

中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 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：宁波银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48

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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金	
基金简称	中金中证 500ESG 指数增强	
基金主代码	016680	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 10 月 25 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	37,094,967.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金中证 500ESG 指数增强 A	中金中证 500ESG 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	016680	016681
报告期末下属分级基金的份额总额	23,987,179.39 份	13,107,788.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。同时力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的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 7.75%。
投资策略	本基金主要的股票投资策略为标的指数投资策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合，然后通过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、债券投资策略；4、可转债投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货、国债期货及股票期权的投资策略；7、转融通投资策略；8、融资投资策略；9、存托凭证投资策略。详见《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中证 500ESG 基准指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	宁波银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰	朱广科
	联系电话	010-63211122	0574-87050338
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		400-868-1166	0574-83895886
传真		010-66159121	0574-89103213
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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码		100004	315100
法定代表人		李金泽	陆华裕

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	中金中证 500ESG 指数增强 A	中金中证 500ESG 指数增强 C
本期已实现收益	-764,404.91	-407,496.07
本期利润	-1,033,605.09	-614,026.37
加权平均基金份 额本期利润	-0.0404	-0.0467
本期加权平均净 值利润率	-4.62%	-5.37%
本期基金份额净 值增长率	-4.80%	-4.98%
3.1.2 期末数	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	-3,630,646.03	-2,058,840.55
期末可供分配基金份额利润	-0.1514	-0.1571
期末基金资产净值	20,356,533.36	11,048,947.64
期末基金份额净值	0.8486	0.8429
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-15.14%	-15.71%

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 500ESG 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
过去一个月	-5.10%	0.92%	-6.11%	0.90%	1.01%	0.02%
过去三个月	-3.22%	1.03%	-5.00%	1.08%	1.78%	-0.05%
过去六个月	-4.80%	1.46%	-6.99%	1.52%	2.19%	-0.06%
过去一年	-12.29%	1.16%	-15.86%	1.21%	3.57%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-15.14%	0.98%	-12.19%	1.06%	-2.95%	-0.08%

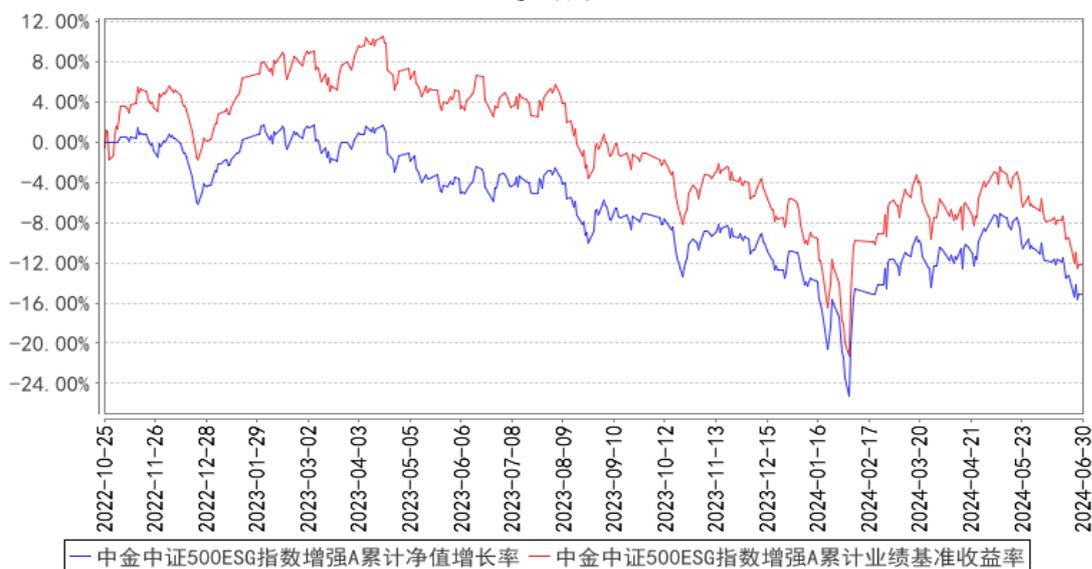
中金中证 500ESG 指数增强 C

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
过去一个月	-5.13%	0.92%	-6.11%	0.90%	0.98%	0.02%

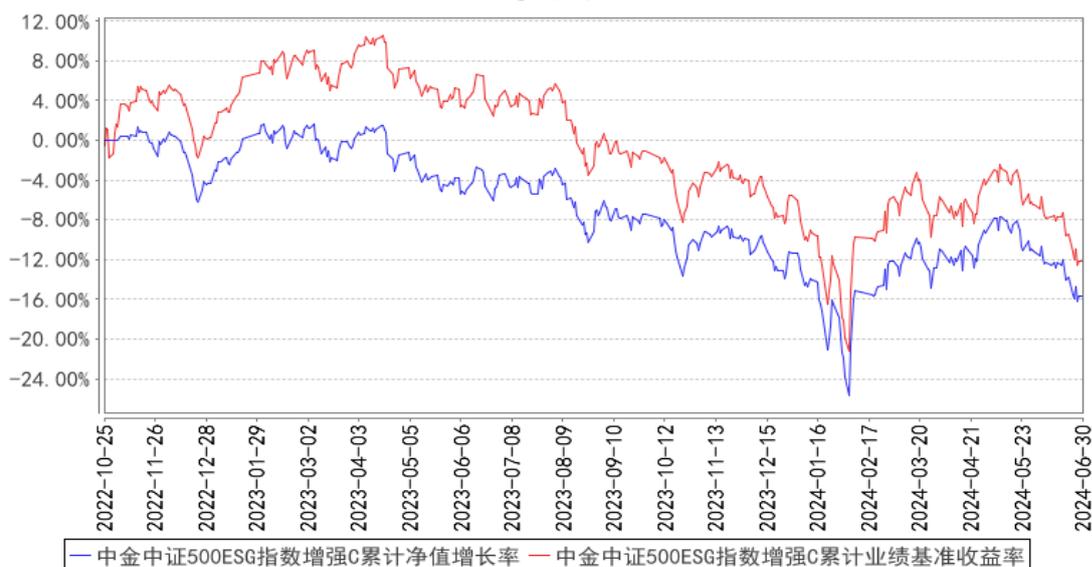
过去三个月	-3.31%	1.03%	-5.00%	1.08%	1.69%	-0.05%
过去六个月	-4.98%	1.46%	-6.99%	1.52%	2.01%	-0.06%
过去一年	-12.63%	1.16%	-15.86%	1.21%	3.23%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-15.71%	0.98%	-12.19%	1.06%	-3.52%	-0.08%

