7	-	-
应收清算款		17,496,291.94	29,266,325.53
应收股利		-	-
应收申购款		1,850,274.75	6,648,895.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-
资产总计		1,136,350,207.69	1,206,646,938.15
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年6月30日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		7,000,000.00	15,999,422.86
应付清算款		12,062,606.61	-
应付赎回款		8,244,067.46	24,495,351.24
应付管理人报酬		480,935.43	576,018.74
应付托管费		144,280.62	172,805.63
应付销售服务费		145,423.63	179,933.39
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 9	789,024.85	1,016,008.23
负债合计		28,866,338.60	42,439,540.09
<b>净资产：</b>			
实收基金	6. 4. 7. 10	649,838,221.04	696,639,217.77
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	457,645,648.05	467,568,180.29
净资产合计		1,107,483,869.09	1,164,207,398.06
负债和净资产总计		1,136,350,207.69	1,206,646,938.15

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日， 中金沪深 300A 的基金份额净值为 1.7034 元， 期末份额总额为 500,513,646.43 份； 中金沪深 300C 的基金份额净值为 1.7069 元， 期末份额总额为 149,324,574.61 份。 基金份额总额 649,838,221.04 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		27,543,928.36	11,091,467.23
1. 利息收入		37,750.77	25,276.02
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	37,750.77	25,276.02
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 号填列）		41,660,219.98	2,916,571.99
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	25,640,858.75	-5,753,634.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	387,692.52	232,247.74
资产支持证券投资 收益	6. 4. 7. 16	-	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	-	305,616.41
股利收益	6. 4. 7. 19	15,631,668.71	8,132,342.10
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	-14,289,888.92	8,040,530.92
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6. 4. 7. 21	135,846.53	109,088.30
<b>减：二、营业总支出</b>		4,809,001.62	2,114,126.39
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	2,954,411.85	1,177,472.45
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	886,323.50	353,241.72
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	731,232.09	430,835.93
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		98,547.92	29,303.53
其中：卖出回购金融资产 支出		98,547.92	29,303.53
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	1,181.71

8. 其他费用	6. 4. 7. 23	138, 486. 26	122, 091. 05
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		22, 734, 926. 74	8, 977, 340. 84
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		22, 734, 926. 74	8, 977, 340. 84
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		22, 734, 926. 74	8, 977, 340. 84

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	696, 639, 217. 77	-	467, 568, 180. 29	1, 164, 207, 398. 06
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	696, 639, 217. 77	-	467, 568, 180. 29	1, 164, 207, 398. 06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-46, 800, 996. 73	-	-9, 922, 532. 24	-56, 723, 528. 97
(一)、综合收益总额	-	-	22, 734, 926. 74	22, 734, 926. 74
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-46, 800, 996. 73	-	-32, 657, 458. 98	-79, 458, 455. 71
其中：1. 基金申购款	655, 738, 649. 48	-	424, 133, 210. 58	1, 079, 871, 860. 06
2. 基金赎回款	-702, 539, 646. 2	-	-456, 790, 669. 5	-1, 159, 330, 315.

	1		6	77
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	649,838,221.04	-	457,645,648.05	1,107,483,869.09
项目 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日				
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	236,950,528.44	-	103,738,602.85	340,689,131.29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	236,950,528.44	-	103,738,602.85	340,689,131.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	263,131,878.18	-	147,754,040.62	410,885,918.80
(一)、综合收益总额	-	-	8,977,340.84	8,977,340.84
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	263,131,878.18	-	138,776,699.78	401,908,577.96
其中：1. 基金申购款	437,388,541.81	-	222,230,489.70	659,619,031.51
2. 基金赎回款	-174,256,663.63	-	-83,453,789.92	-257,710,453.55
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动(净资产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	500,082,406.62	-	251,492,643.47	751,575,050.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

宗喆

二

白娜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2016 年 7 月 5 日证监许可[2016]1516 号《关于准予中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式指数型基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金,托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

本基金通过中金基金直销中心、中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)及中国中金财富证券有限公司(以下简称“中金财富证券”)公开发售,募集期为 2016 年 7 月 18 日。经向中国证监会备案,《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2016 年 7 月 22 日正式生效,合同生效日基金实收份额为 10,001,300.00 份,发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金销售费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,

计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股(含存托凭证)。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、存托凭证、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金管理有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌

公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	7,900,081.22
等于：本金	7,898,983.38
加：应计利息	1,097.84
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	7,900,081.22

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		1,004,349,076.06	-	1,043,634,592.07	39,285,516.01
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	60,541,723.60	518,048.06	61,042,608.06	-17,163.60
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	60,541,723.60	518,048.06	61,042,608.06	-17,163.60
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,064,890,799.66	518,048.06	1,104,677,200.13	39,268,352.41

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	655,251.96
其中：交易所市场	655,251.96
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,739.85
应付指数使用费	40,192.33
其他	1,840.71
合计	789,024.85

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金沪深 300A

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	489,950,881.22	489,950,881.22
本期申购	304,131,106.74	304,131,106.74
本期赎回(以“-”号填列)	-293,568,341.53	-293,568,341.53
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	500,513,646.43	500,513,646.43

中金沪深 300C

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年6月30日	基金份额(份)
上年度末	206,688,336.55	206,688,336.55
本期申购	351,607,542.74	351,607,542.74
本期赎回(以“-”号填列)	-408,971,304.68	-408,971,304.68
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	149,324,574.61	149,324,574.61

