

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64
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	64

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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	67
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	67
10.8 其他重大事件	69
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金		
基金简称	中金中证 500 指数增强		
基金主代码	003016		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 年 7 月 22 日		
基金管理人	中金基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	514,774,094.13 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 500 指数增强 A	中金中证 500 指数增强 B	中金中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	003016	025111	003578
报告期末下属分级基金的份额总额	356,608,813.56 份	2,292,770.86 份	155,872,509.71 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金,在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%,年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	本基金股票投资主要策略为标的指数投资策略,通过复制目标股票指数作为基本投资组合,然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素,找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子,并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合,最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化,力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。具体包括:1、资产配置策略;2、股票投资策略;3、存托凭证投资策略;4、债券投资策略;5、股指期货投资策略;6、参与转融通证券出借业务投资策略。详见《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金,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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	席晓峰	郭明
	联系电话	010-63211122	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95588

传真	010-66159121	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100004	100140
法定代表人	李金泽	廖林

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 500 指数增 强 A	中金中证 500 指数增 强 B	中金中证 500 指数增 强 C
本期已实现收益	152,480,685.40	904,908.85	58,294,848.84
本期利润	177,457,604.72	1,047,224.86	63,649,265.15
加权平均基金份额本期利润	0.4713	0.4714	0.4124
本期加权平均净值利润率	18.82%	18.79%	16.85%
本期基金份额净值增长率	21.09%	21.09%	20.85%
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	592,545,663.16	3,812,867.41	249,289,541.28
期末可供分配基金份额利润	1.6616	1.6630	1.5993
期末基金资产净值	987,871,839.35	6,356,506.66	421,411,572.68
期末基金份额净值	2.7702	2.7724	2.7036
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	177.02%	45.24%	150.40%

- 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 500 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	20.01%	1.52%	17.61%	1.56%	2.40%	-0.04%
过去六个月	21.09%	1.52%	19.93%	1.58%	1.16%	-0.06%
过去一年	54.06%	1.30%	49.68%	1.35%	4.38%	-0.05%
过去三年	68.45%	1.35%	48.15%	1.41%	20.30%	-0.06%
过去五年	61.54%	1.24%	31.61%	1.30%	29.93%	-0.06%
过去七年	180.95%	1.24%	78.59%	1.29%	102.36%	-0.05%
自基金合同生效起至今	177.02%	1.23%	39.54%	1.28%	137.48%	-0.05%

中金中证 500 指数增强 B

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	20.01%	1.52%	17.61%	1.56%	2.40%	-0.04%
过去六个月	21.09%	1.52%	19.93%	1.58%	1.16%	-0.06%
自基金合同生效起至今	45.24%	1.35%	42.85%	1.41%	2.39%	-0.06%

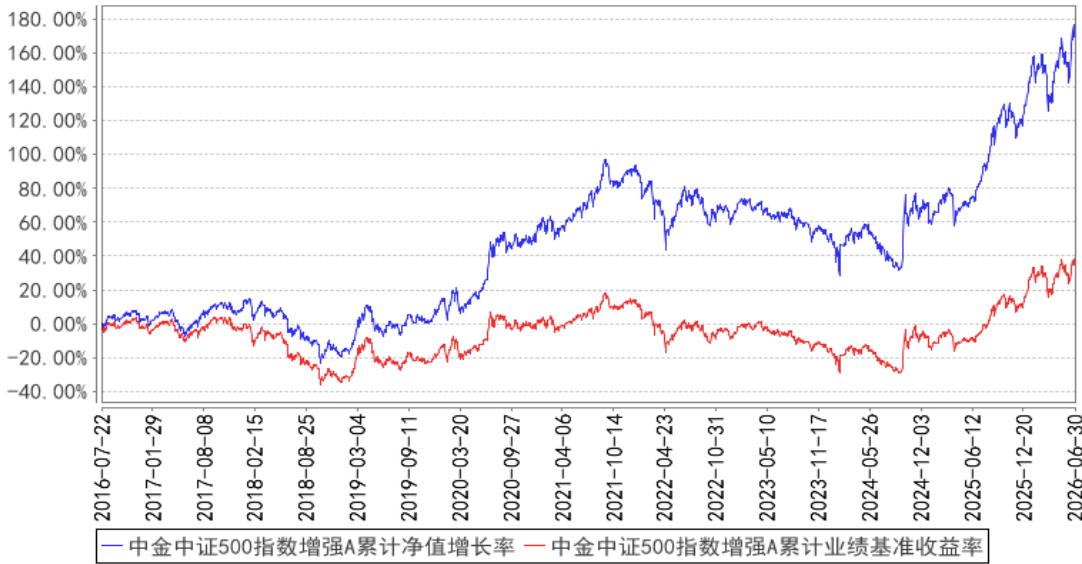
中金中证 500 指数增强 C

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	19.89%	1.52%	17.61%	1.56%	2.28%	-0.04%
过去六个月	20.85%	1.52%	19.93%	1.58%	0.92%	-0.06%
过去一年	53.45%	1.30%	49.68%	1.35%	3.77%	-0.05%
过去三年	66.45%	1.34%	48.15%	1.41%	18.30%	-0.07%
过去五年	58.34%	1.24%	31.61%	1.30%	26.73%	-0.06%
过去七年	172.10%	1.24%	78.59%	1.29%	93.51%	-0.05%
自基金合同生效起 至今	150.40%	1.25%	39.54%	1.29%	110.86 %	-0.04%

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

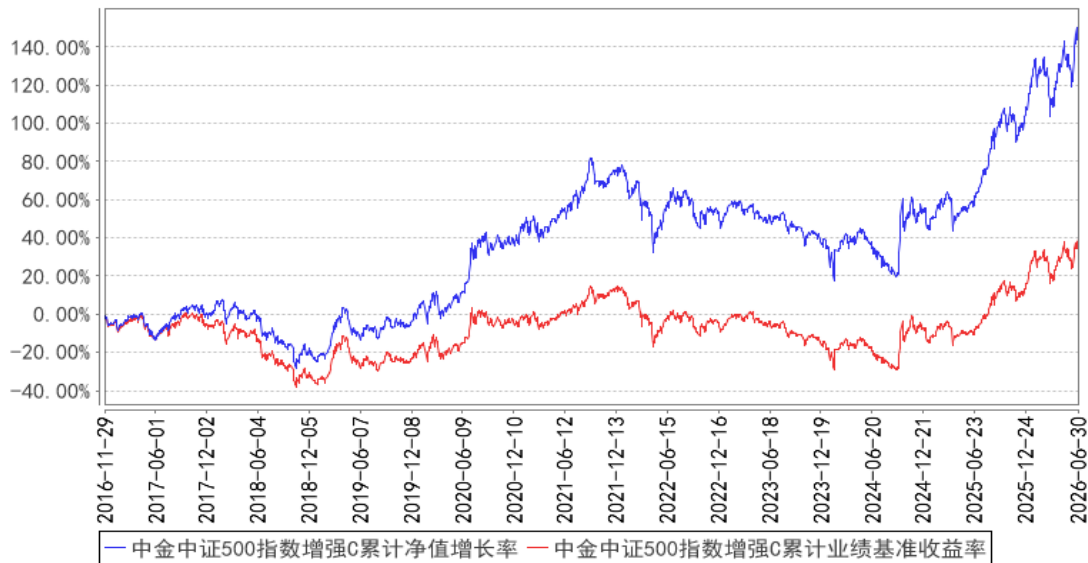
中金中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 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		
耿帅军	本基金基金经理、中金基金管理有限公司副总经理	2020 年 10 月 29 日	-	15 年	耿帅军先生，理学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司金融工程分析师；中信证券股份有限公司研究部副总裁、金融工程分析师；中国国际金融股份有限公司研究部执行总经理、金融工程分析师。现任中金基金管理有限公司副总经理、基金经理。
王家列	本基金基金经理	2026 年 2 月 4 日	-	9 年	王家列先生，金融硕士。历任泰康资产管理有限责任公司金融工程研究员；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。
王家列	本基金基金经理助理	2023 年 10 月 26 日	2026 年 2 月 4 日	9 年	王家列先生，金融硕士。历任泰康资产管理有限责任公司金融工程研究员，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、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遵规守信情况的说明

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，结构向新向好；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 500 指数增强 A 基金份额净值为 2.7702 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.09% 同期业绩基准收益率为 19.93% 中金中证 500 指数增强 B 基金份额净值为 2.7724

