

中金中证 800 指数增强型证券投资基金 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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	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	11
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等内容真实、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	16
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50

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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
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	54
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 800 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中金中证 800 指数增强	
基金主代码	024870	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 9 月 10 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	75,945,317.96 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 800 指数增强 A	中金中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	024870	024871
报告期末下属分级 基金的份额总额	38,967,523.69 份	36,977,794.27 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对业绩比较基准进行有效跟踪的基础上，本基金通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资收益，力求基金资产的长期增值。
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，然后通过基本面与技术面等多种量化因子构建量化增强策略，并根据策略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、股票投资策略；2、债券投资策略；3、可转债投资策略；4、资产支持证券投资策略；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；8、存托凭证投资策略。详见《中金中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中证 800 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，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，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。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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰	滕菲菲
	联系电话	010-63211122	4006800000
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-868-1166	95558
传真		010-66159121	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100004	100020
法定代表人		李金泽	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告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(2026 年 1 月 1 日 – 2026 年 6 月 30 日)	
	中金中证 800 指数增强 A	中金中证 800 指数增强 C
本期已实现收益	10,928,876.50	8,621,932.81
本期利润	12,102,094.89	9,226,022.15
加权平均基金份 额本期利润	0.1727	0.1604
本期加权平均净 值利润率	16.12%	14.96%
本期基金份额净 值增长率	16.11%	15.88%
3.1.2 期末数	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	6,387,135.37	5,923,791.16
期末可供分配基金份额利润	0.1639	0.1602
期末基金资产净值	46,247,438.11	43,745,395.97
期末基金份额净值	1.1868	1.1830
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	18.68%	18.30%

- 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 800 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
过去三个月	18.03%	1.33%	13.02%	1.27%	5.01%	0.06%
过去六个月	16.11%	1.24%	10.59%	1.18%	5.52%	0.06%
自基金合同生效起至今	18.68%	1.12%	16.14%	1.09%	2.54%	0.03%

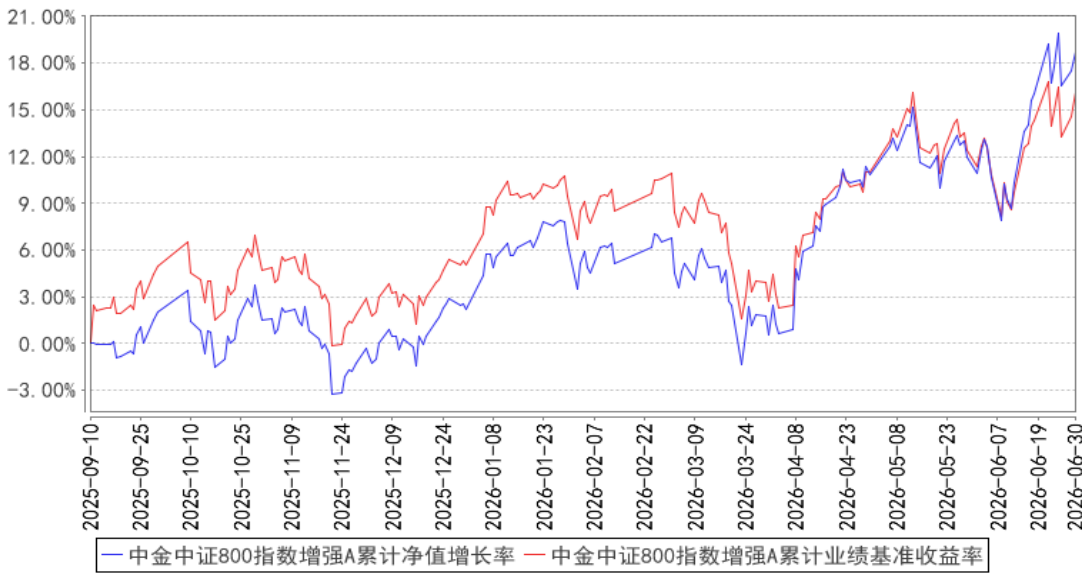
中金中证 800 指数增强 C

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
过去三个月	17.91%	1.33%	13.02%	1.27%	4.89%	0.06%
过去六个月	15.88%	1.24%	10.59%	1.18%	5.29%	0.06%
自基金合同生效起	18.30%	1.12%	16.14%	1.09%	2.16%	0.03%

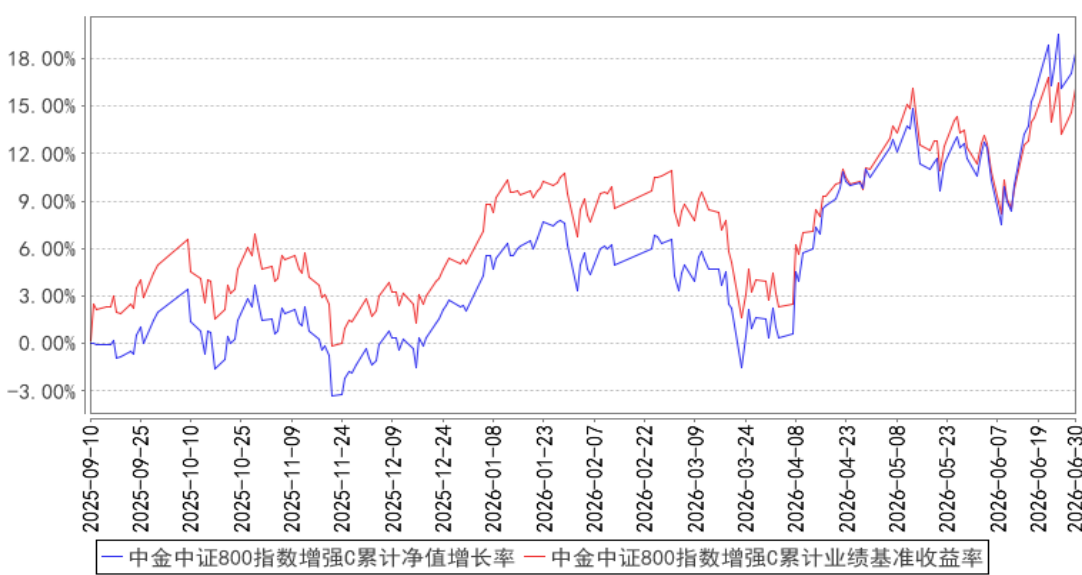
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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800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800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