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 中金沪深 300A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	257,598,090.18	70,285,283.89	327,883,374.07
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	257,598,090.18	70,285,283.89	327,883,374.07
本期利润	24,410,645.07	-18,162,047.95	6,248,597.12
本期基金份额交易产生的变动数	8,824,697.95	9,128,891.20	17,953,589.15
其中：基金申购款	169,109,355.36	32,106,247.67	201,215,603.03
基金赎回款	-160,284,657.41	-22,977,356.47	-183,262,013.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	290,833,433.20	61,252,127.14	352,085,560.34

##### 中金沪深 300C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	109,517,170.24	30,167,635.98	139,684,806.22
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	109,517,170.24	30,167,635.98	139,684,806.22
本期利润	12,614,170.59	3,872,159.03	16,486,329.62
本期基金份额交易产生的变动数	-35,200,313.23	-15,410,734.90	-50,611,048.13
其中：基金申购款	193,906,420.33	29,011,187.22	222,917,607.55
基金赎回款	-229,106,733.56	-44,421,922.12	-273,528,655.68
本期已分配利润	-	-	-

本期末	86,931,027.60	18,629,060.11	105,560,087.71
-----	---------------	---------------	----------------

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	19,836.65
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	9,795.73
其他	8,118.39
合计	37,750.77

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	25,640,858.75
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	25,640,858.75

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	3,706,700,803.63
减：卖出股票成本总额	3,677,297,843.60
减：交易费用	3,762,101.28
买卖股票差价收入	25,640,858.75

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	450,872.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-63,180.36
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	387,692.52

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	53,587,055.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	52,860,230.36
减：应计利息总额	790,005.89
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-63,180.36

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末未持有贵金属。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	15,631,668.71
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,631,668.71

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	-14,289,888.92
股票投资	-14,242,395.28
债券投资	-47,493.64
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-14,289,888.92

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	134,588.35
基金转换费收入	1,258.18
合计	135,846.53

### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	40,192.33
划款手续费	6,554.08
合计	138,486.26

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
工商银行	基金托管人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中金财富证券	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30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 (%)
中金公司	1,752,909,358.71	23.87	-	-

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
中金公司	3,989,840.00	6.59	-	-

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
中金公司	330,100,000.00	27.85	-	-

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	343,414.42	23.87	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结

算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金管理费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。该类佣金协议已根据此规定完成了更新。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,954,411.85	1,177,472.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	737,607.74	348,122.59
应支付基金管理人的净管理费	2,216,804.11	829,349.86

注：支付基金管理人中金基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	886,323.50	353,241.72

注：支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联 方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金沪深 300 指数增 强 A	中金沪深 300 指数增 强 C	合计
工商银行	-	237.70	237.70

中金财富证券	-	28,727.21	28,727.21
中金基金	-	269,592.57	269,592.57
合计	-	298,557.48	298,557.48
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
当期发生的基金应支付的销售服务费			
获得销售服务费的各关联方名称	中金沪深 300 指数增强 A	中金沪深 300 指数增强 C	合计
中金财富证券	-	16,134.89	16,134.89
中金基金	-	110,301.55	110,301.55
合计	-	126,436.44	126,436.44

注：本基金仅针对 C 类基金份额收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日该类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C 类基金日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	7,900,081.22	19,836.65	4,843,787.82	15,894.56

注：本基金的活期银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中金公司	688775	影石创新	网下	5,725	270,620.75
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中金公司	688584	上海合晶	网下	4,999	113277.34
中金公司	301588	美新科技	网下	2,568	37,236.00
中金公司	301536	星宸科技	网下	4,809	77713.44
中金公司	688530	欧莱新材	网下	3,437	32,995.20

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001388	信通电子	2025年6月24日	1-6个月（含）	新股流通受限	16.42	16.42	937	15,385.54	15,385.54	-
001390	古	2025	6个月	新股	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-

	麒 绒 材	年5月 21日		流通 受限						
301458	钧 威 电 子	2025 年1月 2日	6 个 月	新股 流通 受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301560	众 捷 汽 车	2025 年4月 17日	6 个 月	新股 流通 受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优 优 绿 能	2025 年5月 28日	6 个 月	新股 流通 受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太 力 科 技	2025 年5月 12日	6 个 月	新股 流通 受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301662	宏 工 科 技	2025 年4月 10日	6 个 月	新股 流通 受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
603014	威 高 血 净	2025 年5月 12日	6 个 月	新股 流通 受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中 策 橡 胶	2025 年5月 27日	6 个 月	新股 流通 受限	46.50	42.85	558	25,947.00	23,910.30	-
603072	天 和 磁 材	2024 年12 月24 日	6 个 月	新股 流通 受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603202	天 有 为	2025 年4月 16日	6 个 月	新股 流通 受限	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	-
603257	中 国 瑞 林	2025 年3月 28日	6 个 月	新股 流通 受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603382	海 阳	2025 年6月	6 个 月	新股 流通	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-

	科技	5 日		受限						
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-

#### 6.4.12.2 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
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	17,821	552,464.16	678,089.05	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2025 年 6 月 30 日，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 7,000,000.00 元，于 2025 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型股票基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币

市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

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

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。(上年度末：同)

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。(上年度末：同)

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。(上年度末：同)

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。(上年度末：同)

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。(上年度末：同)

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。(上年度末：同)

