

中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录..... 2

1.1 重要提示 2

1.2 目录 3

§ 2 基金简介..... 5

2.1 基金基本情况 5

2.2 基金产品说明 5

2.3 基金管理人和基金托管人 5

2.4 信息披露方式 6

2.5 其他相关资料 6

§ 3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6

3.2 基金净值表现 7

§ 4 管理人报告..... 7

4.1 基金管理人及基金经理情况 7

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 8

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 8

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 9

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 9

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 10

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 10

§ 5 托管人报告..... 10

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 10

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 10

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 11

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） 11

6.1 资产负债表 11

6.2 利润表 12

6.3 净资产变动表 14

6.4 报表附注 16

§ 7 投资组合报告..... 34

7.1 期末基金资产组合情况 34

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 35

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 35

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 47

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 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 49

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 49

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 49

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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
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	51
§ 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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	51
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§ 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 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中金中证 A500ETF
场内简称	A500 中金（扩位简称：A500ETF 中金）
基金主代码	512080
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 1 月 14 日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	596,186,062.00 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	2025 年 1 月 21 日

2.2 基金产品说明

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、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、股票期权投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、信用衍生品投资策略；9、可转换债券及可交换债券投资策略；10、参与融资与转融通证券出借业务投资策略。详见《中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中证 A500 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。

2.3 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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰	王茵
	联系电话	010-63211122	010-63639180
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	wangyin@cebbank.com

客户服务电话	400-868-1166	95595
传真	010-66159121	010-63639132
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号 中国光大中心
邮政编码	100004	100033
法定代表人	李金泽	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	110,488,978.66
本期利润	112,248,311.10
加权平均基金份额本期利润	0.1787
本期加权平均净值利润率	13.36%
本期基金份额净值增长率	12.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	215,489,191.76
期末可供分配基金份额利润	0.3614
期末基金资产净值	855,206,517.78
期末基金份额净值	1.4345
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	43.45%

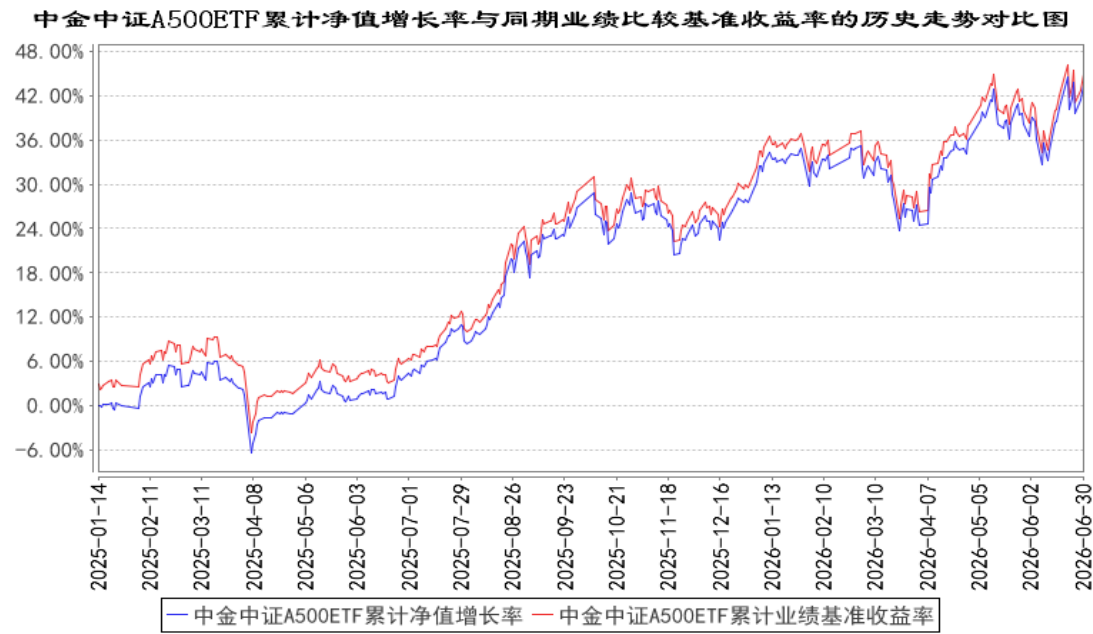
- 注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
- 2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；
- 3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数。

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	14.76%	1.38%	14.26%	1.41%	0.50%	-0.03%
过去六个月	12.43%	1.27%	11.91%	1.29%	0.52%	-0.02%
过去一年	37.76%	1.13%	36.38%	1.14%	1.38%	-0.01%
自基金合同生效起至今	43.45%	1.10%	44.90%	1.13%	-1.45%	-0.03%

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



注：本基金的基金合同生效日为 2025 年 01 月 14 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。建仓期结束时本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 10 亿元人民币。母公司中金公司致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基

金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 79 只公募基金，证券投资基金管理规模 2,772.40 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘重晋	本基金基金经理	2025 年 1 月 14 日	-	14 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。
张传捷	本基金基金经理助理	2025 年 9 月 22 日	-	9 年	张传捷先生，经济学硕士。历任中证指数有限公司研究员；嘉实基金管理有限公司指数投资部研究员；中金基金管理有限公司量化指数部研究员、基金经理助理。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。

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

2、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

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，采用完全复制中证 A500 指数的策略，即按照标的指数的成份股构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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金的份额净值为 1.4345 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.43%，业绩比较基准收益率为 11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，国内经济延续复苏势头，总量稳中有进，结构向新向优；全球经济依然冷热不均，地缘冲突频扰，AI 投资火热。在此背景下，A 股市场整体呈现出“中枢抬高、波动增加、风格分化、科技突出”的特征。一季度，A 股市场在估值消化需要和外部事件冲击综合作用下，经历了冲高、整固、回落的过程，市场风格表现也随投资者风险偏好波动快速切换，从年初的成长领涨转向季末的价值占优。进入二季度，地缘冲击烈度逐渐降级，风险资产的波动率中枢下行，资本市场风险偏好抬升，权益市场对基本面景气更加追逐，A 股呈现鲜明的结构性行情，科技成长主线贯穿始终，而传统周期与内需消费板块相对疲软。

上半年，沪深 300、中证 500、中证 1000、科创 50、创业板指等代表指数分别录得 7.55%、20.97%、15.99%、64.25%、35.58% 的涨幅。风格方面，成长显著跑赢价值，中小市值相对大盘占优，微盘风格表现落后。行业方面，电子、通信、建材、基础化工和机械等板块涨幅居前，消费者服务、综合金融、综合、农林牧渔和商贸零售等板块表现承压。

