

中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数发起式证 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：招商证券股份有限公司

送出日期：2022 年 08 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。

基金托管人招商证券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

§ 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	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
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
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
§ 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	45
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	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51

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	51
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	51
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	51
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	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数发起式证券投资基金	
基金简称	中金 MSCI 质量	
基金主代码	006341	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 22 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	187,406,951.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金 MSCI 质量 A	中金 MSCI 质量 C
下属分级基金的交易代码	006341	006342
报告期末下属分级基金的份额总额	126,986,917.58 份	60,420,033.86 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金通过完全复制策略进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票资产组合。在投资运作过程中，本基金以标的指数权重为标准配置个股，并根据成份股构成及其权重的变动进行动态调整。具体包括：1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、股票期权投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、可转换债券投资策略；8、权证投资策略。详见《中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数发起式证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际质量指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型证券投资基金和混合型证券投资基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	席晓峰
	联系电话	010-63211122
		韩鑫普
		0755-82943666

电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话	400-868-1166	95565
传真	010-66159121	0755-82960794
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	深圳市福田区福田街道福华一 路 111 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	深圳市福田区福田街道福华一 路 111 号
邮政编码	100004	518000
法定代表人	胡长生	霍达

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
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 MSCI 质量 A	中金 MSCI 质量 C
本期已实现收益	-15,389,433.16	-7,550,635.81
本期利润	-32,006,667.43	-18,643,485.12
加权平均基金份 额本期利润	-0.2539	-0.2926
本期加权平均净 值利润率	-11.66%	-13.49%
本期基金份额净 值增长率	-10.09%	-10.20%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	期末可供分配利 润	108,586,506.25

期末可供分配基金份额利润	0.8551	0.8395
期末基金资产净值	299,185,292.76	141,419,962.70
期末基金份额净值	2.3560	2.3406
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	135.60%	134.06%

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

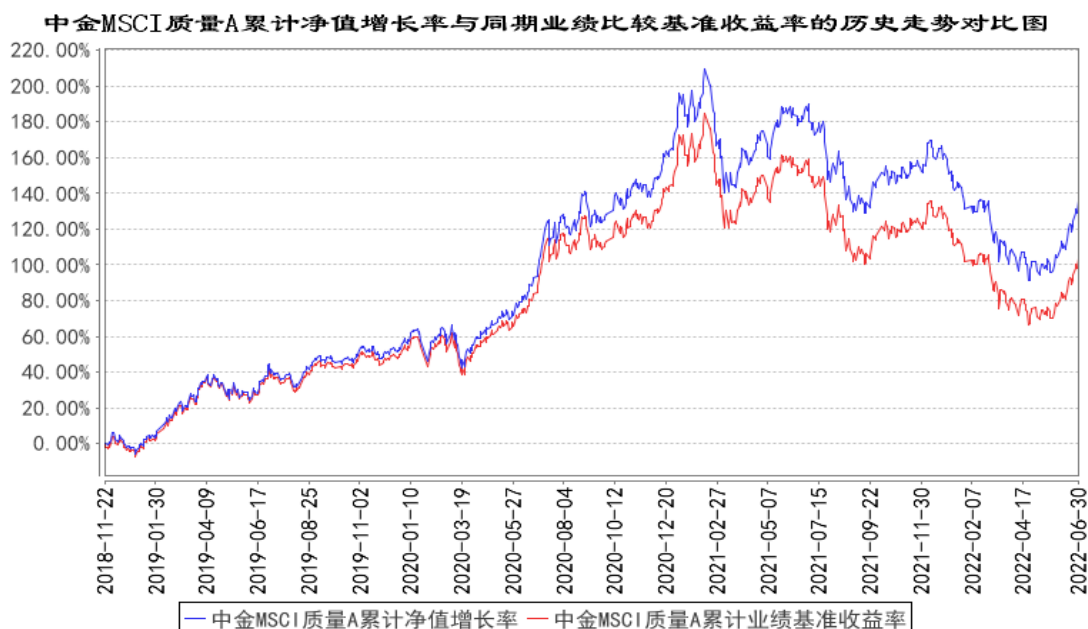
中金 MSCI 质量 A

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
过去一个月	14.65%	1.39%	14.07%	1.39%	0.58%	0.00%
过去三个月	14.23%	1.66%	13.27%	1.66%	0.96%	0.00%
过去六个月	-10.09%	1.67%	-11.01%	1.67%	0.92%	0.00%
过去一年	-17.94%	1.60%	-20.74%	1.61%	2.80%	-0.01%
过去三年	70.58%	1.51%	49.62%	1.51%	20.96%	0.00%
自基金合同生效起至今	135.60%	1.53%	103.43%	1.53%	32.17%	0.00%

