

中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF) 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

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

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§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 期末上市基金前十名持有人.....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64

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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	中金中证优选 300 指数 (LOF)	
场内简称	金选 300 (扩位简称: 金选 300LOF)	
基金主代码	501060	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2018 年 8 月 30 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	61,208,350.02 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2018 年 9 月 25 日	
下属分级基金的基金简称:	中金中证优选 300 指数 (LOF)A	中金中证优选 300 指数 (LOF)C
下属分级基金场内简称:	金选 300A (扩位简称: 金选 300A 类 LOF)	金选 300C (扩位简称: 金选 300C 类 LOF)
下属分级基金的交易代码:	501060	501061
报告期末下属分级基金的份额总额	55,804,666.74 份	5,403,683.28 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵璧	李申
	联系电话	010-63211122	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-868-1166	021-60637111
传真		010-66159121	021-60635778
注册地址		北京市朝阳区建国门外大	北京市西城区金融大街 25 号

	街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100004	100033
法定代表人	胡长生	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	中金中证优选 300 指数 (LOF) A	中金中证优选 300 指数 (LOF) C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,454,859.54	1,427,825.42
本期利润	4,891,395.75	1,178,309.23
加权平均基金份额本期利润	0.0823	0.1146
本期加权平均净值利润率	4.85%	6.80%
本期基金份额净值增长率	3.70%	3.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	39,352,563.13	3,729,409.24
期末可供分配基金份额利润	0.7052	0.6902
期末基金资产净值	95,157,229.87	9,133,092.52
期末基金份额净值	1.7052	1.6902
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	70.52%	69.02%

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

中金中证优选 300 指数 (LOF) A

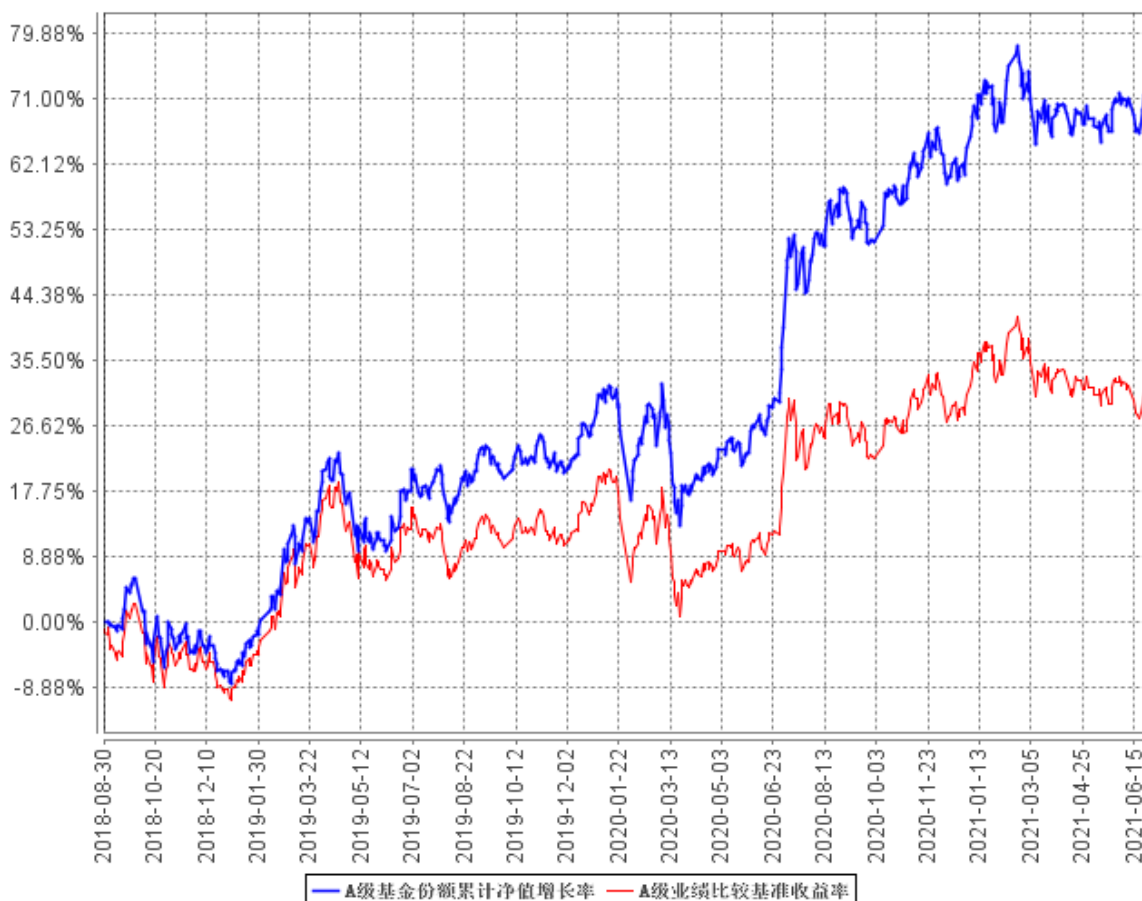
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.18%	0.60%	-2.12%	0.61%	1.94%	-0.01%
过去三个月	0.64%	0.65%	-2.91%	0.66%	3.55%	-0.01%
过去六个月	3.70%	0.89%	-0.81%	0.90%	4.51%	-0.01%
过去一年	29.97%	1.06%	14.95%	1.07%	15.02%	-0.01%
自基金合同生效起至今	70.52%	1.17%	29.87%	1.18%	40.65%	-0.01%

