

中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资
基金
2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60

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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	62
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 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	193,138,651.58 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	128,307,101.13 份	64,831,550.45 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	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(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	中金沪深 300A	中金沪深 300C
本期已实现收益	2,637,694.66	854,122.76
本期利润	987,772.54	382,575.78
加权平均基金份额本期利润	0.0075	0.0111
本期加权平均净值利润率	0.47%	0.69%
本期基金份额净值增长率	1.50%	1.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
	期末可供分配利润	30,479,750.51
	期末可供分配基	0.4701

金份额利润		
期末基金资产净值	200,034,750.33	102,082,281.81
期末基金份额净值	1.5590	1.5746
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	55.90%	47.96%

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	1.72%	0.77%	1.10%	0.83%	0.62%	-0.06%
过去三个月	-3.25%	0.74%	-4.88%	0.79%	1.63%	-0.05%
过去六个月	1.50%	0.76%	-0.69%	0.80%	2.19%	-0.04%
过去一年	-10.13%	0.89%	-13.60%	0.94%	3.47%	-0.05%
过去三年	6.41%	1.14%	-7.07%	1.14%	13.48%	0.00%
自基金合同生效起至今	55.90%	1.09%	17.95%	1.11%	37.95%	-0.02%

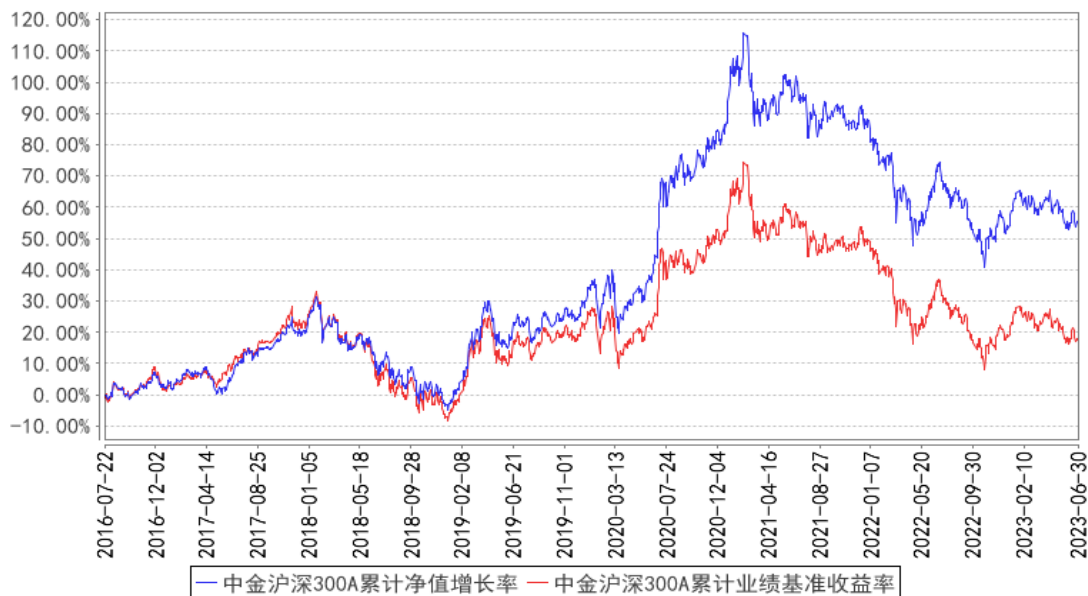
中金沪深 300C

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	1.69%	0.77%	1.10%	0.83%	0.59%	-0.06%
过去三个月	-3.33%	0.74%	-4.88%	0.79%	1.55%	-0.05%
过去六个月	1.31%	0.76%	-0.69%	0.80%	2.00%	-0.04%

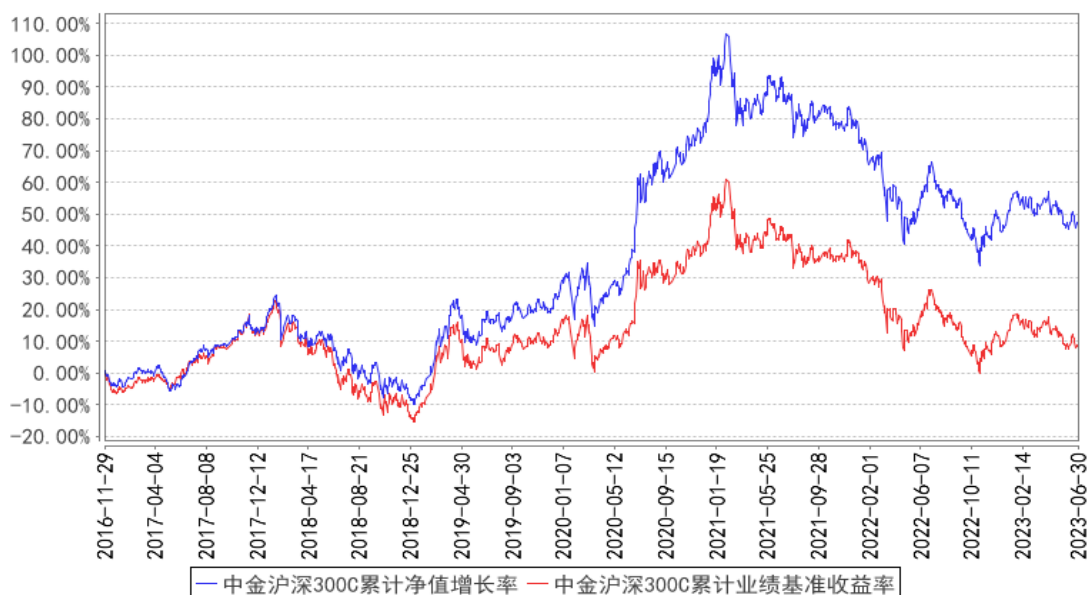
过去一年	-10.49%	0.89%	-13.60%	0.94%	3.11%	-0.05%
过去三年	5.14%	1.14%	-7.07%	1.14%	12.21%	0.00%
自基金合同生效起至今	47.96%	1.11%	8.95%	1.13%	39.01%	-0.02%

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 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 45 只公募基金，证券投资基金管理规模 1208.29 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	-	12 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。
王阳峰	本基金基金经理	2022 年 1 月 14 日	-	9 年	王阳峰先生，理学硕士。历任泰达宏利基金管理有限公司金融工程部投资经理、嘉实基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人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 1.5590 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.50%，同期业绩基准收益率为-0.69%；中金沪深 300C 基金份额净值为 1.5746 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.31%，同期业绩基准收益率为-0.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内经济持续恢复，总体回升向好，政策精准发力，宏观流动性充裕。回顾 A 股市场整体表现，主要规模指数表现分化，沪深 300 下跌 0.75%，中证 500 上涨 2.29%，中证 1000 上涨 5.10%，创业板指下跌 5.61%，科创 50 上涨 4.71%。从经济运行客观规律来分析，疫情防控平稳转段后，经济复苏并不是一个简单线性、一蹴而就的过程，不过，从上半年资本市场的表现看，市场一致预期往往容易阶段性低估这一过程的曲折性，这或可部分解释市场整体节奏变化和风格表现变迁。

