

中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资
基金
2021 年第 2 季度报告

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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中金沪深 300
基金主代码	003015
交易代码	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
报告期末基金份额总额	245,340,287.62 份
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。	
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，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，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。	
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	
下属分级基金的基金简称	中金沪深 300A	中金沪深 300C
下属分级基金的交易代码	003015	003579
报告期末下属分级基金的份额总额	140,121,258.35 份	105,219,029.27 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年4月1日—2021年6月30日）	
	中金沪深 300A	中金沪深 300C
1. 本期已实现收益	10,818,198.05	7,106,544.34
2. 本期利润	14,012,757.96	9,584,777.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0897	0.0927
4. 期末基金资产净值	280,529,828.66	214,463,909.46
5. 期末基金份额净值	2.0021	2.0383

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金沪深 300A

阶段	净值增长率①	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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

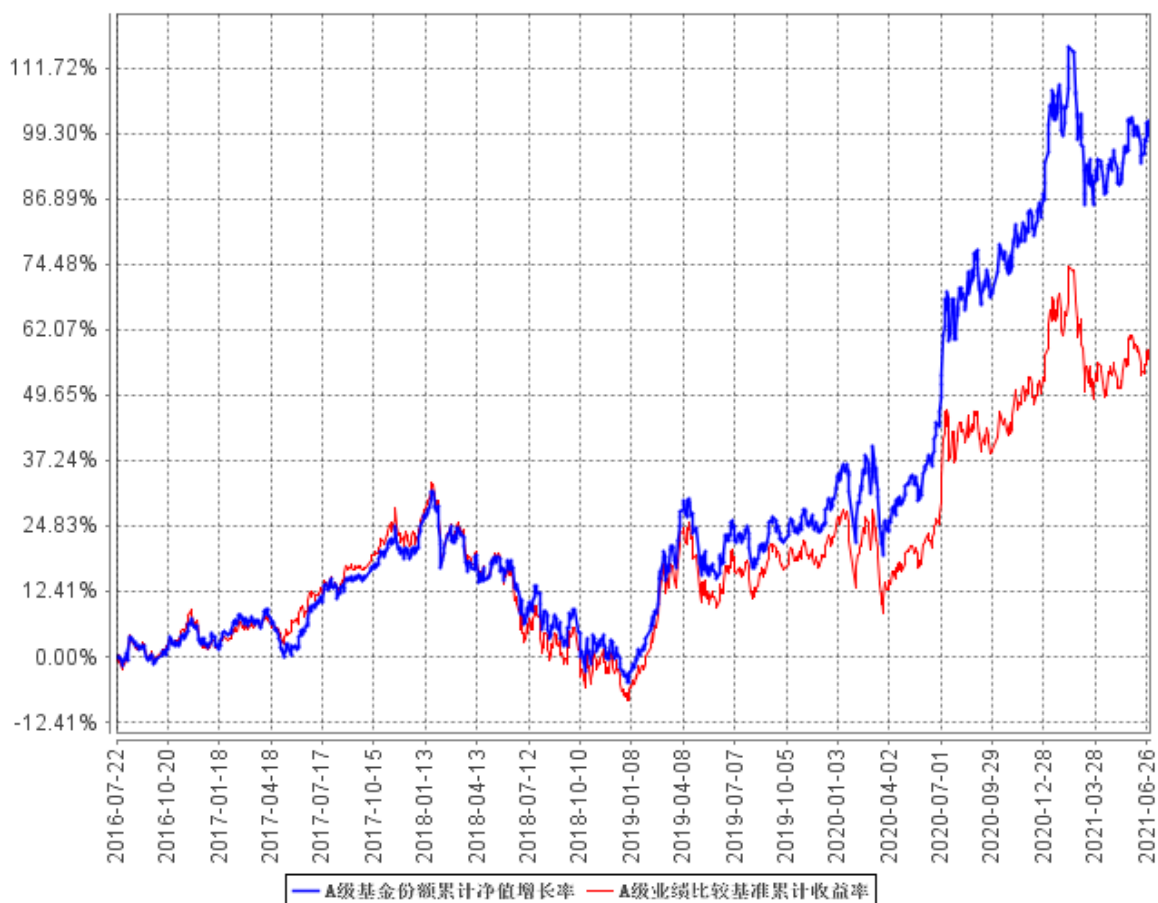
过去三个月	4.93%	0.91%	3.32%	0.93%	1.61%	-0.02%
过去六个月	3.38%	1.26%	0.29%	1.25%	3.09%	0.01%
过去一年	36.65%	1.28%	24.19%	1.27%	12.46%	0.01%
过去三年	80.94%	1.27%	46.42%	1.30%	34.52%	-0.03%
自基金合同生效起至今	100.21%	1.10%	57.63%	1.12%	42.58%	-0.02%