中金中证优选 300 指数(LOF)C

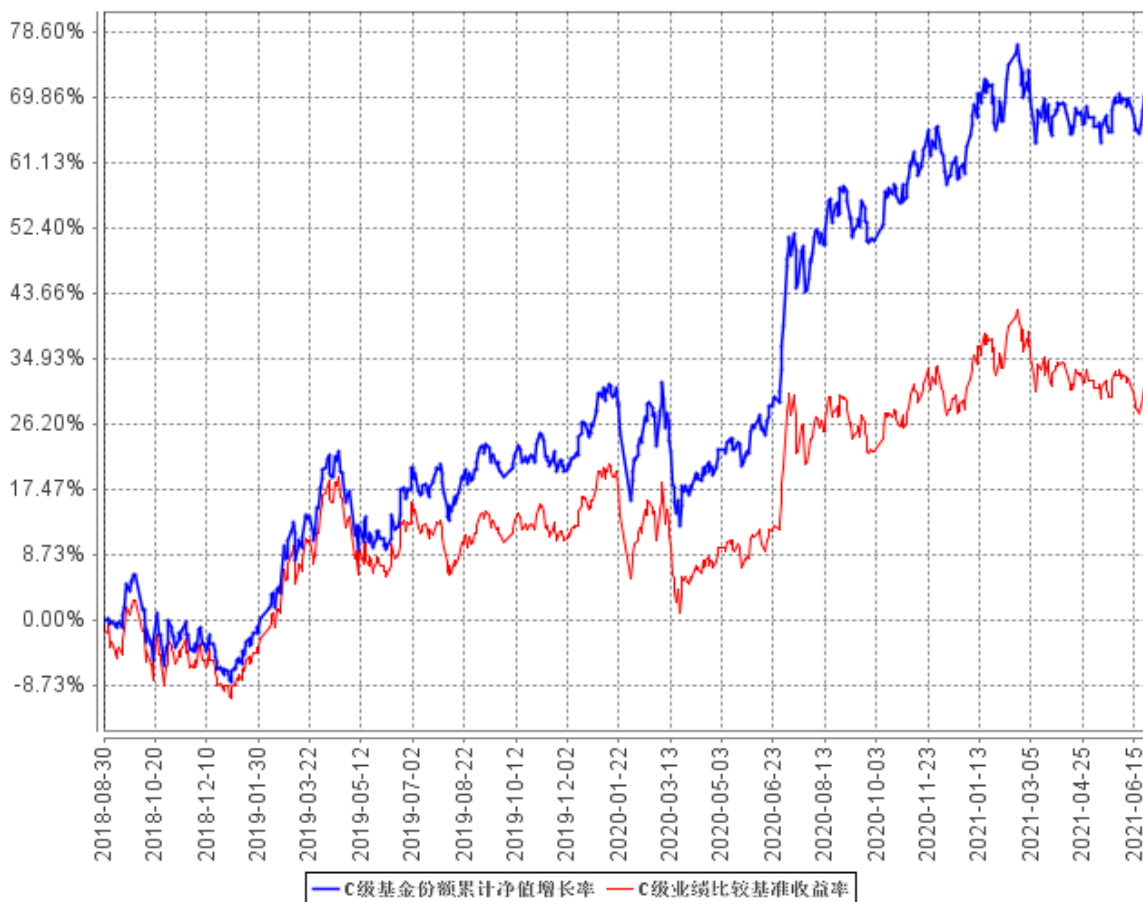
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.19%	0.60%	-2.12%	0.61%	1.93%	-0.01%
过去三个月	0.58%	0.65%	-2.91%	0.66%	3.49%	-0.01%
过去六个月	3.58%	0.89%	-0.81%	0.90%	4.39%	-0.01%
过去一年	29.65%	1.06%	14.95%	1.07%	14.70%	-0.01%
自基金合同生效起至今	69.02%	1.17%	29.87%	1.18%	39.15%	-0.01%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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 5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 37 只公募基金，证券投资基金管理规模 680.27 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏宇	本基金基金经理	2018 年 8 月 30 日	-	10 年	魏宇先生，统计学博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发。2014 年 11 月加入中金基金管理有限公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任量化指数部基金经理。
耿帅军	本基金基金经理	2020 年 10 月 29 日	-	10 年	耿帅军先生，理学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所金融工程分析师，中信证券股份有限公司研究部副总裁、金融工程分析师，中国国际金融股份有限公司研究部执行总经理、金融工程分析师。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。

注：1、对本基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为本基金管理人对外披露的基金经理离任日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”为

本基金管理人对外披露的任免日期。

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

4.1.3 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》和其他有关法律法规及本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金采用完全复制中证中金优选 300 指数的策略，按照标的指数的成份股构成及其权重构

建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金按照基金合同约定保持较高仓位运作，力争使组合与基准收益率的跟踪偏离和跟踪误差保持在较低水平。

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优选 300 指数(LOF)A 基金份额净值为 1.7052 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.70%；截至本报告期末中金中证优选 300 指数(LOF)C 基金份额净值为 1.6902 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.58%；同期业绩比较基准收益率为-0.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年宏观经济运行和资本市场表现，伴随主要经济体短期增长高点在上半年的接连确认，全球资本市场关注点逐渐经历了从高度关注通胀到更加关注增长可持续性的转变；在此期间，周期/防御、价值/成长、大/小市值风格的阶段性表现差异明显。A 股市场在经历春节前快速上涨和春节后明显调整的指数级别行情后，逐渐进入指数震荡、结构分化的行情阶段，不同风格、不同行业之间表现差异较大。整个上半年，沪深 300 指数上涨 0.24%，中证 500 指数上涨 6.93%，本基金所跟踪的中证中金优选 300 指数下跌 0.89%。

展望下半年，为实现“宏观政策跨周期调节，保持经济运行在合理区间”等政策目标，国内宏观政策或将呈现“松货币、宽财政、紧信用”的组合。货币政策料将整体稳健，以保持流动性合理充裕，助力中小企业和困难行业持续恢复；财政及准财政政策有望发挥更积极高效的作用；信用条件在高基数背景下或将继续收敛。这一宏观背景下，市场对无风险收益率超预期上行的担忧或将得到明显缓解，市场整体风险偏好水平则有望保持稳定。行业景气程度较高、产业前景相对明确、估值和业绩匹配度好、具有中长期成长潜力的公司或更具配置价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，

但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,091,023.78	2,768,469.54
结算备付金		1,136,277.00	1,561,748.64
存出保证金		26,014.94	86,944.14
交易性金融资产	6.4.7.2	106,554,448.90	181,049,587.66
其中：股票投资		99,048,248.90	169,159,777.66
基金投资		-	-
债券投资		7,506,200.00	11,889,810.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		567,696.83	1,093,531.75
应收利息	6.4.7.5	149,605.41	172,721.59
应收股利		-	-
应收申购款		83,330.85	77,425.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		110,608,397.71	186,810,428.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		5,600,000.00	7,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		426,799.89	1,023,620.13
应付管理人报酬		44,043.38	74,843.71
应付托管费		13,213.02	22,453.13
应付销售服务费		2,031.49	10,768.12
应付交易费用	6.4.7.7	102,631.64	225,813.10
应交税费		-	-

应付利息		-	-2,531.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	129,355.90	210,099.48
负债合计		6,318,075.32	8,565,066.63
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	61,208,350.02	108,639,265.10
未分配利润	6.4.7.10	43,081,972.37	69,606,097.26
所有者权益合计		104,290,322.39	178,245,362.36
负债和所有者权益总计		110,608,397.71	186,810,428.99

