

# 中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资 基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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 .....	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 .....	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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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的真实、准确和完整发表意见 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
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 .....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52

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 .....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中金沪深 300	
基金主代码	003015	
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	150,589,590.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金沪深 300A	中金沪深 300C
下属分级基金的交易代码	003015	003579
报告期末下属分级基金的份额总额	118,478,370.77 份	32,111,219.24 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，在力求对沪深 300 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《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×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	胡长生	陈四清

## 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	中金沪深 300A	中金沪深 300C
本期已实现收益	-23,896,708.18	-9,129,344.54
本期利润	-12,846,299.48	-7,382,827.92
加权平均基金份额本期利润	-0.1211	-0.2009
本期加权平均净值利润率	-7.27%	-11.78%
本期基金份额净值增长率	-7.56%	-7.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	60,899,447.43	17,163,231.45
期末可供分配利润		

期末可供分配基金份额利润	0.5140	0.5345
期末基金资产净值	205,539,187.74	56,486,997.14
期末基金份额净值	1.7348	1.7591
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	73.48%	65.30%

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

中金沪深 300A

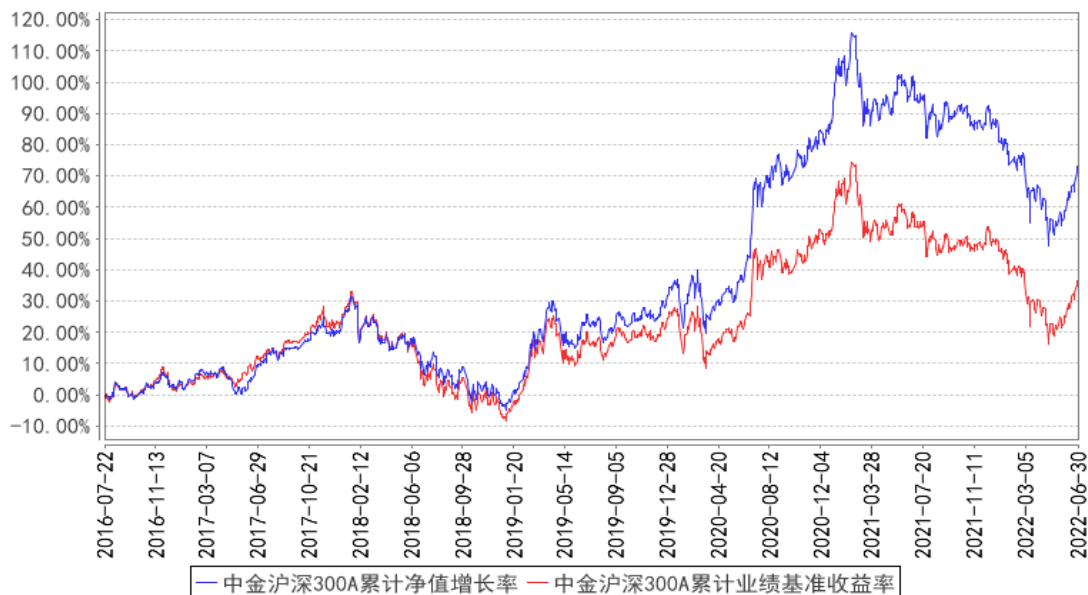
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.15%	0.97%	9.12%	1.02%	0.03%	-0.05%
过去三个月	5.13%	1.38%	5.93%	1.36%	-0.80%	0.02%
过去六个月	-7.56%	1.39%	-8.72%	1.38%	1.16%	0.01%
过去一年	-13.35%	1.20%	-13.40%	1.18%	0.05%	0.02%
过去三年	40.96%	1.22%	16.70%	1.20%	24.26%	0.02%
自基金合同生效起至今	73.48%	1.12%	36.51%	1.13%	36.97%	-0.01%

中金沪深 300C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	9.11%	0.98%	9.12%	1.02%	-0.01%	-0.04%
过去三个月	5.03%	1.38%	5.93%	1.36%	-0.90%	0.02%
过去六个月	-7.75%	1.39%	-8.72%	1.38%	0.97%	0.01%
过去一年	-13.70%	1.20%	-13.40%	1.18%	-0.30%	0.02%
过去三年	41.51%	1.22%	16.70%	1.20%	24.81%	0.02%
自基金合同生效起至今	65.30%	1.14%	26.10%	1.16%	39.20%	-0.02%

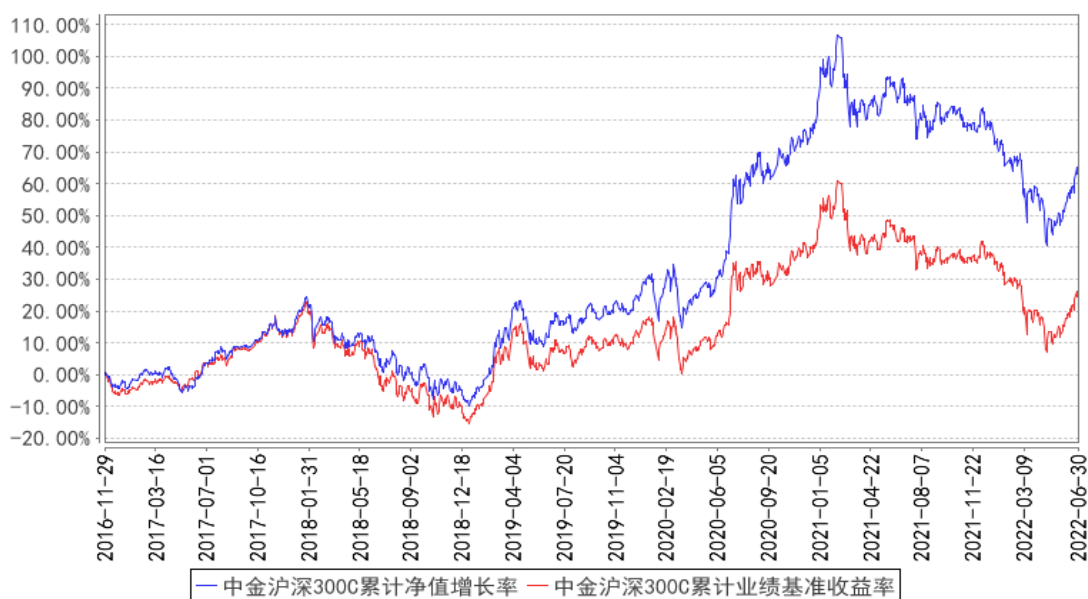
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中金沪深300A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