元，本报告期基金份额净值增长率为 21.09%，同期业绩基准收益率为 19.93%；中金中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 2.7036 元，本报告期基金份额净值增长率为 20.85%，同期业绩基准收益率为 19.93%。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——中金基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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	34,090,897.04	14,397,908.87
结算备付金		7,784,664.20	9,308,080.65
存出保证金		1,690,270.19	2,192,488.54
交易性金融资产	6.4.7.2	1,380,833,207.46	1,083,954,218.32
其中：股票投资		1,324,684,648.88	1,024,720,000.18
基金投资		-	-
债券投资		56,148,558.58	59,234,218.14
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		29,317,961.75	1,768,870.09
应收股利		-	-
应收申购款		6,631,439.13	24,169,663.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,460,348,439.77	1,135,791,229.53
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		6,000,000.00	18,000,000.00
应付清算款		32,073,117.33	7,072,083.56
应付赎回款		4,656,893.73	2,272,440.38
应付管理人报酬		553,819.79	417,330.99
应付托管费		166,145.95	125,199.31
应付销售服务费		131,330.41	79,648.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		54,284.70	34,106.28
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,072,929.17	545,081.37
负债合计		44,708,521.08	28,545,890.74
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	514,774,094.13	486,456,402.55
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	900,865,824.56	620,788,936.24
净资产合计		1,415,639,918.69	1,107,245,338.79
负债和净资产总计		1,460,348,439.77	1,135,791,229.53

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，中金中证 500 指数增强 A 的基金份额净值为 2.7702 元，期末份额总额为 356,608,813.56 份；中金中证 500 指数增强 B 的基金份额净值为 2.7724 元，期末份额总额为 2,292,770.86 份；中金中证 500 指数增强 C 的基金份额净值为 2.7036 元，期末份额总额为 155,872,509.71 份。基金份额总额 514,774,094.13 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		247,294,563.19	50,344,289.60
1. 利息收入		38,217.20	22,863.13
其中：存款利息收入	6.4.7.13	38,217.20	22,863.13
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）		216,536,710.96	37,769,584.78
其中：股票投资收益	6.4.7.14	203,575,541.18	30,470,240.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	468,466.03	246,794.48
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	4,121,055.02	-720,484.78
股利收益	6.4.7.19	8,371,648.73	7,773,034.74
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	30,473,651.64	12,481,293.20
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	245,983.39	70,548.49
减：二、营业总支出		5,140,468.46	2,784,191.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,280,685.06	1,729,694.11
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	984,205.50	518,908.22
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	744,835.94	400,944.87
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		24,260.70	20,719.04
其中：卖出回购金融资产支出		24,260.70	20,719.04
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		15,566.02	-
8. 其他费用	6.4.7.23	90,915.24	113,925.37
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		242,154,094.73	47,560,097.99
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		242,154,094.73	47,560,097.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		242,154,094.73	47,560,097.99

6.3 净资产变动表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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	486,456,402.55	-	620,788,936.24	1,107,245,338.79
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	486,456,402.55	-	620,788,936.24	1,107,245,338.79
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	28,317,691.58	-	280,076,888.32	308,394,579.90
（一）、综合收益总额	-	-	242,154,094.73	242,154,094.73
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	28,317,691.58	-	37,922,793.59	66,240,485.17
其中：1. 基金申购款	361,995,440.26	-	536,286,453.86	898,281,894.12
2. 基金赎回款	-333,677,748.68	-	-498,363,660.27	-832,041,408.95
（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	514,774,094.13	-	900,865,824.56	1,415,639,918.69
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 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	390,698,760.56	-	258,575,831.35	649,274,591.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	390,698,760.56	-	258,575,831.35	649,274,591.91
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	12,781,820.69	-	59,378,421.06	72,160,241.75
（一）、综合收益总额	-	-	47,560,097.99	47,560,097.99
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	12,781,820.69	-	11,818,323.07	24,600,143.76
其中：1. 基金申购款	169,582,966.19	-	121,762,575.40	291,345,541.59
2. 基金赎回款	-156,801,145.50	-	-109,944,252.33	-266,745,397.83
（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	403,480,581.25	-	317,954,252.41	721,434,833.66

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 500 指数增强型发起式证券投资基金(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 2016 年 7 月 5 日证监许可[2016]1517 号《关于准予中金中

证 500 指数增强型发起式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》及配套规则和《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式指数型基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）。

本基金通过中金基金直销中心、中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）及中国中金财富证券有限公司（以下简称“中金财富证券”）公开发售，于 2016 年 7 月 18 日募集。经向中国证监会备案，《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2016 年 7 月 22 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 10,001,000.00 份，发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，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申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金销售费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

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 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股（含存托凭证）。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、存托凭证、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及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）。本基金可根据法律法规的规定参与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》、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	34,090,897.04
等于：本金	34,088,080.91
加：应计利息	2,816.13
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	34,090,897.04

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		1,241,892,332.01	-	1,324,684,648.88	82,792,316.87
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	55,629,634.02	517,388.58	56,148,558.58	1,535.98
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	55,629,634.02	517,388.58	56,148,558.58	1,535.98
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,297,521,966.03	517,388.58	1,380,833,207.46	82,793,852.85

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,395,080.00	-	-	-
其中：股指期货投资	10,395,080.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,395,080.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2609	IC2609	6.00	10,513,680.00	118,600.00
合计				118,600.00
减：可抵销期货暂收款				118,600.00
净额				-

注：1、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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	987,704.12
其中：交易所市场	987,704.12

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	85,225.05
合计	1,072,929.17

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 500 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	373,305,895.05	373,305,895.05
本期申购	180,060,516.57	180,060,516.57
本期赎回（以“-”号填列）	-196,757,598.06	-196,757,598.06
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	356,608,813.56	356,608,813.56

中金中证 500 指数增强 B

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	1,992,287.91	1,992,287.91
本期申购	1,373,753.79	1,373,753.79
本期赎回（以“-”号填列）	-1,073,270.84	-1,073,270.84
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	2,292,770.86	2,292,770.86

中金中证 500 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	111,158,219.59	111,158,219.59
本期申购	180,561,169.90	180,561,169.90
本期赎回（以“-”号填列）	-135,846,879.78	-135,846,879.78
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	155,872,509.71	155,872,509.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中金中证 500 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	466,937,139.76	13,770,253.61	480,707,393.37
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	466,937,139.76	13,770,253.61	480,707,393.37
本期利润	152,480,685.40	24,976,919.32	177,457,604.72
本期基金份额交易产生的变动数	-26,872,162.00	-29,810.30	-26,901,972.30
其中：基金申购款	259,005,631.31	12,647,887.49	271,653,518.80
基金赎回款	-285,877,793.31	-12,677,697.79	-298,555,491.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	592,545,663.16	38,717,362.63	631,263,025.79

中金中证 500 指数增强 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,494,080.87	75,061.07	2,569,141.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,494,080.87	75,061.07	2,569,141.94
本期利润	904,908.85	142,316.01	1,047,224.86
本期基金份额交易产生的变动数	413,877.69	33,491.31	447,369.00
其中：基金申购款	1,985,840.08	63,945.21	2,049,785.29
基金赎回款	-1,571,962.39	-30,453.90	-1,602,416.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,812,867.41	250,868.39	4,063,735.80

中金中证 500 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	133,702,995.93	3,809,405.00	137,512,400.93
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	133,702,995.93	3,809,405.00	137,512,400.93
本期利润	58,294,848.84	5,354,416.31	63,649,265.15
本期基金份额交易产生的变动数	57,291,696.51	7,085,700.38	64,377,396.89

其中：基金申购款	249,068,425.60	13,514,724.17	262,583,149.77
基金赎回款	-191,776,729.09	-6,429,023.79	-198,205,752.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	249,289,541.28	16,249,521.69	265,539,062.97

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	25,859.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,181.14
其他	3,176.37
合计	38,217.20

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	203,575,541.18
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	203,575,541.18

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	4,375,087,880.22
减：卖出股票成本总额	4,167,034,335.78
减：交易费用	4,478,003.26
买卖股票差价收入	203,575,541.18

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	447,569.01

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	20,897.02
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	468,466.03

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	63,826,632.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	63,092,614.98
减：应计利息总额	713,120.13
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	20,897.02

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	4,121,055.02

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	8,371,648.73
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	8,371,648.73

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	30,929,054.81
股票投资	30,967,019.83
债券投资	-37,965.02
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-470,760.00
权证投资	-
期货投资	-470,760.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-15,356.83
合计	30,473,651.64

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	245,750.79

基金转换费收入	232.60
合计	245,983.39

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	-
划款手续费	5,249.49
其他	440.70
合计	90,915.24

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、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
工商银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中金财富证券	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1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(%)
中金公司	-	-	958,980,487.33	23.00

6.4.10.1.2 债券交易

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1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例(%)
中金公司	-	-	4,995,010.00	15.85

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例(%)
中金公司	-	-	66,500,000.00	35.85

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(%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1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(%)
中金公司	187,886.40	22.99	-	-