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，中金中证优选 300 指数(LOF)A 基金份额净值 1.7052 元，基金份额总额 55,804,666.74 份；中金中证优选 300 指数(LOF)C 基金份额净值 1.6902 元，基金份额总额 5,403,683.28 份。中金中证优选 300 指数(LOF)份额总额合计为 61,208,350.02 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		7,097,008.63	4,590,522.13
1.利息收入		100,758.87	149,177.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,789.31	21,782.53
债券利息收入		87,969.56	127,395.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,801,764.68	11,615,512.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,607,823.73	9,716,398.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-15,634.17	7,966.63
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,209,575.12	1,891,148.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,812,979.98	-7,243,548.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,465.06	69,380.27
减：二、费用		1,027,303.65	1,351,369.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	291,905.97	390,231.54
2. 托管费	6.4.10.2.2	87,571.81	117,069.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	20,949.14	28,392.49
4. 交易费用	6.4.7.18	381,254.83	545,272.30
5. 利息支出		61,144.37	46,086.97
其中：卖出回购金融资产支出		61,144.37	46,086.97
6. 税金及附加		-	0.04
7. 其他费用	6.4.7.19	184,477.53	224,317.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,069,704.98	3,239,152.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,069,704.98	3,239,152.16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	108,639,265.10	69,606,097.26	178,245,362.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,069,704.98	6,069,704.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-47,430,915.08	-32,593,829.87	-80,024,744.95
其中：1.基金申购款	24,761,455.68	17,309,837.98	42,071,293.66
2.基金赎回款	-72,192,370.76	-49,903,667.85	-122,096,038.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-	-

证券投资基金（LOF）招募说明书》和《中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型上市开放式基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）、中国中金财富证券有限公司（以下简称“中金财富证券”，原“中国中投证券有限责任公司”）、中国银河证券股份有限公司及招商证券股份有限公司等共同销售，募集期为 2018 年 7 月 23 日起至 2018 年 8 月 23 日。经向中国证监会备案，《中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2018 年 8 月 30 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 274,597,597.22 份（含于 2018 年 9 月 21 日银行结息转份额 63,842.40 份），发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据经中国证监会备案的基金合同和《中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》的相关内容，本基金根据认购 / 申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购 / 申购费用，在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 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金销售费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》的有关规定，本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权、同业存单、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第

3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况、2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号)、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

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

(2)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(3)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从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，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 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。

(5)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,091,023.78
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	2,091,023.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	98,211,760.42	99,048,248.90	836,488.48
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,517,200.00	7,506,200.00
	银行间市场	-	-
	合计	7,517,200.00	7,506,200.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	105,728,960.42	106,554,448.90	825,488.48

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	220.22
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	511.30
应收债券利息	148,862.19
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	11.70
合计	149,605.41

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	102,631.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	102,631.64

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12.74
应付证券出借违约金	-

预提费用	79,343.16
指数使用费	50,000.00
合计	129,355.90

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证优选 300 指数(LOF) A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,148,010.72	77,148,010.72
本期申购	20,830,068.62	20,830,068.62
本期赎回(以“-”号填列)	-42,173,412.60	-42,173,412.60
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	55,804,666.74	55,804,666.74

金额单位：人民币元

中金中证优选 300 指数(LOF) C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,491,254.38	31,491,254.38
本期申购	3,931,387.06	3,931,387.06
本期赎回(以“-”号填列)	-30,018,958.16	-30,018,958.16
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	5,403,683.28	5,403,683.28

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金中证优选 300 指数(LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	49,870,160.25	-161,424.89	49,708,735.36

本期利润	7,454,859.54	-2,563,463.79	4,891,395.75
本期基金份额交易产生的变动数	-14,471,275.14	-776,292.84	-15,247,567.98
其中：基金申购款	14,718,722.65	-104,907.94	14,613,814.71
基金赎回款	-29,189,997.79	-671,384.90	-29,861,382.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,853,744.65	-3,501,181.52	39,352,563.13

单位：人民币元

中金中证优选 300 指数(LOF)C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,953,821.04	-56,459.14	19,897,361.90
本期利润	1,427,825.42	-249,516.19	1,178,309.23
本期基金份额交易产生的变动数	-17,317,585.40	-28,676.49	-17,346,261.89
其中：基金申购款	2,769,475.94	-73,452.67	2,696,023.27
基金赎回款	-20,087,061.34	44,776.18	-20,042,285.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,064,061.06	-334,651.82	3,729,409.24

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,518.07
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	5,885.69
其他	385.55
合计	12,789.31

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	164,765,439.33
减：卖出股票成本总额	156,157,615.60

买卖股票差价收入	8,607,823.73
----------	--------------

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-15,634.17
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	-15,634.17

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,553,054.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,434,695.00
减：应收利息总额	133,993.54
买卖债券差价收入	-15,634.17

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,209,575.12
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	1,209,575.12

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,812,979.98
——股票投资	-2,825,364.98
——债券投资	12,385.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预 估增值税	-
合计	-2,812,979.98

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

基金赎回费收入	7,465.06
合计	7,465.06

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	381,254.83
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	381,254.83

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
汇划手续费	5,134.37
律师费用	-
其他	-
帐户维护费	-
合计	184,477.53

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金管理有限公司（“中金基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（“中金财富证券”原“中国中投证券有限责任公司”）	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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	250,532,983.29	100.00%	387,380,113.12	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	6,035,365.34	100.00%	9,205,884.37	100.00%

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中金公司	611,700,000.00	100.00%	448,700,000.00	100.00%

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 2021年1月1日至2021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	183,212.56	100.00%	102,631.64	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	283,289.21	100.00%	170,371.88	100.00%

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证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险金后的净额列示。

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

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	291,905.97
其中：支付销售机构的客	117,351.89	106,450.20

户维护费		
------	--	--

注：1、支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数；

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，本基金本报告期支付销售服务机构的客户维护费为 117,351.89 元，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	87,571.81	117,069.48

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

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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证优选 300 指数(LOF)A	中金中证优选 300 指数(LOF)C	合计
中金基金	-	8,601.37	8,601.37
中金公司	-	2,484.29	2,484.29
中金财富证券	-	4,087.31	4,087.31
合计	-	15,172.97	15,172.97
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证优选 300 指数(LOF)A	中金中证优选 300 指数(LOF)C	合计
中金基金	-	15,333.09	15,333.09
中金公司	-	3,075.75	3,075.75

中金财富证券	-	4,714.48	4,714.48
合计	-	23,123.32	23,123.32

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；
2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.25% 的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：C 类基金份额每日应计提的销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

本基金本报告期末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

报告期内基金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

份额单位：份

中金中证优选 300 指数(LOF)A				
关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中金公司	2,066,413.00	3.7029%	1,474,679.00	1.9115%