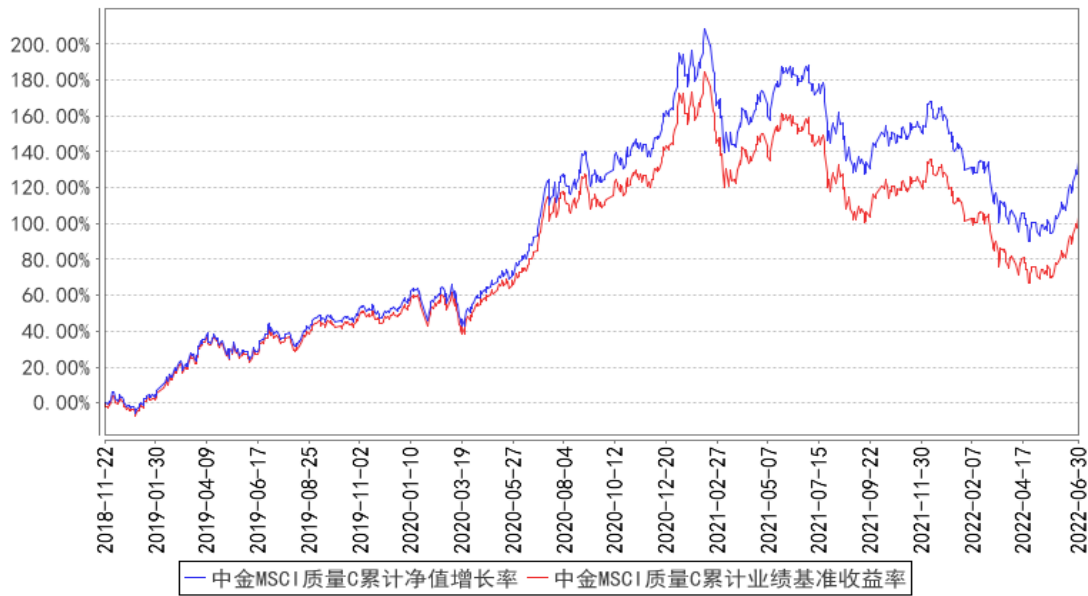
中金 MSCI 质量 C

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
过去一个月	14.63%	1.39%	14.07%	1.39%	0.56%	0.00%
过去三个月	14.16%	1.66%	13.27%	1.66%	0.89%	0.00%
过去六个月	-10.20%	1.67%	-11.01%	1.67%	0.81%	0.00%
过去一年	-18.15%	1.60%	-20.74%	1.61%	2.59%	-0.01%
过去三年	69.40%	1.51%	49.62%	1.51%	19.78%	0.00%
自基金合同生效起至今	134.06%	1.53%	103.43%	1.53%	30.63%	0.00%

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MSCI质量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 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，致力于于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 22 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。
刘重	本基金基	2020 年	-	10 年	刘重晋先生，理学博士。历任松河投资咨

晋	金经理	10 月 22 日			询（深圳）有限公司副总经理、量化研究员。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。
---	-----	--------------	--	--	--

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人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

本基金采用完全复制 MSCI 中国 A 股国际质量指数的策略，按照标的指数的成份股构成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金按照基金合同约定保持较高仓位运作，力争使组合与基准收益率的跟踪偏离和跟踪误差保持在较低水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金 MSCI 质量 A 基金份额净值为 2.3560 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.09%，同期业绩基准收益率为-11.01%；中金 MSCI 质量 C 基金份额净值为 2.3406 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.20%，同期业绩基准收益率为-11.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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，存在疫后内生反弹动能，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、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本托管人复核审查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。

§ 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 MSCI 中国 A 股国际质量指数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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,993,843.65	4,207,130.43
结算备付金		655,628.91	694,020.52
存出保证金		79,048.68	100,009.33
交易性金融资产	6.4.7.2	442,305,539.15	500,559,227.42
其中：股票投资		419,419,155.51	471,730,357.42
基金投资		-	-
债券投资		22,886,383.64	28,828,870.00
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		916,798.41	891,103.64
应收股利		-	-
应收申购款		1,015,595.50	825,196.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	339,102.91
资产总计		448,966,454.30	507,615,791.16
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		5,900,000.00	9,200,000.00
应付清算款		-	330,866.89
应付赎回款		1,863,816.35	521,524.77

