

中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	5
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	12
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）	13
6.1 资产负债表	13
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	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60

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	60
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	60
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	63
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	64
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	64
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	68

§ 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	719,944,876.05 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	中金沪深 300 指数增强 Y
下属分级基金的交易代码	003015	003579	025936
报告期末下属分级基金的份额总额	521,579,581.64 份	195,437,099.95 份	2,928,194.46 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)		
	中金沪深 300 指数增强 A	中金沪深 300 指数增强 C	中金沪深 300 指数增强 Y
本期已实现收益	92,738,207.02	32,589,332.20	273,966.72
本期利润	112,285,204.95	36,159,327.65	450,668.97
加权平均基金份额本期利润	0.2102	0.1752	0.2733
本期加权平均净值利润率	9.93%	8.30%	12.77%
本期基金份额净值增长	9.87%	9.65%	10.05%

率			
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	512,812,198.25	190,801,293.53	2,892,359.70
期末可供分配基金份额利润	0.9832	0.9763	0.9878
期末基金资产净值	1,170,325,518.41	437,662,315.98	6,583,960.84
期末基金份额净值	2.2438	2.2394	2.2485
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	124.38%	110.43%	12.90%

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 300 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	11.93%	1.23%	11.30%	1.19%	0.63%	0.04%
过去六个月	9.87%	1.10%	7.20%	1.07%	2.67%	0.03%
过去一年	31.72%	0.98%	25.13%	0.97%	6.59%	0.01%
过去三年	43.93%	1.04%	28.26%	1.06%	15.67%	-0.02%
过去五年	12.07%	1.04%	-4.03%	1.06%	16.10%	-0.02%

过去七年	82.32%	1.10%	29.32%	1.11%	53.00%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	124.38%	1.07%	51.28%	1.09%	73.10%	-0.02%

中金沪深 300 指数增强 C

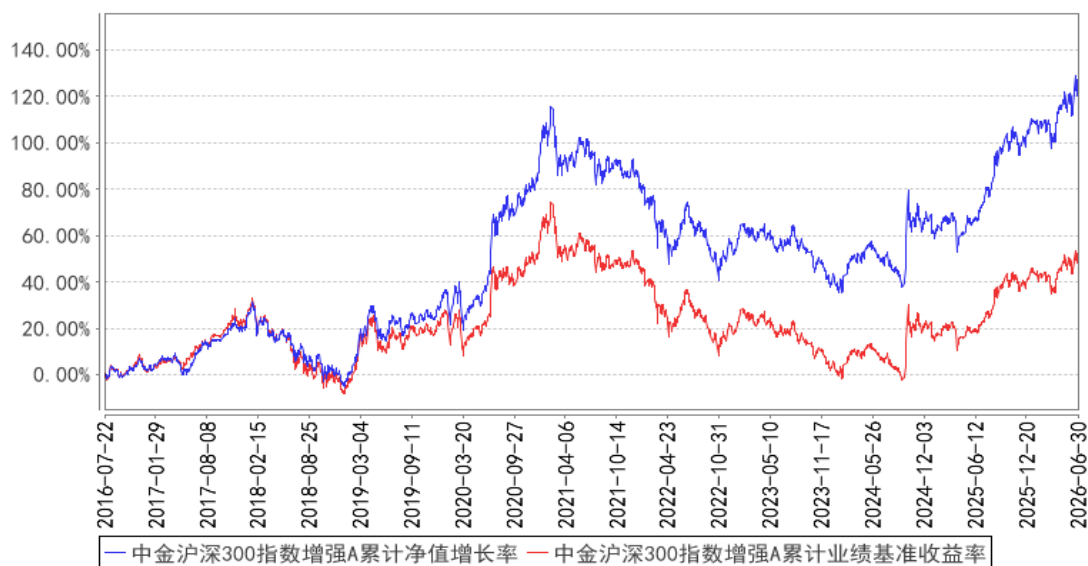
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	11.82%	1.23%	11.30%	1.19%	0.52%	0.04%
过去六个月	9.65%	1.10%	7.20%	1.07%	2.45%	0.03%
过去一年	31.20%	0.98%	25.13%	0.97%	6.07%	0.01%
过去三年	42.22%	1.04%	28.26%	1.06%	13.96%	-0.02%
过去五年	9.87%	1.04%	-4.03%	1.06%	13.90%	-0.02%
过去七年	80.15%	1.10%	29.32%	1.11%	50.83%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	110.43%	1.08%	39.75%	1.10%	70.68%	-0.02%

中金沪深 300 指数增强 Y

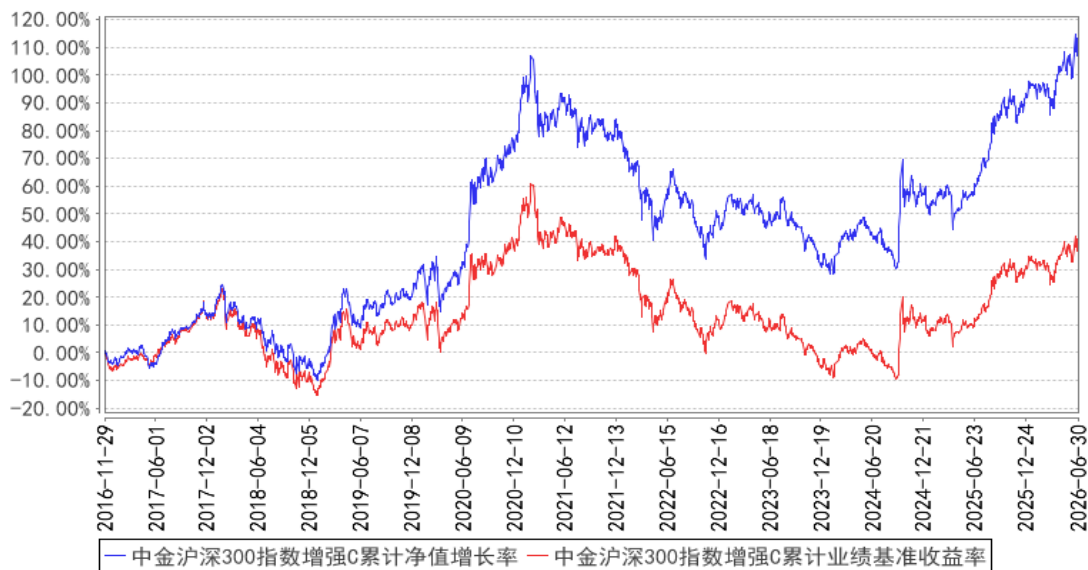
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.02%	1.23%	11.30%	1.19%	0.72%	0.04%
过去六个月	10.05%	1.10%	7.20%	1.07%	2.85%	0.03%
自基金合同生效起 至今	12.90%	1.04%	8.59%	1.01%	4.31%	0.03%

