

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
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	52
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	52

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	53
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 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	495,293,657.47 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	353,539,508.20 份	141,754,149.27 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	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	中金中证 500A	中金中证 500C
本期已实现收益	-19,432,868.33	-9,215,329.60
本期利润	-26,225,130.84	-10,929,689.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0750	-0.0771
本期加权平均净值利润率	-4.99%	-5.22%
本期基金份额净值增长率	-4.89%	-5.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	160,246,969.45	60,905,167.45
期末可供分配基金份额利润	0.4533	0.4297
期末基金资产净值	513,786,477.65	202,659,316.72
期末基金份额净值	1.4533	1.4297
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	45.33%	32.42%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金中证 500A

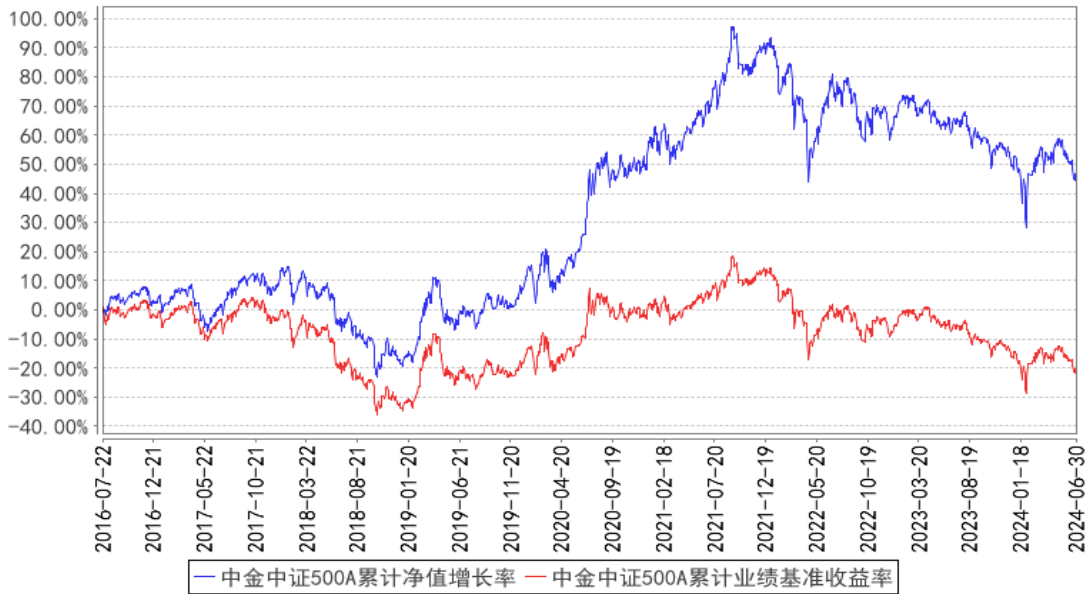
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.11%	0.92%	-6.55%	0.91%	1.44%	0.01%
过去三个月	-3.76%	1.02%	-6.16%	1.09%	2.40%	-0.07%
过去六个月	-4.89%	1.47%	-8.46%	1.53%	3.57%	-0.06%
过去一年	-11.63%	1.16%	-16.71%	1.21%	5.08%	-0.05%
过去三年	-15.25%	1.10%	-26.01%	1.14%	10.76%	-0.04%
自基金合同生效起至今	45.33%	1.18%	-21.55%	1.22%	66.88%	-0.04%

中金中证 500C

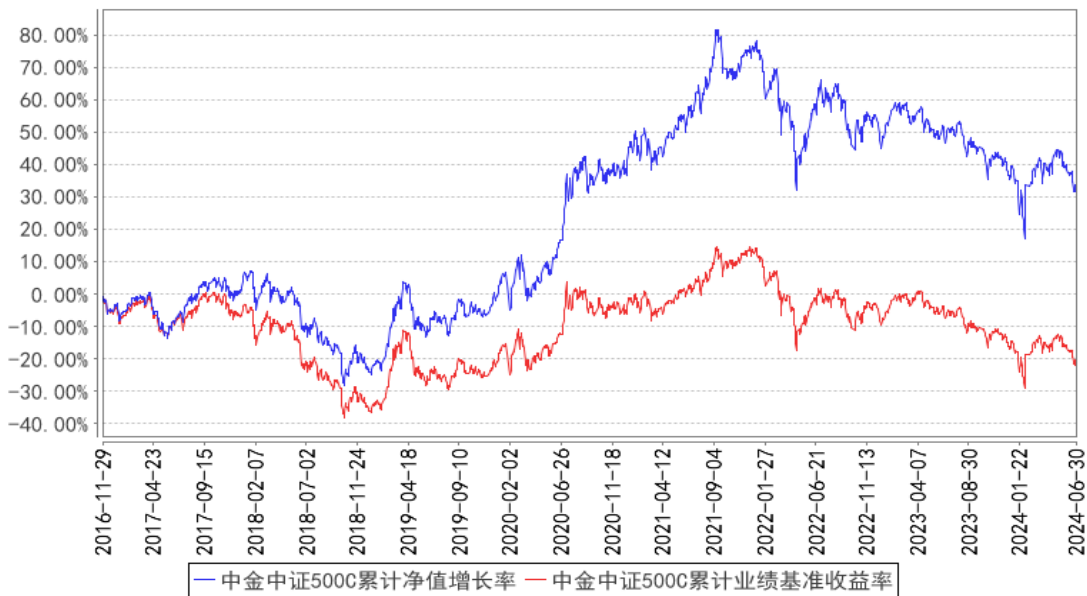
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.14%	0.91%	-6.55%	0.91%	1.41%	0.00%
过去三个月	-3.86%	1.02%	-6.16%	1.09%	2.30%	-0.07%
过去六个月	-5.08%	1.47%	-8.46%	1.53%	3.38%	-0.06%
过去一年	-11.98%	1.16%	-16.71%	1.21%	4.73%	-0.05%
过去三年	-16.27%	1.10%	-26.01%	1.14%	9.74%	-0.04%
自基金合同生效起至今	32.42%	1.20%	-21.55%	1.23%	53.97%	-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