注：本基金的基金合同生效日为 2025 年 09 月 10 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		
王阳峰	本基金基金经理	2025 年 9 月 10 日	-	12 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、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，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。

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。

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 800 指数增强 A 基金份额净值为 1.1868 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.11%，同期业绩基准收益率为 10.59%；中金中证 800 指数增强 C 基金份额净值为 1.1830

元，本报告期基金份额净值增长率为 15.88%，同期业绩基准收益率为 10.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。我们将持续在估值合理性与盈利确定性之间寻求平衡，积极挖掘结构性机会，并始终坚持以高质量研究赋能投资管理的工作范式。

在组合管理过程中，我们将更加注重在不确定性中寻找相对确定性，坚持系统化投资理念，坚守投资规则和纪律，加强策略跟踪和归因，努力开发和改进选股策略，不断储备具备长期风险溢价的投资策略，并基于策略特点动态调整各类风险溢价的配置结构，努力为投资人获取长期稳健超额收益。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《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，对中金中证 800 指数增强型证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中金基金管理有限公司在中金中证 800 指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，中金基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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 800 指数增强型证券投资基金

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	7,122,581.57	21,623,983.12
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	85,054,388.08	246,057,541.44
其中：股票投资		85,054,388.08	246,057,541.44
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		25,262.48	60,962.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		92,202,232.13	267,742,487.04
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		2,042,063.07	5,951,608.03
应付管理人报酬		61,172.47	210,792.48
应付托管费		7,646.57	26,349.05
应付销售服务费		14,811.42	40,416.32
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	83,704.52	148,000.00
负债合计		2,209,398.05	6,377,165.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	75,945,317.96	255,831,857.99
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	14,047,516.12	5,533,463.17
净资产合计		89,992,834.08	261,365,321.16
负债和净资产总计		92,202,232.13	267,742,487.04

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，中金中证 800 指数增强 A 的基金份额净值为 1.1868 元，期末份额总额为 38,967,523.69 份；中金中证 800 指数增强 C 的基金份额净值为 1.1830 元，期末份额总额为 36,977,794.27 份。基金份额总额 75,945,317.96 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证 800 指数增强型证券投资基金

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
一、营业总收入		22,156,718.62
1. 利息收入		4,818.31
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,818.31
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）		20,367,537.03
其中：股票投资收益	6.4.7.14	19,549,843.85
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	817,693.18
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	1,777,307.73
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	7,055.55
减：二、营业总支出		828,601.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	550,219.67
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	68,777.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	123,882.35
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	85,722.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		21,328,117.04
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,328,117.04
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		21,328,117.04

6.3 净资产变动表

会计主体：中金中证 800 指数增强型证券投资基金

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	255,831,857.99	-	5,533,463.17	261,365,321.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	255,831,857.99	-	5,533,463.17	261,365,321.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-179,886,540.03	-	8,514,052.95	-171,372,487.08
（一）、综合收益总额	-	-	21,328,117.04	21,328,117.04
（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）	-179,886,540.03	-	-12,814,064.09	-192,700,604.12
其中：1. 基金申购款	10,881,643.70	-	690,059.04	11,571,702.74
2. 基金赎回款	-190,768,183.73	-	-13,504,123.13	-204,272,306.86
（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	75,945,317.96	-	14,047,516.12	89,992,834.08

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：

宗喆

二

白娜

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 800 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 2025 年 6 月 27 日证监许可[2025]1354 号《关于中金中证 800 指数增强型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 800 指数增强型证券投资基金招募说明书》和《中金中证 800 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，托管人为中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、北京雪球基金销售有限公司、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司及腾安基金销售(深圳)有限公司等共同销售，募集期为 2025 年 8 月 18 日起至 2025 年 9 月 8 日。经向中国证监会备案，《中金中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2025 年 9 月 10 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 570,854,897.39 份(含利息转份额 199,929.34 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 800 指数增强型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式等不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，投资人可自行选择认购/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 800 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、科创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、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》、财税〔2014〕81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2016〕127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、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) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本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。

(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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(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。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	3,329,784.09
等于：本金	3,329,664.10
加：应计利息	119.99

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	3,792,797.48
等于：本金	3,792,760.41
加：应计利息	37.07
减：坏账准备	-
合计	7,122,581.57

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		75,877,313.56	-	85,054,388.08	9,177,074.52
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		75,877,313.56	-	85,054,388.08	9,177,074.52

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	80,550.12
其他	3,154.40
合计	83,704.52

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 800 指数增强 A

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	152,686,069.20	152,686,069.20
本期申购	2,877,508.72	2,877,508.72
本期赎回（以“-”号填列）	-116,596,054.23	-116,596,054.23
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	38,967,523.69	38,967,523.69

中金中证 800 指数增强 C

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	103,145,788.79	103,145,788.79
本期申购	8,004,134.98	8,004,134.98
本期赎回（以“-”号填列）	-74,172,129.50	-74,172,129.50
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	36,977,794.27	36,977,794.27

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

中金中证 800 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	1,888,471.68	1,490,358.87	3,378,830.55
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	1,888,471.68	1,490,358.87	3,378,830.55
本期利润	10,928,876.50	1,173,218.39	12,102,094.89
本期基金份额交易产生的变动数	-6,430,212.81	-1,770,798.21	-8,201,011.02
其中：基金申购款	219,958.34	-32,479.52	187,478.82
基金赎回款	-6,650,171.15	-1,738,318.69	-8,388,489.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,387,135.37	892,779.05	7,279,914.42