中金沪深300C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5亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层。

截至2022年6月30日，公司共管理41只公募基金，证券投资基金管理规模914.35亿元。

#### 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	2020年10月29日	-	11年	耿帅军先生，理学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所金融工程分析师，中信证券股份有限公司研究部副总裁、金融工程分析师，中国国际金融股份有限公司研究部执行总经理、金融工程分析师。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。
王阳	本基金基	2022年1	-	8年	王阳峰先生，理学硕士。历任泰达宏利基

峰	金经理	月 14 日			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对外披露的任免日期填写。

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，在严格控制组合相对基准指数偏离度的基础上，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。未来将继续努力开发和改进选股策略，在遵守合同约定和法律法规的前提下管理组合，争取在超额收益方面有更好的表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金沪深 300A 基金份额净值为 1.7348 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.56%，同期业绩基准收益率为-8.72%；中金沪深 300C 基金份额净值为 1.7591 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.75%，同期业绩基准收益率为-8.72%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2022 年上半年，我国经济增长面临来自各方面的不确定性因素影响。国内方面，局部新冠疫情对短期增长造成一定影响；外部方面，地缘冲突加剧供给受限问题，欧美经济体面临较高通胀压力，主要央行多采取紧缩的货币政策。我国经济增速从 3 月开始出现一定下滑；随着局部疫情好转及稳增长政策支持，5 月经济增速开始逐步好转。通胀方面，CPI 自低位逐渐回升，PPI 自高位开始回落，PPI 与 CPI 的剪刀差有所收敛；流动性方面，为应对内外部不确定性，国内流动性整体保持在合理充裕水平。

年初以来，A 股市场在各不确定性因素影响下持续调整至四月，调整幅度和时间超市场预期。随着风险因素的逐步缓解，市场自四月底开始反弹。以四月底为分界，在市场下跌过程中，风险偏好迅速下降，过去几年表现较好的成长板块调整幅度较大，价值板块有相对收益；四月底以来的反弹行情中，以新能源为代表的成长板块领涨，反弹幅度较大。回顾上半年，宽基指数中，沪深 300 下跌 9.22%，中证 500 下跌 12.30%，创业板指下跌 15.41%；风格方面，大盘优于小盘，价值战胜成长；行业方面，煤炭、消费者服务、交通运输、建筑、银行表现靠前，国防军工、计算机、综合金融、传媒、电子表现落后。

展望未来，四月底以来流动性充裕驱动 A 股估值抬升，当前尽管流动性依然充裕，但进一步宽松的空间不大，因流动性宽松驱动 A 股进一步抬升的空间有限，A 股市场正处于由分母端估值驱动转换为分子端盈利验证的关键阶段。在没有突发性外部事件冲击的情况下，权益市场可能处于一个“上有顶、下有底”的阶段，存在波段和结构性机会。存量市场下，对部分板块的估值泡沫化仍需留一份清醒，估值的空间一方面取决于市场对板块未来业绩增长的预期，另一方面取决于宏观和微观资金面。配置方向来看，消费端，疫情扰动趋弱和常态化核酸后，消费场景逐渐打开，存在内生反弹动能，估值处于合理区间的部分消费板块等相关领域或孕育阶段性投资机会。在流动性适度宽松、经济渐复苏的状态下，基本面预期已见底、长期景气程度仍在向上的科技方向具有稀缺性，具备较高的配置价值。未来我们仍将沿着全年策略展望的思路挖掘市场机会，寻找长期前景与短期业绩、景气周期与估值位置等匹配度较好的高性价比机会。

#### 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》、《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。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、投研部门、基金运营部、风险管理部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。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中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

#### 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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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的真实、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 2022 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：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,815,500.19	5,189,914.88
结算备付金		1,065,052.54	2,594,535.44
存出保证金		74,475.66	154,930.48
交易性金融资产	6.4.7.2	260,394,105.52	296,583,261.02
其中：股票投资		246,145,367.28	280,759,161.02
基金投资		-	-
债券投资		14,248,738.24	15,824,100.00
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		5,505,751.53	1,250.35
应收股利		-	-
应收申购款		9,400,853.75	72,372.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	206,486.54
资产总计		279,255,739.19	304,802,751.06
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		11,000,000.00	2,300,000.00
应付清算款		5,378,449.72	1,632,230.11
应付赎回款		119,705.71	92,677.03

应付管理人报酬		99,188.10	134,183.86
应付托管费		29,756.43	40,255.19
应付销售服务费		17,950.10	38,840.42
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.09	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	584,504.16	1,249,420.67
负债合计		17,229,554.31	5,487,607.28
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	150,589,590.01	158,616,791.24
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	111,436,594.87	140,698,352.54
净资产合计		262,026,184.88	299,315,143.78
负债和净资产总计		279,255,739.19	304,802,751.06

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，中金沪深 300A 基金份额净值 1.7348 元，基金份额总额 118,478,370.77 份；中金沪深 300C 基金份额净值 1.7591 元，基金份额总额 32,111,219.24 份。中金沪深 300 份额总额合计为 150,589,590.01 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-19,187,094.90	25,686,807.44
1. 利息收入		19,834.59	398,777.83
其中：存款利息收入	6.4.7.13	19,834.59	56,397.93
债券利息收入		-	341,980.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	399.08
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-32,008,099.79	45,705,140.30
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-34,434,222.62	42,385,122.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	244,792.84	1,157.96
资产支持证券投资收	6.4.7.16	-	-

益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,181,329.99	3,318,859.62
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	12,796,925.32	-20,487,666.46
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	4,244.98	70,555.77
<b>减：二、营业总支出</b>		1,042,032.50	11,323,010.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	595,279.90	1,218,194.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	178,584.01	365,458.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	125,343.63	414,057.01
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		30,127.38	56,733.67
其中：卖出回购金融资产支出		30,127.38	56,733.67
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.14	0.16
8. 其他费用	6.4.7.23	112,697.44	9,268,567.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-20,229,127.40	14,363,796.70
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-20,229,127.40	14,363,796.70
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-20,229,127.40	14,363,796.70