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 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,280,685.06	1,729,694.11
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,318,205.34	793,264.14
应支付基金管理人的净管理费	1,962,479.72	936,429.97

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 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

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 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	984,205.50	518,908.22

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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 500 指数增强 A	中金中证 500 指数增强 B	中金中证 500 指数增强 C	合计
	工商银行	-	-	27,620.58

中金财富证券	-	-	40,594.29	40,594.29
中金基金	-	-	562.75	562.75
合计	-	-	68,777.62	68,777.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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 500 指数增强 A	中金中证 500 指数增强 B	中金中证 500 指数增强 C	合计
工商银行	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	29,147.68	29,147.68
中金基金	-	-	5,694.76	5,694.76
合计	-	-	34,842.44	34,842.44

注：1、本基金 A 类、B 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；
2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末。其计算公式为：

$$C \text{ 类基金份额每日应计提的销售服务费} = C \text{ 类基金份额前一日基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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

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		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 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
工商银行	34,090,897.04	25,859.69	8,243,920.24	16,074.98

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，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	7,741	86,544.38
中金公司	688781	视涯科技	网下	1,082	24,539.76
中金公司	001220	世盟股份	网下	570	15,960
中金公司	688820	盛合晶微	网下	17,892	352,114.56
中金公司	001399	惠科股份	网下	15,488	156,738.56
中金公司	001248	华润新能源	网下	59,377	600,301.47
中金公司	301531	春光集团	网下	2,898	38,543.40
中金公司	688712	北芯生命	网下	4,998	87,564.96
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	688775	影石创新	网下	5,593	264,381.11

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	成功认购日	受限期	流通受	认购价格	期末估值单价	数量（单位：单位：	期末成本总额	期末估值总额	备注

	称			限 类 型			股)			
001220	世 盟 股 份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001248	华 润 新 能 源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	10.11	10.11	41,564	420,212.04	420,212.04	-
001248	华 润 新 能 源	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内(含)	新 股 流 通 受 限	10.11	10.11	17,813	180,089.43	180,089.43	-
001257	盛 龙 股 份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福 恩 股 份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天 海 电 子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维 通 利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新 股 流 通 受	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-

				限						
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,196	62,703.52	171,815.08	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏	2026	6 个月	新	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-

	明电子	年 3 月 18 日		股流通受限						
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
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	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	XD 至信	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-

	股	日		通 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	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	9 个月	新股 流通 受限	29.06	48.56	15,334	445,606.04	744,619.04	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	9 个月	新股 流通 受	8.62	57.42	38,331	330,413.22	2,200,966.02	-

				限						
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	3,150	359,982.00	2,132,361.00	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	2,263	236,845.58	1,739,998.07	-
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	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易	2026	6 个月	新	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-

	思维	年 2 月 4 日		股流通受限						
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,790	35,227.20	253,267.10	-

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 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	2,774	1,713,787.34	2,439,816.22	-

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，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 6,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金为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。

本基金的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	34,088,080.91	-	-	2,816.13	34,090,897.04
结算备付金	4,122,004.37	-	-	3,662,659.83	7,784,664.20
存出保证金	218,333.79	-	-	1,471,936.40	1,690,270.19
交易性金融资产	55,631,170.00	-	-	1,325,202,037.46	1,380,833,207.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	29,317,961.75	29,317,961.75
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	6,631,439.13	6,631,439.13
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	94,059,589.07	-	-	1,366,288,850.70	1,460,348,439.77
负债					
卖出回购金融资产款	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应付清算款	-	-	-	32,073,117.33	32,073,117.33
应付赎回款	-	-	-	4,656,893.73	4,656,893.73
应付销售服务费	-	-	-	131,330.41	131,330.41
应付管理人报酬	-	-	-	553,819.79	553,819.79
应付托管费	-	-	-	166,145.95	166,145.95
应交税费	-	-	-	54,284.70	54,284.70
其他负债	-	-	-	1,072,929.17	1,072,929.17
负债总计	6,000,000.00	-	-	38,708,521.08	44,708,521.08
利率敏感度缺口	88,059,589.07	-	-	1,327,580,329.62	1,415,639,918.69
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	14,396,031.05	-	-	1,877.82	14,397,908.87
结算备付金	2,035,199.37	-	-	7,272,881.28	9,308,080.65
存出保证金	105,021.32	-	-	2,087,467.22	2,192,488.54
交易性金融资产	58,709,000.00	-	-	1,025,245,218.32	1,083,954,218.32
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,768,870.09	1,768,870.09
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	24,169,663.06	24,169,663.06
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	75,245,251.74	-	-	-1,060,545,977.79	1,135,791,229.53
负债					
卖出回购金融资产款	18,000,000.00	-	-	-	18,000,000.00
应付清算款	-	-	-	7,072,083.56	7,072,083.56
应付赎回款	-	-	-	2,272,440.38	2,272,440.38
应付销售服务费	-	-	-	79,648.85	79,648.85
应付管理人报酬	-	-	-	417,330.99	417,330.99
应付托管费	-	-	-	125,199.31	125,199.31
应交税费	-	-	-	34,106.28	34,106.28
其他负债	-	-	-	545,081.37	545,081.37
负债总计	18,000,000.00	-	-	10,545,890.74	28,545,890.74
利率敏感度缺口	57,245,251.74	-	-	-1,050,000,087.05	1,107,245,338.79

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	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）
	市场利率下降 25 个基点	40,927.58	42,590.08
	市场利率上升 25 个基点	-40,927.58	-42,590.08

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	1,324,684,648.88	93.58	1,024,720,000.18	92.55
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	1,324,684,648.88	93.58	1,024,720,000.18	92.55

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%	66,535,076.18	52,594,153.59
	业绩比较基准下降 5%	-66,535,076.18	-52,594,153.59

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	1, 312, 777, 300. 25	1, 019, 527, 977. 83
第二层次	59, 188, 676. 27	59, 234, 218. 14
第三层次	8, 867, 230. 94	5, 192, 022. 35
合计	1, 380, 833, 207. 46	1, 083, 954, 218. 32

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	1, 324, 684, 648. 88	90. 71
	其中：股票	1, 324, 684, 648. 88	90. 71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	56, 148, 558. 58	3. 84
	其中：债券	56, 148, 558. 58	3. 84
	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	41,875,561.24	2.87
8	其他各项资产	37,639,671.07	2.58
9	合计	1,460,348,439.77	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	4,724,704.00	0.33
B	采矿业	39,314,650.25	2.78
C	制造业	992,821,277.82	70.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,716,200.80	1.89
E	建筑业	10,017,156.00	0.71
F	批发和零售业	32,187,489.79	2.27
G	交通运输、仓储和邮政业	13,453,718.00	0.95
H	住宿和餐饮业	584,675.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,502,979.97	4.98
J	金融业	64,640,198.88	4.57
K	房地产业	2,912,793.45	0.21
L	租赁和商务服务业	7,950,706.80	0.56
M	科学研究和技术服务业	8,740,568.32	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	8,256,716.60	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,870,305.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	4,466,092.80	0.32
S	综合	-	-
	合计	1,289,160,233.48	91.07

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	607,373.02	0.04
C	制造业	30,153,371.10	2.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	600,301.47	0.04
E	建筑业	228,096.00	0.02
F	批发和零售业	634,939.89	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,507,609.60	0.18
J	金融业	138.00	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	17,920.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	771,840.00	0.05
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	1,242.46	0.00
	合计	35,524,415.40	2.51

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	688498	源杰科技	12,645	23,848,470.00	1.68
2	300604	长川科技	63,200	21,577,744.00	1.52
3	001309	德明利	20,900	19,706,610.00	1.39
4	300857	协创数据	55,720	18,939,228.00	1.34
5	002008	大族激光	125,600	18,853,816.00	1.33
6	300475	香农芯创	55,700	16,710,000.00	1.18
7	300223	君正股份	61,700	15,357,130.00	1.08
8	002281	光迅科技	52,900	13,592,126.00	0.96
9	600105	永鼎股份	197,300	13,313,804.00	0.94
10	688347	华虹宏力	35,017	11,776,217.10	0.83
11	300136	信维通信	97,600	11,638,800.00	0.82
12	688002	睿创微纳	74,690	11,553,796.10	0.82
13	300054	鼎龙股份	103,700	10,989,089.00	0.78
14	300373	扬杰科技	60,781	9,556,596.63	0.68
15	688120	华海清科	29,028	9,352,241.04	0.66
16	300390	天华新能	99,400	9,294,894.00	0.66
17	300666	江丰电子	24,700	9,104,420.00	0.64
18	688469	芯联集成	853,288	9,053,385.68	0.64
19	600601	方正科技	634,100	8,775,944.00	0.62
20	002436	兴森科技	166,400	8,478,080.00	0.60
21	001389	广合科技	33,698	7,994,850.50	0.56
22	688220	翱捷科技	63,586	7,905,011.52	0.56
23	002738	中矿资源	133,500	7,875,165.00	0.56
24	688361	中科飞测	18,112	7,788,160.00	0.55
25	600498	烽火通信	105,176	7,740,953.60	0.55
26	601869	长飞光纤	14,100	7,697,190.00	0.54
27	002414	高德红外	544,634	7,221,846.84	0.51