中金中证 800 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	1,149,004.08	1,005,628.54	2,154,632.62
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,149,004.08	1,005,628.54	2,154,632.62
本期利润	8,621,932.81	604,089.34	9,226,022.15
本期基金份额交易产生的变动数	-3,847,145.73	-765,907.34	-4,613,053.07
其中：基金申购款	565,283.82	-62,703.60	502,580.22
基金赎回款	-4,412,429.55	-703,203.74	-5,115,633.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,923,791.16	843,810.54	6,767,601.70

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	3,660.02
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,158.29
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	4,818.31

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	19,549,843.85
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	19,549,843.85

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	420,108,663.88
减：卖出股票成本总额	400,177,862.82
减：交易费用	380,957.21
买卖股票差价收入	19,549,843.85

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

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	817,693.18
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	817,693.18

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	1,777,307.73
股票投资	1,777,307.73
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	1,777,307.73

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	7,055.55
合计	7,055.55

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	21,042.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
划款手续费	5,171.82
其他	0.14
合计	85,722.08

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、基金注册登记机构及基金销售机构
中信银行	基金托管人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司	基金管理人的股东
中国中金财富证券有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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
当期发生的基金应支付的管理费	550,219.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	274,589.22
应支付基金管理人的净管理费	275,630.45

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 0.80%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×0.80%/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
当期发生的基金应支付的托管费	68,777.48

注：支付基金托管人中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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 800 指数增强 A	中金中证 800 指数增强 C	合计
中金财富证券	-	1,738.87	1,738.87

中信银行	-	99,655.60	99,655.60
合计	-	101,394.47	101,394.47

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$C \text{ 类基金份额日基金销售服务费} = C \text{ 类基金份额前一日基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内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

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	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	3,329,784.09	3,660.02

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中金公司	601112	振石股份	网下	1,502	16,792.36
中金公司	688781	视涯科技	网下	197	4,467.96

中金公司	001220	世盟股份	网下	405	11,340
中金公司	688712	北芯生命	网下	2,110	36,967.20

注：本基金基金合同生效日为 2025 年 9 月 10 日，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末未实施利润分配。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	41	1,148.00	1,138.98	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	41	2,378.00	4,598.56	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	151	1,688.18	2,656.09	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	29	1,098.52	1,011.23	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	20	669.80	678.60	-
603352	至信	2026 年 1 月 1 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	82	1,794.16	2,092.64	-

	股份	月 8 日		受限						
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	47	740.72	2,195.37	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	78	1,380.60	6,576.96	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	43	1,762.14	13,252.17	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	633	11,090.16	22,737.36	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	40	907.20	1,904.40	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	41	3,779.38	18,989.15	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	1,034	118,165.52	699,955.96	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	732	76,611.12	562,827.48	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	31	2,538.28	49,114.23	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	372	2,384.52	8,976.36	-
688813	泰金	2026 年 3 月	6 个月	新股流通	26.28	172.09	94	2,470.32	16,176.46	-

	新能	月 24 日		受限						
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	61	3,412.95	3,483.10	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	436	4,128.92	30,581.04	-

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 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

本基金属于指数增强型股票基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。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	7,122,424.51	-	-	157.06	7,122,581.57
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	85,054,388.08	85,054,388.08
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	-	-	-	25,262.48	25,262.48
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,122,424.51	-	-	85,079,807.62	92,202,232.13
负债					

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,042,063.07	2,042,063.07
应付销售服务费	-	-	-	14,811.42	14,811.42
应付管理人报酬	-	-	-	61,172.47	61,172.47
应付托管费	-	-	-	7,646.57	7,646.57
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	83,704.52	83,704.52
负债总计	-	-	-	2,209,398.05	2,209,398.05
利率敏感度缺口	7,122,424.51	-	-	82,870,409.57	89,992,834.08
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	21,623,322.36	-	-	660.76	21,623,983.12
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	246,057,541.44	246,057,541.44
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	-	-	-	60,962.48	60,962.48
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	21,623,322.36	-	-	246,119,164.68	267,742,487.04
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	5,951,608.03	5,951,608.03
应付销售服务费	-	-	-	40,416.32	40,416.32
应付管理人报酬	-	-	-	210,792.48	210,792.48
应付托管费	-	-	-	26,349.05	26,349.05
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	148,000.00	148,000.00
负债总计	-	-	-	6,377,165.88	6,377,165.88
利率敏感度缺口	21,623,322.36	-	-	-239,741,998.80	261,365,321.16

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	85,054,388.08	94.51	246,057,541.44	94.14
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	85,054,388.08	94.51	246,057,541.44	94.14

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期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	83,590,274.84	243,778,305.50
第二层次	—	1,334,200.40
第三层次	1,464,113.24	945,035.54
合计	85,054,388.08	246,057,541.44

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	85,054,388.08	92.25
	其中：股票	85,054,388.08	92.25
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	7,122,581.57	7.72
8	其他各项资产	25,262.48	0.03
9	合计	92,202,232.13	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	240,020.00	0.27
B	采矿业	3,017,039.60	3.35
C	制造业	50,430,196.95	56.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,174,968.00	1.31
E	建筑业	411,199.00	0.46
F	批发和零售业	1,408,576.00	1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	1,449,771.00	1.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,221,931.52	3.58
J	金融业	11,273,544.80	12.53
K	房地产业	67,196.00	0.07
L	租赁和商务服务业	207,091.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	1,464,737.74	1.63
N	水利、环境和公共设施管理业	348,831.20	0.39
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	74,715,102.81	83.02

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	190,110.00	0.21
C	制造业	8,099,484.63	9.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	252,809.00	0.28
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	386,614.00	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	1,138.98	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	574,106.22	0.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	104,500.00	0.12
L	租赁和商务服务业	176,314.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	3,484.98	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	439,517.46	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	30,744.00	0.03
Q	卫生和社会工作	49,606.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	30,856.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	10,339,285.27	11.49

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	3,200	4,064,000.00	4.52
2	300750	宁德时代	7,200	2,829,672.00	3.14
3	603986	兆易创新	2,500	2,037,500.00	2.26
4	002384	东山精密	5,500	1,442,925.00	1.60

