

# 中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF) 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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>11</b>
6.1 资产负债表	11
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>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	中金中证优选 300 指数 (LOF)	
场内简称	金选 300 (扩位简称: 金选 300LOF)	
基金主代码	501060	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2018 年 8 月 30 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	74,889,088.14 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2018 年 9 月 25 日	
下属分级基金的基金简称	中金中证优选 300 指数 (LOF) A	中金中证优选 300 指数 (LOF) C
下属分级基金的场内简称	金选 300A (扩位简称: 金选 300A 类 LOF)	金选 300C (扩位简称: 金选 300C 类 LOF)
下属分级基金的交易代码	501060	501061
报告期末下属分级基金的份额总额	66,390,044.23 份	8,499,043.91 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化, 力争将本基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内, 年跟踪误差控制在 4% 以内, 实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金通过完全复制策略进行被动式指数化投资, 根据标的指数成份股的基准权重构建股票资产组合。在投资运作过程中, 本基金以标的指数权重为标准配置个股, 并根据成份股构成及其权重的变动进行动态调整。具体包括: 1、股票投资策略; 2、存托凭证投资策略; 3、债券投资策略; 4、股指期货投资策略; 5、股票期权投资策略; 6、资产支持证券投资策略; 7、可转换债券投资策略; 8、权证投资策略; 9、参与转融通证券出借业务投资策略。详见《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》。
业绩比较基准	中证中金优选 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率 (税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金, 其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型证券投资基金和混合型证券投资基金, 具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	席晓峰	王小飞
	联系电话	010-63211122	021-60637103

电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-868-1166	021-60637228
传真	010-66159121	021-60635778
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100004	100033
法定代表人	胡长生	田国立

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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)	
	中金中证优选 300 指数 (LOF)A	中金中证优选 300 指数 (LOF)C
本期已实现收益	3,679,222.79	1,216,723.60
本期利润	4,340,622.95	567,627.92
加权平均基金份额本期利润	0.0693	0.0273
本期加权平均净值利润率	4.02%	1.60%
本期基金份额净值增长率	3.85%	3.71%
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	47,492,712.52	5,878,863.34
期末可供分配基金份额利润	0.7154	0.6917
期末基金资产净值	113,882,756.75	14,377,907.25
期末基金份额净值	1.7154	1.6917
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	71.54%	69.17%

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

中金中证优选 300 指数 (LOF) A

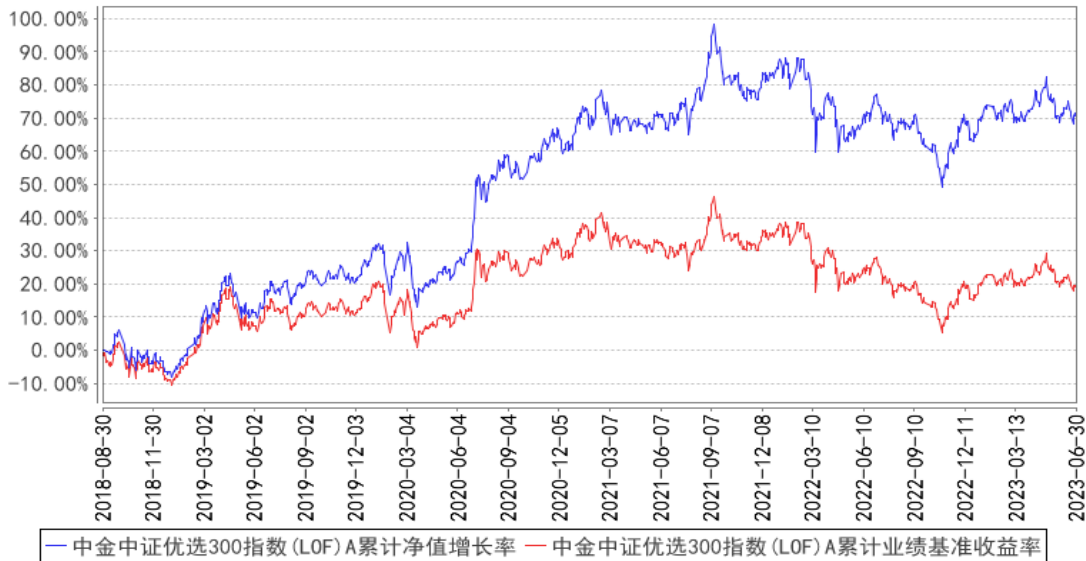
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.58%	0.76%	0.09%	0.78%	1.49%	-0.02%
过去三个月	0.69%	0.83%	-0.93%	0.83%	1.62%	0.00%
过去六个月	3.85%	0.79%	2.46%	0.79%	1.39%	0.00%
过去一年	-2.82%	0.90%	-6.43%	0.91%	3.61%	-0.01%
过去三年	30.75%	1.04%	5.71%	1.04%	25.04%	0.00%
自基金合同生效起至今	71.54%	1.11%	19.44%	1.12%	52.10%	-0.01%

中金中证优选 300 指数 (LOF) C

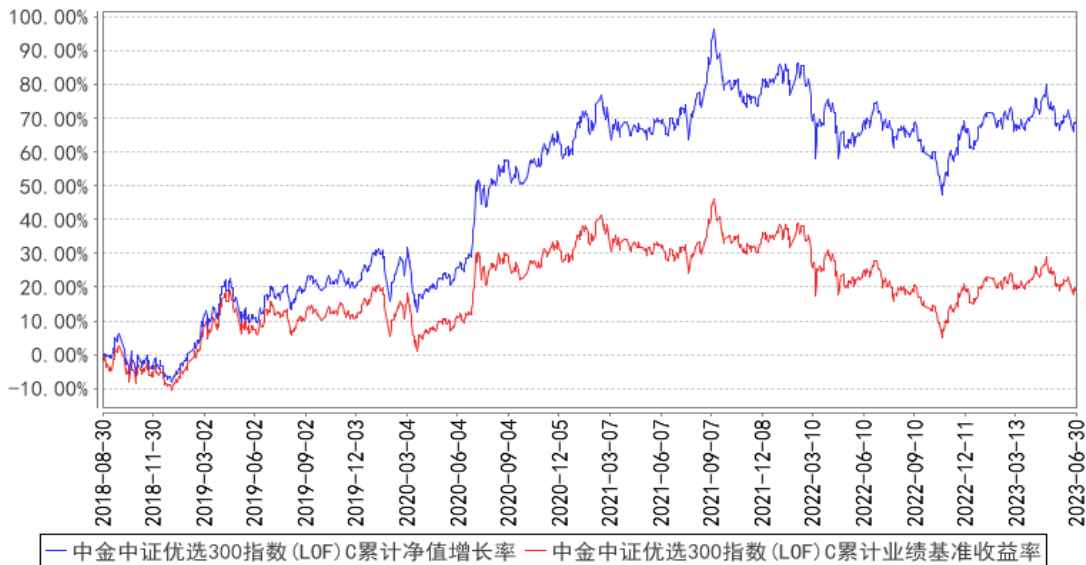
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.55%	0.76%	0.09%	0.78%	1.46%	-0.02%
过去三个月	0.62%	0.83%	-0.93%	0.83%	1.55%	0.00%
过去六个月	3.71%	0.79%	2.46%	0.79%	1.25%	0.00%
过去一年	-3.07%	0.90%	-6.43%	0.91%	3.36%	-0.01%
过去三年	29.76%	1.04%	5.71%	1.04%	24.05%	0.00%
自基金合同生效起至今	69.17%	1.11%	19.44%	1.12%	49.73%	-0.01%

