

中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资  
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：宁波银行股份有限公司

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。

基金托管人宁波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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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
<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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
<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>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47

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	47
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	47
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	48
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12	投资组合报告附注	48
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>49</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>50</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>50</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4	基金投资策略的改变	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8	其他重大事件	52
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>52</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	52
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	52
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>52</b>
12.1	备查文件目录	52
12.2	存放地点	53
12.3	查阅方式	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金	
基金简称	中金中证 500ESG 指数增强	
基金主代码	016680	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 10 月 25 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	49,240,755.79 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 500ESG 指数增强 A	中金中证 500ESG 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	016680	016681
报告期末下属分级基金的份额总额	33,355,254.62 份	15,885,501.17 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。同时力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的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 7.75%。
投资策略	本基金主要的股票投资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、债券投资策略；4、可转债投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货、国债期货及股票期权的投资策略；7、转融通投资策略；8、融资投资策略；9、存托凭证投资策略。详见《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中证 500ESG 基准指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的业绩表现。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金

	资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。
--	-----------------------

### 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	宁波银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰	朱广科
	联系电话	010-63211122	0574-87050338
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		400-868-1166	0574-83895886
传真		010-66159121	0574-89103213
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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码		100004	315100
法定代表人		胡长生	陆华裕

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	中金中证 500ESG 指数增强 A	中金中证 500ESG 指数增强 C
本期已实现收益	1,040,506.06	663,233.90
本期利润	1,075,266.84	1,380,207.15
加权平均基金份 额本期利润	0.0400	0.0834
本期加权平均净 值利润率	4.06%	8.48%
本期基金份额净	1.03%	0.83%

值增长率		
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	-1,085,397.35	-559,143.83
期末可供分配基金份额利润	-0.0325	-0.0352
期末基金资产净值	32,269,857.27	15,326,357.34
期末基金份额净值	0.9675	0.9648
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	-3.25%	-3.52%

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 500ESG 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.89%	0.80%	0.12%	0.89%	0.77%	-0.09%
过去三个月	-3.54%	0.69%	-3.91%	0.77%	0.37%	-0.08%
过去六个月	1.03%	0.67%	4.08%	0.74%	-3.05%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-3.25%	0.64%	4.35%	0.79%	-7.60%	-0.15%

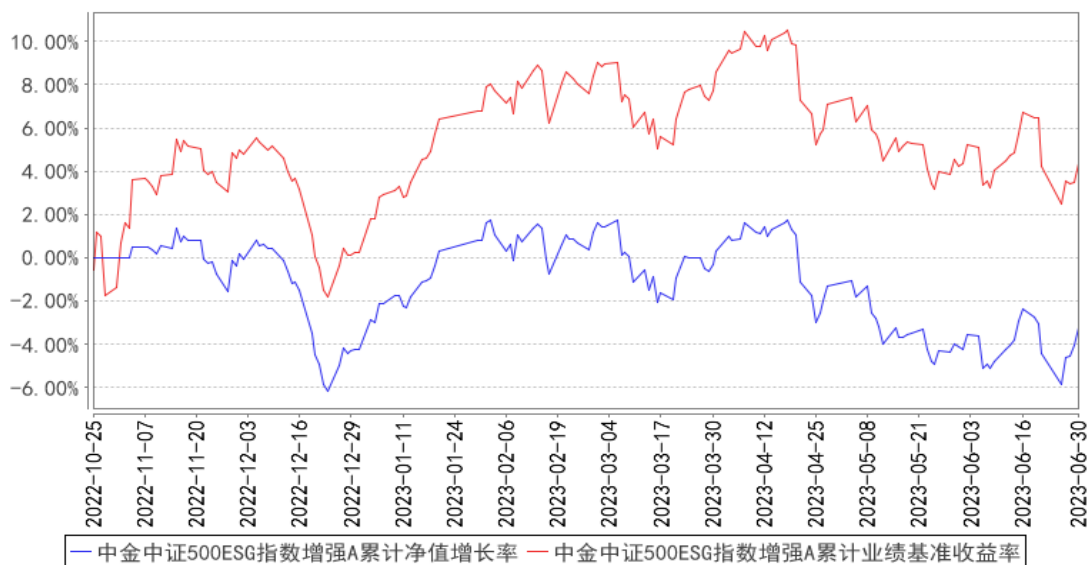
中金中证 500ESG 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

