

中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资
基金联接基金(原中金沪深 300 指数型证券
投资基金)
2025 年第 3 季度报告

2025 年 9 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

报告送出日期：2025 年 10 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 10 月 27 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。

中金沪深 300 指数型证券投资基金于 2025 年 07 月 08 日发布《关于中金沪深 300 指数型证券投资基金变更为中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订法律文件的公告》，自 2025 年 07 月 09 日起，中金沪深 300 指数型证券投资基金变更为中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金报告期自 2025 年 07 月 09 日起至 2025 年 09 月 30 日止，原中金沪深 300 指数型证券投资基金报告期自 2025 年 07 月 01 日起至 2025 年 07 月 08 日止。如无特殊说明，本报告中本基金指中金沪深 300 指数型证券投资基金及中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

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 2025 年 07 月 01 日起至 2025 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	中金沪深 300ETF 联接
基金主代码	023146
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 7 月 9 日
报告期末基金份额总额	39,654,142.61 份
投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	在正常市场情况下，本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。具体包括：1、资产配置策略；2、目标 ETF 投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、债券和货币市场工具投资策略；6、股指期货、国债期货

	及股票期权的投资策略；7、转融通证券出借业务投资策略；8、融资投资策略。详见《中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%	
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，且目标 ETF 为采用指数化操作的股票型基金，因此本基金的预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
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	
下属分级基金的基金简称	中金沪深 300ETF 联接 A	中金沪深 300ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	023146	023147
报告期末下属分级基金的份额总额	32, 230, 863. 31 份	7, 423, 279. 30 份

2.1.1 目标基金基本情况（转型后）

基金名称	中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510320
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 4 月 16 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 4 月 25 日
基金管理人名称	中金基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明（转型后）

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。
投资策略	本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，预期年化跟踪误差不得超过 2%。具体包括：1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券和货币市场工具投资策略；4、衍生品投资策略；5、参与融资与转融通证券出借业务投资策略。详见《中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	中金沪深 300 指数	
基金主代码	023146	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 6 月 3 日	
报告期末基金份额总额	333,394,034.47 份	
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。	
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。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、债券和货币市场工具投资策略；5、股指期货、国债期货及股票期权的投资策略；6、转融通证券出借业务投资策略；7、融资投资策略。详见《中金沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 x95%+银行活期存款税后利率 x5%	
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
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	
下属分级基金的基金简称	中金沪深 300 指数 A	中金沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	023146	023147
报告期末下属分级基金的份额总额	260,286,179.12 份	73,107,855.35 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2025 年 7 月 9 日 – 2025 年 9 月 30 日）	
	中金沪深 300ETF 联接 A	中金沪深 300ETF 联接 C
1. 本期已实现收益	10,469,086.14	2,417,075.14
2. 本期利润	12,276,909.82	2,783,527.17
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1443	0.1346
4. 期末基金资产净值	37,592,377.63	8,652,609.49
5. 期末基金份额净值	1.1663	1.1656

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. 自 2025 年 07 月 09 日起，“中金沪深 300 指数型证券投资基金”转型为“中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，同日起，中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2025 年 7 月 1 日 - 2025 年 7 月 8 日）	
	中金沪深 300 指数 A	中金沪深 300 指数 C
1. 本期已实现收益	87,956.54	23,422.75
2. 本期利润	1,807,846.62	736,423.64
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0063	0.0044
4. 期末基金资产净值	262,900,327.27	73,831,301.35
5. 期末基金份额净值	1.0100	1.0099

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. 自 2025 年 07 月 09 日起，“中金沪深 300 指数型证券投资基金”转型为“中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，同日起，中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效。

3.2 基金净值表现（转型后）

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 300ETF 联接 A

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
自基金合同生效起至今	15.48%	0.82%	15.22%	0.84%	0.26%	-0.02%