应付管理人报酬		233,033.77	302,535.46
应付托管费		33,290.52	43,219.35
应付销售服务费		26,826.45	36,741.45
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.22	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	304,231.53	531,603.62
负债合计		8,361,198.84	10,966,491.54
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	187,406,951.44	189,875,028.63
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	253,198,304.02	306,774,270.99
净资产合计		440,605,255.46	496,649,299.62
负债和净资产总计		448,966,454.30	507,615,791.16

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，中金 MSCI 质量 A 的基金份额净值为 2.3560 元，期末份额总额为 126,986,917.58 份；中金 MSCI 质量 C 的基金份额净值为 2.3406 元，期末份额总额为 60,420,033.86 份。基金份额总额 187,406,951.44 份。

6.2 利润表

会计主体：中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数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
一、营业总收入		-48,573,881.17	23,820,774.74
1. 利息收入		19,312.64	497,689.83
其中：存款利息收入	6.4.7.13	19,312.64	52,756.22
债券利息收入		-	444,933.61
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-20,887,215.30	53,247,518.89
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-25,047,094.69	49,101,234.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	280,411.83	-12,018.70
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	3,879,467.56	4,158,302.94
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	-27,710,083.58	-30,044,983.39
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	4,105.07	120,549.41
减：二、营业总支出		2,076,271.38	3,886,442.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,436,432.11	1,951,054.14
2. 托管费	6.4.10.2.2	205,204.56	278,722.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	171,834.61	239,877.55
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		87,443.39	161,817.00
其中：卖出回购金融资产支出		87,443.39	161,817.00
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.02	0.01
8. 其他费用	6.4.7.23	175,356.69	1,254,972.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-50,650,152.55	19,934,331.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-50,650,152.55	19,934,331.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-50,650,152.55	19,934,331.94

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数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	189,875,028.63	-	306,774,270.99	496,649,299.62

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)	189,875,028.63	-	306,774,270.99	496,649,299.62
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “-” 号 填 列)	-2,468,077.19	-	-53,575,966.97	-56,044,044.16
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-50,650,152.55	-50,650,152.55
(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)	-2,468,077.19	-	-2,925,814.42	-5,393,891.61
其中:1. 基 金 申 购 款	39,655,628.84	-	46,106,669.52	85,762,298.36
2 .基 金 赎 回 款	-42,123,706.03	-	-49,032,483.94	-91,156,189.97
(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)	187,406,951.44	-	253,198,304.02	440,605,255.46
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)	-	-	-	-
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	152,083,319.15	-	262,807,772.23	414,891,091.38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	47,499,568.55	-	109,882,140.25	157,381,708.80
(一)、综合收益总额	-	-	19,934,331.94	19,934,331.94
(二)、本期基金份额	47,499,568.55	-	89,947,808.31	137,447,376.86

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	223,980,664.64	-	404,508,562.66	628,489,227.30
2. 基金赎回款	-176,481,096.09	-	-314,560,754.35	-491,041,850.44
（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）	199,582,887.70	-	372,689,912.48	572,272,800.18

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 MSCI 中国 A 股国际质量指数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 2018 年 5 月 30 日证监许可[2018]894 号《关于准予中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数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、《中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数发起式证券投资基金招募说明书》和《中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数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,托管人为招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)、招商证券、中国银河证券股份有限公司及上海好买基金销售有限公司等共同销售,募集期为 2018 年 9 月 10 日起至 2018 年 11 月 16 日。经向中国证监会备案,《中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2018 年 11 月 22 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 11,386,974.86 份(含利息转份额 318.80 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。

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 MSCI 中国 A 股国际质量指数发起式证券投资基金招募说明书》的相关内容,本基金根据认购/申购费用、赎回费、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,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金销售费用的不同,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 MSCI 中国 A 股国际质量指数发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券、

中期票据等)、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权、同业存单、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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 500,559,227.42 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 500,897,002.49 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

本基金在本报告期末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	3,993,843.65
等于：本金	3,993,085.32
加：应计利息	758.33
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	3,993,843.65

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	454,311,134.86	-	419,419,155.51	-34,891,979.35	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	22,534,608.26	352,153.64	22,886,383.64	-378.26
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	22,534,608.26	352,153.64	22,886,383.64	-378.26
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	476,845,743.12	352,153.64	442,305,539.15	-34,892,357.61	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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