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基	158,616,791.24	-	140,698,352.54	299,315,143.78

金净值)				
加:会计 政策变 更	-	-	-	-
前 期差 错 更 正	-	-	-	-
其 他	-	-	-	-
二、本 期 初 净 资 产 ( 基 金 净 值)	158,616,791.24	-	140,698,352.54	299,315,143.78
三、本 期 增 减 变 动 额 ( 减 少 以 “- ” 号 填 列)	-8,027,201.23	-	-29,261,757.67	-37,288,958.90
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-20,229,127.40	-20,229,127.40
(二)、 本 期 基 金 份 额 交 易 产 生 的 基 金 净 值 变 动 数 ( 净 值 减 少 以 “- ” 号 填 列)	-8,027,201.23	-	-9,032,630.27	-17,059,831.50
其中:1. 基 金 申 购 款	35,985,868.78	-	22,866,430.03	58,852,298.81
2 .基 金 赎 回 款	-44,013,070.01	-	-31,899,060.30	-75,912,130.31
(三)、 本 期 向 基 金 份 额 持 有 人 分 配 利 润 产 生 的 基	-	-	-	-



金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	150,589,590.01	-	111,436,594.87	262,026,184.88
项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021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(基金净值)	201,428,657.43	-	192,770,076.70	394,198,734.13
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产(基金净值)	201,428,657.43	-	192,770,076.70	394,198,734.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	43,911,630.19	-	56,883,373.80	100,795,003.99
(一)、综合收益总额	-	-	14,363,796.70	14,363,796.70
(二)、本期基金份额	43,911,630.19	-	42,519,577.10	86,431,207.29

交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	149,720,982.43	-	147,831,049.21	297,552,031.64
2. 基金赎回款	-105,809,352.24	-	-105,311,472.11	-211,120,824.35
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	245,340,287.62	-	249,653,450.50	494,993,738.12

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：

孙菁

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

中金沪深 300 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]1516 号《关于准予中金沪深 300 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《中金沪深 300 指数增强型发起式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”，原“中国中投证券有限责任公司”）公开发售，募集期为 2016 年 7 月 18 日。经向中国证监会备案，《中金沪深 300 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 10,001,300.00 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。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金沪深 300 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，在力求对沪深 300 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

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本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的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外,本基金报告期所采用的会计政策、其他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

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》。

##### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类:(1)以摊余成本计量的金融资产;(2)以公

允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 296,583,261.02 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 296,787,967.65 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b)修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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》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)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下简称“营改增”)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自2018年1月1日起，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018年1月1日(含)以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1

日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从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，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,815,500.19
等于：本金	2,815,228.49
加：应计利息	271.70
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	2,815,500.19

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	237,254,124.22	-	246,145,367.28	8,891,243.06	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	14,028,335.00	233,318.24	14,248,738.24	-12,915.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,028,335.00	233,318.24	14,248,738.24	-12,915.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	251,282,459.22	233,318.24	260,394,105.52	8,878,328.06	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

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

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 2022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	459,819.61
其中：交易所市场	459,819.61
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,739.85
应付指数使用费	32,944.70
合计	584,504.16

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 中金沪深 300A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	104,375,915.13	104,375,915.13
本期申购	23,193,216.68	23,193,216.68
本期赎回（以“-”号填列）	-9,090,761.04	-9,090,761.04
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	118,478,370.77	118,478,370.77

##### 中金沪深 300C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,240,876.11	54,240,876.11
本期申购	12,792,652.10	12,792,652.10
本期赎回（以“-”号填列）	-34,922,308.97	-34,922,308.97
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	32,111,219.24	32,111,219.24

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 中金沪深 300A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	78,076,021.29	13,435,336.44	91,511,357.73
本期利润	-23,896,708.18	11,050,408.70	-12,846,299.48
本期基金份额交易产生的变动数	6,720,134.32	1,675,624.40	8,395,758.72
其中：基金申购款	12,527,735.19	2,054,381.12	14,582,116.31
基金赎回款	-5,807,600.87	-378,756.72	-6,186,357.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,899,447.43	26,161,369.54	87,060,816.97

##### 中金沪深 300C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	42,062,978.46	7,124,016.35	49,186,994.81
本期利润	-9,129,344.54	1,746,516.62	-7,382,827.92
本期基金份额交易产生的变动数	-15,770,402.47	-1,657,986.52	-17,428,388.99
其中：基金申购款	7,610,654.02	673,659.70	8,284,313.72
基金赎回款	-23,381,056.49	-2,331,646.22	-25,712,702.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,163,231.45	7,212,546.45	24,375,777.90

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	5,060.60
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	13,979.86
其他	794.13
合计	19,834.59

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	830,974,176.76
减：卖出股票成本总额	863,220,438.94
减：交易费用	2,187,960.44
买卖股票差价收入	-34,434,222.62

#### 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	163,416.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	81,376.44
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	244,792.84

##### 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,751,302.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,499,947.06
减：应计利息总额	169,968.17
减：交易费用	10.59
买卖债券差价收入	81,376.44

##### 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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,181,329.99
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	2,181,329.99

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	12,796,925.32
股票投资	12,792,273.26
债券投资	4,652.06
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	12,796,925.32

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	4,109.09
基金转换费收入	135.89
合计	4,244.98

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	19,048.96
划款手续费	1,908.63
合计	112,697.44

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
工商银行	基金托管人
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（“中金财富证券”，原“中国中投证券有限责任公司”）	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
中金财富证券	-	-	343,691,874.69	4.96
中金公司	-	-	612,558,585.98	8.84

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
中金财富证券	-	-	21,000,000.00	3.46
中金公司	-	-	120,200,000.00	19.83

#### 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 2022年1月1日至2022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 2021年1月1日至2021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	447,966.31	8.84	408,131.84	14.90
中金财富证券	251,344.04	4.96	251,344.04	9.18

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	595,279.90	1,218,194.19
其中：支付销售机构的客户维护费	132,916.12	195,217.51

注：支付基金管理人中金基金管理有限公司的基本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：日基本管理费=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数；