5	601899	紫金矿业	47,500	1,194,150.00	1.33
6	600519	贵州茅台	1,000	1,185,490.00	1.32
7	600030	中信证券	40,200	1,154,946.00	1.28
8	301308	江波龙	1,500	1,055,700.00	1.17
9	001309	德明利	1,100	1,037,190.00	1.15
10	300502	新易盛	1,620	983,340.00	1.09
11	600522	中天科技	16,100	976,948.00	1.09
12	601328	交通银行	142,500	916,275.00	1.02
13	300475	香农芯创	3,000	900,000.00	1.00
14	002463	沪电股份	5,500	840,400.00	0.93
15	603259	药明康德	6,700	834,217.00	0.93
16	688002	睿创微纳	5,204	805,006.76	0.89
17	300857	协创数据	2,300	781,770.00	0.87
18	600150	中国船舶	22,427	757,808.33	0.84
19	002142	宁波银行	25,400	754,126.00	0.84
20	000333	美的集团	9,800	740,194.00	0.82
21	600183	生益科技	4,200	728,280.00	0.81
22	601869	长飞光纤	1,300	709,670.00	0.79
23	300223	君正股份	2,800	696,920.00	0.77
24	300408	三环集团	4,000	667,600.00	0.74
25	688498	源杰科技	344	648,784.00	0.72
26	688256	寒武纪	396	631,837.80	0.70
27	600176	中国巨石	7,700	561,176.00	0.62
28	002558	巨人网络	19,400	534,664.00	0.59
29	000657	中钨高新	5,300	507,316.00	0.56
30	002916	深南电路	1,100	503,690.00	0.56
31	688266	泽璟制药	4,309	502,687.94	0.56
32	301358	湖南裕能	6,600	500,742.00	0.56
33	300059	东方财富	24,500	499,310.00	0.55
34	002414	高德红外	37,500	497,250.00	0.55
35	002415	海康威视	14,500	495,900.00	0.55
36	000807	云铝股份	21,800	482,652.00	0.54
37	300458	全志科技	12,100	477,466.00	0.53
38	601009	南京银行	44,400	439,116.00	0.49
39	601318	中国平安	8,800	420,112.00	0.47
40	688111	金山办公	1,970	419,708.50	0.47
41	605117	德业股份	3,880	411,978.40	0.46
42	000729	燕京啤酒	40,200	407,226.00	0.45
43	000703	恒逸石化	30,000	407,100.00	0.45
44	000021	深科技	6,300	404,901.00	0.45
45	688220	翱捷科技	3,186	396,083.52	0.44
46	601066	中信建投	13,600	395,352.00	0.44
47	300676	华大基因	11,100	389,166.00	0.43

48	002709	天赐材料	7,300	375,439.00	0.42
49	600000	浦发银行	43,000	370,230.00	0.41
50	603993	洛阳钼业	20,700	363,285.00	0.40
51	601111	中国国航	57,900	350,295.00	0.39
52	002028	思源电气	2,000	346,000.00	0.38
53	000338	潍柴动力	12,400	337,900.00	0.38
54	002266	浙富控股	66,200	334,972.00	0.37
55	002475	立讯精密	4,700	330,880.00	0.37
56	601211	国泰海通	17,900	325,780.00	0.36
57	601658	邮储银行	66,000	325,380.00	0.36
58	000050	深天马 A	32,500	322,075.00	0.36
59	600601	方正科技	23,000	318,320.00	0.35
60	600036	招商银行	8,800	312,400.00	0.35
61	688599	天合光能	22,000	310,640.00	0.35
62	600885	宏发股份	9,000	310,410.00	0.34
63	688521	芯原股份	835	309,901.90	0.34
64	601319	中国人保	45,700	308,932.00	0.34
65	601699	潞安环能	21,500	307,020.00	0.34
66	000951	中国重汽	15,680	305,916.80	0.34
67	601360	三六零	35,200	305,888.00	0.34
68	000776	广发证券	12,900	301,860.00	0.34
69	600887	伊利股份	12,500	299,500.00	0.33
70	000519	中兵红箭	14,200	299,194.00	0.33
71	301526	国际复材	6,300	294,021.00	0.33
72	603288	海天味业	8,800	291,808.00	0.32
73	000001	平安银行	28,800	289,440.00	0.32
74	300373	扬杰科技	1,800	283,014.00	0.31
75	601233	桐昆股份	12,600	272,790.00	0.30
76	603799	华友钴业	5,600	270,256.00	0.30
77	688301	奕瑞科技	2,157	267,468.00	0.30
78	300014	亿纬锂能	4,100	266,623.00	0.30
79	300432	富临精工	13,200	265,188.00	0.29
80	600926	杭州银行	18,300	264,435.00	0.29
81	300999	金龙鱼	11,300	262,838.00	0.29
82	000100	TCL 科技	44,900	261,318.00	0.29
83	688469	芯联集成	23,800	252,518.00	0.28
84	300390	天华新能	2,700	252,477.00	0.28
85	600884	杉杉股份	17,900	242,545.00	0.27
86	600919	江苏银行	22,200	239,316.00	0.27
87	603256	宏和科技	900	238,797.00	0.27
88	000408	藏格矿业	3,400	235,688.00	0.26
89	688702	盛科通信	600	233,994.00	0.26
90	600166	福田汽车	80,200	233,382.00	0.26