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

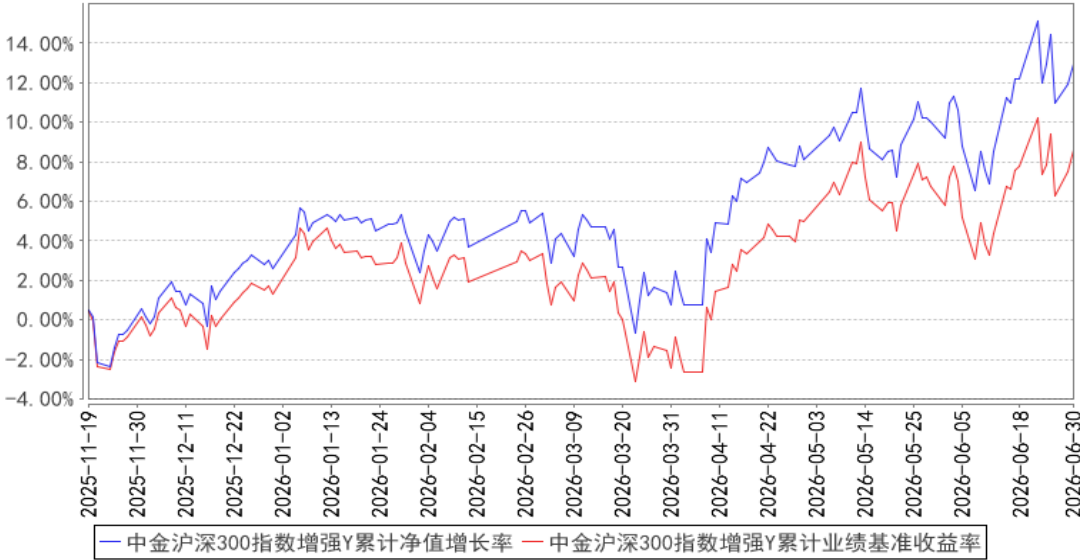
中金沪深300指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



中金沪深300指数增强Y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 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经理	2020 年 10 月 29 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	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，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沪深 300 指数增强 A 基金份额净值为 2.2438 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.87%，同期业绩基准收益率为 7.20%；中金沪深 300 指数增强 C 基金份额净值为 2.2394 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.65%，同期业绩基准收益率为 7.20%；中金沪深 300 指数增强 Y 基金份额净值为 2.2485 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.05%，同期业绩基准收益率为 7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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 2026 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：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	19, 042, 734. 14	14, 474, 983. 81
结算备付金		7, 312, 943. 53	3, 070, 321. 72
存出保证金		357, 564. 89	203, 170. 57
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	1, 612, 628, 537. 05	1, 371, 114, 176. 72
其中：股票投资		1, 521, 279, 961. 67	1, 295, 367, 649. 08
基金投资		-	-
债券投资		91, 348, 575. 38	75, 746, 527. 64
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		-	38, 217, 612. 55
应收股利		-	-
应收申购款		17, 160, 758. 88	6, 054, 799. 21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-
资产总计		1, 656, 502, 538. 49	1, 433, 135, 064. 58
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		26, 000, 000. 00	5, 199, 635. 07
应付清算款		8, 930, 541. 97	-
应付赎回款		5, 120, 279. 49	49, 060, 721. 15
应付管理人报酬		660, 219. 50	563, 687. 06
应付托管费		198, 065. 80	169, 106. 12
应付销售服务费		133, 730. 45	146, 785. 47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		16, 731. 05	35. 17

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	871,175.00	496,324.69
负债合计		41,930,743.26	55,636,294.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	719,944,876.05	674,475,229.96
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	894,626,919.18	703,023,539.89
净资产合计		1,614,571,795.23	1,377,498,769.85
负债和净资产总计		1,656,502,538.49	1,433,135,064.58

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，中金沪深 300 指数增强 A 的基金份额净值为 2.2438 元，期末份额总额为 521,579,581.64 份；中金沪深 300 指数增强 C 的基金份额净值为 2.2394 元，期末份额总额为 195,437,099.95 份；中金沪深 300 指数增强 Y 的基金份额净值为 2.2485 元，期末份额总额为 2,928,194.46 份。基金份额总额 719,944,876.05 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：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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		154,966,808.86	27,543,928.36
1. 利息收入		44,948.96	37,750.77
其中：存款利息收入	6.4.7.13	44,948.96	37,750.77
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“-”填列）		131,149,164.78	41,660,219.98
其中：股票投资收益	6.4.7.14	115,767,544.83	25,640,858.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	583,699.69	387,692.52
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	450,568.74	-
股利收益	6.4.7.19	14,347,351.52	15,631,668.71

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	23, 293, 695. 63	-14, 289, 888. 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	478, 999. 49	135, 846. 53
减：二、营业总支出		6, 071, 607. 29	4, 809, 001. 62
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	3, 873, 630. 70	2, 954, 411. 85
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	1, 162, 089. 07	886, 323. 50
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	862, 639. 51	731, 232. 09
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		73, 052. 11	98, 547. 92
其中：卖出回购金融资产支出		73, 052. 11	98, 547. 92
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		2, 696. 30	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	97, 499. 60	138, 486. 26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		148, 895, 201. 57	22, 734, 926. 74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		148, 895, 201. 57	22, 734, 926. 74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		148, 895, 201. 57	22, 734, 926. 74

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：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	674, 475, 229. 96	-	703, 023, 539. 89	1, 377, 498, 769. 85
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	674,475,229.96	-	703,023,539.89	1,377,498,769.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	45,469,646.09	-	191,603,379.29	237,073,025.38
(一)、综合收益总额	-	-	148,895,201.57	148,895,201.57
(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)	45,469,646.09	-	42,708,177.72	88,177,823.81
其中：1. 基金申购款	660,040,907.30	-	737,580,573.64	1,397,621,480.94
2. 基金赎回款	-614,571,261.21	-	-694,872,395.92	-1,309,443,657.13
(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	719,944,876.05	-	894,626,919.18	1,614,571,795.23
项目	上年度可比期间 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	-702,539,646.21	-	-456,790,669.56	-1,159,330,315.77
(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

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。

根据基金合同和《中金基金管理有限公司关于中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金增设 Y 类基金份额并相应修改法律文件的公告》,本基金于 2025 年 11 月 5 日起增设 Y 类份额(基金代码:025936),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:003015)、C 类基金份额(基金代码:003579)的份额类别名称及各项业务规则保持不变。通过非个人养老金资金账户投资,在投资者申购时收取申购费用,赎回时收取赎回费但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;通过非个人养老金资金账户投资,在投资者申购时不收取申购费用,赎回时收取赎回费但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额;根据《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》设置,针对个人养老金投资基金业务设立的基金份额类别,称为 Y 类基金份额。本基金 A 类、C 类和 Y 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、C 类和 Y 类基金份额将分别计算基金份额净值,投资人可自行选择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》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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》、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》、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) 对本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。

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。

(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。

(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。

(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	19,042,734.14
等于：本金	19,040,893.92
加：应计利息	1,840.22
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	19,042,734.14

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		1,400,096,899.56	—	1,521,279,961.67	121,183,062.11
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	90,535,070.00	802,345.38	91,348,575.38	11,160.00
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	90,535,070.00	802,345.38	91,348,575.38	11,160.00
资产支持证券		—	—	—	—

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,490,631,969.56	802,345.38	1,612,628,537.05	121,194,222.11

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 2026 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	781,273.49
其中：交易所市场	781,273.49
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,901.51
合计	871,175.00

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金沪深 300 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	489,760,231.17	489,760,231.17
本期申购	355,762,793.05	355,762,793.05
本期赎回（以“-”号填列）	-323,943,442.58	-323,943,442.58
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	521,579,581.64	521,579,581.64

