

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资  
基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 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。

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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 .....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
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 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.9 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 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
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 .....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表 .....	16
7.2 利润表 .....	18
7.3 净资产变动表 .....	19
7.4 报表附注 .....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	57

8.3 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 .....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	74
8.6 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 .....	74
8.7 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 .....	74
8.8 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 .....	74
8.9 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 .....	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	74
8.12 投资组合报告附注 .....	75
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>75</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
9.3 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 .....	76
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	76
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>76</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>77</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	77
11.2 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 .....	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	77
11.4 基金投资策略的改变 .....	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	78
11.8 其他重大事件 .....	80
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>82</b>
12.1 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 .....	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>82</b>
13.1 备查文件目录 .....	82
13.2 存放地点 .....	82
13.3 查阅方式 .....	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中金中证 500	
基金主代码	003016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 22 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	483,434,527.78 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金中证 500A	中金中证 500C
下属分级基金的交易代码	003016	003578
报告期末下属分级基金的份额总额	341,398,643.90 份	142,035,883.88 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	本基金股票投资主要策略为标的指数投资策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合，然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化，力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券投资策略；5、股指期货投资策略；6、参与转融通证券出借业务投资策略。详见《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中金基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰
	联系电话	010-63211122
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com
客户服务电话	400-868-1166	95588
传真	010-66159121	010-66105798
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号	北京市西城区复兴门内大街 55

	国贸大厦 B 座 43 层	号
邮政编码	100004	100140
法定代表人	李金泽	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年		2022 年		2021 年	
	中金中证 500A	中金中证 500C	中金中证 500A	中金中证 500C	中金中证 500A	中金中证 500C
本期已实现收益	-27,305,219.20	-12,587,531.65	-37,317,292.23	-16,321,033.21	44,916,225.61	28,548,535.33
本期利润	-30,217,191.07	-12,728,540.43	-63,446,277.98	-27,118,590.31	52,204,497.58	29,000,027.26
加权平均基金份额本期利润	-0.0908	-0.0858	-0.2421	-0.2799	0.4309	0.3751
本期加权平均净值利润率	-5.57%	-5.33%	-14.23%	-16.59%	24.63%	21.73%
本期基金	-5.59%	-5.97%	-16.05%	-16.39%	25.96%	25.47%

份额 净值 增长 率						
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末 可供 分配 利润	180,279,160 .69	71,902,913. 24	198,586,744 .21	96,871,450. 44	155,504,476 .65	68,428,203. 05
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.5281	0.5062	0.6186	0.6019	0.9185	0.9069
期末 基金 资产 净值	521,677,804 .59	213,938,797 .12	519,602,613 .21	257,815,719 .49	326,457,937 .09	144,563,730 .64
期末 基金 份额 净值	1.5281	1.5062	1.6186	1.6019	1.9281	1.9159
3.1. 3 累 计期 末指 标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金 份额 累计 净值 增长 率	52.81%	39.50%	61.86%	48.37%	92.81%	77.45%

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

2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金中证 500A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.06%	0.77%	-4.36%	0.82%	0.30%	-0.05%
过去六个月	-7.08%	0.76%	-9.01%	0.81%	1.93%	-0.05%
过去一年	-5.59%	0.72%	-7.01%	0.78%	1.42%	-0.06%
过去三年	-0.17%	1.01%	-13.83%	1.03%	13.66%	-0.02%
过去五年	87.89%	1.18%	29.29%	1.22%	58.60%	-0.04%
自基金合同生效起至今	52.81%	1.16%	-14.30%	1.20%	67.11%	-0.04%

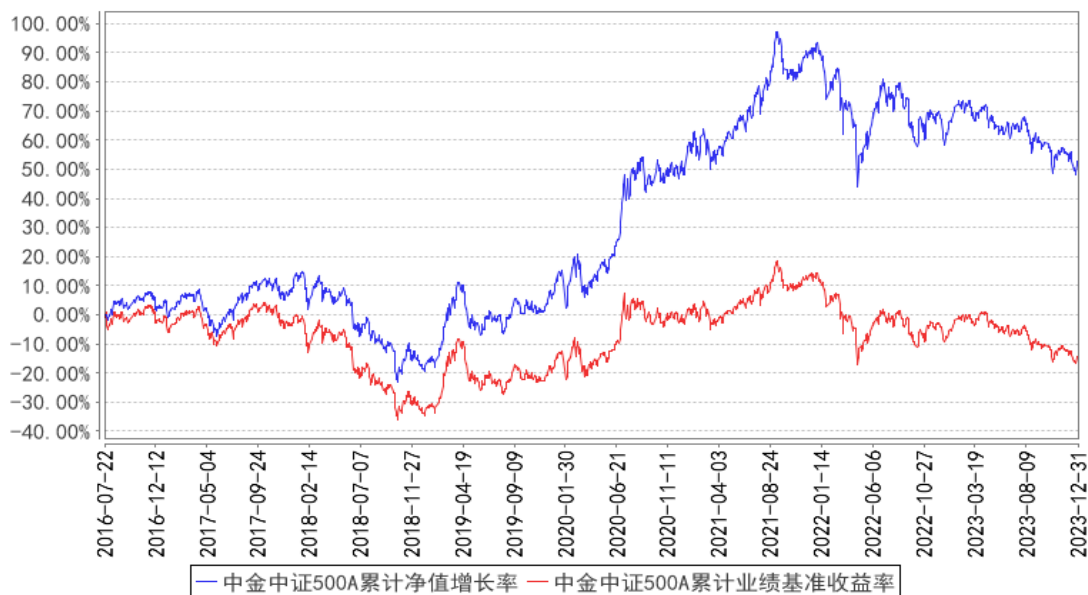
中金中证 500C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.16%	0.77%	-4.36%	0.82%	0.20%	-0.05%
过去六个月	-7.27%	0.76%	-9.01%	0.81%	1.74%	-0.05%
过去一年	-5.97%	0.72%	-7.01%	0.78%	1.04%	-0.06%
过去三年	-1.36%	1.01%	-13.83%	1.03%	12.47%	-0.02%
过去五年	83.62%	1.18%	29.29%	1.22%	54.33%	-0.04%
自基金合同生效起至今	39.50%	1.18%	-14.30%	1.21%	53.80%	-0.03%