### 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

中金中证优选300指数 (LOF) 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



中金中证优选300指数 (LOF) C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于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行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金采用完全复制中证中金优选 300 指数的策略,按照标的指数的成份股构成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金按照基金合同约定保持较高仓位运作,力争使组合与基准收益率的跟踪偏离和跟踪误差保持在较低水平。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证优选 300 指数 (LOF)A 基金份额净值为 1.7154 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.85%,同期业绩基准收益率为 2.46%;中金中证优选 300 指数 (LOF)C 基金份额净值为 1.6917 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.71%,同期业绩基准收益率为 2.46%。

## 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。

## 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF)

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	上年度末
----	-----	-----	------

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,911,145.28	1,774,152.39
结算备付金		819,658.00	512,362.76
存出保证金		12,873.05	5,360.98
交易性金融资产	6.4.7.2	129,912,454.79	118,038,806.38
其中: 股票投资		121,489,930.51	111,519,024.90
基金投资		-	-
债券投资		8,422,524.28	6,519,781.48
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		98,154.90	-
应收股利		-	-
应收申购款		171,336.80	101,466.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		132,925,622.82	120,432,149.20
<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		4,098,795.61	2,499,338.35
应付清算款		21.25	168,188.52
应付赎回款		77,999.63	43,205.75
应付管理人报酬		57,954.95	49,564.03
应付托管费		17,386.48	14,869.20
应付销售服务费		5,534.24	3,026.56
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	407,266.66	272,800.92

负债合计		4,664,958.82	3,050,993.33
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	74,889,088.14	71,172,050.90
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	53,371,575.86	46,209,104.97
净资产合计		128,260,664.00	117,381,155.87
负债和净资产总计		132,925,622.82	120,432,149.20

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，中金中证优选 300 指数 (LOF)A 的基金份额净值为 1.7154 元，期末份额总额为 66,390,044.23 份；中金中证优选 300 指数 (LOF)C 的基金份额净值为 1.6917 元，期末份额总额为 8,499,043.91 份。基金份额总额 74,889,088.14 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF)

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>		5,624,780.07	-2,826,965.91
1. 利息收入		8,384.39	7,572.03
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,384.39	7,572.03
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）		5,600,035.46	-4,059,312.85
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,880,402.65	-6,084,474.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	85,908.03	89,238.70
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	2,633,724.78	1,935,923.29
以摊余成本计量的金融 资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.20	12,304.48	1,221,355.29
4. 汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填	6.4.7.21	4,055.74	3,419.62

列)			
<b>减：二、营业总支出</b>		716,529.20	539,897.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	354,185.66	256,648.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	106,255.68	76,994.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	43,055.26	14,060.87
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		33,569.42	35,035.26
其中：卖出回购金融资产支出		33,569.42	35,035.26
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.02	0.01
8. 其他费用	6.4.7.23	179,463.16	157,157.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,908,250.87	-3,366,863.27
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,908,250.87	-3,366,863.27
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		4,908,250.87	-3,366,863.27

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF)

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）	71,172,050.90	-	46,209,104.97	117,381,155.87
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）	71,172,050.90	-	46,209,104.97	117,381,155.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,717,037.24	-	7,162,470.89	10,879,508.13
（一）、综合收益总额	-	-	4,908,250.87	4,908,250.87
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	3,717,037.24	-	2,254,220.02	5,971,257.26

(净值减少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	44,823,167.35	-	31,785,041.43	76,608,208.78
2. 基金赎回款	-41,106,130.11	-	-29,530,821.41	-70,636,951.52
(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)	74,889,088.14	-	53,371,575.86	128,260,664.00
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)	54,251,048.74	-	45,491,016.77	99,742,065.51
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)	54,251,048.74	-	45,491,016.77	99,742,065.51
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	12,529,478.06	-	5,456,159.04	17,985,637.10
(一)、综合收益总额	-	-	-3,366,863.27	-3,366,863.27
(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)	12,529,478.06	-	8,823,022.31	21,352,500.37
其中: 1. 基金申购款	26,808,076.01	-	19,318,389.86	46,126,465.87
2. 基金赎回款	-14,278,597.95	-	-10,495,367.55	-24,773,965.50

(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)	66,780,526.80	-	50,947,175.81	117,727,702.61

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

中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2018 年 4 月 17 日证监许可[2018]722 号《关于准予中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)注册的批复》核准,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)招募说明书》和《中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型上市开放式基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金,托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)、中国中金财富证券有限公司(以下简称“中金财富证券”,原“中国中投证券有限责任公司”)、中国银河证券股份有限公司及招商证券股份有限公司等共同销售,募集期为 2018 年 7 月 23 日起至 2018 年 8 月 23 日。经向中国证监会备案,《中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2018 年 8 月 30 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 274,597,597.22 份(含于 2018 年 9 月 21 日银行结息转份额 63,842.40 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。



根据经中国证监会备案的基金合同和《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》的相关内容, 本基金根据认购/申购费用、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, 而不从本类别基金资产中计提销售服务费的, 称为 A 类基金份额; 从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用的, 称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金销售费用的不同, 本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值, 计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》的有关规定, 本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、存托凭证、债券 (包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券 (含分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券、中期票据等)、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权、同业存单、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部 (以下简称“财政部”) 颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求, 同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求, 真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