中金沪深 300 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	184,678,979.44	184,678,979.44
本期申购	300,602,609.63	300,602,609.63
本期赎回（以“-”号填列）	-289,844,489.12	-289,844,489.12
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	195,437,099.95	195,437,099.95

中金沪深 300 指数增强 Y

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	36,019.35	36,019.35
本期申购	3,675,504.62	3,675,504.62
本期赎回（以“-”号填列）	-783,329.51	-783,329.51
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	2,928,194.46	2,928,194.46

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

中金沪深 300 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	396,527,311.16	113,955,425.84	510,482,737.00
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	396,527,311.16	113,955,425.84	510,482,737.00
本期利润	92,738,207.02	19,546,997.93	112,285,204.95
本期基金份额交易产生的变动数	23,546,680.07	2,431,314.75	25,977,994.82
其中：基金申购款	316,433,271.17	81,577,015.51	398,010,286.68
基金赎回款	-292,886,591.10	-79,145,700.76	-372,032,291.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	512,812,198.25	135,933,738.52	648,745,936.77

中金沪深 300 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	149,056,117.96	43,447,109.87	192,503,227.83
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	149,056,117.96	43,447,109.87	192,503,227.83
本期利润	32,589,332.20	3,569,995.45	36,159,327.65
本期基金份额交易产生的变动数	9,155,843.37	4,406,817.18	13,562,660.55

其中：基金申购款	266,251,895.38	69,242,436.81	335,494,332.19
基金赎回款	-257,096,052.01	-64,835,619.63	-321,931,671.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	190,801,293.53	51,423,922.50	242,225,216.03

中金沪深 300 指数增强 Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,193.57	8,381.49	37,575.06
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	29,193.57	8,381.49	37,575.06
本期利润	273,966.72	176,702.25	450,668.97
本期基金份额交易产生的变动数	2,589,199.41	578,322.94	3,167,522.35
其中：基金申购款	3,304,487.71	771,467.06	4,075,954.77
基金赎回款	-715,288.30	-193,144.12	-908,432.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,892,359.70	763,406.68	3,655,766.38

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	30,174.01
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	11,079.52
其他	3,695.43
合计	44,948.96

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	115,767,544.83
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	115,767,544.83

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	3,577,339,749.60
减：卖出股票成本总额	3,457,902,388.38
减：交易费用	3,669,816.39
买卖股票差价收入	115,767,544.83

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	543,036.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	40,663.40
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	583,699.69

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	45,155,160.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	44,559,336.60
减：应计利息总额	555,160.00
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	40,663.40

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	450,568.74

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	14,347,351.52
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	14,347,351.52

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	23,293,695.63
股票投资	23,335,329.03
债券投资	-41,633.40
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	23,293,695.63

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	478,713.74
基金转换费收入	285.75
合计	478,999.49

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	30,394.14
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
划款手续费	7,598.09
合计	97,499.60

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	4,422,401,600.59	61.13	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	60,035,130.00	100.00	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	1,064,200,000.00	83.06	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			
	2026年1月1日至2026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	866,363.39	61.13	461,589.85	59.08
关联方名称	上年度可比期间			
	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	-	-

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证券交易费用管理规定》，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,873,630.70	2,954,411.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,373,388.73	737,607.74
应支付基金管理人的净管理费	2,500,241.97	2,216,804.11

注：本基金 A 类基金份额、C 类基金份额的年管理费率为 0.50%；Y 类基金份额适用优惠的管理费率，年管理费率为 0.25%。支付基金管理人中金基金各类基金份额的管理费计算公式为：该类基金份额日基金管理费=该类基金份额前一日基金资产净值×该类基金份额的年管理费率/当年天数，逐日累计至每月月底，按月支付。

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,162,089.07	886,323.50

注：本基金 A 类基金份额、C 类基金份额的年托管费率为 0.15%；Y 类基金份额适用优惠的托管费率，年托管费率为 0.075%。支付基金托管人工商银行的各项基金份额的托管费计算公式为：该类基金份额日基金托管费=该类基金份额前一日基金资产净值×该类基金份额的年托管费率/当年天数，逐日累计至每月月底，按月支付。

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			
	中金沪深 300 指数增强 A	中金沪深 300 指数增强 C	中金沪深 300 指数增强 Y	合计
工商银行	-	23,685.13	-	23,685.13
中金财富证券	-	32,626.17	-	32,626.17
中金基金	-	6,985.06	-	6,985.06
合计	-	63,296.36	-	63,296.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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	中金沪深 300 指数增强 Y	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

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 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
工商银行	19,042,734.14	30,174.01	7,900,081.22	19,836.65

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

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	601112	振石股份	网下	7,741	86,544.38
中金公司	688781	视涯科技	网下	1,082	24,539.76
中金公司	001220	世盟股份	网下	570	15,960
中金公司	688820	盛合晶微	网下	21,716	427,370.88
中金公司	001399	惠科股份	网下	16,218	164,126.16
中金公司	001248	华润新能源	网下	70,142	709,135.62
中金公司	301531	春光集团	网下	2,898	38,543.40
中金公司	688712	北芯生命	网下	4,998	87,564.96
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 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
中金公司	688775	影石创新	网下	5,725	270,620.75

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

本基金本报告期内未实施利润分配。

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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
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	49,100	496,401.00	496,401.00	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新股流通受限	10.11	10.11	21,042	212,734.62	212,734.62	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-

001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普	2026 年 4 月	6 个月	新股	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-

	微	月 8 日		流通受限						
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-

				受限						
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-

688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	9 个月	新股流通受限	29.06	48.56	16,470	478,618.20	799,783.20	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	9 个月	新股流通受限	8.62	57.42	44,686	385,193.32	2,565,870.12	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	4,282	489,346.96	2,898,657.08	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	3,195	334,388.70	2,456,603.55	-
688808	联讯	2026 年 4 月	6 个月	新股	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-

	仪器	月 16 日		流通受限						
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,172	42,744.96	307,316.28	-

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 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	17,348	12,625,750.02	15,258,086.44	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日,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 26,000,000.00 元,于 2026 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 金融工具风险及管理

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	19,040,893.92	-	-	1,840.22	19,042,734.14
结算备付金	7,312,220.93	-	-	722.60	7,312,943.53
存出保证金	357,530.09	-	-	34.80	357,564.89
交易性金融资产	90,546,230.00	-	-	1,522,082,307.05	1,612,628,537.05
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	-	-	-	17,160,758.88	17,160,758.88
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	117,256,874.94	-	-	1,539,245,663.55	1,656,502,538.49
负债					
卖出回购金融资产款	26,000,000.00	-	-	-	26,000,000.00
应付清算款	-	-	-	8,930,541.97	8,930,541.97
应付赎回款	-	-	-	5,120,279.49	5,120,279.49
应付销售服务费	-	-	-	133,730.45	133,730.45
应付管理人报酬	-	-	-	660,219.50	660,219.50
应付托管费	-	-	-	198,065.80	198,065.80
应交税费	-	-	-	16,731.05	16,731.05
其他负债	-	-	-	871,175.00	871,175.00
负债总计	26,000,000.00	-	-	15,930,743.26	41,930,743.26