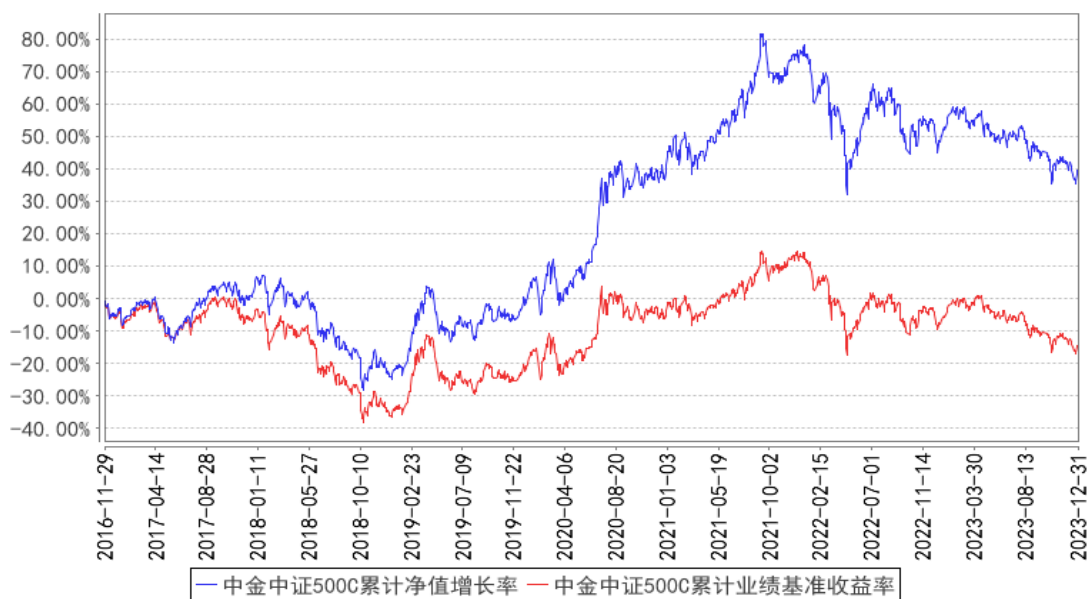


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

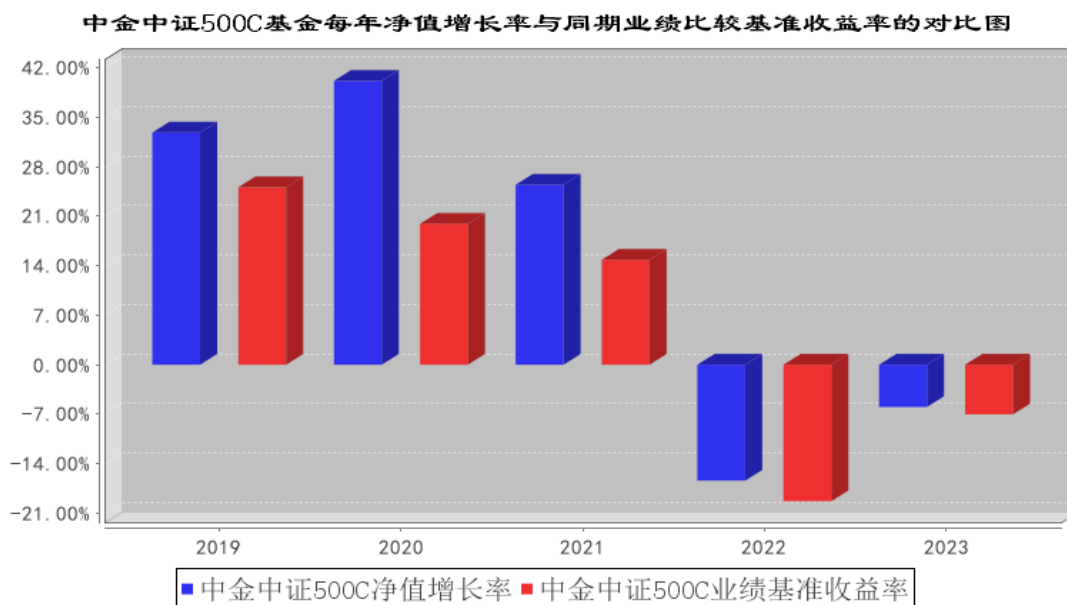
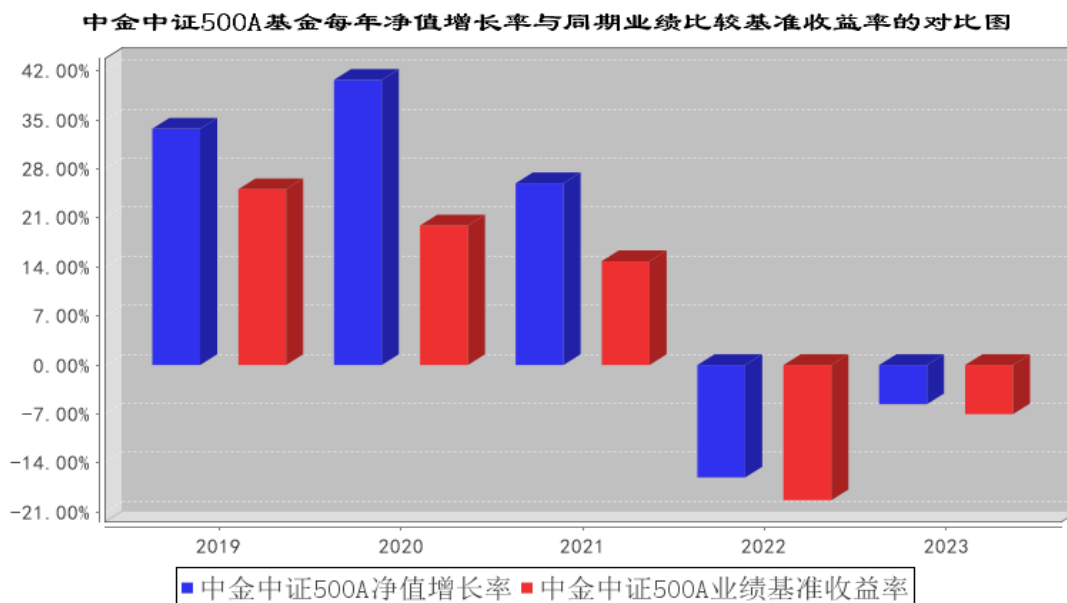
中金中证500A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中金中证500C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，自成立以来本基金未进行收益分配。

## § 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 12 月 31 日，公司共管理 49 只公募基金，证券投资基金管理规模 1272.04 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
耿帅军	本基金基金经理	2020 年 10 月 29 日	-	12 年	耿帅军先生，理学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所金融工程分析师，中信证券股份有限公司研究部副总裁、金融工程分析师，中国国际金融股份有限公司研究部执行总经理、金融工程分析师。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。
王家列	本基金基金经理助理	2023 年 10 月 26 日	-	7 年	王家列先生，金融硕士。历任泰康资产管理有限责任公司金融工程研究员，中金基金管理有限公司量化指数部研究员。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理助理。

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、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，

没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《中金基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施效果评估、信息披露与报告制度等多方面进行了规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，公司建立了科学合理的投资运作体系和规范的投资流程，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

2023 年是疫情防控平稳转段后的首年，中国宏观经济逐步走出疫情影响，恢复常态化运行，GDP 增速达 5.2%，达成全年目标。不同于传统周期型复苏，走出疫情后的经济复苏呈现出一定“非典型”特征，供给整体恢复较快，需求潜力仍有待进一步释放，这使得国内物价水平总体运行在低位区间，全年 CPI 比上年上涨 0.2%。

“非典型”经济复苏背景下，市场整体对“波浪式发展、曲折式前进”的经济恢复过程预期不足，预期与数据之间不断变化的相对位置决定了市场走势节奏和风格结构差异。此外，物价水平低位区间运行，安全资产需求超预期，权益资产风险溢价不断抬升，高股息、强主题成为了更

多投资者关注的投资主线。

2023 年 A 股市场呈现前高后低特征，除部分小市值指数外，代表性规模指数全年多数收跌。风格表现方面，价值优于成长，小盘战胜大盘。选股策略方面，以盈利动量为代表的基本面量化策略在 2023 年遭遇波折，以低波动、低流动为代表的驱动类策略表现突出。

在报告期内，本基金严格遵守基金合同的约定，基于科学系统的投资策略和审慎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。未来我们将继续努力开发和改进选股策略，不断储备具备长期风险溢价的投资策略，并基于策略特点动态调整各类风险溢价的配置结构，努力为投资人获取长期稳健超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证 500A 基金份额净值为 1.5281 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.59%，同期业绩基准收益率为-7.01%；中金中证 500C 基金份额净值为 1.5062 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.97%，同期业绩基准收益率为-7.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，伴随稳增长政策持续发力，中国经济复苏的广度和深度有望愈加深化。在财政政策和货币政策的协调配合下，中国经济需求潜力预计将得到进一步释放，这不仅有利于继续推动经济总量持续增长，也有助于促进物价水平平稳回升，进而降低国内风险资产的风险溢价。此外，美联储加息周期基本结束，货币政策有分歧的更多是减息节奏而非政策方向，国内资产价格修复有机会迎来比去年更好的流动性环境。考虑到当前 A 股市场整体处于历史低位的估值，我们认为 A 股市场未来一个阶段机会或将大于风险。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作，强化制度完善及对制度执行情况的监督检查，相关主要工作如下：

1) 紧密跟踪及落实法律法规、自律规则及监管要求，不断完善基金运作管理内部制度建设，促进依法合规展业；2) 研究、投资交易方面，围绕内幕交易、利用未公开信息交易等重点防范的违法违规行为和各项最新监管要求，开展合规培训，进一步提高员工合规守法意识。3) 营销与销售方面，持续对基金宣传推介材料、销售协议等材料文件进行合规审查，定期开展投资者适当性培训及销售业务专项培训，加强销售行为管理。4) 基金运作保障方面，持续为注册登记、基金会计、资金清算等业务提供合规咨询，适时开展合规检查，为基金运营安全提供法律合规支持。5) 信息披露方面，督促落实信息披露相关法规要求，促进各项信息披露工作依法合规开展。6) 以《季

度监察稽核项目表》为基础，对基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，同时有重点地开展定期不定期的合规检查、内部稽核，促进公司合规运作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施不断完善，坚持维护基金份额持有人合法权益。本基金管理人将继续合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益，提高监察稽核工作的有效性。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

#### 4.9 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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——中金基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有

人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2403953 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“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编制,公允反映了该基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>该基金管理人中金基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2023 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 所列

<p>务报表的责任</p>	<p>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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>	
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）</p>	
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>程海良</p>	<p>贾君宇</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层</p>	
<p>审计报告日期</p>	<p>2024 年 3 月 28 日</p>	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金



报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	3,646,132.59	4,608,330.64
结算备付金		2,613,049.08	3,480,575.44
存出保证金		62,129.85	79,688.80
交易性金融资产	7.4.7.2	730,153,652.48	771,085,898.00
其中：股票投资		690,156,739.16	730,248,140.64
基金投资		-	-
债券投资		39,996,913.32	40,837,757.36
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		162,073.00	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,052,766.91	3,588,600.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		737,689,803.91	782,843,093.25
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	1,500,000.00
应付清算款		-	1,445,385.20
应付赎回款		881,849.86	387,723.76
应付管理人报酬		311,264.46	312,740.90
应付托管费		93,379.35	93,822.29
应付销售服务费		73,820.97	72,129.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	712,887.56	1,612,959.28
负债合计		2,073,202.20	5,424,760.55
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	483,434,527.78	481,960,138.05
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	252,182,073.93	295,458,194.65
净资产合计		735,616,601.71	777,418,332.70
负债和净资产总计		737,689,803.91	782,843,093.25

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，中金中证 500A 的基金份额净值为 1.5281 元，期末份额总额为 341,398,643.90 份；中金中证 500C 的基金份额净值为 1.5062 元，期末份额总额为 142,035,883.88 份。基金份额总额 483,434,527.78 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		-36,482,065.65	-85,587,149.36
1. 利息收入		80,272.12	88,715.31
其中：存款利息收入	7.4.7.13	80,272.12	88,715.31
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-33,575,959.10	-48,903,105.20
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-47,233,013.14	-59,672,653.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	877,597.92	820,023.39
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	12,779,456.12	9,949,524.78
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）	7.4.7.20	-3,052,980.65	-36,926,542.85
4. 汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	66,601.98	153,783.38
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>6,463,665.85</b>	<b>4,977,718.93</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,913,115.22	3,020,247.88
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,173,934.51	906,074.26
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	957,901.77	648,365.52
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		94,024.72	117,034.50
其中：卖出回购金融资产支出		94,024.72	117,034.50
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.15	0.30
8. 其他费用	7.4.7.23	324,689.48	285,996.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-42,945,731.50</b>	<b>-90,564,868.29</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-42,945,731.50</b>	<b>-90,564,868.29</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-42,945,731.50</b>	<b>-90,564,868.29</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	481,960,138.05	-	295,458,194.65	777,418,332.70
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	481,960,138.05	-	295,458,194.65	777,418,332.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,474,389.73	-	-43,276,120.72	-41,801,730.99