本基金于本期末未持有其他资产。

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	15.58
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	139,556.76

其中：交易所市场	139,556.76
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	96,699.25
应付指数使用费	67,959.94
合计	304,231.53

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金 MSCI 质量 A

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	124,720,394.19	124,720,394.19
本期申购	23,924,621.21	23,924,621.21
本期赎回（以“-”号填列）	-21,658,097.82	-21,658,097.82
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	126,986,917.58	126,986,917.58

中金 MSCI 质量 C

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	65,154,634.44	65,154,634.44
本期申购	15,731,007.63	15,731,007.63
本期赎回（以“-”号填列）	-20,465,608.21	-20,465,608.21
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	60,420,033.86	60,420,033.86

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 MSCI 质量 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	121,626,721.01	80,474,757.62	202,101,478.63
本期利润	-15,389,433.16	-16,617,234.27	-32,006,667.43

本期基金份额交易产生的变动数	2,349,218.40	-245,654.42	2,103,563.98
其中：基金申购款	22,833,647.96	4,759,999.05	27,593,647.01
基金赎回款	-20,484,429.56	-5,005,653.47	-25,490,083.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	108,586,506.25	63,611,868.93	172,198,375.18

中金 MSCI 质量 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	62,649,726.48	42,023,065.88	104,672,792.36
本期利润	-7,550,635.81	-11,092,849.31	-18,643,485.12
本期基金份额交易产生的变动数	-4,375,601.41	-653,776.99	-5,029,378.40
其中：基金申购款	14,763,337.84	3,749,684.67	18,513,022.51
基金赎回款	-19,138,939.25	-4,403,461.66	-23,542,400.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,723,489.26	30,276,439.58	80,999,928.84

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	9,629.74
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	8,882.37
其他	800.53
合计	19,312.64

注：“其他”为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-25,047,094.69
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	-25,047,094.69

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
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	120,832,127.00
减：卖出股票成本总额	145,541,549.97
减：交易费用	337,671.72
买卖股票差价收入	-25,047,094.69

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	277,103.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,308.09
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	280,411.83

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	14,882,847.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,590,321.74
减：应计利息总额	289,203.13
减：交易费用	14.65
买卖债券差价收入	3,308.09

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

本基金在本期间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

本基金在本期间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

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

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

本基金在本期间无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

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

本基金在本期间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

本基金在本期间无其他投资收益。

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	3,879,467.56
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	3,879,467.56

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	-27,710,083.58

股票投资	-27,744,165.32
债券投资	34,081.74
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	-27,710,083.58

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	4,105.07
合计	4,105.07

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	37,191.88
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	78,657.44
合计	175,356.69

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
招商证券	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 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 (%)
招商证券	-	-	145,377,038.03	17.20

6.4.10.1.2 债券交易

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 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
招商证券	-	-	18,050,497.20	89.98

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 (%)
招商证券	-	-	123,500,000.00	7.63

6.4.10.1.4 权证交易

本基金在本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 (%)
招商证券	106,313.53	17.20	-	-

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,436,432.11	1,951,054.14
其中：支付销售机构的客户维护费	525,429.33	707,626.97

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 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	205,204.56	278,722.01

注：支付基金托管人招商证券的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期 2022年1月1日至2022年6月30日

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金 MSCI 质量 A	中金 MSCI 质量 C	合计
中金基金	-	191.76	191.76
招商证券	-	452.07	452.07
中金公司	-	-	-
中金财富证券	-	16,056.92	16,056.92
合计	-	16,700.75	16,700.75
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 MSCI 质量 A	中金 MSCI 质量 C	合计
中金基金	-	203.19	203.19
招商证券	-	1,513.15	1,513.15
中金公司	-	16,103.97	16,103.97
中金财富证券	-	3,989.26	3,989.26
合计	-	21,809.57	21,809.57

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 0.25% 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×0.25%/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

本基金本报告期与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

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

份额单位：份

项目	本期	本期
----	----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	中金 MSCI 质量 A	中金 MSCI 质量 C
基金合同生效日(2018 年 11 月 22 日)持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	-
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
	中金 MSCI 质量 A	中金 MSCI 质量 C
基金合同生效日(2018 年 11 月 22 日)持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.4032%	-

