

中金中证 500 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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
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 .....	9
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 .....	10
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
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 .....	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
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 .....	14
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	44
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 .....	46
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 .....	59
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 .....	59

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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
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 .....	60
7.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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 .....	61
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	61
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
10.4 基金投资策略的改变 .....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中金中证 500	
基金主代码	003016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 22 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	479,827,172.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金中证 500A	中金中证 500C
下属分级基金的交易代码	003016	003578
报告期末下属分级基金的份额总额	331,550,719.84 份	148,276,452.57 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	本基金股票投资主要策略为标的指数投资策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合，然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化，力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券投资策略；5、股指期货投资策略；6、参与转融通证券出借业务投资策略。详见《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×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	北京市西城区复兴门内大街 55

	国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	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	《中国证券报》
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)	
	中金中证 500A	中金中证 500C
本期已实现收益	1,411,494.82	336,702.85
本期利润	7,921,909.90	4,583,897.09
加权平均基金份额本期利润	0.0236	0.0304
本期加权平均净值利润率	1.40%	1.83%
本期基金份额净值增长率	1.60%	1.40%
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	213,697,440.36	92,571,807.83
期末可供分配基金份额利润	0.6445	0.6243
期末基金资产净值	545,248,160.20	240,848,260.40
期末基金份额净值	1.6445	1.6243
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	64.45%	50.44%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际

收益水平要低于所列数字；

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金中证 500A

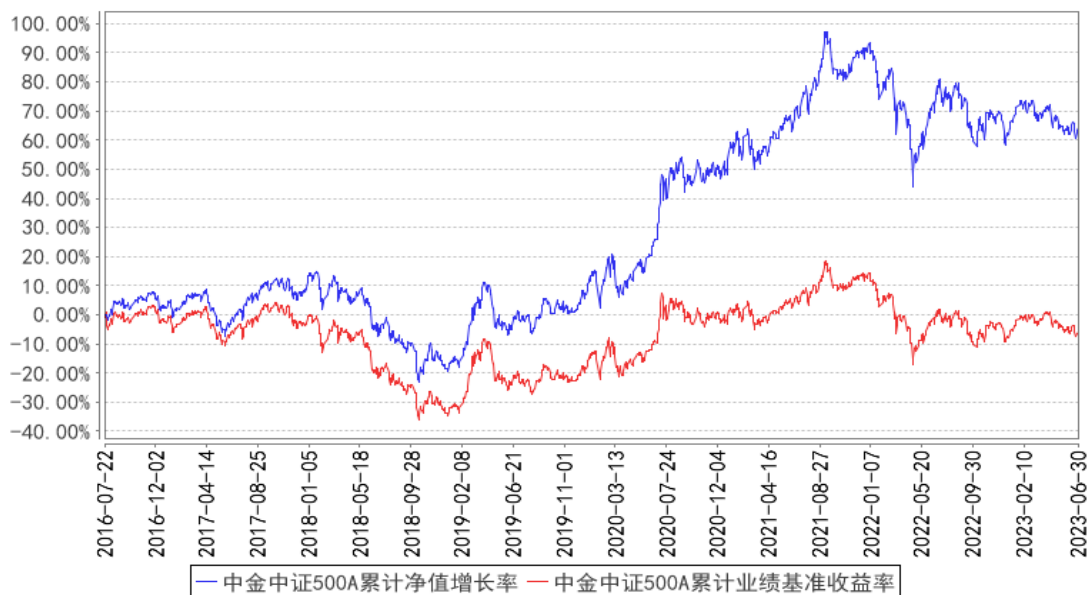
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.46%	0.79%	-0.77%	0.89%	1.23%	-0.10%
过去三个月	-2.78%	0.71%	-5.10%	0.78%	2.32%	-0.07%
过去六个月	1.60%	0.68%	2.20%	0.75%	-0.60%	-0.07%
过去一年	-7.53%	0.87%	-6.65%	0.91%	-0.88%	-0.04%
过去三年	28.36%	1.11%	2.48%	1.13%	25.88%	-0.02%
自基金合同生效起至今	64.45%	1.18%	-5.81%	1.22%	70.26%	-0.04%

中金中证 500C

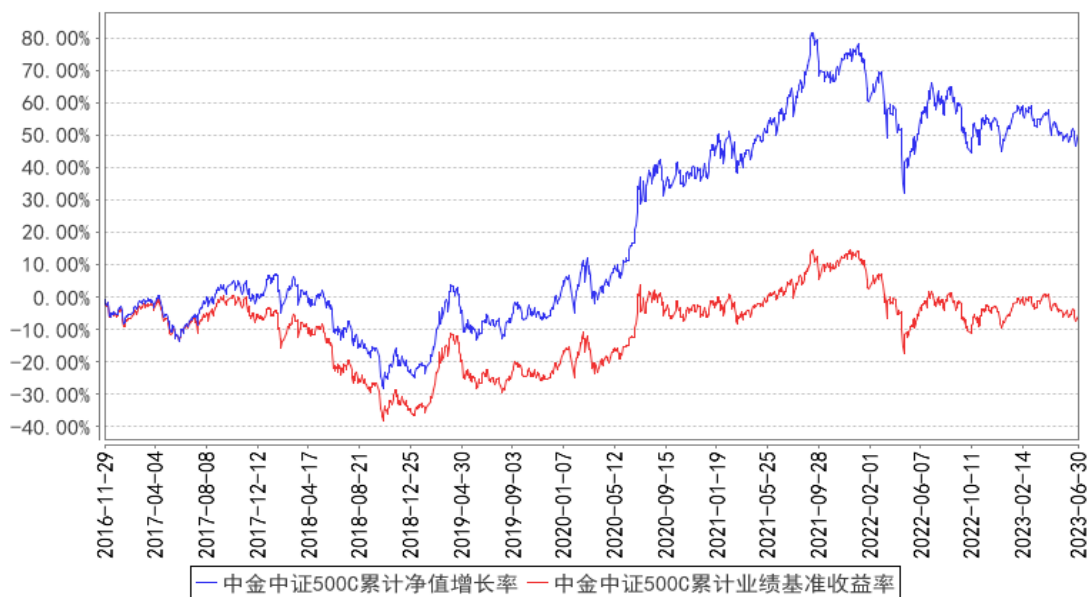
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.43%	0.79%	-0.77%	0.89%	1.20%	-0.10%
过去三个月	-2.88%	0.71%	-5.10%	0.78%	2.22%	-0.07%
过去六个月	1.40%	0.68%	2.20%	0.75%	-0.80%	-0.07%
过去一年	-7.89%	0.87%	-6.65%	0.91%	-1.24%	-0.04%
过去三年	26.83%	1.11%	2.48%	1.13%	24.35%	-0.02%
自基金合同生效起至今	50.44%	1.20%	-5.81%	1.24%	56.25%	-0.04%

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

中金中证500A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中金中证500C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。