(一)、综合收益总额	-	-	-42,945,731.50	-42,945,731.50
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	1,474,389.73	-	-330,389.22	1,144,000.51
其中：1. 基金申购款	259,969,471.15	-	166,747,324.06	426,716,795.21
2. 基金赎回款	-258,495,081.42	-	-167,077,713.28	-425,572,794.70
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	483,434,527.78	-	252,182,073.93	735,616,601.71
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	244,766,875.67	-	226,254,792.06	471,021,667.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	244,766,875.67	-	226,254,792.06	471,021,667.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	237,193,262.38	-	69,203,402.59	306,396,664.97
(一)、综合收益总额	-	-	-90,564,868.29	-90,564,868.29
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	237,193,262.38	-	159,768,270.88	396,961,533.26

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	536,233,759.85	-	372,864,168.99	909,097,928.84
2. 基金赎回款	-299,040,497.47	-	-213,095,898.11	-512,136,395.58
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	481,960,138.05	-	295,458,194.65	777,418,332.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>宗喆</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2016 年 7 月 5 日证监许可[2016]1517 号《关于准予中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式指数型基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金,托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

本基金通过中金基金直销中心、中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)及中国中金财富证券有限公司(以下简称“中金财富证券”)公开发售,于 2016 年 7 月 18 日募集。经向中国证监会备案,《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2016 年 7 月 22 日正式生效,合同生效日基金实收份额为 10,001,000.00 份,发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的

类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金销售费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

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 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股(含存托凭证)。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、存托凭证、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、卖出回购金融资产款等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

##### -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

##### -以摊余成本计量的金融负债

初始确认后,对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

在初始确认时,金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,相关交易费用直接计入当期损益;对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

#### (b) 金融工具的后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产:初始确认后,对于该类金融资产以公允价值进行后续计量,产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益,除非该金融资产属于套期关系的一部分。

以摊余成本计量的金融资产:初始确认后,对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失,在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时,计入当期损益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债:初始确认后,对于该类金融负债以公允价值进行后续计量,除与套期会计有关外,产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债:初始确认后,对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### (c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时,本基金终止确认该金融资产:

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;
- 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;



-该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的, 本基金将下列两项金额的差额计入当期损益:

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值;

-因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的, 本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础, 对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失准备的计量:

预期信用损失, 是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失, 是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额, 即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时, 本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失, 是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失, 是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月, 则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失, 是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备, 对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备:

-该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险; 或

-该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报:

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化, 本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失, 由此形成的损失准备的增加或转回金额, 应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产, 损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销：

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后两类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券

交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财税[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《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《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《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》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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)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。

(b)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。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c)对基金从上市公司、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，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%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(d)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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e)对基金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附加。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	3,646,132.59	4,608,330.64
等于：本金	3,645,699.79	4,607,073.82
加：应计利息	432.80	1,256.82
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	3,646,132.59	4,608,330.64

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		716,876,551.34	-	690,156,739.16	-26,719,812.18
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	39,513,569.00	500,073.32	39,996,913.32	-16,729.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	39,513,569.00	500,073.32	39,996,913.32	-16,729.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		756,390,120.34	500,073.32	730,153,652.48	-26,736,541.18
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		753,871,870.17	-	730,248,140.64	-23,623,729.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	40,368,516.00	529,072.36	40,837,757.36	-59,831.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	40,368,516.00	529,072.36	40,837,757.36	-59,831.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		794,240,386.17	529,072.36	771,085,898.00	-23,683,560.53

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末及上年度末无期货合约。

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末及上年度末无黄金衍生品。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**7.4.7.5 债权投资****7.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末及上年度末无债权投资。

**7.4.7.5.2 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。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

**7.4.7.6.2 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。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

**7.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31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	457,274.24	1,373,095.76
其中：交易所市场	457,274.24	1,373,095.76
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	195,000.00	185,000.00
应付指数使用费	60,613.32	54,863.52



合计	712,887.56	1,612,959.28
----	------------	--------------

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 中金中证 500A

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	321,015,869.00	321,015,869.00
本期申购	174,924,366.83	174,924,366.83
本期赎回（以“-”号填列）	-154,541,591.93	-154,541,591.93
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	341,398,643.90	341,398,643.90

##### 中金中证 500C

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	160,944,269.05	160,944,269.05
本期申购	85,045,104.32	85,045,104.32
本期赎回（以“-”号填列）	-103,953,489.49	-103,953,489.49
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	142,035,883.88	142,035,883.88

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期及上年度可比期间无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 中金中证 500A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	239,038,035.39	-40,451,291.18	198,586,744.21
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	239,038,035.39	-40,451,291.18	198,586,744.21
本期利润	-27,305,219.20	-2,911,971.87	-30,217,191.07
本期基金份额交易产	14,359,483.56	-2,449,876.01	11,909,607.55

生的变动数			
其中：基金申购款	130,344,480.63	-17,235,893.36	113,108,587.27
基金赎回款	-115,984,997.07	14,786,017.35	-101,198,979.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	226,092,299.75	-45,813,139.06	180,279,160.69

## 中金中证 500C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	117,103,054.63	-20,231,604.19	96,871,450.44
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	117,103,054.63	-20,231,604.19	96,871,450.44
本期利润	-12,587,531.65	-141,008.78	-12,728,540.43
本期基金份额交易产生的变动数	-13,623,574.25	1,383,577.48	-12,239,996.77
其中：基金申购款	61,890,131.32	-8,251,394.53	53,638,736.79
基金赎回款	-75,513,705.57	9,634,972.01	-65,878,733.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	90,891,948.73	-18,989,035.49	71,902,913.24

## 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	23,170.97	26,481.92
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	55,568.03	60,386.73
其他	1,533.12	1,846.66
合计	80,272.12	88,715.31

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-47,233,013.14	-59,672,653.37
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	-47,233,013.14	-59,672,653.37

## 7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	4,338,861,867.05	4,355,712,356.62
减：卖出股票成本总额	4,376,783,134.23	4,403,575,368.89
减：交易费用	9,311,745.96	11,809,641.10
买卖股票差价收入	-47,233,013.14	-59,672,653.37

## 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无股票出借差价收入。

## 7.4.7.15 债券投资收益

## 7.4.7.15.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	806,926.27	762,888.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	70,671.65	57,134.68
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	877,597.92	820,023.39

## 7.4.7.15.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	51,255,973.75	37,328,296.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	50,218,388.90	36,371,818.50
减：应计利息总额	966,897.00	899,287.24
减：交易费用	16.20	56.26
买卖债券差价收入	70,671.65	57,134.68

## 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

## 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无其他衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	12,779,456.12	9,949,524.78
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	12,779,456.12	9,949,524.78

#### 7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-3,052,980.65	-36,926,542.85
股票投资	-3,096,082.65	-36,913,131.15
债券投资	43,102.00	-13,411.70
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	-3,052,980.65	-36,926,542.85

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	66,564.34	152,677.96
基金转换费收入	37.64	1,105.42
合计	66,601.98	153,783.38

#### 7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	75,000.00	65,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	125,219.68	96,647.97
划款手续费	4,469.80	4,348.50
合计	324,689.48	285,996.47

#### 7.4.7.24 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
工商银行	基金托管人
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中金财富证券	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构
中金资本运营有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金浦成投资有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金期货有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中国国际金融（国际）有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金私募股权投资管理有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	-	-	1,470,904,821.42	16.25

###### 7.4.10.1.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	-	-	10,019,483.00	18.30

#### 7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	-	-	209,700,000.00	15.03

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	1,075,677.40	16.25	-	-

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,913,115.22	3,020,247.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,677,699.09	1,222,939.86

应支付基金管理人的净管理费	2,235,416.13	1,797,308.02
---------------	--------------	--------------

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：

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

#### 7.4.10.2.2 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12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,173,934.51	906,074.26

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

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

#### 7.4.10.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金财富证券	-	42,646.24	42,646.24
中金基金	-	20,528.28	20,528.28
合计	-	63,174.52	63,174.52
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	52,618.38	52,618.38
中金公司	-	-	-
中金财富证券	-	53,356.39	53,356.39
合计	-	105,974.77	105,974.77

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{C 类基金份额日基金销售服务费} = \text{C 类基金份额前一日基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}$$



**7.4.10.3 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。

**7.4.10.4 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**

**7.4.10.4.1 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。

**7.4.10.4.2 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。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

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

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016年7月22日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	1,014,198.78	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	1,014,198.78	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016年7月22日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	1,014,198.78	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,014,198.78	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3159%	-

**7.4.10.5.2 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 500A

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 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	6,939,003.92	2.0325	-	-

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	3,646,132.59	23,170.97	4,608,330.64	26,481.92

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

7.4.10.7 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 12 月 31 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	网下发行	1,887	122,202.12
中金公司	688502	茂莱光学	网下发行	1,509	105,207.48
中金公司	001287	中电港	网下发行	10,661	126,652.68
中金公司	688249	晶合集成	网下发行	46,275	919,021.50
中金公司	301332	德尔玛	网下发行	11,211	166,034.91
中金公司	688593	新相微	网下发行	9,584	107,149.12
中金公司	688472	阿特斯	网下发行	26,641	295,715.10
中金公司	688334	西高院	网下发行	8,879	125,726.64
中金公司	603296	华勤技术	网下发行	2,844	229,795.20
中金公司	301498	乖宝宠物	网下发行	5,531	221,184.69
中金公司	688702	盛科通信	网下发行	4,768	203,402.88
中金公司	688648	中邮科技	网下发行	3,025	45,919.50
中金公司	301526	国际复材	网下发行	97,225	258,618.50
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	688371	菲沃泰	网下发行	16,203	300,403.62
中金公司	301366	一博科技	网下发行	2,672	174,615.20
中金公司	301216	万凯新材	网下发行	5,410	193,028.80
中金公司	301150	中一科技	网下发行	1,256	205,431.36