中金沪深 300C

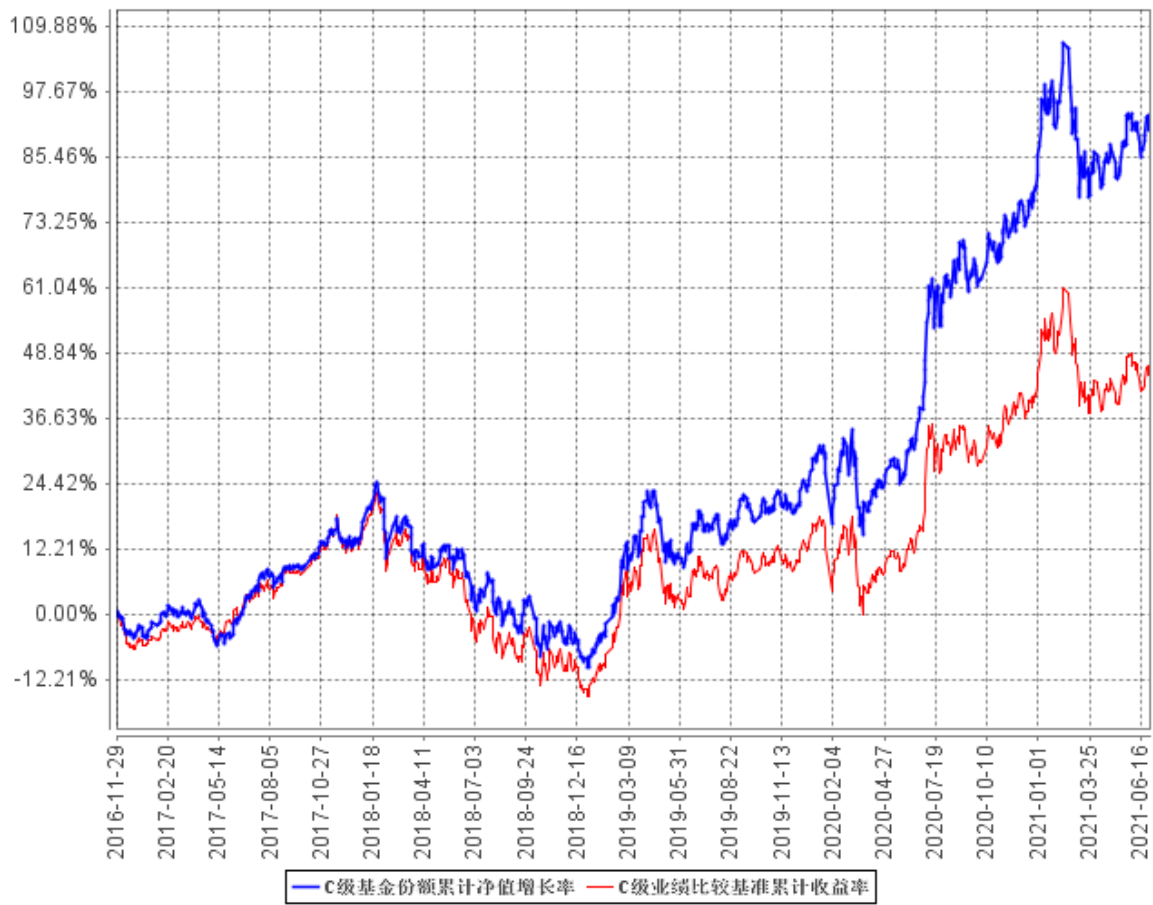
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.82%	0.91%	3.32%	0.93%	1.50%	-0.02%
过去六个月	3.17%	1.26%	0.29%	1.25%	2.88%	0.01%
过去一年	36.10%	1.28%	24.19%	1.27%	11.91%	0.01%
过去三年	82.40%	1.27%	46.42%	1.30%	35.98%	-0.03%
自基金合同生效起至今	91.53%	1.13%	45.61%	1.15%	45.92%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏宇	本基金的基金经理	2017 年 3 月 28 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	本基金的基金经理	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、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉

尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益行为。

4.3 公平交易专项说明

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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，本基金采用量化选股的方法来力争获取超越业绩基准的收益。2021 年第二季度，相对于业绩基准，获取了一定的超额收益。我们将继续努力开发和改进选股模型，争取在超额收益方面有更好的表现。

2021 年二季度，A 股市场总体走势为震荡上行。整个二季度，上证综指上涨 4.34%、沪深 300 指数上涨 3.48%、中证 500 指数上涨 8.86%。沪深 300 指数表现较弱。

上半年全球经济整体上仍处于“疫情模式”之中，下半年有望在全球率先进入“疫后新常态”。市场关注点可能会从之前关注通胀，到逐步更加关注经济增长的可持续性。经济增长方面，6 月官方制造业 PMI 延续放缓，中小企业整体恢复仍然偏慢；从分项看，内需保持平稳，外需连续走弱。通胀方面，猪肉价格增速即将触底，服务业价格持续复苏，CPI 增速温和走强；同时随着 4 月以来大宗商品双向波动加大，PPI 上行压力将得到缓解，全年通胀膨胀态势可控。6 月社融增速企稳，其中人民币信贷显著多增为主要贡献项，直接融资、非标融资和政府融资层面均略好于去年同期，预计下半年将有望回升。流动性总体趋向宽松，市场利率下行，资金面得到改善。