91	002493	荣盛石化	21,700	233,275.00	0.26
92	300054	鼎龙股份	2,200	233,134.00	0.26
93	002603	以岭药业	15,500	232,500.00	0.26
94	300012	华测检测	16,700	231,462.00	0.26
95	300661	圣邦股份	1,600	229,568.00	0.26
96	603077	和邦生物	98,600	228,752.00	0.25
97	601288	农业银行	36,900	223,983.00	0.25
98	601668	中国建筑	51,600	223,944.00	0.25
99	600015	华夏银行	35,000	223,650.00	0.25
100	002568	百润股份	13,200	223,344.00	0.25
101	301536	星宸科技	1,700	218,807.00	0.24
102	000166	申万宏源	49,300	216,920.00	0.24
103	603858	步长制药	14,800	216,080.00	0.24
104	600390	五矿资本	47,300	215,688.00	0.24
105	002157	正邦科技	76,700	215,527.00	0.24
106	603444	吉比特	600	215,052.00	0.24
107	000938	紫光股份	7,400	213,564.00	0.24
108	601872	招商轮船	12,000	210,840.00	0.23
109	605358	立昂微	2,700	209,520.00	0.23
110	600995	南网储能	16,900	207,870.00	0.23
111	600100	同方股份	30,200	206,870.00	0.23
112	601628	中国人寿	5,700	201,495.00	0.22
113	600546	山煤国际	18,400	201,112.00	0.22
114	688036	传音控股	3,369	198,602.55	0.22
115	600031	三一重工	11,400	196,992.00	0.22
116	601106	中国一重	57,700	190,410.00	0.21
117	600066	宇通客车	7,100	190,351.00	0.21
118	601198	东兴证券	13,800	187,542.00	0.21
119	688629	华丰科技	1,000	187,510.00	0.21
120	688008	澜起科技	600	185,940.00	0.21
121	300757	罗博特科	300	185,700.00	0.21
122	601601	中国太保	6,500	185,380.00	0.21
123	688475	萤石网络	6,776	185,323.60	0.21
124	601988	中国银行	32,200	184,184.00	0.20
125	600499	科达制造	13,300	183,540.00	0.20
126	000937	冀中能源	46,020	183,159.60	0.20
127	600026	中远海能	10,200	182,988.00	0.20
128	600104	上汽集团	18,700	182,512.00	0.20
129	600028	中国石化	40,800	181,968.00	0.20
130	002049	紫光国微	2,040	181,050.00	0.20
131	601985	中国核电	19,500	176,085.00	0.20
132	600029	南方航空	33,800	175,084.00	0.19
133	000425	徐工机械	21,500	173,935.00	0.19

134	300972	万辰集团	1,000	173,410.00	0.19
135	600886	国投电力	12,600	167,706.00	0.19
136	600011	华能国际	22,000	166,980.00	0.19
137	601169	北京银行	34,000	166,600.00	0.19
138	601939	建设银行	17,300	166,599.00	0.19
139	300142	沃森生物	12,800	166,272.00	0.18
140	000800	一汽解放	27,900	166,005.00	0.18
141	601919	中远海控	12,500	165,750.00	0.18
142	002261	拓维信息	5,700	159,657.00	0.18
143	002027	分众传媒	32,800	158,752.00	0.18
144	601816	京沪高铁	35,000	158,550.00	0.18
145	600372	中航机载	14,600	158,410.00	0.18
146	600816	建元信托	64,900	158,356.00	0.18
147	600688	上海石化	52,900	154,997.00	0.17
148	000301	东方盛虹	13,400	153,430.00	0.17
149	002648	卫星化学	6,500	152,685.00	0.17
150	000538	云南白药	3,200	151,584.00	0.17
151	601698	中国卫通	5,000	151,250.00	0.17
152	300073	当升科技	3,100	148,924.00	0.17
153	603345	安井食品	1,800	144,342.00	0.16
154	300957	贝泰妮	4,500	141,795.00	0.16
155	000825	太钢不锈	41,500	141,515.00	0.16
156	601665	齐鲁银行	24,500	141,365.00	0.16
157	600332	白云山	7,000	140,280.00	0.16
158	002938	鹏鼎控股	1,300	136,994.00	0.15
159	600309	万华化学	2,000	136,820.00	0.15
160	000975	山金国际	7,900	134,300.00	0.15
161	601688	华泰证券	6,500	134,030.00	0.15
162	002966	苏州银行	19,100	132,936.00	0.15
163	600989	宝丰能源	6,400	130,112.00	0.14
164	603019	中科曙光	1,200	128,676.00	0.14
165	002281	光迅科技	500	128,470.00	0.14
166	600105	永鼎股份	1,900	128,212.00	0.14
167	600801	华新建材	8,200	127,920.00	0.14
168	600549	厦门钨业	1,500	127,800.00	0.14
169	600061	国投资本	19,000	124,450.00	0.14
170	601398	工商银行	17,600	124,432.00	0.14
171	601766	中国中车	23,900	124,280.00	0.14
172	002460	赣锋锂业	1,900	124,260.00	0.14
173	688166	博瑞医药	3,532	123,655.32	0.14
174	002407	多氟多	2,400	120,552.00	0.13
175	601600	中国铝业	14,200	116,724.00	0.13
176	002265	建设工业	6,700	116,580.00	0.13

177	600741	华域汽车	7,400	114,848.00	0.13
178	002738	中矿资源	1,900	112,081.00	0.12
179	300037	新宙邦	1,200	111,420.00	0.12
180	002837	英维克	1,400	111,384.00	0.12
181	300548	长芯博创	400	111,200.00	0.12
182	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	0.12
183	600489	中金黄金	6,100	110,105.00	0.12
184	601059	信达证券	6,800	110,092.00	0.12
185	000651	格力电器	2,900	108,750.00	0.12
186	600765	中航重机	8,400	108,528.00	0.12
187	000783	长江证券	11,100	108,225.00	0.12
188	301200	大族数控	300	108,195.00	0.12
189	601727	上海电气	15,400	107,800.00	0.12
190	002841	视源股份	3,100	107,043.00	0.12
191	603119	浙江荣泰	1,600	106,144.00	0.12
192	300604	长川科技	300	102,426.00	0.11
193	002335	科华数据	2,400	101,880.00	0.11
194	688617	惠泰医疗	560	101,673.60	0.11
195	601857	中国石油	11,400	98,952.00	0.11
196	601138	工业富联	1,300	93,795.00	0.10
197	002466	天齐锂业	1,500	91,980.00	0.10
198	301606	绿联科技	1,500	91,530.00	0.10
199	002236	大华股份	5,500	90,695.00	0.10
200	603308	应流股份	1,500	90,600.00	0.10
201	688538	和辉光电	34,600	89,960.00	0.10
202	002126	银轮股份	1,800	89,640.00	0.10
203	601898	中煤能源	7,100	86,478.00	0.10
204	300394	天孚通信	280	84,750.40	0.09
205	000977	浪潮信息	1,200	84,000.00	0.09
206	600795	国电电力	17,900	83,593.00	0.09
207	600875	东方电气	2,900	83,433.00	0.09
208	000630	铜陵有色	13,100	83,316.00	0.09
209	000708	中信特钢	6,600	83,292.00	0.09
210	600369	西南证券	20,700	83,214.00	0.09
211	600050	中国联通	20,800	83,200.00	0.09
212	601607	上海医药	5,400	83,160.00	0.09
213	601108	财通证券	9,600	83,040.00	0.09
214	601818	光大银行	28,700	82,943.00	0.09
215	002001	新 和 成	2,900	82,418.00	0.09
216	600362	江西铜业	1,900	82,270.00	0.09
217	601000	唐山港	19,800	82,170.00	0.09
218	600535	天士力	6,200	82,026.00	0.09
219	002625	光启技术	2,700	81,864.00	0.09