§ 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 6 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 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 51 只公募基金，证券投资基金管理规模 1631.27 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	-	13 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	-	8 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 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，本组合严格遵守基金合同的约定，基于深入的研究和完备的风控流程进行组合管理，在严格控制组合偏离度的基础上，紧密跟踪标的指数，利用量化选股策略精选个股，在控制组合跟踪误差的同时增强基金阿尔法收益。未来将继续努力开发和改进选股策略，在遵守合同和法律法规的前提下管理组合，争取在超额收益方面有更好的表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证 500A 基金份额净值为 1.4533 元，本报告期基金份额净值增长率为 -4.89%，同期业绩基准收益率为 -8.46%；中金中证 500C 基金份额净值为 1.4297 元，本报告期基金份额净值增长率为 -5.08%，同期业绩基准收益率为 -8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年上半年，中国经济稳步前行，稳增长政策不断推出，新旧动能持续转化。尽管国内有效需求尚有较大释放空间，地产等行业仍存一定整固压力，但上半年国内 GDP 依然实现 5% 增长，为完成全年预期增长目标打下坚实基础。海外通胀形势似展现出较强惰性，美联储政策方向虽分歧不大，但路径依然有不确定性，投资者对全球流动性表达出更多担忧。

在此背景下，国内股票市场呈现“整体震荡，结构分化”格局，大盘战胜小盘，价值跑赢成长。高股息、科技创新、企业出海等主题在不同阶段引领市场行情，资本市场新“国九条”发布，强监管、防风险、促高质量发展成为备受关注的政策重点。主要规模指数表现分化，上证 50 上涨 2.95% 沪深 300 上涨 0.89% 中证 500 下跌 8.96% 中证 1000 下跌 16.84% 中证 2000 下跌 23.28% 创业板指下跌 10.99%，科创 50 下跌 16.42%。行业方面，银行、煤炭、石油石化、家电、电力及公用事业表现较好，综合、消费者服务、计算机、商贸零售、传媒表现落后。

展望未来，我们认为：短期看，伴随逆周期政策效果逐步显现，经济增长内生动能有望不断增强，市场有机会重新定价经济增长预期差；全球通胀缓解趋势或在下半年逐步明朗化，全球主要央行加息周期已基本结束，流动性环境仍有望对国内权益市场形成支撑。中长期看，全面深化改革将为中国经济高质量发展注入强劲动能，改革红利将对资本市场的中长期发展产生积极影

响。我们对未来权益市场表现不悲观，在账户管理中仍将坚持系统化投资理念，以科学理性决策应对市场各类不确定性。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	4,738,640.76	3,646,132.59
结算备付金		3,340,297.73	2,613,049.08
存出保证金		71,504.92	62,129.85
交易性金融资产	6.4.7.2	709,006,306.61	730,153,652.48
其中：股票投资		670,652,437.71	690,156,739.16
基金投资		-	-
债券投资		38,353,868.90	39,996,913.32
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		40,855.75	162,073.00
应收股利		-	-
应收申购款		894,119.07	1,052,766.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		718,091,724.84	737,689,803.91
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		396,770.06	881,849.86
应付管理人报酬		303,609.72	311,264.46
应付托管费		91,082.91	93,379.35
应付销售服务费		68,177.09	73,820.97
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	786,290.69	712,887.56
负债合计		1,645,930.47	2,073,202.20
净 资 产:			
实收基金	6.4.7.10	495,293,657.47	483,434,527.78
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	221,152,136.90	252,182,073.93
净资产合计		716,445,794.37	735,616,601.71
负债和净资产总计		718,091,724.84	737,689,803.91

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，中金中证 500A 的基金份额净值为 1.4533 元，期末份额总额为 353,539,508.20 份；中金中证 500C 的基金份额净值为 1.4297 元，期末份额总额为 141,754,149.27 份。基金份额总额 495,293,657.47 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-34,191,100.71	15,859,552.85
1. 利息收入		26,442.69	47,241.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	26,442.69	47,241.51
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）		-25,798,943.53	5,005,281.85

其中：股票投资收益	6.4.7.14	-36,747,213.84	-5,059,263.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	355,774.79	433,602.08
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	10,592,495.52	9,630,943.29
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	-8,506,622.26	10,757,609.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	88,022.39	49,420.17
减：二、营业总支出		2,963,719.48	3,353,745.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,827,618.24	2,018,949.16
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	548,285.46	605,684.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	417,638.08	496,356.35
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		22,155.21	68,752.21
其中：卖出回购金融资产支出		22,155.21	68,752.21
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.15
8. 其他费用	6.4.7.23	148,022.49	164,003.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-37,154,820.19	12,505,806.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-37,154,820.19	12,505,806.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-37,154,820.19	12,505,806.99

6.3 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	483,434,527.78	-	252,182,073.93	735,616,601.71

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	483,434,527.78	-	252,182,073.93	735,616,601.71
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	11,859,129.69	-	-31,029,937.03	-19,170,807.34
(一)、综合收益总额	-	-	-37,154,820.19	-37,154,820.19
(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)	11,859,129.69	-	6,124,883.16	17,984,012.85
其中：1. 基金申购款	133,569,927.47	-	64,312,498.36	197,882,425.83
2. 基金赎回款	-121,710,797.78	-	-58,187,615.20	-179,898,412.98
(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	495,293,657.47	-	221,152,136.90	716,445,794.37
项目	上年度可比期间			
	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	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)	-2,132,965.64	-	10,811,053.54	8,678,087.90
(一)、综合收益总额	-	-	12,505,806.99	12,505,806.99
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-2,132,965.64	-	-1,694,753.45	-3,827,719.09
其中：1. 基金申购款	162,667,018.87	-	110,574,969.50	273,241,988.37

2. 基金赎回款	-164,799,984.51	-	-112,269,722.95	-277,069,707.46
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(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	479,827,172.41	-	306,269,248.19	786,096,420.60

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>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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2016 年 7 月 5 日证监许可[2016]1517 号《关于准予中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资份额发售公告》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。