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

中金中证500ESG指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中金中证500ESG指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 6 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 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 51 只公募基金，证券投资基金管理规模 1631.27 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		
耿帅军	本基金基金经理	2022 年 10 月 25 日	-	13 年	耿帅军先生，理学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所金融工程分析师，中信证券股份有限公司研究部副总裁、金融工程分析师，中国国际金融股份有限公司研究部执行总经理、金融工程分析师。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。
王阳峰	本基金基金经理	2022 年 10 月 25 日	-	11 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、上述基金经理任职日期为本基金基金合同生效日。

2、本基金无基金经理助理。

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

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

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，紧密跟踪标的指数，利用量化选股策略精选个股，在控制组合跟踪误差的同时增强基金阿尔法收益。未来将继续努力开发和改进选股策略，在遵守合同和法律法规的前提下管理组合，争取在超额收益方面有更好的表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证 500ESG 指数增强 A 基金份额净值为 0.8486 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.80%，同期业绩基准收益率为-6.99%；中金中证 500ESG 指数增强 C 基金份额净值为 0.8429 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.98%，同期业绩基准收益率为-6.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年上半年，中国经济稳步前行，稳增长政策不断推出，新旧动能持续转化。尽管国内有效需求尚有较大释放空间，地产等行业仍存一定整固压力，但上半年国内 GDP 依然实现 5% 增长，为完成全年预期增长目标打下坚实基础。海外通胀形势似展现出较强惰性，美联储政策方向虽分歧不大，但路径依然有不确定性，投资者对全球流动性表达出更多担忧。

在此背景下，国内股票市场呈现“整体震荡，结构分化”格局，大盘战胜小盘，价值跑赢成长。高股息、科技创新、企业出海等主题在不同阶段引领市场行情，资本市场新“国九条”发布，

强监管、防风险、促高质量发展成为备受关注的政策重点。主要规模指数表现分化，上证 50 上涨 2.95% 沪深 300 上涨 0.89% 中证 500 下跌 8.96% 中证 1000 下跌 16.84% 中证 2000 下跌 23.28% 创业板指下跌 10.99%，科创 50 下跌 16.42%。行业方面，银行、煤炭、石油石化、家电、电力及公用事业表现较好，综合、消费者服务、计算机、商贸零售、传媒表现落后。

展望未来，我们认为：短期看，伴随逆周期政策效果逐步显现，经济增长内生动能有望不断增强，市场有机会重新定价经济增长预期差；全球通胀缓解趋势或在下半年逐步明朗化，全球主要央行加息周期已基本结束，流动性环境仍有望对国内权益市场形成支撑。中长期看，全面深化改革将为中国经济高质量发展注入强劲动能，改革红利将对资本市场的中长期发展产生积极影响。我们对未来权益市场表现不悲观，在账户管理中仍将坚持系统化投资理念，以科学理性决策应对市场各类不确定性。

我们将坚持“高质研究驱动高效投资”的理念，不断挖掘具备长期配置价值的策略，并相对均衡地配置，力争获取可持续的长期收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案；本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形。

自 2024 年 7 月 1 日起，由基金管理人承担本基金处于迷你基金期间的信息披露费、审计费等固定费用。

§ 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，本托管人在中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、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：中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	353,088.21	223,944.66
结算备付金		15.48	15.40
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	31,090,515.69	35,792,139.64
其中：股票投资		29,365,355.50	33,869,720.46
基金投资		-	-
债券投资		1,725,160.19	1,922,419.18
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,749.80	2,271.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		31,454,369.18	36,018,371.24
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,025.88	2,617.87
应付管理人报酬		26,653.94	30,928.09
应付托管费		3,998.11	4,639.24
应付销售服务费		3,773.37	4,159.37
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	11,436.88	85,000.00
负债合计		48,888.18	127,344.57
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	37,094,967.58	40,328,530.66
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-5,689,486.58	-4,437,503.99
净资产合计		31,405,481.00	35,891,026.67
负债和净资产总计		31,454,369.18	36,018,371.24

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，中金中证 500ESG 指数增强 A 的基金份额净值为 0.8486 元，期末份额总额为 23,987,179.39 份；中金中证 500ESG 指数增强 C 的基金份额净值为 0.8429 元，期末份额总额为 13,107,788.19 份。基金份额总额 37,094,967.58 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,419,787.29	2,803,506.77
1. 利息收入		445.92	1,978.70
其中：存款利息收入	6.4.7.13	445.92	1,978.70
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）		-944,820.86	2,041,658.78
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,354,032.70	1,528,892.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	16,978.63	16,910.05
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	392,233.21	495,856.33
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	-475,730.48	751,734.03
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	318.13	8,135.26
减：二、营业总支出		227,844.17	348,032.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	168,308.06	216,166.92
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	25,246.26	32,425.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	22,731.95	33,503.76
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		121.02	8,909.38