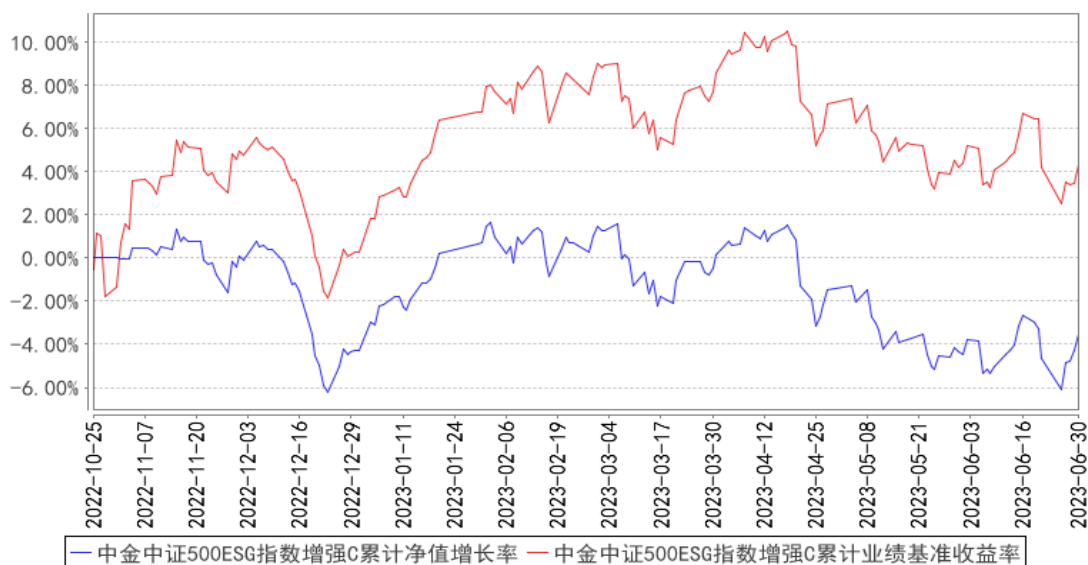
过去一个月	0.85%	0.80%	0.12%	0.89%	0.73%	-0.09%
过去三个月	-3.65%	0.69%	-3.91%	0.77%	0.26%	-0.08%
过去六个月	0.83%	0.67%	4.08%	0.74%	-3.25%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-3.52%	0.64%	4.35%	0.79%	-7.87%	-0.15%

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



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



注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 10 月 25 日，按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。



## § 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	2022 年 10 月 25 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 10 月 25 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、上述基金经理任职日期为本基金基金合同生效日。

2、本基金无基金经理助理。

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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中证 500ESG 指数增强 A 基金份额净值为 0.9675 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.03%，同期业绩基准收益率为 4.08%；中金中证 500ESG 指数增强 C 基金份额净值为 0.9648 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.83%，同期业绩基准收益率为 4.08%。

### 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对基金利润分配原则的约定，本基金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

本基金在本报告期内出现了连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案；本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

## § 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，本托管人在中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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 500ESG 基准指数增强型证券投资基金

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	294,414.03	1,679,111.17
结算备付金		15.32	13,093.47
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	47,226,963.06	64,204,493.08
其中：股票投资		44,715,617.77	60,297,076.31
基金投资		-	-
债券投资		2,511,345.29	3,907,416.77
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		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		356,574.62	13,098,688.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		47,877,967.03	78,995,386.39
<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		170,000.00	3,079,313.53
应付清算款		-	121.60
应付赎回款		-	1,471,335.02
应付管理人报酬		35,825.13	39,904.14
应付托管费		5,373.75	5,985.62
应付销售服务费		4,805.87	7,727.83
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	65,747.67	150,000.00
负债合计		281,752.42	4,754,387.74
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	49,240,755.79	77,556,435.65
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-1,644,541.18	-3,315,437.00
净资产合计		47,596,214.61	74,240,998.65
负债和净资产总计		47,877,967.03	78,995,386.39

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，中金中证 500ESG 指数增强 A 的基金份额净值为 0.9675 元，期末份额总额为 33,355,254.62 份；中金中证 500ESG 指数增强 C 的基金份额净值为 0.9648 元，期末份额总额为 15,885,501.17 份。基金份额总额 49,240,755.79 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		2,803,506.77
1. 利息收入		1,978.70
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,978.70

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		-
<b>2. 投资收益（损失以“-”填列）</b>		2,041,658.78
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,528,892.40
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	16,910.05
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	495,856.33
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		-
<b>3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）</b>	6.4.7.20	751,734.03
<b>4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）</b>		-
<b>5. 其他收入（损失以“-”号填列）</b>	6.4.7.21	8,135.26
<b>减：二、营业总支出</b>		348,032.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	216,166.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	32,425.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	33,503.76
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		8,909.38
其中：卖出回购金融资产支出		8,909.38
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	57,027.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,455,473.99
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,455,473.99
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		2,455,473.99

注：本基金基金合同生效日为 2022 年 10 月 25 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金

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)	77,556,435.65	-	-3,315,437.00	74,240,998.65
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)	77,556,435.65	-	-3,315,437.00	74,240,998.65
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-28,315,679.86	-	1,670,895.82	-26,644,784.04
(一)、综合收益总额	-	-	2,455,473.99	2,455,473.99
(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)	-28,315,679.86	-	-784,578.17	-29,100,258.03
其中：1. 基金申购款	53,601,326.70	-	-1,350,555.80	52,250,770.90
2. 基金赎回款	-81,917,006.56	-	565,977.63	-81,351,028.93
(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)	49,240,755.79	-	-1,644,541.18	47,596,214.61

注：本基金基金合同生效日为 2022 年 10 月 25 日，无上年度可比期间数据。

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

中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金（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 2022 年 8 月 23 日证监许可 [2022] 1924 号文注册，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金招募说明书》和《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型定期开放式股票型证券投资基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司及西部证券股份有限公司等共同销售，募集期为 2022 年 9 月 26 日起至 2022 年 10 月 21 日。经向中国证监会备案，《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2022 年 10 月 25 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 265,614,769.95 份（含利息转份额 28,918.17 份），发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据所收取认购/申购费用、赎回费用、销售服务费方式的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购、赎回基金时收取认购/申购费用、赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，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并公告基金份额净值，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《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证



券公司短期公司债券、政府支持机构债券、政府支持债券等)、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《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