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

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期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。

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。

(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	1,911,145.28
等于: 本金	1,910,937.22
加: 应计利息	208.06

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	1,911,145.28

#### 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	124,702,262.97	-	121,489,930.51	-3,212,332.46	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,298,994.75	116,294.28	8,422,524.28	7,235.25
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,298,994.75	116,294.28	8,422,524.28	7,235.25
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	133,001,257.72	116,294.28	129,912,454.79	-3,205,097.21	

#### 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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末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	0.69
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	127,922.81
其中：交易所市场	127,922.81

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
应付指数使用费	200,000.00
合计	407,266.66

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证优选 300 指数 (LOF) 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	62,377,375.97	62,377,375.97
本期申购	21,304,836.56	21,304,836.56
本期赎回 (以“-”号填列)	-17,292,168.30	-17,292,168.30
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	66,390,044.23	66,390,044.23

中金中证优选 300 指数 (LOF) 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	8,794,674.93	8,794,674.93
本期申购	23,518,330.79	23,518,330.79
本期赎回 (以“-”号填列)	-23,813,961.81	-23,813,961.81
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	8,499,043.91	8,499,043.91

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

中金中证优选 300 指数 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	50,256,156.79	-9,597,855.37	40,658,301.42
本期利润	3,679,222.79	661,400.16	4,340,622.95
本期基金份额交易产生	3,455,405.77	-961,617.62	2,493,788.15

的变动数			
其中：基金申购款	17,720,319.05	-2,486,886.66	15,233,432.39
基金赎回款	-14,264,913.28	1,525,269.04	-12,739,644.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,390,785.35	-9,898,072.83	47,492,712.52

中金中证优选 300 指数 (LOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,888,700.40	-1,337,896.85	5,550,803.55
本期利润	1,216,723.60	-649,095.68	567,627.92
本期基金份额交易产生的变动数	-974,340.36	734,772.23	-239,568.13
其中：基金申购款	18,498,784.79	-1,947,175.75	16,551,609.04
基金赎回款	-19,473,125.15	2,681,947.98	-16,791,177.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,131,083.64	-1,252,220.30	5,878,863.34

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	5,130.27
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	3,183.16
其他	70.96
合计	8,384.39

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	2,880,402.65
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	2,880,402.65

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	107,333,401.95
减：卖出股票成本总额	104,167,036.15
减：交易费用	285,963.15

买卖股票差价收入	2,880,402.65
----------	--------------

#### 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	75,125.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	10,782.15
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	85,908.03

##### 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	5,192,544.35
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,079,692.25
减：应计利息总额	102,066.31
减：交易费用	3.64
买卖债券差价收入	10,782.15

##### 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	2,633,724.78
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,633,724.78

#### 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	12,304.48
股票投资	-6,002.77
债券投资	18,307.25
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动	-

产生的预估增值税	
合计	12,304.48

#### 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	4,055.74
合计	4,055.74

#### 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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
划款手续费	120.00
合计	179,463.16

#### 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、基金销售机构
建设银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（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		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
中金公司	219,431,959.29	100.00	105,531,631.44	100.00

##### 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		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
中金公司	9,088,076.25	100.00	8,319,258.00	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		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
中金公司	327,332,000.00	100.00	353,500,000.00	100.00

##### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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 (%)
中金公司	160,468.89	100.00	127,922.81	100.00
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 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)

中金公司	77,174.51	100.00	64,847.25	100.00
------	-----------	--------	-----------	--------

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	354,185.66	256,648.87
其中：支付销售机构的客户维护费	117,557.87	114,830.52

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。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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	106,255.68	76,994.68

注：支付基金托管人建设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：

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

##### 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		
	中金中证优选 300 指数 (LOF)A	中金中证优选 300 指数 (LOF)C	合计
中金基金	-	24,903.79	24,903.79
中金公司	-	1,572.11	1,572.11

中金财富证券	-	5,235.98	5,235.98
合计	-	31,711.88	31,711.88
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		
	中金中证优选 300 指数 (LOF)A	中金中证优选 300 指数 (LOF)C	合计
	中金基金	-	28.03
中金公司	-	1,533.50	1,533.50
中金财富证券	-	3,144.16	3,144.16
合计	-	4,705.69	4,705.69

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 0.25% 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 × 0.25% / 当年天数

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

本基金本报告期内及上年度可比期间管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

中金中证优选 300 指数 (LOF) A

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
-------	------------------------	--------------------------

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
中金公司	627, 297.00	0.94	580, 397.00	0.93

份额单位：份

中金中证优选 300 指数 (LOF) C

关联方名 称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
中金公司	717, 615.00	8.44	601, 207.00	6.84

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
建设银行	1, 911, 145.28	5, 130.27	2, 088, 040.36	3, 873.95

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，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	629	40, 734.04
中金公司	688502	茂莱光学	网下	514	35, 836.08
中金公司	688249	晶合集成	网下	8, 761	173, 993.46
中金公司	688593	新相微	网下	3, 488	38, 995.84
中金公司	688472	阿特斯	网下	5, 216	57, 897.60
中金公司	688334	西高院	网下	3, 038	43, 018.08
中金公司	601916	浙商银行	配股	46, 830	94, 596.60
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位： 股/张)	总金额
中金公司	688173	希荻微	网下	761	25, 546.77
中金公司	688225	亚信安全	网下	1, 057	32, 249.07
中金公司	688282	理工导航	网下	637	41, 538.77

中金公司	688295	中复神鹰	网下	1,500	43,995.00
中金公司	688125	安达智能	网下	880	53,284.00
中金公司	600938	中国海油	网上	4,000	43,200.00
中金公司	688320	禾川科技	网下	2,052	48,550.32
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	1,853	40,636.29

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金为完全按照有关指数构成比例进行证券投资的基金，本报告期内依法合规投资基金托管人建设银行发行的股票。于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有建设银行的 A 股 102,200 股，占本基金资产净值的比例为 0.50%。（2022 年 12 月 31 日，本基金持有建设银行的 A 股 114,900 股，占本基金资产净值的比例为 0.55%。）

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末实施利润分配。

#### 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
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	349	2,296.42	2,645.42	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	129	1,336.44	1,527.36	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	121	1,410.86	1,483.46	-
601916	浙商银行	2023 年 6 月 27 日	1-6 个月（含）	配股流通受限	2.02	2.64	46,830	94,596.60	123,631.20	浙商银行于 2023 年 6 月 27 日每 10