其中：卖出回购金融资产支出		121.02	8,909.38
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	11,436.88	57,027.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,647,631.46	2,455,473.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,647,631.46	2,455,473.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,647,631.46	2,455,473.99

6.3 净资产变动表

会计主体：中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	40,328,530.66	-	-4,437,503.99	35,891,026.67
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	40,328,530.66	-	-4,437,503.99	35,891,026.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,233,563.08	-	-1,251,982.59	-4,485,545.67
（一）、综合收益总额	-	-	-1,647,631.46	-1,647,631.46
（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）	-3,233,563.08	-	395,648.87	-2,837,914.21
其中：1. 基金申购款	2,161,534.01	-	-275,805.23	1,885,728.78
2. 基金赎回	-5,395,097.09	-	671,454.10	-4,723,642.99

回款				
(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	37,094,967.58	-	-5,689,486.58	31,405,481.00
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	77,556,435.65	-	-3,315,437.00	74,240,998.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	77,556,435.65	-	-3,315,437.00	74,240,998.65
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-28,315,679.86	-	1,670,895.82	-26,644,784.04
(一)、综合收益总额	-	-	2,455,473.99	2,455,473.99
(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)	-28,315,679.86	-	-784,578.17	-29,100,258.03
其中：1. 基金申购款	53,601,326.70	-	-1,350,555.80	52,250,770.90
2. 基金赎回款	-81,917,006.56	-	565,977.63	-81,351,028.93
(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	49,240,755.79	-	-1,644,541.18	47,596,214.61

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：

<u>宗喆</u>	<u>二</u>	<u>白娜</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2022 年 8 月 23 日证监许可 [2022] 1924 号文注册，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金招募说明书》和《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型定期开放式债券型基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司及西部证券股份有限公司等共同销售，募集期为 2022 年 9 月 26 日起至 2022 年 10 月 21 日。经向中国证监会备案，《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2022 年 10 月 25 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 265,614,769.95 份（含利息转份额 28,918.17 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《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 500ESG 基准指数增强型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据所收取认购 / 申购费用、赎回费用、销售服务费方式的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购 / 申购、赎回基金时收取认购 / 申购费用、赎回费用，并不再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；在投资人认购 / 申购时不收取认购/申购费、赎回时收取赎回费用，且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。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设

置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值，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 500ESG 基准指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、股票期权、国债期货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）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和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编制财务报表。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》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和《资产管理产品相关会计处理规定》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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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

(b) 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。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继

续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	353,088.21
等于：本金	353,068.13
加：应计利息	20.08
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	353,088.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	30,795,298.22	-	29,365,355.50	-1,429,942.72
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	22,180.19	1,725,160.19	1,913.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	22,180.19	1,725,160.19	1,913.00

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	32,496,365.22	22,180.19	31,090,515.69	-1,428,029.72

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末计提债权投资减值准备。

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

本基金本报告期末及上年度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 2024 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	11,436.88
合计	11,436.88

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 500ESG 指数增强 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,830,679.96	26,830,679.96
本期申购	507,436.04	507,436.04
本期赎回（以“-”号填列）	-3,350,936.61	-3,350,936.61
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	23,987,179.39	23,987,179.39

中金中证 500ESG 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,497,850.70	13,497,850.70
本期申购	1,654,097.97	1,654,097.97
本期赎回（以“-”号填列）	-2,044,160.48	-2,044,160.48
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	13,107,788.19	13,107,788.19

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中金中证 500ESG 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	-894,523.38	-2,019,685.10	-2,914,208.48
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-894,523.38	-2,019,685.10	-2,914,208.48
本期利润	-764,404.91	-269,200.18	-1,033,605.09
本期基金份额交易产生的变动数	170,747.45	146,420.09	317,167.54
其中：基金申购款	-28,657.39	-45,378.34	-74,035.73
基金赎回款	199,404.84	191,798.43	391,203.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,488,180.84	-2,142,465.19	-3,630,646.03

中金中证 500ESG 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	-508,585.11	-1,014,710.40	-1,523,295.51
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-508,585.11	-1,014,710.40	-1,523,295.51
本期利润	-407,496.07	-206,530.30	-614,026.37
本期基金份额交易产生的变动数	25,236.22	53,245.11	78,481.33
其中：基金申购款	-103,193.38	-98,576.12	-201,769.50
基金赎回款	128,429.60	151,821.23	280,250.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-890,844.96	-1,167,995.59	-2,058,840.55

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	445.84
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	0.08
其他	-
合计	445.92

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,354,032.70
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	-1,354,032.70

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	68,791,823.20
减：卖出股票成本总额	70,004,116.67
减：交易费用	141,739.23
买卖股票差价收入	-1,354,032.70

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	17,312.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-334.04
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	16,978.63

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
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,526,315.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,500,153.67
减：应计利息总额	26,132.79
减：交易费用	363.37
买卖债券差价收入	-334.04

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

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	392,233.21
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	392,233.21

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-475,730.48
股票投资	-476,587.15
债券投资	856.67
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	-475,730.48

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	318.13
合计	318.13

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	11,436.88
信息披露费	-
证券出借违约金	-
合计	11,436.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
宁波银行	基金托管人、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司(以下简称“中金财富证券”)	基金管理人股东的一级全资子公司、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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 (%)
中金财富证券	92,906,362.42	68.94	154,307,421.49	56.01

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 (%)
中金财富证 券	1,803,950.00	100.00	3,598,706.00	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 (%)
中金财富证券	1,690,000.00	100.00	77,340,000.00	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金财富证券	68,257.78	68.90	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 (%)
中金财富证券	113,571.60	56.51	-	-

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《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还获得证券研究综合服务。