6.4.2 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。

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及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	4,738,640.76
等于：本金	4,738,049.48
加：应计利息	591.28
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,738,640.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	705,938,695.83	-	670,652,437.71	-35,286,258.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	417,518.90	38,353,868.90	43,094.68
	银行间市场	-	-	-
	合计	417,518.90	38,353,868.90	43,094.68
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	743,831,951.15	417,518.90	709,006,306.61	-35,243,163.44
----	----------------	------------	----------------	----------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	608,698.92
其中：交易所市场	608,698.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	87,021.48
应付指数使用费	90,570.29
合计	786,290.69

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 500A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	341,398,643.90	341,398,643.90
本期申购	96,454,390.63	96,454,390.63
本期赎回（以“-”号填列）	-84,313,526.33	-84,313,526.33
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	353,539,508.20	353,539,508.20

中金中证 500C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	142,035,883.88	142,035,883.88
本期申购	37,115,536.84	37,115,536.84
本期赎回（以“-”号填列）	-37,397,271.45	-37,397,271.45
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	141,754,149.27	141,754,149.27

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中金中证 500A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	226,092,299.75	-45,813,139.06	180,279,160.69
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	226,092,299.75	-45,813,139.06	180,279,160.69
本期利润	-19,432,868.33	-6,792,262.51	-26,225,130.84
本期基金份额交易产生的变动数	6,663,550.31	-470,610.71	6,192,939.60
其中：基金申购款	57,875,093.61	-10,996,217.74	46,878,875.87
基金赎回款	-51,211,543.30	10,525,607.03	-40,685,936.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	213,322,981.73	-53,076,012.28	160,246,969.45

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	90,891,948.73	-18,989,035.49	71,902,913.24
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	90,891,948.73	-18,989,035.49	71,902,913.24
本期利润	-9,215,329.60	-1,714,359.75	-10,929,689.35
本期基金份额交易产生的变动数	393,439.01	-461,495.45	-68,056.44
其中：基金申购款	21,926,758.06	-4,493,135.57	17,433,622.49
基金赎回款	-21,533,319.05	4,031,640.12	-17,501,678.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	82,070,058.14	-21,164,890.69	60,905,167.45

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	8,249.03
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	17,734.39

其他	459.27
合计	26,442.69

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-36,747,213.84
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	-36,747,213.84

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,521,976,931.00
减：卖出股票成本总额	1,556,705,861.41
减：交易费用	2,018,283.43
买卖股票差价收入	-36,747,213.84

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	396,478.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-40,703.68
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	355,774.79

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	34,255,052.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	33,653,273.68

减：应计利息总额	642,482.74
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-40,703.68

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	10,592,495.52
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	10,592,495.52

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-8,506,622.26
股票投资	-8,566,445.94
债券投资	59,823.68
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	-8,506,622.26

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	88,018.98
基金转换费收入	3.41
合计	88,022.39

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-

指数使用费	58,483.84
划款手续费	2,463.98
其他	53.19
合计	148,022.49

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
工商银行	基金托管人
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司(以下简称“中金财富证券”)	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,827,618.24	2,018,949.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	808,390.14	844,715.17
应支付基金管理人的净管理费	1,019,228.10	1,174,233.99

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	548,285.46	605,684.68

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金财富证券	-	20,708.30	20,708.30
中金基金	-	30.18	30.18
合计	-	20,738.48	20,738.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金财富证券	-	23,239.97	23,239.97
中金基金	-	10,879.28	10,879.28

合计	-	34,119.25	34,119.25
----	---	-----------	-----------

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	1,014,198.78	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	1,014,198.78	-

报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	-

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

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 500A

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	1.96	6,939,003.92	2.03

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	4,738,640.76	8,249.03	4,678,422.92	13,988.70

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024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	688584	上海合晶	网下	8,659	196212.94
中金公司	301588	美新科技	网下	2,568	37236
中金公司	301536	星辰科技	网下	4,809	77713.44
中金公司	688530	欧莱新材	网下	3,437	32995.2
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
中金公司	688486	龙迅股份	网下	1,887	122,202.12
中金公司	688502	茂莱光学	网下	1,509	105,207.48
中金公司	001287	中电港	网下	10,661	126,652.68
中金公司	688249	晶合集成	网下	46,275	919,021.50
中金公司	301332	德尔玛	网下	11,211	166,034.91
中金公司	688593	新相微	网下	9,584	107,149.12

中金公司	688472	阿特斯	网下	26,641	295,715.10
中金公司	688334	西高院	网下	8,879	125,726.64

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024 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
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	雪祺电气于2024年6月3日每10股送3股
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-

301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	39.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	骏鼎达于2024年5月22日每10股送4股
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-

603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

688709	成都华 微	2024 年 1 月 31 日	6 个 月	新股 流通 受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
--------	----------	--------------------------	----------	----------------	-------	-------	-------	-----------	-----------	---

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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 2024 年 06 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不

超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人

管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市场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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,738,049.48	-	-	591.28	4,738,640.76
结算备付金	2,972,848.14	-	-	367,449.59	3,340,297.73
存出保证金	71,472.82	-	-	32.10	71,504.92
交易性金融资产	37,936,350.00	-	-	671,069,956.61	709,006,306.61
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	40,855.75	40,855.75
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	894,119.07	894,119.07
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	45,718,720.44	-	-	672,373,004.40	718,091,724.84
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	396,770.06	396,770.06
应付销售服务费	-	-	-	68,177.09	68,177.09
应付管理人报酬	-	-	-	303,609.72	303,609.72
应付托管费	-	-	-	91,082.91	91,082.91

应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	786,290.69	786,290.69
负债总计	-	-	-	1,645,930.47	1,645,930.47
利率敏感度缺口	45,718,720.44	-	-	-670,727,073.93	716,445,794.37
上年度末 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

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 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
市场利率下降 25 个基点	38,569.78	37,138.07
市场利率上升 25 个基点	-38,569.78	-37,138.07

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	670,652,437.71	93.61	690,156,739.16	93.82
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	670,652,437.71	93.61	690,156,739.16	93.82

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 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)

	业绩比较基准上升 5%	34,056,948.27	33,244,664.35
	业绩比较基准下降 5%	-34,056,948.27	-33,244,664.35