中金公司	688295	中复神鹰	网下发行	7,549	221,412.17
中金公司	688332	中科蓝讯	网下发行	3,228	295,878.48
中金公司	688225	亚信安全	网下发行	5,086	155,173.86
中金公司	688400	凌云光	网下发行	10,669	233,971.17
中金公司	301267	华夏眼科	网下发行	4,850	246,768.00
中金公司	688114	华大智造	网下发行	2,545	221,873.10
中金公司	301391	卡莱特	网下发行	2,470	237,120.00
中金公司	603206	嘉环科技	网下发行	1,210	17,581.30
中金公司	688125	安达智能	网下发行	3,774	228,515.70
中金公司	688173	希荻微	网下发行	3,707	124,443.99
中金公司	301095	广立微	网下发行	4,175	242,150.00
中金公司	301367	怡和嘉业	网下发行	2,018	241,917.84
中金公司	688282	理工导航	网下发行	3,185	207,693.85
中金公司	688362	甬矽电子	网下发行	7,779	144,222.66
中金公司	688373	盟科药业	网下发行	31,886	260,189.76
中金公司	688320	禾川科技	网下发行	6,048	143,095.68
中金公司	688271	联影医疗	网下发行	3,314	364,142.32
中金公司	688428	诺诚健华	网下发行	70,135	773,589.05
中金公司	600938	中国海油	网上发行	4,000	43,200.00

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股流通受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣	2023年	6个	新股	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-

	新材	12月14日	月	流通受限						
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股流通受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	28.36	935	35,651.55	26,516.60	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	6个月	新股流通受限	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	376	20,935.68	14,130.08	-
301372	科净源	2023年8月3日	6个月	新股流通受限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-

301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301509	金凯生科	2023年7月26日	6个月	新股流通	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-

		日		受限						
301510	固高科技	2023年 8月4日	6个月	新股 流通 受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福科技	2023年 8月8日	6个月	新股 流通 受限	28.00	22.67	963	26,964.00	21,831.21	-
301515	港通医疗	2023年 7月13 日	6个月	新股 流通 受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023年 12月1 日	6个月	新股 流通 受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年 10月9 日	6个月	新股 流通 受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023年 7月26 日	6个月	新股 流通 受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023年 7月19 日	6个月	新股 流通 受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医药	2023年 9月18 日	6个月	新股 流通 受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023年 8月23 日	6个月	新股 流通 受限	99.57	81.46	191	19,017.87	15,558.86	-
301526	国际复材	2023年 12月19 日	6个月	新股 流通 受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301528	多浦乐	2023年 8月17 日	6个月	新股 流通 受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023年 8月31 日	6个月	新股 流通 受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023年 8月7日	6个月	新股 流通 受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023年 9月11 日	6个月	新股 流通 受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱	2023年	6个月	新股	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-

	股份	9月6日	月	流通受限						
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股流通受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	887	21,483.14	16,178.88	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股流通受限	11.25	11.07	1,116	12,555.00	12,354.12	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股流通受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-

603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	80.80	77.75	285	23,028.00	22,158.75	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	2,730	26,945.10	34,807.50	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	3,328	17,239.04	26,923.52	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	536	42,338.64	32,422.64	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股流通受限	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通	47.29	37.97	394	18,632.26	14,960.18	-



		日		受限						
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股流通受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股流通受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股流通受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	477	20,348.82	22,981.86	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日，本基金无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日，本基金无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 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 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型股票基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资风险主要包括：

信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金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。

#### **7.4.13.2 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。

##### **7.4.13.2.1 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）

##### **7.4.13.2.2 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）

##### **7.4.13.2.3 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）

##### **7.4.13.2.4 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）

##### **7.4.13.2.5 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）

#### 7.4.13.2.6 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）

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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变动，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。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,645,699.79	-	-	432.80	3,646,132.59
结算备付金	2,245,825.52	-	-	367,223.56	2,613,049.08
存出保证金	62,099.16	-	-	30.69	62,129.85
交易性金融资产	39,496,840.00	-	-	690,656,812.48	730,153,652.48
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	162,073.00	162,073.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,052,766.91	1,052,766.91
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	45,450,464.47	-	-	692,239,339.44	737,689,803.91
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	881,849.86	881,849.86
应付销售服务费	-	-	-	73,820.97	73,820.97
应付管理人报酬	-	-	-	311,264.46	311,264.46
应付托管费	-	-	-	93,379.35	93,379.35
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	712,887.56	712,887.56
负债总计	-	-	-	2,073,202.20	2,073,202.20
利率敏感度缺口	45,450,464.47	-	-	690,166,137.24	735,616,601.71
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					
货币资金	4,607,073.82	-	-	1,256.82	4,608,330.64
结算备付金	3,112,922.77	-	-	367,652.67	3,480,575.44
存出保证金	79,649.42	-	-	39.38	79,688.80
交易性金融资产	40,308,685.00	-	-	730,777,213.00	771,085,898.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,588,600.37	3,588,600.37
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	48,108,331.01	-	-	734,734,762.24	782,843,093.25
负债					
卖出回购金融资产款	1,500,000.00	-	-	-	1,500,000.00
应付清算款	-	-	-	1,445,385.20	1,445,385.20
应付赎回款	-	-	-	387,723.76	387,723.76

应付销售服务费	-	-	-	72,129.12	72,129.12
应付管理人报酬	-	-	-	312,740.90	312,740.90
应付托管费	-	-	-	93,822.29	93,822.29
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,612,959.28	1,612,959.28
负债总计	1,500,000.00	-	-	3,924,760.55	5,424,760.55
利率敏感度缺口	46,608,331.01	-	-	-730,810,001.69	777,418,332.70

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

#### 7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-37,138.07	-36,353.21
	市场利率下降 25 个基点	37,138.07	36,353.21

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	690,156,739.16	93.82	730,248,140.64	93.93
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	690,156,739.16	93.82	730,248,140.64	93.93

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	33,244,664.35	37,818,513.89
	业绩比较基准下降5%	-33,244,664.35	-37,818,513.89

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	689,096,374.13	726,881,307.26
第二层次	39,996,913.32	41,236,883.36

第三层次	1,060,365.03	2,967,707.38
合计	730,153,652.48	771,085,898.00

#### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,967,707.38	2,967,707.38
当期购买	-	2,666,925.95	2,666,925.95
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	5,165,916.11	5,165,916.11
当期利得或损失总额	-	591,647.81	591,647.81
其中：计入损益的利得或损失	-	591,647.81	591,647.81
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,060,365.03	1,060,365.03
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	133,076.46	133,076.46
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	235,650.23	235,650.23
当期购买	-	3,769,399.59	3,769,399.59

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,135,644.71	2,135,644.71
转出第三层次	-	3,192,052.41	3,192,052.41
当期利得或损失总额	-	19,065.26	19,065.26
其中：计入损益的利得或损失	-	19,065.26	19,065.26
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,967,707.38	2,967,707.38
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	388,941.73	388,941.73

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	1,060,365.03	亚式期权模型	预期波动率	0.1462-2.1988	负相关关系
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	2,967,707.38	亚式期权模型	预期波动率	0.1891-2.4756	负相关关系

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末无非持续的以公允价值计量的金融工具（上年度末：无）。

#### 7.4.14.4 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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	690,156,739.16	93.56
	其中：股票	690,156,739.16	93.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,996,913.32	5.42
	其中：债券	39,996,913.32	5.42
	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	6,259,181.67	0.85
8	其他各项资产	1,276,969.76	0.17
9	合计	737,689,803.91	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	1,580,278.64	0.21
B	采矿业	28,305,649.32	3.85
C	制造业	398,936,409.59	54.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,828,850.00	3.51
E	建筑业	9,844,155.00	1.34
F	批发和零售业	24,123,409.52	3.28
G	交通运输、仓储和邮政业	16,869,817.80	2.29
H	住宿和餐饮业	3,711,312.00	0.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,897,273.82	5.02
J	金融业	50,250,381.31	6.83
K	房地产业	10,366,233.00	1.41
L	租赁和商务服务业	3,507,502.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	2,612,280.31	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	7,964,908.00	1.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	99,144.00	0.01
Q	卫生和社会工作	1,440,597.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	14,541,751.77	1.98
S	综合	3,877,031.00	0.53
	合计	640,756,984.08	87.10

### 8.2.2 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	2,142,320.00	0.29
C	制造业	38,194,430.64	5.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	2,680,555.38	0.36
F	批发和零售业	449,709.20	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	12,354.12	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,767,933.17	0.24
J	金融业	1,587,533.00	0.22
K	房地产业	549,596.00	0.07
L	租赁和商务服务业	200,874.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	1,109,415.46	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	381,889.11	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	323,145.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	49,399,755.08	6.72

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通股票资产。

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	601058	赛轮轮胎	594,400	6,984,200.00	0.95
2	601958	金钼股份	703,350	6,646,657.50	0.90
3	600707	彩虹股份	862,300	5,820,525.00	0.79
4	300009	安科生物	567,388	5,798,705.36	0.79
5	000630	铜陵有色	1,737,100	5,697,688.00	0.77
6	600582	天地科技	977,400	5,317,056.00	0.72
7	300866	安克创新	58,293	5,164,759.80	0.70
8	600529	山东药玻	189,900	4,861,440.00	0.66
9	600901	江苏金租	1,004,420	4,861,392.80	0.66
10	600871	石化油服	2,641,700	4,834,311.00	0.66
11	688002	睿创微纳	107,242	4,742,241.24	0.64
12	000997	新大陆	237,900	4,665,219.00	0.63
13	600521	华海药业	315,741	4,631,920.47	0.63
14	300251	光线传媒	546,100	4,450,715.00	0.61
15	600739	辽宁成大	375,299	4,421,022.22	0.60
16	600967	内蒙一机	533,476	4,406,511.76	0.60
17	600161	天坛生物	142,197	4,399,575.18	0.60
18	000729	燕京啤酒	509,600	4,397,848.00	0.60
19	000728	国元证券	637,000	4,350,710.00	0.59