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	168,308.06	216,166.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	72,726.72	65,496.90
应支付基金管理人的净管理费	95,581.34	150,670.02

注：支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00%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×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,246.26	32,425.05

注：支付基金托管人宁波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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500ESG 指数 增强 A	中金中证 500ESG 指数 增强 C	合计
宁波银行	-	19.34	19.34
中金财富证券	-	11,261.58	11,261.58
中金基金	-	9.00	9.00
合计	-	11,289.92	11,289.92
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 500ESG 指数 增强 A	中金中证 500ESG 指数 增强 C	合计
宁波银行	-	262.47	262.47
中金财富证券	-	13,330.62	13,330.62
中金基金	-	10.05	10.05
合计	-	13,603.14	13,603.14

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 0.40% 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×0.40%/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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
宁波银行	105,998.62	176.91	103,370.93	811.51
中金财富证券	119,676.47	135.39	94,000.44	817.59

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日，本基金无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型指数增强基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不

超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性压力测试、流动性风险预警、指标超标及危机的处理、流动性风险管理工具、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司投资风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性指标进行监控。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人

管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市场值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	353,068.13	-	-	20.08	353,088.21
结算备付金	15.48	-	-	-	15.48
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,702,980.00	-	-	29,387,535.69	31,090,515.69
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	-	-	-	10,749.80	10,749.80
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,056,063.61	-	-	29,398,305.57	31,454,369.18
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,025.88	3,025.88
应付销售服务费	-	-	-	3,773.37	3,773.37
应付管理人报酬	-	-	-	26,653.94	26,653.94
应付托管费	-	-	-	3,998.11	3,998.11

应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	11,436.88	11,436.88
负债总计	-	-	-	48,888.18	48,888.18
利率敏感度缺口	2,056,063.61	-	-	29,349,417.39	31,405,481.00
上年度末 2023 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	223,930.43	-	-	14.23	223,944.66
结算备付金	-	-	-	15.40	15.40
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,898,510.00	-	-	33,893,629.64	35,792,139.64
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	-	-	-	2,271.54	2,271.54
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,122,440.43	-	-	33,895,930.81	36,018,371.24
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,617.87	2,617.87
应付销售服务费	-	-	-	4,159.37	4,159.37
应付管理人报酬	-	-	-	30,928.09	30,928.09
应付托管费	-	-	-	4,639.24	4,639.24
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	85,000.00	85,000.00
负债总计	-	-	-	127,344.57	127,344.57
利率敏感度缺口	2,122,440.43	-	-	33,768,586.24	35,891,026.67

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	市场利率下降 25 个基点		1,450.41
市场利率上升 25 个基点		-1,450.41	-1,635.04

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	29,365,355.50	93.50	33,869,720.46	94.37
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	29,365,355.50	93.50	33,869,720.46	94.37

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	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,486,034.35	1,626,326.68
	业绩比较基准下降 5%	-1,486,034.35	-1,626,326.68

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	29,365,355.50	33,869,720.46
第二层次	1,725,160.19	1,922,419.18
第三层次	-	-
合计	31,090,515.69	35,792,139.64

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应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，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	29,365,355.50	93.36
	其中：股票	29,365,355.50	93.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,725,160.19	5.48
	其中：债券	1,725,160.19	5.48
	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	353,103.69	1.12
8	其他各项资产	10,749.80	0.03
9	合计	31,454,369.18	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	14,988.00	0.05
B	采矿业	1,526,231.00	4.86
C	制造业	17,687,885.94	56.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,132,694.00	3.61
E	建筑业	224,243.00	0.71
F	批发和零售业	685,714.36	2.18
G	交通运输、仓储和邮政业	542,061.00	1.73

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,995,973.05	6.36
J	金融业	1,559,864.30	4.97
K	房地产业	340,620.00	1.08
L	租赁和商务服务业	112,592.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	14,429.02	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	355,464.00	1.13
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	386,650.00	1.23
S	综合	80,256.00	0.26
	合计	26,659,665.67	84.89

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	35,308.00	0.11
C	制造业	2,143,975.25	6.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	66,036.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	42,840.00	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	152,635.00	0.49
J	金融业	31,075.00	0.10
K	房地产业	39,930.00	0.13
L	租赁和商务服务业	29,750.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	164,140.58	0.52
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	2,705,689.83	8.62

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	300502	新易盛	5,400	569,970.00	1.81
2	600066	宇通客车	20,100	518,580.00	1.65
3	601058	赛轮轮胎	36,500	511,000.00	1.63
4	002128	电投能源	21,600	455,760.00	1.45
5	002340	格林美	67,000	426,790.00	1.36
6	000423	东阿阿胶	6,400	400,640.00	1.28
7	002008	大族激光	19,100	397,280.00	1.27
8	601168	西部矿业	21,700	389,515.00	1.24
9	601717	郑煤机	25,900	383,320.00	1.22
10	002517	恺英网络	38,700	369,585.00	1.18
11	600885	宏发股份	12,200	337,696.00	1.08
12	300207	欣旺达	22,200	336,774.00	1.07
13	600582	天地科技	46,300	319,007.00	1.02
14	600299	安迪苏	31,900	309,430.00	0.99
15	300251	光线传媒	34,800	292,668.00	0.93
16	603568	伟明环保	14,100	290,178.00	0.92
17	002273	水晶光电	17,000	288,660.00	0.92
18	002563	森马服饰	48,300	280,623.00	0.89
19	601636	旗滨集团	43,400	279,930.00	0.89
20	002203	海亮股份	32,700	260,946.00	0.83
21	002465	海格通信	24,900	257,964.00	0.82
22	002065	东华软件	56,800	256,736.00	0.82
23	600517	国网英大	58,600	253,738.00	0.81
24	601966	玲珑轮胎	13,700	251,669.00	0.80
25	688029	南微医学	3,994	245,870.64	0.78
26	000027	深圳能源	33,000	240,900.00	0.77
27	002414	高德红外	39,600	233,244.00	0.74
28	300383	光环新网	27,600	233,220.00	0.74
29	603228	景旺电子	7,300	232,140.00	0.74
30	300677	英科医疗	8,600	230,566.00	0.73