220	603920	世运电路	1,700	81,668.00	0.09
221	002064	华峰化学	8,600	81,614.00	0.09
222	000878	云南铜业	4,800	76,224.00	0.08
223	603049	中策橡胶	1,700	76,177.00	0.08
224	601991	大唐发电	10,600	75,048.00	0.08
225	600998	九州通	16,000	75,040.00	0.08
226	601901	方正证券	10,400	74,880.00	0.08
227	003816	中国广核	19,100	74,681.00	0.08
228	601916	浙商银行	28,300	74,429.00	0.08
229	600517	国网英大	15,900	74,412.00	0.08
230	300919	中伟新材	1,700	74,375.00	0.08
231	601800	中国交建	13,000	74,230.00	0.08
232	601696	中银证券	5,800	73,370.00	0.08
233	601997	贵阳银行	14,300	73,359.00	0.08
234	600600	青岛啤酒	1,400	73,122.00	0.08
235	002252	上海莱士	16,800	72,912.00	0.08
236	601128	常熟银行	12,490	72,691.80	0.08
237	300033	同花顺	300	72,300.00	0.08
238	688183	生益电子	541	71,628.40	0.08
239	600188	兖矿能源	3,800	67,526.00	0.08
240	600663	陆家嘴	10,700	67,196.00	0.07
241	600808	马钢股份	26,800	67,000.00	0.07
242	000683	博源化工	11,500	66,240.00	0.07
243	600038	中直股份	2,600	65,754.00	0.07
244	000027	深圳能源	10,600	65,720.00	0.07
245	601117	中国化学	8,900	65,415.00	0.07
246	601788	光大证券	4,500	64,935.00	0.07
247	603939	益丰药房	3,600	64,728.00	0.07
248	002065	东华软件	9,000	64,260.00	0.07
249	688180	君实生物	1,889	63,885.98	0.07
250	000062	深圳华强	1,900	60,458.00	0.07
251	600157	永泰能源	37,000	59,570.00	0.07
252	000895	双汇发展	2,600	58,240.00	0.06
253	002532	天山铝业	5,400	57,942.00	0.06
254	001391	国货航	14,200	57,794.00	0.06
255	000988	华工科技	300	55,383.00	0.06
256	601058	赛轮轮胎	4,400	50,732.00	0.06
257	603606	东方电缆	1,220	50,642.20	0.06
258	600233	圆通速递	3,200	50,400.00	0.06
259	600704	物产中大	10,500	49,560.00	0.06
260	002517	恺英网络	3,000	48,750.00	0.05
261	601888	中国中免	900	48,339.00	0.05
262	688778	厦钨新能	888	48,307.20	0.05

263	603979	金诚信	800	47,224.00	0.05
264	600809	山西汾酒	400	43,748.00	0.05
265	600312	平高电气	2,400	42,384.00	0.05
266	600595	中孚实业	7,500	42,150.00	0.05
267	600008	首创环保	15,400	41,888.00	0.05
268	000983	山西焦煤	7,200	41,760.00	0.05
269	601881	中国银河	3,300	41,481.00	0.05
270	688981	中芯国际	259	41,134.38	0.05
271	002594	比亚迪	500	39,850.00	0.04
272	003022	联泓新科	1,500	38,850.00	0.04
273	300442	润泽科技	400	33,228.00	0.04
274	601166	兴业银行	2,000	33,120.00	0.04
275	600685	中船防务	1,300	33,072.00	0.04
276	600019	宝钢股份	5,900	32,037.00	0.04
277	600025	华能水电	3,600	32,004.00	0.04
278	688235	百济神州	122	31,062.42	0.03
279	600893	航发动力	700	26,838.00	0.03
280	300395	菲利华	200	26,746.00	0.03
281	002714	牧原股份	700	24,493.00	0.03
282	600900	长江电力	900	23,823.00	0.03
283	000157	中联重科	3,400	23,698.00	0.03
284	688047	龙芯中科	149	23,045.83	0.03
285	600346	恒力石化	1,300	23,023.00	0.03
286	601618	中国中冶	9,400	22,936.00	0.03
287	002050	三花智控	400	17,532.00	0.02
288	000629	钒钛股份	5,000	16,700.00	0.02
289	000750	国海证券	4,500	16,560.00	0.02
290	600606	绿地控股	13,400	16,214.00	0.02
291	002736	国信证券	1,600	15,984.00	0.02
292	002120	韵达股份	2,500	15,900.00	0.02
293	002032	苏泊尔	400	15,840.00	0.02
294	600089	特变电工	700	15,750.00	0.02
295	600010	包钢股份	7,000	15,610.00	0.02
296	002271	东方雨虹	1,300	15,431.00	0.02
297	002353	杰瑞股份	100	15,250.00	0.02
298	688281	华秦科技	280	14,064.40	0.02
299	002926	华西证券	1,700	13,889.00	0.02
300	600292	电投水电	1,100	13,244.00	0.01
301	688114	华大智造	237	12,105.96	0.01
302	688248	南网科技	143	9,892.74	0.01
303	600406	国电南瑞	400	9,140.00	0.01
304	688122	西部超导	142	8,919.02	0.01
305	600941	中国移动	100	8,613.00	0.01