										股配 3 股
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	44	1,143.12	1,079.32	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	132	2,349.60	2,361.48	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	14.58	16.13	93	1,355.94	1,500.09	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	128	4,627.20	4,880.64	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	877	17,417.22	15,838.62	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	304	4,304.64	4,927.84	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	370	4,477.00	4,465.90	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	153	3,610.80	9,894.51	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	133	2,553.60	3,395.49	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	117	3,119.22	3,685.50	-
688458	美芯	2023 年 5 月	6 个月	新股流通	75.00	90.76	57	4,275.00	5,173.32	-



	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	1,670	9,502.30	9,034.70	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	522	5,794.20	8,894.88	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	39.99	36.71	124	4,958.76	4,552.04	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	20.92	19.16	217	4,539.64	4,157.72	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	214	4,678.04	5,103.90	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	83	2,905.00	4,252.09	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	43.67	53.05	116	5,065.72	6,153.80	-
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	215	4,551.55	5,052.50	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	299	3,791.32	6,670.69	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	150	4,539.00	3,799.50	-
688576	西山	2023 年 5 月	6 个月	新股流通	135.80	120.41	52	7,061.60	6,261.32	-

	科技	月 30 日		受限						
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	36	4,528.80	4,249.08	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	349	3,901.82	5,091.91	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	400	4,272.00	4,936.00	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	36	4,531.68	3,124.44	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	344	3,185.44	6,394.96	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	101	2,553.28	3,016.87	-

#### 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	10,600	63,879.08	73,882.00	-

#### 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

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，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 4,098,795.61 元，于 2023 年 07 月 03 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

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

本基金为股票指数型基金, 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, 具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金投资风险主要包括: 信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制, 从而控制风险, 实现本基金的投资目标。

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约, 或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库, 对发行人及债券投资进行内部评级, 对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度, 以控制可能出现的信用风险。

###### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。(上年度末: 同)

###### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。(上年度末: 同)

###### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。(上年度末: 同)

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	24,002.00
未评级	-	-
合计	-	24,002.00

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

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，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
<b>资产</b>					
银行存款	1,910,937.22	-	-	208.06	1,911,145.28
结算备付金	819,289.30	-	-	368.70	819,658.00
存出保证金	12,867.25	-	-	5.80	12,873.05
交易性金融资产	8,306,230.00	-	-	121,606,224.79	129,912,454.79
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	98,154.90	98,154.90
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	171,336.80	171,336.80
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>11,049,323.77</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>121,876,299.05</b>	<b>132,925,622.82</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	4,100,000.00	-	-	-1,204.39	4,098,795.61
应付清算款	-	-	-	21.25	21.25
应付赎回款	-	-	-	77,999.63	77,999.63
应付销售服务费	-	-	-	5,534.24	5,534.24
应付管理人报酬	-	-	-	57,954.95	57,954.95
应付托管费	-	-	-	17,386.48	17,386.48
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	407,266.66	407,266.66
<b>负债总计</b>	<b>4,100,000.00</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>564,958.82</b>	<b>4,664,958.82</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>6,949,323.77</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>121,311,340.23</b>	<b>128,260,664.00</b>
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	1,773,949.48	-	-	202.91	1,774,152.39
结算备付金	512,109.21	-	-	253.55	512,362.76
存出保证金	5,358.34	-	-	2.64	5,360.98
交易性金融资产	6,395,130.00	-	24,000.00	111,619,676.38	118,038,806.38

买入返售金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	101,466.69	101,466.69
其他资产	-	-	-	-
资产总计	8,686,547.03	-	24,000.00	111,721,602.17
负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,500,000.00	-	-	-661.65
应付清算款	-	-	-	168,188.52
应付赎回款	-	-	-	43,205.75
应付销售服务费	-	-	-	3,026.56
应付管理人报酬	-	-	-	49,564.03
应付托管费	-	-	-	14,869.20
应交税费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	272,800.92
负债总计	2,500,000.00	-	-	550,993.33
利率敏感度缺口	6,186,547.03	-	24,000.00	111,170,608.84
				117,381,155.87

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	-6,225.61	-3,853.75
	市场利率下降 25 个基点	6,225.61	3,853.75

#### 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	121,489,930.51	94.72	111,519,024.90	95.01
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	121,489,930.51	94.72	111,519,024.90	95.01

#### 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%	6,329,869.12	5,825,714.99
	业绩比较基准下降 5%	-6,329,869.12	-5,825,714.99

#### 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	121,138,811.96	111,413,487.56
第二层次	8,620,037.48	6,519,781.48
第三层次	153,605.35	105,537.34
合计	129,912,454.79	118,038,806.38

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末无非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	121,489,930.51	91.40
	其中：股票	121,489,930.51	91.40
2	基金投资	-	-



3	固定收益投资	8,422,524.28	6.34
	其中：债券	8,422,524.28	6.34
	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	2,730,803.28	2.05
8	其他各项资产	282,364.75	0.21
9	合计	132,925,622.82	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	143,964.00	0.11
B	采矿业	6,243,904.00	4.87
C	制造业	45,577,556.52	35.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,420,529.00	4.23
E	建筑业	4,218,138.40	3.29
F	批发和零售业	1,951,940.84	1.52
G	交通运输、仓储和邮政业	1,799,144.40	1.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	898,964.00	0.70
J	金融业	48,382,690.80	37.72
K	房地产业	3,968,738.80	3.09
L	租赁和商务服务业	1,796,531.40	1.40
M	科学研究和技术服务业	44,100.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	313,027.00	0.24
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	577,096.00	0.45
S	综合	-	-
	合计	121,336,325.16	94.60

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	134,861.07	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,483.46	0.00
F	批发和零售业	2,645.42	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,687.56	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,927.84	0.00
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	153,605.35	0.12

