

中金中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	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	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	56

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	59
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 A500 指数增强型证券投资基金		
基金简称	中金中证 A500 指数增强		
基金主代码	023522		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2025 年 3 月 13 日		
基金管理人	中金基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	284,087,540.66 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基 金简称	中金中证 A500 指数增强 A	中金中证 A500 指数增强 B	中金中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	023522	023965	023523
报告期末下属分级 基金的份额总额	57,073,450.92 份	3,221,200.26 份	223,792,889.48 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 A500 指数进行有效跟踪的基础上，本基金通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资收益，力求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金主要的股票投资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，然后通过基本面与技术面等多种量化因子构建量化增强策略，并根据策略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、债券投资策略；4、可转债投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货、国债期货及股票期权的投资策略；7、转融通证券出借业务投资策略；8、融资投资策略；9、存托凭证投资策略。详见《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，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。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非

	必然投资港股。
--	---------

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰	冯萌
	联系电话	010-63211122	021-52629999-213310
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95561
传真		010-66159121	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		100004	200120
法定代表人		李金泽	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日 – 2026 年 6 月 30 日)		
	中金中证 A500 指数增强 A	中金中证 A500 指数增强 B	中金中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	8,433,919.37	462,040.84	4,970,456.48
本期利润	8,468,476.41	437,236.64	11,170,186.54
加权平均基金份额本期利润	0.1671	0.1520	0.2728
本期加权平	12.91%	11.73%	20.90%

均 净 值 利 润 率			
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	12.82%	12.82%	12.55%
3.1.2 期 末 数 据 和 指 标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
期末可供分 配利润	18,112,584.39	1,022,717.60	69,078,518.55
期末可供分 配基金份额 利润	0.3174	0.3175	0.3087
期末基金资 产净值	78,751,021.25	4,445,148.50	306,811,531.93
期末基金份 额净值	1.3798	1.3800	1.3710
3.1.3 累 计期末指 标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
基金份额累 计净值增长 率	37.98%	49.37%	37.10%

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

中金中证 A500 指数增强 A

阶段	份额净 值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	13.49%	1.32%	13.54%	1.34%	-0.05%	-0.02%

过去六个月	12.82%	1.21%	11.34%	1.22%	1.48%	-0.01%
过去一年	38.49%	1.07%	34.41%	1.09%	4.08%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	37.98%	1.07%	33.19%	1.09%	4.79%	-0.02%

中金中证 A500 指数增强 B

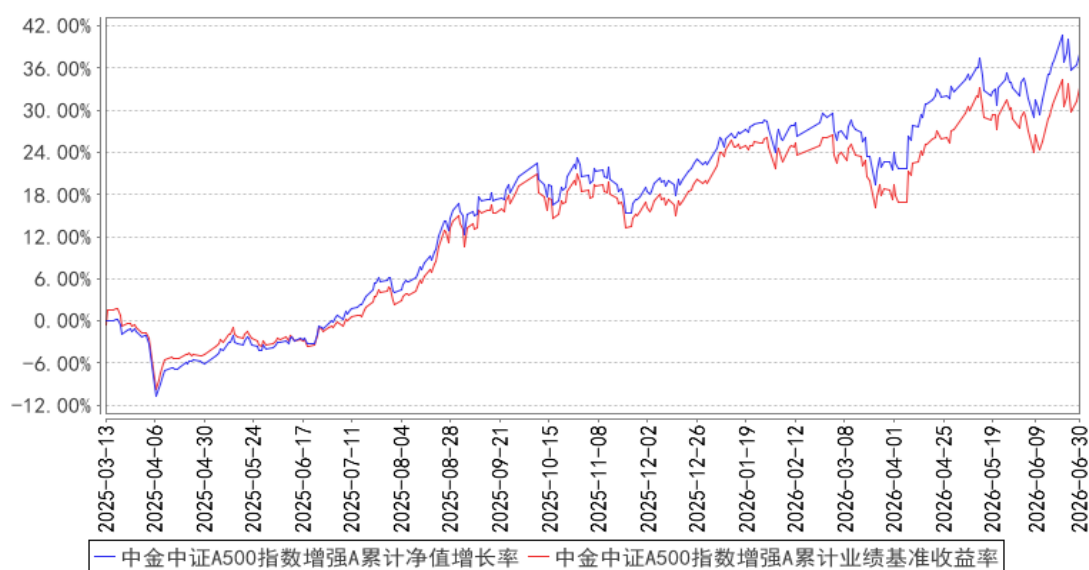
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.50%	1.32%	13.54%	1.34%	-0.04%	-0.02%
过去六个月	12.82%	1.21%	11.34%	1.22%	1.48%	-0.01%
过去一年	38.50%	1.07%	34.41%	1.09%	4.09%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	49.37%	0.99%	41.82%	1.01%	7.55%	-0.02%

中金中证 A500 指数增强 C

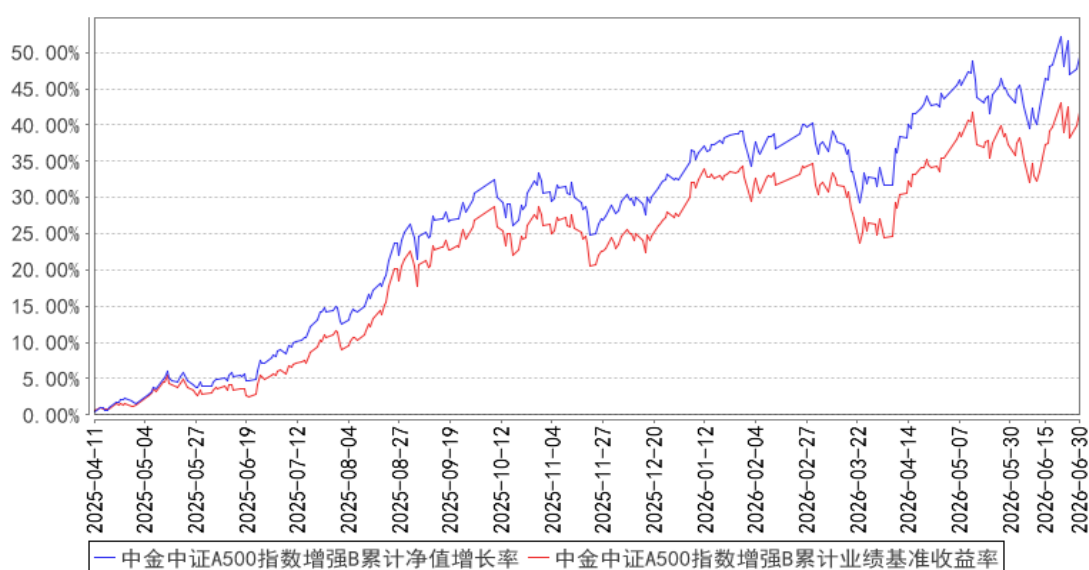
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.36%	1.32%	13.54%	1.34%	-0.18%	-0.02%
过去六个月	12.55%	1.21%	11.34%	1.22%	1.21%	-0.01%
过去一年	37.80%	1.07%	34.41%	1.09%	3.39%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	37.10%	1.07%	33.19%	1.09%	3.91%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