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的行为。

#### 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中证 500A 基金份额净值为 1.6445 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.60%，同期业绩基准收益率为 2.20%；中金中证 500C 基金份额净值为 1.6243 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.40%，同期业绩基准收益率为 2.20%。

## 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，市场中长期机会大于风险。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对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本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，本基金托管人在对中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，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，中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的管理人——中金基金管理有限公司在中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金未进行利润分配。

### 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中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 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：中金中证 500 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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,678,422.92	4,608,330.64
结算备付金		4,586,083.79	3,480,575.44
存出保证金		110,487.91	79,688.80
交易性金融资产	6.4.7.2	780,033,097.19	771,085,898.00
其中：股票投资		737,391,980.91	730,248,140.64
基金投资		-	-
债券投资		42,641,116.28	40,837,757.36
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		456,058.83	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,253,607.73	3,588,600.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		791,117,758.37	782,843,093.25
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	1,500,000.00
应付清算款		1,884,476.82	1,445,385.20
应付赎回款		488,687.52	387,723.76

应付管理人报酬		319,704.17	312,740.90
应付托管费		95,911.26	93,822.29
应付销售服务费		78,302.56	72,129.12
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	2,154,255.44	1,612,959.28
负债合计		5,021,337.77	5,424,760.55
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	479,827,172.41	481,960,138.05
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	306,269,248.19	295,458,194.65
净资产合计		786,096,420.60	777,418,332.70
负债和净资产总计		791,117,758.37	782,843,093.25

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，中金中证 500A 的基金份额净值为 1.6445 元，期末份额总额为 331,550,719.84 份；中金中证 500C 的基金份额净值为 1.6243 元，期末份额总额为 148,276,452.57 份。基金份额总额 479,827,172.41 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：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
<b>一、营业总收入</b>		15,859,552.85	-25,739,257.67
1. 利息收入		47,241.51	44,420.63
其中：存款利息收入	6.4.7.13	47,241.51	44,420.63
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）		5,005,281.85	-43,127,101.45
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,059,263.52	-50,677,992.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	433,602.08	375,224.74
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	9,630,943.29	7,175,666.66

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	10, 757, 609. 32	17, 258, 107. 38
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	49, 420. 17	85, 315. 77
<b>减：二、营业总支出</b>		3, 353, 745. 86	2, 184, 734. 18
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	2, 018, 949. 16	1, 305, 762. 41
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	605, 684. 68	391, 728. 64
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	496, 356. 35	284, 985. 40
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		68, 752. 21	66, 640. 00
其中：卖出回购金融资产支出		68, 752. 21	66, 640. 00
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		0. 15	0. 03
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	164, 003. 31	135, 617. 70
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		12, 505, 806. 99	-27, 923, 991. 85
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		12, 505, 806. 99	-27, 923, 991. 85
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		12, 505, 806. 99	-27, 923, 991. 85

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：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）	481, 960, 138. 05	-	295, 458, 194. 65	777, 418, 332. 70
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）	481, 960, 138. 05	-	295, 458, 194. 65	777, 418, 332. 70
三、本期增减变动额（减少以“-”	-2, 132, 965. 64	-	10, 811, 053. 54	8, 678, 087. 90

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	12,505,806.99	12,505,806.99
(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)	-2,132,965.64	-	-1,694,753.45	-3,827,719.09
其中: 1. 基金申购款	162,667,018.87	-	110,574,969.50	273,241,988.37
2. 基金赎回款	-164,799,984.51	-	-112,269,722.95	-277,069,707.46
(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)	479,827,172.41	-	306,269,248.19	786,096,420.60
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)	244,766,875.67	-	226,254,792.06	471,021,667.73
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)	244,766,875.67	-	226,254,792.06	471,021,667.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	131,183,859.40	-	64,988,831.80	196,172,691.20
(一)、综合收益总额	-	-	-27,923,991.85	-27,923,991.85
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	131,183,859.40	-	92,912,823.65	224,096,683.05

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	272,067,222.92	-	194,495,949.28	466,563,172.20
2. 基金赎回款	-140,883,363.52	-	-101,583,125.63	-242,466,489.15
(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)	375,950,735.07	-	291,243,623.86	667,194,358.93

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：

<u>赵璧</u>	二	<u>白娜</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2016 年 7 月 5 日证监许可[2016]1517 号《关于准予中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》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公开发售,于 2016 年 7 月 18 日募集。经向中国证监会备案《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 22 日正式生效,合同生效日基金实收份额为 10,001,000.00 份,发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。



根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。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）、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。

#### 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

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、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	4,678,422.92
等于：本金	4,677,846.24
加：应计利息	576.68
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	4,678,422.92

#### 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	750,386,471.42	-	737,391,980.91	-12,994,490.51	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	41,983,443.90	589,133.08	42,641,116.28	68,539.30
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	41,983,443.90	589,133.08	42,641,116.28	68,539.30
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	792,369,915.32	589,133.08	780,033,097.19	-12,925,951.21	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末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	1,938,086.31
其中：交易所市场	1,938,086.31
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	96,699.25
应付指数使用费	119,469.88
合计	2,154,255.44

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 中金中证 500A

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	321,015,869.00	321,015,869.00
本期申购	108,054,735.31	108,054,735.31
本期赎回（以“-”号填列）	-97,519,884.47	-97,519,884.47
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	331,550,719.84	331,550,719.84

##### 中金中证 500C

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	160,944,269.05	160,944,269.05
本期申购	54,612,283.56	54,612,283.56
本期赎回（以“-”号填列）	-67,280,100.04	-67,280,100.04
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	148,276,452.57	148,276,452.57

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

##### 中金中证 500A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	239,038,035.39	-40,451,291.18	198,586,744.21
本期利润	1,411,494.82	6,510,415.08	7,921,909.90
本期基金份额交易产生的变动数	7,805,112.78	-616,326.53	7,188,786.25
其中：基金申购款	82,561,709.24	-8,484,721.14	74,076,988.10
基金赎回款	-74,756,596.46	7,868,394.61	-66,888,201.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	248,254,642.99	-34,557,202.63	213,697,440.36

## 中金中证 500C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	117,103,054.63	-20,231,604.19	96,871,450.44
本期利润	336,702.85	4,247,194.24	4,583,897.09
本期基金份额交易产生的变动数	-9,430,697.73	547,158.03	-8,883,539.70
其中：基金申购款	40,785,927.84	-4,287,946.44	36,497,981.40
基金赎回款	-50,216,625.57	4,835,104.47	-45,381,521.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	108,009,059.75	-15,437,251.92	92,571,807.83

## 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	13,988.70
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	32,484.62
其他	768.19
合计	47,241.51

## 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	-5,059,263.52
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	-5,059,263.52

## 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	2,555,246,932.94
减：卖出股票成本总额	2,553,684,740.73
减：交易费用	6,621,455.73
买卖股票差价收入	-5,059,263.52

#### 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	403,798.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	29,803.92
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	433,602.08