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	670,424,128.27	689,096,374.13
第二层次	38,375,477.46	39,996,913.32
第三层次	206,700.88	1,060,365.03
合计	709,006,306.61	730,153,652.48

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。

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	670,652,437.71	93.39
	其中：股票	670,652,437.71	93.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,353,868.90	5.34
	其中：债券	38,353,868.90	5.34
	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	8,078,938.49	1.13
8	其他各项资产	1,006,479.74	0.14
9	合计	718,091,724.84	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	1,843,470.88	0.26
B	采矿业	32,420,561.58	4.53
C	制造业	413,851,269.23	57.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,739,645.00	3.31
E	建筑业	9,380,220.28	1.31
F	批发和零售业	12,448,979.10	1.74
G	交通运输、仓储和邮政业	9,825,054.60	1.37
H	住宿和餐饮业	557,985.35	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,005,006.80	5.86
J	金融业	48,710,162.66	6.80
K	房地产业	8,183,369.70	1.14
L	租赁和商务服务业	2,659,881.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	2,324,334.64	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	5,091,147.80	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,188,963.00	0.17
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	11,335,037.13	1.58
S	综合	439,296.00	0.06
	合计	626,004,384.75	87.38

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	1,861,610.00	0.26
C	制造业	33,144,982.25	4.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	123,776.00	0.02
E	建筑业	476,776.00	0.07
F	批发和零售业	273,292.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	1,890,840.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,530,486.71	0.63
J	金融业	626,938.00	0.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	546,840.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	753,600.00	0.11
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	227,920.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	190,992.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	44,648,052.96	6.23

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	300502	新易盛	104,000	10,977,200.00	1.53
2	600066	宇通客车	373,300	9,631,140.00	1.34
3	002128	电投能源	389,241	8,212,985.10	1.15
4	601058	赛轮轮胎	572,800	8,019,200.00	1.12
5	603160	汇顶科技	109,301	7,514,443.75	1.05
6	601717	郑煤机	473,033	7,000,888.40	0.98
7	002517	恺英网络	720,400	6,879,820.00	0.96
8	000630	铜陵有色	1,838,100	6,635,541.00	0.93
9	002340	格林美	1,035,900	6,598,683.00	0.92
10	600642	申能股份	741,800	6,550,094.00	0.91
11	002465	海格通信	613,500	6,355,860.00	0.89
12	300724	捷佳伟创	117,534	6,348,011.34	0.89
13	300529	健帆生物	226,600	6,165,786.00	0.86

14	002203	海亮股份	752,600	6,005,748.00	0.84
15	600699	均胜电子	403,753	5,983,619.46	0.84
16	600299	安迪苏	595,900	5,780,230.00	0.81
17	603228	景旺电子	179,941	5,722,123.80	0.80
18	601231	环旭电子	355,600	5,707,380.00	0.80
19	002557	洽洽食品	196,800	5,547,792.00	0.77
20	600582	天地科技	772,600	5,323,214.00	0.74
21	002558	巨人网络	552,200	5,212,768.00	0.73
22	600765	中航重机	252,300	5,146,920.00	0.72
23	002563	森马服饰	885,700	5,145,917.00	0.72
24	600885	宏发股份	181,382	5,020,653.76	0.70
25	600737	中粮糖业	521,700	5,003,103.00	0.70
26	600901	江苏金租	985,720	4,977,886.00	0.69
27	300207	欣旺达	324,617	4,924,439.89	0.69
28	002532	天山铝业	605,700	4,912,227.00	0.69
29	600707	彩虹股份	713,650	4,859,956.50	0.68
30	002008	大族激光	232,300	4,831,840.00	0.67
31	000997	新大陆	344,700	4,794,777.00	0.67
32	000563	陕国投 A	1,701,700	4,679,675.00	0.65
33	300251	光线传媒	550,300	4,628,023.00	0.65
34	603379	三美股份	117,800	4,610,692.00	0.64
35	000987	越秀资本	923,900	4,582,544.00	0.64
36	600566	济川药业	144,191	4,572,296.61	0.64
37	300144	宋城演艺	553,871	4,447,584.13	0.62
38	000703	恒逸石化	622,900	4,416,361.00	0.62
39	002273	水晶光电	254,600	4,323,108.00	0.60
40	002958	青农商行	1,609,200	4,312,656.00	0.60
41	300383	光环新网	509,100	4,301,895.00	0.60
42	000830	鲁西化工	370,900	4,298,731.00	0.60
43	000738	航发控制	214,094	4,296,866.58	0.60
44	600096	云天化	220,700	4,285,994.00	0.60
45	603156	养元饮品	198,700	4,226,349.00	0.59
46	601636	旗滨集团	653,000	4,211,850.00	0.59
47	000423	东阿阿胶	66,679	4,174,105.40	0.58
48	600871	石化油服	2,395,200	4,167,648.00	0.58
49	601198	东兴证券	523,200	4,164,672.00	0.58
50	000513	丽珠集团	107,200	3,988,912.00	0.56
51	300677	英科医疗	143,700	3,852,597.00	0.54
52	000683	远兴能源	545,500	3,769,405.00	0.53
53	601168	西部矿业	194,580	3,492,711.00	0.49
54	601991	大唐发电	1,156,400	3,480,764.00	0.49
55	600170	上海建工	1,585,500	3,408,825.00	0.48
56	688819	天能股份	142,686	3,404,487.96	0.48