展望未来，国内政策端有望保持“总量适度宽松，发力更加精准”的基调，兼顾发挥存量政策效能和谋划出台增量政策，宏观经济将有较大概率延续“总量稳健、结构优化”的特征。权益市场层面，经历近期“全球共振式”快速调整后，A 股市场估值水平有明显回落，考虑到国内无风险收益率仍处在历史低位区域，A 股市场中长期配置价值进一步提升。结构方面，市场整体风格在叙事新变化和资金再平衡等综合作用下有望进一步趋于均衡，将为自下而上选股类投资者

提供更为广阔的选股空间。

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，本基金本报告期末未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金

管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。
该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

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

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、准确、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 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	22,081,245.42	19,597,031.36
结算备付金		3,028,223.90	5,005,695.18
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	835,997,316.76	1,149,078,005.33
其中：股票投资		835,997,316.76	1,149,078,005.33
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		3,596,266.74	1,126,497.24
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		864,703,052.82	1,174,807,229.11

负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		86,268.53	127,439.96
应付托管费		28,756.17	42,480.03
应付销售服务费		-	-
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	9,381,510.34	8,226,581.04
负债合计		9,496,535.04	8,396,501.03
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	596,186,062.00	914,186,062.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	259,020,455.78	252,224,666.08
净资产合计		855,206,517.78	1,166,410,728.08
负债和净资产总计		864,703,052.82	1,174,807,229.11

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4345 元，基金份额总额 596,186,062.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 14 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		113,170,155.40	63,342,525.18
1. 利息收入		30,622.54	293,603.31
其中：存款利息收入	6.4.7.13	30,622.54	293,603.31
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）		111,161,514.07	31,863,062.25
其中：股票投资收益	6.4.7.14	104,933,902.85	14,634,712.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
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	6,227,611.22	17,228,349.74
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	1,759,332.44	30,184,187.75
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	218,686.35	1,001,671.87
减：二、营业总支出		921,844.30	1,568,635.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	627,464.44	1,110,254.95
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	209,154.81	370,085.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
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	85,225.05	88,295.76
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		112,248,311.10	61,773,889.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		112,248,311.10	61,773,889.47
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		112,248,311.10	61,773,889.47

6.3 净资产变动表

会计主体：中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	914,186,062.00	-	252,224,666.08	1,166,410,728.08
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	914,186,062.00	-	252,224,666.08	1,166,410,728.08
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-318,000,000.00	-	6,795,789.70	-311,204,210.30
（一）、综合收益总额	-	-	112,248,311.10	112,248,311.10
（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）	-318,000,000.00	-	-105,452,521.40	-423,452,521.40
其中：1. 基金申购款	180,000,000.00	-	69,146,487.09	249,146,487.09
2. 基金赎回款	-498,000,000.00	-	-174,599,008.49	-672,599,008.49
（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	596,186,062.00	-	259,020,455.78	855,206,517.78
项目	上年度可比期间			
	2025 年 1 月 14 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,991,186,062.00	-	-	1,991,186,062.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-531,000,000.00	-	60,355,310.96	-470,644,689.04
（一）、综合收益总额	-	-	61,773,889.47	61,773,889.47
（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）	-531,000,000.00	-	-1,418,578.51	-532,418,578.51
其中：1. 基金申购款	996,000,000.00	-	23,880,319.25	1,019,880,319.25
2. 基金赎回款	-1,527,000,000.00	-	-25,298,897.76	-1,552,298,897.76
（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	1,460,186,062.00	-	60,355,310.96	1,520,541,372.96

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>	二	<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 A500 交易型开放式指数证券投资基金(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 2024 年 12 月 4 日证监许可[2024]1759 号《关于中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为交易型开放式股票型基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金,托管人为中国光大银行股份有限公司(以下简称“光大银行”)。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司等共同销售,募集期为 2024 年 12 月 18 日至 2025 年 1 月 9 日。经向中国证监会备案,《中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2025 年 1 月 14 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 1,991,186,062.00 份(含利息转份额 178,062.00 份),发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由信永中和会计师事务所(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 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成份股(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、股指期货、国债期货、股票期权、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券)、资产支持证券、信用衍生品、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、现金等,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的相关规定。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证

券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	5,668,773.14
等于：本金	5,668,183.87
加：应计利息	589.27
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	16,412,472.28
等于：本金	16,412,437.68
加：应计利息	34.60
减：坏账准备	-
合计	22,081,245.42

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	719,249,954.37	-	835,997,316.76	116,747,362.39
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	719,249,954.37	-	835,997,316.76	116,747,362.39

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

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	85,225.05
应退替代款	8,027,788.74
可退替代款	1,242,707.05
其他	25,789.50
合计	9,381,510.34

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	914,186,062.00	914,186,062.00
本期申购	180,000,000.00	180,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-498,000,000.00	-498,000,000.00
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	596,186,062.00	596,186,062.00

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	172,303,450.49	79,921,215.59	252,224,666.08
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	172,303,450.49	79,921,215.59	252,224,666.08
本期利润	110,488,978.66	1,759,332.44	112,248,311.10
本期基金份额交易产生的变动数	-67,303,237.39	-38,149,284.01	-105,452,521.40
其中：基金申购款	60,587,041.53	8,559,445.56	69,146,487.09

基金赎回款	-127,890,278.92	-46,708,729.57	-174,599,008.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	215,489,191.76	43,531,264.02	259,020,455.78

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,799.59
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,294.23
结算备付金利息收入	22,528.72
其他	-
合计	30,622.54

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	72,100,859.27
股票投资收益——赎回差价收入	32,833,043.58
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	104,933,902.85

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	424,951,429.62
减：卖出股票成本总额	352,466,628.55
减：交易费用	383,941.80
买卖股票差价收入	72,100,859.27

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	672,599,008.49
减：现金支付赎回款总额	328,212,972.49
减：赎回股票成本总额	311,552,992.42
减：交易费用	-
赎回差价收入	32,833,043.58

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无股票申购差价收入。

6.4.7.14.5 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

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,227,611.22
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	6,227,611.22

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,759,332.44
股票投资	1,759,332.44
债券投资	-
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	1,759,332.44

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	218,686.35
合计	218,686.35

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	25,717.68
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	85,225.05

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金销售机构
光大银行	基金托管人
中国国际金融股份有限公司（以下简称“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（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
中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月14日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
中金财富证券	659,299,925.62	100.00	3,369,085,670.10	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中金财富证券	129,168.43	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月14日（基金合同生效日）至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中金财富证券	660,084.35	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的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。该类佣金协议已根据此规定完成了更新。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 14 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	627,464.44	1,110,254.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	24,268.49	46,161.81
应支付基金管理人的净管理费	603,195.95	1,064,093.14