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	3,700	6,256,700.00	4.88
2	600036	招商银行	184,200	6,034,392.00	4.70
3	601318	中国平安	118,700	5,507,680.00	4.29
4	000858	五粮液	29,600	4,841,672.00	3.77
5	000333	美的集团	74,900	4,413,108.00	3.44
6	601166	兴业银行	221,600	3,468,040.00	2.70
7	600900	长江电力	149,100	3,289,146.00	2.56
8	600887	伊利股份	96,900	2,744,208.00	2.14
9	601398	工商银行	534,100	2,574,362.00	2.01
10	000651	格力电器	68,600	2,504,586.00	1.95
11	601328	交通银行	418,700	2,428,460.00	1.89
12	600028	中国石化	289,900	1,843,764.00	1.44
13	601668	中国建筑	319,400	1,833,356.00	1.43
14	601288	农业银行	486,300	1,716,639.00	1.34
15	000001	平安银行	147,800	1,659,794.00	1.29
16	601088	中国神华	50,200	1,543,650.00	1.20
17	002142	宁波银行	60,300	1,525,590.00	1.19
18	000002	万科 A	103,700	1,453,874.00	1.13
19	600048	保利发展	109,400	1,425,482.00	1.11
20	600016	民生银行	378,400	1,419,000.00	1.11
21	600438	通威股份	41,200	1,413,572.00	1.10
22	600837	海通证券	147,100	1,356,262.00	1.06

23	600690	海尔智家	57,700	1,354,796.00	1.06
24	601601	中国太保	52,100	1,353,558.00	1.06
25	600919	江苏银行	180,000	1,323,000.00	1.03
26	601988	中国银行	321,300	1,256,283.00	0.98
27	002304	洋河股份	9,200	1,208,420.00	0.94
28	601766	中国中车	185,300	1,204,450.00	0.94
29	601688	华泰证券	78,400	1,079,568.00	0.84
30	601225	陕西煤业	59,100	1,075,029.00	0.84
31	002027	分众传媒	154,000	1,048,740.00	0.82
32	601169	北京银行	225,600	1,044,528.00	0.81
33	000338	潍柴动力	82,600	1,029,196.00	0.80
34	601211	国泰君安	68,600	959,714.00	0.75
35	601628	中国人寿	25,300	884,488.00	0.69
36	600660	福耀玻璃	24,400	874,740.00	0.68
37	601229	上海银行	151,500	871,125.00	0.68
38	601818	光大银行	282,800	868,196.00	0.68
39	601658	邮储银行	169,100	826,899.00	0.64
40	600999	招商证券	56,400	765,348.00	0.60
41	601006	大秦铁路	90,500	672,415.00	0.52
42	000776	广发证券	45,100	663,421.00	0.52
43	601939	建设银行	102,200	639,772.00	0.50
44	000166	申万宏源	137,300	634,326.00	0.49
45	601009	南京银行	78,800	630,400.00	0.49
46	600196	复星医药	19,400	599,460.00	0.47
47	601800	中国交建	54,000	589,140.00	0.46
48	000538	云南白药	10,940	574,131.20	0.45
49	600886	国投电力	45,300	573,045.00	0.45
50	002422	科伦药业	17,900	531,272.00	0.41
51	600926	杭州银行	45,100	529,925.00	0.41
52	600015	华夏银行	97,000	524,770.00	0.41
53	601916	浙商银行	198,430	523,855.20	0.41
54	600674	川投能源	34,000	511,700.00	0.40
55	600256	广汇能源	70,100	480,886.00	0.37
56	601066	中信建投	19,700	476,740.00	0.37
57	601877	正泰电器	16,400	453,460.00	0.35
58	601618	中国中冶	108,700	431,539.00	0.34
59	601838	成都银行	34,100	416,361.00	0.32
60	600039	四川路桥	39,840	390,830.40	0.30
61	000895	双汇发展	15,800	386,942.00	0.30
62	002736	国信证券	43,900	383,247.00	0.30
63	601607	上海医药	16,900	378,729.00	0.30
64	002007	华兰生物	16,700	374,247.00	0.29
65	300146	汤臣倍健	15,600	374,088.00	0.29

66	003816	中国广核	119,700	372,267.00	0.29
67	000999	华润三九	6,000	363,960.00	0.28
68	601108	财通证券	49,430	357,873.20	0.28
69	600415	小商品城	41,700	355,701.00	0.28
70	600383	金地集团	48,100	346,801.00	0.27
71	600109	国金证券	39,800	345,066.00	0.27
72	601077	渝农商行	94,200	338,178.00	0.26
73	002223	鱼跃医疗	9,100	327,509.00	0.26
74	002603	以岭药业	12,700	326,263.00	0.25
75	600705	中航产融	80,600	308,698.00	0.24
76	601699	潞安环能	18,200	297,024.00	0.23
77	000975	银泰黄金	25,300	296,010.00	0.23
78	601878	浙商证券	29,500	291,460.00	0.23
79	601319	中国人保	48,700	284,408.00	0.22
80	000591	太阳能	41,700	282,726.00	0.22
81	600061	国投资本	39,200	279,104.00	0.22
82	000617	中油资本	38,600	279,078.00	0.22
83	601998	中信银行	46,500	278,070.00	0.22
84	603589	口子窖	5,500	271,425.00	0.21
85	600642	申能股份	37,400	261,426.00	0.20
86	600170	上海建工	94,900	255,281.00	0.20
87	601966	玲珑轮胎	11,200	248,864.00	0.19
88	002372	伟星新材	12,100	248,534.00	0.19
89	601198	东兴证券	29,500	236,590.00	0.18
90	600271	航天信息	17,000	232,730.00	0.18
91	603198	迎驾贡酒	3,600	229,680.00	0.18
92	000623	吉林敖东	14,200	227,768.00	0.18
93	601881	中国银河	19,600	227,556.00	0.18
94	002056	横店东磁	12,400	225,804.00	0.18
95	000513	丽珠集团	5,700	221,787.00	0.17
96	600998	九州通	21,158	219,620.04	0.17
97	600348	华阳股份	27,600	218,316.00	0.17
98	603517	绝味食品	5,800	215,470.00	0.17
99	002595	豪迈科技	6,100	214,293.00	0.17
100	601216	君正集团	51,300	210,330.00	0.16
101	002531	天顺风能	13,800	210,174.00	0.16
102	600970	中材国际	16,100	205,275.00	0.16
103	600580	卧龙电驱	14,000	204,540.00	0.16
104	600655	豫园股份	29,700	203,742.00	0.16
105	600820	隧道股份	33,500	201,335.00	0.16
106	600909	华安证券	43,000	200,810.00	0.16
107	002939	长城证券	24,600	199,998.00	0.16
108	600329	达仁堂	4,400	197,516.00	0.15