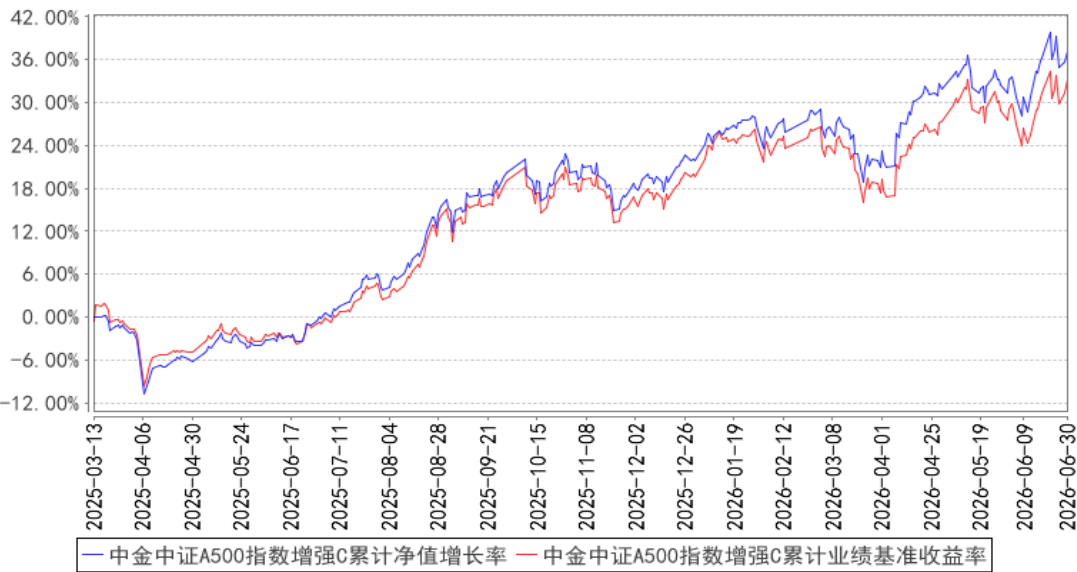
中金中证A500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中金中证A500指数增强B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



中金中证A500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图



注：本基金的基金合同生效日为 2025 年 03 月 13 日，按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 10 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 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 79 只公募基金，证券投资基金管理规模 2,772.40 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、中金基金管理有限公司副总	2025 年 3 月 13 日	-	15 年	耿帅军先生，理学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司金融工程分析师；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

	经理				金基金管理有限公司副总经理、基金经理。
王阳峰	本基金基金经理	2025 年 3 月 13 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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益行为。

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

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。

2026 年上半年，国内经济延续复苏势头，总量稳中有进，结构向新向优；全球经济依然冷热不均，地缘冲突频扰，AI 投资火热。在此背景下，A 股市场整体呈现出“中枢抬高、波动增加、风格分化、科技突出”的特征。一季度，A 股市场在估值消化需要和外部事件冲击综合作用下，经历了冲高、整固、回落的过程，市场风格表现也随投资者风险偏好波动快速切换，从年初的成长领涨转向季末的价值占优。进入二季度，地缘冲击烈度逐渐降级，风险资产的波动率中枢下行，资本市场风险偏好抬升，权益市场对基本面景气更加追逐，A 股呈现鲜明的结构性行情，科技成长主线贯穿始终，而传统周期与内需消费板块相对疲软。

上半年，沪深 300、中证 500、中证 1000、科创 50、创业板指等代表指数分别录得 7.55%、20.97%、15.99%、64.25%、35.58% 的涨幅。风格方面，成长显著跑赢价值，中小市值相对大盘占优，微盘风格表现落后。行业方面，电子、通信、建材、基础化工和机械等板块涨幅居前，消费者服务、综合金融、综合、农林牧渔和商贸零售等板块表现承压。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证 A500 指数增强 A 基金份额净值为 1.3798 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.82%，同期业绩基准收益率为 11.34%；中金中证 A500 指数增强 B 基金份额净值为 1.3800 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.82%，同期业绩基准收益率为 11.34%；中金中证 A500 指数增强 C 基金份额净值为 1.3710 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.55%，同期业绩基准收益率为 11.34%。

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，国内政策端有望保持“总量适度宽松，发力更加精准”的基调，兼顾发挥存量政策效能和谋划出台增量政策，宏观经济将有较大概率延续“总量稳健、结构优化”的特征。权益市场层面，经历近期“全球共振式”快速调整后，A 股市场估值水平有明显回落，考虑到国内无风险收益率仍处在历史低位区域，A 股市场中长期配置价值进一步提升。结构方面，市场整体风格在叙事新变化和资金再平衡等综合作用下有望进一步趋于均衡，将为自下而上选股类投资者提供更为广阔的选股空间。我们将持续在估值合理性与盈利确定性之间寻求平衡，积极挖掘结构性机会，并始终坚持以高质量研究赋能投资管理的工作范式。

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，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运作管理办法》的规定以及本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期末未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、

收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	26,367,535.61	6,255,635.44
结算备付金		2,023,112.96	-
存出保证金		2,311,728.00	-
交易性金融资产	6.4.7.2	347,263,144.30	98,632,322.62
其中：股票投资		347,263,144.30	98,632,322.62
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		14,215,259.87	421,264.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		392,180,780.74	105,309,222.97
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,890,626.08	230,411.25
应付管理人报酬		139,496.89	66,252.78
应付托管费		17,437.13	8,281.61
应付销售服务费		55,794.45	11,986.96
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,412.36	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	65,312.15	165,072.00
负债合计		2,173,079.06	482,004.60
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	284,087,540.66	85,823,843.30
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	105,920,161.02	19,003,375.07
净资产合计		390,007,701.68	104,827,218.37
负债和净资产总计		392,180,780.74	105,309,222.97

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，中金中证 A500 指数增强 A 的基金份额净值为 1.3798 元，期末份额总额为 57,073,450.92 份；中金中证 A500 指数增强 B 的基金份额净值为 1.3800 元，期末份额总额为 3,221,200.26 份；中金中证 A500 指数增强 C 的基金份额净值为 1.3710 元，期末份额总额为 223,792,889.48 份。基金份额总额 284,087,540.66 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 3 月 13 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		20,802,315.29	-3,360,748.62
1. 利息收入		8,457.31	21,014.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,457.31	21,014.26
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“-”		14,556,265.62	-8,876,173.96

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.14	13,410,200.22	-11,428,145.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	-127,458.02	-
股利收益	6.4.7.19	1,273,523.42	2,551,971.63
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	6,209,482.90	5,493,902.67
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	28,109.46	508.41
减：二、营业总支出		726,415.70	865,007.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	483,963.29	583,449.49
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	60,495.48	72,931.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	130,737.06	146,892.13
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	51,219.87	61,734.20
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		20,075,899.59	-4,225,755.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		20,075,899.59	-4,225,755.63
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		20,075,899.59	-4,225,755.63

6.3 净资产变动表

会计主体：中金中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	85,823,843.30	-	19,003,375.07	104,827,218.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	85,823,843.30	-	19,003,375.07	104,827,218.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	198,263,697.36	-	86,916,785.95	285,180,483.31
（一）、综合收益总额	-	-	20,075,899.59	20,075,899.59
（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）	198,263,697.36	-	66,840,886.36	265,104,583.72
其中：1. 基金申购款	305,903,908.77	-	101,018,285.67	406,922,194.44
2. 基金赎回款	-107,640,211.41	-	-34,177,399.31	-141,817,610.72
（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	284,087,540.66	-	105,920,161.02	390,007,701.68
项目	上年度可比期间 2025 年 3 月 13 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	284,403,084.16	-	-	284,403,084.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-69,298,655.42	-	-907,545.45	-70,206,200.87
（一）、综合收益总额	-	-	-4,225,755.63	-4,225,755.63
（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）	-69,298,655.42	-	3,318,210.18	-65,980,445.24
其中：1. 基金申购款	10,773,463.28	-	-477,406.22	10,296,057.06
2. 基金赎回款	-80,072,118.70	-	3,795,616.40	-76,276,502.30
（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	215,104,428.74	-	-907,545.45	214,196,883.29

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

中金中证 A500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委

员会（以下简称“中国证监会”）于 2025 年 2 月 10 日证监许可〔2025〕258 号《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》和《中金中证 A500 指数增强型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股票型基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、腾安基金销售(深圳)有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司等共同销售，募集期为 2025 年 3 月 5 日起至 2025 年 3 月 11 日。经向中国证监会备案《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2025 年 3 月 13 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 284,403,084.16 份(含利息转份额 31,258.71 份)，发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据基金合同和《中金基金管理有限公司关于中金中证 A500 指数增强型证券投资基金增设基金份额并修改法律文件的公告》本基金于 2025 年 4 月 10 日起增设 B 类份额(基金代码: 023965)，在本次基金份额增设完成后，本基金原有 A 类基金份额（基金代码: 023522）、C 类基金份额（基金代码: 023523）的份额类别名称及各项业务规则保持不变。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 B 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、B 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类、B 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