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年6月30日	1年内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	7,898,983.38	-	-	1,097.84	7,900,081.22
结算备付金	4,136,364.09	-	-	49,457.77	4,185,821.86
存出保证金	240,514.39	-	-	23.40	240,537.79
交易性金融资产	60,524,560.00	-	-	1,044,152,640.13	1,104,677,200.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	17,496,291.94	17,496,291.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,850,274.75	1,850,274.75
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>72,800,421.86</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,063,549,785.83</b>	<b>1,136,350,207.69</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	7,000,000.00	-	-	-	7,000,000.00
应付清算款	-	-	-	12,062,606.61	12,062,606.61
应付赎回款	-	-	-	8,244,067.46	8,244,067.46
应付销售服务费	-	-	-	145,423.63	145,423.63
应付管理人报酬	-	-	-	480,935.43	480,935.43
应付托管费	-	-	-	144,280.62	144,280.62
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	789,024.85	789,024.85
<b>负债总计</b>	<b>7,000,000.00</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>21,866,338.60</b>	<b>28,866,338.60</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>65,800,421.86</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,041,683,447.23</b>	<b>1,107,483,869.09</b>
上年度末 2024年12月31日	1年内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	5,603,548.91	-	-	708.73	5,604,257.64
结算备付金	4,968,685.57	-	-	51,515.06	5,020,200.63
存出保证金	460,145.62	-	-	227.81	460,373.43
交易性金融资产	63,848,300.00	-	-	1,095,798,585.56	1,159,646,885.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	29,266,325.53	29,266,325.53
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	6,648,895.36	6,648,895.36
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>74,880,680.10</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,131,766,258.05</b>	<b>1,206,646,938.15</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	16,000,000.00	-	-	-577.14	15,999,422.86
应付清算款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	24,495,351.24	24,495,351.24
应付销售服务费	-	-	-	179,933.39	179,933.39
应付管理人报酬	-	-	-	576,018.74	576,018.74
应付托管费	-	-	-	172,805.63	172,805.63
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,016,008.23	1,016,008.23
负债总计	16,000,000.00	-	-	26,439,540.09	42,439,540.09
利率敏感度缺口	58,880,680.10	-	-	-1,105,326,717.96	1,164,207,398.06

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	51,375.79	53,882.30
	市场利率上升 25 个基点	-51,375.79	-53,882.30

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024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	1,043,634,592.07	94.23	1,095,097,652.87	94.06
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	1,043,634,592.07	94.23	1,095,097,652.87	94.06

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	53,159,225.72	55,299,851.41
	业绩比较基准下降5%	-53,159,225.72	-55,299,851.41

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	1,042,725,530.44	1,087,465,199.23
第二层次	61,736,082.65	71,838,379.97
第三层次	215,587.04	343,306.36
合计	1,104,677,200.13	1,159,646,885.56

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末无非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,043,634,592.07	91.84
	其中：股票	1,043,634,592.07	91.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	61,042,608.06	5.37
	其中：债券	61,042,608.06	5.37

	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	12,085,903.08	1.06
8	其他各项资产	19,587,104.48	1.72
9	合计	1,136,350,207.69	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,688,985.18	0.69
B	采矿业	48,714,182.88	4.40
C	制造业	512,832,499.20	46.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,050,414.76	2.71
E	建筑业	23,398,338.00	2.11
F	批发和零售业	1,886,596.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	31,436,942.06	2.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,444,059.90	3.29
J	金融业	283,879,426.37	25.63
K	房地产业	568,434.00	0.05
L	租赁和商务服务业	4,993,897.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	18,743,124.00	1.69
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,978,087.04	0.81
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,009,614,986.39	91.16

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	416,645.00	0.04
C	制造业	24,569,999.52	2.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,183,719.00	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	813,991.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,076,400.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,362,050.00	0.12
J	金融业	520,710.00	0.05
K	房地产业	1,285,536.00	0.12
L	租赁和商务服务业	70,664.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	361,497.16	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,358,394.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	34,019,605.68	3.07

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	34,201	48,206,993.52	4.35
2	300750	宁德时代	131,600	33,192,152.00	3.00
3	000333	美的集团	340,799	24,605,687.80	2.22
4	601899	紫金矿业	1,185,600	23,119,200.00	2.09
5	600036	招商银行	494,448	22,719,885.60	2.05
6	601318	中国平安	384,779	21,347,538.92	1.93