利率敏感度缺口	91,256,874.94	-	-	-1,523,314,920.29	1,614,571,795.23
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	14,469,850.28	-	-	5,133.53	14,474,983.81
结算备付金	3,020,943.08	-	-	49,378.64	3,070,321.72
存出保证金	203,148.79	-	-	21.78	203,170.57
交易性金融资产	75,112,070.00	-	-	-1,296,002,106.72	1,371,114,176.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	38,217,612.55	38,217,612.55
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	6,054,799.21	6,054,799.21
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	92,806,012.15	-	-	-1,340,329,052.43	1,433,135,064.58
负债					
卖出回购金融资产款	5,200,000.00	-	-	-364.93	5,199,635.07
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	49,060,721.15	49,060,721.15
应付销售服务费	-	-	-	146,785.47	146,785.47
应付管理人报酬	-	-	-	563,687.06	563,687.06
应付托管费	-	-	-	169,106.12	169,106.12
应交税费	-	-	-	35.17	35.17
其他负债	-	-	-	496,324.69	496,324.69
负债总计	5,200,000.00	-	-	50,436,294.73	55,636,294.73
利率敏感度缺口	87,606,012.15	-	-	-1,289,892,757.70	1,377,498,769.85

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）

	市场利率下降 25 个基点	75,966.00	61,844.17
	市场利率上升 25 个基点	-75,966.00	-61,844.17

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	1,521,279,961.67	94.22	1,295,367,649.08	94.04
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	1,521,279,961.67	94.22	1,295,367,649.08	94.04

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%	81, 535, 875. 66	68, 186, 189. 11
	业绩比较基准下降 5%	-81, 535, 875. 66	-68, 186, 189. 11

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	1, 494, 480, 392. 51	1, 276, 441, 767. 96
第二层次	107, 315, 797. 44	88, 027, 885. 88
第三层次	10, 832, 347. 10	6, 644, 522. 88
合计	1, 612, 628, 537. 05	1, 371, 114, 176. 72

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	1,521,279,961.67	91.84
	其中：股票	1,521,279,961.67	91.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	91,348,575.38	5.51
	其中：债券	91,348,575.38	5.51
	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	26,355,677.67	1.59
8	其他各项资产	17,518,323.77	1.06
9	合计	1,656,502,538.49	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	490,433.82	0.03
B	采矿业	56,445,684.47	3.50
C	制造业	914,223,396.76	56.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,377,655.98	1.51
E	建筑业	14,402,071.61	0.89
F	批发和零售业	6,451,416.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	40,971,447.32	2.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	82,675,201.96	5.12

J	金融业	237,303,096.10	14.70
K	房地产业	493,517.00	0.03
L	租赁和商务服务业	12,243,189.50	0.76
M	科学研究和技术服务业	19,079,912.40	1.18
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	672,347.48	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,409,829,370.40	87.32

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	815,150.70	0.05
B	采矿业	1,024,246.82	0.06
C	制造业	97,502,136.17	6.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,253,059.62	0.08
E	建筑业	1,397,974.00	0.09
F	批发和零售业	3,754,298.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	536,518.46	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,172,101.52	0.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	488,512.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	2,443.98	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,179,142.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	325,008.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	111,450,591.27	6.90

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	75,300	95,631,000.00	5.92
2	300750	宁德时代	164,366	64,597,481.66	4.00
3	603986	兆易创新	51,700	42,135,500.00	2.61
4	300502	新易盛	60,519	36,735,033.00	2.28
5	002384	东山精密	138,500	36,335,475.00	2.25
6	688256	寒武纪	21,107	33,677,273.85	2.09
7	600519	贵州茅台	26,801	31,772,317.49	1.97
8	601899	紫金矿业	1,227,223	30,852,386.22	1.91
9	600150	中国船舶	738,764	24,962,835.56	1.55
10	600030	中信证券	778,540	22,367,454.20	1.39
11	600183	生益科技	124,801	21,640,493.40	1.34
12	300408	三环集团	126,783	21,160,082.70	1.31
13	603259	药明康德	153,240	19,079,912.40	1.18
14	000333	美的集团	233,651	17,647,660.03	1.09
15	301308	江波龙	24,000	16,891,200.00	1.05
16	688008	澜起科技	53,708	16,644,109.20	1.03
17	002916	深南电路	35,500	16,255,450.00	1.01
18	000776	广发证券	666,363	15,592,894.20	0.97
19	688072	拓荆科技	17,348	15,258,086.44	0.95
20	002415	海康威视	436,226	14,918,929.20	0.92
21	601288	农业银行	2,454,800	14,900,636.00	0.92
22	601318	中国平安	311,479	14,870,007.46	0.92
23	002142	宁波银行	498,300	14,794,527.00	0.92
24	000338	潍柴动力	534,400	14,562,400.00	0.90
25	600887	伊利股份	598,135	14,331,314.60	0.89
26	605117	德业股份	128,471	13,641,050.78	0.84
27	000100	TCL 科技	2,232,440	12,992,800.80	0.80
28	002558	巨人网络	461,400	12,716,184.00	0.79
29	601138	工业富联	175,736	12,679,352.40	0.79
30	601872	招商轮船	714,200	12,548,494.00	0.78
31	002463	沪电股份	81,500	12,453,200.00	0.77

32	002493	荣盛石化	1, 109, 052	11, 922, 309. 00	0. 74
33	000807	云铝股份	530, 000	11, 734, 200. 00	0. 73
34	688111	金山办公	54, 894	11, 695, 166. 70	0. 72
35	688012	中微公司	24, 358	11, 411, 723. 00	0. 71
36	000001	平安银行	1, 104, 500	11, 100, 225. 00	0. 69
37	600522	中天科技	180, 432	10, 948, 613. 76	0. 68
38	601998	中信银行	1, 571, 100	10, 887, 723. 00	0. 67
39	600036	招商银行	305, 248	10, 836, 304. 00	0. 67
40	000408	藏格矿业	155, 700	10, 793, 124. 00	0. 67
41	603288	海天味业	323, 444	10, 725, 403. 04	0. 66
42	000792	盐湖股份	352, 000	10, 626, 880. 00	0. 66
43	002475	立讯精密	144, 600	10, 179, 840. 00	0. 63
44	600026	中远海能	552, 700	9, 915, 438. 00	0. 61
45	600926	杭州银行	683, 017	9, 869, 595. 65	0. 61
46	601360	三六零	1, 123, 500	9, 763, 215. 00	0. 60
47	002027	分众传媒	2, 006, 400	9, 710, 976. 00	0. 60
48	601688	华泰证券	445, 500	9, 186, 210. 00	0. 57
49	600233	圆通速递	580, 900	9, 149, 175. 00	0. 57
50	600900	长江电力	342, 034	9, 053, 639. 98	0. 56
51	300014	亿纬锂能	134, 400	8, 740, 032. 00	0. 54
52	000301	东方盛虹	759, 800	8, 699, 710. 00	0. 54
53	002001	新 和 成	306, 044	8, 697, 770. 48	0. 54
54	300628	亿联网络	252, 315	8, 533, 293. 30	0. 53
55	000938	紫光股份	292, 200	8, 432, 892. 00	0. 52
56	601066	中信建投	284, 755	8, 277, 827. 85	0. 51
57	600000	浦发银行	958, 687	8, 254, 295. 07	0. 51
58	000975	山金国际	476, 700	8, 103, 900. 00	0. 50
59	601988	中国银行	1, 400, 700	8, 012, 004. 00	0. 50
60	600919	江苏银行	711, 189	7, 666, 617. 42	0. 47
61	600346	恒力石化	427, 200	7, 565, 712. 00	0. 47
62	002532	天山铝业	695, 800	7, 465, 934. 00	0. 46
63	601009	南京银行	725, 900	7, 179, 151. 00	0. 44
64	688472	阿特斯	646, 011	6, 989, 839. 02	0. 43
65	688036	传音控股	116, 274	6, 854, 352. 30	0. 42
66	601328	交通银行	1, 031, 350	6, 631, 580. 50	0. 41
67	601766	中国中车	1, 255, 200	6, 527, 040. 00	0. 40
68	600482	中国动力	198, 800	6, 520, 640. 00	0. 40
69	600489	中金黄金	343, 500	6, 200, 175. 00	0. 38
70	688981	中芯国际	36, 891	5, 859, 028. 62	0. 36
71	003816	中国广核	1, 477, 800	5, 778, 198. 00	0. 36
72	000425	徐工机械	706, 100	5, 712, 349. 00	0. 35
73	601607	上海医药	370, 900	5, 711, 860. 00	0. 35
74	600875	东方电气	192, 182	5, 529, 076. 14	0. 34