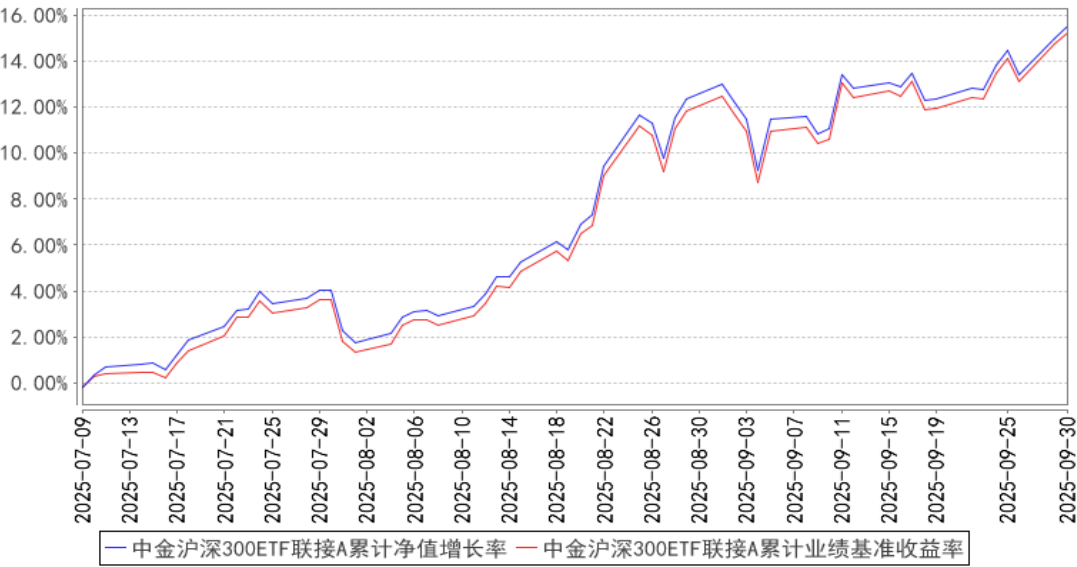
中金沪深 300ETF 联接 C

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

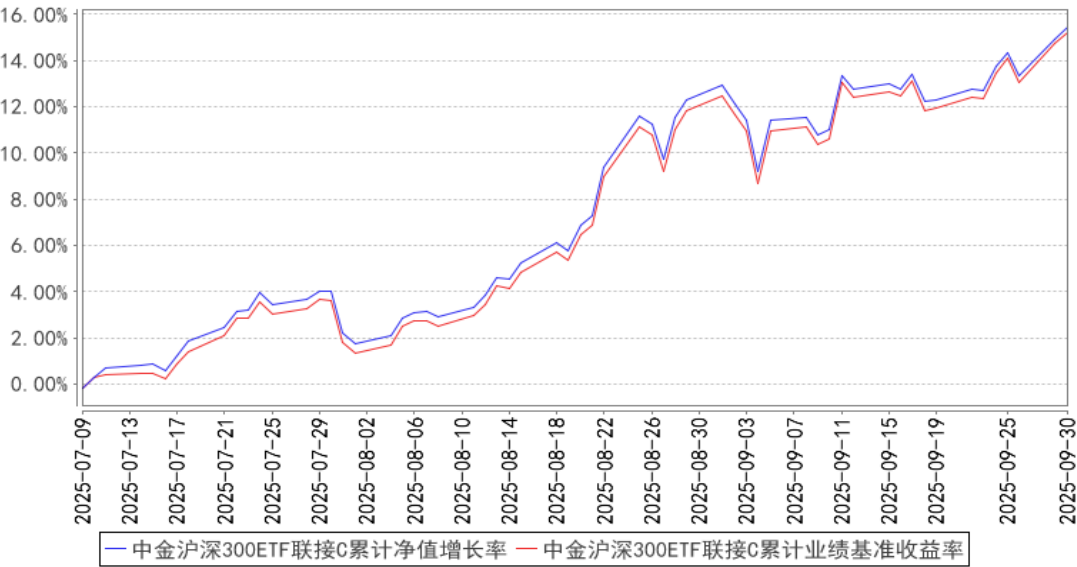
自基金合同 生效起至今	15.42%	0.82%	15.22%	0.84%	0.20%	-0.02%
----------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