7	601211	国泰海通	986,100	18,893,676.00	1.71
8	603259	药明康德	243,540	16,938,207.00	1.53
9	600000	浦发银行	1,197,587	16,622,507.56	1.50
10	300502	新易盛	121,271	15,403,842.42	1.39
11	600276	恒瑞医药	286,680	14,878,692.00	1.34
12	601166	兴业银行	612,158	14,287,767.72	1.29
13	000725	京东方 A	3,551,300	14,169,687.00	1.28
14	688008	澜起科技	159,243	13,057,926.00	1.18
15	601919	中远海控	837,682	12,598,737.28	1.14
16	600926	杭州银行	713,617	12,003,037.94	1.08
17	300274	阳光电源	172,539	11,692,968.03	1.06
18	600900	长江电力	385,534	11,619,994.76	1.05
19	601229	上海银行	1,073,498	11,389,813.78	1.03
20	600919	江苏银行	934,489	11,157,798.66	1.01
21	600031	三一重工	612,300	10,990,785.00	0.99
22	000100	TCL 科技	2,535,640	10,979,321.20	0.99
23	603288	海天味业	272,501	10,603,013.91	0.96
24	000651	格力电器	232,400	10,439,408.00	0.94
25	600030	中信证券	377,840	10,435,940.80	0.94
26	002594	比亚迪	30,400	10,090,064.00	0.91
27	688256	寒武纪	16,710	10,051,065.00	0.91
28	600660	福耀玻璃	176,067	10,037,579.67	0.91
29	002001	新 和 成	465,500	9,901,185.00	0.89
30	601319	中国人保	1,119,300	9,749,103.00	0.88
31	000858	五 粮 液	81,252	9,660,862.80	0.87
32	601916	浙商银行	2,823,900	9,573,021.00	0.86
33	600160	巨化股份	332,400	9,533,232.00	0.86
34	300124	汇川技术	146,000	9,427,220.00	0.85
35	601868	中国能建	4,106,900	9,158,387.00	0.83
36	600482	中国动力	392,400	9,052,668.00	0.82
37	300015	爱尔眼科	719,398	8,978,087.04	0.81
38	601818	光大银行	2,116,000	8,781,400.00	0.79
39	002230	科大讯飞	179,800	8,608,824.00	0.78
40	002736	国信证券	743,700	8,567,424.00	0.77
41	601009	南京银行	732,700	8,513,974.00	0.77
42	000425	徐工机械	1,083,800	8,421,126.00	0.76
43	600183	生益科技	266,300	8,028,945.00	0.72
44	601901	方正证券	989,400	7,826,154.00	0.71
45	601766	中国中车	1,100,000	7,744,000.00	0.70
46	605499	东鹏饮料	24,250	7,615,712.50	0.69
47	000157	中联重科	1,041,500	7,530,045.00	0.68
48	600219	南山铝业	1,814,000	6,947,620.00	0.63
49	688111	金山办公	24,688	6,913,874.40	0.62

50	601857	中国石油	800,900	6,847,695.00	0.62
51	600690	海尔智家	265,370	6,575,868.60	0.59
52	601601	中国太保	174,790	6,556,372.90	0.59
53	601688	华泰证券	360,100	6,413,381.00	0.58
54	000708	中信特钢	544,800	6,406,848.00	0.58
55	601169	北京银行	931,400	6,361,462.00	0.57
56	300033	同花顺	23,200	6,333,832.00	0.57
57	688082	盛美上海	55,422	6,314,782.68	0.57
58	601117	中国化学	798,300	6,122,961.00	0.55
59	300059	东方财富	264,206	6,111,084.78	0.55
60	000975	山金国际	316,200	5,988,828.00	0.54
61	000408	藏格矿业	139,700	5,960,999.00	0.54
62	002463	沪电股份	138,600	5,901,588.00	0.53
63	601288	农业银行	999,100	5,874,708.00	0.53
64	002142	宁波银行	213,300	5,835,888.00	0.53
65	300308	中际旭创	39,500	5,761,470.00	0.52
66	600460	士兰微	230,900	5,730,938.00	0.52
67	601628	中国人寿	138,500	5,704,815.00	0.52
68	300408	三环集团	168,029	5,612,168.60	0.51
69	000166	申万宏源	1,098,500	5,514,470.00	0.50
70	601077	渝农商行	759,800	5,424,972.00	0.49
71	300014	亿纬锂能	118,400	5,423,904.00	0.49
72	002352	顺丰控股	109,900	5,358,724.00	0.48
73	000338	潍柴动力	334,400	5,143,072.00	0.46
74	000538	云南白药	91,560	5,108,132.40	0.46
75	002714	牧原股份	119,318	5,012,549.18	0.45
76	600025	华能水电	517,200	4,939,260.00	0.45
77	601728	中国电信	635,900	4,928,225.00	0.44
78	300628	亿联网络	141,400	4,915,064.00	0.44
79	601988	中国银行	810,400	4,554,448.00	0.41
80	000596	古井贡酒	33,700	4,487,155.00	0.41
81	600018	上港集团	783,100	4,471,501.00	0.40
82	600050	中国联通	812,600	4,339,284.00	0.39
83	600066	宇通客车	173,400	4,310,724.00	0.39
84	603799	华友钴业	115,587	4,279,030.74	0.39
85	600176	中国巨石	371,900	4,239,660.00	0.38
86	002027	分众传媒	576,500	4,208,450.00	0.38
87	601328	交通银行	524,250	4,194,000.00	0.38
88	603993	洛阳钼业	482,949	4,066,430.58	0.37
89	601998	中信银行	462,400	3,930,400.00	0.35
90	000568	泸州老窖	34,398	3,900,733.20	0.35
91	002311	海大集团	66,100	3,872,799.00	0.35
92	601600	中国铝业	513,800	3,617,152.00	0.33