75	000166	申万宏源	1,249,700	5,498,680.00	0.34
76	600176	中国巨石	72,400	5,276,512.00	0.33
77	300661	圣邦股份	36,720	5,268,585.60	0.33
78	600028	中国石化	1,168,300	5,210,618.00	0.32
79	002049	紫光国微	58,514	5,193,117.50	0.32
80	000895	双汇发展	230,300	5,158,720.00	0.32
81	002236	大华股份	311,060	5,129,379.40	0.32
82	000651	格力电器	132,500	4,968,750.00	0.31
83	601658	邮储银行	933,200	4,600,676.00	0.28
84	601319	中国人保	672,800	4,548,128.00	0.28
85	600104	上汽集团	458,300	4,473,008.00	0.28
86	300059	东方财富	216,406	4,410,354.28	0.27
87	002371	北方华创	4,925	4,356,458.00	0.27
88	600372	中航机载	399,700	4,336,745.00	0.27
89	000725	京东方 A	492,000	4,270,560.00	0.26
90	002709	天赐材料	80,800	4,155,544.00	0.26
91	000708	中信特钢	326,500	4,120,430.00	0.26
92	601618	中国中冶	1,673,500	4,083,340.00	0.25
93	688183	生益电子	30,530	4,042,172.00	0.25
94	600309	万华化学	58,399	3,995,075.59	0.25
95	601668	中国建筑	881,800	3,827,012.00	0.24
96	688396	华润微	38,379	3,743,871.45	0.23
97	601100	恒立液压	34,227	3,681,456.12	0.23
98	300999	金龙鱼	154,100	3,584,366.00	0.22
99	601628	中国人寿	99,900	3,531,465.00	0.22
100	601601	中国太保	123,240	3,514,804.80	0.22
101	601939	建设银行	358,100	3,448,503.00	0.21
102	002466	天齐锂业	56,000	3,433,920.00	0.21
103	601166	兴业银行	201,558	3,337,800.48	0.21
104	300476	胜宏科技	9,300	3,221,799.00	0.20
105	600741	华域汽车	203,800	3,162,976.00	0.20
106	688041	海光信息	8,122	3,007,576.60	0.19
107	002460	赣锋锂业	44,400	2,903,760.00	0.18
108	300832	新产业	68,500	2,877,000.00	0.18
109	600050	中国联通	717,700	2,870,800.00	0.18
110	300274	阳光电源	18,039	2,868,561.78	0.18
111	002625	光启技术	93,500	2,834,920.00	0.18
112	300033	同花顺	11,760	2,834,160.00	0.18
113	600570	恒生电子	132,329	2,804,051.51	0.17
114	002648	卫星化学	113,580	2,667,994.20	0.17
115	600930	华电新能	556,700	2,655,459.00	0.16
116	601916	浙商银行	976,900	2,569,247.00	0.16
117	600426	华鲁恒升	103,761	2,481,963.12	0.15

118	600941	中国移动	28,350	2,441,785.50	0.15
119	600893	航发动力	63,100	2,419,254.00	0.15
120	600886	国投电力	179,100	2,383,821.00	0.15
121	601901	方正证券	328,400	2,364,480.00	0.15
122	601238	广汽集团	462,000	2,346,960.00	0.15
123	600016	民生银行	704,800	2,269,456.00	0.14
124	600018	上港集团	478,300	2,257,576.00	0.14
125	601117	中国化学	306,900	2,255,715.00	0.14
126	600066	宇通客车	83,954	2,250,806.74	0.14
127	300394	天孚通信	7,320	2,215,617.60	0.14
128	601888	中国中免	37,650	2,022,181.50	0.13
129	601816	京沪高铁	445,400	2,017,662.00	0.12
130	603993	洛阳钼业	109,649	1,924,339.95	0.12
131	603799	华友钴业	39,087	1,886,338.62	0.12
132	000657	中钨高新	19,500	1,866,540.00	0.12
133	601390	中国中铁	425,533	1,774,472.61	0.11
134	600460	士兰微	32,384	1,770,109.44	0.11
135	000157	中联重科	253,600	1,767,592.00	0.11
136	000988	华工科技	9,400	1,735,334.00	0.11
137	601336	新华保险	28,900	1,724,174.00	0.11
138	601881	中国银河	134,319	1,688,389.83	0.10
139	601058	赛轮轮胎	146,400	1,687,992.00	0.10
140	600196	复星医药	74,800	1,680,756.00	0.10
141	600690	海尔智家	80,370	1,640,351.70	0.10
142	002179	中航光电	34,600	1,598,520.00	0.10
143	601877	正泰电器	63,326	1,587,582.82	0.10
144	002594	比亚迪	19,906	1,586,508.20	0.10
145	600061	国投资本	241,468	1,581,615.40	0.10
146	600025	华能水电	177,400	1,577,086.00	0.10
147	601186	中国铁建	264,200	1,571,990.00	0.10
148	600276	恒瑞医药	30,200	1,571,608.00	0.10
149	600760	中航沈飞	37,460	1,539,606.00	0.10
150	601898	中煤能源	126,300	1,538,334.00	0.10
151	600027	华电国际	344,400	1,532,580.00	0.09
152	601698	中国卫通	50,100	1,515,525.00	0.09
153	600118	中国卫星	18,300	1,501,515.00	0.09
154	603019	中科曙光	14,000	1,501,220.00	0.09
155	603893	瑞芯微	7,900	1,488,044.00	0.09
156	601018	宁波港	471,300	1,484,595.00	0.09
157	300866	安克创新	14,200	1,483,900.00	0.09
158	600845	宝信软件	88,800	1,476,744.00	0.09
159	688009	中国通号	308,555	1,468,721.80	0.09
160	600989	宝丰能源	70,700	1,437,331.00	0.09