展望下半年，宏观政策或将呈现“紧信用、松货币、宽财政”的组合，信用条件在高基数背

景下继续收敛，货币支持财政发挥更大作用支持中小企业。预计货币政策将整体稳健，保持流动性的合理宽裕的同时稳杠杆，短期有助于提升市场风险偏好。在此背景下，景气程度高、产业前景相对明确、估值和业绩匹配度较好的具有成长潜力的公司更具有配置价值。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金沪深 300A 基金份额净值为 2.0021 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.93%；截至本报告期末中金沪深 300C 基金份额净值为 2.0383 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.82%；同期业绩比较基准收益率为 3.32%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	463,976,249.61	90.59
	其中：股票	463,976,249.61	90.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,550,820.00	5.77
	其中：债券	29,550,820.00	5.77
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,281,018.99	2.40
8	其他资产	6,367,608.72	1.24
9	合计	512,175,697.32	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	6,937,129.20	1.40
B	采矿业	9,767,066.96	1.97
C	制造业	227,745,530.20	46.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,629,309.76	1.14
E	建筑业	361,374.00	0.07
F	批发和零售业	6,299,825.00	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	8,094,596.80	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,000,558.20	2.02
J	金融业	97,872,624.60	19.77
K	房地产业	11,098,587.00	2.24
L	租赁和商务服务业	9,813,270.00	1.98
M	科学研究和技术服务业	9,855,774.60	1.99
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	19,554,047.96	3.95
R	文化、体育和娱乐业	9,474.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	423,039,168.28	85.46

5.2.2 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	11,290.28	0.00
B	采矿业	1,397,760.00	0.28
C	制造业	28,822,712.49	5.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,445,482.39	0.29
E	建筑业	1,450,599.37	0.29
F	批发和零售业	46,404.58	0.01
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	2,567,568.64	0.52
J	金融业	1,326,726.10	0.27
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	95,025.15	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,943,384.33	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,830,128.00	0.37
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	40,937,081.33	8.27

5.2.3 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	15,400	31,673,180.00	6.40
2	601318	中国平安	293,330	18,855,252.40	3.81
3	600036	招商银行	317,600	17,210,744.00	3.48
4	000858	五粮液	54,152	16,131,339.28	3.26
5	603259	药明康德	62,940	9,855,774.60	1.99
6	601888	中国中免	32,700	9,813,270.00	1.98
7	300059	东方财富	299,040	9,805,521.60	1.98
8	000001	平安银行	380,900	8,615,958.00	1.74
9	300015	爱尔眼科	111,702	7,928,607.96	1.60
10	600031	三一重工	265,638	7,722,096.66	1.56

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	601717	郑煤机	176,500	2,052,695.00	0.41
2	002429	兆驰股份	328,300	1,992,781.00	0.40
3	002353	杰瑞股份	42,900	1,917,630.00	0.39
4	000967	盈峰环境	277,600	1,907,112.00	0.39

5	601636	旗滨集团	102,200	1,896,832.00	0.38
---	--------	------	---------	--------------	------

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	29,550,820.00	5.97
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	29,550,820.00	5.97

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019645	20 国债 15	162,000	16,250,220.00	3.28
2	019640	20 国债 10	113,000	11,300,000.00	2.28
3	019654	21 国债 06	20,000	2,000,600.00	0.40

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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，除平安银行股份有限公司（平安银行）、招商银行股份有限公司（招商银行）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。

2021 年 6 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会云南监管局发布行政处罚决定书（云银保监罚决字〔2021〕34 号），对平安银行股份有限公司利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款、用于承接处置本行其他贷款风险；固定资产授信严重不审慎等违法违规事实进行处罚。2020 年 10 月 27 日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局发布行政处罚决定书（甬银保监罚决字〔2020〕66 号），对平安银行股份有限公司贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违法违规事实进行处罚。

2021 年 5 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监银罚决字

(2021) 16 号), 对招商银行股份有限公司为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺, 部分未按规定计提风险加权资产等违法违规事实进行处罚。

本基金采用量化的方式进行选股, 作为指数增强型基金, 在行业权重的偏离上会有一些的控制, 银行业在沪深 300 指数中占很大权重, 所以不可避免的选入银行, 同时我们认为平安银行、招商银行所受处罚并未对其投资价值产生实质性的负面影响, 所以依然按照模型选股的结果而没有进行专门的减仓操作。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	225,851.90
2	应收证券清算款	5,189,092.15
3	应收股利	-
4	应收利息	532,523.73
5	应收申购款	420,140.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,367,608.72

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金沪深 300A	中金沪深 300C
报告期期初基金份额总额	142,311,147.74	104,971,782.43
报告期期间基金总申购份额	32,358,411.04	18,328,494.12
减：报告期期间基金总赎回份额	34,548,300.43	18,081,247.28
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	140,121,258.35	105,219,029.27

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 报告期末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 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金依法合规参与了部分基金管理人股东中金公司承销期内承销的证券，具体情况请见本基金本报告期内发布的有关重大关联交易的公告。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本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、本基金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、报告期内本基金在指定媒介上发布的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

10.2 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。

10.3 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 7 月 21 日