展望下半年，尽管国内经济增长仍面临各种复杂因素的挑战，但在经济内在动能边际增强和政策组合拳全方位支持下，经济复苏与高质量发展将继续成为下半年国内经济的主题。A 股市场整体估值处于历史相对低位水平，对各类不确定性因素定价已较为充分，伴随上市公司业绩重回增长趋势，市场中期机会大于风险。考虑到疫情等非典型因素对上市公司盈利带来的扰动已不断淡化，市场有望从主题投资的热潮逐步转向对公司基本面的重视。

我们将坚持“高质研究驱动高效投资”的理念，不断挖掘具备长期配置价值的策略，并相对均衡地配置各类型策略，力争获取可持续的长期收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

基金管理人建立并执行基金估值相关管理制度，设置估值委员会研究、指导基金估值业务。各估值委员会委员和基金会计均具有相关工作经历和专业胜任能力。参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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 2023 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,756,462.07	4,599,912.31
结算备付金		3,754,380.95	485,901.33
存出保证金		519,915.24	24,460.30
交易性金融资产	6.4.7.2	296,488,624.53	221,977,931.56
其中：股票投资		280,112,505.52	209,562,307.54
基金投资		-	-
债券投资		16,376,119.01	12,415,624.02
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		403,296.38	-
应收股利		-	-
应收申购款		257,461.95	120,335.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		307,180,141.12	227,208,540.50

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-1,051.92	499,186.31
应付清算款		4,321,933.73	2,572,195.00
应付赎回款		64,809.80	72,331.47
应付管理人报酬		114,697.08	94,354.66
应付托管费		34,409.12	28,306.42
应付销售服务费		25,182.19	16,935.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	503,128.98	466,969.87
负债合计		5,063,108.98	3,750,278.98
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	193,138,651.58	145,114,569.09
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	108,978,380.56	78,343,692.43
净资产合计		302,117,032.14	223,458,261.52
负债和净资产总计		307,180,141.12	227,208,540.50

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，中金沪深 300A 的基金份额净值为 1.5590 元，期末份额总额为 128,307,101.13 份；中金沪深 300C 的基金份额净值为 1.5746 元，期末份额总额为 64,831,550.45 份。基金份额总额 193,138,651.58 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,478,400.38	-19,187,094.90
1. 利息收入		12,972.07	19,834.59
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,972.07	19,834.59
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		-	-

收入			
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,574,114.40	-32,008,099.79
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,389,905.30	-34,434,222.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	130,100.09	244,792.84
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-136,778.03	-
股利收益	6.4.7.19	3,190,887.04	2,181,329.99
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	-2,121,469.10	12,796,925.32
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	12,783.01	4,244.98
减：二、营业总支出		1,108,052.06	1,042,032.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	661,309.31	595,279.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	198,392.76	178,584.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	111,035.54	125,343.63
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		22,487.28	30,127.38
其中：卖出回购金融资产支出		22,487.28	30,127.38
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.03	0.14
8. 其他费用	6.4.7.23	114,827.14	112,697.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,370,348.32	-20,229,127.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,370,348.32	-20,229,127.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,370,348.32	-20,229,127.40

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	145,114,569.09	-	78,343,692.43	223,458,261.52
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）	145,114,569.09	-	78,343,692.43	223,458,261.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	48,024,082.49	-	30,634,688.13	78,658,770.62
（一）、综合收益总额	-	-	1,370,348.32	1,370,348.32
（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）	48,024,082.49	-	29,264,339.81	77,288,422.30
其中：1. 基金申购款	99,202,787.22	-	59,423,216.00	158,626,003.22
2. 基金赎回款	-51,178,704.73	-	-30,158,876.19	-81,337,580.92
（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）	193,138,651.58	-	108,978,380.56	302,117,032.14
项目	上年度可比期间 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(基金净值)	158,616,791.24	-	140,698,352.54	299,315,143.78
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)	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、本期期末净资产(基金净值)	150,589,590.01	-	111,436,594.87	262,026,184.88

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：

赵璧

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”）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。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》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和《资产管理产品相关会计处理规定》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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金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，资管产品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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	5,756,462.07
等于：本金	5,755,894.72
加：应计利息	567.35
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	5,756,462.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		290,766,924.30	-	280,112,505.52	-10,654,418.78
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	16,185,513.78	154,569.01	16,376,119.01	36,036.22
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	16,185,513.78	154,569.01	16,376,119.01	36,036.22
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		306,952,438.08	154,569.01	296,488,624.53	-10,618,382.56

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,513,370.00	-	-	-
其中：股指期货投资	3,513,370.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,513,370.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2309	IF2309	3.00	3,455,100.00	-58,270.00
合计				-58,270.00

减：可抵销期货 暂收款				-58,270.00
净额				-

注：1、按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末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

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

本基金本报告期末计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	370,227.22
其中：交易所市场	370,227.22
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,739.85
应付指数使用费	41,161.91
合计	503,128.98

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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	113,689,793.24	113,689,793.24
本期申购	55,490,696.42	55,490,696.42
本期赎回（以“-”号填列）	-40,873,388.53	-40,873,388.53
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	128,307,101.13	128,307,101.13

中金沪深 300C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,424,775.85	31,424,775.85
本期申购	43,712,090.80	43,712,090.80
本期赎回（以“-”号填列）	-10,305,316.20	-10,305,316.20
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	64,831,550.45	64,831,550.45

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
上年度末	49,437,059.13	11,489,094.94	60,926,154.07
本期利润	2,637,694.66	-1,649,922.12	987,772.54
本期基金份额交易产生的变动数	6,533,721.39	3,280,001.20	9,813,722.59
其中：基金申购款	25,261,892.64	8,456,836.30	33,718,728.94
基金赎回款	-18,728,171.25	-5,176,835.10	-23,905,006.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	58,608,475.18	13,119,174.02	71,727,649.20

中金沪深 300C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,176,005.75	3,241,532.61	17,417,538.36
本期利润	854,122.76	-471,546.98	382,575.78
本期基金份额交易产生的变动数	15,449,622.00	4,000,995.22	19,450,617.22
其中：基金申购款	20,283,698.38	5,420,788.68	25,704,487.06
基金赎回款	-4,834,076.38	-1,419,793.46	-6,253,869.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,479,750.51	6,770,980.85	37,250,731.36

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	6,430.03
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	6,325.70
其他	216.34
合计	12,972.07

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,389,905.30
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	1,389,905.30

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	441,116,339.92
减：卖出股票成本总额	438,525,292.98
减：交易费用	1,201,141.64
买卖股票差价收入	1,389,905.30

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	134,844.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,744.27
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	130,100.09

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,064,724.39
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,800,142.01
减：应计利息总额	269,322.82
减：交易费用	3.83
买卖债券差价收入	-4,744.27

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期末未持有贵金属。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-136,778.03

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,190,887.04

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	3,190,887.04

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,063,199.10
股票投资	-2,123,600.11
债券投资	60,401.01
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-58,270.00
权证投资	-
期货投资	-58,270.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,121,469.10

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	12,782.95
基金转换费收入	0.06
合计	12,783.01

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023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	21,161.91
划款手续费	1,925.38
合计	114,827.14