##### 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	20,209,075.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,763,245.00
减：应计利息总额	416,013.10
减：交易费用	13.72
买卖债券差价收入	29,803.92

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。



**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,630,943.29
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	9,630,943.29

**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	10,757,609.32
股票投资	10,629,239.02
债券投资	128,370.30
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	10,757,609.32

#### 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	49,391.49
基金转换费收入	28.68
合计	49,420.17

#### 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	37,191.88
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	64,606.36
划款手续费	2,697.70
合计	164,003.31

#### 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	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机

“中金财富证券” )	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 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管理费	2,018,949.16	1,305,762.41
其中：支付销售机构的客户维护费	844,715.17	514,144.63

注：支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	605,684.68	391,728.64

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

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

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	10,879.28	10,879.28
中金财富证券	-	23,239.97	23,239.97
合计	-	34,119.25	34,119.25
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		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	32,975.18	32,975.18
中金财富证券	-	28,797.71	28,797.71
合计	-	61,772.89	61,772.89

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；

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

C 类基金份额每日应计提的销售服务费 = C 类基金份额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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 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	1,014,198.78	-
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	1,014,198.78	-
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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 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	1,014,198.78	-
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	1,014,198.78	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.3586%	-

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	4,678,422.92	13,988.70	6,214,005.37	12,858.81

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	1,887	122,202.12
中金公司	688502	茂莱光学	网下	1,509	105,207.48
中金公司	001287	中电港	网下	10,661	126,652.68
中金公司	688249	晶合集成	网下	46,275	919,021.50
中金公司	301332	德尔玛	网下	11,211	166,034.91
中金公司	688593	新相微	网下	9,584	107,149.12
中金公司	688472	阿特斯	网下	26,641	295,715.10
中金公司	688334	西高院	网下	8,879	125,726.64
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	3,707	124,443.99
中金公司	688225	亚信安全	网下	5,086	155,173.86
中金公司	688282	理工导航	网下	3,185	207,693.85
中金公司	301216	万凯新材	网下	5,410	193,028.80
中金公司	688295	中复神鹰	网下	7,549	221,412.17
中金公司	688125	安达智能	网下	3,774	228,515.70
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	1,256	205,431.36
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	10,669	233,971.17

#### 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

本基金本报告期末未实施利润分配。

#### 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	105	2,932.65	3,468.15	-
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	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,067	12,675.96	22,428.34	-
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	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-

301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
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	3,060	79,009.20	79,009.20	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	900	45,000.00	27,639.00	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	1,507	46,490.95	35,610.41	-
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	1,973	72,803.70	72,803.70	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80	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	935	35,651.55	29,013.05	-
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	5,824	116,421.76	116,421.76	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
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	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩	2023年5月	6个月	新股流通	76.80	107.95	365	28,032.00	39,401.75	-

	斯特	月4日		受限						
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	882	20,965.14	37,828.98	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
301386	未来	2023年3	6个月	新股流通	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-

	电 器	月 21 日		受限							
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	5,196	138,629.28	138,629.28	-	
301397	溯 联 股 份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-	
301399	英 特 科 技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-	
301408	华 人 健 康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股 流通 受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-	
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	949	18,970.51	16,038.10	-	
601061	中 信 金 属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	6.58	7.58	2,088	13,739.04	15,827.04	-	
601065	江 盐 集 团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	10.36	11.84	773	8,008.28	9,152.32	-	
601133	柏 诚 股 份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-	
603125	常 青	2023 年 3	6 个月	新股 流通	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-	

	科技	月 30 日		受限							
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-	
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	780	28,197.00	29,741.40	-	
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	4,628	91,912.08	83,581.68	-	
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-	
688343	云天励飞	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	43.92	50.67	11,066	486,018.72	560,714.22	-	
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,239	27,091.90	27,024.73	-	
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	758	17,888.80	49,019.86	-	
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-	
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-	
688458	美芯	2023 年 5 月	6 个月	新股流通	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-	

	晟	月 15 日		受限							
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	5.69	5.41	8,549	48,643.81	46,250.09	-	
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	2,665	29,581.50	45,411.60	-	
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	39.99	36.71	733	29,312.67	26,908.43	-	
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-	
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-	
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	266	40,533.08	36,168.02	-	
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	410	17,904.70	21,750.50	-	
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-	
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-	
688570	天玛	2023 年 5 月	6 个月	新股流通	30.26	25.33	765	23,148.90	19,377.45	-	

	智控	月 29 日		受限						
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023 年 6 月 28 日	重大事项停牌	6.97	2023 年 7 月 3 日	7.40	207,760	1,302,145.82	1,448,087.20	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日，本基金无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型股票基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性压力测试、流动性风险预警、指标超标及危机的处理、流动性风险管理工具、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司投资风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性指标进行监控。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。



因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	4,677,846.24	-	-	576.68	4,678,422.92
结算备付金	4,218,073.90	-	-	368,009.89	4,586,083.79
存出保证金	110,438.21	-	-	49.70	110,487.91
交易性金融资产	42,051,983.20	-	-	737,981,113.99	780,033,097.19
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	456,058.83	456,058.83
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,253,607.73	1,253,607.73
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	51,058,341.55	-	-	740,059,416.82	791,117,758.37
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1,884,476.82	1,884,476.82
应付赎回款	-	-	-	488,687.52	488,687.52
应付销售服务费	-	-	-	78,302.56	78,302.56
应付管理人报酬	-	-	-	319,704.17	319,704.17
应付托管费	-	-	-	95,911.26	95,911.26
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,154,255.44	2,154,255.44
负债总计	-	-	-	5,021,337.77	5,021,337.77
利率敏感度缺口	51,058,341.55	-	-	735,038,079.05	786,096,420.60
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	4,607,073.82	-	-	1,256.82	4,608,330.64
结算备付金	3,112,922.77	-	-	367,652.67	3,480,575.44
存出保证金	79,649.42	-	-	39.38	79,688.80
交易性金融资产	40,308,685.00	-	-	-730,777,213.00	771,085,898.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,588,600.37	3,588,600.37
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	48,108,331.01	-	-	-734,734,762.24	782,843,093.25
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,500,000.00	-	-	-	1,500,000.00
应付清算款	-	-	-	1,445,385.20	1,445,385.20
应付赎回款	-	-	-	387,723.76	387,723.76
应付销售服务费	-	-	-	72,129.12	72,129.12
应付管理人报酬	-	-	-	312,740.90	312,740.90
应付托管费	-	-	-	93,822.29	93,822.29
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,612,959.28	1,612,959.28
负债总计	1,500,000.00	-	-	3,924,760.55	5,424,760.55
利率敏感度缺口	46,608,331.01	-	-	-730,810,001.69	777,418,332.70

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	-26,130.01	-36,353.21
市场利率下降 25 个基点	26,130.01	36,353.21	

#### 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	737,391,980.91	93.80	730,248,140.64	93.93
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	737,391,980.91	93.80	730,248,140.64	93.93