20	603688	石英股份	49,600	4,309,248.00	0.59
21	688208	道通科技	180,684	4,291,245.00	0.58
22	300001	特锐德	211,600	4,253,160.00	0.58
23	000563	陕国投 A	1,389,600	4,224,384.00	0.57
24	002867	周大生	276,500	4,197,270.00	0.57
25	002056	横店东磁	309,100	4,185,214.00	0.57
26	002138	顺络电子	154,500	4,173,045.00	0.57
27	600157	永泰能源	3,011,200	4,125,344.00	0.56
28	002373	千方科技	367,862	4,123,733.02	0.56
29	000623	吉林敖东	269,450	4,079,473.00	0.55
30	600143	金发科技	509,000	4,066,910.00	0.55
31	002625	光启技术	271,600	4,014,248.00	0.55
32	600580	卧龙电驱	338,281	3,968,036.13	0.54
33	600166	福田汽车	1,451,700	3,963,141.00	0.54
34	601568	北元集团	829,373	3,931,228.02	0.53
35	002966	苏州银行	607,950	3,927,357.00	0.53
36	600737	中粮糖业	464,300	3,825,832.00	0.52
37	601717	郑煤机	302,433	3,825,777.45	0.52
38	002563	森马服饰	662,700	3,823,779.00	0.52
39	002203	海亮股份	342,385	3,817,592.75	0.52
40	000591	太阳能	684,000	3,816,720.00	0.52
41	002739	万达电影	290,500	3,782,310.00	0.51
42	002152	广电运通	306,290	3,755,115.40	0.51
43	600258	首旅酒店	237,600	3,711,312.00	0.50
44	000089	深圳机场	565,600	3,636,808.00	0.49
45	601636	旗滨集团	528,100	3,612,204.00	0.49
46	000739	普洛药业	234,500	3,608,955.00	0.49
47	002506	协鑫集成	1,308,700	3,585,838.00	0.49
48	002600	领益智造	526,100	3,556,436.00	0.48
49	600970	中材国际	374,400	3,496,896.00	0.48
50	002422	科伦药业	120,326	3,495,470.30	0.48
51	600208	新湖中宝	1,568,400	3,403,428.00	0.46
52	600038	中直股份	87,700	3,379,081.00	0.46
53	601128	常熟银行	527,089	3,368,098.71	0.46
54	600549	厦门钨业	193,030	3,316,255.40	0.45
55	603228	景旺电子	146,041	3,294,684.96	0.45
56	600535	天士力	193,193	3,288,144.86	0.45
57	601608	中信重工	843,700	3,256,682.00	0.44
58	601231	环旭电子	213,000	3,218,430.00	0.44
59	002653	海思科	138,800	3,213,220.00	0.44
60	600998	九州通	454,474	3,185,862.74	0.43
61	601108	财通证券	409,080	3,174,460.80	0.43
62	603233	大参林	125,992	3,137,200.80	0.43

63	600820	隧道股份	544,100	3,134,016.00	0.43
64	000967	盈峰环境	648,800	3,081,800.00	0.42
65	000009	中国宝安	260,500	3,058,270.00	0.42
66	002266	浙富控股	893,620	3,038,308.00	0.41
67	002683	广东宏大	151,200	3,036,096.00	0.41
68	688520	神州细胞	55,842	3,008,208.54	0.41
69	600765	中航重机	156,500	2,990,715.00	0.41
70	600704	物产中大	671,000	2,972,530.00	0.40
71	600481	双良节能	349,700	2,958,462.00	0.40
72	000027	深圳能源	457,400	2,950,230.00	0.40
73	601168	西部矿业	204,780	2,922,210.60	0.40
74	000987	越秀资本	484,400	2,916,088.00	0.40
75	600500	中化国际	653,900	2,890,238.00	0.39
76	000960	锡业股份	197,400	2,826,768.00	0.38
77	688772	珠海冠宇	127,672	2,810,060.72	0.38
78	600352	浙江龙盛	333,400	2,800,560.00	0.38
79	002568	百润股份	113,700	2,798,157.00	0.38
80	600885	宏发股份	100,940	2,789,981.60	0.38
81	002925	盈趣科技	140,300	2,731,641.00	0.37
82	300144	宋城演艺	273,971	2,704,093.77	0.37
83	600271	航天信息	250,703	2,667,479.92	0.36
84	603927	中科软	88,300	2,647,234.00	0.36
85	600879	航天电子	342,200	2,638,362.00	0.36
86	002690	美亚光电	133,500	2,621,940.00	0.36
87	600126	杭钢股份	484,400	2,581,852.00	0.35
88	002399	海普瑞	217,800	2,554,794.00	0.35
89	002064	华峰化学	379,100	2,543,761.00	0.35
90	600380	健康元	204,272	2,539,100.96	0.35
91	603883	老百姓	84,400	2,522,716.00	0.34
92	000878	云南铜业	230,801	2,513,422.89	0.34
93	300118	东方日升	142,300	2,511,595.00	0.34
94	002340	格林美	457,400	2,497,404.00	0.34
95	300724	捷佳伟创	33,634	2,489,252.34	0.34
96	600498	烽火通信	149,120	2,481,356.80	0.34
97	001914	招商积余	204,700	2,448,212.00	0.33
98	688281	华秦科技	18,011	2,443,372.26	0.33
99	688425	铁建重工	614,400	2,439,168.00	0.33
100	002608	江苏国信	369,900	2,430,243.00	0.33
101	300285	国瓷材料	103,900	2,402,168.00	0.33
102	000559	万向钱潮	458,380	2,378,992.20	0.32
103	603338	浙江鼎力	46,400	2,374,288.00	0.32
104	601106	中国一重	822,800	2,369,664.00	0.32
105	600699	均胜电子	131,653	2,364,487.88	0.32

106	002273	水晶光电	174,200	2,358,668.00	0.32
107	600170	上海建工	1,004,500	2,350,530.00	0.32
108	000898	鞍钢股份	932,400	2,321,676.00	0.32
109	002595	豪迈科技	77,800	2,316,106.00	0.31
110	000598	兴蓉环境	403,800	2,297,622.00	0.31
111	600390	五矿资本	490,100	2,293,668.00	0.31
112	300558	贝达药业	43,900	2,263,045.00	0.31
113	600517	国网英大	470,500	2,244,285.00	0.31
114	601139	深圳燃气	325,500	2,242,695.00	0.30
115	002429	兆驰股份	400,600	2,235,348.00	0.30
116	000930	中粮科技	335,300	2,226,392.00	0.30
117	600066	宇通客车	168,000	2,226,000.00	0.30
118	600862	中航高科	98,500	2,181,775.00	0.30
119	601992	金隅集团	1,139,008	2,175,505.28	0.30
120	002032	苏泊尔	40,800	2,162,808.00	0.29
121	000636	风华高科	155,800	2,128,228.00	0.29
122	600153	建发股份	219,700	2,115,711.00	0.29
123	600528	中铁工业	283,400	2,108,496.00	0.29
124	300394	天孚通信	22,873	2,093,336.96	0.28
125	001872	招商港口	130,400	2,081,184.00	0.28
126	600909	华安证券	424,600	2,072,048.00	0.28
127	601665	齐鲁银行	520,700	2,035,937.00	0.28
128	300699	光威复材	74,400	1,984,248.00	0.27
129	002430	杭氧股份	67,300	1,965,833.00	0.27
130	000937	冀中能源	273,086	1,949,834.04	0.27
131	000050	深天马 A	180,500	1,922,325.00	0.26
132	603160	汇顶科技	27,501	1,900,319.10	0.26
133	300418	昆仑万维	50,636	1,893,786.40	0.26
134	000887	中鼎股份	150,200	1,857,974.00	0.25
135	603568	伟明环保	115,300	1,844,800.00	0.25
136	688169	石头科技	6,504	1,840,306.80	0.25
137	300073	当升科技	47,948	1,831,613.60	0.25
138	603218	日月股份	146,300	1,809,731.00	0.25
139	000933	神火股份	107,500	1,806,000.00	0.25
140	600299	安迪苏	224,800	1,798,400.00	0.24
141	002465	海格通信	137,400	1,765,590.00	0.24
142	600873	梅花生物	184,500	1,761,975.00	0.24
143	600928	西安银行	527,200	1,755,576.00	0.24
144	688276	百克生物	31,704	1,737,696.24	0.24
145	000039	中集集团	226,300	1,731,195.00	0.24
146	601156	东航物流	115,300	1,704,134.00	0.23
147	688516	奥特维	18,817	1,702,938.50	0.23
148	601233	桐昆股份	112,200	1,697,586.00	0.23

149	688006	杭可科技	71,995	1,690,442.60	0.23
150	601828	美凯龙	434,200	1,680,354.00	0.23
151	601966	玲珑轮胎	86,591	1,665,144.93	0.23
152	600755	厦门国贸	238,708	1,663,794.76	0.23
153	300595	欧普康视	72,600	1,639,308.00	0.22
154	300296	利亚德	271,800	1,630,800.00	0.22
155	000709	河钢股份	753,600	1,605,168.00	0.22
156	600497	驰宏锌锗	316,600	1,598,830.00	0.22
157	000959	首钢股份	456,898	1,580,867.08	0.21
158	600022	山东钢铁	1,151,800	1,577,966.00	0.21
159	000932	华菱钢铁	305,400	1,572,810.00	0.21
160	601000	唐山港	438,200	1,533,700.00	0.21
161	600339	中油工程	502,000	1,521,060.00	0.21
162	603885	吉祥航空	126,300	1,515,600.00	0.21
163	000883	湖北能源	353,400	1,494,882.00	0.20
164	600282	南钢股份	400,700	1,482,590.00	0.20
165	603650	彤程新材	44,100	1,468,530.00	0.20
166	600060	海信视像	70,100	1,465,090.00	0.20
167	600167	联美控股	256,200	1,452,654.00	0.20
168	600867	通化东宝	133,600	1,446,888.00	0.20
169	002044	美年健康	239,700	1,440,597.00	0.20
170	000547	航天发展	170,500	1,427,085.00	0.19
171	600637	东方明珠	189,018	1,421,415.36	0.19
172	603317	天味食品	106,272	1,412,354.88	0.19
173	300682	朗新集团	85,900	1,407,901.00	0.19
174	600350	山东高速	202,200	1,403,268.00	0.19
175	688728	格科微	67,800	1,387,866.00	0.19
176	002558	巨人网络	122,500	1,364,650.00	0.19
177	002131	利欧股份	596,400	1,359,792.00	0.18
178	603225	新凤鸣	95,500	1,356,100.00	0.18
179	002294	信立泰	40,400	1,319,464.00	0.18
180	002372	伟星新材	90,600	1,310,982.00	0.18
181	000031	大悦城	437,400	1,299,078.00	0.18
182	600177	雅戈尔	197,648	1,294,594.40	0.18
183	002153	石基信息	131,390	1,279,738.60	0.17
184	002407	多氟多	83,860	1,276,349.20	0.17
185	003031	中瓷电子	14,300	1,261,689.00	0.17
186	300207	欣旺达	85,100	1,256,076.00	0.17
187	603379	三美股份	36,800	1,251,200.00	0.17
188	600536	中国软件	34,080	1,235,740.80	0.17
189	600985	淮北矿业	74,197	1,233,896.11	0.17
190	688099	晶晨股份	19,648	1,230,554.24	0.17
191	603305	旭升集团	62,000	1,223,260.00	0.17