3.2.2 自基金转型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

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



中金沪深300ETF联接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



注：1、本基金的基金合同生效日为 2025 年 07 月 09 日，按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

2、本基金于 2025 年 07 月 09 日转型为中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金沪深 300 指数 A

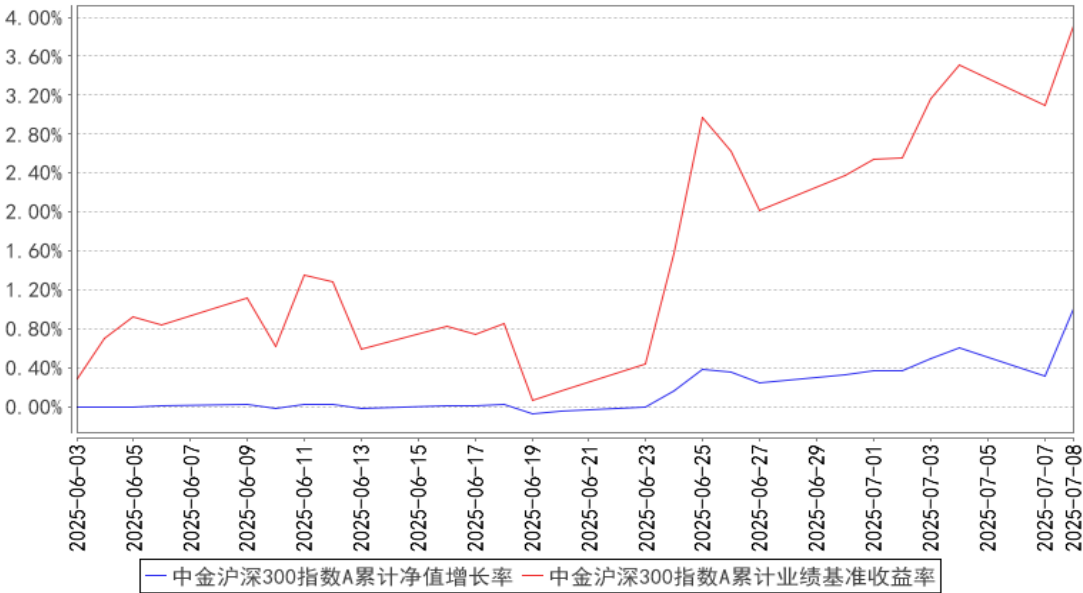
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效起至今	1.00%	0.16%	3.91%	0.52%	-2.91%	-0.36%