306	601669	中国电建	1,800	8,460.00	0.01
307	002078	太阳纸业	600	7,494.00	0.01
308	688099	晶晨股份	66	6,791.40	0.01
309	688213	思特威	56	5,995.92	0.01
310	302132	中航成飞	100	5,832.00	0.01
311	688126	沪硅产业	146	5,823.94	0.01
312	688520	神州细胞	148	5,063.08	0.01
313	688728	格科微	182	3,829.28	0.00
314	605499	东鹏饮料	30	3,702.90	0.00
315	688363	华熙生物	100	3,577.00	0.00
316	601112	振石股份	151	2,656.09	0.00
317	688303	大全能源	131	2,283.33	0.00
318	000034	神州数码	80	2,220.00	0.00
319	603179	新泉股份	40	1,986.00	0.00
320	603596	伯特利	48	1,192.32	0.00
321	603568	伟明环保	40	615.20	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	688525	佰维存储	1,600	791,568.00	0.88
2	688795	摩尔线程	1,034	699,955.96	0.78
3	688802	沐曦股份	732	562,827.48	0.63
4	688257	新锐股份	5,400	550,260.00	0.61
5	600487	亨通光电	4,300	470,162.00	0.52
6	688766	普冉股份	600	459,960.00	0.51
7	688110	东芯股份	2,200	448,140.00	0.50
8	000810	创维数字	21,700	287,525.00	0.32
9	603588	高能环境	14,700	282,240.00	0.31
10	000933	神火股份	11,900	252,280.00	0.28
11	000958	电投产融	36,900	208,116.00	0.23
12	603195	公牛集团	5,100	199,665.00	0.22
13	603618	杭电股份	4,000	199,520.00	0.22
14	300607	拓斯达	4,600	189,658.00	0.21
15	600619	海立股份	11,000	174,350.00	0.19
16	002439	启明星辰	13,200	166,980.00	0.19
17	688059	华锐精密	800	159,768.00	0.18
18	300590	移为通信	11,000	157,850.00	0.18
19	002127	南极电商	54,900	150,426.00	0.17
20	603045	福达合金	2,100	149,919.00	0.17
21	603579	荣泰健康	8,300	140,851.00	0.16
22	688221	前沿生物	6,200	138,880.00	0.15
23	002354	天娱数科	14,300	132,990.00	0.15
24	600739	辽宁成大	13,000	131,430.00	0.15

25	002080	中材科技	1,400	126,000.00	0.14
26	600323	瀚蓝环境	3,900	107,094.00	0.12
27	600246	万通发展	5,500	104,500.00	0.12
28	002079	苏州固锔	6,700	100,701.00	0.11
29	300821	东岳硅材	4,800	98,688.00	0.11
30	688328	深科达	1,000	95,700.00	0.11
31	301373	凌玮科技	600	93,300.00	0.10
32	600320	振华重工	22,200	91,686.00	0.10
33	300184	力源信息	4,800	84,240.00	0.09
34	001298	好上好	4,000	83,000.00	0.09
35	300277	汽轮科技	5,500	82,720.00	0.09
36	002446	盛路通信	7,600	81,624.00	0.09
37	603638	艾迪精密	3,300	77,385.00	0.09
38	300183	东软载波	7,000	73,150.00	0.08
39	600925	苏能股份	18,200	72,982.00	0.08
40	600267	海正药业	6,600	66,726.00	0.07
41	300296	利亚德	11,800	66,080.00	0.07
42	000426	兴业银锡	1,800	59,328.00	0.07
43	000980	众泰汽车	29,800	58,706.00	0.07
44	300256	星星科技	22,300	58,203.00	0.06
45	600252	中恒集团	33,000	58,080.00	0.06
46	002128	电投能源	2,500	57,800.00	0.06
47	300657	弘信电子	1,300	57,226.00	0.06
48	600718	东软集团	7,700	55,748.00	0.06
49	603067	振华股份	1,200	55,548.00	0.06
50	301362	民爆光电	300	55,176.00	0.06
51	688809	强一股份	87	54,201.00	0.06
52	301031	中熔电气	440	52,558.00	0.06
53	301267	华夏眼科	3,400	49,606.00	0.06
54	300168	万达信息	10,800	49,572.00	0.06
55	002063	远光软件	9,700	49,470.00	0.05
56	688808	联讯仪器	31	49,114.23	0.05
57	301408	华人健康	3,400	48,892.00	0.05
58	688208	道通科技	1,923	48,440.37	0.05
59	002310	东方新能	18,700	44,693.00	0.05
60	603936	博敏电子	1,600	42,736.00	0.05
61	300070	碧水源	12,900	41,151.00	0.05
62	300005	探路者	1,800	40,680.00	0.05
63	002511	中顺洁柔	6,100	40,565.00	0.05
64	600616	金枫酒业	10,500	39,375.00	0.04
65	605138	盛泰集团	6,100	33,672.00	0.04
66	600715	文投控股	20,300	30,856.00	0.03
67	600455	博通股份	1,400	30,744.00	0.03