192	600325	华发股份	168,800	1,217,048.00	0.17
193	002092	中泰化学	199,500	1,216,950.00	0.17
194	603185	弘元绿能	36,500	1,214,720.00	0.17
195	002572	索菲亚	74,900	1,194,655.00	0.16
196	603866	桃李面包	154,800	1,185,768.00	0.16
197	600927	永安期货	75,200	1,181,392.00	0.16
198	601016	节能风电	392,900	1,178,700.00	0.16
199	601555	东吴证券	160,900	1,176,179.00	0.16
200	601098	中南传媒	114,900	1,168,533.00	0.16
201	300529	健帆生物	52,200	1,160,406.00	0.16
202	300136	信维通信	49,100	1,158,760.00	0.16
203	600482	中国动力	63,013	1,134,864.13	0.15
204	603858	步长制药	66,100	1,124,361.00	0.15
205	601866	中远海发	479,200	1,121,328.00	0.15
206	603056	德邦股份	77,100	1,115,637.00	0.15
207	002384	东山精密	61,300	1,114,434.00	0.15
208	600056	中国医药	99,700	1,113,649.00	0.15
209	002065	东华软件	178,000	1,098,260.00	0.15
210	688567	孚能科技	65,933	1,075,367.23	0.15
211	000785	居然之家	320,900	1,058,970.00	0.14
212	601880	辽港股份	729,400	1,057,630.00	0.14
213	002624	完美世界	88,600	1,049,024.00	0.14
214	601118	海南橡胶	244,900	1,038,376.00	0.14
215	002423	中粮资本	154,000	1,028,720.00	0.14
216	002080	中材科技	63,369	1,008,834.48	0.14
217	600848	上海临港	100,300	1,008,015.00	0.14
218	603000	人民网	35,900	1,004,482.00	0.14
219	600373	中文传媒	75,800	999,044.00	0.14
220	300253	卫宁健康	138,200	993,658.00	0.14
221	000060	中金岭南	229,650	992,088.00	0.13
222	600131	国网信通	64,200	972,630.00	0.13
223	300383	光环新网	99,600	968,112.00	0.13
224	600416	湘电股份	59,500	944,860.00	0.13
225	002517	恺英网络	84,400	942,748.00	0.13
226	688153	唯捷创芯	14,339	939,204.50	0.13
227	600968	海油发展	328,800	937,080.00	0.13
228	688387	信科移动	127,630	920,212.30	0.13
229	688188	柏楚电子	3,572	904,108.92	0.12
230	603444	吉比特	3,600	882,432.00	0.12
231	300604	长川科技	22,900	869,971.00	0.12
232	300017	网宿科技	110,304	865,886.40	0.12
233	002223	鱼跃医疗	24,900	861,042.00	0.12
234	300502	新易盛	17,300	853,236.00	0.12

235	002156	通富微电	36,144	835,649.28	0.11
236	688819	天能股份	29,453	822,327.76	0.11
237	600673	东阳光	111,700	818,761.00	0.11
238	002463	沪电股份	36,580	809,149.60	0.11
239	002958	青农商行	308,500	808,270.00	0.11
240	600377	宁沪高速	77,200	791,300.00	0.11
241	600764	中国海防	31,592	788,220.40	0.11
242	002025	航天电器	16,257	780,661.14	0.11
243	600546	山煤国际	44,500	779,195.00	0.11
244	600369	西南证券	187,300	766,057.00	0.10
245	603127	昭衍新药	32,300	765,833.00	0.10
246	000750	国海证券	215,000	761,100.00	0.10
247	002926	华西证券	97,000	752,720.00	0.10
248	601611	中国核建	108,500	751,905.00	0.10
249	300861	美畅股份	22,400	745,696.00	0.10
250	001203	大中矿业	73,300	745,461.00	0.10
251	600435	北方导航	62,400	732,576.00	0.10
252	002439	启明星辰	26,800	723,600.00	0.10
253	601778	晶科科技	205,900	720,650.00	0.10
254	003035	南网能源	136,500	717,990.00	0.10
255	300357	我武生物	24,700	716,300.00	0.10
256	000988	华工科技	23,791	708,020.16	0.10
257	300363	博腾股份	28,000	704,200.00	0.10
258	601198	东兴证券	85,200	701,196.00	0.10
259	601187	厦门银行	137,400	696,618.00	0.09
260	601928	凤凰传媒	79,000	695,990.00	0.09
261	688521	芯原股份	13,865	692,695.40	0.09
262	000066	中国长城	68,400	692,208.00	0.09
263	000975	银泰黄金	46,000	690,000.00	0.09
264	603712	七一二	21,800	686,918.00	0.09
265	002008	大族激光	33,100	685,832.00	0.09
266	603737	三棵树	14,400	685,584.00	0.09
267	688180	君实生物	16,349	683,878.67	0.09
268	600663	陆家嘴	77,800	680,750.00	0.09
269	600141	兴发集团	37,240	679,630.00	0.09
270	000513	丽珠集团	19,400	679,194.00	0.09
271	300888	稳健医疗	18,100	674,225.00	0.09
272	600160	巨化股份	40,661	670,499.89	0.09
273	003022	联泓新科	36,500	668,315.00	0.09
274	000401	冀东水泥	103,900	663,921.00	0.09
275	688248	南网科技	26,505	661,829.85	0.09
276	002078	太阳纸业	54,300	660,831.00	0.09
277	601228	广州港	210,800	659,804.00	0.09



278	000830	鲁西化工	65,300	654,959.00	0.09
279	603355	莱克电气	29,200	651,160.00	0.09
280	002557	洽洽食品	18,700	651,134.00	0.09
281	601158	重庆水务	114,500	649,215.00	0.09
282	002511	中顺洁柔	64,800	648,000.00	0.09
283	600959	江苏有线	205,200	644,328.00	0.09
284	600906	财达证券	84,100	630,750.00	0.09
285	000553	安道麦 A	90,500	628,070.00	0.09
286	002408	齐翔腾达	113,200	597,696.00	0.08
287	002670	国盛金控	63,100	588,092.00	0.08
288	600095	湘财股份	78,300	588,033.00	0.08
289	600977	中国电影	47,900	586,296.00	0.08
290	600925	苏能股份	106,300	585,713.00	0.08
291	301236	软通动力	12,600	582,120.00	0.08
292	300146	汤臣倍健	33,400	568,802.00	0.08
293	000825	太钢不锈	151,600	565,468.00	0.08
294	600801	华新水泥	45,200	561,836.00	0.08
295	002155	湖南黄金	47,600	530,264.00	0.07
296	688538	和辉光电	216,800	526,824.00	0.07
297	002185	华天科技	61,700	525,684.00	0.07
298	002532	天山铝业	86,600	520,466.00	0.07
299	002028	思源电气	9,900	515,196.00	0.07
300	600511	国药股份	17,800	509,436.00	0.07
301	000423	东阿阿胶	10,300	507,996.00	0.07
302	688779	长远锂科	69,040	503,992.00	0.07
303	688072	拓荆科技	2,155	498,451.50	0.07
304	002505	鹏都农牧	307,400	491,840.00	0.07
305	600597	光明乳业	56,200	490,626.00	0.07
306	600008	首创环保	179,600	483,124.00	0.07
307	002128	电投能源	33,141	472,922.07	0.06
308	000738	航发控制	23,660	470,834.00	0.06
309	688105	诺唯赞	14,573	466,627.46	0.06
310	002945	华林证券	30,800	465,080.00	0.06
311	002850	科达利	5,400	456,084.00	0.06
312	002414	高德红外	62,200	454,060.00	0.06
313	600298	安琪酵母	12,800	450,304.00	0.06
314	600988	赤峰黄金	31,600	442,716.00	0.06
315	603456	九洲药业	18,000	435,780.00	0.06
316	600398	海澜之家	58,600	434,812.00	0.06
317	600021	上海电力	50,300	425,538.00	0.06
318	600598	北大荒	35,512	425,078.64	0.06
319	600109	国金证券	46,800	424,944.00	0.06
320	601577	长沙银行	62,100	423,522.00	0.06