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 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：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 14 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	209,154.81	370,085.00

注：支付基金托管人光大银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

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固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	58,819,956.00	9.87	57,082,524.00	6.24
中金中证 A500ETF联接	62,863,000.00	10.54	97,755,100.00	10.69

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 14 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	5,668,773.14	6,799.59	5,384,019.32	161,458.33
中金财富证券	16,412,472.28	1,294.23	17,116,666.37	22,928.73

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

2、本基金的证券交易结算资金存放在基金证券经纪商中金财富证券的基金专用证券账户，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13	890.99	4,600	1,371,616.06	3,827,200.00	-

		日			日					
--	--	---	--	--	---	--	--	--	--	--

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 2026 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 2026 年 06 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 2026 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

本基金属于股票指数型基金，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，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。本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场

利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	22,080,621.55	-	-	623.87	22,081,245.42
结算备付金	3,027,468.20	-	-	755.70	3,028,223.90
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	835,997,316.76	835,997,316.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	3,596,266.74	3,596,266.74
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,108,089.75	-	-	839,594,963.07	864,703,052.82
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	86,268.53	86,268.53
应付托管费	-	-	-	28,756.17	28,756.17
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	9,381,510.34	9,381,510.34
负债总计	-	-	-	9,496,535.04	9,496,535.04
利率敏感度缺口	25,108,089.75	-	-	830,098,428.03	855,206,517.78
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	19,596,274.94	-	-	756.42	19,597,031.36
结算备付金	5,004,305.56	-	-	1,389.62	5,005,695.18
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	1,149,078,005.33	1,149,078,005.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,126,497.24	1,126,497.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,600,580.50	-	-	1,150,206,648.61	1,174,807,229.11
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	127,439.96	127,439.96
应付托管费	-	-	-	42,480.03	42,480.03
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	8,226,581.04	8,226,581.04
负债总计	-	-	-	8,396,501.03	8,396,501.03
利率敏感度缺口	24,600,580.50	-	-	-1,141,810,147.58	1,166,410,728.08

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

本期末本基金未持有交易性债券投资（不含可转换债券、可交换债券）和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（上年度末：同）

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	835,997,316.76	97.75	1,149,078,005.33	98.51
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	835,997,316.76	97.75	1,149,078,005.33	98.51

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	42,332,722.63	-
	业绩比较基准下降5%	-42,332,722.63	-

注：于上年度末，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	832,170,116.76	1,142,962,116.81

第二层次	3,827,200.00	6,115,888.52
第三层次	—	—
合计	835,997,316.76	1,149,078,005.33

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	835,997,316.76	96.68
	其中：股票	835,997,316.76	96.68
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	25,109,469.32	2.90
8	其他各项资产	3,596,266.74	0.42

9	合计	864,703,052.82	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	2,690,038.00	0.31
B	采矿业	34,640,138.70	4.05
C	制造业	591,670,542.27	69.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,416,364.00	2.15
E	建筑业	10,264,092.58	1.20
F	批发和零售业	6,775,701.60	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	18,947,822.00	2.22
H	住宿和餐饮业	409,808.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,679,039.52	5.22
J	金融业	81,155,983.65	9.49
K	房地产业	4,700,228.00	0.55
L	租赁和商务服务业	6,062,546.20	0.71
M	科学研究和技术服务业	9,983,320.00	1.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,457,387.60	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	281,160.00	0.03
Q	卫生和社会工作	1,679,088.64	0.20
R	文化、体育和娱乐业	643,680.00	0.08
S	综合	1,540,376.00	0.18
	合计	835,997,316.76	97.75

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

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	27,400	34,798,000.00	4.07
2	300750	宁德时代	66,300	26,056,563.00	3.05
3	300502	新易盛	35,792	21,725,744.00	2.54
4	600519	贵州茅台	16,200	19,204,938.00	2.25
5	603986	兆易创新	17,100	13,936,500.00	1.63
6	601318	中国平安	270,800	12,927,992.00	1.51
7	688256	寒武纪	7,148	11,404,991.40	1.33
8	600036	招商银行	313,900	11,143,450.00	1.30
9	002371	北方华创	11,875	10,504,150.00	1.23
10	601899	紫金矿业	417,400	10,493,436.00	1.23
11	000333	美的集团	122,700	9,267,531.00	1.08
12	002475	立讯精密	130,200	9,166,080.00	1.07
13	688041	海光信息	24,020	8,894,606.00	1.04
14	688008	澜起科技	28,527	8,840,517.30	1.03
15	002384	东山精密	33,200	8,710,020.00	1.02
16	600900	长江电力	309,100	8,181,877.00	0.96
17	000725	京东方 A	921,600	7,999,488.00	0.94
18	688012	中微公司	17,016	7,971,996.00	0.93
19	688981	中芯国际	49,354	7,838,402.28	0.92
20	603259	药明康德	62,300	7,756,973.00	0.91
21	600183	生益科技	41,600	7,213,440.00	0.84
22	600030	中信证券	248,305	7,133,802.65	0.83
23	601166	兴业银行	429,500	7,112,520.00	0.83
24	300059	东方财富	320,300	6,527,714.00	0.76
25	600276	恒瑞医药	113,700	5,916,948.00	0.69
26	300274	阳光电源	37,100	5,899,642.00	0.69
27	601398	工商银行	820,800	5,803,056.00	0.68
28	300408	三环集团	34,600	5,774,740.00	0.68
29	002594	比亚迪	69,900	5,571,030.00	0.65
30	600487	亨通光电	50,900	5,565,406.00	0.65
31	300476	胜宏科技	15,900	5,508,237.00	0.64
32	002463	沪电股份	34,700	5,302,160.00	0.62
33	300394	天孚通信	16,892	5,112,870.56	0.60
34	601211	国泰海通	273,700	4,981,340.00	0.58
35	600176	中国巨石	67,200	4,897,536.00	0.57
36	000988	华工科技	24,900	4,596,789.00	0.54
37	601288	农业银行	728,800	4,423,816.00	0.52
38	601328	交通银行	677,400	4,355,682.00	0.51
39	000651	格力电器	114,100	4,278,750.00	0.50
40	600522	中天科技	70,200	4,259,736.00	0.50
41	688525	佰维存储	8,600	4,254,678.00	0.50
42	688498	源杰科技	2,200	4,149,200.00	0.49