##### 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%	36,968,727.59	37,818,513.89
	业绩比较基准下降5%	-36,968,727.59	-37,818,513.89

#### 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	733,619,855.98	726,881,307.26
第二层次	44,496,067.42	41,236,883.36
第三层次	1,917,173.79	2,967,707.38
合计	780,033,097.19	771,085,898.00

##### 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	737,391,980.91	93.21
	其中：股票	737,391,980.91	93.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	42,641,116.28	5.39
	其中：债券	42,641,116.28	5.39
	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	9,264,506.71	1.17
8	其他各项资产	1,820,154.47	0.23
9	合计	791,117,758.37	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	9,840,082.71	1.25
B	采矿业	45,053,128.14	5.73
C	制造业	419,065,500.79	53.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,218,884.00	2.83
E	建筑业	8,823,792.96	1.12
F	批发和零售业	14,176,305.75	1.80
G	交通运输、仓储和邮政业	14,919,824.20	1.90
H	住宿和餐饮业	1,900,685.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,589,240.58	5.80
J	金融业	62,943,114.84	8.01
K	房地产业	11,321,251.50	1.44
L	租赁和商务服务业	1,271,806.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	3,463,575.60	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	5,278,944.00	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,359,691.40	2.97
S	综合	2,558,108.00	0.33
	合计	691,783,935.47	88.00

### 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	2,232,405.00	0.28
B	采矿业	-	-
C	制造业	29,627,782.05	3.77

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	8,140.64	0.00
F	批发和零售业	270,937.84	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,918,853.80	0.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,108,290.68	0.65
J	金融业	2,622,343.00	0.33
K	房地产业	1,276,638.40	0.16
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,168,309.13	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	315,114.57	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	45,608,045.44	5.80

### 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	002422	科伦药业	311,600	9,248,288.00	1.18
2	600580	卧龙电驱	610,081	8,913,283.41	1.13
3	002384	东山精密	321,900	8,337,210.00	1.06
4	603688	石英股份	73,000	8,310,320.00	1.06
5	601717	郑煤机	596,233	7,423,100.85	0.94
6	002056	横店东磁	401,000	7,302,210.00	0.93
7	601958	金钼股份	653,050	7,281,507.50	0.93
8	002739	万达电影	577,400	7,240,596.00	0.92
9	600329	达仁堂	156,600	7,029,774.00	0.89
10	000060	中金岭南	1,471,850	6,991,287.50	0.89
11	600985	淮北矿业	600,497	6,917,725.44	0.88
12	000878	云南铜业	613,501	6,779,186.05	0.86
13	002273	水晶光电	566,400	6,762,816.00	0.86
14	600481	双良节能	462,903	6,471,383.94	0.82
15	002223	鱼跃医疗	172,100	6,193,879.00	0.79
16	688777	中控技术	98,173	6,163,300.94	0.78
17	601928	凤凰传媒	531,800	6,062,520.00	0.77
18	600497	驰宏锌锗	1,199,500	6,021,490.00	0.77

19	600909	华安证券	1,268,200	5,922,494.00	0.75
20	300073	当升科技	117,533	5,915,435.89	0.75
21	600143	金发科技	670,700	5,855,211.00	0.74
22	600315	上海家化	200,900	5,828,109.00	0.74
23	002128	电投能源	428,241	5,661,346.02	0.72
24	002966	苏州银行	856,450	5,609,747.50	0.71
25	002465	海格通信	537,500	5,557,750.00	0.71
26	002203	海亮股份	458,885	5,511,208.85	0.70
27	000739	普洛药业	306,100	5,430,214.00	0.69
28	002500	山西证券	966,007	5,390,319.06	0.69
29	000729	燕京啤酒	429,400	5,354,618.00	0.68
30	600161	天坛生物	188,977	5,130,725.55	0.65
31	603317	天味食品	347,872	5,082,409.92	0.65
32	600968	海油发展	1,631,600	5,009,012.00	0.64
33	000559	万向钱潮	918,080	5,003,536.00	0.64
34	688002	睿创微纳	111,511	4,995,692.80	0.64
35	300144	宋城演艺	402,871	4,995,600.40	0.64
36	300308	中际旭创	33,307	4,911,117.15	0.62
37	688029	南微医学	60,088	4,900,777.28	0.62
38	002025	航天电器	76,057	4,852,436.60	0.62
39	002152	广电运通	400,400	4,692,688.00	0.60
40	601966	玲珑轮胎	210,791	4,683,776.02	0.60
41	600398	海澜之家	671,600	4,620,608.00	0.59
42	002518	科士达	115,200	4,609,152.00	0.59
43	002249	大洋电机	807,400	4,602,180.00	0.59
44	001914	招商积余	304,400	4,581,220.00	0.58
45	600170	上海建工	1,702,600	4,579,994.00	0.58
46	002600	领益智造	659,700	4,558,527.00	0.58
47	600582	天地科技	776,000	4,524,080.00	0.58
48	000750	国海证券	1,347,410	4,513,823.50	0.57
49	600879	航天电子	527,800	4,481,022.00	0.57
50	002299	圣农发展	233,234	4,466,431.10	0.57
51	000709	河钢股份	1,943,800	4,392,988.00	0.56
52	002867	周大生	246,600	4,384,548.00	0.56
53	600060	海信视像	169,500	4,195,125.00	0.53
54	000997	新大陆	219,100	4,140,990.00	0.53
55	603218	日月股份	215,100	4,084,749.00	0.52
56	603589	口子窖	81,400	4,017,090.00	0.51
57	600079	人福医药	144,900	3,903,606.00	0.50
58	601869	长飞光纤	104,600	3,871,246.00	0.49
59	600372	中航电子	254,809	3,868,000.62	0.49
60	600008	首创环保	1,320,900	3,804,192.00	0.48
61	002155	湖南黄金	305,500	3,727,100.00	0.47