本基金在本报告期未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、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 [2014] 81 号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税 [2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、中投信 [2021] 20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税 [2014] 81 号《财政部、国家税务总局、中国证券监督管理委员会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》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。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。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。对内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。个人投资者在国外已缴纳的预提税，可持有效扣税凭证到中国结算的主管税务机关申请税收抵免。对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，计入其收入总额，依法计征企业所得税。其中，内地居民企业连续持有 H 股满 12 个月取得的股息红利所得，依法免征企业所得税。

(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。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。根据香港联合交易所有限公司（以下简称联交所）上调股票交易印花税公告，自 2021 年 8 月 1 日起，香港市场的股票交易印花税由按成交金额的 0.1% 双向收取，上调为按成交金额的 0.13% 双向收取（取整到元，不足一元按一元计）。按照《上海证券交易所沪港通业务实施办法》第七十六条的有关规定，投资者进行沪港通下的港股通交易，应按照联交所市场的有关规定交纳相关费用。

(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。对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，自 2019 年 12 月 5 日起至 2022 年 12 月 31 日止，继续暂免征收个人所得税。对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得，计入其收入总额，依法征收企业所得税。

(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	294,414.03
等于: 本金	294,348.20
加: 应计利息	65.83
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	294,414.03

##### 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	45,058,365.86	-	44,715,617.77	-342,748.09	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,476,670.87	29,923.29	2,511,345.29	4,751.13
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,476,670.87	29,923.29	2,511,345.29	4,751.13
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	47,535,036.73	29,923.29	47,226,963.06	-337,996.96	

### 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。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,027.67
其他	8,720.00
合计	65,747.67

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 500ESG 指数增强 A

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	42,084,588.96	42,084,588.96
本期申购	31,642,539.69	31,642,539.69
本期赎回（以“-”号填列）	-40,371,874.03	-40,371,874.03
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	33,355,254.62	33,355,254.62

中金中证 500ESG 指数增强 C

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	35,471,846.69	35,471,846.69
本期申购	21,958,787.01	21,958,787.01
本期赎回（以“-”号填列）	-41,545,132.53	-41,545,132.53
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	15,885,501.17	15,885,501.17

### 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 500ESG 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-298,277.26	-1,487,373.97	-1,785,651.23
本期利润	1,040,506.06	34,760.78	1,075,266.84
本期基金份额交易产生的变动数	269,220.27	-644,233.23	-375,012.96
其中：基金申购款	715,678.60	-1,471,119.74	-755,441.14
基金赎回款	-446,458.33	826,886.51	380,428.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,011,449.07	-2,096,846.42	-1,085,397.35

中金中证 500ESG 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-276,786.88	-1,252,998.89	-1,529,785.77
本期利润	663,233.90	716,973.25	1,380,207.15
本期基金份额交易产生的变动数	51,646.66	-461,211.87	-409,565.21
其中：基金申购款	294,658.76	-889,773.42	-595,114.66
基金赎回款	-243,012.10	428,561.55	185,549.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	438,093.68	-997,237.51	-559,143.83

### 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	1,965.18
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13.52
其他	-
合计	1,978.70

### 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	1,528,892.40
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	1,528,892.40
----	--------------

#### 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	146,917,102.48
减：卖出股票成本总额	145,019,342.81
减：交易费用	368,867.27
买卖股票差价收入	1,528,892.40

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	21,053.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,143.84
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	16,910.05

##### 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	2,531,802.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,501,925.93
减：应计利息总额	33,292.82
减：交易费用	727.91
买卖债券差价收入	-4,143.84

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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	495,856.33
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	495,856.33

#### 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	751,734.03
股票投资	741,390.10
债券投资	10,343.93
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	751,734.03

#### 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	8,135.26
合计	8,135.26

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	17,356.09
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	57,027.67

#### 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、基金注册登记机构及基金销售机构
宁波银行	基金托管人、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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
中金财富证券	154,307,421.49	56.01

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
中金财富证券	3,598,706.00	100.00

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
中金财富证券	77,340,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金财富证券	113,571.60	56.51	-	-

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	216,166.92
其中：支付销售机构的客户维护费	65,496.90

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 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

本基金基金合同生效日为 2022 年 10 月 25 日，无上年度可比期间数据。

##### 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
当期发生的基金应支付的托管费	32,425.05

注：支付基金托管人宁波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。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。

本基金基金合同生效日为 2022 年 10 月 25 日，无上年度可比期间数据。

##### 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 500ESG 指数 增强 A	中金中证 500ESG 指数 增强 C	合计
宁波银行		262.47	262.47

中金基金		10.05	10.05
中金财富证券		13,330.62	13,330.62
合计	-	13,603.14	13,603.14

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，按月支付。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

3、本基金基金合同生效日为 2022 年 10 月 25 日，无上年度可比期间数据。

#### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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	
	期末余额	当期利息收入
宁波银行	103,370.93	811.51
中金财富证券	94,000.44	817.59

注：本基金的活期银行存款由基金托管人宁波银行保管，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

本基金本报告期在承销期内未参与认购关联方承销的证券。

#### 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 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 07 月 03 日	7.40	43,800	281,523.29	305,286.00	-

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 170,000.00 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型指数增强基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金、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在合理水平，保障业务稳健运行。