28	002273	水晶光电	201,300	7,142,124.00	0.50
29	300285	国瓷材料	69,100	7,129,738.00	0.50
30	603256	宏和科技	26,700	7,084,311.00	0.50
31	301536	星辰科技	54,700	7,040,437.00	0.50
32	600885	宏发股份	201,335	6,944,044.15	0.49
33	300548	长芯博创	24,800	6,894,400.00	0.49
34	000703	恒逸石化	494,080	6,704,665.60	0.47
35	300395	菲利华	49,150	6,572,829.50	0.46
36	002266	浙富控股	1,294,320	6,549,259.20	0.46
37	688777	中控技术	52,940	6,220,450.00	0.44
38	301200	大族数控	17,057	6,151,607.05	0.43
39	301526	国际复材	130,500	6,090,435.00	0.43
40	300073	当升科技	126,400	6,072,256.00	0.43
41	301358	湖南裕能	80,000	6,069,600.00	0.43
42	300458	全志科技	152,980	6,036,590.80	0.43
43	601233	桐昆股份	277,900	6,016,535.00	0.43
44	002064	华峰化学	624,400	5,925,556.00	0.42
45	600884	杉杉股份	430,283	5,830,334.65	0.41
46	688313	仕佳光子	30,775	5,682,603.75	0.40
47	600166	福田汽车	1,925,700	5,603,787.00	0.40
48	301377	鼎泰高科	10,100	5,564,090.00	0.39
49	000951	中国重汽	281,800	5,497,918.00	0.39
50	300567	精测电子	17,300	5,494,480.00	0.39
51	002841	视源股份	158,600	5,476,458.00	0.39
52	002851	麦格米特	32,100	5,366,478.00	0.38
53	688599	天合光能	379,959	5,365,021.08	0.38
54	300757	罗博特科	8,600	5,323,400.00	0.38
55	300346	南大光电	57,200	5,299,580.00	0.37
56	600595	中孚实业	935,600	5,258,072.00	0.37
57	688200	华峰测控	10,000	5,251,000.00	0.37
58	002517	恺英网络	323,000	5,248,750.00	0.37
59	003031	中瓷电子	28,700	5,174,610.00	0.37
60	300037	新宙邦	55,500	5,153,175.00	0.36
61	600711	盛屯矿业	468,600	5,140,542.00	0.36
62	000021	深科技	78,700	5,058,049.00	0.36
63	688037	芯源微	11,400	5,005,170.00	0.35
64	688578	艾力斯	45,720	4,992,624.00	0.35
65	605358	立昂微	64,100	4,974,160.00	0.35
66	002271	东方雨虹	418,500	4,967,595.00	0.35
67	688387	信科移动	245,772	4,876,116.48	0.34
68	000800	一汽解放	818,900	4,872,455.00	0.34
69	300953	震裕科技	36,380	4,864,006.00	0.34
70	000960	锡业股份	112,601	4,806,936.69	0.34

71	603444	吉比特	13,400	4,802,828.00	0.34
72	002185	华天科技	214,800	4,792,188.00	0.34
73	603308	应流股份	77,200	4,662,880.00	0.33
74	688172	燕东微	55,693	4,659,276.38	0.33
75	600685	中船防务	182,700	4,647,888.00	0.33
76	300620	光库科技	12,200	4,614,040.00	0.33
77	688702	盛科通信	11,805	4,603,831.95	0.33
78	600497	驰宏锌锗	379,700	4,598,167.00	0.32
79	600499	科达制造	330,200	4,556,760.00	0.32
80	002409	雅克科技	20,200	4,534,900.00	0.32
81	002407	多氟多	89,300	4,485,539.00	0.32
82	688019	安集科技	12,962	4,400,080.52	0.31
83	600704	物产中大	927,700	4,378,744.00	0.31
84	002138	顺络电子	58,700	4,290,970.00	0.30
85	688266	泽璟制药	36,607	4,270,572.62	0.30
86	688180	君实生物	125,588	4,247,386.16	0.30
87	600535	天士力	320,300	4,237,569.00	0.30
88	600816	建元信托	1,710,300	4,173,132.00	0.29
89	300012	华测检测	298,500	4,137,210.00	0.29
90	002850	科达利	21,800	4,126,740.00	0.29
91	600879	航天电子	187,700	3,996,133.00	0.28
92	603298	杭叉集团	164,700	3,929,742.00	0.28
93	002126	银轮股份	77,400	3,854,520.00	0.27
94	688017	绿的谐波	9,200	3,844,312.00	0.27
95	603659	璞泰来	132,757	3,840,660.01	0.27
96	601608	中信重工	800,100	3,816,477.00	0.27
97	600100	同方股份	556,700	3,813,395.00	0.27
98	600157	永泰能源	2,362,300	3,803,303.00	0.27
99	300058	蓝色光标	271,680	3,738,316.80	0.26
100	300017	网宿科技	286,904	3,732,621.04	0.26
101	000709	河钢股份	1,923,500	3,731,590.00	0.26
102	688385	复旦微电	52,211	3,722,122.19	0.26
103	002340	格林美	556,500	3,678,465.00	0.26
104	601108	财通证券	418,100	3,616,565.00	0.26
105	600808	马钢股份	1,446,500	3,616,250.00	0.26
106	603077	和邦生物	1,551,000	3,598,320.00	0.25
107	603156	养元饮品	71,900	3,528,133.00	0.25
108	300919	中伟新材	80,600	3,526,250.00	0.25
109	688629	华丰科技	18,803	3,525,750.53	0.25
110	600988	赤峰黄金	133,232	3,506,666.24	0.25
111	002155	湖南黄金	146,810	3,504,354.70	0.25
112	002756	永兴材料	61,600	3,489,024.00	0.25
113	300751	迈为股份	12,200	3,446,012.00	0.24

114	600008	首创环保	1,261,800	3,432,096.00	0.24
115	300432	富临精工	167,100	3,357,039.00	0.24
116	600546	山煤国际	305,600	3,340,208.00	0.24
117	600298	安琪酵母	89,324	3,233,528.80	0.23
118	300207	欣旺达	169,817	3,224,824.83	0.23
119	002812	恩捷股份	48,100	3,218,371.00	0.23
120	300146	汤臣倍健	351,800	3,180,272.00	0.22
121	300454	深信服	32,800	3,155,360.00	0.22
122	688561	奇安信	131,518	3,153,801.64	0.22
123	002152	广电运通	333,800	3,131,044.00	0.22
124	688099	晶晨股份	30,045	3,091,630.50	0.22
125	000519	中兵红箭	146,500	3,086,755.00	0.22
126	300570	太辰光	12,400	3,059,204.00	0.22
127	600606	绿地控股	2,524,900	3,055,129.00	0.22
128	600060	海信视像	109,600	3,054,552.00	0.22
129	600352	浙江龙盛	247,300	2,994,803.00	0.21
130	600909	华安证券	269,000	2,988,590.00	0.21
131	600392	盛和资源	99,700	2,968,069.00	0.21
132	600517	国网英大	634,100	2,967,588.00	0.21
133	689009	九号公司	77,779	2,967,268.85	0.21
134	000831	中国稀土	52,800	2,929,872.00	0.21
135	002487	大金重工	49,900	2,892,703.00	0.20
136	000783	长江证券	295,900	2,885,025.00	0.20
137	605589	圣泉集团	45,000	2,860,650.00	0.20
138	000683	博源化工	487,600	2,808,576.00	0.20
139	000750	国海证券	756,800	2,785,024.00	0.20
140	000733	振华科技	48,600	2,752,704.00	0.19
141	600390	五矿资本	600,100	2,736,456.00	0.19
142	601179	中国西电	182,200	2,718,424.00	0.19
143	600699	均胜电子	124,453	2,689,429.33	0.19
144	000629	钒钛股份	802,700	2,681,018.00	0.19
145	600598	北大荒	244,600	2,651,464.00	0.19
146	000050	深天马 A	267,000	2,645,970.00	0.19
147	002120	韵达股份	415,300	2,641,308.00	0.19
148	688234	天岳先进	15,217	2,640,301.67	0.19
149	000739	普洛药业	158,400	2,638,944.00	0.19
150	002195	岩山科技	403,200	2,636,928.00	0.19
151	000893	亚钾国际	64,000	2,616,960.00	0.18
152	688778	厦钨新能	48,088	2,615,987.20	0.18
153	600369	西南证券	644,400	2,590,488.00	0.18
154	600871	石化油服	1,265,700	2,569,371.00	0.18
155	600141	兴发集团	54,700	2,569,259.00	0.18
156	002203	海亮股份	112,000	2,559,200.00	0.18