注: 报告期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金总赎回份额含转换出份额。

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

本基金本期及上年度可比期间均无由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	688173	希荻微	网下	3,773	126,659.61
中金公司	688225	亚信安全	网下	4,842	147,729.42
中金公司	688282	理工导航	网下	2,744	178,936.24
中金公司	301216	万凯新材	网下	4,291	153,102.88
中金公司	688295	中复神鹰	网下	6,049	177,417.17
中金公司	688125	安达智能	网下	3,396	205,627.80
中金公司	600938	中国海油	网上	3,000	32,400.00
中金公司	301150	中一科技	网下	971	158,816.76
中金公司	688320	禾川科技	网下	6,048	143,095.68
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	6,736	147,720.48
招商证券	301222	浙江恒威	网下	3,315	112,643.70
招商证券	688072	拓荆科技	网下	2,332	167,624.16
招商证券	001323	慕思股份	网下	573	22,306.89
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	1,252	167,429.96
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	68,646	197,014.02
招商证券	601963	重庆银行	网下	7,472	80,921.76
招商证券	688059	华锐精密	网下	1,023	37,943.07
招商证券	300960	通业科技	网下	2,332	28,170.56
招商证券	300968	格林精密	网下	11,620	79,829.40
招商证券	688517	金冠电气	网下	2,892	22,297.32

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	292	16,226.44	8,768.76	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股流通受限	39.88	31.09	413	16,470.44	12,840.17	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	32.71	32.02	421	13,770.00	13,480.42	数量包含期间送股
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	23.21	16.14	837	19,423.98	13,509.18	数量包含期间送股
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	新股流通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
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	1,032	14,169.36	15,985.68	-
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	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
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	4,272	164,301.12	164,301.12	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	38.46	38.46	475	18,268.50	18,268.50	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	38.39	23.90	509	19,540.51	12,165.10	-

		日									
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	109.04	82.76	147	16,028.88	12,165.72	数量包含期间送股	
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新股流通受限	30.82	21.46	483	14,886.06	10,365.18	-	
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股流通受限	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-	
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	876	18,685.08	19,745.04	-	
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	160	10,252.80	6,003.20	-	
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	275	21,054.00	14,278.00	-	
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	262	19,044.78	18,743.48	-	
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-	
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	430	15,342.40	12,831.20	-	
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	96.36	87.82	130	12,526.56	11,416.60	数量包含期间送股	
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-	
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	2022年	6个月	新股流	48.59	31.38	519	25,216.48	16,286.22	数量包含	

	动力	3月8日		通受限							期间送股
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股流通受限	56.69	41.86	257	14,569.33	10,758.02		-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股流通受限	19.18	32.07	1,130	21,673.40	36,239.10		-
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	4,138	139,243.70	139,243.70		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	460	15,479.00	15,479.00		-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,713	13,789.65	17,267.04		-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	48.30	41.68	254	12,268.20	10,586.72		-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16		-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76		-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36		-
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	333	17,325.99	18,787.86		-
688045	必易微	2022年5月19日	6个月	新股流通受限	55.15	61.98	3,939	217,235.85	244,139.22		-
688072	拓荆科技-U	2022年4月12日	6个月	新股流通受限	71.88	139.78	2,332	167,624.16	325,966.96		-
688220	翱捷科技-U	2022年1月6日	6个月	新股流通受限	164.54	68.59	2,379	391,440.66	163,175.61		-

688234	天岳先进	2022 年 1 月 5 日	6 个月	新股流通受限	82.79	65.19	2,269	187,850.51	147,916.11	-
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	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月内(含)	新股流通受限	21.93	21.93	6,736	147,720.48	147,720.48	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金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

本基金未进行银行间市场债券正回购交易。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日，本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为人民币 5,900,000.00 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

本基金属于股票指数型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型证券投资基金、混合型证券投资基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金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，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 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,993,085.32			758.33	3,993,843.65
结算备付金	655,334.01			294.90	655,628.91
存出保证金	79,013.18			35.50	79,048.68
交易性金融资产-股票投资				419,419,155.51	419,419,155.51
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	22,534,230.00			352,153.64	22,886,383.64
买入返售金融资产					
应收证券清算款				916,798.41	916,798.41
应收股利					
应收申购款				1,015,595.50	1,015,595.50
资产总计	27,261,662.51			-421,704,791.79	448,966,454.30