109	603233	大参林	6,980	195,509.80	0.15
110	000921	海信家电	7,100	191,345.00	0.15
111	603156	养元饮品	7,700	190,190.00	0.15
112	600633	浙数文化	11,600	188,036.00	0.15
113	600390	五矿资本	34,300	184,534.00	0.14
114	002508	老板电器	7,200	182,088.00	0.14
115	600398	海澜之家	26,300	180,944.00	0.14
116	002128	电投能源	13,600	179,792.00	0.14
117	002318	久立特材	10,400	177,112.00	0.14
118	002335	科华数据	4,900	176,155.00	0.14
119	601717	郑煤机	14,000	174,300.00	0.14
120	600985	淮北矿业	15,100	173,952.00	0.14
121	002244	滨江集团	18,900	166,698.00	0.13
122	603195	公牛集团	1,720	165,223.20	0.13
123	603279	景津装备	5,240	164,326.40	0.13
124	600566	济川药业	5,600	162,624.00	0.13
125	600208	新湖中宝	64,900	160,952.00	0.13
126	601000	唐山港	45,000	158,850.00	0.12
127	002085	万丰奥威	22,800	158,004.00	0.12
128	600761	安徽合力	7,900	157,447.00	0.12
129	600755	厦门国贸	20,300	157,122.00	0.12
130	300674	宇信科技	8,700	153,816.00	0.12
131	000951	中国重汽	9,000	151,650.00	0.12
132	600057	厦门象屿	17,300	150,510.00	0.12
133	603218	日月股份	7,900	150,021.00	0.12
134	600056	中国医药	11,400	147,972.00	0.12
135	600582	天地科技	25,200	146,916.00	0.11
136	600598	北大荒	10,800	143,964.00	0.11
137	002605	姚记科技	3,100	143,933.00	0.11
138	000528	柳工	17,800	140,620.00	0.11
139	600323	瀚蓝环境	7,400	140,082.00	0.11
140	603565	中谷物流	12,748	137,678.40	0.11
141	002690	美亚光电	5,340	137,505.00	0.11
142	600373	中文传媒	10,300	137,196.00	0.11
143	002698	博实股份	7,800	136,422.00	0.11
144	601567	三星医疗	10,700	135,141.00	0.11
145	603298	杭叉集团	5,700	134,235.00	0.10
146	600612	老凤祥	1,900	132,772.00	0.10
147	600737	中粮糖业	16,200	130,410.00	0.10
148	600993	马应龙	4,600	127,926.00	0.10
149	688208	道通科技	4,200	127,302.00	0.10
150	001965	招商公路	13,200	126,720.00	0.10
151	601098	中南传媒	10,900	126,440.00	0.10

152	600933	爱柯迪	5,400	125,766.00	0.10
153	600750	江中药业	5,700	125,001.00	0.10
154	002701	奥瑞金	27,600	124,476.00	0.10
155	603918	金桥信息	4,500	123,615.00	0.10
156	600064	南京高科	18,380	121,491.80	0.09
157	002004	华邦健康	24,100	120,500.00	0.09
158	600916	中国黄金	10,200	120,462.00	0.09
159	600120	浙江东方	31,300	119,879.00	0.09
160	603197	保隆科技	2,200	119,350.00	0.09
161	002867	周大生	6,700	119,126.00	0.09
162	600197	伊力特	4,300	116,831.00	0.09
163	600211	西藏药业	1,900	112,860.00	0.09
164	002010	传化智联	21,200	112,784.00	0.09
165	601126	四方股份	7,400	112,406.00	0.09
166	601137	博威合金	7,200	112,032.00	0.09
167	002315	焦点科技	2,800	112,000.00	0.09
168	600062	华润双鹤	6,400	111,488.00	0.09
169	600285	羚锐制药	6,900	110,814.00	0.09
170	002038	双鹭药业	10,900	109,981.00	0.09
171	002737	葵花药业	4,508	109,724.72	0.09
172	600597	光明乳业	10,500	109,200.00	0.09
173	603368	柳药集团	4,400	108,724.00	0.08
174	600720	祁连山	9,500	108,015.00	0.08
175	000989	九芝堂	7,800	107,952.00	0.08
176	600901	江苏金租	25,580	105,645.40	0.08
177	000650	仁和药业	17,000	104,380.00	0.08
178	600477	杭萧钢构	25,300	103,477.00	0.08
179	002048	宁波华翔	7,500	100,500.00	0.08
180	601311	骆驼股份	10,800	100,224.00	0.08
181	605168	三人行	1,160	99,690.40	0.08
182	002154	报喜鸟	17,800	98,256.00	0.08
183	002233	塔牌集团	12,700	98,044.00	0.08
184	600210	紫江企业	18,400	97,888.00	0.08
185	000967	盈峰环境	19,300	97,465.00	0.08
186	600729	重庆百货	3,100	97,464.00	0.08
187	600502	安徽建工	18,300	96,624.00	0.08
188	000928	中钢国际	9,900	95,535.00	0.07
189	002108	沧州明珠	20,400	92,412.00	0.07
190	603566	普莱柯	3,800	88,350.00	0.07
191	601801	皖新传媒	9,100	85,449.00	0.07
192	603567	珍宝岛	5,700	85,272.00	0.07
193	600835	上海机电	4,900	84,182.00	0.07
194	601900	南方传媒	4,100	84,091.00	0.07