157	002261	拓维信息	89,600	2,509,696.00	0.18
158	601699	潞安环能	173,800	2,481,864.00	0.18
159	603816	顾家家居	109,830	2,455,798.80	0.17
160	301611	珂玛科技	13,600	2,448,952.00	0.17
161	002966	苏州银行	351,300	2,445,048.00	0.17
162	603379	三美股份	32,185	2,442,519.65	0.17
163	000623	吉林敖东	137,580	2,439,293.40	0.17
164	601615	明阳智能	210,600	2,436,642.00	0.17
165	688235	百济神州	9,477	2,412,938.97	0.17
166	600332	白云山	120,300	2,410,812.00	0.17
167	300972	万辰集团	13,800	2,393,058.00	0.17
168	603858	步长制药	162,740	2,376,004.00	0.17
169	688166	博瑞医药	67,401	2,359,709.01	0.17
170	600143	金发科技	152,400	2,354,580.00	0.17
171	688052	纳芯微	8,155	2,351,168.05	0.17
172	601958	金钼股份	83,421	2,344,964.31	0.17
173	600998	九州通	498,792	2,339,334.48	0.17
174	601997	贵阳银行	455,300	2,335,689.00	0.16
175	688411	海博思创	8,000	2,329,600.00	0.16
176	600109	国金证券	264,400	2,321,432.00	0.16
177	603699	纽威股份	45,825	2,304,997.50	0.16
178	002821	凯莱英	14,172	2,295,864.00	0.16
179	003022	联泓新科	88,600	2,294,740.00	0.16
180	002131	利欧股份	481,400	2,286,650.00	0.16
181	601555	东吴证券	288,300	2,283,336.00	0.16
182	688027	国盾量子	4,511	2,273,589.11	0.16
183	688475	萤石网络	82,144	2,246,638.40	0.16
184	000967	盈峰环境	211,500	2,227,095.00	0.16
185	601139	深圳燃气	392,000	2,218,720.00	0.16
186	300957	贝泰妮	70,200	2,212,002.00	0.16
187	000987	越秀资本	280,500	2,193,510.00	0.15
188	688772	珠海冠宇	111,536	2,189,451.68	0.15
189	600380	健康元	231,900	2,184,498.00	0.15
190	300339	润和软件	56,700	2,183,517.00	0.15
191	688213	思特威	19,924	2,133,262.68	0.15
192	000034	神州数码	76,840	2,132,310.00	0.15
193	300759	康龙化成	73,700	2,132,141.00	0.15
194	002465	海格通信	165,800	2,117,266.00	0.15
195	002444	巨星科技	67,100	2,086,810.00	0.15
196	600901	江苏金租	362,600	2,084,950.00	0.15
197	600131	国网信通	142,800	2,084,880.00	0.15
198	601128	常熟银行	358,084	2,084,048.88	0.15
199	688538	和辉光电	799,400	2,078,440.00	0.15

200	000878	云南铜业	130,600	2,073,928.00	0.15
201	002299	圣农发展	136,500	2,069,340.00	0.15
202	002410	广联达	253,140	2,065,622.40	0.15
203	300496	中科创达	33,200	2,051,428.00	0.14
204	688122	西部超导	32,322	2,030,144.82	0.14
205	002797	第一创业	305,300	2,005,821.00	0.14
206	300001	特锐德	52,600	1,989,858.00	0.14
207	688728	格科微	94,448	1,987,185.92	0.14
208	002683	广东宏大	67,800	1,985,862.00	0.14
209	688676	金盘科技	23,258	1,968,557.12	0.14
210	002601	龙佰集团	118,900	1,959,472.00	0.14
211	603129	春风动力	7,600	1,944,080.00	0.14
212	600378	昊华科技	25,700	1,937,266.00	0.14
213	002078	太阳纸业	154,500	1,929,705.00	0.14
214	000932	华菱钢铁	552,200	1,916,134.00	0.14
215	002429	兆驰股份	182,800	1,899,292.00	0.13
216	300115	长盈精密	67,300	1,880,362.00	0.13
217	000729	燕京啤酒	185,400	1,878,102.00	0.13
218	601991	大唐发电	264,500	1,872,660.00	0.13
219	603345	安井食品	23,300	1,868,427.00	0.13
220	600329	达仁堂	50,000	1,861,000.00	0.13
221	002624	完美世界	148,800	1,848,096.00	0.13
222	601717	中创智领	132,033	1,836,579.03	0.13
223	688322	奥比中光	14,067	1,836,446.85	0.13
224	688192	迪哲医药	45,760	1,827,196.80	0.13
225	601665	齐鲁银行	315,800	1,822,166.00	0.13
226	688301	奕瑞科技	14,628	1,813,872.00	0.13
227	600563	法拉电子	9,500	1,812,600.00	0.13
228	000060	中金岭南	238,400	1,804,688.00	0.13
229	603606	东方电缆	43,240	1,794,892.40	0.13
230	601880	辽港股份	1,287,100	1,776,198.00	0.13
231	603179	新泉股份	35,580	1,766,547.00	0.12
232	688349	三一重能	115,493	1,753,183.74	0.12
233	600170	上海建工	778,700	1,728,714.00	0.12
234	601162	天风证券	512,900	1,728,473.00	0.12
235	603650	彤程新材	17,600	1,724,448.00	0.12
236	300024	机器人	89,000	1,720,370.00	0.12
237	300142	沃森生物	132,100	1,715,979.00	0.12
238	002603	以岭药业	113,800	1,707,000.00	0.12
239	601696	中银证券	133,900	1,693,835.00	0.12
240	002130	沃尔核材	89,300	1,693,128.00	0.12
241	600820	隧道股份	323,600	1,685,956.00	0.12
242	601099	太平洋	495,600	1,670,172.00	0.12

243	688331	荣昌生物	12,694	1,653,520.44	0.12
244	002402	和而泰	63,700	1,645,371.00	0.12
245	002432	九安医疗	23,200	1,639,776.00	0.12
246	000997	新大陆	100,100	1,631,630.00	0.12
247	000983	山西焦煤	280,600	1,627,480.00	0.11
248	601212	白银有色	317,700	1,613,916.00	0.11
249	601399	国机重装	460,100	1,610,350.00	0.11
250	002056	横店东磁	52,799	1,609,313.52	0.11
251	002461	珠江啤酒	210,800	1,595,756.00	0.11
252	601106	中国一重	482,700	1,592,910.00	0.11
253	300623	捷捷微电	35,400	1,592,646.00	0.11
254	603688	石英股份	19,200	1,586,112.00	0.11
255	002335	科华数据	37,250	1,581,262.50	0.11
256	600765	中航重机	122,300	1,580,116.00	0.11
257	603979	金诚信	26,700	1,576,101.00	0.11
258	600582	天地科技	354,000	1,575,300.00	0.11
259	600256	广汇能源	318,400	1,572,896.00	0.11
260	300474	景嘉微	26,000	1,572,480.00	0.11
261	600153	建发股份	198,000	1,570,140.00	0.11
262	000661	长春高新	23,200	1,545,120.00	0.11
263	000032	深桑达 A	61,900	1,544,405.00	0.11
264	688188	柏楚电子	14,445	1,541,281.50	0.11
265	300763	锦浪科技	17,000	1,535,950.00	0.11
266	600021	上海电力	100,600	1,516,042.00	0.11
267	300748	金力永磁	48,600	1,499,310.00	0.11
268	601577	长沙银行	171,900	1,497,249.00	0.11
269	600521	华海药业	103,800	1,494,720.00	0.11
270	002065	东华软件	207,700	1,482,978.00	0.10
271	002568	百润股份	87,500	1,480,500.00	0.10
272	002157	正邦科技	525,600	1,476,936.00	0.10
273	603920	世运电路	30,600	1,470,024.00	0.10
274	688343	云天励飞	18,000	1,469,880.00	0.10
275	001203	大中矿业	48,900	1,464,555.00	0.10
276	600339	中油工程	476,500	1,462,855.00	0.10
277	000423	东阿阿胶	32,080	1,455,148.80	0.10
278	603087	甘李药业	25,500	1,447,380.00	0.10
279	000728	国元证券	190,400	1,426,096.00	0.10
280	002252	上海莱士	328,100	1,423,954.00	0.10
281	000039	中集集团	175,400	1,422,494.00	0.10
282	688608	恒玄科技	8,480	1,417,771.20	0.10
283	002025	航天电器	18,500	1,410,070.00	0.10
284	688169	石头科技	14,800	1,405,556.00	0.10
285	002472	双环传动	33,600	1,394,736.00	0.10