68	688818	电科蓝天	436	30,581.04	0.03
69	603268	松发股份	200	27,856.00	0.03
70	000839	国安股份	9,700	25,123.00	0.03
71	000599	青岛双星	5,500	23,210.00	0.03
72	688712	北芯生命	633	22,737.36	0.03
73	601061	中信金属	2,100	22,617.00	0.03
74	603390	通达电气	2,100	21,924.00	0.02
75	603329	上海雅仕	2,400	21,552.00	0.02
76	688785	恒运昌	41	18,989.15	0.02
77	000818	航锦科技	1,200	17,424.00	0.02
78	603719	良品铺子	1,900	16,435.00	0.02
79	000589	贵州轮胎	4,000	16,240.00	0.02
80	688813	泰金新能	94	16,176.46	0.02
81	301687	新广益	195	15,167.10	0.02
82	301260	格力博	1,100	14,861.00	0.02
83	688635	长进光子	43	13,252.17	0.01
84	688577	浙海德曼	280	12,832.40	0.01
85	688485	九州一轨	141	9,032.46	0.01
86	688811	有研复材	372	8,976.36	0.01
87	002189	中光学	400	8,944.00	0.01
88	000981	山子高科	2,900	8,352.00	0.01
89	688607	康众医疗	162	8,262.00	0.01
90	300414	中光防雷	700	7,714.00	0.01
91	603459	红板科技	78	6,576.96	0.01
92	001369	双欣材料	466	6,300.32	0.01
93	000990	诚志股份	700	5,726.00	0.01
94	688023	安恒信息	136	4,993.92	0.01
95	688612	威迈斯	167	4,941.53	0.01
96	688013	天臣医疗	197	4,859.99	0.01
97	301680	固德电材	41	4,598.56	0.01
98	688479	友车科技	118	4,480.46	0.00
99	600057	厦门象屿	800	4,336.00	0.00
100	688428	诺诚健华	142	4,042.74	0.00
101	688443	智翔金泰	160	3,720.00	0.00
102	688816	易思维	61	3,483.10	0.00
103	688177	百奥泰	178	2,993.96	0.00
104	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
105	603435	嘉德利	47	2,195.37	0.00
106	002595	豪迈科技	45	2,097.00	0.00
107	603352	至信股份	82	2,092.64	0.00
108	688173	希荻微	106	2,028.84	0.00
109	688781	视涯科技	40	1,904.40	0.00
110	001220	世盟股份	41	1,138.98	0.00

111	688105	诺唯赞	60	1,041.00	0.00
112	603284	林平发展	29	1,011.23	0.00
113	603293	埃泰克	20	678.60	0.00
114	688329	艾隆科技	15	303.15	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	603986	兆易创新	2,142,995.00	0.82
2	600030	中信证券	2,066,920.00	0.79
3	002028	思源电气	1,944,498.00	0.74
4	688525	佰维存储	1,787,087.39	0.68
5	300750	宁德时代	1,738,318.00	0.67
6	601899	紫金矿业	1,687,603.00	0.65
7	002558	巨人网络	1,680,416.00	0.64
8	002384	东山精密	1,622,728.00	0.62
9	601211	国泰海通	1,574,392.00	0.60
10	601658	邮储银行	1,546,617.00	0.59
11	600522	中天科技	1,506,336.00	0.58
12	300207	欣旺达	1,482,671.00	0.57
13	300502	新易盛	1,451,909.00	0.56
14	601601	中国太保	1,435,572.00	0.55
15	603799	华友钴业	1,327,295.00	0.51
16	601328	交通银行	1,309,999.00	0.50
17	603659	璞泰来	1,304,312.00	0.50
18	000776	广发证券	1,269,656.00	0.49
19	600885	宏发股份	1,238,100.00	0.47
20	002284	亚太股份	1,223,385.00	0.47

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	7,513,906.40	2.87
2	300308	中际旭创	6,772,574.00	2.59
3	300502	新易盛	6,418,067.00	2.46
4	601899	紫金矿业	5,436,418.52	2.08
5	601318	中国平安	4,817,153.00	1.84
6	601138	工业富联	3,914,651.00	1.50
7	603259	药明康德	3,488,860.00	1.33
8	600183	生益科技	3,348,875.00	1.28
9	002436	兴森科技	3,336,179.00	1.28

10	002916	深南电路	3,334,876.10	1.28
11	600519	贵州茅台	3,066,631.50	1.17
12	688525	佰维存储	2,974,398.05	1.14
13	000333	美的集团	2,842,680.00	1.09
14	600989	宝丰能源	2,815,250.00	1.08
15	002475	立讯精密	2,811,841.00	1.08
16	002415	海康威视	2,732,418.00	1.05
17	002414	高德红外	2,729,436.00	1.04
18	600030	中信证券	2,717,909.00	1.04
19	600150	中国船舶	2,713,849.62	1.04
20	603993	洛阳钼业	2,677,388.00	1.02

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	237,397,401.73
卖出股票收入（成交）总额	420,108,663.88

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	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	25,262.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,262.48

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	699,955.96	0.78	新股流通受限
2	688802	沐曦股份	562,827.48	0.63	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
中金中证 800 指数 增强 A	528	73,802.13	52,777.83	0.14	38,914,745.86	99.86
中金中证 800 指数 增强 C	421	87,833.24	51,310.71	0.14	36,926,483.56	99.86
合计	949	80,026.68	104,088.54	0.14	75,841,229.42	99.86

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 800 指数增强 A	99.29	0.0003
	中金中证 800 指数增强 C	0.00	0.0000
	合计	99.29	0.0001

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 800 指数增强 A	0
	中金中证 800 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 800 指数增强 A	0
	中金中证 800 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 800 指数增强 A	中金中证 800 指数增强 C
基金合同生效日 (2025 年 9 月 10 日)	358,433,112.09	212,421,785.30

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	152,686,069.20	103,145,788.79
本报告期基金总申购份额	2,877,508.72	8,004,134.98
减：本报告期基金总赎回份额	116,596,054.23	74,172,129.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	38,967,523.69	36,977,794.27

§ 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

2026 年 6 月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。

2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

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 (%)	
国信证券	2	466,525,825.57	70.99	91,404.48	70.99	-
国投证券	2	190,627,204.52	29.01	37,347.63	29.01	-

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服务；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(%)
国信证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-28
3	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-29
4	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金投资上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
5	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-19
6	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
7	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
8	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 800 指数增强型证券投资基金注册的文件
- 2、《中金中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 800 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、《中金中证 800 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 5、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 800 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

2026 年 8 月 28 日