57	000709	河钢股份	1,752,200	3,399,268.00	0.47
58	600390	五矿资本	822,500	3,331,125.00	0.46
59	601233	桐昆股份	204,900	3,270,204.00	0.46
60	002152	广电运通	307,090	3,212,161.40	0.45
61	000400	许继电气	93,200	3,207,012.00	0.45
62	688029	南微医学	52,074	3,205,675.44	0.45
63	300054	鼎龙股份	137,100	3,109,428.00	0.43
64	002138	顺络电子	112,800	3,097,488.00	0.43
65	601608	中信重工	804,700	3,065,907.00	0.43
66	000027	深圳能源	413,900	3,021,470.00	0.42
67	000050	深天马 A	415,000	3,021,200.00	0.42
68	002078	太阳纸业	214,000	2,985,300.00	0.42
69	600739	辽宁成大	352,699	2,952,090.63	0.41
70	601990	南京证券	383,200	2,942,976.00	0.41
71	002429	兆驰股份	607,700	2,923,037.00	0.41
72	601577	长沙银行	353,600	2,892,448.00	0.40
73	300394	天孚通信	32,522	2,875,595.24	0.40
74	002506	协鑫集成	1,482,000	2,875,080.00	0.40
75	603568	伟明环保	137,900	2,837,982.00	0.40
76	688772	珠海冠宇	190,086	2,832,281.40	0.40
77	000878	云南铜业	226,701	2,824,694.46	0.39
78	000883	湖北能源	468,800	2,817,488.00	0.39
79	600521	华海药业	161,641	2,755,979.05	0.38
80	002025	航天电器	59,157	2,743,701.66	0.38
81	688234	天岳先进	57,589	2,702,075.88	0.38
82	600062	华润双鹤	136,400	2,670,712.00	0.37
83	688099	晶晨股份	44,697	2,651,426.04	0.37
84	688169	石头科技	6,718	2,637,486.80	0.37
85	600497	驰宏锌锗	488,000	2,605,920.00	0.36
86	600704	物产中大	599,500	2,601,830.00	0.36
87	300558	贝达药业	79,700	2,594,235.00	0.36
88	002064	华峰化学	349,800	2,508,066.00	0.35
89	600398	海澜之家	270,500	2,499,420.00	0.35
90	002065	东华软件	550,800	2,489,616.00	0.35
91	300017	网宿科技	312,504	2,468,781.60	0.34
92	600511	国药股份	80,100	2,466,279.00	0.34
93	000887	中鼎股份	196,500	2,405,160.00	0.34
94	600535	天士力	189,693	2,386,337.94	0.33
95	002120	韵达股份	307,800	2,382,372.00	0.33
96	600528	中铁工业	322,700	2,362,164.00	0.33
97	603816	顾家家居	73,000	2,357,170.00	0.33
98	600967	内蒙一机	326,176	2,348,467.20	0.33
99	600872	中炬高新	102,100	2,316,649.00	0.32

100	600820	隧道股份	352,900	2,304,437.00	0.32
101	600380	健康元	202,072	2,257,144.24	0.32
102	600517	国网英大	506,300	2,192,279.00	0.31
103	300390	天华新能	127,600	2,192,168.00	0.31
104	601568	北元集团	581,673	2,158,006.83	0.30
105	002195	岩山科技	857,100	2,151,321.00	0.30
106	002531	天顺风能	236,200	2,111,628.00	0.29
107	600985	淮北矿业	125,197	2,095,797.78	0.29
108	002608	江苏国信	269,000	2,084,750.00	0.29
109	600416	湘电股份	209,500	2,082,430.00	0.29
110	600862	中航高科	106,100	1,992,558.00	0.28
111	002244	滨江集团	270,800	1,966,008.00	0.27
112	601665	齐鲁银行	399,000	1,959,090.00	0.27
113	002444	巨星科技	79,300	1,958,710.00	0.27
114	000932	华菱钢铁	434,800	1,926,164.00	0.27
115	600157	永泰能源	1,629,700	1,923,046.00	0.27
116	000728	国元证券	315,000	1,908,900.00	0.27
117	603893	瑞芯微	32,000	1,893,440.00	0.26
118	603589	口子窖	48,300	1,892,877.00	0.26
119	002738	中矿资源	70,600	1,892,080.00	0.26
120	002508	老板电器	85,000	1,878,500.00	0.26
121	002266	浙富控股	668,220	1,864,333.80	0.26
122	600863	内蒙华电	394,900	1,832,336.00	0.26
123	601399	国机重装	710,200	1,832,316.00	0.26
124	601958	金钼股份	175,450	1,826,434.50	0.25
125	600038	中直股份	44,100	1,812,951.00	0.25
126	688122	西部超导	47,211	1,809,125.52	0.25
127	601966	玲珑轮胎	97,591	1,792,746.67	0.25
128	600208	新潮中宝	1,133,615	1,791,111.70	0.25
129	300146	汤臣倍健	132,100	1,789,955.00	0.25
130	689009	九号公司	48,600	1,788,966.00	0.25
131	600166	福田汽车	795,000	1,788,750.00	0.25
132	002683	广东宏大	88,500	1,781,505.00	0.25
133	000739	普洛药业	128,400	1,742,388.00	0.24
134	688180	君实生物	59,418	1,726,092.90	0.24
135	002867	周大生	130,800	1,708,248.00	0.24
136	688516	奥特维	40,030	1,673,654.30	0.23
137	601228	广州港	541,200	1,650,660.00	0.23
138	600022	山东钢铁	1,344,400	1,640,168.00	0.23
139	603444	吉比特	9,200	1,637,692.00	0.23
140	002653	海思科	53,300	1,636,310.00	0.23
141	300866	安克创新	22,631	1,611,553.51	0.22
142	000031	大悦城	685,000	1,602,900.00	0.22