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

##### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----



2023 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	294,348.20	-	-	65.83	294,414.03
结算备付金	-	-	-	15.32	15.32
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	2,481,422.00	-	-	44,745,541.06	47,226,963.06
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	356,574.62	356,574.62
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,775,770.20	-	-	45,102,196.83	47,877,967.03
负债					
卖出回购金融资产款	170,000.00	-	-	-	170,000.00
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	4,805.87	4,805.87
应付管理人报酬	-	-	-	35,825.13	35,825.13
应付托管费	-	-	-	5,373.75	5,373.75
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	65,747.67	65,747.67
负债总计	170,000.00	-	-	111,752.42	281,752.42
利率敏感度缺口	2,605,770.20	-	-	44,990,444.41	47,596,214.61
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	1,678,959.09	-	-	152.08	1,679,111.17
结算备付金	13,091.67	-	-	1.80	13,093.47
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	3,872,808.00	-	-	60,331,685.08	64,204,493.08
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	13,098,688.67	13,098,688.67
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,564,858.76	-	-	73,430,527.63	78,995,386.39
负债					
卖出回购金融资产款	3,080,000.00	-	-	-686.47	3,079,313.53
应付清算款	-	-	-	121.60	121.60
应付赎回款	-	-	-	1,471,335.02	1,471,335.02
应付销售服务费	-	-	-	7,727.83	7,727.83
应付管理人报酬	-	-	-	39,904.14	39,904.14
应付托管费	-	-	-	5,985.62	5,985.62
应交税费	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	3,080,000.00	-	-	1,674,387.74	4,754,387.74
利率敏感度缺口	2,484,858.76	-	-	71,756,139.89	74,240,998.65

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	-2,158.77	-5,294.15
	市场利率下降 25 个基点	2,158.77	5,294.15

#### 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	44,715,617.77	93.95	60,297,076.31	81.22
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	44,715,617.77	93.95	60,297,076.31	81.22

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	44,410,331.77	60,283,153.31
第二层次	2,816,631.29	3,921,339.77
第三层次	-	-
合计	47,226,963.06	64,204,493.08

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末无非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，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	44,715,617.77	93.39
	其中：股票	44,715,617.77	93.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,511,345.29	5.25
	其中：债券	2,511,345.29	5.25
	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	294,429.35	0.61
8	其他各项资产	356,574.62	0.74
9	合计	47,877,967.03	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	258,525.00	0.54
B	采矿业	2,146,492.00	4.51
C	制造业	25,926,320.37	54.47

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,315,662.60	2.76
E	建筑业	550,905.00	1.16
F	批发和零售业	1,475,892.05	3.10
G	交通运输、仓储和邮政业	633,554.00	1.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,872,948.28	6.04
J	金融业	2,539,696.46	5.34
K	房地产业	579,267.00	1.22
L	租赁和商务服务业	83,594.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	127,989.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	450,967.00	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,126.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	681,466.00	1.43
S	综合	165,830.00	0.35
	合计	39,814,234.76	83.65

### 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	154,090.00	0.32
B	采矿业	176,969.00	0.37
C	制造业	2,805,009.34	5.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	306,219.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	338,131.40	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	294,075.67	0.62
J	金融业	470,304.00	0.99
K	房地产业	139,965.00	0.29
L	租赁和商务服务业	37,102.60	0.08

M	科学研究和技术服务业	150,675.00	0.32
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	28,842.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	4,901,383.01	10.30

### 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	28,500	845,880.00	1.78
2	002384	东山精密	26,000	673,400.00	1.41
3	688777	中控技术	10,546	662,077.88	1.39
4	300308	中际旭创	4,300	634,035.00	1.33
5	603688	石英股份	5,200	591,968.00	1.24
6	002056	横店东磁	30,500	555,405.00	1.17
7	601958	金钼股份	48,400	539,660.00	1.13
8	600161	天坛生物	18,900	513,135.00	1.08
9	000878	云南铜业	43,000	475,150.00	1.00
10	002203	海亮股份	39,000	468,390.00	0.98
11	000997	新大陆	24,400	461,160.00	0.97
12	002025	航天电器	6,900	440,220.00	0.92
13	600481	双良节能	30,900	431,982.00	0.91
14	000729	燕京啤酒	33,400	416,498.00	0.88
15	688009	中国通号	71,800	416,440.00	0.87
16	600398	海澜之家	60,100	413,488.00	0.87
17	600998	九州通	39,587	410,913.06	0.86
18	601717	郑煤机	30,900	384,705.00	0.81
19	002966	苏州银行	57,700	377,935.00	0.79
20	600580	卧龙电驱	25,800	376,938.00	0.79
21	002152	广电运通	31,700	371,524.00	0.78
22	600060	海信视像	15,000	371,250.00	0.78
23	600528	中铁工业	37,000	365,560.00	0.77