62	002065	东华软件	526,400	3,716,384.00	0.47
63	600995	南网储能	324,400	3,571,644.00	0.45
64	600528	中铁工业	357,400	3,531,112.00	0.45
65	300866	安克创新	40,300	3,526,250.00	0.45
66	600623	华谊集团	564,600	3,517,458.00	0.45
67	603160	汇顶科技	75,801	3,505,796.25	0.45
68	688006	杭可科技	113,920	3,471,142.40	0.44
69	603127	昭衍新药	84,684	3,463,575.60	0.44
70	000738	航发控制	140,660	3,432,104.00	0.44
71	600517	国网英大	599,500	3,417,150.00	0.43
72	600901	江苏金租	824,420	3,404,854.60	0.43
73	600967	内蒙一机	336,076	3,394,367.60	0.43
74	600998	九州通	326,853	3,392,734.14	0.43
75	688052	纳芯微	21,400	3,389,118.00	0.43
76	300568	星源材质	194,500	3,343,455.00	0.43
77	300146	汤臣倍健	138,100	3,311,638.00	0.42
78	601000	唐山港	922,700	3,257,131.00	0.41
79	601162	天风证券	1,089,800	3,247,604.00	0.41
80	688188	柏楚电子	17,046	3,214,193.76	0.41
81	600755	厦门国贸	412,566	3,193,260.84	0.41
82	600885	宏发股份	99,040	3,154,424.00	0.40
83	688516	奥特维	16,742	3,154,192.80	0.40
84	000728	国元证券	482,300	3,144,596.00	0.40
85	000967	盈峰环境	614,000	3,100,700.00	0.39
86	600563	法拉电子	22,000	3,020,600.00	0.38
87	300017	网宿科技	416,104	2,958,499.44	0.38
88	600369	西南证券	808,700	2,951,755.00	0.38
89	300088	长信科技	488,200	2,943,846.00	0.37
90	000783	长江证券	500,975	2,905,655.00	0.37
91	600566	济川药业	99,402	2,886,634.08	0.37
92	600380	健康元	226,032	2,872,866.72	0.37
93	300861	美畅股份	66,000	2,862,420.00	0.36
94	600871	石化油服	1,421,100	2,813,778.00	0.36
95	600131	国网信通	139,200	2,810,448.00	0.36
96	688009	中国通号	479,483	2,781,001.40	0.35
97	000630	铜陵有色	962,100	2,780,469.00	0.35
98	000998	隆平高科	180,639	2,772,808.65	0.35
99	603529	爱玛科技	85,000	2,738,700.00	0.35
100	603885	吉祥航空	177,300	2,735,739.00	0.35
101	688390	固德威	16,350	2,728,161.00	0.35
102	000563	陕国投 A	882,900	2,692,845.00	0.34
103	600867	通化东宝	255,201	2,664,298.44	0.34
104	600598	北大荒	195,112	2,600,842.96	0.33



105	600673	东阳光	354,800	2,558,108.00	0.33
106	600418	江淮汽车	200,200	2,520,518.00	0.32
107	000012	南玻 A	414,600	2,471,016.00	0.31
108	002373	千方科技	179,562	2,449,225.68	0.31
109	601077	渝农商行	669,700	2,404,223.00	0.31
110	603456	九洲药业	87,800	2,403,964.00	0.31
111	601228	广州港	731,100	2,361,453.00	0.30
112	300136	信维通信	117,200	2,353,376.00	0.30
113	600535	天士力	161,593	2,344,714.43	0.30
114	002926	华西证券	279,100	2,319,321.00	0.30
115	600637	东方明珠	292,218	2,285,144.76	0.29
116	002131	利欧股份	986,300	2,268,490.00	0.29
117	600166	福田汽车	664,600	2,259,640.00	0.29
118	601997	贵阳银行	430,600	2,221,896.00	0.28
119	002081	金螳螂	488,700	2,204,037.00	0.28
120	603568	伟明环保	124,400	2,178,244.00	0.28
121	600157	永泰能源	1,533,600	2,177,712.00	0.28
122	000937	冀中能源	335,686	2,141,676.68	0.27
123	000683	远兴能源	296,900	2,134,711.00	0.27
124	603737	三棵树	32,580	2,131,383.60	0.27
125	300438	鹏辉能源	43,600	2,094,544.00	0.27
126	600699	均胜电子	117,005	2,063,968.20	0.26
127	000598	兴蓉环境	377,800	2,051,454.00	0.26
128	300395	菲利华	41,500	2,041,800.00	0.26
129	002244	滨江集团	230,525	2,033,230.50	0.26
130	002353	杰瑞股份	79,700	2,002,861.00	0.25
131	002745	木林森	216,600	1,992,720.00	0.25
132	002294	信立泰	63,500	1,980,565.00	0.25
133	600325	华发股份	198,600	1,956,210.00	0.25
134	603858	步长制药	92,800	1,910,752.00	0.24
135	600258	首旅酒店	100,300	1,900,685.00	0.24
136	600487	亨通光电	126,200	1,850,092.00	0.24
137	002078	太阳纸业	166,700	1,782,023.00	0.23
138	601187	厦门银行	353,500	1,774,570.00	0.23
139	600066	宇通客车	117,900	1,737,846.00	0.22
140	600377	宁沪高速	173,600	1,706,488.00	0.22
141	600739	辽宁成大	127,899	1,681,871.85	0.21
142	300251	光线传媒	204,500	1,654,405.00	0.21
143	603868	飞科电器	26,069	1,644,693.21	0.21
144	000830	鲁西化工	154,200	1,628,352.00	0.21
145	300115	长盈精密	133,300	1,587,603.00	0.20
146	601098	中南传媒	136,200	1,579,920.00	0.20
147	688538	和辉光电	617,800	1,569,212.00	0.20

148	600167	联美控股	223,400	1,557,098.00	0.20
149	601128	常熟银行	226,289	1,543,290.98	0.20
150	600863	内蒙华电	370,600	1,537,990.00	0.20
151	603267	鸿远电子	22,200	1,449,660.00	0.18
152	601298	青岛港	207,760	1,448,087.20	0.18
153	600160	巨化股份	104,361	1,438,094.58	0.18
154	002563	森马服饰	229,700	1,428,734.00	0.18
155	002110	三钢闽光	336,400	1,419,608.00	0.18
156	601108	财通证券	195,680	1,416,723.20	0.18
157	000825	太钢不锈	362,900	1,404,423.00	0.18
158	600516	方大炭素	224,976	1,394,851.20	0.18
159	601992	金隅集团	639,808	1,394,781.44	0.18
160	688208	道通科技	45,914	1,391,653.34	0.18
161	601168	西部矿业	131,400	1,381,014.00	0.18
162	000988	华工科技	35,991	1,368,017.91	0.17
163	300487	蓝晓科技	21,900	1,366,998.00	0.17
164	600499	科达制造	119,500	1,357,520.00	0.17
165	600873	梅花生物	151,400	1,352,002.00	0.17
166	603816	顾家家居	34,900	1,331,435.00	0.17
167	600373	中文传媒	99,900	1,330,668.00	0.17
168	000513	丽珠集团	33,700	1,311,267.00	0.17
169	601058	赛轮轮胎	114,800	1,307,572.00	0.17
170	002531	天顺风能	85,700	1,305,211.00	0.17
171	600435	北方导航	112,200	1,289,178.00	0.16
172	002429	兆驰股份	233,200	1,282,600.00	0.16
173	002958	青农商行	468,300	1,273,776.00	0.16
174	600096	云天化	74,600	1,273,422.00	0.16
175	300009	安科生物	127,300	1,273,000.00	0.16
176	601016	节能风电	341,600	1,253,672.00	0.16
177	600177	雅戈尔	198,248	1,250,944.88	0.16
178	002032	苏泊尔	24,900	1,245,000.00	0.16
179	601665	齐鲁银行	314,800	1,234,016.00	0.16
180	601158	重庆水务	219,600	1,220,976.00	0.16
181	601666	平煤股份	160,700	1,211,678.00	0.15
182	603883	老百姓	40,300	1,202,955.00	0.15
183	600409	三友化工	219,800	1,197,910.00	0.15
184	601866	中远海发	483,400	1,193,998.00	0.15
185	600642	申能股份	170,700	1,193,193.00	0.15
186	000883	湖北能源	261,300	1,191,528.00	0.15
187	600655	豫园股份	173,600	1,190,896.00	0.15
188	603355	莱克电气	46,817	1,189,619.97	0.15
189	600848	上海临港	98,000	1,171,100.00	0.15
190	688779	长远锂科	103,911	1,171,076.97	0.15