161	601169	北京银行	283,900	1,391,110.00	0.09
162	002602	世纪华通	98,400	1,387,440.00	0.09
163	002353	杰瑞股份	8,900	1,357,250.00	0.08
164	000063	中兴通讯	36,900	1,335,411.00	0.08
165	300124	汇川技术	19,700	1,306,701.00	0.08
166	601788	光大证券	87,400	1,261,182.00	0.08
167	600999	招商证券	58,720	1,238,992.00	0.08
168	002028	思源电气	7,078	1,224,494.00	0.08
169	601211	国泰海通	65,187	1,186,403.40	0.07
170	600809	山西汾酒	10,340	1,130,885.80	0.07
171	002202	金风科技	47,300	1,130,470.00	0.07
172	601600	中国铝业	136,300	1,120,386.00	0.07
173	601728	中国电信	206,700	1,072,773.00	0.07
174	000538	云南白药	22,078	1,045,834.86	0.06
175	601111	中国国航	170,400	1,030,920.00	0.06
176	002600	领益智造	57,500	997,050.00	0.06
177	600115	中国东航	260,300	991,743.00	0.06
178	600111	北方稀土	19,863	954,417.15	0.06
179	600031	三一重工	53,480	924,134.40	0.06
180	600600	青岛啤酒	17,550	916,636.50	0.06
181	600011	华能国际	118,700	900,933.00	0.06
182	002050	三花智控	20,300	889,749.00	0.06
183	300803	指南针	9,400	861,698.00	0.05
184	002352	顺丰控股	27,200	850,272.00	0.05
185	600015	华夏银行	123,872	791,542.08	0.05
186	600019	宝钢股份	142,150	771,874.50	0.05
187	600547	山东黄金	33,000	761,970.00	0.05
188	000963	华东医药	26,300	739,556.00	0.05
189	601800	中国交建	121,200	692,052.00	0.04
190	600660	福耀玻璃	13,467	679,275.48	0.04
191	300015	爱尔眼科	81,398	672,347.48	0.04
192	600188	兖矿能源	32,190	572,016.30	0.04
193	600438	通威股份	43,100	521,941.00	0.03
194	600415	小商品城	50,200	510,032.00	0.03
195	000858	五粮液	6,652	492,248.00	0.03
196	301165	锐捷网络	6,100	490,745.00	0.03
197	601127	赛力斯	7,900	483,875.00	0.03
198	601059	信达证券	28,500	461,415.00	0.03
199	600362	江西铜业	10,300	445,990.00	0.03
200	603296	华勤技术	5,820	432,251.40	0.03
201	601006	大秦铁路	93,300	430,113.00	0.03
202	300450	先导智能	10,100	411,272.00	0.03
203	600089	特变电工	17,600	396,000.00	0.02

204	601077	渝农商行	64,600	394,706.00	0.02
205	601088	中国神华	10,100	394,304.00	0.02
206	601857	中国石油	45,200	392,336.00	0.02
207	300433	蓝思科技	7,295	391,449.70	0.02
208	605499	东鹏饮料	2,865	353,626.95	0.02
209	300760	迈瑞医疗	2,200	298,826.00	0.02
210	600549	厦门钨业	3,500	298,200.00	0.02
211	601225	陕西煤业	14,600	297,110.00	0.02
212	601919	中远海控	22,282	295,459.32	0.02
213	002938	鹏鼎控股	2,800	295,064.00	0.02
214	002714	牧原股份	8,418	294,545.82	0.02
215	600406	国电南瑞	12,884	294,399.40	0.02
216	601012	隆基绿能	22,437	294,373.44	0.02
217	601229	上海银行	33,898	294,234.64	0.02
218	002230	科大讯飞	7,200	294,048.00	0.02
219	601878	浙商证券	30,100	285,950.00	0.02
220	300122	智飞生物	23,200	271,208.00	0.02
221	000002	万 科 A	90,400	267,584.00	0.02
222	688521	芯原股份	600	222,684.00	0.01
223	600584	长电科技	2,000	207,100.00	0.01
224	600010	包钢股份	90,200	201,146.00	0.01
225	601985	中国核电	22,100	199,563.00	0.01
226	300442	润泽科技	2,400	199,368.00	0.01
227	603501	豪威集团	2,100	199,185.00	0.01
228	000630	铜陵有色	31,200	198,432.00	0.01
229	002241	歌尔股份	8,800	198,264.00	0.01
230	600938	中国海油	7,300	198,195.00	0.01
231	688126	沪硅产业	4,952	197,535.28	0.01
232	600905	三峡能源	53,200	197,372.00	0.01
233	688271	联影医疗	1,948	197,196.04	0.01
234	600958	东方证券	20,836	196,691.84	0.01
235	601818	光大银行	68,000	196,520.00	0.01
236	000977	浪潮信息	2,800	196,000.00	0.01
237	300498	温氏股份	15,900	195,888.00	0.01
238	601825	沪农商行	26,100	195,489.00	0.01
239	000568	泸州老窖	2,498	193,644.96	0.01
240	002837	英维克	2,400	190,944.00	0.01
241	600160	巨化股份	3,600	190,836.00	0.01
242	603369	今世缘	7,800	184,938.00	0.01
243	688082	盛美上海	411	177,552.00	0.01
244	600585	海螺水泥	10,000	169,500.00	0.01
245	600588	用友网络	16,000	146,880.00	0.01
246	001979	招商蛇口	19,800	127,314.00	0.01

247	601689	拓普集团	1,800	101,556.00	0.01
248	002422	科伦药业	2,600	100,152.00	0.01
249	601838	成都银行	5,600	99,120.00	0.01
250	601377	兴业证券	16,400	99,056.00	0.01
251	002074	国轩高科	3,600	99,036.00	0.01
252	600795	国电电力	21,200	99,004.00	0.01
253	601868	中国能建	37,000	98,790.00	0.01
254	601669	中国电建	21,000	98,700.00	0.01
254	601727	上海电气	14,100	98,700.00	0.01
255	600048	保利发展	21,300	98,619.00	0.01
256	600219	南山铝业	24,700	98,553.00	0.01
257	600436	片仔癀	900	98,352.00	0.01
258	000625	长安汽车	13,700	98,229.00	0.01
259	002311	海大集团	2,200	98,142.00	0.01
260	300418	昆仑万维	2,400	96,864.00	0.01
261	300316	晶盛机电	1,600	96,640.00	0.01
262	603260	合盛硅业	79	3,812.54	0.00
263	688303	大全能源	192	3,346.56	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	688498	源杰科技	4,600	8,675,600.00	0.54
2	600487	亨通光电	49,600	5,423,264.00	0.34
3	300223	君正股份	12,900	3,210,810.00	0.20
4	688795	摩尔线程	4,282	2,898,657.08	0.18
5	603083	剑桥科技	10,800	2,752,596.00	0.17
6	688783	西安奕材	44,686	2,565,870.12	0.16
7	688802	沐曦股份	3,195	2,456,603.55	0.15
8	002653	海思科	34,900	2,315,266.00	0.14
9	002738	中矿资源	38,400	2,265,216.00	0.14
10	002851	麦格米特	12,900	2,156,622.00	0.13
11	688266	泽璟制药	17,555	2,047,966.30	0.13
12	002812	恩捷股份	29,600	1,980,536.00	0.12
13	688627	精智达	2,600	1,859,000.00	0.12
14	002281	光迅科技	7,100	1,824,274.00	0.11
15	002266	浙富控股	349,800	1,769,988.00	0.11
16	301511	德福科技	11,300	1,625,505.00	0.10
17	688257	新锐股份	15,760	1,605,944.00	0.10
18	300475	香农芯创	5,300	1,590,000.00	0.10
19	301526	国际复材	31,500	1,470,105.00	0.09
20	000949	新乡化纤	207,700	1,316,818.00	0.08
21	603268	松发股份	9,300	1,295,304.00	0.08
22	688221	前沿生物	56,839	1,273,193.60	0.08