24	600985	淮北矿业	30,700	353,664.00	0.74
25	600879	航天电子	40,600	344,694.00	0.72
26	601928	凤凰传媒	30,100	343,140.00	0.72
27	600637	东方明珠	43,300	338,606.00	0.71
28	600967	内蒙一机	33,500	338,350.00	0.71
29	603737	三棵树	4,980	325,791.60	0.68
30	002244	滨江集团	36,600	322,812.00	0.68
31	002600	领益智造	46,600	322,006.00	0.68
32	300146	汤臣倍健	13,300	318,934.00	0.67
33	688006	杭可科技	10,193	310,580.71	0.65
34	601298	青岛港	43,800	305,286.00	0.64
35	600582	天地科技	52,000	303,160.00	0.64
36	600131	国网信通	15,000	302,850.00	0.64
37	300487	蓝晓科技	4,850	302,737.00	0.64
38	688390	固德威	1,800	300,348.00	0.63
39	600315	上海家化	10,300	298,803.00	0.63
40	002568	百润股份	8,200	298,070.00	0.63
41	600160	巨化股份	21,500	296,270.00	0.62
42	601966	玲珑轮胎	13,300	295,526.00	0.62
43	601231	环旭电子	19,710	294,861.60	0.62
44	603218	日月股份	15,400	292,446.00	0.61
45	600497	驰宏锌锗	58,200	292,164.00	0.61
46	300073	当升科技	5,800	291,914.00	0.61
47	002078	太阳纸业	27,100	289,699.00	0.61
48	600901	江苏金租	69,540	287,200.20	0.60
49	002465	海格通信	27,600	285,384.00	0.60
50	002867	周大生	15,700	279,146.00	0.59
51	002223	鱼跃医疗	7,700	277,123.00	0.58
52	002273	水晶光电	22,200	265,068.00	0.56
53	002249	大洋电机	46,300	263,910.00	0.55
54	000967	盈峰环境	52,200	263,610.00	0.55
55	002299	圣农发展	13,500	258,525.00	0.54
56	000060	中金岭南	54,000	256,500.00	0.54
57	600380	健康元	19,900	252,929.00	0.53
58	300395	菲利华	5,100	250,920.00	0.53
59	600566	济川药业	8,600	249,744.00	0.52
60	300866	安克创新	2,800	245,000.00	0.51
61	601139	深圳燃气	33,600	244,944.00	0.51
62	600027	华电国际	36,600	244,854.00	0.51
63	300136	信维通信	12,100	242,968.00	0.51
64	002110	三钢闽光	56,700	239,274.00	0.50
65	600066	宇通客车	16,100	237,314.00	0.50
66	600968	海油发展	77,000	236,390.00	0.50

67	601162	天风证券	78,600	234,228.00	0.49
68	000739	普洛药业	13,200	234,168.00	0.49
69	603317	天味食品	15,960	233,175.60	0.49
70	600909	华安证券	49,100	229,297.00	0.48
71	002563	森马服饰	36,600	227,652.00	0.48
72	688188	柏楚电子	1,200	226,272.00	0.48
73	000423	东阿阿胶	4,200	224,490.00	0.47
74	600373	中文传媒	16,800	223,776.00	0.47
75	600535	天士力	15,100	219,101.00	0.46
76	600970	中材国际	16,700	212,925.00	0.45
77	000401	冀东水泥	28,400	209,308.00	0.44
78	002028	思源电气	4,400	205,568.00	0.43
79	603233	大参林	7,199	201,643.99	0.42
80	002081	金螳螂	44,700	201,597.00	0.42
81	600325	华发股份	20,300	199,955.00	0.42
82	688002	睿创微纳	4,400	197,120.00	0.41
83	688029	南微医学	2,394	195,254.64	0.41
84	600517	国网英大	33,900	193,230.00	0.41
85	601869	长飞光纤	5,200	192,452.00	0.40
86	600995	南网储能	17,400	191,574.00	0.40
87	688516	奥特维	1,000	188,400.00	0.40
88	603568	伟明环保	10,700	187,357.00	0.39
89	002128	电投能源	14,100	186,402.00	0.39
90	600704	物产中大	37,200	183,768.00	0.39
91	600143	金发科技	20,500	178,965.00	0.38
92	600871	石化油服	90,200	178,596.00	0.38
93	000598	兴蓉环境	32,700	177,561.00	0.37
94	000630	铜陵有色	61,000	176,290.00	0.37
95	600867	通化东宝	16,700	174,348.00	0.37
96	601158	重庆水务	30,200	167,912.00	0.35
97	600673	东阳光	23,000	165,830.00	0.35
98	603939	益丰药房	4,480	165,760.00	0.35
99	600489	中金黄金	16,000	165,280.00	0.35
100	600782	新钢股份	44,400	164,724.00	0.35
101	000012	南玻 A	27,400	163,304.00	0.34
102	002745	木林森	17,200	158,240.00	0.33
103	000563	陕国投 A	51,700	157,685.00	0.33
104	688538	和辉光电	62,000	157,480.00	0.33
105	600498	烽火通信	7,700	156,849.00	0.33
106	002131	利欧股份	67,500	155,250.00	0.33
107	300699	光威复材	4,960	153,016.00	0.32
108	000987	越秀资本	23,100	146,685.00	0.31
109	688819	天能股份	3,977	146,512.68	0.31