321	002195	岩山科技	135,500	415,985.00	0.06
322	300058	蓝色光标	57,700	414,286.00	0.06
323	688120	华海清科	2,200	412,940.00	0.06
324	300568	星源材质	26,700	411,714.00	0.06
325	002030	达安基因	41,900	405,592.00	0.06
326	300601	康泰生物	14,600	396,390.00	0.05
327	300003	乐普医疗	24,500	395,920.00	0.05
328	001227	兰州银行	151,400	393,640.00	0.05
329	300088	长信科技	58,400	390,696.00	0.05
330	600129	太极集团	8,400	390,264.00	0.05
331	002262	恩华药业	14,300	387,816.00	0.05
332	600642	申能股份	60,000	385,200.00	0.05
333	600499	科达制造	36,000	379,800.00	0.05
334	601077	渝农商行	93,000	379,440.00	0.05
335	603786	科博达	5,300	378,208.00	0.05
336	601991	大唐发电	155,700	376,794.00	0.05
337	002409	雅克科技	6,700	373,391.00	0.05
338	600062	华润双鹤	20,000	372,000.00	0.05
339	600486	扬农化工	5,800	366,096.00	0.05
340	300487	蓝晓科技	6,800	360,808.00	0.05
341	002385	大北农	60,000	357,600.00	0.05
342	000021	深科技	22,000	356,620.00	0.05
343	002010	传化智联	76,600	353,892.00	0.05
344	605358	立昂微	12,900	353,331.00	0.05
345	688220	翱捷科技	4,852	341,774.88	0.05
346	600859	王府井	21,400	341,758.00	0.05
347	688052	纳芯微	2,038	340,040.30	0.05
348	000400	许继电气	15,300	335,988.00	0.05
349	001286	陕西能源	38,700	330,885.00	0.04
350	300850	新强联	9,900	315,117.00	0.04
351	300212	易华录	10,000	314,500.00	0.04
352	600079	人福医药	12,600	313,236.00	0.04
353	002268	电科网安	13,800	309,948.00	0.04
354	002244	滨江集团	42,600	309,702.00	0.04
355	002368	太极股份	10,146	299,611.38	0.04
356	600563	法拉电子	3,100	287,060.00	0.04
357	601061	中信金属	36,700	282,957.00	0.04
358	300373	扬杰科技	7,700	282,590.00	0.04
359	002281	光迅科技	9,600	273,600.00	0.04
360	688536	思瑞浦	1,800	263,340.00	0.04
361	688234	天岳先进	3,897	257,474.79	0.04
362	601298	青岛港	40,360	249,424.80	0.03
363	688385	复旦微电	6,278	242,519.14	0.03

364	603893	瑞芯微	3,800	240,920.00	0.03
365	002831	裕同科技	8,500	233,835.00	0.03
366	601933	永辉超市	82,000	231,240.00	0.03
367	688200	华峰测控	1,839	225,829.20	0.03
368	301029	怡合达	8,700	224,286.00	0.03
369	688331	荣昌生物	3,600	223,416.00	0.03
370	000778	新兴铸管	56,900	217,358.00	0.03
371	002939	长城证券	27,100	216,800.00	0.03
372	002673	西部证券	33,800	215,306.00	0.03
373	600839	四川长虹	40,200	212,658.00	0.03
374	688082	盛美上海	2,000	208,820.00	0.03
375	000783	长江证券	38,400	206,592.00	0.03
376	600827	百联股份	20,900	198,341.00	0.03
377	000539	粤电力 A	38,800	189,732.00	0.03
378	002500	山西证券	34,900	188,111.00	0.03
379	002756	永兴材料	3,400	177,514.00	0.02
380	000958	电投产融	42,600	167,844.00	0.02
381	601456	国联证券	15,100	163,684.00	0.02
382	002508	老板电器	7,300	158,994.00	0.02
383	600583	海油工程	26,700	158,598.00	0.02
384	600956	新天绿能	19,400	157,722.00	0.02
385	603939	益丰药房	3,900	156,156.00	0.02
386	000156	华数传媒	21,000	154,770.00	0.02
387	688107	安路科技	3,676	135,203.28	0.02
388	600032	浙江新能	15,000	120,900.00	0.02
389	002299	圣农发展	6,800	116,824.00	0.02
390	603816	顾家家居	3,200	112,000.00	0.02
391	002761	浙江建投	10,800	110,808.00	0.02
392	601997	贵阳银行	19,900	102,286.00	0.01
393	002607	中公教育	24,300	99,144.00	0.01
394	603517	绝味食品	3,500	94,010.00	0.01
395	600884	杉杉股份	6,000	81,720.00	0.01
396	002865	钧达股份	800	61,984.00	0.01
397	000970	中科三环	4,600	47,610.00	0.01
398	002507	涪陵榨菜	1,450	20,720.50	0.00

### 8.3.2 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	300308	中际旭创	42,807	4,833,338.37	0.66
2	600372	中航机载	178,065	2,346,896.70	0.32
3	600667	太极实业	303,646	2,134,631.38	0.29
4	300442	润泽科技	75,880	1,925,075.60	0.26
5	002249	大洋电机	381,350	1,895,309.50	0.26

6	300618	寒锐钴业	62,900	1,779,441.00	0.24
7	601869	长飞光纤	61,400	1,686,044.00	0.23
8	002705	新宝股份	114,100	1,662,437.00	0.23
9	000426	兴业银锡	132,600	1,204,008.00	0.16
10	603897	长城科技	57,200	1,171,456.00	0.16
11	603859	能科科技	28,700	1,082,851.00	0.15
12	000589	贵州轮胎	175,100	1,071,612.00	0.15
13	000990	诚志股份	129,200	1,060,732.00	0.14
14	688510	航亚科技	59,485	1,048,125.70	0.14
15	603590	康辰药业	27,400	1,043,392.00	0.14
16	300638	广和通	54,140	1,030,284.20	0.14
17	601288	农业银行	250,100	910,364.00	0.12
18	300551	古鳌科技	48,100	836,940.00	0.11
19	300796	贝斯美	41,500	668,150.00	0.09
20	002724	海洋王	79,500	653,490.00	0.09
21	000020	深华发 A	50,200	650,090.00	0.09
22	002544	普天科技	30,900	627,888.00	0.09
23	601988	中国银行	155,000	618,450.00	0.08
24	000953	河化股份	107,900	590,213.00	0.08
25	603933	睿能科技	36,100	561,355.00	0.08
26	002461	珠江啤酒	70,800	559,320.00	0.08
27	000612	焦作万方	95,100	546,825.00	0.07
28	002171	楚江新材	71,400	534,072.00	0.07
29	688368	晶丰明源	4,900	528,906.00	0.07
30	600370	三房巷	209,500	506,990.00	0.07
31	300515	三德科技	42,600	491,604.00	0.07
32	688108	赛诺医疗	37,946	476,222.30	0.06
33	600403	大有能源	124,600	473,480.00	0.06
34	688319	欧林生物	29,092	459,653.60	0.06
35	002211	宏达新材	113,000	452,000.00	0.06
36	603680	今创集团	46,300	437,535.00	0.06
37	600297	广汇汽车	250,100	430,172.00	0.06
38	600675	中华企业	132,800	418,320.00	0.06
39	600696	岩石股份	20,500	368,795.00	0.05
40	300225	金力泰	35,900	351,102.00	0.05
41	300203	聚光科技	20,600	326,510.00	0.04
42	003006	百亚股份	21,400	324,424.00	0.04
43	002524	光正眼科	50,100	323,145.00	0.04
44	300533	冰川网络	11,500	318,550.00	0.04
45	002313	日海智能	27,600	314,088.00	0.04
46	600251	冠农股份	36,100	313,709.00	0.04
47	688166	博瑞医药	8,830	309,050.00	0.04
48	601005	重庆钢铁	214,700	298,433.00	0.04

49	002501	利源股份	205,300	293,579.00	0.04
50	601857	中国石油	39,600	279,576.00	0.04
51	601127	赛力斯	3,500	266,700.00	0.04
52	002533	金杯电工	32,500	262,600.00	0.04
53	300340	科恒股份	20,900	254,980.00	0.03
54	300958	建工修复	14,300	248,677.00	0.03
55	603879	永悦科技	38,800	247,932.00	0.03
56	300140	节能环境	33,400	246,158.00	0.03
57	688066	航天宏图	5,800	244,992.00	0.03
58	002027	分众传媒	31,300	197,816.00	0.03
59	002415	海康威视	5,400	187,488.00	0.03
60	000333	美的集团	3,400	185,742.00	0.03
61	000063	中兴通讯	7,000	185,360.00	0.03
62	600028	中国石化	33,200	185,256.00	0.03
63	601390	中国中铁	32,300	183,464.00	0.02
64	601668	中国建筑	37,600	180,856.00	0.02
65	300750	宁德时代	1,100	179,586.00	0.02
66	600104	上汽集团	13,200	178,596.00	0.02
67	002594	比亚迪	900	178,200.00	0.02
68	002938	鹏鼎控股	7,100	158,472.00	0.02
69	600448	华纺股份	40,600	133,980.00	0.02
70	600565	迪马股份	88,700	131,276.00	0.02
71	300760	迈瑞医疗	400	116,240.00	0.02
72	300266	兴源环境	42,300	114,210.00	0.02
73	002491	通鼎互联	21,200	111,088.00	0.02
74	300942	易瑞生物	9,400	109,886.00	0.01
75	601068	中铝国际	22,200	102,564.00	0.01
76	603876	鼎胜新材	7,500	93,975.00	0.01
77	603611	诺力股份	4,500	85,185.00	0.01
78	601800	中国交建	10,400	79,040.00	0.01
79	600391	航发科技	3,600	68,832.00	0.01
80	688007	光峰科技	2,400	62,112.00	0.01
81	601998	中信银行	11,100	58,719.00	0.01
82	688505	复旦张江	4,800	44,304.00	0.01
83	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.01
84	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
85	688548	广钢气体	2,730	34,807.50	0.00
86	688563	航材股份	536	32,422.64	0.00
87	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
88	688549	中巨芯	3,328	26,923.52	0.00
89	301291	明阳电气	935	26,516.60	0.00
90	688702	盛科通信	477	22,981.86	0.00
91	603296	华勤技术	285	22,158.75	0.00

92	301511	德福科技	963	21,831.21	0.00
93	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
94	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
95	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
96	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
97	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
98	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
99	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
100	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
101	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
102	301559	中集环科	887	16,178.88	0.00
103	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
104	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
105	301525	儒竞科技	191	15,558.86	0.00
106	301393	吴帆生物	260	15,436.20	0.00
107	688612	威迈斯	394	14,960.18	0.00
108	301371	敷尔佳	376	14,130.08	0.00
109	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
110	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
111	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
112	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
113	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
114	601083	锦江航运	1,116	12,354.12	0.00
115	301225	恒勃股份	333	11,921.40	0.00
116	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
117	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
118	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
119	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
120	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
121	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
122	601766	中国中车	2,000	10,520.00	0.00
123	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
124	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
125	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
126	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
127	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
128	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
129	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
130	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
131	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
132	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
133	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
134	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00