43	300604	长川科技	12,100	4,131,182.00	0.48
44	301308	江波龙	5,800	4,082,040.00	0.48
45	603019	中科曙光	37,400	4,010,402.00	0.47
46	600150	中国船舶	114,963	3,884,599.77	0.45
47	603993	洛阳钼业	221,000	3,878,550.00	0.45
48	600887	伊利股份	160,000	3,833,600.00	0.45
49	688072	拓荆科技	4,600	3,827,200.00	0.45
50	600584	长电科技	36,600	3,789,930.00	0.44
51	000858	五 粮 液	50,200	3,714,800.00	0.43
52	000338	潍柴动力	136,300	3,714,175.00	0.43
53	688521	芯原股份	9,600	3,562,944.00	0.42
54	601816	京沪高铁	745,200	3,375,756.00	0.39
55	002281	光迅科技	13,000	3,340,220.00	0.39
56	300857	协创数据	9,800	3,331,020.00	0.39
57	600309	万华化学	46,800	3,201,588.00	0.37
58	002415	海康威视	93,600	3,201,120.00	0.37
59	688347	华虹宏力	9,400	3,161,220.00	0.37
60	300124	汇川技术	47,100	3,124,143.00	0.37
61	002008	大族激光	20,800	3,122,288.00	0.37
62	600111	北方稀土	63,600	3,055,980.00	0.36
63	000063	中兴通讯	81,500	2,949,485.00	0.34
64	600000	浦发银行	337,700	2,907,597.00	0.34
65	688120	华海清科	9,020	2,906,063.60	0.34
66	600089	特变电工	129,100	2,904,750.00	0.34
67	300136	信维通信	24,000	2,862,000.00	0.33
68	601857	中国石油	329,100	2,856,588.00	0.33
69	300475	香农芯创	9,500	2,850,000.00	0.33
70	002916	深南电路	6,210	2,843,559.00	0.33
71	002028	思源电气	16,200	2,802,600.00	0.33
72	000100	TCL 科技	481,500	2,802,330.00	0.33
73	300433	蓝思科技	51,300	2,752,758.00	0.32
74	601088	中国神华	70,500	2,752,320.00	0.32
75	300223	君正股份	10,800	2,688,120.00	0.31
76	600031	三一重工	151,200	2,612,736.00	0.31
77	300014	亿纬锂能	38,640	2,512,759.20	0.29
78	002050	三花智控	57,000	2,498,310.00	0.29
79	000001	平安银行	246,800	2,480,340.00	0.29
80	002714	牧原股份	70,200	2,456,298.00	0.29
81	601601	中国太保	86,100	2,455,572.00	0.29
82	002353	杰瑞股份	16,000	2,440,000.00	0.29
83	000792	盐湖股份	80,400	2,427,276.00	0.28
84	002156	通富微电	31,600	2,397,492.00	0.28
85	600406	国电南瑞	101,400	2,316,990.00	0.27

86	601668	中国建筑	525,200	2,279,368.00	0.27
87	600549	厦门钨业	26,200	2,232,240.00	0.26
88	002436	兴森科技	42,700	2,175,565.00	0.25
89	000657	中钨高新	22,700	2,172,844.00	0.25
90	300760	迈瑞医疗	15,800	2,146,114.00	0.25
91	002602	世纪华通	150,300	2,119,230.00	0.25
92	601919	中远海控	158,900	2,107,014.00	0.25
93	601988	中国银行	363,900	2,081,508.00	0.24
94	300054	鼎龙股份	19,400	2,055,818.00	0.24
95	601728	中国电信	393,100	2,040,189.00	0.24
96	600660	福耀玻璃	40,200	2,027,688.00	0.24
97	603501	豪威集团	21,300	2,020,305.00	0.24
98	601012	隆基绿能	153,900	2,019,168.00	0.24
99	601225	陕西煤业	98,300	2,000,405.00	0.23
100	600160	巨化股份	37,100	1,966,671.00	0.23
101	600690	海尔智家	95,500	1,949,155.00	0.23
102	002230	科大讯飞	47,700	1,948,068.00	0.23
103	600941	中国移动	22,600	1,946,538.00	0.23
104	002352	顺丰控股	60,700	1,897,482.00	0.22
105	601985	中国核电	209,600	1,892,688.00	0.22
106	002851	麦格米特	11,300	1,889,134.00	0.22
107	002709	天赐材料	36,600	1,882,338.00	0.22
108	600460	士兰微	34,400	1,880,304.00	0.22
109	002938	鹏鼎控股	17,800	1,875,764.00	0.22
110	603799	华友钴业	38,600	1,862,836.00	0.22
111	002460	赣锋锂业	27,800	1,818,120.00	0.21
112	000977	浪潮信息	25,500	1,785,000.00	0.21
113	300442	润泽科技	20,700	1,719,549.00	0.20
114	300661	圣邦股份	11,880	1,704,542.40	0.20
115	000425	徐工机械	208,400	1,685,956.00	0.20
116	688777	中控技术	14,254	1,674,845.00	0.20
117	300757	罗博特科	2,700	1,671,300.00	0.20
118	600028	中国石化	369,700	1,648,862.00	0.19
119	300346	南大光电	17,780	1,647,317.00	0.19
120	601600	中国铝业	200,400	1,647,288.00	0.19
121	300033	同花顺	6,820	1,643,620.00	0.19
122	600938	中国海油	60,500	1,642,575.00	0.19
123	688126	沪硅产业	40,475	1,614,547.75	0.19
124	601766	中国中车	309,200	1,607,840.00	0.19
125	601872	招商轮船	90,300	1,586,571.00	0.19
126	600050	中国联通	396,200	1,584,800.00	0.19
127	002466	天齐锂业	25,600	1,569,792.00	0.18
128	002080	中材科技	17,300	1,557,000.00	0.18