286	300724	捷佳伟创	19,733	1,393,149.80	0.10
287	601216	君正集团	304,400	1,357,624.00	0.10
288	600801	华新建材	87,000	1,357,200.00	0.10
289	603119	浙江荣泰	20,300	1,346,702.00	0.10
290	688375	国博电子	12,785	1,333,475.50	0.09
291	603225	新凤鸣	67,500	1,326,375.00	0.09
292	000786	北新建材	72,700	1,315,143.00	0.09
293	002831	裕同科技	36,668	1,303,914.08	0.09
294	603290	斯达半导	8,500	1,299,990.00	0.09
295	603338	浙江鼎力	30,400	1,292,000.00	0.09
296	600171	上海贝岭	40,265	1,286,064.10	0.09
297	300677	英科医疗	32,700	1,280,859.00	0.09
298	688018	乐鑫科技	10,005	1,279,839.60	0.09
299	688187	时代电气	18,600	1,277,076.00	0.09
300	300383	光环新网	102,200	1,271,368.00	0.09
301	300679	电连技术	21,100	1,265,789.00	0.09
302	002673	西部证券	194,800	1,264,252.00	0.09
303	603806	福斯特	74,100	1,244,139.00	0.09
304	603233	大参林	82,677	1,242,635.31	0.09
305	002945	华林证券	92,400	1,240,932.00	0.09
306	000155	川能动力	103,300	1,237,534.00	0.09
307	600177	雅戈尔	164,300	1,237,179.00	0.09
308	688065	凯赛生物	25,725	1,230,941.25	0.09
309	600038	中直股份	48,500	1,226,565.00	0.09
310	603160	汇顶科技	19,800	1,221,858.00	0.09
311	000559	万向钱潮	94,400	1,220,592.00	0.09
312	601098	中南传媒	123,500	1,215,240.00	0.09
313	600642	申能股份	138,900	1,212,597.00	0.09
314	600486	扬农化工	23,900	1,211,730.00	0.09
315	600995	南网储能	97,700	1,201,710.00	0.08
316	002500	山西证券	231,500	1,194,540.00	0.08
317	688568	中科星图	28,692	1,189,857.24	0.08
318	600637	东方明珠	143,100	1,189,161.00	0.08
319	300699	光威复材	41,422	1,186,740.30	0.08
320	600707	彩虹股份	69,700	1,177,233.00	0.08
321	002085	万丰奥威	105,900	1,174,431.00	0.08
322	001696	宗申动力	56,300	1,171,603.00	0.08
323	300558	贝达药业	17,900	1,164,753.00	0.08
324	300676	华大基因	33,199	1,163,956.94	0.08
325	002318	久立特材	48,700	1,163,930.00	0.08
326	002739	儒意电影	120,100	1,152,960.00	0.08
327	601156	东航物流	71,500	1,152,580.00	0.08
328	600516	方大炭素	185,400	1,143,918.00	0.08

329	300627	华测导航	39,880	1,132,592.00	0.08
330	600536	中国软件	39,794	1,119,007.28	0.08
331	002044	美年健康	222,300	1,118,169.00	0.08
332	603596	伯特利	44,563	1,106,944.92	0.08
333	688617	惠泰医疗	6,064	1,100,979.84	0.08
334	002223	鱼跃医疗	42,800	1,098,248.00	0.08
335	000400	许继电气	50,600	1,098,020.00	0.08
336	300003	乐普医疗	92,000	1,090,200.00	0.08
337	600562	国睿科技	51,200	1,086,464.00	0.08
338	601016	节能风电	278,700	1,081,356.00	0.08
339	600985	淮北矿业	76,800	1,079,040.00	0.08
340	002430	杭氧股份	34,843	1,078,739.28	0.08
341	000528	柳 工	142,000	1,072,100.00	0.08
342	600862	中航高科	59,332	1,069,755.96	0.08
343	688281	华秦科技	21,259	1,067,839.57	0.08
344	300487	蓝晓科技	18,100	1,065,185.00	0.08
345	000825	太钢不锈	309,000	1,053,690.00	0.07
346	601990	南京证券	159,700	1,049,229.00	0.07
347	600863	华能蒙电	223,200	1,049,040.00	0.07
348	600970	中材国际	146,900	1,047,397.00	0.07
349	603766	隆鑫通用	87,500	1,043,875.00	0.07
350	600348	华阳股份	136,400	1,043,460.00	0.07
351	601001	晋控煤业	59,400	1,032,966.00	0.07
352	002265	建设工业	59,200	1,030,080.00	0.07
353	600873	梅花生物	139,500	1,025,325.00	0.07
354	600312	平高电气	57,700	1,018,982.00	0.07
355	603605	珀莱雅	16,900	1,012,648.00	0.07
356	000887	中鼎股份	56,300	1,007,207.00	0.07
357	688297	中无人机	23,995	996,992.25	0.07
358	603565	中谷物流	101,300	993,753.00	0.07
359	600927	永安期货	78,800	981,060.00	0.07
360	002939	长城证券	117,400	979,116.00	0.07
361	600062	华润双鹤	61,000	978,440.00	0.07
362	000830	鲁西化工	81,395	976,740.00	0.07
363	601611	中国核建	85,700	955,555.00	0.07
364	688615	合合信息	8,435	953,998.50	0.07
365	000062	深圳华强	29,900	951,418.00	0.07
366	002007	华兰生物	78,000	950,820.00	0.07
367	688692	达梦数据	3,891	950,532.39	0.07
368	000937	冀中能源	238,450	949,031.00	0.07
369	600583	海油工程	185,800	934,574.00	0.07
370	002926	华西证券	113,900	930,563.00	0.07
371	688582	芯动联科	14,238	925,470.00	0.07

372	601799	星宇股份	10,200	924,324.00	0.07
373	600578	京能电力	142,784	920,956.80	0.07
374	688114	华大智造	17,760	907,180.80	0.06
375	000921	海信家电	33,000	901,560.00	0.06
376	603568	伟明环保	58,280	896,346.40	0.06
377	000737	北方铜业	67,800	896,316.00	0.06
378	000591	太阳能	194,500	894,700.00	0.06
379	600398	海澜之家	170,600	892,238.00	0.06
380	000598	兴蓉环境	138,700	890,454.00	0.06
381	601000	唐山港	210,300	872,745.00	0.06
382	301606	绿联科技	14,200	866,484.00	0.06
383	600208	衢州发展	302,615	856,400.45	0.06
384	600316	洪都航空	30,600	854,964.00	0.06
385	000738	航发控制	46,700	854,143.00	0.06
386	603341	龙旗科技	20,100	854,049.00	0.06
387	600848	上海临港	113,700	851,613.00	0.06
388	600435	北方导航	75,400	844,480.00	0.06
389	688248	南网科技	12,141	839,914.38	0.06
390	001286	陕西能源	82,600	837,564.00	0.06
391	601198	东兴证券	61,500	835,785.00	0.06
392	603486	科沃斯	16,400	832,300.00	0.06
393	600764	中国海防	47,200	822,696.00	0.06
394	600161	天坛生物	70,400	815,232.00	0.06
395	002262	恩华药业	43,467	815,006.25	0.06
396	600483	福能股份	79,000	805,010.00	0.06
397	600282	南钢股份	175,300	804,627.00	0.06
398	603885	吉祥航空	78,000	802,620.00	0.06
399	000009	中国宝安	127,700	795,571.00	0.06
400	000027	深圳能源	127,100	788,020.00	0.06
401	688295	中复神鹰	12,912	781,692.48	0.06
402	603939	益丰药房	43,100	774,938.00	0.05
403	000582	北部湾港	71,600	768,268.00	0.05
404	601666	平煤股份	106,200	759,330.00	0.05
405	600763	通策医疗	22,200	752,136.00	0.05
406	000513	丽珠集团	26,000	751,140.00	0.05
407	601567	三星电气	50,100	748,494.00	0.05
408	002312	川发龙蟒	80,400	737,268.00	0.05
409	600602	云赛智联	45,800	736,464.00	0.05
410	000723	美锦能源	219,800	736,330.00	0.05
411	688318	财富趋势	10,320	735,919.20	0.05
412	600132	重庆啤酒	17,300	714,490.00	0.05
413	601865	福莱特	67,500	709,425.00	0.05
414	600098	广州发展	120,000	709,200.00	0.05