195	600125	铁龙物流	13,900	83,956.00	0.07
196	600531	豫光金铅	13,300	83,790.00	0.07
197	002803	吉宏股份	4,000	81,840.00	0.06
198	603187	海容冷链	4,080	81,559.20	0.06
199	600757	长江传媒	9,300	79,980.00	0.06
200	002215	诺普信	10,600	79,606.00	0.06
201	688676	金盘科技	2,600	78,754.00	0.06
202	601163	三角轮胎	4,900	77,763.00	0.06
203	002563	森马服饰	12,400	77,128.00	0.06
204	603556	海兴电力	3,000	75,720.00	0.06
205	603283	赛腾股份	1,700	75,650.00	0.06
206	601827	三峰环境	10,200	75,480.00	0.06
207	002293	罗莱生活	6,500	74,750.00	0.06
208	001696	宗申动力	10,500	74,340.00	0.06
209	601298	青岛港	10,600	73,882.00	0.06
210	002035	华帝股份	10,400	73,840.00	0.06
211	600377	宁沪高速	7,500	73,725.00	0.06
212	688819	天能股份	2,000	73,680.00	0.06
213	601326	秦港股份	21,700	73,346.00	0.06
214	603056	德邦股份	4,700	72,474.00	0.06
215	300869	康泰医学	3,100	71,176.00	0.06
216	603611	诺力股份	2,700	71,118.00	0.06
217	600971	恒源煤电	9,100	70,889.00	0.06
218	688658	悦康药业	3,400	70,754.00	0.06
219	002117	东港股份	6,600	69,564.00	0.05
220	300206	理邦仪器	4,500	67,860.00	0.05
221	600710	苏美达	7,900	67,624.00	0.05
222	603871	嘉友国际	4,300	67,553.00	0.05
223	605266	健之佳	800	67,064.00	0.05
224	603699	纽威股份	4,500	66,960.00	0.05
225	603855	华荣股份	2,500	66,500.00	0.05
226	600350	山东高速	10,400	66,248.00	0.05
227	600987	航民股份	8,000	65,840.00	0.05
228	000900	现代投资	16,200	65,286.00	0.05
229	600508	上海能源	4,400	64,592.00	0.05
230	600133	东湖高新	9,800	64,582.00	0.05
231	002533	金杯电工	7,900	64,464.00	0.05
232	603466	风语筑	4,600	63,940.00	0.05
233	601139	深圳燃气	8,700	63,423.00	0.05
234	000718	苏宁环球	23,200	63,336.00	0.05
235	600639	浦东金桥	5,100	63,291.00	0.05
236	603328	依顿电子	7,600	62,928.00	0.05
237	603920	世运电路	3,200	62,496.00	0.05

238	000048	京基智农	3,200	62,464.00	0.05
239	300349	金卡智能	4,500	62,460.00	0.05
240	300569	天能重工	7,400	62,308.00	0.05
241	601515	东风股份	14,200	62,196.00	0.05
242	002320	海峡股份	10,100	61,004.00	0.05
243	300403	汉宇集团	5,500	60,445.00	0.05
244	600668	尖峰集团	5,200	59,904.00	0.05
245	002959	小熊电器	700	58,450.00	0.05
246	600007	中国国贸	3,100	57,412.00	0.04
247	000906	浙商中拓	6,300	56,196.00	0.04
248	603877	太平鸟	2,200	55,616.00	0.04
249	002540	亚太科技	9,500	54,910.00	0.04
250	002062	宏润建设	10,100	54,641.00	0.04
251	002327	富安娜	6,300	53,046.00	0.04
252	600479	千金药业	4,600	51,888.00	0.04
253	603367	辰欣药业	3,400	51,612.00	0.04
254	603358	华达科技	2,700	51,462.00	0.04
255	300718	长盛轴承	2,300	51,175.00	0.04
256	603609	禾丰股份	5,600	50,960.00	0.04
257	300342	天银机电	4,600	49,542.00	0.04
258	002275	桂林三金	2,700	48,627.00	0.04
259	603889	新澳股份	6,440	48,364.40	0.04
260	002391	长青股份	7,000	48,090.00	0.04
261	002892	科力尔	3,440	47,472.00	0.04
262	300783	三只松鼠	2,400	46,896.00	0.04
263	603515	欧普照明	2,300	46,690.00	0.04
264	600261	阳光照明	12,600	45,990.00	0.04
265	002728	特一药业	2,960	45,140.00	0.04
266	603719	良品铺子	1,800	45,018.00	0.04
267	000517	荣安地产	14,700	44,835.00	0.03
268	603868	飞科电器	700	44,163.00	0.03
269	603357	设计总院	4,200	44,100.00	0.03
270	300691	联合光电	2,500	44,050.00	0.03
271	000544	中原环保	5,900	42,362.00	0.03
272	002641	公元股份	7,500	42,300.00	0.03
273	300729	乐歌股份	2,360	42,102.40	0.03
274	002997	瑞鹄模具	1,400	41,622.00	0.03
275	002014	永新股份	4,700	40,796.00	0.03
276	000026	飞亚达	3,300	39,798.00	0.03
277	002598	山东章鼓	3,300	39,039.00	0.03
278	000030	富奥股份	7,700	38,808.00	0.03
279	600548	深高速	4,300	38,614.00	0.03
280	600510	黑牡丹	6,300	38,241.00	0.03



281	002404	嘉欣丝绸	5,300	35,722.00	0.03
282	002843	泰嘉股份	1,700	35,632.00	0.03
283	603158	腾龙股份	4,500	34,470.00	0.03
284	603165	荣晟环保	2,100	33,684.00	0.03
285	002238	天威视讯	4,800	33,264.00	0.03
286	603587	地素时尚	2,200	32,208.00	0.03
287	603757	大元泵业	1,000	29,840.00	0.02
288	002818	富森美	2,200	29,106.00	0.02
289	603088	宁波精达	3,300	27,654.00	0.02
290	603066	音飞储存	2,300	27,393.00	0.02
291	600665	天地源	6,500	26,325.00	0.02
292	002394	联发股份	3,000	25,530.00	0.02
293	002911	佛燃能源	1,900	24,434.00	0.02
294	603365	水星家纺	1,600	22,496.00	0.02
295	603600	永艺股份	2,300	21,873.00	0.02
296	603109	神驰机电	1,200	21,420.00	0.02
297	603856	东宏股份	1,600	21,104.00	0.02
298	603680	今创集团	1,500	15,570.00	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	688249	晶合集成	877	15,838.62	0.01
2	688361	中科飞测	153	9,894.51	0.01
3	688469	中芯集成	1,670	9,034.70	0.01
4	688472	阿特斯	522	8,894.88	0.01
5	688562	航天软件	299	6,670.69	0.01
6	688629	华丰科技	344	6,394.96	0.00
7	688576	西山科技	52	6,261.32	0.00
8	688543	国科军工	116	6,153.80	0.00
9	688458	美芯晟	57	5,173.32	0.00
10	688523	航天环宇	214	5,103.90	0.00
11	688593	新相微	349	5,091.91	0.00
12	688552	航天南湖	215	5,052.50	0.00
13	688620	安凯微	400	4,936.00	0.00
14	688334	西高院	304	4,927.84	0.00
15	688146	中船特气	128	4,880.64	0.00
16	688484	南芯科技	124	4,552.04	0.00
17	688352	颀中科技	370	4,465.90	0.00
18	688535	华海诚科	83	4,252.09	0.00
19	688581	安杰思	36	4,249.08	0.00
20	688512	慧智微	217	4,157.72	0.00
21	688570	天玛智控	150	3,799.50	0.00
22	688433	华曙高科	117	3,685.50	0.00