31	002078	太阳纸业	16,500	230,175.00	0.73
32	000883	湖北能源	37,900	227,779.00	0.73
33	600737	中粮糖业	23,700	227,283.00	0.72
34	000050	深天马 A	30,700	223,496.00	0.71
35	600765	中航重机	10,900	222,360.00	0.71
36	300724	捷佳伟创	4,100	221,441.00	0.71
37	000825	太钢不锈	65,300	220,714.00	0.70
38	000830	鲁西化工	18,600	215,574.00	0.69
39	002064	华峰化学	29,500	211,515.00	0.67
40	688819	天能股份	8,682	207,152.52	0.66
41	000738	航发控制	10,300	206,721.00	0.66
42	600704	物产中大	47,300	205,282.00	0.65
43	000997	新大陆	14,600	203,086.00	0.65
44	600699	均胜电子	13,700	203,034.00	0.65
45	600521	华海药业	11,900	202,895.00	0.65
46	002984	森麒麟	8,400	202,356.00	0.64
47	600967	内蒙一机	28,100	202,320.00	0.64
48	002120	韵达股份	26,100	202,014.00	0.64
49	002153	石基信息	35,000	200,550.00	0.64
50	002444	巨星科技	8,100	200,070.00	0.64
51	002557	洽洽食品	6,900	194,511.00	0.62
52	688567	孚能科技	20,255	194,448.00	0.62
53	601231	环旭电子	12,100	194,205.00	0.62
54	600126	杭钢股份	47,100	193,581.00	0.62
55	002608	江苏国信	24,600	190,650.00	0.61
56	688169	石头科技	483	189,625.80	0.60
57	600663	陆家嘴	21,300	187,866.00	0.60
58	688234	天岳先进	4,000	187,680.00	0.60
59	002558	巨人网络	19,700	185,968.00	0.59
60	601665	齐鲁银行	37,100	182,161.00	0.58
61	000987	越秀资本	35,800	177,568.00	0.57
62	601608	中信重工	45,100	171,831.00	0.55
63	601615	明阳智能	18,200	171,808.00	0.55
64	600871	石化油服	92,400	160,776.00	0.51
65	603786	科博达	2,500	160,375.00	0.51
66	000039	中集集团	16,900	156,494.00	0.50
67	000887	中鼎股份	12,600	154,224.00	0.49
68	000921	海信家电	4,700	151,528.00	0.48
69	002152	广电运通	14,400	150,624.00	0.48
70	000960	锡业股份	9,600	148,704.00	0.47
71	600062	华润双鹤	7,500	146,850.00	0.47
72	002138	顺络电子	5,300	145,538.00	0.46
73	688281	华秦科技	1,720	143,310.40	0.46

74	601991	大唐发电	46,700	140,567.00	0.45
75	688188	柏楚电子	760	140,258.00	0.45
76	000636	风华高科	10,500	137,130.00	0.44
77	000878	云南铜业	11,000	137,060.00	0.44
78	603893	瑞芯微	2,300	136,091.00	0.43
79	000598	兴蓉环境	17,900	134,608.00	0.43
80	600655	豫园股份	25,500	131,325.00	0.42
81	002506	协鑫集成	64,700	125,518.00	0.40
82	603156	养元饮品	5,900	125,493.00	0.40
83	000031	大悦城	53,600	125,424.00	0.40
84	688520	神州细胞	3,181	125,172.35	0.40
85	002507	涪陵榨菜	10,200	124,950.00	0.40
86	300866	安克创新	1,730	123,193.30	0.39
87	600500	中化国际	35,100	122,499.00	0.39
88	688516	奥特维	2,910	121,667.10	0.39
89	601990	南京证券	15,800	121,344.00	0.39
90	002683	广东宏大	6,000	120,780.00	0.38
91	600739	辽宁成大	13,600	113,832.00	0.36
92	300357	我武生物	5,400	109,188.00	0.35
93	300394	天孚通信	1,220	107,872.40	0.34
94	000513	丽珠集团	2,800	104,188.00	0.33
95	601233	桐昆股份	6,400	102,144.00	0.33
96	300017	网宿科技	12,300	97,170.00	0.31
97	601228	广州港	31,700	96,685.00	0.31
98	002958	青农商行	35,700	95,676.00	0.30
99	601828	美凯龙	37,500	95,625.00	0.30
100	000729	燕京啤酒	10,600	93,598.00	0.30
101	000703	恒逸石化	13,000	92,170.00	0.29
102	002939	长城证券	13,700	91,790.00	0.29
103	000630	铜陵有色	24,700	89,167.00	0.28
104	601399	国机重装	34,000	87,720.00	0.28
105	600928	西安银行	26,200	85,674.00	0.27
106	600282	南钢股份	17,200	85,656.00	0.27
107	600170	上海建工	39,400	84,710.00	0.27
108	601216	君正集团	22,200	81,918.00	0.26
109	688002	睿创微纳	2,923	81,756.31	0.26
110	600998	九州通	16,487	80,456.56	0.26
111	600673	东阳光	11,400	80,256.00	0.26
112	603650	彤程新材	2,700	79,785.00	0.25
113	002508	老板电器	3,500	77,350.00	0.25
114	600511	国药股份	2,500	76,975.00	0.25
115	600390	五矿资本	18,800	76,140.00	0.24
116	600637	东方明珠	12,300	74,784.00	0.24