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（以下简称“中金财富证券”）	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	661,309.31	595,279.90
其中：支付销售机构的客户维护费	183,475.06	132,916.12

注：支付基金管理人中金基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	198,392.76	178,584.01

注：支付基金托管人工商银行的基金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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	9.05	9.05
中金财富证券	-	2,937.14	2,937.14
合计	-	2,946.19	2,946.19
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 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
中金财富证券	-	2,608.17	2,608.17
合计	-	25,819.04	25,819.04

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**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

本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	5,756,462.07	6,430.03	2,815,500.19	5,060.60

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中金公司	688486	龙迅股份	网下	1,258	81,468.08
中金公司	688502	茂莱光学	网下	1,029	71,741.88
中金公司	001287	中电港	网下	3,518	41,793.84
中金公司	688249	晶合集成	网下	15,672	311,245.92
中金公司	301332	德尔玛	网下	5,372	79,559.32
中金公司	688593	新相微	网下	6,389	71,429.02

中金公司	688472	阿特斯	网下	9,251	102,686.10
中金公司	688334	西高院	网下	5,165	73,136.40
中金公司	601916	浙商银行	配股	6,180	12,483.60
上年度可比期间 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： 股/张）	总金额
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

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（2023 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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	86	2,401.98	2,840.58	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电	2023 年 3 月	6 个月	新股流通	11.88	21.02	352	4,181.76	7,399.04	-

	港	月 30 日		受限							
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-	
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	109	2,254.12	2,778.41	-	
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	129	1,984.02	1,918.23	-	
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	50	2,224.00	1,974.00	-	
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	42.45	32.97	197	8,362.65	6,495.09	-	
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	226	9,311.20	9,647.94	-	
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	108	6,102.00	5,716.44	-	
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	169	5,746.00	5,903.17	-	
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	25.82	25.82	2,395	61,838.90	61,838.90	-	
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	57.88	49.17	173	10,013.24	8,506.41	-	
301225	恒勃	2023 年 6 月	6 个月	新股流通	35.66	33.26	253	9,021.98	8,414.78	-	

	股份	月 8 日		受限							
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流通受限	72.50	58.42	111	8,047.50	6,484.62	-	
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	50.00	30.71	286	14,300.00	8,783.06	-	
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	30.85	23.63	432	13,327.20	10,208.16	-	
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,635	60,331.50	60,331.50	-	
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	30.22	25.50	296	8,945.12	7,548.00	-	
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	31.58	25.10	242	7,643.14	6,074.20	科源制药于 2023 年 5 月 26 日每 10 股送 4 股	
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	38.13	31.03	316	12,049.08	9,805.48	-	
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	19.99	19.99	4,853	97,011.47	97,011.47	-	
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	270	7,992.00	19,283.40	-	
301303	真	2023	6 个月	新股	26.80	22.32	376	10,076.80	8,392.32	-	

	兰仪表	年2月13日		流通受限						
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	377	9,519.25	7,423.13	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	335	10,833.90	10,673.10	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	211	14,196.08	13,805.73	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	207	6,684.03	10,581.84	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	148	5,780.88	5,825.28	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	132	10,137.60	14,249.40	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	538	7,967.78	7,386.74	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	206	6,715.60	6,256.22	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	93	6,830.85	4,337.52	-
301355	南	2023	6个月	新股	17.55	16.75	427	7,493.85	7,152.25	-

	王科技	年6月2日		流通受限						
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	256	6,085.12	10,979.84	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	111	7,978.68	10,278.60	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	201	6,779.73	6,401.85	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	290	7,151.40	6,527.90	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	294	6,997.20	9,654.96	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	279	12,878.64	9,965.88	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	254	7,617.46	6,042.66	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1-6个月(含)	新股流通受限	26.68	26.68	3,593	95,861.24	95,861.24	-
301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	175	9,322.25	7,035.00	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	229	10,073.71	11,809.53	-
301408	华	2023	6个月	新股	16.24	16.95	505	8,201.20	8,559.75	-

	人健康	年2月22日		流通受限							
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-	
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-	
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	329	6,576.71	5,560.10	-	
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	691	4,546.78	5,237.78	-	
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	254	2,631.44	3,007.36	-	
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	239	2,786.74	2,930.14	-	
601916	浙商银行	2023年6月27日	1-6个月(含)	配股流通受限	2.02	2.64	6,180	12,483.60	16,315.20	浙商银行于2023年6月27日每10股配3股	
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	88	2,286.24	2,158.64	-	
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	262	4,663.60	4,687.18	-	

603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	255	9,218.25	9,723.15	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	1,568	31,140.48	28,318.08	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	517	7,320.72	8,380.57	-
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	740	8,954.00	8,931.80	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	263	6,206.80	17,008.21	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	265	5,088.00	6,765.45	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	230	6,131.80	7,245.00	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	75.00	90.76	104	7,800.00	9,439.04	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	2,905	16,529.45	15,716.05	-

688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	926	10,278.60	15,779.04	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	39.99	36.71	243	9,717.57	8,920.53	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	164.83	122.11	73	12,032.44	8,914.03	索辰科技于2023年6月20日每10股送4.8股
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	20.92	19.16	372	7,782.24	7,127.52	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	392	8,569.12	9,349.20	-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	87	13,257.06	11,829.39	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	168	7,336.56	8,912.40	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	366	7,748.22	8,601.00	-
688562	航天软	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	523	6,631.64	11,668.13	-

	件	日								
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	273	8,260.98	6,915.09	-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股流通受限	135.80	120.41	92	12,493.60	11,077.72	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	61	7,673.80	7,199.83	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	639	7,144.02	9,323.01	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	655	6,995.40	8,082.70	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	68	8,559.84	5,901.72	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	602	5,574.52	11,191.18	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	199	5,030.72	5,944.13	-

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

于2023年6月30日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	12,001.00
未评级	-	-
合计	-	12,001.00

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

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 2023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	5,755,894.72	-	-	567.35	5,756,462.07
结算备付金	730,814.08	-	-	3,023,566.87	3,754,380.95
存出保证金	36,184.94	-	-	483,730.30	519,915.24
交易性金融资产	16,221,550.00	-	-	-280,267,074.53	296,488,624.53
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	403,296.38	403,296.38
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	257,461.95	257,461.95
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,744,443.74	-	-	-284,435,697.38	307,180,141.12
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-1,051.92	-1,051.92
应付清算款	-	-	-	4,321,933.73	4,321,933.73
应付赎回款	-	-	-	64,809.80	64,809.80
应付销售服务费	-	-	-	25,182.19	25,182.19
应付管理人报酬	-	-	-	114,697.08	114,697.08
应付托管费	-	-	-	34,409.12	34,409.12
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	503,128.98	503,128.98
负债总计	-	-	-	5,063,108.98	5,063,108.98
利率敏感度缺口	22,744,443.74	-	-	-279,372,588.40	302,117,032.14
上年度末 2022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	4,599,651.97	-	-	260.34	4,599,912.31
结算备付金	483,661.97	-	-	2,239.36	485,901.33