23	688429	时创能源	133	3,395.49	0.00
24	688623	二元科技	36	3,124.44	0.00
25	688631	莱斯信息	101	3,016.87	0.00
26	601061	中信金属	349	2,645.42	0.00
27	603135	中重科技	132	2,361.48	0.00
28	601065	江盐集团	129	1,527.36	0.00
29	603172	万丰股份	93	1,500.09	0.00
30	601133	柏诚股份	121	1,483.46	0.00
31	603125	常青科技	44	1,079.32	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	8,274,842.00	7.05
2	000858	五粮液	6,697,541.12	5.71
3	600900	长江电力	4,467,498.00	3.81
4	600887	伊利股份	3,832,721.68	3.27
5	600036	招商银行	3,005,701.00	2.56
6	601318	中国平安	2,934,118.00	2.50
7	000333	美的集团	2,028,246.00	1.73
8	600837	海通证券	1,933,901.00	1.65
9	601166	兴业银行	1,854,899.00	1.58
10	601225	陕西煤业	1,574,512.00	1.34
11	601688	华泰证券	1,510,825.00	1.29
12	002027	分众传媒	1,431,629.00	1.22
13	601211	国泰君安	1,395,628.00	1.19
14	000338	潍柴动力	1,357,518.00	1.16
15	601628	中国人寿	1,257,786.00	1.07
16	000651	格力电器	1,219,095.22	1.04
17	601398	工商银行	1,180,718.00	1.01
18	600999	招商证券	1,091,389.00	0.93
19	601328	交通银行	1,076,690.00	0.92
20	000568	泸州老窖	1,040,937.00	0.89

##### 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	601318	中国平安	3,956,623.00	3.37
2	000568	泸州老窖	3,658,600.00	3.12
3	600036	招商银行	2,703,151.00	2.30
4	000333	美的集团	2,555,844.72	2.18

5	601166	兴业银行	2,335,033.00	1.99
6	600000	浦发银行	2,052,578.00	1.75
7	601390	中国中铁	1,915,333.00	1.63
8	600519	贵州茅台	1,842,006.00	1.57
9	601398	工商银行	1,646,517.00	1.40
10	000858	五粮液	1,543,266.00	1.31
11	601328	交通银行	1,526,479.00	1.30
12	601985	中国核电	1,507,358.00	1.28
13	000651	格力电器	1,491,833.00	1.27
14	600104	上汽集团	1,486,526.00	1.27
15	601138	工业富联	1,299,850.00	1.11
16	601668	中国建筑	1,256,787.00	1.07
17	601669	中国电建	1,255,639.23	1.07
18	601186	中国铁建	1,198,609.00	1.02
19	000001	平安银行	1,135,976.00	0.97
20	601288	农业银行	1,081,542.00	0.92

#### 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	114,143,944.53
卖出股票收入（成交）总额	107,333,401.95

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	8,422,524.28	6.57
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	8,422,524.28	6.57

#### 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	27,000	2,730,220.03	2.13

2	019679	22 国债 14	23,000	2,341,351.48	1.83
3	019663	21 国债 15	21,000	2,142,303.78	1.67
4	019703	23 国债 10	8,000	804,210.41	0.63
5	019694	23 国债 01	4,000	404,438.58	0.32

#### 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，招商银行股份有限公司、兴业银行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	12,873.05
2	应收清算款	98,154.90
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	171,336.80
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	282,364.75

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688249	晶合集成	15,838.62	0.01	新股流通受限
2	688361	中科飞测	9,894.51	0.01	新股流通受限
3	688469	中芯集成	9,034.70	0.01	新股流通受限
4	688472	阿特斯	8,894.88	0.01	新股流通受限
5	688562	航天软件	6,670.69	0.01	新股流通受限

#### 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 (%)
中金中证优选 300 指数 (LOF) A	7,317	9,073.40	8,304,789.27	12.51	58,085,254.96	87.49
中金中证优选 300 指数 (LOF) C	972	8,743.87	717,615.00	8.44	7,781,428.91	91.56
合计	8,289	9,034.76	9,022,404.27	12.05	65,866,683.87	87.95

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

中金中证优选 300 指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	吴洪才	680,300.00	31.89
2	中国国际金融股份有限公司	627,297.00	29.40
3	林成武	140,100.00	6.57
4	金萍	106,700.00	5.00
5	陈瑶	100,000.00	4.69
6	张强	39,800.00	1.87
7	吴雷	32,900.00	1.54
8	肖鲲	30,500.00	1.43
9	苏西华	29,767.00	1.40
10	李进喜	27,700.00	1.30

中金中证优选 300 指数 (LOF) C

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国国际金融股份有限公司	717,615.00	63.37
2	刘志刚	125,800.00	11.11
3	李文燕	80,081.00	7.07
4	陈敏	50,022.00	4.42
5	任景英	30,000.00	2.65
6	温岩松	20,200.00	1.78
7	丁一	20,004.00	1.77
8	吴康	10,002.00	0.88
9	曹瑞萍	10,002.00	0.88
10	余加响	10,000.00	0.88

## 8.3 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	中金中证优选 300 指数 (LOF) A	366,648.78	0.5523
	中金中证优选 300 指数 (LOF) C	31,058.39	0.3654
	合计	397,707.17	0.5311

## 8.4 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	中金中证优选 300 指数 (LOF) A	10~50
	中金中证优选 300 指数 (LOF) C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证优选 300 指数 (LOF) A	0

	中金中证优选 300 指数 (LOF)C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证优选 300 指数 (LOF) A	中金中证优选 300 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2018 年 8 月 30 日) 基金份额总额	196,888,672.87	77,708,924.35
本报告期期初基金份额总额	62,377,375.97	8,794,674.93
本报告期基金总申购份额	21,304,836.56	23,518,330.79
减：本报告期基金总赎回份额	17,292,168.30	23,813,961.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	66,390,044.23	8,499,043.91

## § 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 (%)	
中金公司	2	219,431,959.29	100.00	160,468.89	100.00	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-

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

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金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 (%)
中金公司	9,088,076.25	100.00	327,332,000.00	100.00	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-

### 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	中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 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
8	中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
9	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
10	中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-21
11	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-25
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	2023-05-26
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	2023-06-03
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	2023-06-10
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	2023-06-28

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 募集注册的文件
- 2、《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》
- 3、《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》
- 4、《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》及其更新
- 5、中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 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、报告期内中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 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