117	600968	海油发展	17,100	70,452.00	0.22
118	002423	中粮资本	9,400	70,406.00	0.22
119	002436	兴森科技	6,800	70,176.00	0.22
120	600873	梅花生物	6,900	69,138.00	0.22
121	000709	河钢股份	35,200	68,288.00	0.22
122	600315	上海家化	3,800	67,564.00	0.22
123	600498	烽火通信	4,200	66,780.00	0.21
123	601568	北元集团	18,000	66,780.00	0.21
124	603486	科沃斯	1,400	66,052.00	0.21
125	601598	中国外运	11,600	65,308.00	0.21
126	600820	隧道股份	10,000	65,300.00	0.21
127	002266	浙富控股	23,400	65,286.00	0.21
128	600985	淮北矿业	3,800	63,612.00	0.20
129	600566	济川药业	2,000	63,420.00	0.20
130	000728	国元证券	10,300	62,418.00	0.20
131	600096	云天化	3,200	62,144.00	0.20
132	603883	老百姓	3,380	62,056.80	0.20
133	600380	健康元	5,400	60,318.00	0.19
134	600549	厦门钨业	3,382	58,339.50	0.19
135	600901	江苏金租	11,540	58,277.00	0.19
136	601077	渝农商行	11,600	58,232.00	0.19
137	601577	长沙银行	6,900	56,442.00	0.18
138	601179	中国西电	6,700	53,868.00	0.17
139	002056	横店东磁	4,300	53,621.00	0.17
140	002155	湖南黄金	2,900	52,490.00	0.17
141	688180	君实生物	1,800	52,290.00	0.17
142	600348	华阳股份	5,000	49,800.00	0.16
143	600350	山东高速	5,600	49,560.00	0.16
144	600956	新天绿能	5,900	48,203.00	0.15
145	600988	赤峰黄金	2,900	47,386.00	0.15
146	600862	中航高科	2,500	46,950.00	0.15
147	603816	顾家家居	1,400	45,206.00	0.14
148	600032	浙江新能	6,000	43,680.00	0.14
149	601611	中国核建	5,300	42,877.00	0.14
150	000959	首钢股份	15,600	42,432.00	0.14
151	600497	驰宏锌锗	7,900	42,186.00	0.13
152	002353	杰瑞股份	1,200	42,096.00	0.13
153	000739	普洛药业	3,100	42,067.00	0.13
154	688006	杭可科技	2,386	41,635.70	0.13
155	600369	西南证券	11,600	41,528.00	0.13
156	601098	中南传媒	3,300	40,986.00	0.13
157	300296	利亚德	9,000	40,500.00	0.13
158	600642	申能股份	4,500	39,735.00	0.13

159	600131	国网信通	2,300	38,801.00	0.12
160	600528	中铁工业	5,300	38,796.00	0.12
161	601666	平煤股份	3,400	38,080.00	0.12
162	000400	许继电气	1,100	37,851.00	0.12
163	600352	浙江龙盛	4,400	37,796.00	0.12
164	002223	鱼跃医疗	1,000	37,600.00	0.12
165	002294	信立泰	1,400	37,282.00	0.12
166	601880	辽港股份	29,900	36,777.00	0.12
167	300253	卫宁健康	6,200	36,580.00	0.12
168	603444	吉比特	200	35,602.00	0.11
169	688099	晶晨股份	600	35,592.00	0.11
170	601019	山东出版	3,000	35,460.00	0.11
171	601958	金钼股份	3,400	35,394.00	0.11
172	600377	宁沪高速	2,800	35,280.00	0.11
173	601198	东兴证券	4,400	35,024.00	0.11
174	688538	和辉光电	17,400	34,452.00	0.11
175	600416	湘电股份	3,400	33,796.00	0.11
176	002373	千方科技	3,700	33,559.00	0.11
177	300487	蓝晓科技	800	33,408.00	0.11
178	002372	伟星新材	2,102	32,412.84	0.10
179	601992	金隅集团	23,500	32,195.00	0.10
180	601158	重庆水务	6,600	31,680.00	0.10
181	600970	中材国际	2,600	31,356.00	0.10
182	600867	通化东宝	3,700	30,969.00	0.10
183	300009	安科生物	3,600	30,744.00	0.10
184	600906	财达证券	5,300	30,369.00	0.10
185	002472	双环传动	1,300	28,626.00	0.09
186	600848	上海临港	3,000	27,330.00	0.09
187	603927	中科软	1,500	27,135.00	0.09
188	002028	思源电气	400	26,760.00	0.09
189	688331	荣昌生物	600	25,920.00	0.08
190	688425	铁建重工	6,800	25,024.00	0.08
191	002531	天顺风能	2,782	24,871.08	0.08
192	003022	联泓新科	1,800	24,678.00	0.08
193	600166	福田汽车	10,500	23,625.00	0.08
194	300776	帝尔激光	500	22,980.00	0.07
195	600535	天士力	1,800	22,644.00	0.07
196	000060	中金岭南	5,300	22,472.00	0.07
197	601128	常熟银行	2,890	21,877.30	0.07
198	600801	华新水泥	1,500	20,625.00	0.07
199	300765	新诺威	760	19,174.80	0.06
200	601928	凤凰传媒	1,600	17,536.00	0.06
201	001872	招商港口	900	17,325.00	0.06