存出保证金	24,448.20	-	-	12.10	24,460.30
交易性金融资产	12,197,860.00	-	12,000.00	209,768,071.56	221,977,931.56
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	120,335.00	120,335.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,305,622.14	-	12,000.00	209,890,918.36	227,208,540.50
负债					
卖出回购金融资产款	500,000.00	-	-	-813.69	499,186.31
应付清算款	-	-	-	2,572,195.00	2,572,195.00
应付赎回款	-	-	-	72,331.47	72,331.47
应付销售服务费	-	-	-	16,935.25	16,935.25
应付管理人报酬	-	-	-	94,354.66	94,354.66
应付托管费	-	-	-	28,306.42	28,306.42
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	466,969.87	466,969.87
负债总计	500,000.00	-	-	3,250,278.98	3,750,278.98
利率敏感度缺口	16,805,622.14	-	12,000.00	206,640,639.38	223,458,261.52

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-20,559.02	-6,011.91
	市场利率下降 25 个基点	20,559.02	6,011.91

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	280,112,505.52	92.72	209,562,307.54	93.78
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	280,112,505.52	92.72	209,562,307.54	93.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	14,261,287.61	10,954,578.46
业绩比较基准下降	-14,261,287.61	-10,954,578.46	

	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

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	279,091,192.32	208,685,010.59
第二层次	16,707,477.32	12,415,624.02
第三层次	689,954.89	877,296.95
合计	296,488,624.53	221,977,931.56

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，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	280,112,505.52	91.19
	其中：股票	280,112,505.52	91.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,376,119.01	5.33
	其中：债券	16,376,119.01	5.33
	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	9,510,843.02	3.10
8	其他各项资产	1,180,673.57	0.38
9	合计	307,180,141.12	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,991,573.70	0.99
B	采矿业	9,953,009.12	3.29
C	制造业	153,124,178.06	50.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,545,898.19	3.16
E	建筑业	7,458,780.80	2.47
F	批发和零售业	1,162,539.00	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	9,304,183.00	3.08
H	住宿和餐饮业	1,033,096.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,490,612.02	4.13
J	金融业	59,154,187.11	19.58
K	房地产业	3,895,353.00	1.29
L	租赁和商务服务业	888,608.36	0.29

M	科学研究和技术服务业	1,567,045.40	0.52
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	1,324,045.10	0.44
R	文化、体育和娱乐业	75,262.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	273,968,370.86	90.68

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	49,321.00	0.02
B	采矿业	49,816.20	0.02
C	制造业	4,720,153.24	1.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	38,661.65	0.01
F	批发和零售业	123,379.47	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	43,186.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	522,785.11	0.17
J	金融业	229,123.20	0.08
K	房地产业	97,746.00	0.03
L	租赁和商务服务业	91,532.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	29,134.79	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	7,423.13	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	106,425.40	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,144,134.66	2.03

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	9,200	15,557,200.00	5.15
2	300750	宁德时代	41,400	9,471,906.00	3.14
3	601318	中国平安	191,430	8,882,352.00	2.94
4	600036	招商银行	194,400	6,368,544.00	2.11
5	000858	五粮液	30,452	4,981,033.64	1.65
6	000333	美的集团	69,565	4,098,769.80	1.36
7	002475	立讯精密	110,700	3,592,215.00	1.19
8	600030	中信证券	169,770	3,358,050.60	1.11
9	002594	比亚迪	12,600	3,254,202.00	1.08
10	600900	长江电力	146,434	3,230,334.04	1.07
11	002142	宁波银行	114,900	2,906,970.00	0.96
12	601688	华泰证券	203,200	2,798,064.00	0.93
13	601211	国泰君安	181,700	2,541,983.00	0.84
14	600941	中国移动	26,700	2,491,110.00	0.82
15	601668	中国建筑	431,900	2,479,106.00	0.82
16	600887	伊利股份	83,935	2,377,039.20	0.79
17	601006	大秦铁路	303,900	2,257,977.00	0.75
18	600050	中国联通	442,400	2,123,520.00	0.70
19	600016	民生银行	563,000	2,111,250.00	0.70
20	000538	云南白药	40,200	2,109,696.00	0.70
21	000063	中兴通讯	46,200	2,103,948.00	0.70
22	601816	京沪高铁	399,000	2,098,740.00	0.69
23	600926	杭州银行	176,400	2,072,700.00	0.69
24	601328	交通银行	348,200	2,019,560.00	0.67
25	601728	中国电信	353,700	1,991,331.00	0.66
26	601838	成都银行	162,200	1,980,462.00	0.66
27	002304	洋河股份	14,900	1,957,115.00	0.65
28	300760	迈瑞医疗	6,500	1,948,700.00	0.65
29	601166	兴业银行	124,058	1,941,507.70	0.64
30	000651	格力电器	52,400	1,913,124.00	0.63
31	000002	万科A	135,800	1,903,916.00	0.63
32	600089	特变电工	85,000	1,894,650.00	0.63
33	600690	海尔智家	75,435	1,771,213.80	0.59
34	000338	潍柴动力	139,900	1,743,154.00	0.58
35	000001	平安银行	153,500	1,723,805.00	0.57
36	600438	通威股份	49,900	1,712,069.00	0.57
37	002938	鹏鼎控股	70,400	1,710,016.00	0.57
38	000157	中联重科	248,600	1,678,050.00	0.56
39	601877	正泰电器	60,226	1,665,248.90	0.55

40	601088	中国神华	53,600	1,648,200.00	0.55
41	688599	天合光能	38,216	1,628,383.76	0.54
42	601225	陕西煤业	88,600	1,611,634.00	0.53
43	000776	广发证券	108,600	1,597,506.00	0.53
44	002179	中航光电	35,220	1,597,227.00	0.53
45	600660	福耀玻璃	44,400	1,591,740.00	0.53
46	600406	国电南瑞	68,284	1,577,360.40	0.52
47	002371	北方华创	4,900	1,556,485.00	0.52
48	603799	华友钴业	33,800	1,551,758.00	0.51
49	300498	温氏股份	84,200	1,545,070.00	0.51
50	600028	中国石化	238,100	1,514,316.00	0.50
51	601169	北京银行	326,400	1,511,232.00	0.50
52	600362	江西铜业	79,500	1,508,910.00	0.50
53	601618	中国中冶	376,900	1,496,293.00	0.50
54	300124	汇川技术	22,800	1,463,988.00	0.48
55	601988	中国银行	372,000	1,454,520.00	0.48
56	002714	牧原股份	34,318	1,446,503.70	0.48
57	300316	晶盛机电	20,400	1,446,360.00	0.48
58	601766	中国中车	221,700	1,441,050.00	0.48
59	601012	隆基绿能	48,677	1,395,569.59	0.46
60	000568	泸州老窖	6,600	1,383,162.00	0.46
61	300896	爱美客	3,100	1,379,345.00	0.46
62	600585	海螺水泥	58,000	1,376,920.00	0.46
63	600039	四川路桥	140,180	1,375,165.80	0.46
64	601229	上海银行	237,300	1,364,475.00	0.45
65	601319	中国人保	232,600	1,358,384.00	0.45
66	601985	中国核电	191,843	1,352,493.15	0.45
67	002466	天齐锂业	19,300	1,349,263.00	0.45
68	600809	山西汾酒	7,100	1,313,997.00	0.43
69	300142	沃森生物	49,300	1,303,985.00	0.43
70	600104	上汽集团	91,697	1,299,346.49	0.43
71	603899	晨光股份	28,700	1,281,168.00	0.42
72	002202	金风科技	120,200	1,276,524.00	0.42
73	601138	工业富联	50,300	1,267,560.00	0.42
74	300015	爱尔眼科	67,722	1,256,243.10	0.42
75	003816	中国广核	402,100	1,250,531.00	0.41
76	601601	中国太保	47,900	1,244,442.00	0.41
77	002050	三花智控	40,300	1,219,478.00	0.40
78	000408	藏格矿业	53,500	1,207,495.00	0.40
79	600674	川投能源	80,200	1,207,010.00	0.40
80	603290	斯达半导	5,500	1,183,600.00	0.39
81	600309	万华化学	13,400	1,177,056.00	0.39
82	000725	京东方 A	279,700	1,143,973.00	0.38