份额单位：份

中金中证优选 300 指数(LOF)C				
关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中金公司	1,424,275.00	26.3575%	1,067,071.00	3.3885%

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
中国建设银行	2,091,023.78	6,518.07	5,802,418.69	15,143.78

注：1、本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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：份）	总金额
中金公司	003033	征和工业	网下	301	7,007.28
中金公司	688696	极米科技	网下	250	33,432.50
中金公司	688316	青云科技	网下	476	30,321.20
中金公司	605090	九丰能源	网下	1,090	37,681.30
中金公司	601156	东航物流	网下	2,090	32,959.30
中金公司	688425	铁建重工	网下	12,948	37,160.76
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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：份）	总金额
中金公司	688100	威胜信息	网下	7,166	98,747.48
中金公司	688158	优刻得	网下	4,945	164,322.35
中金公司	688266	泽璟制药	网下	8,335	281,389.60
中金公司	688200	华峰测控	网下	1,008	108,269.28
中金公司	300825	阿尔特	网下	1,642	10,081.88
中金公司	688222	成都先导	网下	4,801	98,516.52
中金公司	688365	光云科技	网下	8,249	89,089.20
中金公司	300831	派瑞股份	网下	1,716	6,829.68
中金公司	688505	复旦张江	网下	6,986	62,524.70
中金公司	688520	神州细胞	网下	3,362	86,201.68

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金为完全按照有关指数构成比例进行证券投资的基金，本报告期内依法合规买卖基金托

管人建设银行发行的股票，总买入量 18,900 股，总卖出量 203,330 股。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金持有 0 股建设银行 A 股普通股，占基金资产净值比例为 0%。

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（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688315	诺禾致源	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股流通受限	12.76	39.20	1,731	22,087.56	67,855.20	-
688663	新风光	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 13 日	新股流通受限	14.48	19.21	1,878	27,193.44	36,076.38	-
688195	腾景科技	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股流通受限	13.60	19.87	1,620	22,032.00	32,189.40	-

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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

300660	江苏雷利	2021年6月21日	重大事项停牌	20.57	2021年7月5日	20.82	2,200	44,488.22	45,254.00	-
--------	------	------------	--------	-------	-----------	-------	-------	-----------	-----------	---

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 2021 年 6 月 30 日止，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 5,600,000.00 元，于 2021 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

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

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

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

系，实现风险控制的有效性和全面性。

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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，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 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,091,023.78	-	-	-	2,091,023.78
结算备付金	1,136,277.00	-	-	-	1,136,277.00
存出保证金	26,014.94	-	-	-	26,014.94
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	99,048,248.90	99,048,248.90
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	7,506,200.00	-	-	-	7,506,200.00

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	567,696.83	567,696.83
应收利息	-	-	-	149,605.41	149,605.41
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	83,330.85	83,330.85
资产总计	10,759,515.72	-	-	99,848,881.99	110,608,397.71
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	5,600,000.00	-	-	-	5,600,000.00
应付赎回款	-	-	-	426,799.89	426,799.89
应付管理人报酬	-	-	-	44,043.38	44,043.38
应付托管费	-	-	-	13,213.02	13,213.02
应付销售服务费	-	-	-	2,031.49	2,031.49
应付交易费用	-	-	-	102,631.64	102,631.64
其他负债	-	-	-	129,355.90	129,355.90
负债总计	5,600,000.00	-	-	718,075.32	6,318,075.32
利率敏感度缺口	5,159,515.72	-	-	99,130,806.67	104,290,322.39
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
银行存款	2,768,469.54	-	-	-	2,768,469.54
结算备付金	1,561,748.64	-	-	-	1,561,748.64
存出保证金	86,944.14	-	-	-	86,944.14
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	169,159,777.66	169,159,777.66
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	11,889,810.00	-	-	-	11,889,810.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,093,531.75	1,093,531.75
应收利息	-	-	-	172,721.59	172,721.59
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	77,425.67	77,425.67
资产总计	16,306,972.32	-	-	170,503,456.67	186,810,428.99
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	7,000,000.00	-	-	-	7,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,023,620.13	1,023,620.13
应付管理人报酬	-	-	-	74,843.71	74,843.71
应付托管费	-	-	-	22,453.13	22,453.13
应付交易费用	-	-	-	225,813.10	225,813.10

应付销售服务费	-	-	-	10,768.12	10,768.12
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-2,531.04	-2,531.04
其他负债	-	-	-	210,099.48	210,099.48
负债总计	7,000,000.00	-	-	1,565,066.63	8,565,066.63
利率敏感度缺口	9,306,972.32	-	-	168,938,390.04	178,245,362.36

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	2,538.23	10,311.83
市场利率上升 25 个基点	-2,538.23	-10,311.83	

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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	99,048,248.90	94.97	169,159,777.66	94.90
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	99,048,248.90	94.97	169,159,777.66	94.90

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 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	5,137,516.38	8,798,857.06
	业绩比较基准下降 5%	-5,137,516.38	-8,798,857.06

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	99,048,248.90	89.55
	其中：股票	99,048,248.90	89.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,506,200.00	6.79
	其中：债券	7,506,200.00	6.79
	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	3,227,300.78	2.92
8	其他各项资产	826,648.03	0.75
9	合计	110,608,397.71	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	82,825.00	0.08
B	采矿业	6,208,309.00	5.95
C	制造业	58,757,279.04	56.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,964,533.20	2.84
E	建筑业	6,755,665.16	6.48
F	批发和零售业	2,768,233.00	2.65
G	交通运输、仓储和邮政业	2,543,157.00	2.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	278,101.00	0.27
J	金融业	14,025,446.00	13.45
K	房地产业	1,007,456.40	0.97
L	租赁和商务服务业	2,546,824.00	2.44

M	科学研究和技术服务业	288,566.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	43,470.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	79,961.20	0.08
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	468,826.50	0.45
S	综合	-	-
	合计	98,818,652.50	94.75

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	99,113.26	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,230.40	0.01
J	金融业	34,721.10	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	67,855.20	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	229,596.40	0.22