135	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
136	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
137	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
138	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
139	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
140	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
141	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
142	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
143	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
144	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
145	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
146	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
147	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
148	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
149	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
150	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
151	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
152	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
153	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
154	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
155	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
156	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
157	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
158	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
159	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
160	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
161	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
162	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
163	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
164	688289	圣湘生物	206	4,027.30	0.00
165	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
166	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
167	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
168	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
169	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
170	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	600580	卧龙电驱	20,850,483.00	2.68
2	600563	法拉电子	20,105,596.60	2.59

3	300009	安科生物	19,862,227.84	2.55
4	601128	常熟银行	19,020,386.00	2.45
5	600143	金发科技	18,842,844.00	2.42
6	000738	航发控制	18,493,122.00	2.38
7	300308	中际旭创	18,490,362.79	2.38
8	600161	天坛生物	18,355,147.40	2.36
9	600885	宏发股份	18,349,263.28	2.36
10	002422	科伦药业	18,330,275.24	2.36
11	000967	盈峰环境	18,204,941.00	2.34
12	601108	财通证券	18,122,310.69	2.33
13	601717	郑煤机	17,792,599.05	2.29
14	600348	华阳股份	17,527,931.00	2.25
15	000997	新大陆	17,332,748.36	2.23
16	603737	三棵树	17,256,739.60	2.22
17	002384	东山精密	17,114,465.00	2.20
18	000739	普洛药业	16,983,776.66	2.18
19	600038	中直股份	16,977,261.99	2.18
20	000563	陕国投 A	16,764,307.00	2.16
21	600500	中化国际	16,674,394.16	2.14
22	601058	赛轮轮胎	16,594,428.00	2.13
23	688188	柏楚电子	16,369,858.79	2.11
24	002966	苏州银行	16,342,305.60	2.10
25	300073	当升科技	16,286,267.05	2.09
26	002739	万达电影	16,088,174.00	2.07
27	600060	海信视像	16,008,073.28	2.06
28	000729	燕京啤酒	15,901,797.00	2.05
29	600066	宇通客车	15,892,009.00	2.04
30	002203	海亮股份	15,884,471.75	2.04
31	600967	内蒙一机	15,882,934.16	2.04
32	000937	冀中能源	15,813,650.70	2.03
33	000709	河钢股份	15,777,187.00	2.03
34	600879	航天电子	15,683,410.80	2.02
35	601555	东吴证券	15,680,759.30	2.02
36	002056	横店东磁	15,583,348.00	2.00

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600563	法拉电子	24,485,446.40	3.15
2	600885	宏发股份	23,572,235.60	3.03
3	002384	东山精密	23,397,394.03	3.01
4	300308	中际旭创	22,433,935.82	2.89
5	002422	科伦药业	21,513,795.00	2.77



6	002738	中矿资源	20,600,714.40	2.65
7	688777	中控技术	20,157,177.33	2.59
8	601128	常熟银行	20,138,626.12	2.59
9	601555	东吴证券	20,058,112.64	2.58
10	600580	卧龙电驱	19,984,457.00	2.57
11	688009	中国通号	19,522,417.04	2.51
12	300073	当升科技	19,331,051.64	2.49
13	688390	固德威	18,481,632.48	2.38
14	000738	航发控制	18,359,159.00	2.36
15	300009	安科生物	18,343,326.37	2.36
16	603605	珀莱雅	18,307,599.56	2.35
17	600655	豫园股份	17,915,088.00	2.30
18	603456	九洲药业	17,672,752.00	2.27
19	600566	济川药业	17,505,960.42	2.25
20	600348	华阳股份	17,221,014.00	2.22
21	600157	永泰能源	17,021,722.00	2.19
22	603737	三棵树	17,020,124.80	2.19
23	002966	苏州银行	16,926,291.00	2.18
24	600598	北大荒	16,914,913.97	2.18
25	002056	横店东磁	16,868,567.00	2.17
26	002465	海格通信	16,866,285.00	2.17
27	002273	水晶光电	16,732,744.00	2.15
28	601108	财通证券	16,540,417.00	2.13
29	600170	上海建工	16,491,990.00	2.12
30	000728	国元证券	16,456,276.46	2.12
31	600967	内蒙一机	16,334,013.00	2.10
32	600380	健康元	16,247,213.80	2.09
33	002249	大洋电机	16,224,387.00	2.09
34	603613	国联股份	16,196,931.47	2.08
35	300017	网宿科技	16,176,750.78	2.08
36	002152	广电运通	16,095,234.10	2.07
37	600064	南京高科	15,866,551.76	2.04
38	600060	海信视像	15,790,266.00	2.03
39	601298	青岛港	15,774,633.00	2.03
40	688188	柏楚电子	15,708,737.78	2.02
41	600820	隧道股份	15,621,803.00	2.01
42	000967	盈峰环境	15,592,213.00	2.01
43	601717	郑煤机	15,548,663.00	2.00

#### 8.4.3 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	4,339,787,815.40
卖出股票收入（成交）总额	4,338,861,867.05

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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。

### 8.5 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	39,996,913.32	5.44
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	39,996,913.32	5.44

### 8.6 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	019678	22 国债 13	190,000	19,223,210.96	2.61
2	019694	23 国债 01	116,000	11,825,376.88	1.61
3	019709	23 国债 16	75,000	7,539,246.58	1.02
4	019727	23 国债 24	14,000	1,409,078.90	0.19

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	62,129.85
2	应收清算款	162,073.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,052,766.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,276,969.76

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	户均持有的基金份	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)	额	持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
中金中证 500A	37,479	9,109.06	37,907,053.51	11.10	303,491,590.39	88.90
中金中证 500C	46,044	3,084.79	1,305,092.22	0.92	140,730,791.66	99.08
合计	83,523	5,788.04	39,212,145.73	8.11	444,222,382.05	91.89

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金中证 500A	628,222.53	0.1840
	中金中证 500C	15,919.99	0.0112
	合计	644,142.52	0.1332

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金中证 500A	10~50
	中金中证 500C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 500A	0~10
	中金中证 500C	0
	合计	0~10

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金已成立满三年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日(2016年7月22日)基金份额总额	10,001,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	321,015,869.00	160,944,269.05
本报告期基金总申购份额	174,924,366.83	85,045,104.32
减：本报告期基金总赎回份额	154,541,591.93	103,953,489.49
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	341,398,643.90	142,035,883.88

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

2023 年 7 月 29 日, 本基金管理人发布公告, 汤琰女士自 2023 年 7 月 28 日起不再担任公司副总经理, 自 2023 年 7 月 18 日起不再担任公司董事。

2023 年 9 月 29 日, 本基金管理人发布公告, 赵璧先生自 2023 年 9 月 28 日起不再担任公司总经理、财务负责人、董事, 董事长胡长生先生自 2023 年 9 月 28 日起代为履行公司总经理职务。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 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。本基金本报告期内应支付审计费用 75,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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。

#### 11.6.2 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
东北证券	2	2,332,466,128.55	26.95	1,705,746.64	34.98	-
华创证券	2	1,476,605,147.77	17.06	704,925.45	14.46	-
兴业证券	2	1,210,750,296.47	13.99	541,787.51	11.11	-
长江证券	2	1,018,653,678.83	11.77	337,478.96	6.92	-
开源证券	2	845,382,798.43	9.77	516,606.68	10.59	-
中信建投	2	585,473,427.68	6.76	202,513.99	4.15	-
海通证券	2	483,518,992.34	5.59	353,600.15	7.25	-
东兴证券	1	349,116,991.38	4.03	255,311.09	5.24	-
华泰证券	2	177,740,717.10	2.05	129,980.96	2.67	-
申港证券	1	175,614,805.87	2.03	128,426.81	2.63	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中邮证券	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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
东北证券	11,589,575.48	23.45	307,900,000.00	33.15	-	-
华创证券	62,020.21	0.13	213,700,000.00	23.01	-	-
兴业证券	8,565,284.00	17.33	126,200,000.00	13.59	-	-
长江证券	19,068,020.00	38.58	96,900,000.00	10.43	-	-
开源证券	8,246,615.16	16.68	109,000,000.00	11.73	-	-
中信建投	300,465.00	0.61	15,800,000.00	1.70	-	-
海通证券	-	-	35,800,000.00	3.85	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,597,488.00	3.23	23,600,000.00	2.54	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
2	中金基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
3	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
4	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2023-02-11
5	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-01
6	中金基金管理有限公司关于不法分子假冒“中金基金”名义、虚构“中金基金静态战略投资项目”进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2023-03-09
7	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
8	中金基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
9	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
10	中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-04-21
11	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-21
12	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-25
13	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2023-05-10
14	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资	中国证监会规定媒介	2023-05-26



	关联方承销期内承销证券的公告		
15	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2023-06-03
16	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2023-06-10
17	中金基金管理有限公司关于注销厦门分公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-07-01
18	中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-07-21
19	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-07-21
20	中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2023-07-29
21	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书（2023 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2023-08-02
22	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（2023 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2023-08-02
23	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	2023-08-02
24	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	2023-08-10
25	中金基金管理有限公司关于公司股东运用自有资金投资公司旗下权益类公募基金的公告	中国证监会规定媒介	2023-08-24
26	中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-08-31
27	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会规定媒介	2023-08-31
28	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	2023-09-07
29	中金基金管理有限公司高级管理人员变更及代为履行职务的公告	中国证监会规定媒介	2023-09-29
30	中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-10-25
31	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-10-25
32	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	2023-11-07
33	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	2023-12-15
34	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	2023-12-20

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 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。

### 13.3 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

2024 年 3 月 29 日