110	601992	金隅集团	65,200	142,136.00	0.30
111	000738	航发控制	5,700	139,080.00	0.29
112	600170	上海建工	50,700	136,383.00	0.29
113	600755	厦门国贸	17,400	134,676.00	0.28
114	603355	莱克电气	5,300	134,673.00	0.28
115	000559	万向钱潮	24,700	134,615.00	0.28
116	000591	太阳能	19,200	130,176.00	0.27
117	000750	国海证券	37,500	125,625.00	0.26
118	000709	河钢股份	54,000	122,040.00	0.26
119	603650	彤程新材	3,600	118,080.00	0.25
120	600435	北方导航	9,900	113,751.00	0.24
121	002092	中泰化学	17,100	110,295.00	0.23
122	000783	长江证券	19,000	110,200.00	0.23
123	002595	豪迈科技	3,000	105,390.00	0.22
124	600549	厦门钨业	5,482	104,322.46	0.22
125	600282	南钢股份	29,800	100,426.00	0.21
126	600022	山东钢铁	69,800	99,116.00	0.21
127	002531	天顺风能	6,500	98,995.00	0.21
128	000553	安道麦 A	11,700	98,748.00	0.21
129	601997	贵阳银行	19,100	98,556.00	0.21
130	002373	千方科技	7,200	98,208.00	0.21
131	002353	杰瑞股份	3,900	98,007.00	0.21
132	601098	中南传媒	8,300	96,280.00	0.20
133	002624	完美世界	5,700	96,273.00	0.20
134	600271	航天信息	7,000	95,830.00	0.20
135	600298	安琪酵母	2,600	94,146.00	0.20
136	600297	广汇汽车	44,300	92,144.00	0.19
137	600699	均胜电子	5,200	91,728.00	0.19
138	000988	华工科技	2,400	91,224.00	0.19
139	300724	捷佳伟创	800	89,880.00	0.19
140	002065	东华软件	12,700	89,662.00	0.19
141	600521	华海药业	4,800	88,368.00	0.19
142	688521	芯原股份	1,225	88,102.00	0.19
143	601000	唐山港	24,900	87,897.00	0.18
144	600377	宁沪高速	8,900	87,487.00	0.18
145	688208	道通科技	2,800	84,868.00	0.18
146	603638	艾迪精密	4,100	84,132.00	0.18
147	601555	东吴证券	12,100	83,974.00	0.18
148	002138	顺络电子	3,500	83,685.00	0.18
149	600415	小商品城	9,800	83,594.00	0.18
150	600008	首创环保	28,000	80,640.00	0.17
151	002926	华西证券	9,700	80,607.00	0.17
152	600348	华阳股份	10,000	79,100.00	0.17

153	603000	人民网	2,700	78,840.00	0.17
154	603786	科博达	1,200	78,840.00	0.17
155	603338	浙江鼎力	1,400	78,414.00	0.16
156	002500	山西证券	14,000	78,120.00	0.16
157	000021	深科技	3,900	77,961.00	0.16
158	300037	新宙邦	1,500	77,835.00	0.16
159	002572	索菲亚	4,400	76,648.00	0.16
160	601187	厦门银行	15,213	76,369.26	0.16
161	601058	赛轮轮胎	6,400	72,896.00	0.15
162	002399	海普瑞	6,300	72,261.00	0.15
163	600339	中油工程	17,400	70,818.00	0.15
164	601128	常熟银行	10,200	69,564.00	0.15
165	600546	山煤国际	4,800	69,456.00	0.15
166	002250	联化科技	6,600	69,036.00	0.15
167	300296	利亚德	10,400	67,912.00	0.14
168	300568	星源材质	3,900	67,041.00	0.14
169	300888	稳健医疗	1,600	66,672.00	0.14
170	603056	德邦股份	4,300	66,306.00	0.14
171	002985	北摩高科	1,500	66,180.00	0.14
172	600369	西南证券	18,100	66,065.00	0.14
173	600808	马钢股份	25,500	65,535.00	0.14
174	300115	长盈精密	5,500	65,505.00	0.14
175	002439	启明星辰	2,200	65,472.00	0.14
176	603127	昭衍新药	1,600	65,440.00	0.14
177	000519	中兵红箭	3,600	65,124.00	0.14
178	002468	申通快递	6,000	64,920.00	0.14
179	603529	爱玛科技	2,000	64,440.00	0.14
180	603517	绝味食品	1,700	63,155.00	0.13
181	603868	飞科电器	1,000	63,090.00	0.13
182	002511	中顺洁柔	5,600	62,440.00	0.13
183	603883	老百姓	2,000	59,700.00	0.13
184	000898	鞍钢股份	21,400	59,492.00	0.12
185	300357	我武生物	1,700	57,171.00	0.12
186	600655	豫园股份	8,300	56,938.00	0.12
187	601577	长沙银行	7,300	56,648.00	0.12
188	300012	华测检测	2,900	56,550.00	0.12
189	000402	金融街	12,500	56,500.00	0.12
190	600859	王府井	2,700	53,433.00	0.11
191	300682	朗新科技	2,200	51,216.00	0.11
192	600718	东软集团	4,700	50,102.00	0.11
193	603444	吉比特	100	49,111.00	0.10
194	300390	天华新能	1,330	47,614.00	0.10
195	002185	华天科技	4,900	45,080.00	0.09