负债					
卖出回购金融资产款	5,900,000.00				5,900,000.00
应付证券清算款				-	-
应付赎回款				1,863,816.35	1,863,816.35
应付管理人报酬				233,033.77	233,033.77
应付托管费				33,290.52	33,290.52
应付销售服务费				26,826.45	26,826.45
应交税费				0.22	0.22
其他负债				304,231.53	304,231.53
负债总计	5,900,000.00			2,461,198.84	8,361,198.84
利率敏感度缺口	21,361,662.51			-419,243,592.95	440,605,255.46
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	4,207,130.43			-	4,207,130.43
结算备付金	694,020.52			-	694,020.52
存出保证金	100,009.33			-	100,009.33
交易性金融资产-股票投资				-471,730,357.42	471,730,357.42
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	28,828,870.00			-	28,828,870.00
买入返售金融资产				-	-
应收证券清算款				891,103.64	891,103.64
应收利息				339,102.91	339,102.91
应收股利				-	-
应收申购款				825,196.91	825,196.91
资产总计	33,830,030.28			-473,785,760.88	507,615,791.16
负债					
卖出回购金融资产款	9,200,000.00			-	9,200,000.00
应付证券清算款				330,866.89	330,866.89
应付赎回款				521,524.77	521,524.77
应付管理人报酬				302,535.46	302,535.46
应付托管费				43,219.35	43,219.35
应付交易费用				291,040.70	291,040.70
应付销售服务费				36,741.45	36,741.45
应交税费				-	-
应付利息				-3,615.04	-3,615.04
其他负债				244,177.96	244,177.96
负债总计	9,200,000.00			1,766,491.54	10,966,491.54
利率敏感度缺口	24,630,030.28			-472,019,269.34	496,649,299.62

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。		
	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	-	19,611.41	36,872.00
	市场利率上升 25 个基点	-19,611.41	-36,872.00

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	419,419,155.51	95.19	471,730,357.42	94.98
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	419,419,155.51	95.19	471,730,357.42	94.98

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5%	21,953,556.91	24,737,240.12
	业绩比较基准下降5%	-21,953,556.91	-24,737,240.12

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	417,390,959.43	469,245,142.38
第二层次	23,556,143.53	29,079,633.03
第三层次	1,358,436.19	2,234,452.01
合计	442,305,539.15	500,559,227.42

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	419,419,155.51	93.42
	其中：股票	419,419,155.51	93.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	22,886,383.64	5.10
	其中：债券	22,886,383.64	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	4,649,472.56	1.04
8	其他各项资产	2,011,442.59	0.45
9	合计	448,966,454.30	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	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	341,025,094.50	77.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,493,449.00	4.88
J	金融业	5,759,385.00	1.31
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	35,074,713.00	7.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,171,250.00	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,818,914.00	2.23
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	417,342,805.50	94.72

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	-	-
C	制造业	1,330,586.85	0.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,401.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	487,336.66	0.11
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,840.17	0.00
M	科学研究和技术服务业	30,307.77	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	25,674.28	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	168,203.12	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,076,350.01	0.47

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投资股票。

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	601888	中国中免	104,300	24,294,599.00	5.51
2	000858	五粮液	114,000	23,020,020.00	5.22
3	600809	山西汾酒	69,479	22,566,779.20	5.12
4	000568	泸州老窖	89,285	22,012,323.90	5.00
5	603288	海天味业	239,376	21,630,015.36	4.91
6	600276	恒瑞医药	576,150	21,369,403.50	4.85
7	600436	片仔癀	59,858	21,353,144.34	4.85
8	600519	贵州茅台	10,000	20,450,000.00	4.64
9	300760	迈瑞医疗	58,000	18,165,600.00	4.12
10	002027	分众传媒	1,601,800	10,780,114.00	2.45
11	000661	长春高新	41,953	9,792,669.26	2.22
12	603392	万泰生物	62,975	9,780,017.50	2.22
13	000651	格力电器	288,700	9,734,964.00	2.21
14	000895	双汇发展	324,895	9,519,423.50	2.16
15	300316	晶盛机电	122,100	8,252,739.00	1.87
16	600132	重庆啤酒	56,200	8,238,920.00	1.87
17	601100	恒立液压	129,200	7,974,224.00	1.81
18	300782	卓胜微	54,590	7,369,650.00	1.67
19	300628	亿联网络	92,000	7,005,800.00	1.59
20	600702	舍得酒业	34,200	6,976,458.00	1.58