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	126,000	4,640,580.00	4.45
2	601166	兴业银行	217,600	4,471,680.00	4.29
3	000651	格力电器	82,800	4,313,880.00	4.14
4	600309	万华化学	32,600	3,547,532.00	3.40
5	601899	紫金矿业	286,400	2,775,216.00	2.66
6	600837	海通证券	200,000	2,300,000.00	2.21
7	000100	TCL 科技	290,800	2,224,620.00	2.13
8	600690	海尔智家	78,400	2,031,344.00	1.95
9	601668	中国建筑	434,600	2,020,890.00	1.94
10	002027	分众传媒	212,900	2,003,389.00	1.92
11	000338	潍柴动力	98,400	1,758,408.00	1.69
12	600919	江苏银行	244,900	1,738,790.00	1.67
13	600660	福耀玻璃	29,100	1,625,235.00	1.56
14	601211	国泰君安	93,500	1,602,590.00	1.54
15	600104	上汽集团	72,700	1,597,219.00	1.53
16	601766	中国中车	252,100	1,532,768.00	1.47
17	600019	宝钢股份	184,600	1,410,344.00	1.35
18	601088	中国神华	68,300	1,333,216.00	1.28
19	601628	中国人寿	34,500	1,169,205.00	1.12
20	601390	中国中铁	211,000	1,105,640.00	1.06
21	601633	长城汽车	25,300	1,102,827.00	1.06
22	600089	特变电工	77,000	989,450.00	0.95
23	601225	陕西煤业	82,900	982,365.00	0.94
24	002601	龙佰集团	27,800	961,324.00	0.92
25	600426	华鲁恒升	30,680	949,546.00	0.91
26	000776	广发证券	61,300	928,082.00	0.89
27	600741	华域汽车	32,700	859,029.00	0.82
28	601006	大秦铁路	123,300	811,314.00	0.78
29	601233	桐昆股份	33,200	799,788.00	0.77
30	601336	新华保险	17,300	794,243.00	0.76
31	600176	中国巨石	49,835	772,940.85	0.74
32	601186	中国铁建	95,300	708,079.00	0.68
33	601636	旗滨集团	33,400	619,904.00	0.59

34	601669	中国电建	158,500	613,395.00	0.59
35	601238	广汽集团	45,100	584,045.00	0.56
36	601838	成都银行	44,900	567,536.00	0.54
37	600183	生益科技	23,700	554,817.00	0.53
38	603026	石大胜华	3,400	550,970.00	0.53
39	601985	中国核电	108,600	549,516.00	0.53
40	000703	恒逸石化	45,800	547,310.00	0.52
41	600779	水井坊	4,100	518,035.00	0.50
42	603589	口子窖	7,500	507,675.00	0.49
43	601607	上海医药	23,900	505,007.00	0.48
44	600704	物产中大	62,900	495,023.00	0.47
45	600332	白云山	14,600	494,210.00	0.47
46	601800	中国交建	73,100	473,688.00	0.45
47	601117	中国化学	51,100	447,636.00	0.43
48	000830	鲁西化工	23,700	443,901.00	0.43
49	600563	法拉电子	2,800	443,408.00	0.43
50	002078	太阳纸业	32,600	435,210.00	0.42
51	600068	葛洲坝	57,300	429,177.00	0.41
52	600201	生物股份	23,400	408,330.00	0.39
53	002139	拓邦股份	20,500	368,795.00	0.35
54	601216	君正集团	70,000	356,300.00	0.34
55	600066	宇通客车	28,100	350,969.00	0.34
56	600018	上港集团	72,200	344,394.00	0.33
57	000723	美锦能源	44,300	334,908.00	0.32
58	601998	中信银行	63,600	324,360.00	0.31
59	002572	索菲亚	13,200	319,440.00	0.31
60	600642	申能股份	50,900	312,526.00	0.30
61	002690	美亚光电	5,600	312,256.00	0.30
62	600023	浙能电力	84,600	310,482.00	0.30
63	002294	信立泰	9,300	305,970.00	0.29
64	600236	桂冠电力	49,100	304,911.00	0.29
65	600271	航天信息	23,100	300,993.00	0.29
66	603156	养元饮品	10,460	298,946.80	0.29
67	600415	小商品城	56,900	293,035.00	0.28
68	601699	潞安环能	24,800	292,888.00	0.28
69	000012	南玻A	28,500	291,840.00	0.28
70	600188	兖州煤业	18,500	284,160.00	0.27
71	600008	首创环保	91,380	275,053.80	0.26
72	000591	太阳能	43,700	272,251.00	0.26

73	002382	蓝帆医疗	13,000	271,050.00	0.26
74	600208	新湖中宝	89,100	270,864.00	0.26
75	603858	步长制药	11,880	267,181.20	0.26
76	600498	烽火通信	14,100	262,683.00	0.25
77	600409	三友化工	25,700	259,827.00	0.25
78	601678	滨化股份	32,000	253,120.00	0.24
79	600873	梅花生物	44,900	251,440.00	0.24
80	002756	永兴材料	4,200	249,438.00	0.24
81	002408	齐翔腾达	20,000	248,400.00	0.24
82	600801	华新水泥	14,100	247,737.00	0.24
83	600663	陆家嘴	18,220	242,690.40	0.23
84	600297	广汇汽车	84,100	242,208.00	0.23
85	603260	合盛硅业	3,100	238,421.00	0.23
86	603225	新凤鸣	11,600	235,480.00	0.23
87	000060	中金岭南	51,800	234,136.00	0.22
88	600567	山鹰国际	67,000	231,150.00	0.22
89	600859	王府井	8,000	231,040.00	0.22
90	002056	横店东磁	17,100	222,300.00	0.21
91	603198	迎驾贡酒	5,000	221,500.00	0.21
92	600737	中粮糖业	22,100	221,221.00	0.21
93	002032	苏泊尔	3,400	216,886.00	0.21
94	000581	威孚高科	10,400	216,632.00	0.21
95	002281	光迅科技	8,700	214,020.00	0.21
96	000902	新洋丰	13,500	211,005.00	0.20
97	002396	星网锐捷	9,700	207,095.00	0.20
98	600820	隧道股份	39,104	206,860.16	0.20
99	002745	木林森	15,400	206,360.00	0.20
100	000488	晨鸣纸业	25,300	205,942.00	0.20
101	002614	奥佳华	9,100	205,933.00	0.20
102	002004	华邦健康	32,800	203,688.00	0.20
103	002048	宁波华翔	10,400	202,800.00	0.19
104	002563	森马服饰	16,800	200,760.00	0.19
105	600970	中材国际	21,600	198,072.00	0.19
106	601018	宁波港	49,200	194,340.00	0.19
107	600398	海澜之家	26,800	194,032.00	0.19
108	002022	科华生物	10,700	191,637.00	0.18
109	002925	盈趣科技	4,910	191,048.10	0.18
110	002002	鸿达兴业	47,500	186,675.00	0.18
111	600039	四川路桥	29,700	186,219.00	0.18