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，同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集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》、《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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 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》、财税[2014] 81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、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》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》《中华人民共和国增值税法实施条例》财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

(c) 对本基金从上市公司、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。对本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。

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

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(d) 本基金卖出股票按 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。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	6,332,200.55
等于：本金	6,331,231.53
加：应计利息	969.02
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	20,035,335.06
等于：本金	20,035,192.30
加：应计利息	142.76
减：坏账准备	-
合计	26,367,535.61

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	333,728,257.21	-	347,263,144.30	13,534,887.09
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		333,728,257.21	-	347,263,144.30	13,534,887.09

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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	19,003,060.00	-	-	-
其中：股指期货投资	19,003,060.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	19,003,060.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2607	IC2607	5.00	8,928,200.00	227,200.00
IF2607	IF2607	7.00	10,336,200.00	34,140.00
合计				261,340.00
减：可抵销期货暂收款				261,340.00
净额				-

注：1、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

本基金本报告期末无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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.28

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	51,219.87
其他	14,092.00
合计	65,312.15

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 A500 指数增强 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,271,029.62	55,271,029.62
本期申购	31,872,134.40	31,872,134.40
本期赎回（以“-”号填列）	-30,069,713.10	-30,069,713.10
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	57,073,450.92	57,073,450.92

中金中证 A500 指数增强 B

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,291,283.12	2,291,283.12
本期申购	2,634,607.02	2,634,607.02
本期赎回（以“-”号填列）	-1,704,689.88	-1,704,689.88
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	3,221,200.26	3,221,200.26

中金中证 A500 指数增强 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,261,530.56	28,261,530.56
本期申购	271,397,167.35	271,397,167.35
本期赎回（以“-”号填列）	-75,865,808.43	-75,865,808.43
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	223,792,889.48	223,792,889.48

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中金中证 A500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,255,780.37	4,071,920.57	12,327,700.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8,255,780.37	4,071,920.57	12,327,700.94
本期利润	8,433,919.37	34,557.04	8,468,476.41
本期基金份额交易产生的变动数	1,422,884.65	-541,491.67	881,392.98
其中：基金申购款	8,551,020.20	1,208,298.63	9,759,318.83
基金赎回款	-7,128,135.55	-1,749,790.30	-8,877,925.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,112,584.39	3,564,985.94	21,677,570.33

中金中证 A500 指数增强 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	342,487.46	168,821.68	511,309.14
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	342,487.46	168,821.68	511,309.14
本期利润	462,040.84	-24,804.20	437,236.64
本期基金份额交易产生的变动数	218,189.30	57,213.16	275,402.46
其中：基金申购款	667,125.78	116,006.19	783,131.97
基金赎回款	-448,936.48	-58,793.03	-507,729.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,022,717.60	201,230.64	1,223,948.24

中金中证 A500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,086,659.19	2,077,705.80	6,164,364.99
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,086,659.19	2,077,705.80	6,164,364.99

本期利润	4,970,456.48	6,199,730.06	11,170,186.54
本期基金份额交易产生的变动数	60,021,402.88	5,662,688.04	65,684,090.92
其中：基金申购款	80,572,515.98	9,903,318.89	90,475,834.87
基金赎回款	-20,551,113.10	-4,240,630.85	-24,791,743.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,078,518.55	13,940,123.90	83,018,642.45

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,463.49
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,034.84
结算备付金利息收入	958.98
其他	-
合计	8,457.31

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	13,410,200.22
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	13,410,200.22

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	303,628,199.77
减：卖出股票成本总额	289,852,778.23
减：交易费用	365,221.32
买卖股票差价收入	13,410,200.22

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

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

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

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股指期货投资收益	-127,458.02
----------	-------------

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,273,523.42
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	1,273,523.42

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,952,555.26
股票投资	5,952,555.26
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	261,340.00
权证投资	-
期货投资	261,340.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	4,412.36
合计	6,209,482.90

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	28,109.46
合计	28,109.46

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	11,548.29

信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	51,219.87

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、关联关系

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、基金注册登记机构及基金销售机构
兴业银行	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
中国中金财富证券有限公司（以下简称“中金财富证券”）	基金管理人股东的一级全资子公司及基金销售机构

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

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股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	483,963.29	583,449.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	169,768.24	203,624.57
应支付基金管理人的净管理费	314,195.05	379,824.92

注：支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	60,495.48	72,931.19

注：支付基金托管人兴业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中金中证 A500 指数增强 A	中金中证 A500 指数增强 B	中金中证 A500 指数增强 C	合计
兴业银行	-	-	37,418.71	37,418.71
中金财富证券	-	-	1,100.82	1,100.82
合计	-	-	38,519.53	38,519.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中金中证 A500 指数增强 A	中金中证 A500 指数增强 B	中金中证 A500 指数增强 C	合计

	数增强 A	数增强 B	数增强 C	
兴业银行	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	15.66	15.66
合计	-	-	15.66	15.66

注：本基金 A 类、B 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$C \text{ 类基金份额日基金销售服务费} = C \text{ 类基金份额前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

6.4.10.5 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 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
兴业银行	6,332,200.55	6,463.49	4,034,966.97	17,856.74

注：本基金的活期银行存款由基金托管人兴业银行保管，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

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	001248	华润新能源	网下	5,719	57,819.09
上年度可比期间 2025 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 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
-	-	-	-	-	-

注：本基金上年度可比期间在承销期内未参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 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
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	4,004	40,480.44	40,480.44	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月以内（含）	新股流通受限	10.11	10.11	1,715	17,338.65	17,338.65	-

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
688072	拓荆科技	2026 年 6	重大事项	879.53	2026 年 7	890.99	1,600	1,048,938.00	1,407,248.00	-

		月 29 日	停牌		月 13 日					
--	--	-----------	----	--	-----------	--	--	--	--	--

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

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日，本基金无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型指数增强基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金、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办法》，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场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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	26,366,423.83	-	-	1,111.78	26,367,535.61
结算备付金	2,022,793.16	-	-	319.80	2,023,112.96
存出保证金	-	-	-	2,311,728.00	2,311,728.00
交易性金融资产	-	-	-	347,263,144.30	347,263,144.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	14,215,259.87	14,215,259.87
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	28,389,216.99	-	-	363,791,563.75	392,180,780.74
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,890,626.08	1,890,626.08
应付销售服务费	-	-	-	55,794.45	55,794.45
应付管理人报酬	-	-	-	139,496.89	139,496.89
应付托管费	-	-	-	17,437.13	17,437.13
应交税费	-	-	-	4,412.36	4,412.36
其他负债	-	-	-	65,312.15	65,312.15
负债总计	-	-	-	2,173,079.06	2,173,079.06
利率敏感度缺口	28,389,216.99	-	-	361,618,484.69	390,007,701.68
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	6,255,240.17	-	-	395.27	6,255,635.44
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	98,632,322.62	98,632,322.62
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	421,264.91	421,264.91
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,255,240.17	-	-	99,053,982.80	105,309,222.97
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	230,411.25	230,411.25
应付销售服务费	-	-	-	11,986.96	11,986.96
应付管理人报酬	-	-	-	66,252.78	66,252.78
应付托管费	-	-	-	8,281.61	8,281.61
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	165,072.00	165,072.00
负债总计	-	-	-	482,004.60	482,004.60
利率敏感度缺口	6,255,240.17	-	-	98,571,978.20	104,827,218.37

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

本期末本基金未持有交易性债券投资（不含可转换债券、可交换债券）和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（上年度末：同）

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	347,263,144.30	89.04	98,632,322.62	94.09
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	347,263,144.30	89.04	98,632,322.62	94.09