23	301377	鼎泰高科	2,200	1,211,980.00	0.08
24	300438	鹏辉能源	14,400	1,193,040.00	0.07
25	688235	百济神州	4,400	1,120,284.00	0.07
26	002079	苏州固锟	69,400	1,043,082.00	0.06
27	300590	移为通信	71,900	1,031,765.00	0.06
28	603929	亚翔集成	3,700	1,006,474.00	0.06
29	688025	杰普特	2,000	940,000.00	0.06
30	300458	全志科技	23,800	939,148.00	0.06
31	301068	大地海洋	38,800	923,440.00	0.06
32	600619	海立股份	57,300	908,205.00	0.06
33	301217	铜冠铜箔	5,500	907,885.00	0.06
34	300953	震裕科技	6,600	882,420.00	0.05
35	002326	永太科技	36,100	853,765.00	0.05
36	688519	南亚新材	2,200	836,088.00	0.05
37	301060	兰卫医学	101,200	826,804.00	0.05
38	002458	益生股份	104,910	815,150.70	0.05
39	688765	禾元生物	16,470	799,783.20	0.05
40	688059	华锐精密	4,000	798,840.00	0.05
41	002756	永兴材料	14,100	798,624.00	0.05
42	300424	航新科技	50,500	794,870.00	0.05
43	300277	汽轮科技	52,800	794,112.00	0.05
44	600869	远东股份	23,700	793,239.00	0.05
45	300604	长川科技	2,300	785,266.00	0.05
46	603579	荣泰健康	43,400	736,498.00	0.05
47	001248	华润新能源	70,142	709,135.62	0.04
48	000973	佛塑科技	48,600	697,410.00	0.04
49	603390	通达电气	66,800	697,392.00	0.04
50	002975	博杰股份	4,900	695,800.00	0.04
51	002487	大金重工	12,000	695,640.00	0.04
52	301280	珠城科技	13,200	667,524.00	0.04
53	300568	星源材质	33,900	634,608.00	0.04
54	688388	嘉元科技	14,400	633,600.00	0.04
55	000703	恒逸石化	46,300	628,291.00	0.04
56	002568	百润股份	36,900	624,348.00	0.04
57	603061	金海通	1,200	602,664.00	0.04
58	301180	万祥科技	47,400	593,922.00	0.04
59	300789	唐源电气	33,400	593,518.00	0.04
60	601666	平煤股份	82,300	588,445.00	0.04
61	600166	福田汽车	201,800	587,238.00	0.04
62	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.04
63	000933	神火股份	25,900	549,080.00	0.03
64	001289	龙源电力	34,800	543,924.00	0.03
65	601000	唐山港	128,900	534,935.00	0.03

66	300769	德方纳米	7,800	518,700.00	0.03
67	000729	燕京啤酒	50,255	509,083.15	0.03
68	688208	道通科技	20,192	508,636.48	0.03
69	300444	双杰电气	40,500	494,505.00	0.03
70	001339	智微智能	4,810	491,966.80	0.03
71	603329	上海雅仕	54,400	488,512.00	0.03
72	688090	瑞松科技	4,560	485,412.00	0.03
73	000990	诚志股份	59,300	485,074.00	0.03
74	002379	宏桥控股	32,000	472,640.00	0.03
75	688411	海博思创	1,600	465,920.00	0.03
76	300005	探路者	20,400	461,040.00	0.03
77	601869	长飞光纤	800	436,720.00	0.03
78	301122	采纳股份	14,700	432,327.00	0.03
79	001311	多利科技	26,250	423,412.50	0.03
80	002064	华峰化学	43,800	415,662.00	0.03
81	301177	迪阿股份	15,000	413,550.00	0.03
82	688700	东威科技	4,589	410,256.60	0.03
83	605218	伟时电子	24,800	409,944.00	0.03
84	600323	瀚蓝环境	14,900	409,154.00	0.03
85	300822	贝仕达克	34,400	402,480.00	0.02
86	688258	卓易信息	3,388	401,613.52	0.02
87	000506	招金黄金	34,100	399,652.00	0.02
88	603876	鼎胜新材	15,300	397,953.00	0.02
89	000893	亚钾国际	9,700	396,633.00	0.02
90	605289	罗曼股份	2,700	391,500.00	0.02
91	300184	力源信息	21,400	375,570.00	0.02
92	603045	福达合金	5,200	371,228.00	0.02
93	688347	华虹宏力	1,000	336,300.00	0.02
94	600455	博通股份	14,800	325,008.00	0.02
95	688820	盛合晶微	2,172	307,316.28	0.02
96	688456	有研粉材	2,200	307,120.00	0.02
97	301099	雅创电子	3,200	305,600.00	0.02
98	002810	山东赫达	12,100	298,870.00	0.02
99	300617	安靠智电	5,600	296,744.00	0.02
100	002488	金固股份	33,200	295,812.00	0.02
101	002838	道恩股份	9,600	293,952.00	0.02
102	603115	海星股份	2,400	293,928.00	0.02
103	600320	振华重工	70,500	291,165.00	0.02
104	688603	天承科技	1,400	291,130.00	0.02
105	301037	保立佳	22,400	268,800.00	0.02
106	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
107	300972	万辰集团	1,400	242,774.00	0.02
108	002154	报喜鸟	66,000	234,960.00	0.01

109	688668	鼎通科技	600	223,980.00	0.01
110	301116	益客食品	25,900	221,704.00	0.01
111	301536	星宸科技	1,700	218,807.00	0.01
112	688368	晶丰明源	1,000	216,520.00	0.01
113	301150	中一科技	3,380	213,311.80	0.01
114	603638	艾迪精密	8,900	208,705.00	0.01
115	603808	歌力思	26,800	202,876.00	0.01
116	688261	东微半导	1,900	199,367.00	0.01
117	688378	奥来德	3,200	198,400.00	0.01
118	605196	华通线缆	7,600	198,360.00	0.01
119	301510	固高科技	6,200	197,966.00	0.01
120	002957	科瑞技术	3,600	197,424.00	0.01
121	003022	联泓新科	7,600	196,840.00	0.01
122	301522	上大股份	7,500	196,275.00	0.01
123	301338	凯格精机	1,200	195,468.00	0.01
124	688690	纳微科技	4,400	194,040.00	0.01
125	002283	天润工业	19,600	189,140.00	0.01
126	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
127	301056	森赫股份	15,900	178,080.00	0.01
128	688809	强一股份	259	161,357.00	0.01
129	300168	万达信息	35,000	160,650.00	0.01
130	300395	菲利华	1,100	147,103.00	0.01
131	301200	大族数控	400	144,260.00	0.01
132	300861	美畅股份	5,300	133,507.00	0.01
133	600496	精工钢构	42,100	130,510.00	0.01
134	605138	盛泰集团	22,300	123,096.00	0.01
135	301369	联动科技	500	122,500.00	0.01
136	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
137	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
138	688610	埃科光电	400	105,360.00	0.01
139	301086	鸿富瀚	500	104,640.00	0.01
140	002518	科士达	1,900	101,821.00	0.01
141	002222	福晶科技	1,100	101,508.00	0.01
142	301662	宏工科技	1,000	101,320.00	0.01
143	600686	金龙汽车	8,800	99,352.00	0.01
144	301489	思泉新材	600	98,748.00	0.01
145	300756	金马游乐	2,960	97,828.00	0.01
146	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
147	603124	江南新材	500	93,490.00	0.01
148	601233	桐昆股份	3,100	67,115.00	0.00
149	600595	中孚实业	11,000	61,820.00	0.00
150	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
151	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00