83	603259	药明康德	18,340	1,142,765.40	0.38
84	601216	君正集团	278,700	1,142,670.00	0.38
85	600011	华能国际	120,600	1,116,756.00	0.37
86	300274	阳光电源	9,500	1,107,985.00	0.37
87	600018	上港集团	210,600	1,105,650.00	0.37
88	000625	长安汽车	85,282	1,102,696.26	0.36
89	600919	江苏银行	148,400	1,090,740.00	0.36
90	000100	TCL 科技	271,940	1,071,443.60	0.35
91	600741	华域汽车	57,100	1,054,066.00	0.35
92	000786	北新建材	43,000	1,053,930.00	0.35
93	600754	锦江酒店	24,400	1,033,096.00	0.34
94	601857	中国石油	137,700	1,028,619.00	0.34
95	000895	双汇发展	41,900	1,026,131.00	0.34
96	600019	宝钢股份	182,400	1,025,088.00	0.34
97	600332	白云山	31,907	1,017,195.16	0.34
98	600196	复星医药	32,800	1,013,520.00	0.34
99	600570	恒生电子	22,600	1,000,954.00	0.33
100	600837	海通证券	108,100	996,682.00	0.33
101	000938	紫光股份	31,000	987,350.00	0.33
102	603369	今世缘	18,200	960,960.00	0.32
103	600233	圆通速递	64,200	934,752.00	0.31
104	002001	新 和 成	60,300	928,620.00	0.31
105	601669	中国电建	160,000	918,400.00	0.30
106	001979	招商蛇口	70,300	916,009.00	0.30
107	000596	古井贡酒	3,700	915,306.00	0.30
108	600600	青岛啤酒	8,800	911,944.00	0.30
109	002415	海康威视	27,100	897,281.00	0.30
110	603659	璞泰来	23,455	896,450.10	0.30
111	600085	同仁堂	15,447	889,129.32	0.29
112	600276	恒瑞医药	18,100	866,990.00	0.29
113	600219	南山铝业	284,700	859,794.00	0.28
114	002460	赣锋锂业	13,880	846,124.80	0.28
115	601288	农业银行	239,500	845,435.00	0.28
116	600875	东方电气	44,900	837,385.00	0.28
117	300014	亿纬锂能	13,800	834,900.00	0.28
118	601699	潞安环能	51,100	833,952.00	0.28
119	300059	东方财富	58,006	823,685.20	0.27
120	600048	保利发展	62,900	819,587.00	0.27
121	601607	上海医药	36,200	811,242.00	0.27
122	002916	深南电路	10,500	791,385.00	0.26
123	002252	上海莱士	105,000	788,550.00	0.26
124	601898	中煤能源	92,200	778,168.00	0.26
125	601878	浙商证券	78,700	777,556.00	0.26

126	688981	中芯国际	15,092	762,447.84	0.25
127	600745	闻泰科技	15,300	748,170.00	0.25
128	300408	三环集团	25,000	733,750.00	0.24
129	600436	片仔癀	2,500	715,900.00	0.24
130	600183	生益科技	50,300	714,260.00	0.24
131	002601	龙佰集团	43,200	712,800.00	0.24
132	600547	山东黄金	29,800	699,704.00	0.23
133	002129	TCL 中环	20,975	696,370.00	0.23
134	688012	中微公司	4,400	688,380.00	0.23
135	300433	蓝思科技	56,900	669,144.00	0.22
136	601600	中国铝业	118,400	650,016.00	0.22
137	688111	金山办公	1,371	647,413.62	0.21
138	002756	永兴材料	10,310	645,509.10	0.21
139	600958	东方证券	66,000	640,200.00	0.21
140	601888	中国中免	5,612	620,294.36	0.21
141	002049	紫光国微	6,624	617,688.00	0.20
142	002812	恩捷股份	6,400	616,640.00	0.20
143	600886	国投电力	48,000	607,200.00	0.20
144	002410	广联达	18,680	606,913.20	0.20
145	601899	紫金矿业	53,300	606,021.00	0.20
146	601658	邮储银行	122,900	600,981.00	0.20
147	603019	中科曙光	11,700	595,530.00	0.20
148	002236	大华股份	29,500	582,625.00	0.19
149	601989	中国重工	119,000	573,580.00	0.19
150	300454	深信服	5,000	566,250.00	0.19
151	600000	浦发银行	76,000	550,240.00	0.18
152	688396	华润微	10,105	529,603.05	0.18
153	002352	顺丰控股	11,700	527,553.00	0.17
154	600115	中国东航	110,000	523,600.00	0.17
155	002230	科大讯飞	7,700	523,292.00	0.17
156	605117	德业股份	3,460	517,443.00	0.17
157	000768	中航西飞	19,300	516,275.00	0.17
158	300999	金龙鱼	12,800	511,872.00	0.17
159	600015	华夏银行	92,100	498,261.00	0.16
160	601818	光大银行	162,100	497,647.00	0.16
161	002007	华兰生物	22,200	497,502.00	0.16
162	688126	沪硅产业	23,601	493,260.90	0.16
163	688223	晶科能源	35,000	492,100.00	0.16
164	002459	晶澳科技	11,660	486,222.00	0.16
165	601111	中国国航	58,200	479,568.00	0.16
166	000166	申万宏源	103,100	476,322.00	0.16
167	600061	国投资本	64,800	461,376.00	0.15
168	300450	先导智能	12,700	459,359.00	0.15