191	601156	东航物流	89,100	1,158,300.00	0.15
192	002568	百润股份	31,800	1,155,930.00	0.15
193	600801	华新水泥	93,500	1,154,725.00	0.15
194	600808	马钢股份	447,400	1,149,818.00	0.15
195	600663	陆家嘴	116,400	1,148,868.00	0.15
196	600782	新钢股份	305,800	1,134,518.00	0.14
197	002673	西部证券	177,000	1,123,950.00	0.14
198	000959	首钢股份	318,798	1,115,793.00	0.14
199	002683	广东宏大	37,800	1,112,832.00	0.14
200	688819	天能股份	29,683	1,093,521.72	0.14
201	603228	景旺电子	42,041	1,078,351.65	0.14
202	002463	沪电股份	50,580	1,059,145.20	0.13
203	300724	捷佳伟创	9,334	1,048,674.90	0.13
204	002850	科达利	7,800	1,031,550.00	0.13
205	603444	吉比特	2,100	1,031,331.00	0.13
206	002439	启明星辰	34,000	1,011,840.00	0.13
207	600704	物产中大	201,500	995,410.00	0.13
208	000039	中集集团	138,600	954,954.00	0.12
209	603939	益丰药房	25,580	946,460.00	0.12
210	600021	上海电力	87,100	938,067.00	0.12
211	688256	寒武纪	4,941	928,908.00	0.12
212	601456	国联证券	101,200	920,920.00	0.12
213	600862	中航高科	34,900	883,319.00	0.11
214	600536	中国软件	18,780	880,406.40	0.11
215	002738	中矿资源	16,832	857,422.08	0.11
216	603650	彤程新材	26,000	852,800.00	0.11
217	688099	晶晨股份	9,600	809,472.00	0.10
218	002797	第一创业	139,100	795,652.00	0.10
219	300418	昆仑万维	19,636	790,938.08	0.10
220	002368	太极股份	18,946	780,006.82	0.10
221	000636	风华高科	50,200	770,068.00	0.10
222	600970	中材国际	60,000	765,000.00	0.10
223	002624	完美世界	44,500	751,605.00	0.10
224	603786	科博达	11,400	748,980.00	0.10
225	600415	小商品城	83,800	714,814.00	0.09
226	603056	德邦股份	45,000	693,900.00	0.09
227	300604	长川科技	14,600	693,354.00	0.09
228	000401	冀东水泥	93,400	688,358.00	0.09
229	600667	太极实业	94,346	684,951.96	0.09
230	600348	华阳股份	83,450	660,089.50	0.08
231	600316	洪都航空	27,200	637,840.00	0.08
232	000400	许继电气	27,600	636,180.00	0.08
233	000066	中国长城	45,800	633,414.00	0.08

234	600486	扬农化工	7,100	620,682.00	0.08
235	002138	顺络电子	25,600	612,096.00	0.08
236	600927	永安期货	36,800	598,368.00	0.08
237	601611	中国核建	69,800	589,810.00	0.08
238	002557	洽洽食品	13,900	577,545.00	0.07
239	000553	安道麦 A	66,200	558,728.00	0.07
240	600298	安琪酵母	15,400	557,634.00	0.07
241	300058	蓝色光标	57,600	556,992.00	0.07
242	600718	东软集团	52,153	555,950.98	0.07
243	002028	思源电气	11,600	541,952.00	0.07
244	002185	华天科技	58,300	536,360.00	0.07
245	600022	山东钢铁	373,800	530,796.00	0.07
246	002156	通富微电	22,844	516,274.40	0.07
247	601231	环旭电子	33,400	499,664.00	0.06
248	600489	中金黄金	48,100	496,873.00	0.06
249	605358	立昂微	13,000	477,490.00	0.06
250	600959	江苏有线	140,500	474,890.00	0.06
251	002409	雅克科技	6,500	473,720.00	0.06
252	600859	王府井	23,900	472,981.00	0.06
253	000021	深科技	22,000	439,780.00	0.06
254	300253	卫宁健康	40,500	438,210.00	0.06
255	600027	华电国际	65,300	436,857.00	0.06
256	000537	广宇发展	36,900	430,623.00	0.05
257	002511	中顺洁柔	38,500	429,275.00	0.05
258	600109	国金证券	49,500	429,165.00	0.05
259	688072	拓荆科技	1,000	425,970.00	0.05
260	002240	盛新锂能	13,200	420,684.00	0.05
261	600118	中国卫星	14,800	417,508.00	0.05
262	603338	浙江鼎力	7,200	403,272.00	0.05
263	002670	国盛金控	45,900	403,002.00	0.05
264	688521	芯原股份	5,566	400,306.72	0.05
265	002268	电科网安	14,300	398,541.00	0.05
266	600521	华海药业	21,641	398,410.81	0.05
267	000932	华菱钢铁	82,700	394,479.00	0.05
268	002372	伟星新材	19,181	393,977.74	0.05
269	603000	人民网	13,400	391,280.00	0.05
270	603596	伯特利	4,900	388,374.00	0.05
271	002595	豪迈科技	11,000	386,430.00	0.05
272	002080	中材科技	18,769	385,139.88	0.05
273	600546	山煤国际	26,600	384,902.00	0.05
274	002195	岩山科技	131,300	379,457.00	0.05
275	603233	大参林	13,492	377,910.92	0.05
276	603156	养元饮品	15,297	377,835.90	0.05