93	601668	中国建筑	600,800	3,466,616.00	0.31
94	002371	北方华创	7,500	3,316,575.00	0.30
95	002920	德赛西威	32,400	3,309,012.00	0.30
96	600674	川投能源	200,800	3,220,832.00	0.29
97	600600	青岛啤酒	45,700	3,174,322.00	0.29
98	603833	欧派家居	56,000	3,161,200.00	0.29
99	000001	平安银行	259,800	3,135,786.00	0.28
100	000983	山西焦煤	471,800	3,019,520.00	0.27
101	000776	广发证券	177,863	2,989,877.03	0.27
102	600887	伊利股份	102,635	2,861,463.80	0.26
103	600989	宝丰能源	173,100	2,793,834.00	0.25
104	600150	中国船舶	84,400	2,746,376.00	0.25
105	601618	中国中冶	905,400	2,698,092.00	0.24
106	601816	京沪高铁	468,800	2,695,600.00	0.24
107	605117	德业股份	51,042	2,687,871.72	0.24
108	300498	温氏股份	156,700	2,676,436.00	0.24
109	600027	华电国际	488,200	2,670,454.00	0.24
110	603986	兆易创新	21,100	2,669,783.00	0.24
111	601799	星宇股份	20,600	2,575,000.00	0.23
112	601138	工业富联	112,100	2,396,698.00	0.22
113	600377	宁沪高速	152,500	2,339,350.00	0.21
114	000301	东方盛虹	260,100	2,166,633.00	0.20
115	600905	三峡能源	503,400	2,144,484.00	0.19
116	600104	上汽集团	132,700	2,129,835.00	0.19
117	600999	招商证券	120,400	2,117,836.00	0.19
118	002475	立讯精密	55,300	1,918,357.00	0.17
119	600011	华能国际	267,200	1,907,808.00	0.17
120	300759	康龙化成	73,550	1,804,917.00	0.16
121	600111	北方稀土	68,863	1,714,688.70	0.15
122	601808	中海油服	122,700	1,688,352.00	0.15
123	002415	海康威视	60,826	1,686,704.98	0.15
124	000625	长安汽车	131,400	1,676,664.00	0.15
125	601881	中国银河	95,819	1,643,295.85	0.15
126	601127	赛力斯	12,200	1,638,704.00	0.15
127	601877	正泰电器	71,826	1,628,295.42	0.15
128	603369	今世缘	41,600	1,619,488.00	0.15
129	601939	建设银行	171,400	1,618,016.00	0.15
130	600741	华域汽车	90,000	1,588,500.00	0.14
131	600795	国电电力	325,400	1,574,936.00	0.14
132	601800	中国交建	172,500	1,533,525.00	0.14
133	601066	中信建投	63,755	1,533,307.75	0.14
134	688009	中国通号	281,073	1,444,715.22	0.13
135	603501	豪威集团	11,200	1,429,680.00	0.13

136	600009	上海机场	45,000	1,429,650.00	0.13
137	600085	同仁堂	38,300	1,381,098.00	0.12
138	600019	宝钢股份	205,300	1,352,927.00	0.12
139	601336	新华保险	22,700	1,327,950.00	0.12
140	601898	中煤能源	120,800	1,321,552.00	0.12
141	600089	特变电工	110,300	1,315,879.00	0.12
142	002648	卫星化学	74,280	1,287,272.40	0.12
143	688396	华润微	24,384	1,149,949.44	0.10
144	000977	浪潮信息	22,600	1,149,888.00	0.10
145	002600	领益智造	133,200	1,144,188.00	0.10
146	600115	中国东航	277,000	1,116,310.00	0.10
147	002236	大华股份	68,800	1,092,544.00	0.10
148	600015	华夏银行	133,200	1,053,612.00	0.10
149	002493	荣盛石化	126,952	1,051,162.56	0.09
150	600875	东方电气	60,382	1,010,794.68	0.09
151	601236	红塔证券	119,300	1,010,471.00	0.09
152	601607	上海医药	54,500	974,460.00	0.09
153	000630	铜陵有色	291,600	973,944.00	0.09
154	600332	白云山	35,200	927,872.00	0.08
155	000963	华东医药	22,600	912,136.00	0.08
156	603296	华勤技术	11,300	911,684.00	0.08
157	600803	新奥股份	47,200	892,080.00	0.08
158	600016	民生银行	178,200	846,450.00	0.08
159	300433	蓝思科技	37,895	845,058.50	0.08
160	688981	中芯国际	9,520	839,378.40	0.08
161	600547	山东黄金	25,400	811,022.00	0.07
162	601838	成都银行	40,000	804,000.00	0.07
163	600161	天坛生物	41,800	802,142.00	0.07
164	601989	中国重工	165,000	765,600.00	0.07
165	002050	三花智控	27,800	733,364.00	0.07
166	002938	鹏鼎控股	21,700	695,051.00	0.06
167	002304	洋河股份	10,300	664,865.00	0.06
168	688126	沪硅产业	35,461	663,829.92	0.06
169	300760	迈瑞医疗	2,900	651,775.00	0.06
170	600415	小商品城	31,200	645,216.00	0.06
171	000876	新希望	66,900	627,522.00	0.06
172	001965	招商公路	52,200	626,400.00	0.06
173	600023	浙能电力	118,100	625,930.00	0.06
174	300999	金龙鱼	20,200	596,506.00	0.05
175	600010	包钢股份	331,000	592,490.00	0.05
176	603392	万泰生物	9,700	591,700.00	0.05
177	600958	东方证券	58,056	561,982.08	0.05
178	002180	纳思达	24,400	559,736.00	0.05