169	000983	山西焦煤	50,200	456,820.00	0.15
170	002821	凯莱英	3,700	436,082.00	0.14
171	601009	南京银行	52,600	420,800.00	0.14
172	601021	春秋航空	7,300	419,531.00	0.14
173	002241	歌尔股份	23,500	417,125.00	0.14
174	601808	中海油服	29,499	409,446.12	0.14
175	603195	公牛集团	4,240	407,294.40	0.13
176	600989	宝丰能源	32,100	404,781.00	0.13
177	601919	中远海控	43,000	404,200.00	0.13
178	000617	中油资本	55,900	404,157.00	0.13
179	603986	兆易创新	3,700	393,125.00	0.13
180	688008	澜起科技	6,800	390,456.00	0.13
181	600031	三一重工	22,200	369,186.00	0.12
182	300033	同花顺	2,100	368,088.00	0.12
183	000963	华东医药	8,100	351,297.00	0.12
184	601236	红塔证券	47,000	350,150.00	0.12
185	688065	凯赛生物	5,550	345,543.00	0.11
186	600760	中航沈飞	7,660	344,700.00	0.11
187	603501	韦尔股份	3,500	343,140.00	0.11
188	601238	广汽集团	31,500	328,230.00	0.11
189	002841	视源股份	4,882	326,312.88	0.11
190	603288	海天味业	6,960	326,076.00	0.11
191	000792	盐湖股份	16,700	320,139.00	0.11
192	300207	欣旺达	19,400	316,608.00	0.10
193	600111	北方稀土	13,200	316,536.00	0.10
194	605499	东鹏饮料	1,800	311,220.00	0.10
195	601390	中国中铁	40,000	303,200.00	0.10
196	601186	中国铁建	29,000	285,650.00	0.09
197	600795	国电电力	72,300	276,909.00	0.09
198	601939	建设银行	44,200	276,692.00	0.09
199	600150	中国船舶	8,400	276,444.00	0.09
200	601689	拓普集团	3,400	274,380.00	0.09
201	002027	分众传媒	39,400	268,314.00	0.09
202	601628	中国人寿	7,600	265,696.00	0.09
203	000708	中信特钢	16,500	261,360.00	0.09
204	000733	振华科技	2,700	258,795.00	0.09
205	300759	康龙化成	6,700	256,476.00	0.08
206	600188	兖矿能源	8,300	248,336.00	0.08
207	600905	三峡能源	46,200	248,094.00	0.08
208	601998	中信银行	40,500	242,190.00	0.08
209	601336	新华保险	6,400	235,328.00	0.08
210	300751	迈为股份	1,380	233,744.40	0.08
211	002555	三七互娱	6,700	233,696.00	0.08

212	300122	智飞生物	5,200	229,840.00	0.08
213	688303	大全能源	5,518	223,203.10	0.07
214	600584	长电科技	7,015	218,657.55	0.07
215	600999	招商证券	15,700	213,049.00	0.07
216	601100	恒立液压	3,300	212,289.00	0.07
217	002311	海大集团	4,400	206,096.00	0.07
218	000661	长春高新	1,500	204,450.00	0.07
219	600383	金地集团	28,100	202,601.00	0.07
220	300496	中科创达	2,100	202,335.00	0.07
221	600025	华能水电	27,900	198,927.00	0.07
222	688363	华熙生物	2,231	198,915.96	0.07
223	600009	上海机场	4,300	195,306.00	0.06
224	600884	杉杉股份	12,900	195,306.00	0.06
225	601800	中国交建	17,600	192,016.00	0.06
226	600893	航发动力	4,500	190,170.00	0.06
227	600029	南方航空	31,300	188,739.00	0.06
228	600845	宝信软件	3,680	186,980.80	0.06
229	601360	三六零	14,700	184,338.00	0.06
230	603260	合盛硅业	2,500	175,050.00	0.06
231	300628	亿联网络	4,980	174,648.60	0.06
232	600606	绿地控股	62,800	172,700.00	0.06
233	002271	东方雨虹	6,300	171,738.00	0.06
234	603185	弘元绿能	2,300	171,465.00	0.06
235	002709	天赐材料	4,100	168,879.00	0.06
236	300347	泰格医药	2,600	167,804.00	0.06
237	300769	德方纳米	1,520	167,549.60	0.06
238	603806	福斯特	4,280	159,173.20	0.05
239	002736	国信证券	18,100	158,013.00	0.05
240	002180	纳思达	4,600	157,550.00	0.05
241	000425	徐工机械	23,200	157,064.00	0.05
242	000977	浪潮信息	3,200	155,200.00	0.05
243	601868	中国能建	63,100	147,654.00	0.05
244	688036	传音控股	1,000	147,000.00	0.05
245	601881	中国银河	12,401	143,975.61	0.05
246	002493	荣盛石化	12,300	143,172.00	0.05
247	600426	华鲁恒升	4,500	137,835.00	0.05
248	601066	中信建投	5,600	135,520.00	0.04
249	600588	用友网络	6,500	133,250.00	0.04
250	601377	兴业证券	21,700	132,804.00	0.04
251	600346	恒力石化	9,200	131,836.00	0.04
252	600918	中泰证券	18,800	129,908.00	0.04
253	000301	东方盛虹	10,700	126,474.00	0.04
254	300957	贝泰妮	1,400	124,432.00	0.04

255	300223	北京君正	1,400	123,634.00	0.04
256	600010	包钢股份	68,500	122,615.00	0.04
257	600732	爱旭股份	3,940	121,155.00	0.04
258	600132	重庆啤酒	1,300	119,808.00	0.04
259	603993	洛阳钼业	22,100	117,793.00	0.04
260	300782	卓胜微	1,200	115,956.00	0.04
261	002120	韵达股份	12,000	114,720.00	0.04
262	300763	锦浪科技	1,100	114,510.00	0.04
263	002074	国轩高科	4,100	113,242.00	0.04
264	002920	德赛西威	700	109,067.00	0.04
265	000876	新希望	9,100	106,288.00	0.04
266	603833	欧派家居	1,100	105,380.00	0.03
267	600176	中国巨石	7,400	104,784.00	0.03
268	601788	光大证券	6,200	98,518.00	0.03
269	000877	天山股份	11,400	92,796.00	0.03
270	601633	长城汽车	3,600	90,612.00	0.03
271	601117	中国化学	10,700	88,596.00	0.03
272	601615	明阳智能	5,000	84,400.00	0.03
273	601901	方正证券	12,900	84,366.00	0.03
274	600460	士兰微	2,700	81,729.00	0.03
275	603392	万泰生物	1,140	76,117.80	0.03
276	300413	芒果超媒	2,200	75,262.00	0.02
277	300661	圣邦股份	880	72,274.40	0.02
278	002648	卫星化学	4,800	71,808.00	0.02
279	000723	美锦能源	9,400	70,876.00	0.02
280	300601	康泰生物	2,700	68,553.00	0.02
281	600763	通策医疗	700	67,802.00	0.02
282	688187	时代电气	1,561	65,343.46	0.02
283	688005	容百科技	1,200	64,824.00	0.02
284	300919	中伟股份	1,000	60,250.00	0.02
285	601865	福莱特	1,500	57,765.00	0.02
286	603486	科沃斯	700	54,439.00	0.02
287	601872	招商轮船	9,300	53,847.00	0.02
288	000069	华侨城 A	12,100	53,240.00	0.02
289	600803	新奥股份	2,800	53,144.00	0.02
290	601799	星宇股份	400	49,440.00	0.02
291	002414	高德红外	5,520	42,890.40	0.01
292	002064	华峰化学	5,500	37,730.00	0.01
293	601698	中国卫通	1,100	21,868.00	0.01
294	000800	一汽解放	2,400	20,088.00	0.01
295	300979	华利集团	400	19,496.00	0.01
296	001289	龙源电力	200	4,500.00	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	600637	东方明珠	33,030	258,294.60	0.09
2	002815	崇达技术	18,000	224,100.00	0.07
3	601231	环旭电子	10,300	154,088.00	0.05
4	002602	世纪华通	20,300	154,077.00	0.05
5	600479	千金药业	10,300	116,184.00	0.04
6	603606	东方电缆	2,200	107,866.00	0.04
7	601966	玲珑轮胎	4,800	106,656.00	0.04
8	000521	长虹美菱	13,600	103,904.00	0.03
9	601567	三星医疗	7,900	99,777.00	0.03
10	300595	欧普康视	3,300	99,627.00	0.03
11	301292	海科新源	4,853	97,011.47	0.03
12	301395	仁信新材	3,593	95,861.24	0.03
13	600522	中天科技	5,700	90,687.00	0.03
14	300244	迪安诊断	3,400	87,142.00	0.03
15	002391	长青股份	12,600	86,562.00	0.03
16	600353	旭光电子	10,220	83,804.00	0.03
17	002966	苏州银行	12,600	82,530.00	0.03
18	300709	精研科技	3,300	81,411.00	0.03
19	300529	健帆生物	3,500	81,130.00	0.03
20	002865	钧达股份	519	79,163.07	0.03
21	601127	赛力斯	1,900	69,863.00	0.02
22	601916	浙商银行	26,380	69,643.20	0.02
23	002582	好想你	8,900	69,509.00	0.02
24	002785	万里石	3,200	68,960.00	0.02
25	600246	万通发展	12,000	68,640.00	0.02
26	603688	石英股份	600	68,304.00	0.02
27	300724	捷佳伟创	600	67,410.00	0.02
28	601222	林洋能源	8,200	67,158.00	0.02
29	688128	中国电研	2,600	66,300.00	0.02
30	300393	中来股份	4,700	65,988.00	0.02
31	603027	千禾味业	3,100	65,472.00	0.02
32	603217	元利科技	2,500	64,375.00	0.02
33	600771	广誉远	1,800	63,486.00	0.02
34	002737	葵花药业	2,600	63,284.00	0.02
35	688007	光峰科技	3,011	62,779.35	0.02
36	002826	易明医药	5,700	62,757.00	0.02
37	301202	朗威股份	2,395	61,838.90	0.02
38	688518	联赢激光	2,200	61,292.00	0.02
39	301261	恒工精密	1,635	60,331.50	0.02
40	603609	禾丰股份	6,600	60,060.00	0.02