415	600906	财达证券	94,500	704,970.00	0.05
416	601236	红塔证券	102,900	701,778.00	0.05
417	600511	国药股份	26,800	697,872.00	0.05
418	600977	中国电影	53,500	691,220.00	0.05
419	688336	三生国健	12,735	676,228.50	0.05
420	300100	双林股份	24,278	674,442.84	0.05
421	002244	滨江集团	88,700	674,120.00	0.05
422	600967	内蒙一机	60,400	655,340.00	0.05
423	300735	光弘科技	28,700	652,638.00	0.05
424	300718	长盛轴承	10,700	652,379.00	0.05
425	600737	中粮糖业	52,900	652,257.00	0.05
426	300144	宋城演艺	112,000	650,720.00	0.05
427	000883	湖北能源	150,200	648,864.00	0.05
428	603728	鸣志电器	10,401	633,628.92	0.04
429	600095	湘财股份	83,000	624,990.00	0.04
430	688278	特宝生物	11,422	621,356.80	0.04
431	688363	华熙生物	17,149	613,419.73	0.04
432	601866	中远海发	276,200	610,402.00	0.04
433	603737	三棵树	25,252	608,573.20	0.04
434	000088	盐田港	147,800	604,502.00	0.04
435	002583	海能达	78,600	604,434.00	0.04
436	600363	联创光电	16,700	597,526.00	0.04
437	601118	海南橡胶	121,200	596,304.00	0.04
438	003021	兆威机电	6,800	593,980.00	0.04
439	600566	济川药业	26,600	590,254.00	0.04
440	600126	杭钢股份	96,000	588,480.00	0.04
441	600754	锦江酒店	32,500	584,675.00	0.04
442	603000	人民网	39,200	579,768.00	0.04
443	002984	森麒麟	44,056	575,811.92	0.04
444	600655	豫园股份	138,000	567,180.00	0.04
445	002508	老板电器	38,500	562,870.00	0.04
446	603589	口子窖	30,000	560,400.00	0.04
447	600299	安迪苏	70,500	553,425.00	0.04
448	601598	中国外运	110,300	547,088.00	0.04
449	603899	晨光股份	26,200	540,506.00	0.04
450	002423	中粮资本	65,300	537,419.00	0.04
451	600350	山东高速	48,200	536,466.00	0.04
452	002773	康弘药业	26,200	535,790.00	0.04
453	601966	玲珑轮胎	52,300	532,937.00	0.04
454	600663	陆家嘴	84,500	530,660.00	0.04
455	600004	白云机场	73,000	529,980.00	0.04
456	300888	稳健医疗	18,700	523,413.00	0.04
457	688709	成都华微	13,501	514,253.09	0.04

458	000429	粤高速 A	37,100	506,415.00	0.04
459	002153	石基信息	68,800	497,424.00	0.04
460	688563	航材股份	9,578	490,680.94	0.03
461	600292	电投水电	40,000	481,600.00	0.03
462	600968	海油发展	144,200	480,186.00	0.03
463	601928	凤凰传媒	54,000	474,660.00	0.03
464	003035	南网能源	80,300	467,346.00	0.03
465	002670	国盛证券	42,300	465,300.00	0.03
466	600688	上海石化	157,400	461,182.00	0.03
467	688425	铁建重工	114,355	459,707.10	0.03
468	601808	中海油服	42,400	458,344.00	0.03
469	002032	苏泊尔	11,400	451,440.00	0.03
470	600295	鄂尔多斯	41,900	449,168.00	0.03
471	688708	佳驰科技	8,629	438,353.20	0.03
472	000539	粤电力 A	63,600	433,116.00	0.03
473	000537	绿发电力	58,300	426,173.00	0.03
474	600377	宁沪高速	35,100	406,107.00	0.03
475	601298	青岛港	50,200	404,110.00	0.03
476	603833	欧派家居	12,900	388,419.00	0.03
477	000959	首钢股份	109,900	385,749.00	0.03
478	301301	川宁生物	47,800	379,532.00	0.03
479	002608	江苏国信	54,000	372,600.00	0.03
480	600032	浙江新能	51,700	364,485.00	0.03
481	603529	爱玛科技	18,650	363,861.50	0.03
482	000785	居然智家	177,800	355,600.00	0.03
483	603786	科博达	8,600	351,826.00	0.02
484	603658	安图生物	12,100	351,142.00	0.02
485	301498	乖宝宠物	8,400	340,956.00	0.02
486	688520	神州细胞	9,939	340,013.19	0.02
487	688819	天能股份	15,315	339,993.00	0.02
488	300140	节能环保	66,300	329,511.00	0.02
489	000898	鞍钢股份	169,900	317,713.00	0.02
490	603049	中策橡胶	6,900	309,189.00	0.02
491	601228	广州港	106,800	301,176.00	0.02
492	603175	超颖电子	3,200	285,088.00	0.02
493	601019	山东出版	43,952	281,292.80	0.02
494	601112	振石股份	13,600	247,928.00	0.02
495	603092	德力佳	2,600	140,322.00	0.01
496	001221	悍高集团	2,900	116,638.00	0.01
497	001386	马可波罗	7,700	109,032.00	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

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	688072	拓荆科技	2,774	2,439,816.22	0.17
2	688783	西安奕材	38,331	2,200,966.02	0.16
3	688795	摩尔线程	3,150	2,132,361.00	0.15
4	300308	中际旭创	1,400	1,778,000.00	0.13
5	688802	沐曦股份	2,263	1,739,998.07	0.12
6	688257	新锐股份	16,761	1,707,945.90	0.12
7	688110	东芯股份	7,181	1,462,769.70	0.10
8	688416	恒烁股份	8,197	1,147,580.00	0.08
9	603991	领先股份	7,900	1,115,085.00	0.08
10	600288	大恒科技	78,000	1,037,400.00	0.07
11	002558	巨人网络	36,500	1,005,940.00	0.07
12	688221	前沿生物	40,884	915,801.60	0.06
13	603986	兆易创新	1,100	896,500.00	0.06
14	688525	佰维存储	1,766	873,693.18	0.06
15	000933	神火股份	40,200	852,240.00	0.06
16	688766	普冉股份	1,094	838,660.40	0.06
17	000657	中钨高新	8,700	832,764.00	0.06
18	603588	高能环境	40,200	771,840.00	0.05
19	688765	禾元生物	15,334	744,619.04	0.05
20	001248	华润新能源	59,377	600,301.47	0.04
21	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.04
22	002439	启明星辰	44,200	559,130.00	0.04
23	688609	九联科技	46,593	512,988.93	0.04
24	301308	江波龙	700	492,660.00	0.03
25	300084	海默科技	35,600	428,268.00	0.03
26	300137	先河环保	23,800	415,072.00	0.03
27	300358	楚天科技	51,800	414,400.00	0.03
28	300022	吉峰科技	50,100	389,277.00	0.03
29	000553	安道麦 A	67,500	361,125.00	0.03
30	600718	东软集团	48,700	352,588.00	0.02
31	300741	华宝股份	27,300	341,796.00	0.02
32	300323	华灿光电	16,400	334,560.00	0.02
33	002396	星网锐捷	14,800	283,716.00	0.02
34	601279	英利汽车	89,700	273,585.00	0.02
35	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
36	688820	盛合晶微	1,790	253,267.10	0.02
37	600487	亨通光电	2,300	251,482.00	0.02
38	002378	章源钨业	7,400	247,752.00	0.02
39	600739	辽宁成大	24,299	245,662.89	0.02
40	601068	中铝国际	52,800	228,096.00	0.02
41	603045	福达合金	3,100	221,309.00	0.02
42	300440	运达科技	10,300	219,699.00	0.02
43	002384	东山精密	800	209,880.00	0.01

44	688232	新点软件	11,600	206,248.00	0.01
45	600320	振华重工	43,000	177,590.00	0.01
46	001399	惠科股份	6,196	171,815.08	0.01
47	603876	鼎胜新材	6,200	161,262.00	0.01
48	000599	青岛双星	35,100	148,122.00	0.01
49	601899	紫金矿业	5,600	140,784.00	0.01
50	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
51	600176	中国巨石	1,600	116,608.00	0.01
52	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
53	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
54	002695	煌上煌	8,200	83,230.00	0.01
55	688519	南亚新材	179	68,027.16	0.00
56	002602	世纪华通	4,400	62,040.00	0.00
57	688521	芯原股份	166	61,609.24	0.00
58	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
59	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
60	002228	合兴包装	14,000	41,160.00	0.00
61	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
62	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
63	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
64	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
65	688368	晶丰明源	114	24,683.28	0.00
66	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
67	688686	奥普特	125	21,048.75	0.00
68	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
69	688090	瑞松科技	180	19,161.00	0.00
70	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
71	688131	皓元医药	166	15,703.60	0.00
72	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
73	688559	海目星	182	15,273.44	0.00
74	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
75	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
76	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
77	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
78	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
79	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
80	301338	凯格精机	80	13,031.20	0.00
81	688261	东微半导	121	12,696.53	0.00
82	688032	禾迈股份	148	12,508.96	0.00
83	688677	海泰新光	120	12,135.60	0.00
84	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
85	688378	奥来德	183	11,346.00	0.00
86	688388	嘉元科技	256	11,264.00	0.00