129	002049	紫光国微	17,500	1,553,125.00	0.18
130	300395	菲利华	11,600	1,551,268.00	0.18
131	002837	英维克	19,350	1,539,486.00	0.18
132	002202	金风科技	64,100	1,531,990.00	0.18
133	601100	恒立液压	14,200	1,527,352.00	0.18
134	000938	紫光股份	52,900	1,526,694.00	0.18
135	002179	中航光电	33,000	1,524,600.00	0.18
136	002138	顺络电子	20,300	1,483,930.00	0.17
137	002185	华天科技	66,400	1,481,384.00	0.17
138	601628	中国人寿	41,700	1,474,095.00	0.17
139	002600	领益智造	84,900	1,472,166.00	0.17
140	000568	泸州老窖	18,800	1,457,376.00	0.17
141	605117	德业股份	13,672	1,451,692.96	0.17
142	300567	精测电子	4,500	1,429,200.00	0.17
143	300390	天华新能	15,200	1,421,352.00	0.17
144	002241	歌尔股份	62,600	1,410,378.00	0.16
145	600879	航天电子	66,100	1,407,269.00	0.16
146	603288	海天味业	42,000	1,392,720.00	0.16
147	002407	多氟多	27,700	1,391,371.00	0.16
148	601006	大秦铁路	301,800	1,391,298.00	0.16
149	000408	藏格矿业	19,900	1,379,468.00	0.16
150	601658	邮储银行	279,100	1,375,963.00	0.16
151	600905	三峡能源	364,200	1,351,182.00	0.16
152	600489	中金黄金	74,200	1,339,310.00	0.16
153	688002	睿创微纳	8,600	1,330,334.00	0.16
154	600893	航发动力	34,400	1,318,896.00	0.15
155	002625	光启技术	43,200	1,309,824.00	0.15
156	300037	新宙邦	14,100	1,309,185.00	0.15
157	601888	中国中免	24,200	1,299,782.00	0.15
158	000630	铜陵有色	203,700	1,295,532.00	0.15
159	688469	芯联集成	121,800	1,292,298.00	0.15
160	600673	东阳光	38,200	1,282,756.00	0.15
161	600010	宝钢股份	572,300	1,276,229.00	0.15
162	600118	中国卫星	15,500	1,271,775.00	0.15
163	300058	蓝色光标	91,720	1,262,067.20	0.15
164	601127	赛力斯	20,600	1,261,750.00	0.15
165	002027	分众传媒	256,300	1,240,492.00	0.15
166	605589	圣泉集团	19,500	1,239,615.00	0.14
167	688017	绿的谐波	2,936	1,226,836.96	0.14
168	600019	宝钢股份	221,100	1,200,573.00	0.14
169	000426	兴业银锡	36,400	1,199,744.00	0.14
170	000807	云铝股份	53,400	1,182,276.00	0.14
171	688396	华润微	12,051	1,175,575.05	0.14

172	601689	拓普集团	20,800	1,173,536.00	0.14
173	002273	水晶光电	32,300	1,146,004.00	0.13
174	600760	中航沈飞	27,760	1,140,936.00	0.13
175	600104	上汽集团	116,700	1,138,992.00	0.13
176	600989	宝丰能源	56,000	1,138,480.00	0.13
177	600362	江西铜业	26,200	1,134,460.00	0.13
178	601168	西部矿业	41,800	1,134,452.00	0.13
179	688271	联影医疗	11,200	1,133,776.00	0.13
180	688111	金山办公	5,300	1,129,165.00	0.13
181	601727	上海电气	160,000	1,120,000.00	0.13
182	600875	东方电气	38,800	1,116,276.00	0.13
183	002001	新 和 成	39,000	1,108,380.00	0.13
184	600885	宏发股份	32,020	1,104,369.80	0.13
185	600988	赤峰黄金	41,800	1,100,176.00	0.13
186	300450	先导智能	27,000	1,099,440.00	0.13
187	600667	太极实业	37,031	1,080,564.58	0.13
188	300782	卓胜微	9,860	1,080,458.80	0.13
189	601390	中国中铁	259,100	1,080,447.00	0.13
190	300751	迈为股份	3,800	1,073,348.00	0.13
191	600392	盛和资源	35,800	1,065,766.00	0.12
192	002126	银轮股份	21,300	1,060,740.00	0.12
193	600795	国电电力	226,900	1,059,623.00	0.12
194	000538	云南白药	22,320	1,057,298.40	0.12
195	002422	科伦药业	27,400	1,055,448.00	0.12
196	000831	中国稀土	19,000	1,054,310.00	0.12
197	000960	锡业股份	24,500	1,045,905.00	0.12
198	600547	山东黄金	45,200	1,043,668.00	0.12
199	600418	江淮汽车	40,000	1,033,200.00	0.12
200	002812	恩捷股份	15,400	1,030,414.00	0.12
201	600585	海螺水泥	60,600	1,027,170.00	0.12
202	601669	中国电建	218,500	1,026,950.00	0.12
203	300316	晶盛机电	17,000	1,026,800.00	0.12
204	301358	湖南裕能	13,500	1,024,245.00	0.12
205	600096	云天化	33,000	1,003,200.00	0.12
206	688099	晶晨股份	9,700	998,130.00	0.12
207	600141	兴发集团	21,200	995,764.00	0.12
208	002648	卫星化学	42,200	991,278.00	0.12
209	002738	中矿资源	16,700	985,133.00	0.12
210	002129	TCL 中环	81,950	985,039.00	0.12
211	300015	爱尔眼科	118,100	975,506.00	0.11
212	600346	恒力石化	54,000	956,340.00	0.11
213	601179	中国西电	64,000	954,880.00	0.11
214	000066	中国长城	50,100	954,405.00	0.11

215	300803	指南针	10,400	953,368.00	0.11
216	601868	中国能建	355,800	949,986.00	0.11
217	002558	巨人网络	34,300	945,308.00	0.11
218	600497	驰宏锌锗	77,200	934,892.00	0.11
219	002195	岩山科技	142,700	933,258.00	0.11
220	600066	宇通客车	34,200	916,902.00	0.11
221	600482	中国动力	27,900	915,120.00	0.11
222	300418	昆仑万维	22,400	904,064.00	0.11
223	600426	华鲁恒升	37,700	901,784.00	0.11
224	000625	长安汽车	125,100	896,967.00	0.10
225	600580	卧龙电驱	27,000	893,700.00	0.10
226	600157	永泰能源	553,500	891,135.00	0.10
227	600221	海航控股	652,900	881,415.00	0.10
228	002532	天山铝业	81,900	878,787.00	0.10
229	000157	中联重科	124,700	869,159.00	0.10
230	600895	张江高科	23,200	864,200.00	0.10
231	002340	格林美	130,400	861,944.00	0.10
232	600711	盛屯矿业	78,000	855,660.00	0.10
233	600011	华能国际	112,400	853,116.00	0.10
234	600143	金发科技	54,900	848,205.00	0.10
235	600438	通威股份	69,800	845,278.00	0.10
236	000933	神火股份	39,800	843,760.00	0.10
237	002236	大华股份	50,800	837,692.00	0.10
238	600048	保利发展	180,900	837,567.00	0.10
239	300438	鹏辉能源	10,100	836,785.00	0.10
240	600026	中远海能	46,300	830,622.00	0.10
241	600115	中国东航	216,600	825,246.00	0.10
242	002493	荣盛石化	76,300	820,225.00	0.10
243	002131	利欧股份	172,500	819,375.00	0.10
244	300017	网宿科技	62,900	818,329.00	0.10
245	600570	恒生电子	38,300	811,577.00	0.09
246	600886	国投电力	60,500	805,255.00	0.09
247	002456	欧菲光	84,700	801,262.00	0.09
248	601233	桐昆股份	36,600	792,390.00	0.09
249	600352	浙江龙盛	65,400	791,994.00	0.09
250	003816	中国广核	199,800	781,218.00	0.09
251	601360	三六零	89,400	776,886.00	0.09
252	300339	润和软件	20,100	774,051.00	0.09
253	688036	传音控股	13,100	772,245.00	0.09
254	601058	赛轮轮胎	66,200	763,286.00	0.09
255	605499	东鹏饮料	6,180	762,797.40	0.09
256	603659	璞泰来	26,300	760,859.00	0.09
257	000301	东方盛虹	66,000	755,700.00	0.09