21	300661	圣邦股份	37,300	6,789,346.00	1.54
22	000799	酒鬼酒	34,500	6,410,445.00	1.45
23	600426	华鲁恒升	215,800	6,301,360.00	1.43
24	600570	恒生电子	143,600	6,252,344.00	1.42
25	603260	合盛硅业	50,500	5,956,980.00	1.35
26	600763	通策医疗	33,100	5,773,964.00	1.31
27	300033	同花顺	59,900	5,759,385.00	1.31
28	600845	宝信软件	105,130	5,740,098.00	1.30
29	603899	晨光股份	94,800	5,316,384.00	1.21
30	600779	水井坊	55,300	5,117,462.00	1.16
31	300595	欧普康视	86,510	4,947,506.90	1.12
32	300529	健帆生物	90,135	4,586,970.15	1.04
33	600563	法拉电子	22,000	4,513,520.00	1.02
34	002555	三七互娱	210,900	4,477,407.00	1.02
35	603198	迎驾贡酒	68,100	4,436,034.00	1.01
36	603568	伟明环保	125,000	4,171,250.00	0.95
37	603882	金域医学	49,000	4,044,950.00	0.92
38	002372	伟星新材	166,420	4,000,736.80	0.91
39	601636	旗滨集团	290,800	3,707,700.00	0.84
40	603589	口子窖	54,816	3,212,765.76	0.73
41	002032	苏泊尔	56,100	3,160,674.00	0.72
42	603267	鸿远电子	23,400	3,143,322.00	0.71
43	603026	石大胜华	21,167	3,076,623.45	0.70
44	603444	吉比特	7,900	3,065,200.00	0.70
45	300726	宏达电子	46,000	2,813,820.00	0.64
46	300357	我武生物	47,946	2,494,630.38	0.57
47	688598	金博股份	7,699	2,268,895.30	0.51
48	600867	通化东宝	194,000	2,005,960.00	0.46
49	300418	昆仑万维	122,400	1,958,400.00	0.44
50	002925	盈趣科技	72,110	1,551,807.20	0.35

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-U	2,332	325,966.96	0.07
2	688045	必易微	3,939	244,139.22	0.06
3	301139	元道通信	4,747	182,569.62	0.04
4	688220	翱捷科技-U	2,379	163,175.61	0.04
5	301239	普瑞眼科	4,598	154,722.70	0.04
6	688234	天岳先进	2,269	147,916.11	0.03
7	688400	凌云光	6,736	147,720.48	0.03
8	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.03

9	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
10	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
11	301238	瑞泰新材	1,130	36,239.10	0.01
12	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.01
13	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
14	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
15	301302	华如科技	333	18,787.86	0.00
16	301201	诚达药业	262	18,743.48	0.00
17	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
18	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
19	301256	华融化学	1,713	17,267.04	0.00
20	301236	软通动力	519	16,286.22	0.00
21	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
22	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
23	301200	大族数控	275	14,278.00	0.00
24	301109	军信股份	837	13,509.18	0.00
25	301103	何氏眼科	421	13,480.42	0.00
26	301102	兆讯传媒	413	12,840.17	0.00
27	301216	万凯新材	430	12,831.20	0.00
28	301150	中一科技	147	12,165.72	0.00
29	301148	嘉戎技术	509	12,165.10	0.00
30	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
31	301219	腾远钴业	130	11,416.60	0.00
32	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
33	301237	和顺科技	257	10,758.02	0.00
34	301258	富士莱	254	10,586.72	0.00
35	301151	冠龙节能	483	10,365.18	0.00
36	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
37	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
38	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
39	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
40	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
41	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
42	300834	星辉环材	292	8,768.76	0.00
43	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
44	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
45	301196	唯科科技	160	6,003.20	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	000651	格力电器	9,463,590.00	1.91
2	600132	重庆啤酒	7,557,643.00	1.52
3	300316	晶盛机电	6,931,528.00	1.40
4	600570	恒生电子	5,817,232.04	1.17
5	600276	恒瑞医药	5,777,713.80	1.16
6	603260	合盛硅业	5,097,852.00	1.03
7	002555	三七互娱	4,686,562.00	0.94
8	600436	片仔癀	4,657,351.00	0.94
9	603288	海天味业	3,835,232.68	0.77
10	600519	贵州茅台	3,036,311.00	0.61
11	000858	五粮液	2,875,218.00	0.58
12	601888	中国中免	2,872,396.00	0.58
13	000895	双汇发展	2,474,324.00	0.50
14	600809	山西汾酒	2,443,747.00	0.49
15	300760	迈瑞医疗	2,278,890.00	0.46
16	000568	泸州老窖	2,208,033.00	0.44
17	600867	通化东宝	2,090,771.00	0.42
18	600887	伊利股份	1,945,425.76	0.39
19	688598	金博股份	1,924,845.65	0.39
20	300661	圣邦股份	1,831,990.00	0.37