41	688569	铁科轨道	1,400	58,898.00	0.02
42	002432	九安医疗	1,600	56,336.00	0.02
43	300639	凯普生物	5,550	55,611.00	0.02
44	002372	伟星新材	2,700	55,458.00	0.02
45	688377	迪威尔	2,200	55,110.00	0.02
46	300071	福石控股	14,000	55,020.00	0.02
47	601028	玉龙股份	5,100	54,825.00	0.02
48	300390	天华新能	1,530	54,774.00	0.02
49	603011	合锻智能	6,900	54,510.00	0.02
50	600096	云天化	3,100	52,917.00	0.02
51	603088	宁波精达	6,000	50,280.00	0.02
52	600123	兰花科创	6,090	49,816.20	0.02
53	600598	北大荒	3,700	49,321.00	0.02
54	002030	达安基因	4,900	48,853.00	0.02
55	000878	云南铜业	4,400	48,620.00	0.02
56	000541	佛山照明	8,500	48,535.00	0.02
57	000563	陕国投 A	15,000	45,750.00	0.02
58	600130	波导股份	10,400	45,240.00	0.01
59	600469	风神股份	6,900	44,436.00	0.01
60	688399	硕世生物	800	44,160.00	0.01
61	002932	明德生物	1,690	43,754.10	0.01
62	601975	招商南油	15,100	43,186.00	0.01
63	603613	国联股份	1,160	42,838.80	0.01
64	300592	华凯易佰	1,500	40,830.00	0.01
65	600160	巨化股份	2,800	38,584.00	0.01
66	688516	奥特维	200	37,680.00	0.01
67	600400	红豆股份	11,400	37,392.00	0.01
68	603876	鼎胜新材	1,920	36,844.80	0.01
69	688116	天奈科技	800	36,600.00	0.01
70	002115	三维通信	5,600	36,512.00	0.01
71	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
72	300328	宜安科技	5,100	35,445.00	0.01
73	000756	新华制药	1,600	34,528.00	0.01
74	601727	上海电气	7,500	34,275.00	0.01
75	600170	上海建工	12,400	33,356.00	0.01
76	688123	聚辰股份	606	32,554.32	0.01
77	603192	汇得科技	1,700	32,453.00	0.01
78	603980	吉华集团	7,500	32,025.00	0.01
79	600305	恒顺醋业	2,900	31,494.00	0.01
80	000627	天茂集团	10,400	31,200.00	0.01
81	300442	润泽科技	1,000	30,760.00	0.01
82	600537	亿晶光电	4,000	30,560.00	0.01
83	002146	荣盛发展	18,900	29,106.00	0.01

84	688249	晶合集成	1,568	28,318.08	0.01
85	603595	东尼电子	500	21,410.00	0.01
86	301297	富乐德	922	20,754.22	0.01
87	301293	三博脑科	270	19,283.40	0.01
88	688361	中科飞测	263	17,008.21	0.01
89	688472	阿特斯	926	15,779.04	0.01
90	688469	中芯集成	2,905	15,716.05	0.01
91	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
92	301325	曼恩斯特	132	14,249.40	0.00
93	301310	鑫宏业	211	13,805.73	0.00
94	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
95	688531	日联科技	87	11,829.39	0.00
96	301399	英特科技	229	11,809.53	0.00
97	688562	航天软件	523	11,668.13	0.00
98	688629	华丰科技	602	11,191.18	0.00
99	688576	西山科技	92	11,077.72	0.00
100	301358	湖南裕能	256	10,979.84	0.00
101	301307	美利信	335	10,673.10	0.00
102	301315	威士顿	207	10,581.84	0.00
103	301360	荣旗科技	111	10,278.60	0.00
104	301260	格力博	432	10,208.16	0.00
105	301383	天键股份	279	9,965.88	0.00
106	301291	明阳电气	316	9,805.48	0.00
107	688146	中船特气	255	9,723.15	0.00
108	301382	蜂助手	294	9,654.96	0.00
109	301141	中科磁业	226	9,647.94	0.00
110	688458	美芯晟	104	9,439.04	0.00
111	688523	航天环宇	392	9,349.20	0.00
112	688593	新相微	639	9,323.01	0.00
113	688352	颀中科技	740	8,931.80	0.00
114	688484	南芯科技	243	8,920.53	0.00
115	688507	索辰科技	73	8,914.03	0.00
116	688543	国科军工	168	8,912.40	0.00
117	301246	宏源药业	286	8,783.06	0.00
118	688552	航天南湖	366	8,601.00	0.00
119	301408	华人健康	505	8,559.75	0.00
120	301210	金杨股份	173	8,506.41	0.00
121	301225	恒勃股份	253	8,414.78	0.00
122	301303	真兰仪表	376	8,392.32	0.00
123	688334	西高院	517	8,380.57	0.00
124	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
125	688620	安凯微	655	8,082.70	0.00
126	301262	海看股份	296	7,548.00	0.00