258	600436	片仔癀	6,849	748,458.72	0.09
259	600009	上海机场	32,300	746,130.00	0.09
260	002821	凯莱英	4,600	745,200.00	0.09
261	600196	复星医药	33,100	743,757.00	0.09
262	300759	康龙化成	25,700	743,501.00	0.09
263	002555	三七互娱	39,300	741,591.00	0.09
264	002074	国轩高科	26,600	731,766.00	0.09
265	000768	中航西飞	35,700	731,136.00	0.09
266	002128	电投能源	31,000	716,720.00	0.08
267	300207	欣旺达	37,700	715,923.00	0.08
268	601111	中国国航	118,200	715,110.00	0.08
269	600415	小商品城	70,200	713,232.00	0.08
270	000975	山金国际	41,900	712,300.00	0.08
271	688047	龙芯中科	4,600	711,482.00	0.08
272	600674	川投能源	50,200	711,334.00	0.08
273	300001	特锐德	18,800	711,204.00	0.08
274	002595	豪迈科技	15,185	707,621.00	0.08
275	300458	全志科技	17,800	702,388.00	0.08
276	600219	南山铝业	175,600	700,644.00	0.08
277	002517	恺英网络	42,900	697,125.00	0.08
278	002601	龙佰集团	42,100	693,808.00	0.08
279	601186	中国铁建	116,500	693,175.00	0.08
280	600029	南方航空	133,400	691,012.00	0.08
281	601117	中国化学	93,600	687,960.00	0.08
282	301236	软通动力	16,200	687,690.00	0.08
283	688235	百济神州	2,700	687,447.00	0.08
284	688213	思特威	6,386	683,749.02	0.08
285	688578	艾力斯	6,200	677,040.00	0.08
286	600233	圆通速递	42,600	670,950.00	0.08
287	002432	九安医疗	9,400	664,392.00	0.08
288	601877	正泰电器	26,500	664,355.00	0.08
289	600372	中航机载	61,100	662,935.00	0.08
290	300347	泰格医药	13,800	662,400.00	0.08
291	688122	西部超导	10,500	659,505.00	0.08
292	300115	长盈精密	23,600	659,384.00	0.08
293	002472	双环传动	15,800	655,858.00	0.08
294	002465	海格通信	51,300	655,101.00	0.08
295	600839	四川长虹	93,800	654,724.00	0.08
296	300568	星源材质	34,800	651,456.00	0.08
297	002155	湖南黄金	27,020	644,967.40	0.08
298	300496	中科创达	10,400	642,616.00	0.08
299	000547	航天发展	33,300	637,695.00	0.07
300	000661	长春高新	9,500	632,700.00	0.07

301	300474	景嘉微	10,400	628,992.00	0.07
302	300024	机器人	32,400	626,292.00	0.07
303	002130	沃尔核材	32,800	621,888.00	0.07
304	600741	华域汽车	40,000	620,800.00	0.07
305	603979	金诚信	10,510	620,405.30	0.07
306	000733	振华科技	10,900	617,376.00	0.07
307	000963	华东医药	21,900	615,828.00	0.07
308	603129	春风动力	2,400	613,920.00	0.07
309	002497	雅化集团	29,900	609,063.00	0.07
310	002756	永兴材料	10,600	600,384.00	0.07
311	601021	春秋航空	13,000	592,540.00	0.07
312	001979	招商蛇口	91,900	590,917.00	0.07
313	000878	云南铜业	37,200	590,736.00	0.07
314	300012	华测检测	42,500	589,050.00	0.07
315	600226	亨通股份	60,300	578,277.00	0.07
316	603087	甘李药业	10,100	573,276.00	0.07
317	300073	当升科技	11,900	571,676.00	0.07
318	300083	创世纪	41,800	569,316.00	0.07
319	002444	巨星科技	18,300	569,130.00	0.07
320	002414	高德红外	42,900	568,854.00	0.07
321	000034	神州数码	20,480	568,320.00	0.07
322	300454	深信服	5,900	567,580.00	0.07
323	002271	东方雨虹	47,700	566,199.00	0.07
324	688506	百利天恒	1,900	558,657.00	0.07
325	000423	东阿阿胶	12,300	557,928.00	0.07
326	002920	德赛西威	6,800	554,200.00	0.06
327	300919	中伟新材	12,600	551,250.00	0.06
328	603650	彤程新材	5,600	548,688.00	0.06
329	603606	东方电缆	13,200	547,932.00	0.06
330	300748	金力永磁	17,600	542,960.00	0.06
331	601319	中国人保	80,300	542,828.00	0.06
332	601677	明泰铝业	32,200	534,520.00	0.06
333	002078	太阳纸业	42,100	525,829.00	0.06
334	688676	金盘科技	6,200	524,768.00	0.06
335	601615	明阳智能	45,300	524,121.00	0.06
336	300142	沃森生物	40,300	523,497.00	0.06
337	600699	均胜电子	24,200	522,962.00	0.06
338	688331	荣昌生物	4,000	521,040.00	0.06
339	601800	中国交建	90,700	517,897.00	0.06
340	000002	万科 A	174,100	515,336.00	0.06
341	600039	四川路桥	65,600	512,992.00	0.06
342	300432	富临精工	25,500	512,295.00	0.06
343	300866	安克创新	4,900	512,050.00	0.06