196	600801	华新水泥	3,600	44,460.00	0.09
197	600988	赤峰黄金	3,300	44,418.00	0.09
198	300363	博腾股份	1,500	44,385.00	0.09
199	600499	科达制造	3,700	42,032.00	0.09
200	601456	国联证券	4,600	41,860.00	0.09
201	002505	鹏都农牧	21,000	39,690.00	0.08
202	000027	深圳能源	6,000	39,540.00	0.08
203	000050	深天马 A	4,200	38,556.00	0.08
204	601016	节能风电	10,480	38,461.60	0.08
205	300253	卫宁健康	3,400	36,788.00	0.08
206	300474	景嘉微	400	35,996.00	0.08
207	002430	杭氧股份	1,000	34,360.00	0.07
208	600038	中直股份	800	31,856.00	0.07
209	002080	中材科技	1,500	30,780.00	0.06
210	603816	顾家家居	800	30,520.00	0.06
211	002030	达安基因	3,000	29,910.00	0.06
212	000623	吉林敖东	1,700	27,268.00	0.06
213	601077	渝农商行	7,200	25,848.00	0.05
214	000807	云铝股份	1,900	24,187.00	0.05
215	002372	伟星新材	1,102	22,635.08	0.05
216	600141	兴发集团	1,000	22,220.00	0.05
217	603893	瑞芯微	300	21,855.00	0.05
218	600350	山东高速	3,400	21,658.00	0.05
219	000156	华数传媒	2,100	18,270.00	0.04
220	600487	亨通光电	1,200	17,592.00	0.04
221	688099	晶晨股份	200	16,864.00	0.04
222	000629	钒钛股份	3,800	14,858.00	0.03
223	002281	光迅科技	400	14,836.00	0.03
224	300776	帝尔激光	160	10,384.00	0.02
225	002340	格林美	1,300	8,983.00	0.02
226	600511	国药股份	200	7,770.00	0.02
227	600378	昊华科技	200	7,528.00	0.02
228	600482	中国动力	300	7,032.00	0.01
229	300024	机器人	400	6,668.00	0.01
230	300677	英科医疗	300	6,600.00	0.01
231	002444	巨星科技	300	6,564.00	0.01
232	300741	华宝股份	300	6,426.00	0.01
233	000039	中集集团	900	6,201.00	0.01
234	600536	中国软件	130	6,094.40	0.01
235	300676	华大基因	100	5,999.00	0.01
236	601608	中信重工	1,400	5,894.00	0.01
237	300244	迪安诊断	200	5,126.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600612	老凤祥	3,500	244,580.00	0.51
2	600958	东方证券	20,500	198,850.00	0.42
3	603605	珀莱雅	1,740	195,576.00	0.41
4	002727	一心堂	6,600	174,240.00	0.37
5	000338	潍柴动力	13,300	165,718.00	0.35
6	002929	润建股份	3,700	160,617.00	0.34
7	002270	华明装备	14,500	158,775.00	0.33
8	603367	辰欣药业	10,300	156,354.00	0.33
9	601163	三角轮胎	9,800	155,526.00	0.33
10	000048	京基智农	7,800	152,256.00	0.32
11	605077	华康股份	5,700	150,936.00	0.32
12	002967	广电计量	7,500	150,675.00	0.32
13	001965	招商公路	15,400	147,840.00	0.31
14	001914	招商积余	9,300	139,965.00	0.29
15	601336	新华保险	3,700	136,049.00	0.29
16	000538	云南白药	2,200	115,456.00	0.24
17	603027	千禾味业	4,600	97,152.00	0.20
18	603639	海利尔	4,500	80,640.00	0.17
19	300856	科思股份	1,000	78,770.00	0.17
20	300511	雪榕生物	10,200	77,520.00	0.16
21	002458	益生股份	6,200	76,570.00	0.16
22	002737	葵花药业	3,100	75,454.00	0.16
23	002594	比亚迪	290	74,898.30	0.16
24	300638	广和通	3,200	72,576.00	0.15
25	600129	太极集团	1,200	71,388.00	0.15
26	603368	柳药集团	2,800	69,188.00	0.15
27	600583	海油工程	10,300	60,255.00	0.13
28	603225	新凤鸣	5,400	59,670.00	0.13
29	688599	天合光能	1,400	59,654.00	0.13
30	601319	中国人保	9,600	56,064.00	0.12
31	600839	四川长虹	11,000	55,550.00	0.12
32	600728	佳都科技	7,900	54,747.00	0.12
33	603093	南华期货	4,900	53,361.00	0.11
34	002402	和而泰	3,100	52,638.00	0.11
35	601021	春秋航空	900	51,723.00	0.11
36	600361	创新新材	10,600	50,880.00	0.11
37	002698	博实股份	2,800	48,972.00	0.10
38	000999	华润三九	800	48,528.00	0.10
39	000758	中色股份	10,100	47,672.00	0.10
40	603345	安井食品	300	44,040.00	0.09

41	002149	西部材料	2,600	43,654.00	0.09
42	600295	鄂尔多斯	4,564	40,939.08	0.09
43	688063	派能科技	200	39,650.00	0.08
44	000655	金岭矿业	6,200	39,122.00	0.08
45	601111	中国国航	4,000	32,960.00	0.07
46	600537	亿晶光电	4,300	32,852.00	0.07
47	603808	歌力思	2,500	32,825.00	0.07
48	603129	春风动力	200	32,380.00	0.07
49	600188	兖矿能源	1,000	29,920.00	0.06
50	603565	中谷物流	2,768	29,894.40	0.06
51	002544	普天科技	1,300	29,770.00	0.06
52	600012	皖通高速	2,800	29,344.00	0.06
53	002739	万达电影	2,300	28,842.00	0.06
54	002852	道道全	2,200	28,446.00	0.06
55	601601	中国太保	1,000	25,980.00	0.05
56	605168	三人行	290	24,922.60	0.05
57	688981	中芯国际	400	20,208.00	0.04
58	600329	达仁堂	400	17,956.00	0.04
59	600897	厦门空港	800	16,552.00	0.03
60	600717	天津港	3,400	15,062.00	0.03
61	000557	西部创业	2,800	14,756.00	0.03
62	603613	国联股份	394	14,550.42	0.03
63	002459	晶澳科技	340	14,178.00	0.03
64	300442	润泽科技	440	13,534.40	0.03
65	603083	剑桥科技	200	12,578.00	0.03
66	600057	厦门象屿	1,400	12,180.00	0.03
67	300399	天利科技	900	11,835.00	0.02
68	605186	健麾信息	200	9,900.00	0.02
69	603118	共进股份	700	9,303.00	0.02
70	300316	晶盛机电	128	9,075.20	0.02
71	300226	上海钢联	260	8,424.00	0.02
72	688088	虹软科技	187	7,994.25	0.02
73	603486	科沃斯	100	7,777.00	0.02
74	300510	金冠股份	900	6,282.00	0.01
75	002803	吉宏股份	300	6,138.00	0.01
76	600865	百大集团	700	5,999.00	0.01
77	000715	中兴商业	800	5,912.00	0.01
78	688122	西部超导	105	5,851.65	0.01
79	002792	通宇通讯	300	5,646.00	0.01
80	688377	迪威尔	152	3,807.60	0.01
81	688336	三生国健	179	3,059.11	0.01