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	18,915,373.53	—
	业绩比较基准下降 5%	-18,915,373.53	—

注：于上年度末，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	345,798,077.21	97,988,871.14
第二层次	1,465,067.09	391,558.00
第三层次	-	251,893.48
合计	347,263,144.30	98,632,322.62

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	347,263,144.30	88.55
	其中：股票	347,263,144.30	88.55
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	28,390,648.57	7.24
8	其他各项资产	16,526,987.87	4.21
9	合计	392,180,780.74	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	41,988.00	0.01
B	采矿业	12,684,947.00	3.25
C	制造业	236,238,510.53	60.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,629,568.00	1.19
E	建筑业	3,277,571.00	0.84
F	批发和零售业	9,361,309.00	2.40
G	交通运输、仓储和邮政业	8,498,342.80	2.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,264,100.60	4.17
J	金融业	27,208,572.00	6.98
K	房地产业	527,441.00	0.14
L	租赁和商务服务业	1,886,571.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	6,022,466.20	1.54
N	水利、环境和公共设施管理业	3,451,275.00	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,782.00	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	10,074.00	-
	合计	330,108,518.13	84.64

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	298,804.00	0.08
B	采矿业	317,653.00	0.08
C	制造业	12,415,295.08	3.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	196,535.09	0.05
E	建筑业	166,013.00	0.04
F	批发和零售业	559,282.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,782,072.00	0.46
J	金融业	605,663.00	0.16
K	房地产业	250,800.00	0.06
L	租赁和商务服务业	101,547.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	2,082.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	458,880.00	0.12
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,154,626.17	4.40

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	300308	中际旭创	14,100	17,907,000.00	4.59
2	300750	宁德时代	33,800	13,283,738.00	3.41
3	603986	兆易创新	10,900	8,883,500.00	2.28
4	300502	新易盛	10,216	6,201,112.00	1.59
5	600519	贵州茅台	5,100	6,045,999.00	1.55
6	002384	东山精密	22,800	5,981,580.00	1.53

7	601899	紫金矿业	224,500	5,643,930.00	1.45
8	000333	美的集团	61,800	4,667,754.00	1.20
9	688525	佰维存储	9,200	4,551,516.00	1.17
10	688256	寒武纪	2,849	4,545,721.95	1.17
11	002415	海康威视	124,254	4,249,486.80	1.09
12	600487	亨通光电	37,000	4,045,580.00	1.04
13	603259	药明康德	32,020	3,986,810.20	1.02
14	600183	生益科技	22,800	3,953,520.00	1.01
15	688002	睿创微纳	25,375	3,925,258.75	1.01
16	300857	协创数据	11,500	3,908,850.00	1.00
17	300408	三环集团	23,400	3,905,460.00	1.00
18	600150	中国船舶	112,205	3,791,406.95	0.97
19	600522	中天科技	60,400	3,665,072.00	0.94
20	600030	中信证券	127,400	3,660,202.00	0.94
21	601288	农业银行	574,200	3,485,394.00	0.89
22	300475	香农芯创	11,100	3,330,000.00	0.85
23	600887	伊利股份	136,100	3,260,956.00	0.84
24	000338	潍柴动力	114,500	3,120,125.00	0.80
25	688498	源杰科技	1,600	3,017,600.00	0.77
26	002463	沪电股份	19,300	2,949,040.00	0.76
27	300223	君正股份	11,800	2,937,020.00	0.75
28	605117	德业股份	27,320	2,900,837.60	0.74
29	002414	高德红外	214,700	2,846,922.00	0.73
30	000807	云铝股份	127,300	2,818,422.00	0.72
31	002558	巨人网络	102,200	2,816,632.00	0.72
32	000001	平安银行	266,100	2,674,305.00	0.69
33	688111	金山办公	12,514	2,666,107.70	0.68
34	601360	三六零	305,500	2,654,795.00	0.68
35	000938	紫光股份	89,361	2,578,958.46	0.66
36	000933	神火股份	121,600	2,577,920.00	0.66
37	601318	中国平安	53,400	2,549,316.00	0.65
38	000301	东方盛虹	221,000	2,530,450.00	0.65
39	300604	长川科技	7,400	2,526,508.00	0.65
40	603288	海天味业	74,299	2,463,754.84	0.63
41	002266	浙富控股	463,000	2,342,780.00	0.60
42	000408	藏格矿业	33,500	2,322,220.00	0.60
43	688578	艾力斯	20,633	2,253,123.60	0.58
44	600499	科达制造	163,100	2,250,780.00	0.58
45	000100	TCL 科技	383,300	2,230,806.00	0.57
46	000792	盐湖股份	72,300	2,182,737.00	0.56
47	601233	桐昆股份	98,500	2,132,525.00	0.55
48	300432	富临精工	105,700	2,123,513.00	0.54
49	002493	荣盛石化	195,500	2,101,625.00	0.54

50	600989	宝丰能源	101,218	2,057,761.94	0.53
51	600036	招商银行	57,500	2,041,250.00	0.52
52	301308	江波龙	2,900	2,041,020.00	0.52
53	601872	招商轮船	114,500	2,011,765.00	0.52
54	688469	芯联集成	187,200	1,986,192.00	0.51
55	600166	福田汽车	673,100	1,958,721.00	0.50
56	300972	万辰集团	11,200	1,942,192.00	0.50
57	688396	华润微	19,886	1,939,879.30	0.50
58	000975	山金国际	113,900	1,936,300.00	0.50
59	600535	天士力	137,000	1,812,510.00	0.46
60	601328	交通银行	281,500	1,810,045.00	0.46
61	002027	分众传媒	366,300	1,772,892.00	0.45
62	600816	建元信托	698,600	1,704,584.00	0.44
63	002709	天赐材料	32,900	1,692,047.00	0.43
64	003816	中国广核	428,600	1,675,826.00	0.43
65	300458	全志科技	42,140	1,662,844.40	0.43
66	601658	邮储银行	331,500	1,634,295.00	0.42
67	002475	立讯精密	22,900	1,612,160.00	0.41
68	688266	泽璟制药	13,749	1,603,958.34	0.41
69	600176	中国巨石	22,000	1,603,360.00	0.41
70	002916	深南电路	3,500	1,602,650.00	0.41
71	000426	兴业银锡	48,500	1,598,560.00	0.41
72	300012	华测检测	115,000	1,593,900.00	0.41
73	300438	鹏辉能源	19,100	1,582,435.00	0.41
74	601618	中国中冶	624,600	1,524,024.00	0.39
75	002738	中矿资源	25,400	1,498,346.00	0.38
76	300059	东方财富	72,700	1,481,626.00	0.38
77	688008	澜起科技	4,771	1,478,532.90	0.38
78	600309	万华化学	21,400	1,463,974.00	0.38
79	601607	上海医药	91,500	1,409,100.00	0.36
80	688072	拓荆科技	1,600	1,407,248.00	0.36
81	000988	华工科技	7,500	1,384,575.00	0.36
82	600885	宏发股份	38,040	1,311,999.60	0.34
83	601601	中国太保	45,300	1,291,956.00	0.33
84	600000	浦发银行	149,100	1,283,751.00	0.33
85	600704	物产中大	267,400	1,262,128.00	0.32
86	688599	天合光能	88,451	1,248,928.12	0.32
87	002648	卫星化学	52,000	1,221,480.00	0.31
88	000657	中钨高新	12,300	1,177,356.00	0.30
89	000519	中兵红箭	55,500	1,169,385.00	0.30
90	600115	中国东航	298,600	1,137,666.00	0.29
91	002371	北方华创	1,275	1,127,814.00	0.29
92	601766	中国中车	216,200	1,124,240.00	0.29