277	300383	光环新网	35,100	377,325.00	0.05
278	600765	中航重机	14,200	376,442.00	0.05
279	002506	协鑫集成	124,900	365,957.00	0.05
280	601568	北元集团	69,363	365,543.01	0.05
281	300558	贝达药业	7,600	365,028.00	0.05
282	601880	辽港股份	233,800	364,728.00	0.05
283	600416	湘电股份	19,100	364,619.00	0.05
284	300001	特锐德	17,543	364,543.54	0.05
285	600390	五矿资本	67,700	364,226.00	0.05
286	000423	东阿阿胶	6,800	363,460.00	0.05
287	000027	深圳能源	55,100	363,109.00	0.05
288	688220	翱捷科技	4,800	361,872.00	0.05
289	600271	航天信息	26,103	357,350.07	0.05
290	300682	朗新科技	15,300	356,184.00	0.05
291	002625	光启技术	23,040	351,590.40	0.04
292	688536	思瑞浦	1,600	348,800.00	0.04
293	000591	太阳能	50,600	343,068.00	0.04
294	002945	华林证券	25,000	342,000.00	0.04
295	301029	怡合达	7,560	337,780.80	0.04
296	600827	百联股份	25,200	336,924.00	0.04
297	603927	中科软	8,700	335,472.00	0.04
298	002281	光迅科技	9,000	333,810.00	0.04
299	002690	美亚光电	12,500	321,875.00	0.04
300	002423	中粮资本	39,900	319,200.00	0.04
301	601778	晶科科技	64,600	319,124.00	0.04
302	600062	华润双鹤	18,300	318,786.00	0.04
303	600737	中粮糖业	39,600	318,780.00	0.04
304	600339	中油工程	78,200	318,274.00	0.04
305	300296	利亚德	48,700	318,011.00	0.04
306	300118	东方日升	12,400	317,812.00	0.04
307	688385	复旦微电	6,343	317,784.30	0.04
308	688772	珠海冠宇	15,758	317,523.70	0.04
309	300748	金力永磁	10,600	317,152.00	0.04
310	300182	捷成股份	50,200	316,762.00	0.04
311	600498	烽火通信	15,520	316,142.40	0.04
312	300212	易华录	9,500	315,685.00	0.04
313	601969	海南矿业	45,400	298,732.00	0.04
314	688200	华峰测控	1,839	281,367.00	0.04
315	603893	瑞芯微	3,800	276,830.00	0.04
316	300373	扬杰科技	6,400	259,648.00	0.03
317	000155	川能动力	18,000	259,200.00	0.03
318	000050	深天马 A	28,200	258,876.00	0.03
319	600482	中国动力	11,013	258,144.72	0.03

320	601696	中银证券	24,200	257,972.00	0.03
321	002153	石基信息	18,390	257,460.00	0.03
322	600171	上海贝岭	13,100	239,075.00	0.03
323	688082	盛美上海	2,000	220,800.00	0.03
324	600549	厦门钨业	11,300	215,039.00	0.03
325	002008	大族激光	8,200	214,840.00	0.03
326	603712	七一二	7,100	214,491.00	0.03
327	600141	兴发集团	9,640	214,200.80	0.03
328	000807	云铝股份	16,800	213,864.00	0.03
329	600556	天下秀	25,300	179,377.00	0.02
330	000156	华数传媒	20,600	179,220.00	0.02
331	600707	彩虹股份	33,400	158,984.00	0.02
332	688107	安路科技	2,800	155,092.00	0.02
333	002925	盈趣科技	7,200	139,680.00	0.02
334	300442	润泽科技	4,500	138,420.00	0.02
335	688234	天岳先进	1,850	136,789.00	0.02
336	600597	光明乳业	12,100	125,840.00	0.02
337	000623	吉林敖东	7,450	119,498.00	0.02
338	688520	神州细胞	108	6,127.92	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	600612	老凤祥	35,400	2,473,752.00	0.31
2	300511	雪榕生物	262,700	1,996,520.00	0.25
3	000048	京基智农	99,200	1,936,384.00	0.25
4	002929	润建股份	41,400	1,797,174.00	0.23
5	603639	海利尔	96,100	1,722,112.00	0.22
6	601163	三角轮胎	107,200	1,701,264.00	0.22
7	605066	天正电气	178,900	1,683,449.00	0.21
8	603367	辰欣药业	109,800	1,666,764.00	0.21
9	002852	道道全	114,700	1,483,071.00	0.19
10	603605	珀莱雅	11,988	1,347,451.20	0.17
11	001965	招商公路	125,500	1,204,800.00	0.15
12	000338	潍柴动力	96,200	1,198,652.00	0.15
13	603027	千禾味业	55,700	1,176,384.00	0.15
14	002270	华明装备	106,000	1,160,700.00	0.15
15	600728	佳都科技	165,600	1,147,608.00	0.15
16	600958	东方证券	117,600	1,140,720.00	0.15
17	002967	广电计量	56,300	1,131,067.00	0.14
18	601333	广深铁路	238,000	942,480.00	0.12
19	600064	南京高科	138,640	916,410.40	0.12
20	002212	天融信	90,600	878,820.00	0.11
21	300396	迪瑞医疗	26,300	854,487.00	0.11

22	300638	广和通	33,220	753,429.60	0.10
23	601336	新华保险	19,800	728,046.00	0.09
24	603519	立霸股份	44,400	658,008.00	0.08
25	300842	帝科股份	7,000	640,080.00	0.08
26	605077	华康股份	21,800	577,264.00	0.07
27	688343	云天励飞	11,066	560,714.22	0.07
28	000538	云南白药	10,607	556,655.36	0.07
29	002478	常宝股份	63,300	471,585.00	0.06
30	603871	嘉友国际	28,780	452,133.80	0.06
31	600760	中航沈飞	10,000	450,000.00	0.06
32	600036	招商银行	11,100	363,636.00	0.05
33	300316	晶盛机电	5,100	361,590.00	0.05
34	603220	中贝通信	19,900	339,295.00	0.04
35	601702	华峰铝业	23,600	322,848.00	0.04
36	002096	易普力	27,200	321,776.00	0.04
37	603328	依顿电子	38,800	321,264.00	0.04
38	603093	南华期货	29,500	321,255.00	0.04
39	603269	海鸥股份	20,380	321,188.80	0.04
40	002603	以岭药业	12,500	321,125.00	0.04
41	600211	西藏药业	5,400	320,760.00	0.04
42	688569	铁科轨道	7,600	319,732.00	0.04
43	000885	城发环境	24,000	319,440.00	0.04
44	002605	姚记科技	6,500	301,795.00	0.04
45	300869	康泰医学	13,100	300,776.00	0.04
46	603032	德新科技	8,700	300,498.00	0.04
47	600639	浦东金桥	24,200	300,322.00	0.04
48	002033	丽江股份	27,600	300,288.00	0.04
49	688599	天合光能	6,992	297,929.12	0.04
50	605123	派克新材	2,600	282,490.00	0.04
51	603345	安井食品	1,900	278,920.00	0.04
52	002728	特一药业	18,280	278,770.00	0.04
53	603551	奥普家居	18,300	236,619.00	0.03
54	300775	三角防务	7,000	236,460.00	0.03
55	002458	益生股份	19,100	235,885.00	0.03
56	002371	北方华创	700	222,355.00	0.03
57	603290	斯达半导	1,000	215,200.00	0.03
58	603518	锦泓集团	18,900	214,515.00	0.03
59	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
60	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
61	000906	浙商中拓	12,600	112,392.00	0.01
62	601607	上海医药	4,281	95,937.21	0.01
63	002345	潮宏基	12,200	95,892.00	0.01
64	688249	晶合集成	4,628	83,581.68	0.01