344	002252	上海莱士	117,000	507,780.00	0.06
345	603260	合盛硅业	10,300	497,078.00	0.06
346	688599	天合光能	34,769	490,938.28	0.06
347	688266	泽璟制药	4,200	489,972.00	0.06
348	300677	英科医疗	12,500	489,625.00	0.06
349	601633	长城汽车	32,400	488,916.00	0.06
350	300763	锦浪科技	5,400	487,890.00	0.06
351	002064	华峰化学	51,400	487,786.00	0.06
352	688223	晶科能源	102,650	487,587.50	0.06
353	002831	裕同科技	13,700	487,172.00	0.06
354	600588	用友网络	52,700	483,786.00	0.06
355	001965	招商公路	52,300	479,068.00	0.06
356	002025	航天电器	6,200	472,564.00	0.06
357	002294	信立泰	14,800	471,972.00	0.06
358	300832	新产业	11,000	462,000.00	0.05
359	603806	福斯特	27,500	461,725.00	0.05
360	688608	恒玄科技	2,760	461,444.40	0.05
361	300342	天银机电	9,800	460,600.00	0.05
362	000786	北新建材	25,400	459,486.00	0.05
363	600516	方大炭素	72,400	446,708.00	0.05
364	300724	捷佳伟创	6,300	444,780.00	0.05
365	600177	雅戈尔	58,900	443,517.00	0.05
366	688169	石头科技	4,668	443,319.96	0.05
367	000519	中兵红箭	21,000	442,470.00	0.05
368	601618	中国中冶	180,000	439,200.00	0.05
369	300699	光威复材	15,100	432,615.00	0.05
370	002176	江特电机	43,100	431,431.00	0.05
371	605090	九丰能源	11,500	427,455.00	0.05
372	601607	上海医药	27,500	423,500.00	0.05
373	688390	固德威	3,900	423,189.00	0.05
374	000617	中油资本	64,000	421,760.00	0.05
375	002085	万丰奥威	38,000	421,420.00	0.05
376	000623	吉林敖东	23,700	420,201.00	0.05
377	688180	君实生物	12,400	419,368.00	0.05
378	002318	久立特材	17,500	418,250.00	0.05
379	002459	晶澳科技	51,300	415,530.00	0.05
380	300251	光线传媒	37,400	414,766.00	0.05
381	600499	科达制造	30,000	414,000.00	0.05
382	002065	东华软件	57,400	409,836.00	0.05
383	600085	同仁堂	17,500	404,425.00	0.05
384	002223	鱼跃医疗	15,700	402,862.00	0.05
385	603596	伯特利	16,200	402,408.00	0.05
386	688472	阿特斯	37,138	401,833.16	0.05

387	000032	深桑达 A	16,000	399,200.00	0.05
388	002266	浙富控股	78,700	398,222.00	0.05
389	688188	柏楚电子	3,723	397,244.10	0.05
390	002044	美年健康	78,900	396,867.00	0.05
391	000400	许继电气	18,200	394,940.00	0.05
392	300003	乐普医疗	33,300	394,605.00	0.05
393	300409	道氏技术	19,700	392,621.00	0.05
394	688065	凯赛生物	8,200	392,370.00	0.05
395	600515	海南机场	143,200	392,368.00	0.05
396	302132	中航成飞	6,700	390,744.00	0.05
397	002405	四维图新	59,600	385,612.00	0.05
398	000999	华润三九	17,130	385,253.70	0.05
399	000415	渤海租赁	94,600	385,022.00	0.05
400	300972	万辰集团	2,200	381,502.00	0.04
401	600862	中航高科	21,100	380,433.00	0.04
402	603766	隆鑫通用	31,800	379,374.00	0.04
403	601216	君正集团	85,000	379,100.00	0.04
404	600521	华海药业	25,900	372,960.00	0.04
405	000683	博源化工	64,700	372,672.00	0.04
406	000039	中集集团	45,900	372,249.00	0.04
407	300558	贝达药业	5,700	370,899.00	0.04
408	600704	物产中大	78,500	370,520.00	0.04
409	600312	平高电气	20,700	365,562.00	0.04
410	600018	上港集团	77,300	364,856.00	0.04
411	300122	智飞生物	31,100	363,559.00	0.04
412	600803	新奥股份	23,000	363,400.00	0.04
413	000830	鲁西化工	30,229	362,748.00	0.04
414	600332	白云山	18,100	362,724.00	0.04
415	600323	瀚蓝环境	13,000	356,980.00	0.04
416	000887	中鼎股份	19,900	356,011.00	0.04
417	688005	容百科技	11,429	349,727.40	0.04
418	600166	福田汽车	119,800	348,618.00	0.04
419	688617	惠泰医疗	1,920	348,595.20	0.04
420	600765	中航重机	26,900	347,548.00	0.04
421	301550	斯菱智驱	3,800	347,434.00	0.04
422	600153	建发股份	43,200	342,576.00	0.04
423	002410	广联达	41,900	341,904.00	0.04
424	600316	洪都航空	11,800	329,692.00	0.04
425	002007	华兰生物	27,000	329,130.00	0.04
426	000967	盈峰环境	30,900	325,377.00	0.04
427	603605	珀莱雅	5,400	323,568.00	0.04
428	688116	天奈科技	8,400	320,880.00	0.04
429	603568	伟明环保	20,820	320,211.60	0.04

430	600529	山东药玻	17,200	317,340.00	0.04
431	600398	海澜之家	60,400	315,892.00	0.04
432	002389	航天彩虹	17,700	314,529.00	0.04
433	601000	唐山港	75,700	314,155.00	0.04
434	002603	以岭药业	20,900	313,500.00	0.04
435	000738	航发控制	17,000	310,930.00	0.04
436	688009	中国通号	65,300	310,828.00	0.04
437	601018	宁波港	97,900	308,385.00	0.04
438	600008	首创环保	112,900	307,088.00	0.04
439	600763	通策医疗	9,053	306,715.64	0.04
440	600208	衢州发展	107,700	304,791.00	0.04
441	600170	上海建工	136,500	303,030.00	0.04
442	601799	星宇股份	3,300	299,046.00	0.03
443	000932	华菱钢铁	85,600	297,032.00	0.03
444	300896	爱美客	3,400	296,480.00	0.03
445	688114	华大智造	5,800	296,264.00	0.03
446	600998	九州通	62,900	295,001.00	0.03
447	600820	隧道股份	56,300	293,323.00	0.03
448	603816	顾家家居	13,100	292,916.00	0.03
449	601238	广汽集团	56,700	288,036.00	0.03
450	603939	益丰药房	15,920	286,241.60	0.03
451	603392	万泰生物	10,600	285,882.00	0.03
452	600038	中直股份	11,300	285,777.00	0.03
453	300118	东方日升	22,900	285,105.00	0.03
454	600161	天坛生物	24,400	282,552.00	0.03
455	002607	中公教育	156,200	281,160.00	0.03
456	600486	扬农化工	5,500	278,850.00	0.03
457	603885	吉祥航空	26,900	276,801.00	0.03
458	300100	双林股份	9,900	275,022.00	0.03
459	600511	国药股份	10,500	273,420.00	0.03
460	601567	三星电气	18,200	271,908.00	0.03
461	603486	科沃斯	5,200	263,900.00	0.03
462	000833	粤桂股份	11,000	257,620.00	0.03
463	601880	辽港股份	186,300	257,094.00	0.03
464	688303	大全能源	14,600	254,478.00	0.03
465	600535	天士力	19,000	251,370.00	0.03
466	002244	滨江集团	32,700	248,520.00	0.03
467	688166	博瑞医药	7,000	245,070.00	0.03
468	600816	建元信托	99,100	241,804.00	0.03
469	300049	福瑞医科	6,100	237,168.00	0.03
470	300573	兴齐眼药	5,797	236,285.72	0.03
471	000998	隆平高科	31,000	233,740.00	0.03
472	002120	韵达股份	36,600	232,776.00	0.03