127	301305	朗坤环境	377	7,423.13	0.00
128	001287	中电港	352	7,399.04	0.00
129	301332	德尔玛	538	7,386.74	0.00
130	688433	华曙高科	230	7,245.00	0.00
131	688581	安杰思	61	7,199.83	0.00
132	301355	南王科技	427	7,152.25	0.00
133	688512	慧智微	372	7,127.52	0.00
134	301397	溯联股份	175	7,035.00	0.00
135	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
136	688570	天玛智控	273	6,915.09	0.00
137	688429	时创能源	265	6,765.45	0.00
138	301376	致欧科技	290	6,527.90	0.00
139	300804	广康生化	197	6,495.09	0.00
140	301232	飞沃科技	111	6,484.62	0.00
141	301373	凌玮科技	201	6,401.85	0.00
142	301337	亚华电子	206	6,256.22	0.00
143	301281	科源制药	242	6,074.20	0.00
144	301386	未来电器	254	6,042.66	0.00
145	688631	莱斯信息	199	5,944.13	0.00
146	301170	锡南科技	169	5,903.17	0.00
147	688623	双元科技	68	5,901.72	0.00
148	301323	新莱福	148	5,825.28	0.00
149	301157	华塑科技	108	5,716.44	0.00
150	301439	泓淋电力	329	5,560.10	0.00
151	601061	中信金属	691	5,237.78	0.00
152	603135	中重科技	262	4,687.18	0.00
153	301345	涛涛车业	93	4,337.52	0.00
154	688068	热景生物	100	4,241.00	0.00
155	601065	江盐集团	254	3,007.36	0.00
156	601133	柏诚股份	239	2,930.14	0.00
157	001282	三联锻造	86	2,840.58	0.00
158	001328	登康口腔	109	2,778.41	0.00
159	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
160	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
161	603125	常青科技	88	2,158.64	0.00
162	001367	海森药业	50	1,974.00	0.00
163	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
164	001360	南矿集团	129	1,918.23	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	600519	贵州茅台	10,114,827.00	4.53
2	601318	中国平安	6,922,761.00	3.10
3	600036	招商银行	6,908,662.00	3.09
4	300750	宁德时代	6,443,821.10	2.88
5	002142	宁波银行	5,238,842.00	2.34
6	000001	平安银行	5,177,864.00	2.32
7	002475	立讯精密	4,860,594.00	2.18
8	601857	中国石油	4,636,343.00	2.07
9	300274	阳光电源	4,553,191.74	2.04
10	000651	格力电器	4,541,677.00	2.03
11	002714	牧原股份	4,514,787.96	2.02
12	601688	华泰证券	4,401,881.00	1.97
13	600030	中信证券	4,312,121.85	1.93
14	601012	隆基绿能	4,167,644.00	1.87
15	600438	通威股份	4,108,712.00	1.84
16	000568	泸州老窖	3,984,150.00	1.78
17	601319	中国人保	3,980,329.00	1.78
18	002304	洋河股份	3,719,658.00	1.66
19	601211	国泰君安	3,714,870.00	1.66
20	600016	民生银行	3,685,504.00	1.65

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	601012	隆基绿能	5,863,305.59	2.62
2	601857	中国石油	5,734,289.00	2.57
3	000001	平安银行	5,130,584.00	2.30
4	600519	贵州茅台	5,046,773.00	2.26
5	300274	阳光电源	4,372,766.00	1.96
6	601138	工业富联	4,333,236.00	1.94
7	002352	顺丰控股	4,321,661.00	1.93
8	000568	泸州老窖	4,254,850.00	1.90
9	002714	牧原股份	4,196,972.00	1.88
10	600036	招商银行	3,958,976.00	1.77
11	002304	洋河股份	3,881,480.00	1.74
12	002475	立讯精密	3,858,071.00	1.73
13	601328	交通银行	3,812,299.00	1.71
14	600438	通威股份	3,664,289.00	1.64
15	000651	格力电器	3,589,683.00	1.61
16	300014	亿纬锂能	3,491,269.00	1.56
17	601601	中国太保	3,454,413.00	1.55
18	601318	中国平安	3,410,687.00	1.53
19	300979	华利集团	3,370,388.00	1.51

20	300750	宁德时代	3,361,226.00	1.50
----	--------	------	--------------	------

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	511,199,091.07
卖出股票收入（成交）总额	441,116,339.92

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	16,376,119.01	5.42
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	16,376,119.01	5.42

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	019694	23 国债 01	85,000	8,594,319.73	2.84
2	019688	22 国债 23	42,000	4,247,008.93	1.41
3	019703	23 国债 10	24,000	2,412,631.23	0.80
4	019663	21 国债 15	11,000	1,122,159.12	0.37

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司、中信证券股份有限公司本期出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	519,915.24
2	应收清算款	403,296.38
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	257,461.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,180,673.57

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	6,593	19,461.11	69,420,265.26	54.10	58,886,835.87	45.90
中金沪深 300C	5,200	12,467.61	32,638,680.69	50.34	32,192,869.76	49.66
合计	11,793	16,377.40	102,058,945.95	52.84	91,079,705.63	47.16

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	4,296,754.24	3.3488
	中金沪深 300C	3,687.12	0.0057
	合计	4,300,441.36	2.2266

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	>100
	中金沪深 300C	0
	合计	>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	113,689,793.24	31,424,775.85
本报告期基金总申购 份额	55,490,696.42	43,712,090.80
减：本报告期基金总 赎回份额	40,873,388.53	10,305,316.20
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	128,307,101.13	64,831,550.45

§ 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

2023 年 1 月 20 日，本基金管理人发布公告，赵璧先生自 2023 年 1 月 18 日起担任公司总经理、董事，同日起不再担任公司副总经理；孙菁女士自 2023 年 1 月 18 日起不再担任公司总经理、董事。

(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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

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 (%)	
东北证券	2	505,031,498.64	53.47	369,330.63	54.03	-
长江证券	2	173,045,225.02	18.32	119,408.97	17.47	-
国联证券	2	134,207,234.19	14.21	98,146.91	14.36	-
华创证券	2	78,843,673.74	8.35	57,658.52	8.43	-
东兴证券	1	29,087,896.94	3.08	21,272.20	3.11	-
申港证券	1	24,291,667.04	2.57	17,764.37	2.60	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	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(%)
东北证券	10,373,223.95	51.92	98,860,000.00	48.53	-	-
长江证券	5,105,578.00	25.56	77,850,000.00	38.22	-	-
国联证券	3,498,110.00	17.51	17,300,000.00	8.49	-	-
华创证券	1,000,936.00	5.01	9,700,000.00	4.76	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

申港证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
2	中金基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-01-20

3	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
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	2023-02-11
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	2023-03-01
6	中金基金管理有限公司关于不法分子假冒“中金基金”名义、虚构“中金基金静态战略投资项目”进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2023-03-09
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	2023-03-31
8	中金基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
9	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
10	中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-04-21
11	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-21
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	2023-04-25
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	2023-05-10
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	2023-05-26
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	2023-06-03
16	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	2023-06-10
17	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	2023-06-28

§ 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、报告期内中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日