143	003031	中瓷电子	34,320	1,586,956.80	0.22
144	600339	中油工程	505,200	1,576,224.00	0.22
145	601077	渝农商行	311,000	1,561,220.00	0.22
146	688248	南网科技	52,528	1,556,404.64	0.22
147	688778	厦钨新能	49,800	1,555,752.00	0.22
148	601000	唐山港	330,000	1,551,000.00	0.22
149	002028	思源电气	23,100	1,545,390.00	0.22
150	000825	太钢不锈	455,300	1,538,914.00	0.21
151	601666	平煤股份	134,600	1,507,520.00	0.21
152	603185	弘元绿能	87,838	1,501,151.42	0.21
153	600583	海油工程	249,100	1,472,181.00	0.21
154	688188	柏楚电子	7,886	1,455,361.30	0.20
155	600126	杭钢股份	353,200	1,451,652.00	0.20
156	300296	利亚德	318,800	1,434,600.00	0.20
157	000967	盈峰环境	338,800	1,433,124.00	0.20
158	600637	东方明珠	235,418	1,431,341.44	0.20
159	600282	南钢股份	284,400	1,416,312.00	0.20
160	600325	华发股份	214,600	1,394,900.00	0.19
161	601555	东吴证券	232,700	1,372,930.00	0.19
162	000032	深桑达 A	91,586	1,371,958.28	0.19
163	601216	君正集团	367,600	1,356,444.00	0.19
164	002056	横店东磁	108,400	1,351,748.00	0.19
165	600873	梅花生物	134,000	1,342,680.00	0.19
166	002414	高德红外	226,534	1,334,285.26	0.19
167	000729	燕京啤酒	151,100	1,334,213.00	0.19
168	603883	老百姓	71,630	1,315,126.80	0.18
169	600549	厦门钨业	76,130	1,313,242.50	0.18
170	688425	铁建重工	355,020	1,306,473.60	0.18
171	002372	伟星新材	84,300	1,299,906.00	0.18
172	600848	上海临港	141,600	1,289,976.00	0.18
173	601108	财通证券	194,180	1,283,529.80	0.18
174	600925	苏能股份	253,200	1,278,660.00	0.18
175	600529	山东药玻	49,800	1,261,932.00	0.18
176	600095	湘财股份	209,700	1,249,812.00	0.17
177	603658	安图生物	26,900	1,239,283.00	0.17
178	600498	烽火通信	77,176	1,227,098.40	0.17
179	000959	首钢股份	450,198	1,224,538.56	0.17
180	600143	金发科技	185,200	1,224,172.00	0.17
181	002153	石基信息	213,090	1,221,005.70	0.17
182	002019	亿帆医药	98,200	1,213,752.00	0.17
183	688520	神州细胞	30,838	1,213,475.30	0.17
184	002607	中公教育	777,100	1,188,963.00	0.17
185	000960	锡业股份	76,500	1,184,985.00	0.17

186	002409	雅克科技	18,700	1,176,417.00	0.16
187	600598	北大荒	93,212	1,164,217.88	0.16
188	002185	华天科技	141,900	1,156,485.00	0.16
189	601598	中国外运	205,000	1,154,150.00	0.16
190	603317	天味食品	100,672	1,148,667.52	0.16
191	603927	中科软	62,556	1,131,638.04	0.16
192	600968	海油发展	270,100	1,112,812.00	0.16
193	600315	上海家化	62,500	1,111,250.00	0.16
194	603650	彤程新材	37,600	1,111,080.00	0.16
195	002850	科达利	14,400	1,099,872.00	0.15
196	601128	常熟银行	144,698	1,095,363.86	0.15
197	300009	安科生物	128,188	1,094,725.52	0.15
198	688349	三一重能	43,710	1,085,756.40	0.15
199	000039	中集集团	116,900	1,082,494.00	0.15
200	001872	招商港口	55,000	1,058,750.00	0.15
201	301165	锐捷网络	35,000	1,044,400.00	0.15
202	002625	光启技术	59,800	1,037,530.00	0.14
203	002739	万达电影	85,800	1,037,322.00	0.14
204	300253	卫宁健康	172,500	1,017,750.00	0.14
205	600928	西安银行	305,600	999,312.00	0.14
206	601567	三星医疗	28,400	994,000.00	0.14
207	688567	孚能科技	102,531	984,297.60	0.14
208	300595	欧普康视	61,100	958,048.00	0.13
209	600755	厦门国贸	127,800	916,326.00	0.13
210	300001	特锐德	45,200	909,424.00	0.13
211	600500	中化国际	258,100	900,769.00	0.13
212	002984	森麒麟	37,300	898,557.00	0.13
213	601156	东航物流	43,700	889,295.00	0.12
214	603486	科沃斯	17,900	844,522.00	0.12
215	688002	睿创微纳	29,707	830,904.79	0.12
216	002423	中粮资本	109,900	823,151.00	0.11
217	002831	裕同科技	32,100	821,439.00	0.11
218	603606	东方电缆	16,800	820,008.00	0.11
219	001203	大中矿业	85,100	817,811.00	0.11
220	002939	长城证券	120,900	810,030.00	0.11
221	601098	中南传媒	62,700	778,734.00	0.11
222	600329	达仁堂	23,800	770,882.00	0.11
223	600867	通化东宝	91,600	766,692.00	0.11
224	600970	中材国际	59,600	718,776.00	0.10
225	600141	兴发集团	36,340	693,367.20	0.10
226	002439	启明星辰	40,100	692,126.00	0.10
227	600988	赤峰黄金	42,300	691,182.00	0.10
228	002507	涪陵榨菜	55,960	685,510.00	0.10

229	600153	建发股份	76,200	680,466.00	0.09
230	000998	隆平高科	69,100	679,253.00	0.09
231	600956	新天绿能	81,300	664,221.00	0.09
232	601828	美凯龙	250,800	639,540.00	0.09
233	000937	冀中能源	94,686	634,396.20	0.09
234	603786	科博达	9,800	628,670.00	0.09
235	600580	卧龙电驱	51,581	626,709.15	0.09
236	601965	中国汽研	37,000	624,930.00	0.09
237	300776	帝尔激光	13,560	623,217.60	0.09
238	002430	杭氧股份	27,800	618,550.00	0.09
239	601615	明阳智能	65,100	614,544.00	0.09
240	002472	双环传动	26,400	581,328.00	0.08
241	600998	九州通	118,844	579,958.72	0.08
242	600927	永安期货	52,000	579,800.00	0.08
243	688525	佰维存储	9,000	577,350.00	0.08
244	000636	风华高科	43,960	574,117.60	0.08
245	002624	完美世界	75,100	570,760.00	0.08
246	600008	首创环保	212,900	570,572.00	0.08
247	000060	中金岭南	131,950	559,468.00	0.08
248	600499	科达制造	66,300	558,909.00	0.08
249	600258	首旅酒店	45,181	557,985.35	0.08
250	002155	湖南黄金	30,700	555,670.00	0.08
251	601880	辽港股份	451,400	555,222.00	0.08
252	000921	海信家电	17,100	551,304.00	0.08
253	000818	航锦科技	24,700	545,376.00	0.08
254	603707	健友股份	44,400	527,472.00	0.07
255	688213	思特威	10,800	523,800.00	0.07
256	600655	豫园股份	101,500	522,725.00	0.07
257	002595	豪迈科技	13,600	519,112.00	0.07
258	600959	江苏有线	193,500	510,840.00	0.07
259	603517	绝味食品	32,300	497,420.00	0.07
260	003022	联泓新科	36,100	494,931.00	0.07
261	688387	信科移动	92,830	467,863.20	0.07
262	600032	浙江新能	63,900	465,192.00	0.06
263	000066	中国长城	51,300	448,875.00	0.06
264	002294	信立泰	16,500	439,395.00	0.06
265	600673	东阳光	62,400	439,296.00	0.06
266	000785	居然之家	174,300	423,549.00	0.06
267	688006	杭可科技	22,849	398,715.05	0.06
268	000933	神火股份	19,600	396,508.00	0.06
269	300070	碧水源	92,800	388,832.00	0.05
270	002436	兴森科技	32,000	330,240.00	0.05
271	688561	奇安信	13,589	320,972.18	0.04