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	178,584.01	365,458.31

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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金沪深 300A	中金沪深 300C	合计
中金基金	-	23,210.87	23,210.87
中金公司	-	-	-
中金财富证券	-	2,608.17	2,608.17
合计	-	25,819.04	25,819.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金沪深 300A	中金沪深 300C	合计
中金基金	-	169,283.08	169,283.08
中金公司	-	4,310.53	4,310.53
中金财富证券	-	1,056.51	1,056.51

合计	-	174,650.12	174,650.12
----	---	------------	------------

注：本基金仅针对 C 类基金份额收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日该类基金资产净值 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 类基金日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	2,815,500.19	5,060.60	6,304,585.67	11,380.69

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

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：张）	总金额
本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
中金公司	688173	希荻微	网下	2,250	75,532.50
中金公司	688225	亚信安全	网下	2,807	85,641.57
中金公司	688282	理工导航	网下	1,568	102,249.28
中金公司	301216	万凯新材	网下	2,472	88,200.96
中金公司	688295	中复神鹰	网下	3,550	104,121.50
中金公司	688125	安达智能	网下	1,887	114,257.85
中金公司	600938	中国海油	网上	4,000	43,200.00



中金公司	301150	中一科技	网下	514	84,069.84
中金公司	688320	禾川科技	网下	4,320	102,211.20
中金公司	603206	嘉环科技	网下	1,210	17,581.30
中金公司	688400	凌云光	网下	3,978	87,237.54
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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： 张）	总金额
中金公司	003033	征和工业	网下	301	7,007.28
中金公司	688696	极米科技	网下	1,216	162,615.68
中金公司	688316	青云科技	网下	1,428	90,963.60
中金公司	605090	九丰能源	网下	1,090	37,681.30
中金公司	601156	东航物流	网下	2,090	32,959.30
中金公司	688425	铁建重工	网下	62,230	178,600.10

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022 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
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股流通受限	55.57	30.03	170	9,446.90	5,105.10	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股流通受限	39.88	31.09	248	9,890.24	7,710.32	-
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.68	32.02	251	8,202.50	8,037.02	数量包含送股
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股流通受限	23.18	16.14	461	10,686.67	7,440.54	数量包含送股
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	63.10	39.85	129	8,139.90	5,140.65	-
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	27.53	45.04	319	8,782.07	14,367.76	-

301116	益客食品	2022年 1月10日	6个月	新股流 通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301120	新特电气	2022年 4月11日	6个月	新股流 通受限	13.73	15.49	922	12,659.06	14,281.78	-
301130	西点药业	2022年 2月16日	6个月	新股流 通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022年 4月1日	6个月	新股流 通受限	31.98	26.26	237	7,579.26	6,223.62	-
301137	哈焊华通	2022年 3月14日	6个月	新股流 通受限	15.37	15.99	558	8,576.46	8,922.42	-
301139	元道通信	2022年 6月30日	1个月 内(含)	新股流 通受限	38.46	38.46	2,492	95,842.32	95,842.32	-
301139	元道通信	2022年 6月30日	6个月	新股流 通受限	38.46	38.46	277	10,653.42	10,653.42	-
301148	嘉戎技术	2022年 4月14日	6个月	新股流 通受限	38.39	23.90	284	10,902.76	6,787.60	-
301150	中一科技	2022年 4月14日	6个月	新股流 通受限	109.04	82.76	78	8,505.12	6,455.28	数量包含 送股
301151	冠龙节能	2022年 3月30日	6个月	新股流 通受限	30.82	21.46	286	8,814.52	6,137.56	-
301153	中科江南	2022年 5月10日	6个月	新股流 通受限	33.68	43.98	229	7,712.72	10,071.42	-
301163	宏德股份	2022年 4月11日	6个月	新股流 通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301187	欧圣电气	2022年 4月13日	6个月	新股流 通受限	21.33	22.54	508	10,835.64	11,450.32	-
301196	唯科科技	2022年 1月4日	6个月	新股流 通受限	64.08	37.52	98	6,279.84	3,676.96	-
301200	大族数控	2022年 2月18日	6个月	新股流 通受限	76.56	51.92	166	12,708.96	8,618.72	-
301201	诚达药	2022年	6个月	新股流	72.69	71.54	157	11,412.33	11,231.78	-

	业	1月12日		通受限							
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	2,814	10,693.20	17,981.46		-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	248	8,848.64	7,400.32		-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	96.66	87.82	72	6,959.20	6,323.04	数量包含送股	
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	246	8,359.08	7,124.16		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股流通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16		-
301236	软通动力	2022年3月8日	6个月	新股流通受限	48.51	31.38	302	14,648.88	9,476.76	数量包含送股	
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股流通受限	56.69	41.86	153	8,673.57	6,404.58		-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股流通受限	19.18	32.07	680	13,042.40	21,807.60		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股流通受限	33.65	33.65	2,499	84,091.35	84,091.35		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	278	9,354.70	9,354.70		-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,018	8,194.90	10,261.44		-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	48.30	41.68	148	7,148.40	6,168.64		-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	401	7,991.93	12,583.38		-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	31.20	22.81	229	7,144.80	5,223.49		-

301286	侨源股份	2022 年 6 月 6 日	6 个月	新股流 通受限	16.91	19.79	629	10,636.39	12,447.91	-
301288	清研环 境	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301302	华如科 技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新股流 通受限	52.03	56.42	201	10,458.03	11,340.42	-
688173	希荻微	2022 年 1 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	33.57	31.62	2,250	75,532.50	71,145.00	-
688237	超卓航 科	2022 年 6 月 24 日	1 个月 内(含)	新股流 通受限	41.27	41.27	2,135	88,111.45	88,111.45	-
688259	创耀科 技	2022 年 1 月 5 日	6 个月	新股流 通受限	66.60	79.22	931	62,004.60	73,753.82	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	6 个月	新股流 通受限	21.93	21.93	3,978	87,237.54	87,237.54	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止,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 11,000,000.00 元,于 2022 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