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	600887	伊利股份	22,072,527.07	4.44
2	002475	立讯精密	20,101,135.12	4.05
3	600519	贵州茅台	7,715,805.00	1.55
4	000568	泸州老窖	4,791,673.00	0.96
5	002841	视源股份	4,780,910.68	0.96
6	600809	山西汾酒	3,302,600.00	0.66
7	002007	华兰生物	3,172,144.50	0.64
8	300760	迈瑞医疗	2,918,344.00	0.59
9	002508	老板电器	2,780,446.00	0.56
10	601888	中国中免	2,270,611.00	0.46
11	603392	万泰生物	2,030,581.80	0.41
12	000858	五粮液	1,941,234.00	0.39
13	002690	美亚光电	1,808,575.30	0.36
14	600436	片仔癀	1,578,639.00	0.32
15	600276	恒瑞医药	1,513,064.00	0.30
16	300773	拉卡拉	1,501,744.00	0.30
17	603288	海天味业	1,481,495.00	0.30
18	002626	金达威	1,408,754.00	0.28

19	000895	双汇发展	1,324,845.00	0.27
20	601100	恒立液压	969,061.00	0.20

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	120,974,513.38
卖出股票收入（成交）总额	120,832,127.00

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	22,886,383.64	5.19
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	22,886,383.64	5.19

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	83,000	8,501,605.86	1.93
2	019629	20 国债 03	69,000	6,965,147.34	1.58
3	019664	21 国债 16	33,000	3,354,325.23	0.76
4	019658	21 国债 10	30,000	3,057,147.95	0.69
5	019656	21 国债 08	10,000	1,008,157.26	0.23

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	79,048.68
2	应收清算款	916,798.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,015,595.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,011,442.59

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	占基金资产净	流通受限情况说明
----	------	------	----------	--------	----------

			允价值	值比例 (%)	
1	688072	拓荆科技-U	325,966.96	0.07	新股流通受限
2	688045	必易微	244,139.22	0.06	新股流通受限
3	301139	元道通信	182,569.62	0.04	新股未上市
4	688220	翱捷科技-U	163,175.61	0.04	新股流通受限
5	301239	普瑞眼科	154,722.70	0.04	新股未上市

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 MSCI 质量 A	28,403	4,470.90	290,034.98	0.23	126,696,882.60	99.77
中金 MSCI 质量 C	14,894	4,056.67	70,547.11	0.12	60,349,486.75	99.88
合计	43,297	4,328.41	360,582.09	0.19	187,046,369.35	99.81

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 MSCI 质量 A	1,747,307.77	1.38
	中金 MSCI 质量 C	35,765.97	0.06
	合计	1,783,073.74	0.95

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 MSCI 质量 A	>100
	中金 MSCI 质量 C	0
	合计	>100

本基金基金经理持有 本开放式基金	中金 MSCI 质量 A	0
	中金 MSCI 质量 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 MSCI 质量 A	中金 MSCI 质量 C
基金合同生效日 (2018 年 11 月 22 日) 基金份额总额	10,628,651.65	758,323.21
本报告期期初基金份 额总额	124,720,394.19	65,154,634.44
本报告期基金总申购 份额	23,924,621.21	15,731,007.63
减：本报告期基金总 赎回份额	21,658,097.82	20,465,608.21
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	126,986,917.58	60,420,033.86

§ 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

本报告期内本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、基金托管人公募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 (%)	
国海证券	2	203,726,279.22	88.45	148,984.17	88.45	-
方正证券	2	26,604,476.81	11.55	19,455.84	11.55	-
招商证券	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，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 (%)
国海证券	11,510,142.60	79.31	512,100,000.00	57.96	-	-
方正证券	3,002,100.00	20.69	371,500,000.00	42.04	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-14
2	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
3	中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数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
4	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
5	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-04
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	2022-03-11
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	2022-03-22
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	2022-03-29
9	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
10	中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数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
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	2022-04-09
12	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	2022-04-13
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	2022-04-15
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	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		
16	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
17	中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数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
18	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
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	2022-06-17
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、中国证监会批准中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数发起式证券投资基金募集注册文件
- 2、《中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、关于申请募集中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数发起式证券投资基金之法律意见书
- 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 MSCI 中国 A 股国际质量指数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