272	603225	新凤鸣	20,500	319,595.00	0.04
273	601019	山东出版	24,900	294,318.00	0.04
274	600350	山东高速	33,200	293,820.00	0.04
275	002945	华林证券	23,900	238,522.00	0.03
276	002408	齐翔腾达	42,200	236,320.00	0.03
277	688375	国博电子	3,294	232,688.16	0.03
278	600369	西南证券	63,900	228,762.00	0.03
279	000750	国海证券	77,400	225,234.00	0.03
280	688777	中控技术	4,800	180,960.00	0.03
281	000156	华数传媒	28,400	178,352.00	0.02
282	600131	国网信通	10,500	177,135.00	0.02
283	601179	中国西电	22,000	176,880.00	0.02
284	000519	中兵红箭	11,500	168,705.00	0.02
285	600348	华阳股份	16,800	167,328.00	0.02
286	603939	益丰药房	6,529	160,286.95	0.02
287	603179	新泉股份	4,000	156,960.00	0.02
288	600563	法拉电子	2,000	152,360.00	0.02
289	600801	华新水泥	11,000	151,250.00	0.02
290	002500	山西证券	32,100	150,870.00	0.02
291	601928	凤凰传媒	13,600	149,056.00	0.02
292	600377	宁沪高速	11,800	148,680.00	0.02
293	002966	苏州银行	19,650	147,375.00	0.02
294	002690	美亚光电	8,900	146,850.00	0.02
295	003035	南网能源	32,500	143,000.00	0.02
296	601139	深圳燃气	21,400	142,952.00	0.02
297	600827	百联股份	19,300	142,434.00	0.02
298	601298	青岛港	14,760	141,105.60	0.02
299	601158	重庆水务	29,300	140,640.00	0.02
300	300861	美畅股份	7,200	139,320.00	0.02
301	600663	陆家嘴	15,700	138,474.00	0.02
302	603290	斯达半导	1,600	137,776.00	0.02
303	603305	旭升集团	12,200	128,832.00	0.02
304	000401	冀东水泥	30,700	124,642.00	0.02
305	603868	飞科电器	3,100	119,040.00	0.02
306	688153	唯捷创芯	2,912	107,744.00	0.02
307	688617	惠泰医疗	200	91,220.00	0.01
308	001286	陕西能源	4,000	46,120.00	0.01
309	688120	华海清科	173	32,797.34	0.00
310	000988	华工科技	791	23,674.63	0.00
311	688281	华秦科技	241	20,080.12	0.00
312	688276	百克生物	294	8,340.78	0.00
313	688220	翱捷科技	179	6,705.34	0.00
314	688521	芯原股份	182	4,868.50	0.00

315	688385	复旦微电	125	3,922.50	0.00
-----	--------	------	-----	----------	------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002422	科伦药业	111,426	3,379,550.58	0.47
2	002463	沪电股份	88,480	3,229,520.00	0.45
3	688208	道通科技	80,426	1,941,483.64	0.27
4	002468	申通快递	225,100	1,890,840.00	0.26
5	300638	广和通	87,800	1,501,380.00	0.21
6	603629	利通电子	79,900	1,474,954.00	0.21
7	688373	盟科药业	329,206	1,432,046.10	0.20
8	603355	莱克电气	61,800	1,334,880.00	0.19
9	600482	中国动力	60,913	1,186,585.24	0.17
10	000975	银泰黄金	66,900	1,089,801.00	0.15
11	688030	山石网科	100,584	1,051,102.80	0.15
12	300533	冰川网络	75,600	1,049,328.00	0.15
13	002387	维信诺	170,100	1,034,208.00	0.14
14	688382	益方生物	130,503	943,536.69	0.13
15	002600	领益智造	125,200	891,424.00	0.12
16	688108	赛诺医疗	94,390	843,846.60	0.12
17	300369	绿盟科技	159,200	813,512.00	0.11
18	603025	大豪科技	56,900	786,358.00	0.11
19	002602	世纪华通	228,400	783,412.00	0.11
20	601700	风范股份	177,700	780,103.00	0.11
21	300492	华图山鼎	8,000	753,600.00	0.11
22	603269	海鸥股份	66,200	650,084.00	0.09
23	002032	苏泊尔	12,400	621,240.00	0.09
24	002106	莱宝高科	55,600	606,040.00	0.08
25	000016	深康佳 A	265,800	566,154.00	0.08
26	300864	南大环境	27,900	546,840.00	0.08
27	600547	山东黄金	19,600	536,648.00	0.07
28	688018	乐鑫科技	5,400	532,872.00	0.07
29	300953	震裕科技	9,600	520,320.00	0.07
30	000581	威孚高科	31,300	509,564.00	0.07
31	601886	江河集团	97,700	476,776.00	0.07
32	300005	探路者	94,600	473,946.00	0.07
33	300679	电连技术	11,100	446,553.00	0.06
34	300307	慈星股份	74,600	443,870.00	0.06
35	601127	赛力斯	4,600	419,152.00	0.06
36	688660	电气风电	134,277	386,717.76	0.05
37	600000	浦发银行	46,300	381,049.00	0.05
38	000725	京东方 A	89,400	365,646.00	0.05
39	000922	佳电股份	30,200	360,286.00	0.05