112	300616	尚品宅配	2,100	185,871.00	0.18
113	000883	湖北能源	40,400	185,436.00	0.18
114	600782	新钢股份	33,000	184,140.00	0.18
115	000887	中鼎股份	15,200	183,616.00	0.18
116	600197	伊力特	5,900	180,894.00	0.17
117	002701	奥瑞金	35,100	180,414.00	0.17
118	002867	周大生	9,050	178,918.50	0.17
119	002085	万丰奥威	31,800	178,080.00	0.17
120	600577	精达股份	27,900	178,002.00	0.17
121	600985	淮北矿业	14,200	173,382.00	0.17
122	603650	彤程新材	3,600	173,160.00	0.17
123	600688	上海石化	45,600	171,456.00	0.16
124	002110	三钢闽光	25,400	171,196.00	0.16
125	000402	金融街	24,800	167,400.00	0.16
126	603733	仙鹤股份	4,400	167,200.00	0.16
127	601598	中国外运	32,800	165,640.00	0.16
128	601311	骆驼股份	14,000	161,980.00	0.16
129	002531	天顺风能	18,700	161,755.00	0.16
130	600338	西藏珠峰	11,400	161,538.00	0.15
131	603113	金能科技	8,800	158,928.00	0.15
132	002233	塔牌集团	14,900	153,172.00	0.15
133	600507	方大特钢	22,300	151,194.00	0.14
134	000685	中山公用	18,300	149,328.00	0.14
135	603025	大豪科技	3,800	145,996.00	0.14
136	000559	万向钱潮	27,400	145,494.00	0.14
137	002171	楚江新材	16,600	144,918.00	0.14
138	600612	老凤祥	2,679	141,906.63	0.14
139	000951	中国重汽	5,200	140,712.00	0.13
140	600057	厦门象屿	22,400	140,000.00	0.13
141	600328	中盐化工	9,900	138,303.00	0.13
142	603306	华懋科技	3,800	137,902.00	0.13
143	300415	伊之密	6,300	135,450.00	0.13
144	000921	海信家电	9,400	135,078.00	0.13
145	002038	双鹭药业	12,800	134,784.00	0.13
146	600266	城建发展	28,200	133,668.00	0.13
147	600582	天地科技	34,200	133,380.00	0.13
148	600388	龙净环保	15,500	132,060.00	0.13
149	601098	中南传媒	14,900	131,418.00	0.13
150	600901	江苏租赁	24,800	128,960.00	0.12

151	603010	万盛股份	6,060	127,078.20	0.12
152	000928	中钢国际	13,100	124,581.00	0.12
153	001965	招商公路	16,700	120,574.00	0.12
154	300406	九强生物	6,100	120,353.00	0.12
155	600210	紫江企业	25,200	119,700.00	0.11
156	600761	安徽合力	10,700	118,342.00	0.11
157	002649	博彦科技	11,100	116,550.00	0.11
158	600483	福能股份	11,100	116,439.00	0.11
159	600481	双良节能	16,900	116,272.00	0.11
160	600729	重庆百货	4,200	115,290.00	0.11
161	001696	宗申动力	14,300	114,114.00	0.11
162	002293	罗莱生活	8,500	113,815.00	0.11
163	600648	外高桥	7,700	113,806.00	0.11
164	000789	万年青	9,900	113,256.00	0.11
165	600742	一汽富维	11,100	113,109.00	0.11
166	002108	沧州明珠	20,500	112,955.00	0.11
167	601928	凤凰传媒	15,800	112,812.00	0.11
168	600295	鄂尔多斯	6,300	112,707.00	0.11
169	002182	云海金属	9,400	112,612.00	0.11
170	000501	鄂武商A	9,500	111,150.00	0.11
171	002043	兔宝宝	11,200	110,432.00	0.11
172	601828	美凯龙	9,200	110,400.00	0.11
173	002206	海利得	17,700	109,917.00	0.11
174	000062	深圳华强	6,500	109,915.00	0.11
175	600835	上海机电	6,700	108,875.00	0.10
176	000906	浙商中拓	8,400	108,696.00	0.10
177	000603	盛达资源	8,600	108,274.00	0.10
178	603989	艾华集团	3,300	107,547.00	0.10
179	603877	太平鸟	2,000	106,760.00	0.10
180	600422	昆药集团	11,000	106,700.00	0.10
181	603355	莱克电气	1,700	105,791.00	0.10
182	002637	赞宇科技	6,900	105,501.00	0.10
183	000915	华特达因	3,900	104,247.00	0.10
184	000869	张裕A	2,800	103,992.00	0.10
185	002035	华帝股份	14,400	103,968.00	0.10
186	603801	志邦家居	3,220	102,911.20	0.10
187	000828	东莞控股	8,600	102,426.00	0.10
188	603179	新泉股份	3,100	101,928.00	0.10
189	002737	葵花药业	6,108	99,682.56	0.10

190	600377	宁沪高速	10,200	99,552.00	0.10
191	600337	美克家居	23,600	99,356.00	0.10
192	002677	浙江美大	5,400	98,712.00	0.09
193	601010	文峰股份	30,500	98,210.00	0.09
194	000006	深振业 A	19,500	97,695.00	0.09
195	000811	冰轮环境	9,300	97,650.00	0.09
196	600395	盘江股份	13,700	97,270.00	0.09
197	600502	安徽建工	25,000	97,000.00	0.09
198	000070	特发信息	11,900	96,628.00	0.09
199	600308	华泰股份	17,000	93,840.00	0.09
200	600327	大东方	10,900	93,740.00	0.09
201	000030	富奥股份	14,600	93,002.00	0.09
202	600284	浦东建设	14,000	92,540.00	0.09
203	603888	新华网	4,300	91,031.00	0.09
204	601126	四方股份	10,100	90,395.00	0.09
205	601298	青岛港	14,500	89,610.00	0.09
206	600694	大商股份	4,300	89,268.00	0.09
207	000989	九芝堂	9,000	88,200.00	0.08
208	300382	斯莱克	5,800	86,826.00	0.08
209	603393	新天然气	4,680	85,550.40	0.08
210	603035	常熟汽饰	5,100	83,130.00	0.08
211	300284	苏交科	14,200	83,070.00	0.08
212	300657	弘信电子	4,900	83,055.00	0.08
213	300761	立华股份	2,500	82,825.00	0.08
214	002479	富春环保	12,600	81,522.00	0.08
215	002516	旷达科技	15,300	81,090.00	0.08
216	002320	海峡股份	13,800	81,006.00	0.08
217	000910	大亚圣象	6,800	80,784.00	0.08
218	600075	新疆天业	11,800	80,240.00	0.08
219	603377	东方时尚	7,480	79,961.20	0.08
220	603515	欧普照明	3,100	79,577.00	0.08
221	600350	山东高速	12,900	79,335.00	0.08
222	601326	秦港股份	29,500	79,060.00	0.08
223	300213	佳讯飞鸿	12,300	77,982.00	0.07
224	000429	粤高速 A	10,800	77,436.00	0.07
225	002651	利君股份	6,400	77,376.00	0.07
226	603766	隆鑫通用	21,200	76,956.00	0.07
227	002540	亚太科技	15,800	76,946.00	0.07
228	000900	现代投资	18,800	76,892.00	0.07