93	601988	中国银行	195,400	1,117,688.00	0.29
94	002008	大族激光	7,300	1,095,803.00	0.28
95	600998	九州通	232,300	1,089,487.00	0.28
96	300014	亿纬锂能	16,200	1,053,486.00	0.27
97	600008	首创环保	384,700	1,046,384.00	0.27
98	600233	圆通速递	63,100	993,825.00	0.25
99	600372	中航机载	90,300	979,755.00	0.25
100	300661	圣邦股份	6,800	975,664.00	0.25
101	688036	传音控股	16,539	974,974.05	0.25
102	600900	长江电力	36,600	968,802.00	0.25
103	600489	中金黄金	53,100	958,455.00	0.25
104	600026	中远海能	53,200	954,408.00	0.24
105	601100	恒立液压	8,800	946,528.00	0.24
106	002001	新 和 成	33,300	946,386.00	0.24
107	688390	固德威	8,600	933,186.00	0.24
108	301358	湖南裕能	12,200	925,614.00	0.24
109	600323	瀚蓝环境	33,200	911,672.00	0.23
110	002236	大华股份	54,800	903,652.00	0.23
111	300476	胜宏科技	2,600	900,718.00	0.23
112	601398	工商银行	123,800	875,266.00	0.22
113	600875	东方电气	29,900	860,223.00	0.22
114	601168	西部矿业	29,700	806,058.00	0.21
115	002517	恺英网络	49,100	797,875.00	0.20
116	600482	中国动力	23,500	770,800.00	0.20
117	688981	中芯国际	4,800	762,336.00	0.20
118	002532	天山铝业	70,800	759,684.00	0.19
119	000725	京东方 A	85,200	739,536.00	0.19
120	603799	华友钴业	14,500	699,770.00	0.18
121	601668	中国建筑	160,800	697,872.00	0.18
122	688472	阿特斯	64,000	692,480.00	0.18
123	601018	宁波港	217,200	684,180.00	0.18
124	600104	上汽集团	69,900	682,224.00	0.17
125	600170	上海建工	305,200	677,544.00	0.17
126	601111	中国国航	108,600	657,030.00	0.17
127	603993	洛阳钼业	37,000	649,350.00	0.17
128	600196	复星医药	28,600	642,642.00	0.16
129	600426	华鲁恒升	26,000	621,920.00	0.16
130	688235	百济神州	2,400	611,064.00	0.16
131	000977	浪潮信息	8,400	588,000.00	0.15
132	601319	中国人保	86,400	584,064.00	0.15
133	002602	世纪华通	41,300	582,330.00	0.15
134	002353	杰瑞股份	3,800	579,500.00	0.15
135	601238	广汽集团	114,000	579,120.00	0.15

136	300054	鼎龙股份	5,400	572,238.00	0.15
137	000425	徐工机械	70,100	567,109.00	0.15
138	300573	兴齐眼药	13,387	545,654.12	0.14
139	601880	辽港股份	395,200	545,376.00	0.14
140	002064	华峰化学	57,000	540,930.00	0.14
141	600031	三一重工	31,000	535,680.00	0.14
142	300390	天华新能	5,400	504,954.00	0.13
143	601727	上海电气	71,000	497,000.00	0.13
144	002049	紫光国微	5,500	488,125.00	0.13
145	601628	中国人寿	13,800	487,830.00	0.13
146	688009	中国通号	102,012	485,577.12	0.12
147	600312	平高电气	27,300	482,118.00	0.12
148	600893	航发动力	12,500	479,250.00	0.12
149	601600	中国铝业	58,100	477,582.00	0.12
150	603087	甘李药业	8,400	476,784.00	0.12
151	000069	华侨城 A	282,500	463,300.00	0.12
152	601816	京沪高铁	100,200	453,906.00	0.12
153	002603	以岭药业	30,100	451,500.00	0.12
154	300676	华大基因	12,600	441,756.00	0.11
155	600332	白云山	21,900	438,876.00	0.11
156	600028	中国石化	97,300	433,958.00	0.11
157	300919	中伟新材	9,900	433,125.00	0.11
158	600029	南方航空	82,700	428,386.00	0.11
159	000651	格力电器	11,400	427,500.00	0.11
160	600741	华域汽车	27,400	425,248.00	0.11
161	300142	沃森生物	32,700	424,773.00	0.11
162	300037	新宙邦	4,500	417,825.00	0.11
163	601211	国泰海通	22,600	411,320.00	0.11
164	002407	多氟多	8,000	401,840.00	0.10
165	002028	思源电气	2,300	397,900.00	0.10
166	600157	永泰能源	238,900	384,629.00	0.10
167	688521	芯原股份	1,000	371,140.00	0.10
168	002340	格林美	56,100	370,821.00	0.10
169	000157	中联重科	52,900	368,713.00	0.09
170	002460	赣锋锂业	5,600	366,240.00	0.09
171	002281	光迅科技	1,400	359,716.00	0.09
172	000623	吉林敖东	19,600	347,508.00	0.09
173	688223	晶科能源	71,600	340,100.00	0.09
174	600765	中航重机	25,400	328,168.00	0.08
175	688012	中微公司	698	327,013.00	0.08
176	603766	隆鑫通用	26,200	312,566.00	0.08
177	300124	汇川技术	4,500	298,485.00	0.08
178	688041	海光信息	800	296,240.00	0.08

179	600346	恒力石化	16,400	290,444.00	0.07
180	002230	科大讯飞	7,100	289,964.00	0.07
181	000066	中国长城	15,100	287,655.00	0.07
182	600050	中国联通	70,000	280,000.00	0.07
183	000063	中兴通讯	7,400	267,806.00	0.07
184	002241	歌尔股份	11,800	265,854.00	0.07
185	600362	江西铜业	6,000	259,800.00	0.07
186	002128	电投能源	11,200	258,944.00	0.07
187	603019	中科曙光	2,400	257,352.00	0.07
188	000538	云南白药	5,300	251,061.00	0.06
189	300136	信维通信	2,100	250,425.00	0.06
190	601919	中远海控	18,630	247,033.80	0.06
191	688099	晶晨股份	2,400	246,960.00	0.06
192	688617	惠泰医疗	1,313	238,388.28	0.06
193	600690	海尔智家	11,600	236,756.00	0.06
194	600886	国投电力	17,700	235,587.00	0.06
195	002080	中材科技	2,600	234,000.00	0.06
196	002938	鹏鼎控股	2,200	231,836.00	0.06
197	000963	华东医药	8,200	230,584.00	0.06
198	300866	安克创新	2,200	229,900.00	0.06
199	002065	东华软件	32,000	228,480.00	0.06
200	300207	欣旺达	11,900	225,981.00	0.06
201	601058	赛轮轮胎	19,500	224,835.00	0.06
202	600570	恒生电子	10,528	223,088.32	0.06
203	300568	星源材质	11,800	220,896.00	0.06
204	600276	恒瑞医药	4,100	213,364.00	0.05
205	300073	当升科技	4,400	211,376.00	0.05
206	000878	云南铜业	13,300	211,204.00	0.05
207	002466	天齐锂业	3,400	208,488.00	0.05
208	688063	派能科技	3,800	202,426.00	0.05
209	002837	英维克	2,510	199,695.60	0.05
210	300070	碧水源	61,700	196,823.00	0.05
211	002120	韵达股份	30,500	193,980.00	0.05
212	600418	江淮汽车	7,300	188,559.00	0.05
213	300757	罗博特科	300	185,700.00	0.05
214	601633	长城汽车	12,300	185,607.00	0.05
215	002594	比亚迪	2,300	183,310.00	0.05
216	688166	博瑞医药	5,000	175,050.00	0.04
217	002126	银轮股份	3,500	174,300.00	0.04
218	002625	光启技术	5,600	169,792.00	0.04
219	601117	中国化学	23,000	169,050.00	0.04
220	000630	铜陵有色	25,700	163,452.00	0.04
221	600795	国电电力	33,900	158,313.00	0.04