152	688475	萤石网络	1,800	49,230.00	0.00
153	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
154	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
155	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
156	688002	睿创微纳	192	29,700.48	0.00
157	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
158	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
159	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
160	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
161	688578	艾力斯	152	16,598.40	0.00
162	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
163	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
164	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
165	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
166	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
167	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
168	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
169	688011	新光光电	177	12,366.99	0.00
170	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
171	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
172	301362	民爆光电	60	11,035.20	0.00
173	688677	海泰新光	109	11,023.17	0.00
174	688450	光格科技	162	10,852.38	0.00
175	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
176	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
177	688122	西部超导	156	9,798.36	0.00
178	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
179	688088	虹软科技	160	5,688.00	0.00
180	688685	迈信林	103	5,654.70	0.00
181	688577	浙海德曼	120	5,499.60	0.00
182	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
183	301031	中熔电气	36	4,300.20	0.00
184	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
185	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
186	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
187	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
188	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
189	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
190	688267	中触媒	46	906.20	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(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	300750	宁德时代	50,598,866.22	3.67
2	688256	寒武纪	46,545,059.13	3.38
3	002475	立讯精密	46,365,960.24	3.37
4	600030	中信证券	45,638,562.00	3.31
5	601328	交通银行	40,309,071.00	2.93
6	300308	中际旭创	40,065,952.05	2.91
7	601899	紫金矿业	39,528,034.22	2.87
8	000333	美的集团	37,772,341.84	2.74
9	600150	中国船舶	36,793,898.39	2.67
10	603986	兆易创新	35,791,168.00	2.60
11	601138	工业富联	35,787,029.00	2.60
12	002384	东山精密	34,539,744.00	2.51
13	603799	华友钴业	34,427,561.74	2.50
14	601288	农业银行	33,033,906.00	2.40
15	601998	中信银行	32,053,299.20	2.33
16	300502	新易盛	31,511,198.20	2.29
17	000776	广发证券	31,342,611.72	2.28
18	000338	潍柴动力	31,180,172.80	2.26
19	000001	平安银行	30,438,495.00	2.21
20	688008	澜起科技	29,143,971.94	2.12
21	002028	思源电气	28,982,848.52	2.10
22	601166	兴业银行	27,912,082.00	2.03
23	603993	洛阳钼业	27,673,462.00	2.01

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	52,244,464.83	3.79
2	002475	立讯精密	50,680,840.40	3.68
3	000333	美的集团	46,362,995.83	3.37
4	603993	洛阳钼业	45,163,087.36	3.28
5	300750	宁德时代	41,796,049.40	3.03
6	601138	工业富联	39,366,005.64	2.86
7	601328	交通银行	39,320,617.00	2.85
8	300308	中际旭创	39,139,111.40	2.84
9	601899	紫金矿业	35,904,787.94	2.61
10	600030	中信证券	35,737,683.00	2.59
11	601166	兴业银行	35,189,359.00	2.55
12	002028	思源电气	32,997,694.92	2.40
13	603799	华友钴业	32,366,385.50	2.35
14	000338	潍柴动力	32,145,352.50	2.33
15	300408	三环集团	31,403,640.83	2.28

16	688256	寒武纪	30,620,745.16	2.22
17	600406	国电南瑞	29,590,013.83	2.15
18	000001	平安银行	28,570,100.95	2.07
19	601898	中煤能源	28,262,449.99	2.05
20	603986	兆易创新	27,846,320.24	2.02
21	002463	沪电股份	27,767,909.00	2.02
22	600036	招商银行	27,684,557.65	2.01

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	3,660,479,371.94
卖出股票收入（成交）总额	3,577,339,749.60

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

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	91,348,575.38	5.66
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	91,348,575.38	5.66

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	019792	25 国债 19	377,000	38,095,560.80	2.36
2	019785	25 国债 13	248,000	25,113,111.89	1.56
3	019827	26 国债 01	194,000	19,525,749.21	1.21
4	019835	26 国债 09	86,000	8,614,153.48	0.53

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	357,564.89
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,160,758.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,518,323.77

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	2,898,657.08	0.18	新股流通受限

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	184,471	2,827.43	198,331,856.93	38.03	323,247,724.71	61.97
中金沪深 300 指数增强 C	61,713	3,166.87	35,776,243.24	18.31	159,660,856.71	81.69
中金沪深 300 指数增强 Y	830	3,527.95	—	—	2,928,194.46	100.00
合计	247,014	2,914.59	234,108,100.17	32.52	485,836,775.88	67.48

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	456,161.87	0.0875
	中金沪深 300 指数增强 C	1,979.43	0.0010
	中金沪深 300 指数增强 Y	7,062.40	0.2412
	合计	465,203.70	0.0646

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	中金沪深 300 指数增强 A	10~50
	中金沪深 300 指数增强 C	0
	中金沪深 300 指数增强 Y	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	0~10
	中金沪深 300 指数增强 C	0
	中金沪深 300 指数增强 Y	0
	合计	0~10

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 300 指数增强 A	中金沪深 300 指数增强 C	中金沪深 300 指数增强 Y
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）基金份额总额	10,001,300.00	—	—
本报告期期初基金份额总额	489,760,231.17	184,678,979.44	36,019.35
本报告期基金总申购份额	355,762,793.05	300,602,609.63	3,675,504.62
减：本报告期基金总赎回份额	323,943,442.58	289,844,489.12	783,329.51
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	521,579,581.64	195,437,099.95	2,928,194.46

§ 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

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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

本报告期内托管人无重大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

本报告期内托管人相关从业人员无重大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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中金公司	2	4,422,401,600.59	61.13	866,363.39	61.13	-
中信建投	2	2,812,152,13	38.87	550,933.50	38.87	-

		8.25				
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	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(%)
中金公司	60,035,130.00	100.00	1,064,200,000.00	83.06	-	-

中信建投	-	-	217,000,000.00	16.94	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
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	2026-01-22
2	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	2026-01-28
3	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	2026-01-29
4	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
5	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	2026-03-19
6	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	2026-04-14
7	中金基金管理有限公司关于新增基金	中国证监会规定媒介	2026-04-21

	直销账户的公告		
8	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	2026-04-29
9	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	2026-06-17
10	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	2026-06-25
11	关于调整中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金申购金额起点（包括转换转入、定期定额投资）及赎回份额下限（包括转换转出）的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-25
12	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
13	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