65	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
66	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
67	002647	仁东控股	12,200	68,686.00	0.01
68	002146	荣盛发展	38,900	59,906.00	0.01
69	688361	中科飞测	758	49,019.86	0.01
70	688469	中芯集成	8,549	46,250.09	0.01
71	688472	阿特斯	2,665	45,411.60	0.01
72	301325	曼恩斯特	365	39,401.75	0.01
73	301358	湖南裕能	882	37,828.98	0.00
74	688531	日联科技	266	36,168.02	0.00
75	301260	格力博	1,507	35,610.41	0.00
76	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
77	688146	中船特气	780	29,741.40	0.00
78	301291	明阳电气	935	29,013.05	0.00
79	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
80	301246	宏源药业	900	27,639.00	0.00
81	688352	颀中科技	2,239	27,024.73	0.00
82	688484	南芯科技	733	26,908.43	0.00
83	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
84	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
85	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
86	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
87	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
88	001287	中电港	1,067	22,428.34	0.00
89	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
90	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
91	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
92	688570	天玛智控	765	19,377.45	0.00
93	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
94	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
95	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
96	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
97	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
98	601061	中信金属	2,088	15,827.04	0.00
99	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
100	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
101	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
102	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
103	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
104	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
105	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
106	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
107	688593	新相微	959	13,991.81	0.00



108	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
109	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
110	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
111	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
112	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
113	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
114	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
115	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
116	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
117	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
118	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
119	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
120	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
121	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
122	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
123	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
124	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
125	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
126	601065	江盐集团	773	9,152.32	0.00
127	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
128	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
129	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
130	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
131	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
132	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
133	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
134	688139	海尔生物	159	8,183.73	0.00
135	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
136	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
137	688550	瑞联新材	193	7,642.80	0.00
138	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
139	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
140	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
141	688001	华兴源创	162	5,738.04	0.00
142	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
143	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
144	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
145	688560	明冠新材	100	2,779.00	0.00
146	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
147	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
148	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
149	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	000738	航发控制	15,510,197.00	2.00
2	600563	法拉电子	14,361,181.60	1.85
3	002353	杰瑞股份	13,415,104.00	1.73
4	600885	宏发股份	13,344,499.28	1.72
5	688390	固德威	13,235,199.75	1.70
6	688188	柏楚电子	13,197,015.89	1.70
7	002966	苏州银行	12,709,152.60	1.63
8	603613	国联股份	12,650,355.60	1.63
9	002422	科伦药业	12,563,907.00	1.62
10	600143	金发科技	12,263,788.00	1.58
11	002384	东山精密	12,254,231.00	1.58
12	601128	常熟银行	12,204,879.00	1.57
13	601717	郑煤机	12,193,047.05	1.57
14	600580	卧龙电驱	12,135,562.00	1.56
15	600348	华阳股份	11,867,001.00	1.53
16	600064	南京高科	11,717,906.80	1.51
17	000709	河钢股份	11,712,624.00	1.51
18	600500	中化国际	11,580,372.16	1.49
19	002056	横店东磁	11,533,046.00	1.48
20	002739	万达电影	11,441,823.00	1.47

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600885	宏发股份	18,571,173.60	2.39
2	600563	法拉电子	17,115,975.54	2.20
3	603605	珀莱雅	16,425,275.20	2.11
4	603613	国联股份	16,196,931.47	2.08
5	002738	中矿资源	15,708,957.40	2.02
6	601128	常熟银行	15,624,919.12	2.01
7	600064	南京高科	14,945,046.76	1.92
8	688390	固德威	14,463,709.53	1.86
9	688122	西部超导	13,303,369.75	1.71
10	603456	九洲药业	13,130,268.00	1.69
11	002384	东山精密	13,093,493.03	1.68
12	000738	航发控制	12,917,935.00	1.66
13	601555	东吴证券	12,781,594.64	1.64
14	603345	安井食品	12,760,735.00	1.64

15	000728	国元证券	12,358,329.46	1.59
16	600862	中航高科	12,346,488.00	1.59
17	688009	中国通号	12,249,501.51	1.58
18	688777	中控技术	12,128,601.71	1.56
19	600380	健康元	11,921,250.00	1.53
20	603233	大参林	11,889,558.00	1.53

#### 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	2,550,199,341.98
卖出股票收入（成交）总额	2,555,246,932.94

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	42,641,116.28	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	42,641,116.28	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	019679	22 国债 14	203,000	20,664,971.75	2.63
2	019694	23 国债 01	116,000	11,728,718.69	1.49
3	019688	22 国债 23	101,340	10,247,425.84	1.30

#### 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中，四川科伦药业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	110,487.91
2	应收清算款	456,058.83
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,253,607.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,820,154.47

### 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

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的情况。

### 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 (%)
中金中证 500A	41,047	8,077.34	33,442,445.33	10.09	298,108,274.51	89.91
中金中证 500C	50,742	2,922.16	6,223,338.64	4.20	142,053,113.93	95.80
合计	91,789	5,227.50	39,665,783.97	8.27	440,161,388.44	91.73

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金中证 500A	4,585,472.81	1.3830
	中金中证 500C	15,292.68	0.0103
	合计	4,600,765.49	0.9588

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金中证 500A	>100
	中金中证 500C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 500A	0
	中金中证 500C	0
	合计	0

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金已成立满三年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日 (2016 年 7 月 22)	10,001,000.00	-

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	321,015,869.00	160,944,269.05
本报告期基金总申购份额	108,054,735.31	54,612,283.56
减: 本报告期基金总赎回份额	97,519,884.47	67,280,100.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	331,550,719.84	148,276,452.57

## § 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	2,332,466,128.55	45.82	1,705,746.64	46.57	-
开源证券	2	581,685,468.70	11.43	425,393.22	11.61	-
华创证券	2	521,205,504.61	10.24	381,157.51	10.41	-
海通证券	2	483,518,992.34	9.50	353,600.15	9.65	-
东兴证券	1	349,116,991.38	6.86	255,311.09	6.97	-
兴业证券	2	319,136,102.65	6.27	233,384.73	6.37	-
华泰证券	2	177,740,717.10	3.49	129,980.96	3.55	-
申港证券	1	175,614,805.87	3.45	128,426.81	3.51	-
长江证券	2	149,973,557.11	2.95	49,687.72	1.36	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
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	11,589,575.48	54.07	307,900,000.00	49.98	-	-
开源证券	8,246,615.16	38.48	103,000,000.00	16.72	-	-
华创证券	-	-	90,300,000.00	14.66	-	-
海通证券	-	-	35,800,000.00	5.81	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	45,800,000.00	7.43	-	-
华泰证券	1,597,488.00	7.45	23,600,000.00	3.83	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	9,700,000.00	1.57	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
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	中金中证 500 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	中金中证 500 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	中金中证 500 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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有份额比例达到或超过总份额 20%的情况。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金申请募集注册的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、报告期内中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日