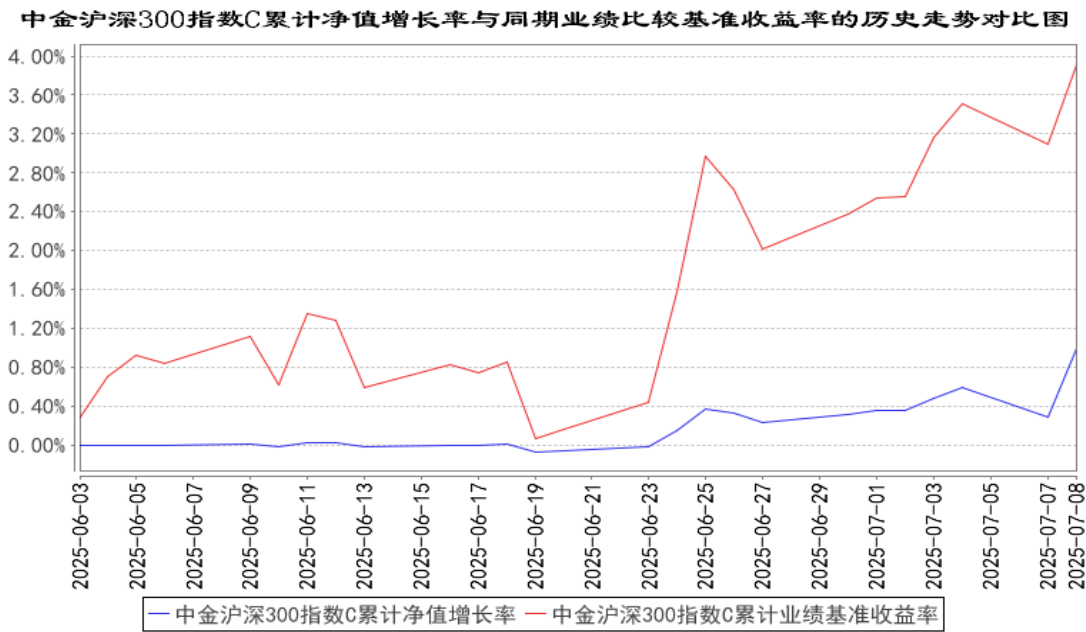
中金沪深 300 指数 C

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
自基金合同生效起至今	0.99%	0.16%	3.91%	0.52%	-2.92%	-0.36%

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

中金沪深300指数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





§ 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		
刘重晋	本基金基金经理	2025 年 6 月 3 日	-	13 年	刘重晋先生，理学博士。历任松河投资咨询（深圳）有限公司副总经理、量化研究员。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人作出决定确定的任免日期填写；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金为 ETF 联接基金，跟踪沪深 300 指数表现，运作过程中将力争保持较高仓位，降低跟踪误差，以实现较好的指数跟踪效果。

2025 年三季度，全球贸易格局调整仍在持续，国内宏观政策发力不断显效，“投资于人”和“反内卷”等政策从供需两侧共同促进中国经济延续高质量发展态势。产业发展厚积薄发，科技创新成果更为市场所认知，新兴产业持续发展壮大，为经济结构转型提供强大动力。

在此背景下，中国资本市场整体风险溢价水平系统性下降，投资者风险偏好普遍提高，A 股市场活跃度不断上升，科创、创业等板块引领市场整体不断创出近年新高。代表指数中，沪深 300、中证 500、中证 1000、科创 50、创业板指分别上涨 17.90%、25.31%、19.17%、49.02%、50.40%。风格方面，成长大幅战胜价值，中盘表现较为突出。行业方面，通信、电子、有色金属、电力设备及新能源、机械等涨幅相对较大，综合金融、银行、交通运输、公用事业、食品饮料等表现相对落后。

展望四季度，虽然全球贸易环境的不确定性短期内仍有可能对资产价格带来一定扰动，但从中长期角度来看，中国经济高质量发展的关键还是“办好自己的事”。“十五五”规划正受到市场密切关注，改革发展新规划有望引领中国经济发展新篇章，也有机会为挖掘 A 股市场未来长期主线提供更多基本面依据。我们将把更多精力放在具备长期价值的研究主题上，以高质量研究来赋能投资管理工作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前，截至 2025 年 07 月 08 日，原中金沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.0100 元，2025 年 07 月 01 日至 2025 年 07 月 08 日期间基金份额净值增长率为 1.00%；同期业绩比较基准收益率为 3.91%；原中金沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.0099 元，2025 年 07 月 01 日至 2025 年 07

月 08 日期间基金份额净值增长率为 0.99%；同期业绩比较基准收益率为 3.91%。转型后，截至 2025 年 09 月 30 日，中金沪深 300ETF 联接 A 基金份额净值为 1.1663 元，2025 年 07 月 09 日至 2025 年 09 月 30 日期间基金份额净值增长率为 15.48%，同期业绩比较基准收益率为 15.22%；中金沪深 300ETF 联接 C 基金份额净值为 1.1656 元，2025 年 07 月 09 日至 2025 年 09 月 30 日期间基金份额净值增长率为 15.42%，同期业绩比较基准收益率为 15.22%。