## 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	002422	科伦药业	1,036,794.00	1.40
2	300308	中际旭创	958,666.00	1.29
3	002384	东山精密	931,322.00	1.25
4	603688	石英股份	915,630.00	1.23
5	688777	中控技术	825,524.00	1.11
6	600161	天坛生物	795,010.00	1.07
7	002056	横店东磁	751,561.00	1.01
8	601958	金钼股份	722,340.00	0.97
9	002152	广电运通	716,122.00	0.96
10	002203	海亮股份	705,272.00	0.95
11	601717	郑煤机	693,280.00	0.93
12	000999	华润三九	691,644.00	0.93
13	603737	三棵树	662,310.00	0.89
14	688390	固德威	662,122.00	0.89
15	603939	益丰药房	658,672.67	0.89
16	603613	国联股份	655,658.00	0.88
17	000878	云南铜业	654,300.00	0.88
18	603605	珀莱雅	650,300.00	0.88
19	600435	北方导航	638,756.00	0.86
20	300073	当升科技	614,216.00	0.83

### 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	603605	珀莱雅	1,540,099.00	2.07
2	603613	国联股份	1,461,419.00	1.97
3	688009	中国通号	1,364,926.00	1.84
4	002831	裕同科技	1,351,169.00	1.82
5	688122	西部超导	1,303,794.66	1.76
6	600885	宏发股份	1,222,056.00	1.65
7	300037	新宙邦	1,191,638.00	1.61
8	603345	安井食品	1,100,384.00	1.48
9	600160	巨化股份	1,067,826.00	1.44
10	688777	中控技术	1,053,184.63	1.42
11	002422	科伦药业	1,014,146.00	1.37
12	002056	横店东磁	982,142.00	1.32
13	601607	上海医药	957,361.00	1.29
14	002465	海格通信	952,539.00	1.28

15	601231	环旭电子	932,066.00	1.26
16	600498	烽火通信	927,052.00	1.25
17	603737	三棵树	922,867.00	1.24
18	002384	东山精密	910,678.00	1.23
19	603456	九洲药业	901,325.00	1.21
20	002281	光迅科技	890,426.00	1.20

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	128,696,494.17
卖出股票收入（成交）总额	146,917,102.48

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	2,511,345.29	5.28
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	2,511,345.29	5.28

#### 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	019688	22 国债 23	10,000	1,011,192.60	2.12
2	019694	23 国债 01	6,000	606,657.86	1.27
3	019679	22 国债 14	5,800	590,427.76	1.24
4	019703	23 国债 10	2,000	201,052.60	0.42
5	019663	21 国债 15	1,000	102,014.47	0.21

#### 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、浙江中控技术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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	356,574.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	356,574.62

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。



### 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 500ESG 指数增强 A	452	73,794.81	137,486.47	0.41	33,217,768.15	99.59
中金中证 500ESG 指数增强 C	518	30,666.99	200,000.00	1.26	15,685,501.17	98.74
合计	970	50,763.67	337,486.47	0.69	48,903,269.32	99.31

### 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 500ESG 指数增强 A	567,110.76	1.7002
	中金中证 500ESG 指数增强 C	6,089.92	0.0383
	合计	573,200.68	1.1641

### 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 500ESG 指数增强 A	0
	中金中证 500ESG 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 500ESG 指数增强 A	50~100
	中金中证 500ESG 指数增强 C	0
	合计	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 500ESG 指数增强 A	中金中证 500ESG 指数增强 C
基金合同生效日 (2022 年 10 月 25 日) 基金份额总额	87,120,640.18	178,494,129.77
本报告期期初基金份额总额	42,084,588.96	35,471,846.69
本报告期基金总申购份额	31,642,539.69	21,958,787.01
减：本报告期基金总赎回份额	40,371,874.03	41,545,132.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	33,355,254.62	15,885,501.17

注：报告期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。

## § 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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
中金财富证券	2	154,307,421.49	56.01	113,571.60	56.51	-
东兴证券	2	121,179,156.14	43.99	87,407.01	43.49	-

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

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

2、基金交易单元的选择程序如下：

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中金财富证券	3,598,706.00	100.00	77,340,000.00	100.00	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司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 500ESG 基准指数增强型证券投资基金 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
5	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
6	中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
7	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
8	中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-21

## § 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 500ESG 基准指数增强型证券投资基金募集注册的文件

- 2、《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、《中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金中证 500ESG 基准指数增强型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 500ESG 基准指数增强型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