202	600008	首创环保	6,400	17,152.00	0.05
203	600153	建发股份	1,900	16,967.00	0.05
204	601156	东航物流	800	16,280.00	0.05
205	300146	汤臣倍健	1,200	16,260.00	0.05
206	688772	珠海冠宇	1,086	16,181.40	0.05
207	600499	科达制造	1,800	15,174.00	0.05
208	600598	北大荒	1,200	14,988.00	0.05
209	601108	财通证券	2,200	14,542.00	0.05
210	603317	天味食品	1,260	14,376.60	0.05
211	600098	广州发展	2,200	14,080.00	0.04
212	600909	华安证券	3,300	13,893.00	0.04
213	603658	安图生物	300	13,821.00	0.04
214	600141	兴发集团	700	13,356.00	0.04
215	600004	白云机场	1,400	13,272.00	0.04
216	600329	达仁堂	400	12,956.00	0.04
217	002831	裕同科技	500	12,795.00	0.04
218	000988	华工科技	400	11,972.00	0.04
219	601965	中国汽研	700	11,823.00	0.04
220	603868	飞科电器	300	11,520.00	0.04
221	002966	苏州银行	1,400	10,500.00	0.03
222	002384	东山精密	500	10,350.00	0.03
223	601298	青岛港	1,000	9,560.00	0.03
224	600859	王府井	800	9,392.00	0.03
225	688122	西部超导	200	7,664.00	0.02
226	688777	中控技术	200	7,540.00	0.02
227	003031	中瓷电子	160	7,398.40	0.02
228	603712	七一二	400	7,276.00	0.02
229	600808	马钢股份	3,600	7,272.00	0.02
230	301236	软通动力	200	7,042.00	0.02
231	600271	航天信息	900	6,624.00	0.02
232	688375	国博电子	92	6,498.88	0.02
233	600827	百联股份	800	5,904.00	0.02
234	000156	华数传媒	900	5,652.00	0.02
235	000898	鞍钢股份	2,400	5,088.00	0.02
236	000932	华菱钢铁	1,000	4,430.00	0.01
237	000958	电投产融	1,000	3,660.00	0.01
238	002568	百润股份	200	3,366.00	0.01
239	688390	固德威	56	3,142.72	0.01
240	688295	中复神鹰	122	2,476.60	0.01
241	600060	海信视像	100	2,474.00	0.01
242	600109	国金证券	300	2,265.00	0.01
243	688248	南网科技	54	1,600.02	0.01
244	002202	金风科技	200	1,344.00	0.00

245	300012	华测检测	100	1,006.00	0.00
246	300699	光威复材	20	496.60	0.00
247	603939	益丰药房	20	491.00	0.00
248	688536	思瑞浦	5	489.05	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	600707	彩虹股份	18,700	127,347.00	0.41
2	002422	科伦药业	3,900	118,287.00	0.38
3	300492	华图山鼎	1,200	113,040.00	0.36
4	002106	莱宝高科	9,100	99,190.00	0.32
5	688159	有方科技	2,600	98,436.00	0.31
6	002245	蔚蓝锂芯	12,600	97,650.00	0.31
7	605166	聚合顺	9,200	96,508.00	0.31
8	603113	金能科技	17,200	94,084.00	0.30
9	001309	德明利	1,070	92,448.00	0.29
10	300323	华灿光电	20,200	87,870.00	0.28
11	688578	艾力斯	1,365	87,005.10	0.28
12	601700	风范股份	19,200	84,288.00	0.27
13	002463	沪电股份	2,300	83,950.00	0.27
14	605369	拱东医疗	2,000	79,800.00	0.25
15	002602	世纪华通	20,800	71,344.00	0.23
16	600482	中国动力	2,800	54,544.00	0.17
17	688788	科思科技	2,200	51,150.00	0.16
18	688136	科兴制药	3,000	50,280.00	0.16
19	688222	成都先导	4,400	49,940.00	0.16
20	688660	电气风电	16,800	48,384.00	0.15
21	002032	苏泊尔	900	45,090.00	0.14
22	002468	申通快递	5,100	42,840.00	0.14
23	002025	航天电器	900	41,742.00	0.13
24	002215	诺普信	5,500	40,975.00	0.13
25	300679	电连技术	1,000	40,230.00	0.13
26	603025	大豪科技	2,900	40,078.00	0.13
27	002244	滨江集团	5,500	39,930.00	0.13
28	601127	赛力斯	400	36,448.00	0.12
29	688208	道通科技	1,484	35,823.76	0.11
30	688030	山石网科	3,400	35,530.00	0.11
31	000426	兴业银锡	2,600	35,308.00	0.11
32	300783	三只松鼠	1,500	32,805.00	0.10
33	600989	宝丰能源	1,800	31,194.00	0.10
34	000563	陕国投 A	11,300	31,075.00	0.10
35	603355	莱克电气	1,400	30,240.00	0.10
36	000927	中国铁物	12,500	29,750.00	0.09