87	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
88	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
89	688049	炬芯科技	194	9,100.54	0.00
90	688216	气派科技	196	8,233.96	0.00
91	688249	晶合集成	139	8,205.17	0.00
92	688516	奥特维	140	8,034.60	0.00
93	688001	华兴源创	93	7,970.10	0.00
94	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
95	688023	安恒信息	157	5,765.04	0.00
96	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
97	301608	博实结	96	4,824.96	0.00
98	688062	迈威生物	163	4,604.75	0.00
99	301662	宏工科技	45	4,559.40	0.00
100	688005	容百科技	148	4,528.80	0.00
101	688100	威胜信息	147	4,496.73	0.00
102	688208	道通科技	173	4,357.87	0.00
103	688557	兰剑智能	139	4,313.17	0.00
104	688196	卓越新能	120	4,308.00	0.00
105	688720	艾森股份	40	4,040.00	0.00
106	300502	新易盛	6	3,642.00	0.00
107	300573	兴齐眼药	89	3,627.64	0.00
108	688357	建龙微纳	115	3,389.05	0.00
109	688128	中国电研	131	3,109.94	0.00
110	688633	星球石墨	100	2,973.00	0.00
111	688310	迈得医疗	193	2,966.41	0.00
112	600150	中国船舶	87	2,939.73	0.00
113	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
114	002595	豪迈科技	60	2,796.00	0.00
115	688443	智翔金泰	120	2,790.00	0.00
116	002294	信立泰	86	2,742.54	0.00
117	300756	金马游乐	80	2,644.00	0.00
118	688365	光云科技	167	2,633.59	0.00
119	688369	致远互联	124	2,605.24	0.00
120	688276	百克生物	186	2,592.84	0.00
121	688173	希荻微	128	2,449.92	0.00
122	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
123	300450	先导智能	58	2,361.76	0.00
124	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
125	688179	阿拉丁	80	2,216.80	0.00
126	688533	上声电子	106	2,211.16	0.00
127	688499	利元亨	42	2,207.10	0.00
128	601168	西部矿业	80	2,171.20	0.00
129	688108	赛诺医疗	109	2,019.77	0.00

130	688183	生益电子	15	1,986.00	0.00
131	688567	孚能科技	189	1,984.50	0.00
132	002202	金风科技	71	1,696.90	0.00
133	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
134	002837	英维克	20	1,591.20	0.00
135	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
136	688015	交控科技	102	1,568.76	0.00
137	688660	电气风电	167	1,439.54	0.00
138	688658	悦康药业	105	1,350.30	0.00
139	600580	卧龙电驱	40	1,324.00	0.00
140	600673	东阳光	37	1,242.46	0.00
141	603927	中科软	93	1,182.03	0.00
142	688588	凌志软件	114	1,036.26	0.00
143	688055	龙腾光电	113	650.88	0.00
144	002532	天山铝业	60	643.80	0.00
145	000563	陕国投 A	50	138.00	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	688498	源杰科技	33,727,027.26	3.05
2	600988	赤峰黄金	31,423,900.62	2.84
3	300604	长川科技	28,466,168.00	2.57
4	002008	大族激光	28,239,954.11	2.55
5	600487	亨通光电	28,040,641.00	2.53
6	300450	先导智能	26,629,395.00	2.41
7	002738	中矿资源	26,438,187.00	2.39
8	300857	协创数据	25,944,341.60	2.34
9	300373	扬杰科技	25,581,365.12	2.31
10	600808	马钢股份	25,381,184.00	2.29
11	688525	佰维存储	25,011,424.52	2.26
12	000951	中国重汽	24,507,346.00	2.21
13	002436	兴森科技	24,377,349.16	2.20
14	000933	神火股份	24,342,481.00	2.20
15	300475	香农芯创	23,045,405.92	2.08
16	600549	厦门钨业	21,775,479.00	1.97
17	601168	西部矿业	21,671,946.00	1.96
18	002138	顺络电子	21,419,175.00	1.93
19	002532	天山铝业	21,081,314.00	1.90
20	600885	宏发股份	20,509,912.80	1.85

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	600549	厦门钨业	45,704,930.00	4.13
2	600487	亨通光电	45,108,204.36	4.07
3	000657	中钨高新	39,197,541.00	3.54
4	688525	佰维存储	36,112,530.81	3.26
5	600988	赤峰黄金	33,684,506.58	3.04
6	002008	大族激光	33,413,712.00	3.02
7	300373	扬杰科技	32,751,266.31	2.96
8	002436	兴森科技	29,097,857.74	2.63
9	000933	神火股份	28,207,428.28	2.55
10	300604	长川科技	26,958,143.00	2.43
11	000426	兴业银锡	26,011,050.19	2.35
12	002281	光迅科技	25,880,792.00	2.34
13	600098	广州发展	25,774,166.00	2.33
14	000951	中国重汽	25,723,694.40	2.32
15	300857	协创数据	25,605,475.20	2.31
16	002080	中材科技	25,452,926.00	2.30
17	300450	先导智能	25,316,789.65	2.29
18	002138	顺络电子	25,067,119.00	2.26
19	601168	西部矿业	24,588,422.00	2.22
20	000050	深天马 A	24,567,536.00	2.22
21	688002	睿创微纳	24,440,560.86	2.21
22	301308	江波龙	24,302,342.00	2.19
23	600808	马钢股份	24,196,096.00	2.19
24	300308	中际旭创	23,434,984.65	2.12
25	688183	生益电子	22,860,544.79	2.06

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	4,436,031,964.65
卖出股票收入（成交）总额	4,375,087,880.22

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	56,148,558.58	3.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,148,558.58	3.97

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019785	25 国债 13	241,000	24,404,274.06	1.72
2	019827	26 国债 01	215,000	21,639,361.23	1.53
3	019792	25 国债 19	100,000	10,104,923.29	0.71

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

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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	1,690,270.19
2	应收清算款	29,317,961.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,631,439.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,639,671.07

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

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	688072	拓荆科技	2,439,816.22	0.17	重大事项停牌
2	688783	西安奕材	2,200,966.02	0.16	新股流通受限
3	688795	摩尔线程	2,132,361.00	0.15	新股流通受限
4	688802	沐曦股份	1,739,998.07	0.12	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 500	89,557	3,981.92	93,243,326.34	26.15	263,365,487.22	73.85

指数增强 A						
中金中证 500 指数增强 B	386	5,939.82	-	-	2,292,770.86	100.00
中金中证 500 指数增强 C	49,102	3,174.46	28,975,696.18	18.59	126,896,813.53	81.41
合计	139,045	3,702.21	122,219,022.52	23.74	392,555,071.61	76.26

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 500 指数增强 A	690,603.28	0.1937
	中金中证 500 指数增强 B	5.23	0.0002
	中金中证 500 指数增强 C	17,667.56	0.0113
	合计	708,276.07	0.1376

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 500 指数增强 A	10~50
	中金中证 500 指数增强 B	0
	中金中证 500 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 500 指数增强 A	0
	中金中证 500 指数增强 B	0
	中金中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金已成立满三年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 500 指数增强 A	中金中证 500 指数增强 B	中金中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）基金份额总额	10,001,000.00	-	-
本报告期期初基金份额总额	373,305,895.05	1,992,287.91	111,158,219.59
本报告期基金总申购份额	180,060,516.57	1,373,753.79	180,561,169.90
减：本报告期基金总赎回份额	196,757,598.06	1,073,270.84	135,846,879.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	356,608,813.56	2,292,770.86	155,872,509.71

§ 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
本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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 (%)	
广发证券	2	3,729,013,243.23	42.34	730,732.52	42.34	-
申万宏源	2	3,284,955,298.72	37.29	643,571.47	37.29	-
国泰海通	2	1,794,077,398.29	20.37	351,492.06	20.37	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-

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	成交金额	占当期债	成交	占当期权

		券 成交总额 的比例 (%)		券回购成 交总额的 比例 (%)	金额	证 成交总额 的比例 (%)
广发证券	64, 055, 750. 00	81. 02	396, 000, 000. 00	84. 98	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国泰海通	15, 010, 512. 00	18. 98	70, 000, 000. 00	15. 02	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2026-02-04
5	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
6	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
7	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	2026-04-14
8	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
9	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方	中国证监会规定媒介	2026-04-29

	承销期内承销证券的公告		
10	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	2026-06-17
11	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	2026-06-25
12	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
13	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 500 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金中证 500 指数增强型发起式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 500 指数增强型发起式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