222	300003	乐普医疗	13,300	157,605.00	0.04
223	000568	泸州老窖	2,000	155,040.00	0.04
224	600941	中国移动	1,800	155,034.00	0.04
225	600018	上港集团	32,800	154,816.00	0.04
226	688303	大全能源	8,800	153,384.00	0.04
227	601985	中国核电	16,900	152,607.00	0.04
228	600521	华海药业	10,200	146,880.00	0.04
229	000683	博源化工	24,000	138,240.00	0.04
230	002252	上海莱士	31,800	138,012.00	0.04
231	300274	阳光电源	840	133,576.80	0.03
232	688180	君实生物	3,912	132,303.84	0.03
233	603979	金诚信	2,200	129,866.00	0.03
234	601857	中国石油	14,300	124,124.00	0.03
235	300496	中科创达	2,000	123,580.00	0.03
236	601669	中国电建	25,200	118,440.00	0.03
237	002851	麦格米特	700	117,026.00	0.03
238	300033	同花顺	480	115,680.00	0.03
239	300394	天孚通信	360	108,964.80	0.03
240	002812	恩捷股份	1,600	107,056.00	0.03
241	601888	中国中免	1,900	102,049.00	0.03
242	601225	陕西煤业	4,900	99,715.00	0.03
243	002156	通富微电	1,300	98,631.00	0.03
244	000967	盈峰环境	9,300	97,929.00	0.03
245	600655	豫园股份	23,800	97,818.00	0.03
246	600460	士兰微	1,700	92,922.00	0.02
247	002444	巨星科技	2,700	83,970.00	0.02
248	601186	中国铁建	13,400	79,730.00	0.02
249	002271	东方雨虹	6,600	78,342.00	0.02
250	601877	正泰电器	3,100	77,717.00	0.02
251	601728	中国电信	14,900	77,331.00	0.02
252	002389	航天彩虹	4,300	76,411.00	0.02
253	600398	海澜之家	14,100	73,743.00	0.02
254	600497	驰宏锌锗	6,000	72,660.00	0.02
255	603816	顾家家居	3,200	71,552.00	0.02
256	002410	广联达	8,700	70,992.00	0.02
257	688347	华虹宏力	200	67,260.00	0.02
258	600066	宇通客车	2,500	67,025.00	0.02
259	688120	华海清科	200	64,436.00	0.02
260	300454	深信服	600	57,720.00	0.01
261	600392	盛和资源	1,600	47,632.00	0.01
262	002756	永兴材料	800	45,312.00	0.01
263	002714	牧原股份	1,200	41,988.00	0.01
264	000002	万科 A	13,000	38,480.00	0.01

265	002078	太阳纸业	3,000	37,470.00	0.01
266	603659	璞泰来	1,200	34,716.00	0.01
267	300567	精测电子	100	31,760.00	0.01
268	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.01
269	002352	顺丰控股	900	28,134.00	0.01
270	688608	恒玄科技	160	26,750.40	0.01
271	603129	春风动力	100	25,580.00	0.01
272	002273	水晶光电	700	24,836.00	0.01
273	688777	中控技术	200	23,500.00	0.01
274	302132	中航成飞	400	23,328.00	0.01
275	000858	五 粮 液	300	22,200.00	0.01
276	002202	金风科技	900	21,510.00	0.01
277	600584	长电科技	200	20,710.00	0.01
278	688271	联影医疗	200	20,246.00	0.01
279	600208	衢州发展	6,800	19,244.00	0.00
280	600111	北方稀土	400	19,220.00	0.00
281	600141	兴发集团	400	18,788.00	0.00
282	600089	特变电工	800	18,000.00	0.00
283	600549	厦门钨业	200	17,040.00	0.00
284	300433	蓝思科技	300	16,098.00	0.00
285	688126	沪硅产业	400	15,956.00	0.00
286	601088	中国神华	400	15,616.00	0.00
287	002436	兴森科技	300	15,285.00	0.00
288	600406	国电南瑞	600	13,710.00	0.00
289	300760	迈瑞医疗	100	13,583.00	0.00
290	300395	菲利华	100	13,373.00	0.00
291	002050	三花智控	300	13,149.00	0.00
292	601012	隆基绿能	900	11,808.00	0.00
293	688213	思特威	109	11,670.63	0.00
294	601689	拓普集团	200	11,284.00	0.00
295	300782	卓胜微	100	10,958.00	0.00
296	600938	中国海油	400	10,860.00	0.00
297	600879	航天电子	500	10,645.00	0.00
298	600160	巨化股份	200	10,602.00	0.00
299	600660	福耀玻璃	200	10,088.00	0.00
300	600673	东阳光	300	10,074.00	0.00
301	603501	豪威集团	100	9,485.00	0.00
302	300346	南大光电	100	9,265.00	0.00
303	002179	中航光电	200	9,240.00	0.00
304	002185	华天科技	400	8,924.00	0.00
305	002600	领益智造	500	8,670.00	0.00
306	000960	锡业股份	200	8,538.00	0.00
307	300442	润泽科技	100	8,307.00	0.00

308	600760	中航沈飞	200	8,220.00	0.00
309	600118	中国卫星	100	8,205.00	0.00
310	300450	先导智能	200	8,144.00	0.00
311	300418	昆仑万维	200	8,072.00	0.00
312	600988	赤峰黄金	300	7,896.00	0.00
313	601006	大秦铁路	1,700	7,837.00	0.00
314	002422	科伦药业	200	7,704.00	0.00
315	600905	三峡能源	2,000	7,420.00	0.00
316	002138	顺络电子	100	7,310.00	0.00
317	600010	包钢股份	3,200	7,136.00	0.00
318	600019	宝钢股份	1,300	7,059.00	0.00
319	600547	山东黄金	300	6,927.00	0.00
320	300058	蓝色光标	500	6,880.00	0.00
321	600585	海螺水泥	400	6,780.00	0.00
322	600580	卧龙电驱	200	6,620.00	0.00
323	600064	南京高科	900	6,417.00	0.00
324	605589	圣泉集团	100	6,357.00	0.00
325	600143	金发科技	400	6,180.00	0.00
326	601127	赛力斯	100	6,125.00	0.00
327	600096	云天化	200	6,080.00	0.00
328	601179	中国西电	400	5,968.00	0.00
329	002195	岩山科技	900	5,886.00	0.00
330	601390	中国中铁	1,400	5,838.00	0.00
331	300015	爱尔眼科	700	5,782.00	0.00
332	000625	长安汽车	800	5,736.00	0.00
333	000831	中国稀土	100	5,549.00	0.00
334	300017	网宿科技	400	5,204.00	0.00
335	601868	中国能建	1,900	5,073.00	0.00
336	002131	利欧股份	1,000	4,750.00	0.00
337	600711	盛屯矿业	400	4,388.00	0.00
338	605499	东鹏饮料	30	3,702.90	0.00
339	688017	绿的谐波	7	2,925.02	0.00
340	002595	豪迈科技	45	2,097.00	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	688257	新锐股份	6,160	627,704.00	0.16
2	688110	东芯股份	2,800	570,360.00	0.15
3	603195	公牛集团	12,900	505,035.00	0.13
4	603588	高能环境	23,900	458,880.00	0.12
5	600718	东软集团	55,300	400,372.00	0.10
6	000708	中信特钢	31,600	398,792.00	0.10
7	301526	国际复材	8,500	396,695.00	0.10