本基金本报告期末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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2022 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	2,815,228.49			271.70	2,815,500.19
结算备付金	1,062,574.44			2,478.10	1,065,052.54
存出保证金	74,442.16			33.50	74,475.66
交易性金融资产-股票投资				246,145,367.28	246,145,367.28
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	14,015,420.00			233,318.24	14,248,738.24
买入返售金融资产					
应收证券清算款				5,505,751.53	5,505,751.53
应收股利					
应收申购款				9,400,853.75	9,400,853.75
资产总计	17,967,665.09			261,288,074.10	279,255,739.19
负债					
卖出回购金融资产款	11,000,000.00				11,000,000.00
应付证券清算款				5,378,449.72	5,378,449.72
应付赎回款				119,705.71	119,705.71
应付管理人报酬				99,188.10	99,188.10
应付托管费				29,756.43	29,756.43
应付销售服务费				17,950.10	17,950.10
应交税费				0.09	0.09
其他负债				584,504.16	584,504.16
负债总计	11,000,000.00			6,229,554.31	17,229,554.31
利率敏感度缺口	6,967,665.09			255,058,519.79	262,026,184.88
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,189,914.88				5,189,914.88
结算备付金	2,592,535.44			2,000.00	2,594,535.44
存出保证金	154,930.48				154,930.48
交易性金融资产-股				280,759,161.02	280,759,161.02

票投资					
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	15,824,100.00	-	-	-	15,824,100.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,250.35	1,250.35
应收利息	-	-	-	206,486.54	206,486.54
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	72,372.35	72,372.35
资产总计	23,761,480.80	-	-	281,041,270.26	304,802,751.06
负债					
卖出回购金融资产款	2,300,000.00	-	-	-	2,300,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1,632,230.11	1,632,230.11
应付赎回款	-	-	-	92,677.03	92,677.03
应付管理人报酬	-	-	-	134,183.86	134,183.86
应付托管费	-	-	-	40,255.19	40,255.19
应付交易费用	-	-	-	1,052,331.51	1,052,331.51
应付销售服务费	-	-	-	38,840.42	38,840.42
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-1,806.58	-1,806.58
其他负债	-	-	-	198,895.74	198,895.74
负债总计	2,300,000.00	-	-	3,187,607.28	5,487,607.28
利率敏感度缺口	21,461,480.80	-	-	277,853,662.98	299,315,143.78

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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。		
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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）	
分析	市场利率下降 25 个基点	11,704.32	18,867.64



	市场利率上升 25 个基点	-11,704.32	-18,867.64
--	---------------	------------	------------

#### 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 2022年6月30日		上年度末 2021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	246,145,367.28	93.94	280,759,161.02	93.80
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	246,145,367.28	93.94	280,759,161.02	93.80

##### 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		
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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升	13,128,638.05	15,023,062.63

	5%		
	业绩比较基准下降	-13,128,638.05	-15,023,062.63
	5%		

#### 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	245,244,813.42	278,480,421.30
第二层次	14,689,464.54	17,917,649.45
第三层次	459,827.56	185,190.27
合计	260,394,105.52	296,583,261.02

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

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

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末无非持续的以公允价值计量的金融工具。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其

账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	246,145,367.28	88.14
	其中：股票	246,145,367.28	88.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,248,738.24	5.10
	其中：债券	14,248,738.24	5.10
	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	3,880,552.73	1.39
8	其他各项资产	14,981,080.94	5.36
9	合计	279,255,739.19	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	837,893.20	0.32
B	采矿业	10,018,419.00	3.82
C	制造业	136,816,740.94	52.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,483,334.06	3.62
E	建筑业	4,356,751.00	1.66
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,597,996.00	2.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,171,193.44	4.26
J	金融业	47,022,752.00	17.95
K	房地产业	1,717,938.00	0.66

L	租赁和商务服务业	1,072,557.16	0.41
M	科学研究和技术服务业	6,159,007.60	2.35
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,701,766.00	0.65
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	236,956,348.40	90.43

### 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	1,258,476.00	0.48
C	制造业	4,477,578.70	1.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	724,464.00	0.28
F	批发和零售业	259,725.38	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	362,942.00	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	287,423.81	0.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,677,006.00	0.64
L	租赁和商务服务业	7,710.32	0.00
M	科学研究和技术服务业	17,981.46	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	14,228.14	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	101,483.07	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,189,018.88	3.51

### 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	600519	贵州茅台	7,600	15,542,000.00	5.93
2	300750	宁德时代	12,800	6,835,200.00	2.61
3	600036	招商银行	118,700	5,009,140.00	1.91
4	603259	药明康德	46,240	4,808,497.60	1.84
5	002129	TCL 中环	80,800	4,758,312.00	1.82
6	600030	中信证券	190,405	4,124,172.30	1.57
7	601899	紫金矿业	427,500	3,988,575.00	1.52
8	601318	中国平安	83,230	3,886,008.70	1.48
9	601985	中国核电	527,043	3,615,514.98	1.38
10	000568	泸州老窖	13,400	3,303,636.00	1.26
11	000858	五粮液	16,052	3,241,380.36	1.24
12	000001	平安银行	214,900	3,219,202.00	1.23
13	600438	通威股份	52,900	3,166,594.00	1.21
14	003816	中国广核	1,118,300	3,131,240.00	1.20
15	600809	山西汾酒	9,400	3,053,120.00	1.17
16	601658	邮储银行	544,500	2,934,855.00	1.12
17	600919	江苏银行	400,800	2,853,696.00	1.09
18	603986	兆易创新	19,400	2,758,874.00	1.05
19	002352	顺丰控股	49,200	2,745,852.00	1.05
20	002821	凯莱英	9,300	2,687,700.00	1.03
21	002466	天齐锂业	21,200	2,645,760.00	1.01
22	002304	洋河股份	14,300	2,619,045.00	1.00
23	600690	海尔智家	94,235	2,587,693.10	0.99
24	300316	晶盛机电	38,200	2,581,938.00	0.99
25	002049	紫光国微	13,000	2,466,360.00	0.94
26	601012	隆基绿能	36,197	2,411,806.11	0.92
27	000333	美的集团	38,665	2,334,979.35	0.89
28	002142	宁波银行	64,100	2,295,421.00	0.88
29	601211	国泰君安	149,400	2,270,880.00	0.87
30	601166	兴业银行	113,658	2,261,794.20	0.86
31	002460	赣锋锂业	15,200	2,260,240.00	0.86
32	601319	中国人保	440,400	2,228,424.00	0.85
33	002459	晶澳科技	27,830	2,195,787.00	0.84
34	601998	中信银行	458,400	2,177,400.00	0.83