229	000810	创维数字	8,900	75,739.00	0.07
230	600114	东睦股份	9,000	75,510.00	0.07
231	603337	杰克股份	2,800	74,844.00	0.07
232	603587	地素时尚	3,000	74,730.00	0.07
233	002653	海思科	3,400	73,168.00	0.07
234	300196	长海股份	4,200	72,072.00	0.07
235	603100	川仪股份	4,100	71,791.00	0.07
236	600261	阳光照明	18,200	71,162.00	0.07
237	600461	洪城环境	9,800	71,148.00	0.07
238	300448	浩云科技	8,600	70,520.00	0.07
239	603056	德邦股份	6,400	70,336.00	0.07
240	603197	保隆科技	2,100	69,069.00	0.07
241	002518	科士达	4,800	68,976.00	0.07
242	600757	长江传媒	12,600	66,906.00	0.06
243	002117	东港股份	7,900	66,281.00	0.06
244	002406	远东传动	10,300	66,229.00	0.06
245	300215	电科院	7,900	66,202.00	0.06
246	002462	嘉事堂	4,900	65,807.00	0.06
247	603186	华正新材	1,800	65,628.00	0.06
248	002419	天虹股份	10,000	65,600.00	0.06
249	000026	飞亚达	4,600	64,032.00	0.06
250	002267	陕天然气	9,300	63,891.00	0.06
251	601003	柳钢股份	10,600	62,540.00	0.06
252	601158	重庆水务	11,900	62,118.00	0.06
253	002538	司尔特	9,000	61,650.00	0.06
254	002448	中原内配	10,000	61,000.00	0.06
255	002003	伟星股份	9,700	60,528.00	0.06
256	600523	贵航股份	4,200	60,144.00	0.06
257	603855	华荣股份	3,500	59,850.00	0.06
258	002678	珠江钢琴	8,400	58,548.00	0.06
259	600987	航民股份	11,100	58,275.00	0.06
260	601801	皖新传媒	12,300	58,056.00	0.06
261	603579	荣泰健康	1,400	57,512.00	0.06
262	603126	中材节能	6,300	57,456.00	0.06
263	603698	航天工程	3,300	57,222.00	0.05
264	603466	风语筑	3,470	56,734.50	0.05
265	601566	九牧王	3,600	56,340.00	0.05
266	603985	恒润股份	3,280	55,596.00	0.05
267	000011	深物业 A	4,400	53,504.00	0.05

268	600917	重庆燃气	6,500	53,105.00	0.05
269	002441	众业达	6,700	52,528.00	0.05
270	601515	东风股份	8,300	51,958.00	0.05
271	601789	宁波建工	14,100	51,888.00	0.05
272	600548	深高速	5,900	51,448.00	0.05
273	601882	海天精工	3,300	51,315.00	0.05
274	300021	大禹节水	9,800	51,254.00	0.05
275	000885	城发环境	5,300	50,668.00	0.05
276	600180	瑞茂通	8,400	49,560.00	0.05
277	603167	渤海轮渡	5,800	49,126.00	0.05
278	000544	中原环保	8,000	48,720.00	0.05
279	002658	雪迪龙	5,200	46,904.00	0.04
280	002533	金杯电工	9,100	46,774.00	0.04
281	300660	江苏雷利	2,200	45,254.00	0.04
282	300403	汉宇集团	6,300	43,596.00	0.04
283	002033	丽江股份	6,900	43,470.00	0.04
284	603158	腾龙股份	3,680	43,056.00	0.04
285	601900	南方传媒	5,500	42,900.00	0.04
286	002454	松芝股份	7,800	42,042.00	0.04
287	000029	深深房 A	5,500	41,635.00	0.04
288	600814	杭州解百	5,900	40,297.00	0.04
289	002666	德联集团	7,800	39,390.00	0.04
290	002300	太阳电缆	6,800	38,352.00	0.04
291	600081	东风科技	2,600	38,168.00	0.04
292	002287	奇正藏药	1,400	37,758.00	0.04
293	603898	好莱客	2,600	35,620.00	0.03
294	300127	银河磁体	2,000	35,020.00	0.03
295	002543	万和电气	4,700	35,015.00	0.03
296	603600	永艺股份	3,100	31,868.00	0.03
297	603787	新日股份	1,300	31,174.00	0.03
298	600629	华建集团	3,400	24,616.00	0.02
299	002911	佛燃能源	2,400	22,536.00	0.02
300	600828	茂业商业	5,000	17,700.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	688315	诺禾致源	1,731	67,855.20	0.07
2	688663	新风光	1,878	36,076.38	0.03
3	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.03
4	688195	腾景科技	1,620	32,189.40	0.03
5	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.02
6	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
7	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
8	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
9	605011	杭州热电	525	4,662.00	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	000651	格力电器	5,304,802.00	2.98
2	600309	万华化学	3,694,968.00	2.07
3	600887	伊利股份	2,164,154.00	1.21
4	600919	江苏银行	1,977,439.90	1.11
5	600019	宝钢股份	1,757,793.00	0.99
6	601899	紫金矿业	1,756,613.00	0.99
7	601766	中国中车	1,629,340.99	0.91
8	601166	兴业银行	1,592,369.00	0.89
9	600660	福耀玻璃	1,521,479.00	0.85
10	000333	美的集团	1,289,355.00	0.72
11	000100	TCL 科技	1,264,533.00	0.71
12	601628	中国人寿	1,239,085.00	0.70
13	600690	海尔智家	1,139,519.00	0.64
14	601225	陕西煤业	1,128,340.00	0.63
15	600837	海通证券	1,127,823.00	0.63
16	600089	特变电工	1,040,882.00	0.58
17	002027	分众传媒	1,040,350.00	0.58
18	002601	龙佰集团	1,026,902.00	0.58
19	600426	华鲁恒升	988,807.00	0.55
20	601006	大秦铁路	934,440.00	0.52