8	688221	前沿生物	15,400	344,960.00	0.09
9	000810	创维数字	24,000	318,000.00	0.08
10	300277	汽轮科技	21,000	315,840.00	0.08
11	688766	普冉股份	400	306,640.00	0.08
12	000800	一汽解放	50,100	298,095.00	0.08
13	300590	移为通信	19,800	284,130.00	0.07
14	688059	华锐精密	1,400	279,594.00	0.07
15	300607	拓斯达	6,400	263,872.00	0.07
16	603579	荣泰健康	15,000	254,550.00	0.07
17	600246	万通发展	13,200	250,800.00	0.06
18	600973	宝胜股份	34,600	245,314.00	0.06
19	300358	楚天科技	29,800	238,400.00	0.06
20	002568	百润股份	13,800	233,496.00	0.06
21	300428	立中集团	12,500	227,250.00	0.06
22	603876	鼎胜新材	8,700	226,287.00	0.06
23	600739	辽宁成大	22,000	222,420.00	0.06
24	688819	天能股份	10,000	222,000.00	0.06
25	600619	海立股份	14,000	221,900.00	0.06
26	601869	长飞光纤	400	218,360.00	0.06
27	002439	启明星辰	16,500	208,725.00	0.05
28	300137	先河环保	11,000	191,840.00	0.05
29	300861	美畅股份	7,600	191,444.00	0.05
30	000825	太钢不锈	56,100	191,301.00	0.05
31	603077	和邦生物	81,600	189,312.00	0.05
32	001218	丽臣实业	8,500	187,510.00	0.05
33	002841	视源股份	5,400	186,462.00	0.05
34	000703	恒逸石化	13,500	183,195.00	0.05
35	002636	金安国纪	1,500	179,955.00	0.05
36	002653	海思科	2,700	179,118.00	0.05
37	002157	正邦科技	63,200	177,592.00	0.05
38	002354	天娱数科	18,600	172,980.00	0.04
39	603083	剑桥科技	600	152,922.00	0.04
40	601698	中国卫通	4,900	148,225.00	0.04
41	002624	完美世界	11,800	146,556.00	0.04
42	000166	申万宏源	32,500	143,000.00	0.04
42	688627	精智达	200	143,000.00	0.04
43	000729	燕京啤酒	13,900	140,807.00	0.04
44	600100	同方股份	20,300	139,055.00	0.04
45	601138	工业富联	1,900	137,085.00	0.04
46	600546	山煤国际	12,500	136,625.00	0.04
47	603920	世运电路	2,800	134,512.00	0.03
48	600925	苏能股份	33,400	133,934.00	0.03
49	002079	苏州固锝	8,700	130,761.00	0.03

50	002142	宁波银行	4,400	130,636.00	0.03
51	301068	大地海洋	5,400	128,520.00	0.03
52	000709	河钢股份	66,200	128,428.00	0.03
53	603308	应流股份	2,100	126,840.00	0.03
54	002458	益生股份	15,600	121,212.00	0.03
55	002251	步步高	34,800	117,624.00	0.03
56	600061	国投资本	17,600	115,280.00	0.03
57	000958	电投产融	20,400	115,056.00	0.03
58	600517	国网英大	24,500	114,660.00	0.03
59	603045	福达合金	1,600	114,224.00	0.03
60	301373	凌玮科技	700	108,850.00	0.03
61	000049	德赛电池	4,500	105,165.00	0.03
62	301408	华人健康	7,100	102,098.00	0.03
63	000567	海德股份	17,100	102,087.00	0.03
64	301511	德福科技	700	100,695.00	0.03
65	000589	贵州轮胎	24,200	98,252.00	0.03
66	301060	兰卫医学	12,000	98,040.00	0.03
67	300271	华宇软件	20,100	96,882.00	0.02
68	688262	国芯科技	2,200	95,106.00	0.02
69	600884	杉杉股份	7,000	94,850.00	0.02
70	603779	威龙股份	12,600	94,626.00	0.02
71	688025	杰普特	200	94,000.00	0.02
72	002010	传化智联	20,100	89,847.00	0.02
73	002701	奥瑞金	19,600	83,496.00	0.02
74	603929	亚翔集成	300	81,606.00	0.02
75	300628	亿联网络	2,300	77,786.00	0.02
76	688519	南亚新材	200	76,008.00	0.02
77	300459	汤姆猫	22,300	75,597.00	0.02
78	603268	松发股份	500	69,640.00	0.02
79	301217	铜冠铜箔	400	66,028.00	0.02
80	600616	金枫酒业	17,600	66,000.00	0.02
81	688411	海博思创	200	58,240.00	0.01
82	001248	华润新能源	5,719	57,819.09	0.01
83	601886	江河集团	6,900	55,407.00	0.01
84	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.01
85	000553	安道麦 A	10,100	54,035.00	0.01
86	300953	震裕科技	400	53,480.00	0.01
87	603113	金能科技	12,700	52,324.00	0.01
88	603296	华勤技术	700	51,989.00	0.01
89	603061	金海通	100	50,222.00	0.01
90	600997	开滦股份	9,400	44,650.00	0.01
91	688388	嘉元科技	1,000	44,000.00	0.01
92	688368	晶丰明源	200	43,304.00	0.01

93	002975	博杰股份	300	42,600.00	0.01
94	688603	天承科技	200	41,590.00	0.01
95	300183	东软载波	3,900	40,755.00	0.01
96	002487	大金重工	700	40,579.00	0.01
97	600869	远东股份	1,100	36,817.00	0.01
98	000990	诚志股份	4,400	35,992.00	0.01
99	688090	瑞松科技	320	34,064.00	0.01
100	000973	佛塑科技	2,300	33,005.00	0.01
101	002420	毅昌科技	6,000	32,640.00	0.01
102	300233	金城医药	2,500	31,000.00	0.01
103	300098	高新兴	6,700	30,753.00	0.01
104	605289	罗曼股份	200	29,000.00	0.01
105	688456	有研粉材	200	27,920.00	0.01
106	300504	天邑股份	1,700	27,421.00	0.01
107	688389	普门科技	2,800	27,412.00	0.01
108	601666	平煤股份	3,800	27,170.00	0.01
109	301536	星辰科技	200	25,742.00	0.01
110	001339	智微智能	250	25,570.00	0.01
111	301150	中一科技	400	25,244.00	0.01
112	301369	联动科技	100	24,500.00	0.01
113	300444	双杰电气	2,000	24,420.00	0.01
114	603059	倍加洁	1,000	24,250.00	0.01
115	300613	富瀚微	300	24,024.00	0.01
116	688258	卓易信息	200	23,708.00	0.01
117	600509	天富能源	2,800	23,660.00	0.01
118	688220	翱捷科技	170	21,134.40	0.01
119	688261	东微半导	200	20,986.00	0.01
120	301086	鸿富瀚	100	20,928.00	0.01
121	000506	招金黄金	1,700	19,924.00	0.01
122	301099	雅创电子	200	19,100.00	0.00
123	603124	江南新材	100	18,698.00	0.00
124	688700	东威科技	200	17,880.00	0.00
125	688690	纳微科技	400	17,640.00	0.00
126	301489	思泉新材	100	16,458.00	0.00
127	000893	亚钾国际	400	16,356.00	0.00
128	301338	凯格精机	100	16,289.00	0.00
129	002488	金固股份	1,800	16,038.00	0.00
130	300617	安靠智电	300	15,897.00	0.00
131	002838	道恩股份	500	15,310.00	0.00
132	002810	山东赫达	600	14,820.00	0.00
133	301362	民爆光电	80	14,713.60	0.00
134	688378	奥来德	200	12,400.00	0.00
135	603115	海星股份	100	12,247.00	0.00

136	000949	新乡化纤	1,900	12,046.00	0.00
137	600185	珠免集团	2,600	11,700.00	0.00
138	002957	科瑞技术	200	10,968.00	0.00
139	301522	上大股份	400	10,468.00	0.00
140	605196	华通线缆	400	10,440.00	0.00
141	003022	联泓新科	400	10,360.00	0.00
142	301662	宏工科技	100	10,132.00	0.00
143	301510	固高科技	300	9,579.00	0.00
144	002222	福晶科技	100	9,228.00	0.00
145	002326	永太科技	300	7,095.00	0.00
146	300756	金马游乐	200	6,610.00	0.00
147	600686	金龙汽车	500	5,645.00	0.00
148	002518	科士达	100	5,359.00	0.00
149	688105	诺唯赞	120	2,082.00	0.00
150	002245	蔚蓝锂芯	48	898.08	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	300308	中际旭创	14,115,150.00	13.47
2	300750	宁德时代	12,431,971.00	11.86
3	000333	美的集团	6,976,359.00	6.66
4	603986	兆易创新	6,976,035.00	6.65
5	601899	紫金矿业	6,869,905.42	6.55
6	300502	新易盛	6,023,779.00	5.75
7	600150	中国船舶	5,825,661.60	5.56
8	002384	东山精密	5,261,394.43	5.02
9	600519	贵州茅台	5,252,059.00	5.01
10	600030	中信证券	4,789,802.00	4.57
11	000338	潍柴动力	4,570,625.00	4.36
12	601288	农业银行	4,505,011.00	4.30
13	600487	亨通光电	4,266,588.00	4.07
14	600887	伊利股份	4,145,760.00	3.95
15	002415	海康威视	4,036,169.91	3.85
16	688525	佰维存储	3,998,110.58	3.81
17	688256	寒武纪	3,965,406.97	3.78
18	600522	中天科技	3,885,150.00	3.71
19	600183	生益科技	3,817,552.00	3.64
20	300857	协创数据	3,729,064.00	3.56
21	002463	沪电股份	3,707,209.00	3.54
22	000807	云铝股份	3,647,797.00	3.48
23	000933	神火股份	3,629,565.00	3.46