35	601088	中国神华	62,600	2,084,580.00	0.80
36	600089	特变电工	75,700	2,073,423.00	0.79
37	002938	鹏鼎控股	67,700	2,045,217.00	0.78
38	002709	天赐材料	32,400	2,010,744.00	0.77
39	600050	中国联通	577,300	1,997,458.00	0.76
40	601238	广汽集团	130,229	1,984,689.96	0.76
41	600176	中国巨石	109,244	1,901,938.04	0.73
42	600018	上港集团	325,700	1,898,831.00	0.72
43	002594	比亚迪	5,600	1,867,544.00	0.71
44	601838	成都银行	112,400	1,863,592.00	0.71
45	600760	中航沈飞	30,200	1,825,590.00	0.70
46	600926	杭州银行	121,200	1,815,576.00	0.69
47	002555	三七互娱	84,100	1,785,443.00	0.68
48	600941	中国移动	29,000	1,754,500.00	0.67
49	600887	伊利股份	43,635	1,699,583.25	0.65
50	002311	海大集团	28,300	1,698,283.00	0.65
51	603392	万泰生物	10,585	1,643,850.50	0.63
52	002371	北方华创	5,800	1,607,296.00	0.61
53	002241	歌尔股份	46,900	1,575,840.00	0.60
54	000596	古井贡酒	6,300	1,572,858.00	0.60
55	000792	盐湖股份	52,200	1,563,912.00	0.60
56	002415	海康威视	41,400	1,498,680.00	0.57
57	601898	中煤能源	144,000	1,494,720.00	0.57
58	002920	德赛西威	9,800	1,450,400.00	0.55
59	601009	南京银行	133,500	1,391,070.00	0.53
60	603882	金域医学	16,600	1,370,330.00	0.52
61	601919	中远海控	97,620	1,356,918.00	0.52
62	300347	泰格医药	11,800	1,350,510.00	0.52
63	300628	亿联网络	17,600	1,340,240.00	0.51
64	601728	中国电信	357,700	1,334,221.00	0.51
65	600188	兖矿能源	33,700	1,330,476.00	0.51
66	601939	建设银行	218,700	1,325,322.00	0.51
67	600905	三峡能源	208,500	1,311,465.00	0.50
68	300661	圣邦股份	7,200	1,310,544.00	0.50
69	000651	格力电器	38,600	1,301,592.00	0.50
70	601669	中国电建	159,200	1,252,904.00	0.48
71	600426	华鲁恒升	42,800	1,249,760.00	0.48
72	688008	澜起科技	20,400	1,235,832.00	0.47
73	603486	科沃斯	9,800	1,194,522.00	0.46
74	603369	今世缘	22,900	1,167,900.00	0.45
75	600845	宝信软件	21,300	1,162,980.00	0.44
76	002179	中航光电	18,140	1,148,624.80	0.44

77	002410	广联达	21,000	1,143,240.00	0.44
78	600660	福耀玻璃	27,200	1,137,232.00	0.43
79	600900	长江电力	48,934	1,131,354.08	0.43
80	600460	士兰微	21,400	1,112,800.00	0.42
81	601877	正泰电器	30,700	1,098,446.00	0.42
82	601186	中国铁建	135,900	1,073,610.00	0.41
83	601881	中国银河	105,600	1,021,152.00	0.39
84	600383	金地集团	75,200	1,010,688.00	0.39
85	600741	华域汽车	43,200	993,600.00	0.38
86	002001	新和成	42,680	973,530.80	0.37
87	300124	汇川技术	14,700	968,289.00	0.37
88	000977	浪潮信息	35,200	932,096.00	0.36
89	600332	白云山	27,800	878,202.00	0.34
90	300122	智飞生物	7,800	865,878.00	0.33
91	603290	斯达半导	2,200	848,980.00	0.32
92	601618	中国中冶	240,200	840,700.00	0.32
93	002714	牧原股份	15,160	837,893.20	0.32
94	300059	东方财富	31,422	798,118.80	0.30
95	000625	长安汽车	45,982	796,408.24	0.30
96	688012	中微公司	6,645	775,803.75	0.30
97	600104	上汽集团	42,897	763,995.57	0.29
98	002812	恩捷股份	3,000	751,350.00	0.29
99	002475	立讯精密	22,200	750,138.00	0.29
100	601888	中国中免	3,212	748,171.16	0.29
101	600837	海通证券	74,600	731,826.00	0.28
102	600585	海螺水泥	20,600	726,768.00	0.28
103	300896	爱美客	1,200	720,012.00	0.27
104	688981	中芯国际	15,728	710,433.76	0.27
105	000002	万科 A	34,500	707,250.00	0.27
106	601601	中国太保	29,700	698,841.00	0.27
107	600406	国电南瑞	25,720	694,440.00	0.27
108	603019	中科曙光	23,700	687,774.00	0.26
109	002050	三花智控	25,000	687,000.00	0.26
110	000338	潍柴动力	52,900	659,663.00	0.25
111	601225	陕西煤业	31,000	656,580.00	0.25
112	601766	中国中车	126,200	656,240.00	0.25
113	600196	复星医药	14,500	639,305.00	0.24
114	000776	广发证券	33,900	633,930.00	0.24
115	601117	中国化学	67,100	631,411.00	0.24
116	600584	长电科技	23,300	629,100.00	0.24
117	002202	金风科技	41,800	618,640.00	0.24
118	600346	恒力石化	27,800	618,272.00	0.24