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（转型后）

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	44,169,360.48	89.71
3	固定收益投资	3,051,838.08	6.20
	其中：债券	3,051,838.08	6.20
	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	1,480,014.34	3.01
8	其他资产	536,870.49	1.09
9	合计	49,238,083.39	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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 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

本基金本报告期末未持有股票。

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	3,051,838.08	6.60
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	3,051,838.08	6.60

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	019696	23 国债 03	25,000	2,548,666.44	5.51
2	019773	25 国债 08	5,000	503,171.64	1.09

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。

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。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产 净值比例（%）
1	中金沪深 300 交 易型开放式指数 证券投资基金	股票型	交易型开放 式(ETF)	中金基金 管理有限 公司	44,169,360.48	95.51

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未持有股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期末，本基金未持有国债期货。

5.11.2 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。

5.11.3 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本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，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	536,870.49
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	536,870.49

5.12.4 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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 5 投资组合报告（转型前）

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	276,205,295.70	80.84
	其中：股票	276,205,295.70	80.84

2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	18,133,064.38	5.31
	其中：债券	18,133,064.38	5.31
	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	47,308,142.62	13.85
8	其他资产	2,133.82	0.00
9	合计	341,648,636.52	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	2,826,910.00	0.84
B	采矿业	13,924,169.00	4.14
C	制造业	135,431,622.20	40.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,176,802.96	3.02
E	建筑业	5,332,529.00	1.58
F	批发和零售业	662,161.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	9,741,855.00	2.89
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,877,783.00	3.82
J	金融业	76,771,943.54	22.80
K	房地产业	2,100,914.00	0.62
L	租赁和商务服务业	2,542,990.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	3,050,572.00	0.91
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	765,044.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	276,205,295.70	82.03

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

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

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 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	600036	招商银行	161,217	7,677,153.54	2.28
2	601318	中国平安	134,300	7,581,235.00	2.25
3	300750	宁德时代	28,300	7,451,673.00	2.21
4	600519	贵州茅台	5,000	7,080,550.00	2.10
5	601166	兴业银行	222,300	5,588,622.00	1.66
6	600900	长江电力	163,513	4,892,308.96	1.45
7	000333	美的集团	65,800	4,752,076.00	1.41
8	601899	紫金矿业	220,400	4,368,328.00	1.30
9	002594	比亚迪	12,200	3,987,936.00	1.18
10	300059	东方财富	169,000	3,912,350.00	1.16

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

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

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	18,133,064.38	5.39
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	18,133,064.38	5.39

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	019766	25 国债 01	65,000	6,529,650.68	1.94
2	019773	25 国债 08	65,000	6,521,387.67	1.94
3	019696	23 国债 03	50,000	5,082,026.03	1.51

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。

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。

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中，招商银行股份有限公司、紫金矿业股份有限公司本期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。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,133.82
6	其他应收款	—
7	其他	—

8	合计	2,133.82
---	----	----------

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的情况。

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的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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（转型后）

单位：份

项目	中金沪深 300ETF 联接 A	中金沪深 300ETF 联接 C
基金合同生效日(2025 年 7 月 9 日)基金份额总额	260,286,179.12	73,107,855.35
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,662,334.35	3,092,693.96
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	232,717,650.16	68,777,270.01
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	32,230,863.31	7,423,279.30

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	中金沪深 300 指数 A	中金沪深 300 指数 C
报告期期初基金份额总额	293,508,121.90	204,956,500.43
报告期期间基金总申购份额	15,206.76	63,153.23
减:报告期期间基金总赎回份额	33,237,149.54	131,911,798.31
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	260,286,179.12	73,107,855.35

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
- 3、《中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
- 4、《中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》
- 5、本基金申请募集注册的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、报告期内中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接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

9.2 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。

9.3 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

2025 年 10 月 28 日