37	603922	金鸿顺	1,200	29,520.00	0.09
38	002399	海普瑞	3,400	29,478.00	0.09
39	600161	天坛生物	1,200	29,280.00	0.09
40	002867	周大生	2,200	28,732.00	0.09
41	000016	深康佳 A	13,200	28,116.00	0.09
42	300698	万马科技	800	28,104.00	0.09
43	002491	通鼎互联	8,300	28,054.00	0.09
44	300386	飞天诚信	2,500	26,025.00	0.08
45	603997	继峰股份	2,300	23,529.00	0.07
46	000990	诚志股份	3,000	22,320.00	0.07
47	002600	领益智造	3,100	22,072.00	0.07
48	688018	乐鑫科技	200	19,736.00	0.06
49	605222	起帆电缆	1,200	18,408.00	0.06
50	300218	安利股份	1,200	18,096.00	0.06
51	300595	欧普康视	700	10,976.00	0.03
52	002518	科士达	600	10,620.00	0.03
53	601633	长城汽车	400	10,120.00	0.03
54	688510	航亚科技	536	9,867.76	0.03
55	600983	惠而浦	1,100	8,195.00	0.03
56	603819	神力股份	500	5,250.00	0.02
57	600538	国发股份	1,100	4,499.00	0.01
58	002662	京威股份	1,300	3,952.00	0.01
59	603698	航天工程	300	3,591.00	0.01
60	600160	巨化股份	100	2,413.00	0.01
61	000553	安道麦 A	500	2,270.00	0.01
62	688049	炬芯科技	70	1,548.40	0.00
63	002461	珠江啤酒	200	1,484.00	0.00
64	688182	灿勤科技	89	1,178.36	0.00
65	688105	诺唯赞	58	1,160.58	0.00
66	688728	格科微	69	835.59	0.00
67	688219	会通股份	104	808.08	0.00
68	688177	百奥泰	25	528.00	0.00
69	002687	乔治白	76	319.20	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 (%)
1	002517	恺英网络	760,726.00	2.12
2	002422	科伦药业	637,001.00	1.77
3	300502	新易盛	559,331.00	1.56
4	002463	沪电股份	549,704.80	1.53
5	601168	西部矿业	525,313.00	1.46

6	000423	东阿阿胶	523,237.00	1.46
7	002128	电投能源	484,498.00	1.35
8	601966	玲珑轮胎	468,185.00	1.30
9	002340	格林美	449,850.00	1.25
10	002465	海格通信	446,012.00	1.24
11	600885	宏发股份	437,901.00	1.22
12	002008	大族激光	416,010.00	1.16
13	300207	欣旺达	415,049.00	1.16
14	002683	广东宏大	410,296.00	1.14
15	002078	太阳纸业	404,893.00	1.13
16	600535	天士力	392,829.00	1.09
17	601058	赛轮轮胎	383,206.00	1.07
18	600582	天地科技	381,221.00	1.06
19	000050	深天马 A	378,962.00	1.06
20	000039	中集集团	376,385.00	1.05

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002422	科伦药业	690,380.00	1.92
2	002463	沪电股份	555,843.00	1.55
3	601958	金钼股份	469,260.00	1.31
4	600498	烽火通信	460,402.00	1.28
5	600637	东方明珠	454,686.00	1.27
6	300866	安克创新	439,555.00	1.22
7	000630	铜陵有色	438,920.00	1.22
8	600820	隧道股份	437,559.00	1.22
9	600160	巨化股份	425,002.00	1.18
10	000636	风华高科	423,546.00	1.18
11	600535	天士力	413,794.00	1.15
12	002925	盈趣科技	411,884.00	1.15
13	603338	浙江鼎力	410,312.00	1.14
14	002064	华峰化学	409,891.00	1.14
15	002414	高德红外	401,904.00	1.12
16	688208	道通科技	401,638.68	1.12
17	601233	桐昆股份	389,196.00	1.08
18	300682	朗新集团	386,569.00	1.08
19	600998	九州通	386,140.00	1.08
20	002092	ST 中泰	378,389.00	1.05

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	65,976,338.86
卖出股票收入（成交）总额	68,791,823.20

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	1,725,160.19	5.49
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	1,725,160.19	5.49

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	019727	23 国债 24	6,000	610,914.25	1.95
2	019733	24 国债 02	6,000	606,438.41	1.93
3	019709	23 国债 16	5,000	507,807.53	1.62

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,749.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,749.80

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中不存在流通受限股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
中金中证 500ESG 指 数增强 A	357	67,190.98	137,486.47	0.57	23,849,692.92	99.43
中金中证 500ESG 指 数增强 C	392	33,438.24	200,000.00	1.53	12,907,788.19	98.47
合计	749	49,525.99	337,486.47	0.91	36,757,481.11	99.09

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金中证 500ESG 指数增强 A	562,858.07	2.3465
	中金中证 500ESG 指数增强 C	6,079.91	0.0464
	合计	568,937.98	1.5337

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金中证 500ESG 指数增强 A	50~100
	中金中证 500ESG 指数增强 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 500ESG 指数增强 A	50~100
	中金中证 500ESG 指数增强 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 500ESG 指数增强 A	中金中证 500ESG 指数增强 C
基金合同生效日 (2022 年 10 月 25 日) 基金份额总额	87,120,640.18	178,494,129.77
本报告期期初基金份 额总额	26,830,679.96	13,497,850.70
本报告期基金总申购 份额	507,436.04	1,654,097.97
减：本报告期基金总 赎回份额	3,350,936.61	2,044,160.48

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	23,987,179.39	13,107,788.19

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、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

2024 年 1 月 20 日，本基金管理人发布公告，李金泽先生自 2024 年 1 月 19 日起担任公司董事长、法定代表人；宗喆先生自 2024 年 1 月 19 日起担任公司总经理、董事；胡长生先生自 2024 年 1 月 19 日起不再担任公司董事长、法定代表人，不再代履公司总经理职务。

2024 年 3 月 2 日，本基金管理人发布公告，宗喆先生自 2024 年 2 月 29 日起担任公司财务负责人。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中金财富证券	2	92,906,362.42	68.94	68,257.78	68.90	-
东兴证券	2	41,861,799.64	31.06	30,804.07	31.10	-

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 (%)
中金财富证券	1,803,950.00	100.00	1,690,000.00	100.00	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-1-19
2	中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-1-19
3	中金基金管理有限公司董事长、高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024-1-20
4	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	2024-3-2
5	中金基金管理有限公司关于不法分子假冒“中金基金”名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2024-3-22
6	中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-3-29
7	中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-3-29
8	中金基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-4-20
9	中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-4-20
10	中金基金管理有限公司关于上海分公司负责人及注册地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-5-15
11	中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-6-24

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金申请募集注册的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照

- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、报告期内中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日