119	300496	中科创达	4,700	613,256.00	0.23
120	601006	大秦铁路	90,500	596,395.00	0.23
121	600219	南山铝业	161,200	594,828.00	0.23
122	601229	上海银行	90,400	592,120.00	0.23
123	601600	中国铝业	124,300	590,425.00	0.23
124	600015	华夏银行	112,000	583,520.00	0.22
125	600352	浙江龙盛	55,300	562,954.00	0.21
126	002601	龙佰集团	28,000	561,400.00	0.21
127	601336	新华保险	17,400	560,106.00	0.21
128	601390	中国中铁	90,900	558,126.00	0.21
129	002648	卫星化学	21,500	555,775.00	0.21
130	002252	上海莱士	93,700	555,641.00	0.21
131	300003	乐普医疗	29,700	551,529.00	0.21
132	600183	生益科技	32,100	545,379.00	0.21
133	603087	甘李药业	11,300	542,061.00	0.21
134	002841	视源股份	7,000	527,240.00	0.20
135	601825	沪农商行	83,100	521,037.00	0.20
136	603659	璞泰来	6,000	506,400.00	0.19
137	600019	宝钢股份	81,600	491,232.00	0.19
138	688036	传音控股	5,502	490,943.46	0.19
139	600893	航发动力	10,600	482,406.00	0.18
140	000938	紫光股份	24,800	481,120.00	0.18
141	601328	交通银行	94,600	471,108.00	0.18
142	600028	中国石化	113,600	463,488.00	0.18
143	300999	金龙鱼	8,500	459,170.00	0.18
144	002236	大华股份	27,100	444,982.00	0.17
145	300760	迈瑞医疗	1,400	438,480.00	0.17
146	601688	华泰证券	30,100	427,420.00	0.16
147	000661	长春高新	1,774	414,087.08	0.16
148	000725	京东方 A	97,200	382,968.00	0.15
149	600588	用友网络	17,400	377,754.00	0.14
150	600763	通策医疗	1,900	331,436.00	0.13
151	601916	浙商银行	98,500	327,020.00	0.12
152	002027	分众传媒	48,200	324,386.00	0.12
153	688111	金山办公	1,562	307,901.44	0.12
154	001289	龙源电力	13,500	293,760.00	0.11
155	688363	华熙生物	1,400	199,052.00	0.08
156	688396	华润微	183	10,809.81	0.00
157	688599	天合光能	132	8,613.00	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	600639	浦东金桥	123,400	1,677,006.00	0.64
2	600873	梅花生物	115,400	1,301,712.00	0.50
3	600256	广汇能源	119,400	1,258,476.00	0.48
4	300037	新宙邦	13,860	728,481.60	0.28
5	600039	四川路桥	68,800	724,464.00	0.28
6	601615	明阳智能	15,000	507,000.00	0.19
7	000933	神火股份	38,400	502,272.00	0.19
8	300457	赢合科技	14,500	411,945.00	0.16
9	600233	圆通速递	17,800	362,942.00	0.14
10	002932	明德生物	4,719	323,534.64	0.12
11	600546	山煤国际	12,700	247,142.00	0.09
12	688110	东芯股份	4,026	152,665.92	0.06
13	301139	元道通信	2,769	106,495.74	0.04
14	301239	普瑞眼科	2,777	93,446.05	0.04
15	688237	超卓航科	2,135	88,111.45	0.03
16	688400	凌云光	3,978	87,237.54	0.03
17	688259	创耀科技	931	73,753.82	0.03
18	688173	希荻微	2,250	71,145.00	0.03
19	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
20	600885	宏发股份	1,000	41,850.00	0.02
21	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
22	301238	瑞泰新材	680	21,807.60	0.01
23	301215	中汽股份	2,814	17,981.46	0.01
24	301112	信邦智能	319	14,367.76	0.01
25	301120	新特电气	922	14,281.78	0.01
26	301263	泰恩康	401	12,583.38	0.00
27	301286	侨源股份	629	12,447.91	0.00
28	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
29	301187	欧圣电气	508	11,450.32	0.00
30	301302	华如科技	201	11,340.42	0.00
31	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
32	301201	诚达药业	157	11,231.78	0.00
33	301256	华融化学	1,018	10,261.44	0.00
34	301153	中科江南	229	10,071.42	0.00
35	301236	软通动力	302	9,476.76	0.00
36	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
37	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
38	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
39	301137	哈焊华通	558	8,922.42	0.00
40	301200	大族数控	166	8,618.72	0.00
41	301103	何氏眼科	251	8,037.02	0.00

42	301102	兆讯传媒	248	7,710.32	0.00
43	301109	军信股份	461	7,440.54	0.00
44	301216	万凯新材	248	7,400.32	0.00
45	301222	浙江恒威	246	7,124.16	0.00
46	301148	嘉戎技术	284	6,787.60	0.00
47	301150	中一科技	78	6,455.28	0.00
48	301237	和顺科技	153	6,404.58	0.00
49	301219	腾远钴业	72	6,323.04	0.00
50	301135	瑞德智能	237	6,223.62	0.00
51	301258	富士莱	148	6,168.64	0.00
52	301151	冠龙节能	286	6,137.56	0.00
53	301279	金道科技	229	5,223.49	0.00
54	301110	青木股份	129	5,140.65	0.00
55	300834	星辉环材	170	5,105.10	0.00
56	301196	唯科科技	98	3,676.96	0.00
57	688009	中国通号	181	819.93	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	002142	宁波银行	12,187,295.30	4.07
2	000858	五粮液	12,001,098.00	4.01
3	600036	招商银行	11,219,157.00	3.75
4	601899	紫金矿业	9,679,350.00	3.23
5	002304	洋河股份	8,778,314.00	2.93
6	600104	上汽集团	7,440,695.50	2.49
7	000568	泸州老窖	7,405,113.00	2.47
8	002594	比亚迪	7,331,469.00	2.45
9	601166	兴业银行	7,231,837.00	2.42
10	600887	伊利股份	7,166,917.00	2.39
11	601985	中国核电	6,986,575.51	2.33
12	603392	万泰生物	6,960,153.00	2.33
13	601600	中国铝业	6,672,526.00	2.23
14	600050	中国联通	6,608,868.00	2.21
15	002050	三花智控	6,566,729.00	2.19
16	001979	招商蛇口	6,555,935.00	2.19
17	600519	贵州茅台	6,548,885.00	2.19
18	600926	杭州银行	6,451,748.00	2.16
19	002049	紫光国微	6,416,575.82	2.14
20	601988	中国银行	6,415,429.00	2.14
21	300896	爱美客	6,402,514.00	2.14

22	002812	恩捷股份	6,295,044.00	2.10
23	300316	晶盛机电	6,228,933.00	2.08
24	600309	万华化学	6,080,081.00	2.03
25	601658	邮储银行	6,053,078.00	2.02