179	688012	中微公司	2,842	518,096.60	0.05
180	600406	国电南瑞	21,884	490,420.44	0.04
181	600188	兖矿能源	40,090	487,895.30	0.04
182	600941	中国移动	4,000	450,200.00	0.04
183	601088	中国神华	10,400	421,616.00	0.04
184	002241	歌尔股份	17,800	415,096.00	0.04
185	002179	中航光电	9,600	387,456.00	0.03
186	002709	天赐材料	21,100	382,332.00	0.03
187	600570	恒生电子	11,389	381,987.06	0.03
188	601872	招商轮船	56,100	351,186.00	0.03
189	600048	保利发展	40,100	324,810.00	0.03
190	600426	华鲁恒升	14,700	318,549.00	0.03
191	601633	长城汽车	14,700	315,756.00	0.03
192	600938	中国海油	10,700	279,377.00	0.03
193	601225	陕西煤业	12,700	244,348.00	0.02
194	600028	中国石化	43,100	243,084.00	0.02
195	601377	兴业证券	33,800	209,222.00	0.02
196	600436	片仔癀	1,000	200,010.00	0.02
197	688041	海光信息	1,384	195,545.36	0.02
198	600893	航发动力	4,600	177,284.00	0.02
199	601012	隆基绿能	11,637	174,787.74	0.02
200	601390	中国中铁	31,100	174,471.00	0.02
201	001979	招商蛇口	19,800	173,646.00	0.02
202	600760	中航沈飞	2,960	173,515.20	0.02
203	300979	华利集团	3,300	173,481.00	0.02
204	688036	传音控股	1,800	143,460.00	0.01
205	603019	中科曙光	2,000	140,800.00	0.01
206	001289	龙源电力	8,700	140,766.00	0.01
207	600489	中金黄金	9,600	140,448.00	0.01
208	601888	中国中免	2,300	140,231.00	0.01
209	601658	邮储银行	25,600	140,032.00	0.01
210	000063	中兴通讯	4,300	139,707.00	0.01
211	600309	万华化学	2,572	139,556.72	0.01
212	600585	海螺水泥	6,500	139,555.00	0.01
213	601006	大秦铁路	21,100	139,260.00	0.01
214	601111	中国国航	17,600	138,864.00	0.01
215	603195	公牛集团	2,869	138,429.25	0.01
216	688506	百利天恒	400	118,448.00	0.01
217	600809	山西汾酒	640	112,889.60	0.01
218	600346	恒力石化	7,400	105,524.00	0.01
219	600029	南方航空	17,800	105,020.00	0.01
220	000895	双汇发展	4,300	104,963.00	0.01
221	601186	中国铁建	13,100	104,931.00	0.01

222	003816	中国广核	28,800	104,832.00	0.01
223	601669	中国电建	21,500	104,705.00	0.01
224	600886	国投电力	7,100	104,654.00	0.01
225	002916	深南电路	970	104,575.70	0.01
226	000617	中油资本	14,300	104,390.00	0.01
227	601985	中国核电	11,200	104,384.00	0.01
228	002049	紫光国微	1,100	72,446.00	0.01
229	600438	通威股份	4,300	72,025.00	0.01
230	601100	恒立液压	1,000	72,000.00	0.01
231	300394	天孚通信	900	71,856.00	0.01
232	002460	赣锋锂业	2,100	70,917.00	0.01
233	601689	拓普集团	1,500	70,875.00	0.01
234	600845	宝信软件	3,000	70,860.00	0.01
235	600584	长电科技	2,100	70,749.00	0.01
236	601360	三六零	6,900	70,380.00	0.01
237	000807	云铝股份	4,400	70,312.00	0.01
238	600362	江西铜业	3,000	70,290.00	0.01
239	600196	复星医药	2,800	70,252.00	0.01
240	601788	光大证券	3,900	70,122.00	0.01
241	000002	万科 A	10,900	69,978.00	0.01
242	601238	广汽集团	9,319	69,799.31	0.01
243	000999	华润三九	2,230	69,754.40	0.01
244	601698	中国卫通	3,400	69,598.00	0.01
245	000938	紫光股份	2,900	69,571.00	0.01
246	002252	上海莱士	10,119	69,517.53	0.01
247	300442	润泽科技	1,400	69,342.00	0.01
248	000768	中航西飞	2,500	68,350.00	0.01
249	002028	思源电气	900	65,619.00	0.01
250	300661	圣邦股份	520	37,840.40	0.00
251	688223	晶科能源	7,022	36,444.18	0.00
252	002601	龙佰集团	2,200	35,662.00	0.00
253	601058	赛轮轮胎	2,700	35,424.00	0.00
254	603806	福斯特	2,700	34,992.00	0.00
255	600372	中航机载	2,900	34,974.00	0.00
256	300896	爱美客	200	34,962.00	0.00
257	002459	晶澳科技	3,500	34,930.00	0.00
258	601699	潞安环能	3,300	34,815.00	0.00
259	600233	圆通速递	2,700	34,803.00	0.00
260	600039	四川路桥	3,500	34,650.00	0.00
261	000786	北新建材	1,300	34,424.00	0.00
262	601059	信达证券	2,000	34,200.00	0.00
263	300832	新产业	600	34,032.00	0.00
264	603260	合盛硅业	700	33,180.00	0.00