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	000333	美的集团	9,584,568.00	5.38
2	000002	万科 A	5,790,385.70	3.25
3	601166	兴业银行	5,746,460.00	3.22
4	600900	长江电力	5,404,150.88	3.03
5	601398	工商银行	5,294,547.80	2.97
6	600887	伊利股份	4,270,217.00	2.40
7	601328	交通银行	3,813,023.00	2.14
8	600438	通威股份	3,525,481.00	1.98
9	600000	浦发银行	3,464,035.93	1.94
10	600048	保利地产	3,031,504.00	1.70
11	002460	赣锋锂业	2,794,835.00	1.57
12	601288	农业银行	2,682,798.00	1.51
13	601899	紫金矿业	2,581,571.00	1.45
14	600999	招商证券	2,480,388.30	1.39
15	688981	中芯国际	2,116,226.68	1.19
16	000100	TCL 科技	2,092,138.00	1.17
17	601169	北京银行	2,091,230.00	1.17
18	600690	海尔智家	2,043,174.00	1.15
19	601988	中国银行	1,996,540.00	1.12
20	601818	光大银行	1,880,602.00	1.06

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	88,871,451.82
卖出股票收入（成交）总额	164,765,439.33

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	7,506,200.00	7.20
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	7,506,200.00	7.20

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	019640	20 国债 10	55,000	5,500,000.00	5.27
2	019645	20 国债 15	20,000	2,006,200.00	1.92

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除兴业银行股份有限公司（兴业银行）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2020 年 9 月 11 日，中国人民银行福州中心支行发布行政处罚决定书（福银罚字〔2020〕35 号），对兴业银行股份有限公司为无证机构提供转接清算服务、为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务等违法违规事实进行处罚。2020 年 9 月 4 日，中国银行保险监督管理委员会福建监管局发布行政处罚决定书（闽银保监罚决字〔2020〕24 号），对兴业银行股份有限公司同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款等违法违规事实进行处罚。

中金中证优选 300 基金采用完全复制中证中金优选 300 指数的投资策略，兴业银行属于中证中金优选 300 指数的前十大成分股，我们判断所列处罚对其投资价值不会产生重大影响，故依然按照完全复制指数的投资策略持有该股。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	26,014.94
2	应收证券清算款	567,696.83
3	应收股利	-
4	应收利息	149,605.41
5	应收申购款	83,330.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	826,648.03

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688315	诺禾致源	67,855.20	0.07	流通受限
2	688663	新风光	36,076.38	0.03	流通受限
3	688195	腾景科技	32,189.40	0.03	流通受限
4	688226	威腾电气	17,289.06	0.02	新股未上市

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
中金中证优选 300 指数(LOF)A	7,988	6,986.06	5,334,587.69	9.56%	50,470,079.05	90.44%
中金中证优选 300 指数(LOF)C	609	8,873.04	1,424,275.00	26.36%	3,979,408.28	73.64%
合计	8,597	7,119.73	6,758,862.69	11.04%	54,449,487.33	88.96%

8.2 期末上市基金前十名持有人

中金中证优选 300 指数(LOF)A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国国际金融股份有限公司	2,066,413.00	45.85%
2	吴洪才	1,020,000.00	22.63%
3	钱中明	568,688.00	12.62%
4	王新明	120,000.00	2.66%
5	金萍	107,500.00	2.39%
6	陈瑶	100,000.00	2.22%
7	刘志刚	85,400.00	1.90%
8	施宁娜	50,000.00	1.11%
9	刘飞燕	37,900.00	0.84%
10	苏西华	29,767.00	0.66%

中金中证优选 300 指数(LOF)C

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国国际金融股份有限公司	1,424,275.00	75.68%
2	李文燕	80,081.00	4.26%
3	王新明	61,100.00	3.25%

4	刘超	51,800.00	2.75%
5	陈敏	50,022.00	2.66%
6	任晓艳	41,299.00	2.19%
7	任景英	30,000.00	1.59%
8	丁一	20,004.00	1.06%
9	袁芳	10,009.00	0.53%
10	吴康	10,002.00	0.53%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金中证优选 300 指数 (LOF)A	1,553,464.58	2.7838%
	中金中证优选 300 指数 (LOF)C	17,755.44	0.3286%
	合计	1,571,220.02	2.5670%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金中证优选 300 指数 (LOF)A	>100
	中金中证优选 300 指数 (LOF)C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证优选 300 指数 (LOF)A	0~10
	中金中证优选 300 指数 (LOF)C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证优选 300 指数(LOF)A	中金中证优选 300 指数(LOF)C
基金合同生效日(2018年8月30日)基金 份额总额	196,888,672.87	77,708,924.35
本报告期期初基金份额总额	77,148,010.72	31,491,254.38
本报告期基金总申购份额	20,830,068.62	3,931,387.06
减:本报告期基金总赎回份额	42,173,412.60	30,018,958.16
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以 “-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	55,804,666.74	5,403,683.28

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 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

2021 年 3 月 5 日, 本基金管理人发布公告, 赵璧先生自 2021 年 3 月 3 日担任公司督察长; 李虹女士同日起不再担任公司督察长。同日, 本基金管理人发布公告, 公司股东中金公司于 2021 年 3 月作出股东决定, 赵璧先生不再担任公司第三届董事会董事, 任命邱延冰先生担任公司第三届董事会董事。

2021 年 6 月 2 日, 本基金管理人发布公告, 杨毓莹女士自 2021 年 6 月 1 日起担任公司独立董事; 王元先生同日起不再担任公司独立董事。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
中金公司	2	250,532,983.29	100.00%	183,212.56	100.00%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-

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

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

2、基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	6,035,365.34	100.00%	611,700,000.00	100.00%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
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	2021 年 1 月 5 日
2	中金基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 1 月 16 日
3	中金基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 1 月 22 日
4	中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2021 年 1 月 22 日
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	2021 年 2 月 24 日
6	中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 5 日
7	中金基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 5 日
8	中金基金管理有限公司关于设立厦门分公司的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 6 日
9	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 30 日
10	中金基金管理有限公司中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 30 日
11	中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2021 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 30 日
12	中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)(中金中证优选 300 指数基金产品资料概要(更新))	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 30 日
13	中金基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 31 日
14	中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)2020 年年度报告及摘要	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 31 日
15	中金基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 22 日

16	中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 22 日
17	关于不法分子假冒“中金基金”名义进行诈骗的风险提示	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 26 日
18	关于不法分子假冒“中金基金”名义虚构“中金基金静态战略投资项目”进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 27 日
19	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	2021 年 5 月 29 日
20	中金基金管理有限公司关于公司独立董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 2 日
21	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	2021 年 6 月 12 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，本基金单一投资者持有份额比例没有达到或超过总份额 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优选 300 指数证券投资基金(LOF)募集注册的文件
- 2、《中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》
- 3、《中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)托管协议》
- 4、中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)申请募集注册的法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 7、报告期内中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)在指定媒介上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日