#### 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	000858	五粮液	10,837,547.00	3.62
2	600036	招商银行	10,253,338.00	3.43
3	002142	宁波银行	9,814,011.90	3.28
4	601288	农业银行	9,575,294.00	3.20
5	600926	杭州银行	9,208,012.00	3.08
6	300750	宁德时代	9,130,662.00	3.05
7	600887	伊利股份	9,023,135.00	3.01
8	000568	泸州老窖	8,766,534.00	2.93
9	001979	招商蛇口	8,543,754.00	2.85
10	000333	美的集团	8,316,998.00	2.78
11	300059	东方财富	8,275,736.50	2.76
12	601988	中国银行	8,153,976.00	2.72
13	002050	三花智控	8,092,286.64	2.70
14	601658	邮储银行	7,619,748.00	2.55
15	601618	中国中冶	7,502,404.00	2.51
16	002008	大族激光	7,382,817.00	2.47
17	300316	晶盛机电	7,316,885.00	2.44
18	600436	片仔癀	6,908,396.00	2.31
19	002304	洋河股份	6,794,404.00	2.27
20	600132	重庆啤酒	6,716,997.21	2.24
21	603392	万泰生物	6,689,939.00	2.24
22	000100	TCL 科技	6,642,843.00	2.22
23	600104	上汽集团	6,491,596.00	2.17
24	000063	中兴通讯	6,381,010.00	2.13
25	002594	比亚迪	6,270,438.00	2.09
26	600019	宝钢股份	6,256,972.00	2.09
27	300124	汇川技术	6,247,427.50	2.09
28	603659	璞泰来	6,236,368.00	2.08
29	600111	北方稀土	6,198,997.00	2.07
30	601600	中国铝业	6,135,408.00	2.05
31	300450	先导智能	6,092,726.40	2.04
32	000625	长安汽车	5,994,798.00	2.00

#### 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	815,814,371.94
卖出股票收入（成交）总额	830,974,176.76

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	14,248,738.24	5.44
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	14,248,738.24	5.44

## 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	019641	20 国债 11	78,000	7,989,460.93	3.05
2	019666	22 国债 01	48,000	4,853,871.78	1.85
3	019674	22 国债 09	14,000	1,405,405.53	0.54

## 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投资。

## 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投资。

## 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将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

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除招商银行股份有限公司（招商银行）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2022年3月25日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监罚决字（2022）21号），对招商银行股份有限公司不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据等违法违规事实进行处罚。

本基金采用量化的方式进行选股，作为指数增强型基金，在行业权重的偏离上会有一些的控制，银行业在沪深 300 指数中占很大权重，所以不可避免的选入银行，同时我们认为招商银行所受处罚并未对其投资价值产生实质性的负面影响，所以依然按照模型选股的结果而没有进行专门的减仓操作。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	74,475.66
2	应收清算款	5,505,751.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,400,853.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,981,080.94

### 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不存在流通受限的情况。

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	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 (%)
中金沪深 300A	4,304	27,527.50	75,263,108.26	63.52	43,215,262.51	36.48
中金沪深 300C	3,387	9,480.73	3,884,136.79	12.10	28,227,082.45	87.90
合计	7,691	19,579.98	79,147,245.05	52.56	71,442,344.96	47.44

### 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	中金沪深 300A	1,120,995.14	0.95
	中金沪深 300C	3,687.12	0.01
	合计	1,124,682.26	0.75

### 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	中金沪深 300A	50~100
	中金沪深 300C	0

	合计	50~100
本基金基金经理持有 本开放式基金	中金沪深 300A	0
	中金沪深 300C	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	中金沪深 300A	中金沪深 300C
基金合同生效日 (2016 年 7 月 22 日) 基金份额总额	10,001,300.00	-
本报告期期初基金份 额总额	104,375,915.13	54,240,876.11
本报告期基金总申购 份额	23,193,216.68	12,792,652.10
减：本报告期基金总 赎回份额	9,090,761.04	34,922,308.97
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	118,478,370.77	32,111,219.24

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

##### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

2022 年 6 月 21 日，本基金管理人发布公告，赵璧先生自 2022 年 6 月 20 日起担任公司副总经理、财务负责人，同日起不再担任公司督察长；席晓峰先生自 2022 年 6 月 20 日起担任公司督察长，同日起不再担任公司副总经理。

##### (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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	857,160,904.54	52.29	626,840.22	52.29	-
东北证券	2	212,338,400.49	12.95	155,283.91	12.95	-
华创证券	2	196,477,917.91	11.99	143,685.97	11.99	-
兴业证券	2	115,496,709.47	7.05	84,461.89	7.05	-
海通证券	2	103,297,091.73	6.30	75,540.88	6.30	-
东方财富证券	2	72,204,139.13	4.40	52,803.17	4.40	-
申港证券	1	56,101,848.90	3.42	41,027.47	3.42	-
东兴证券	1	26,140,658.22	1.59	19,116.51	1.59	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-



天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

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

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	5,410,809.00	51.58	167,700,000.00	52.06	-	-
东北证券	2,231,523.80	21.27	54,000,000.00	16.76	-	-
华创证券	2,826,238.90	26.94	36,700,000.00	11.39	-	-
兴业证券	22,410.00	0.21	24,600,000.00	7.64	-	-
海通证券	-	-	14,800,000.00	4.59	-	-
东方财富 证券	-	-	24,300,000.00	7.54	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-

首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

## 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	2022-01-14
2	中金沪深 300 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	2022-01-15
3	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书(2022 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2022-01-17
4	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要(更新)(2022 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2022-01-17
5	中金基金管理有限公司旗下公募基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-01-24
6	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-24
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	2022-01-27
8	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	2022-03-11
9	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	2022-03-22
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	2022-03-29
11	中金基金管理有限公司旗下公募基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-03-31
12	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-31
13	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	2022-04-09
14	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	2022-04-15
15	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	2022-04-15
16	中金基金管理有限公司关于旗下基金	中国证监会规定媒介	2022-04-22

	投资关联方承销期内承销证券的公告		
17	中金基金管理有限公司旗下公募基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
18	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
19	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	2022-04-23
20	中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-06-21
21	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	2022-06-28

## § 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沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金沪深 300 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、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 8、报告期内中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金在指定媒介上发布的各项公告
- 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

投资者营业时间内可到基金管理人和/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和复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

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

2022 年 8 月 31 日