473	300676	华大基因	6,600	231,396.00	0.03
474	002544	普天科技	12,700	231,394.00	0.03
475	601155	新城控股	22,500	230,850.00	0.03
476	300457	赢合科技	10,900	229,772.00	0.03
477	300144	宋城演艺	39,400	228,914.00	0.03
478	600064	南京高科	31,600	225,308.00	0.03
479	600754	锦江酒店	12,400	223,076.00	0.03
480	601866	中远海发	98,500	217,685.00	0.03
481	603899	晨光股份	10,400	214,552.00	0.03
482	600635	大众公用	49,700	212,716.00	0.02
483	688063	派能科技	3,900	207,753.00	0.02
484	600655	豫园股份	50,300	206,733.00	0.02
485	000035	中国天楹	41,900	202,377.00	0.02
486	600663	陆家嘴	30,900	194,052.00	0.02
487	300601	康泰生物	17,100	193,914.00	0.02
488	600258	首旅酒店	17,100	186,732.00	0.02
489	600004	白云机场	25,600	185,856.00	0.02
490	600859	王府井	20,100	184,518.00	0.02
491	300070	碧水源	56,300	179,597.00	0.02
492	002091	江苏国泰	23,800	172,074.00	0.02
493	600864	哈投股份	32,400	168,156.00	0.02
494	000069	华侨城 A	101,100	165,804.00	0.02
495	301078	孩子王	21,900	148,044.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	22,400	146,944.00	0.02
497	600325	华发股份	56,500	130,515.00	0.02
498	603833	欧派家居	4,200	126,462.00	0.01
499	002891	中宠股份	4,500	120,240.00	0.01
500	002572	索菲亚	14,900	108,770.00	0.01

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

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

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	300750	宁德时代	10,645,423.66	0.91
2	300308	中际旭创	8,100,282.00	0.69
3	002371	北方华创	7,179,441.00	0.62
4	300502	新易盛	5,915,583.80	0.51
5	300394	天孚通信	4,262,007.40	0.37
6	000333	美的集团	3,519,692.00	0.30
7	600519	贵州茅台	3,225,298.00	0.28

8	688498	源杰科技	3,168,945.56	0.27
9	002384	东山精密	3,092,398.00	0.27
10	301308	江波龙	3,056,624.00	0.26
11	002475	立讯精密	2,975,648.84	0.26
12	688041	海光信息	2,884,378.48	0.25
13	688525	佰维存储	2,884,370.16	0.25
14	300857	协创数据	2,867,638.80	0.25
15	300476	胜宏科技	2,769,593.60	0.24
16	600183	生益科技	2,678,854.00	0.23
17	002594	比亚迪	2,668,781.00	0.23
18	300604	长川科技	2,357,630.00	0.20
19	300475	香农芯创	2,352,211.00	0.20
20	300223	君正股份	2,306,889.00	0.20

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	300750	宁德时代	25,417,650.75	2.18
2	300308	中际旭创	17,095,278.00	1.47
3	300502	新易盛	10,297,920.20	0.88
4	000333	美的集团	9,486,086.22	0.81
5	002371	北方华创	9,475,803.00	0.81
6	002475	立讯精密	7,009,853.70	0.60
7	002594	比亚迪	6,555,970.00	0.56
8	300059	东方财富	6,347,379.00	0.54
9	300394	天孚通信	5,947,446.80	0.51
10	688256	寒武纪	5,474,905.22	0.47
11	300476	胜宏科技	5,274,145.00	0.45
12	000858	五粮液	5,216,721.68	0.45
13	300274	阳光电源	5,138,534.36	0.44
14	002384	东山精密	4,219,515.00	0.36
15	000651	格力电器	3,991,136.00	0.34
16	000725	京东方 A	3,838,794.00	0.33
17	300124	汇川技术	3,783,969.00	0.32
18	002028	思源电气	3,529,548.00	0.30
19	000338	潍柴动力	3,293,305.00	0.28
20	300760	迈瑞医疗	3,159,055.73	0.27

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	234,348,496.00
卖出股票收入（成交）总额	424,951,429.62

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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中，招商银行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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-

2	应收清算款	3, 596, 266. 74
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3, 596, 266. 74

7. 12. 4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7. 12. 5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7. 12. 5. 1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中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

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

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

8. 1. 1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
761	783, 424. 52	556, 419, 962. 00	93. 33	39, 766, 100. 00	6. 67

8. 1. 2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
中金中证 A500ETF 联接基金	62, 863, 000. 00	10. 54

8. 2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0. 00	0. 0000

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 1 月 14 日） 基金份额总额	1, 991, 186, 062. 00
本报告期期初基金份额总额	914, 186, 062. 00
本报告期基金总申购份额	180, 000, 000. 00
减：本报告期基金总赎回份额	498, 000, 000. 00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	596, 186, 062. 00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况
本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况
本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本基金管理人在本报告期内未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本基金管理人相关从业人员在本报告期内未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本基金托管人在本报告期内未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本基金托管人相关从业人员在本报告期内未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中金财富证券	5	659,299,925.62	100.00	129,168.43	100.00	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

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

2、基金交易单元的选择程序如下：

- （1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- （2）本基金管理人和被选中的证券经营机构签订《交易单元租用协议》《证券综合服务协议》（注：被动股票型基金不通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用）。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)

中金财富证券	-	-	-	-	-	-
--------	---	---	---	---	---	---

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部分基金投资北交所股票及相关风险提示的公告	中国证监会规定媒介	2026-02-07
2	中金基金管理有限公司旗下部分基金增加一级交易商的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-19
3	中金基金管理有限公司关于新增基金直销账户的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-21
4	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-26
5	中金基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金估值调整情况的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-27

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、《中金中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 5、中金中证 A500 交易型开放式指数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 A500 交易型开放式指数证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：（86）010-63211122 400-868-1166

传真：（86）010-66159121

中金基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日