265	001391	国货航	4,686	31,536.78	0.00
266	688187	时代电气	376	16,036.40	0.00

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300548	长芯博创	36,300	2,423,751.00	0.22
2	300476	胜宏科技	17,300	2,324,774.00	0.21
3	300251	光线传媒	88,900	1,802,003.00	0.16
4	603659	璞泰来	74,400	1,397,232.00	0.13
5	600745	闻泰科技	38,493	1,290,670.29	0.12
6	002102	能特科技	374,900	1,184,684.00	0.11
7	603113	金能科技	162,300	1,124,739.00	0.10
8	600675	中华企业	385,900	1,111,392.00	0.10
9	002846	英联股份	55,300	1,103,788.00	0.10
10	002479	富春环保	215,300	1,078,653.00	0.10
11	600179	安通控股	390,000	1,076,400.00	0.10
12	688685	迈信林	17,578	981,731.30	0.09
13	688313	仕佳光子	17,821	678,089.05	0.06
14	002546	新联电子	108,100	593,469.00	0.05
15	300166	东方国信	54,000	588,600.00	0.05
16	002185	华天科技	58,100	586,810.00	0.05
17	601212	白银有色	177,100	554,323.00	0.05
18	002891	中宠股份	8,600	532,082.00	0.05
19	600267	海正药业	56,700	524,475.00	0.05
20	603586	金麒麟	28,500	522,120.00	0.05
21	600517	国网英大	102,100	520,710.00	0.05
22	600688	上海石化	182,700	520,695.00	0.05
23	300570	太辰光	5,400	520,452.00	0.05
24	603858	步长制药	30,200	490,448.00	0.04
25	000523	红棉股份	150,100	489,326.00	0.04
26	603766	隆鑫通用	38,000	484,880.00	0.04
27	000554	泰山石油	65,800	465,206.00	0.04
28	300573	兴齐眼药	8,860	458,859.40	0.04
29	300001	特锐德	19,100	457,827.00	0.04
30	002728	特一药业	54,200	455,822.00	0.04
31	688122	西部超导	8,156	423,133.28	0.04
32	002739	万达电影	36,500	417,195.00	0.04
33	688578	艾力斯	4,152	386,302.08	0.03
34	688088	虹软科技	7,388	356,471.00	0.03
35	002170	芭田股份	34,100	349,525.00	0.03
36	601113	华鼎股份	88,300	348,785.00	0.03
37	600685	中船防务	12,800	348,032.00	0.03
38	301061	匠心家居	4,190	324,892.60	0.03

39	688606	奥泰生物	4,800	322,560.00	0.03
40	603322	超讯通信	7,900	311,892.00	0.03
41	000893	亚钾国际	10,300	310,442.00	0.03
42	603129	春风动力	1,300	281,450.00	0.03
43	000729	燕京啤酒	21,700	280,581.00	0.03
44	300976	达瑞电子	5,040	250,941.60	0.02
45	002245	蔚蓝锂芯	19,200	246,336.00	0.02
46	300926	博俊科技	9,200	243,524.00	0.02
47	600338	西藏珠峰	21,900	242,871.00	0.02
48	688131	皓元医药	3,922	189,628.70	0.02
49	600848	上海临港	19,200	174,144.00	0.02
50	601918	新集能源	26,900	173,774.00	0.02
51	603699	纽威股份	5,500	171,435.00	0.02
52	600216	浙江医药	9,600	141,984.00	0.01
53	601900	南方传媒	8,900	139,196.00	0.01
54	000039	中集集团	17,700	139,122.00	0.01
55	300879	大叶股份	2,700	106,056.00	0.01
56	605080	浙江自然	3,800	105,640.00	0.01
57	002318	久立特材	4,500	105,255.00	0.01
58	002315	焦点科技	2,300	105,087.00	0.01
59	600578	京能电力	23,400	105,066.00	0.01
60	002967	广电计量	5,900	103,781.00	0.01
61	688775	影石创新	573	71,143.68	0.01
62	002769	普路通	7,300	70,664.00	0.01
63	300777	中简科技	1,900	68,875.00	0.01
64	300492	华图山鼎	960	65,164.80	0.01
65	603798	康普顿	3,200	34,816.00	0.00
66	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
67	603049	中策橡胶	558	23,910.30	0.00
68	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
69	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
70	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
71	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
72	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
73	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
74	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
75	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
76	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
77	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
78	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
79	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
80	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	38,787,650.18	3.33
2	600519	贵州茅台	34,466,240.00	2.96
3	600036	招商银行	33,568,237.00	2.88
4	300750	宁德时代	33,475,872.00	2.88
5	601899	紫金矿业	32,157,745.00	2.76
6	601601	中国太保	30,245,212.00	2.60
7	600919	江苏银行	29,762,222.00	2.56
8	601816	京沪高铁	28,446,671.00	2.44
9	601919	中远海控	28,330,794.89	2.43
10	601288	农业银行	28,191,842.00	2.42
11	601229	上海银行	27,872,212.00	2.39
12	688111	金山办公	27,158,489.29	2.33
13	600276	恒瑞医药	26,367,884.52	2.26
14	600160	巨化股份	26,275,737.00	2.26
15	601988	中国银行	25,886,555.00	2.22
16	600926	杭州银行	25,776,321.93	2.21
17	600660	福耀玻璃	25,657,792.16	2.20
18	002594	比亚迪	25,538,939.00	2.19
19	688008	澜起科技	24,991,170.11	2.15
20	601166	兴业银行	24,913,041.00	2.14
21	601211	国泰海通	24,733,232.38	2.12
22	002142	宁波银行	24,156,961.00	2.07
23	600900	长江电力	24,117,065.50	2.07
24	000425	徐工机械	23,913,059.00	2.05
25	601728	中国电信	23,878,151.00	2.05
26	300033	同花顺	23,693,368.00	2.04
27	601818	光大银行	23,673,845.00	2.03
28	300759	康龙化成	23,630,990.50	2.03
29	601328	交通银行	23,515,819.00	2.02