24	603288	海天味业	3,519,733.98	3.36
25	002475	立讯精密	3,503,819.50	3.34
26	603259	药明康德	3,502,596.00	3.34
27	000001	平安银行	3,485,237.00	3.32
28	300408	三环集团	3,454,570.80	3.30
29	688002	睿创微纳	3,449,853.79	3.29
30	601360	三六零	3,357,504.00	3.20
31	600499	科达制造	3,302,550.00	3.15
32	300604	长川科技	3,255,128.00	3.11
33	002558	巨人网络	3,251,359.00	3.10
34	605117	德业股份	3,250,260.72	3.10
35	603993	洛阳钼业	3,216,551.00	3.07
36	300475	香农芯创	3,207,896.00	3.06
37	000408	藏格矿业	3,163,155.00	3.02
38	688111	金山办公	3,117,765.69	2.97
39	603799	华友钴业	3,049,296.00	2.91
40	601658	邮储银行	3,034,439.00	2.89
41	002414	高德红外	2,935,509.00	2.80
42	002493	荣盛石化	2,931,098.00	2.80
43	000301	东方盛虹	2,887,858.00	2.75
44	688578	艾力斯	2,867,525.54	2.74
45	000975	山金国际	2,845,649.00	2.71
46	601233	桐昆股份	2,800,081.00	2.67
47	600036	招商银行	2,781,173.00	2.65
48	688498	源杰科技	2,764,066.74	2.64
49	600989	宝丰能源	2,752,465.00	2.63
50	601601	中国太保	2,748,990.00	2.62
51	600031	三一重工	2,713,932.00	2.59
52	300438	鹏辉能源	2,678,016.00	2.55
53	002027	分众传媒	2,651,591.00	2.53
54	002709	天赐材料	2,617,698.00	2.50
55	000938	紫光股份	2,604,040.23	2.48
56	601318	中国平安	2,594,221.00	2.47
57	002028	思源电气	2,518,475.00	2.40
58	600885	宏发股份	2,490,630.00	2.38
59	601872	招商轮船	2,478,769.00	2.36
60	002266	浙富控股	2,433,652.00	2.32
61	000100	TCL 科技	2,428,584.00	2.32
62	300012	华测检测	2,399,142.00	2.29
63	300223	君正股份	2,367,684.00	2.26
64	002532	天山铝业	2,337,105.00	2.23
65	688072	拓荆科技	2,309,901.31	2.20
66	300014	亿纬锂能	2,277,986.00	2.17

67	600000	浦发银行	2,271,719.00	2.17
68	601600	中国铝业	2,267,038.00	2.16
69	300972	万辰集团	2,247,300.00	2.14
70	300432	富临精工	2,217,678.00	2.12
71	002236	大华股份	2,205,012.00	2.10
72	000426	兴业银锡	2,192,195.00	2.09
73	601328	交通银行	2,192,053.00	2.09
74	002008	大族激光	2,191,797.00	2.09
75	600166	福田汽车	2,189,395.00	2.09
76	000792	盐湖股份	2,173,650.00	2.07
77	601211	国泰海通	2,158,968.00	2.06
78	002916	深南电路	2,158,617.00	2.06
79	002001	新 和 成	2,103,212.00	2.01
80	600535	天士力	2,101,349.00	2.00

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	300502	新易盛	4,037,497.00	3.85
2	603993	洛阳钼业	4,023,378.00	3.84
3	000333	美的集团	3,924,414.00	3.74
4	002475	立讯精密	2,915,874.00	2.78
5	601899	紫金矿业	2,911,292.00	2.78
6	300308	中际旭创	2,898,000.00	2.76
7	002028	思源电气	2,733,310.00	2.61
8	000338	潍柴动力	2,661,592.00	2.54
9	603799	华友钴业	2,602,339.00	2.48
10	600031	三一重工	2,582,434.00	2.46
11	600036	招商银行	2,479,863.00	2.37
12	600183	生益科技	2,428,890.95	2.32
13	600150	中国船舶	2,415,980.80	2.30
14	601211	国泰海通	2,361,246.00	2.25
15	600549	厦门钨业	2,359,636.00	2.25
16	300750	宁德时代	2,339,716.00	2.23
17	002916	深南电路	2,324,389.30	2.22
18	600066	宇通客车	2,232,644.00	2.13
19	002281	光迅科技	2,184,882.00	2.08
20	300604	长川科技	2,164,837.00	2.07

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	532,531,044.65
卖出股票收入（成交）总额	303,628,199.77

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（成交单价乘以成交数量）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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货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约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

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	2,311,728.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,215,259.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,526,987.87

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中不存在流通受限股票。

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的情况。

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 (%)
中金中证 A500 指数 增强 A	699	81,650.14	9,266,380.39	16.24	47,807,070.53	83.76
中金中证 A500 指数 增强 B	382	8,432.46	-	-	3,221,200.26	100.00
中金中证 A500 指数 增强 C	1,367	163,710.97	2,744,253.08	1.23	221,048,636.40	98.77
合计	2,448	116,048.83	12,010,633.47	4.23	272,076,907.19	95.77

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	中金中证 A500 指数增强 A	19,964.85	0.0350
	中金中证 A500 指数增强 B	0.00	0.0000
	中金中证 A500 指数增强 C	0.00	0.0000
	合计	19,964.85	0.0070

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金中证 A500 指数增强 A	0
	中金中证 A500 指数增强 B	0
	中金中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 A500 指数增强 A	0
	中金中证 A500 指数增强 B	0
	中金中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 A500 指数增强 A	中金中证 A500 指数增强 B	中金中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 3 月 13 日）基金份额总额	159,696,668.80	—	124,706,415.36
本报告期期初基金份额总额	55,271,029.62	2,291,283.12	28,261,530.56
本报告期基金总申购份额	31,872,134.40	2,634,607.02	271,397,167.35
减：本报告期基金总赎回份额	30,069,713.10	1,704,689.88	75,865,808.43
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	57,073,450.92	3,221,200.26	223,792,889.48

§ 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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本基金管理人在本报告期内未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本基金管理人相关从业人员在本报告期内未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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 (%)	
太平洋证券	2	836, 101, 425.33	100.00	159, 790.13	100.00	—

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。

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 基金租用或者通过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 (%)
太平洋证券	—	—	—	—	—	—

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关于旗下部分基金投资北交所股票及相关风险提示的公告	中国证监会规定媒介	2026-02-07
2	中金基金管理有限公司关于新增基金直销账户的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-21
3	关于中金中证 A500 指数增强型证券投资基金暂停大额申购（包括转换转入、定期定额投资）业务的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-30
4	中金基金管理有限公司关于旗下基金	中国证监会规定媒介	2026-06-25

	投资关联方承销期内承销证券的公告		
5	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-26
6	中金基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金估值调整情况的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-27

§ 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中证 A500 指数增强型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金中证 A500 指数增强型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、报告期内中金中证 A500 指数增强型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

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人和/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制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日