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	41,441,402.40	3.56
2	600036	招商银行	33,398,182.00	2.87
3	601816	京沪高铁	32,723,437.00	2.81
4	000333	美的集团	31,879,378.00	2.74
5	000651	格力电器	30,667,553.00	2.63

6	600519	贵州茅台	30,627,146.90	2.63
7	601899	紫金矿业	29,361,573.00	2.52
8	601288	农业银行	29,199,988.00	2.51
9	002475	立讯精密	28,721,371.10	2.47
10	600900	长江电力	27,790,438.00	2.39
11	601601	中国太保	27,642,808.30	2.37
12	600919	江苏银行	27,360,191.28	2.35
13	601919	中远海控	27,260,788.89	2.34
14	601328	交通银行	27,202,270.00	2.34
15	600887	伊利股份	26,979,180.00	2.32
16	601818	光大银行	26,713,212.00	2.29
17	601318	中国平安	26,288,030.00	2.26
18	002142	宁波银行	26,132,734.00	2.24
19	300308	中际旭创	25,941,259.00	2.23
20	600660	福耀玻璃	25,917,845.06	2.23
21	601229	上海银行	25,788,410.38	2.22
22	601169	北京银行	24,700,559.00	2.12
23	300502	新易盛	24,593,647.20	2.11
24	002594	比亚迪	24,348,120.00	2.09
25	601668	中国建筑	24,207,231.00	2.08
26	601728	中国电信	24,182,055.00	2.08
27	688111	金山办公	24,150,957.63	2.07
28	601766	中国中车	23,815,257.00	2.05
29	601628	中国人寿	23,735,229.00	2.04

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,640,077,178.08
卖出股票收入（成交）总额	3,706,700,803.63

注：7.4.1项“买入金额”、7.4.2项“卖出金额”及7.4.3项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	61,042,608.06	5.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	61,042,608.06	5.51

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019766	25 国债 01	266,000	26,717,236.77	2.41
2	019749	24 国债 15	189,500	19,190,774.03	1.73
3	019758	24 国债 21	150,000	15,134,597.26	1.37

## 7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	240,537.79
2	应收清算款	17,496,291.94
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,850,274.75
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	19,587,104.48

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
中金沪深 300 指数增强 A	119,935	4,173.21	253,167,262.09	50.58	247,346,384.34	49.42
中金沪深 300 指数增强 C	20,279	7,363.51	63,402,723.88	42.46	85,921,850.73	57.54
合计	140,214	4,634.62	316,569,985.97	48.72	333,268,235.07	51.28

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金沪深 300 指数增强 A	747,161.21	0.1493
	中金沪深 300 指数增强 C	996.92	0.0007
	合计	748,158.13	0.1151

## 8.3 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、基金经理和研究部门负责人持有本开放式基金	中金沪深 300 指数增强 A	10~50
	中金沪深 300 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中金沪深 300 指数增强 A	10~50
	中金沪深 300 指数增强 C	0
	合计	10~50

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金已成立满三年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金沪深 300A	中金沪深 300C
基金合同生效日 (2016年7月22日)	10,001,300.00	-
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	489,950,881.22	206,688,336.55
本报告期基金总申购份额	304,131,106.74	351,607,542.74
减：本报告期基金总赎回份额	293,568,341.53	408,971,304.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	500,513,646.43	149,324,574.61

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
国泰海通	4	1, 961, 051, 00 7. 02	26. 71	384, 185. 02	26. 71	-
中金公司	2	1, 752, 909, 35 8. 71	23. 87	343, 414. 42	23. 87	-

申万宏源	2	1,365,195,86 2.91	18.59	267,455.03	18.59	-
广发证券	2	1,339,054,78 9.82	18.24	262,332.91	18.24	-
中信建投	2	924,893,060. 17	12.60	181,197.04	12.60	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好，资本充足，财务指标等符合监管要求；
- (2) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (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的需要；
- (4) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

(5) 国泰君安证券股份有限公司自合并交割日 2025 年 3 月 14 日起吸收合并海通证券股份有限公司。根据《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自 2025 年 4 月 3 日起，国泰君安证券股份有限公司中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订《交易单元租用协议》《证券综合服务协议》  
(注：被动股票型基金不通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用)。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额 的比例(%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例(%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例(%)
国泰海通	30,553,794.00	50.43	337,400,000.00	28.46	-	-
中金公司	3,989,840.00	6.59	330,100,000.00	27.85	-	-
申万宏源	7,993,120.00	13.19	246,000,000.00	20.75	-	-
广发证券	18,044,280.00	29.79	168,900,000.00	14.25	-	-
中信建投	-	-	103,000,000.00	8.69	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-1-22
2	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2025-1-22
3	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025-3-19
4	中金沪深 300 指数增强型发起式证券	中国证监会规定媒介	2025-3-19

	投资基金托管协议		
5	关于中金基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会规定媒介	2025-3-19
6	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025-3-21
7	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金产品资料概要更新（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025-3-21
8	中金基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-3-28
9	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-3-28
10	关于中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金开通同一基金不同类别基金份额相互转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2025-4-9
11	中金基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-4-22
12	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2025-4-22
13	中金基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-4-24
14	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2025-6-5

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有份额比例达到或超过总份额 20% 的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新

- 5、中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金申请募集注册的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、报告期内中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人和/或及基金托管人住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复印件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：010-63211122 400-868-1166

传真：010-66159121

中金基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日