40	300203	聚光科技	34,600	349,114.00	0.05
41	300048	合康新能	72,200	334,286.00	0.05
42	000990	诚志股份	43,700	325,128.00	0.05
43	002237	恒邦股份	25,200	290,052.00	0.04
44	002228	合兴包装	112,100	262,314.00	0.04
45	002399	海普瑞	29,200	253,164.00	0.04
46	688136	科兴制药	14,841	248,735.16	0.03
47	605369	拱东医疗	6,200	247,380.00	0.03
48	603515	欧普照明	13,800	239,292.00	0.03
49	601088	中国神华	5,300	235,161.00	0.03
50	000526	学大教育	3,700	227,920.00	0.03
51	600525	长园集团	53,300	227,058.00	0.03
52	605333	沪光股份	7,300	203,305.00	0.03
53	300879	大叶股份	14,900	199,362.00	0.03
54	688788	科思科技	8,400	195,300.00	0.03
55	603103	横店影视	13,800	190,992.00	0.03
56	003019	宸展光电	7,200	182,376.00	0.03
57	300323	华灿光电	41,300	179,655.00	0.03
58	000930	中粮科技	35,700	179,571.00	0.03
59	688578	艾力斯	2,517	160,433.58	0.02
60	301182	凯旺科技	7,100	157,478.00	0.02
61	002947	恒铭达	4,300	151,360.00	0.02
62	002730	电光科技	20,000	140,800.00	0.02
63	600916	中国黄金	14,600	140,452.00	0.02
64	300031	宝通科技	9,400	135,078.00	0.02
65	301017	漱玉平民	13,500	132,840.00	0.02
66	605255	天普股份	11,000	132,220.00	0.02
67	600893	航发动力	3,600	131,580.00	0.02
68	603983	丸美股份	4,700	129,391.00	0.02
69	000020	深华发 A	13,000	128,700.00	0.02
70	601688	华泰证券	10,300	127,617.00	0.02
71	688019	安集科技	1,000	125,800.00	0.02
72	000409	云鼎科技	15,500	125,085.00	0.02
73	601500	通用股份	23,200	123,888.00	0.02
74	000899	赣能股份	12,800	123,776.00	0.02
75	300876	蒙泰高新	7,100	121,978.00	0.02
76	000553	安道麦 A	26,700	121,218.00	0.02
77	300059	东方财富	11,200	118,272.00	0.02
78	300841	康华生物	2,300	116,472.00	0.02
79	600983	惠而浦	15,300	113,985.00	0.02
80	688072	拓荆科技	229	27,505.19	0.00
81	300418	昆仑万维	736	23,728.64	0.00
82	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00

83	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
84	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
85	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
86	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
87	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
88	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
89	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
90	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
91	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
92	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
93	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
94	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
95	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
96	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
97	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
98	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
99	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
100	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
101	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
102	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
103	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
104	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
105	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
106	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
107	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
108	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
109	688219	会通股份	303	2,354.31	0.00
110	688728	格科微	193	2,337.23	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002422	科伦药业	11,195,081.50	1.52
2	600066	宇通客车	11,155,871.00	1.52
3	002517	恺英网络	10,601,696.79	1.44
4	300724	捷佳伟创	9,430,964.00	1.28
5	300529	健帆生物	9,137,120.00	1.24
6	002558	巨人网络	9,121,648.00	1.24
7	002203	海亮股份	8,850,201.00	1.20
8	600699	均胜电子	8,799,336.00	1.20
9	002128	电投能源	8,638,803.00	1.17
10	002463	沪电股份	8,578,066.17	1.17

11	000830	鲁西化工	8,213,996.00	1.12
12	300502	新易盛	8,200,048.00	1.11
13	000975	银泰黄金	8,187,486.00	1.11
14	603160	汇顶科技	8,169,928.44	1.11
15	600566	济川药业	7,860,752.00	1.07
16	601717	郑煤机	7,769,725.00	1.06
17	600528	中铁工业	7,748,361.00	1.05
18	600707	彩虹股份	7,367,313.50	1.00
19	600885	宏发股份	7,354,546.76	1.00
20	000050	深天马 A	7,318,694.00	0.99

7.4.2 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	002422	科伦药业	11,500,953.50	1.56
2	300009	安科生物	9,518,792.12	1.29
3	600161	天坛生物	9,050,873.68	1.23
4	002653	海思科	8,785,050.00	1.19
5	300001	特锐德	8,105,424.00	1.10
6	600707	彩虹股份	8,061,476.00	1.10
7	601958	金钼股份	7,988,295.00	1.09
8	601168	西部矿业	7,865,808.10	1.07
9	600528	中铁工业	7,717,843.99	1.05
10	600998	九州通	7,676,090.00	1.04
11	300866	安克创新	7,672,773.52	1.04
12	002463	沪电股份	7,653,114.58	1.04
13	603317	天味食品	7,198,668.00	0.98
14	000975	银泰黄金	7,183,575.00	0.98
15	688208	道通科技	7,135,716.65	0.97
16	600529	山东药玻	7,068,027.00	0.96
17	002373	千方科技	6,828,562.44	0.93
18	600498	烽火通信	6,814,706.00	0.93
19	600879	航天电子	6,761,360.00	0.92
20	600535	天士力	6,746,967.52	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	1,545,768,005.90
卖出股票收入（成交）总额	1,521,976,931.00

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	38,353,868.90	5.35
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	38,353,868.90	5.35

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	019709	23 国债 16	140,000	14,218,610.96	1.98
2	019740	24 国债 09	130,000	13,044,442.19	1.82
3	019727	23 国债 24	99,000	10,080,085.07	1.41
4	019733	24 国债 02	10,000	1,010,730.68	0.14

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本期未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。

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	71,504.92
2	应收清算款	40,855.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	894,119.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,006,479.74

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份	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	33,290	10,619.99	50,206,480.50	14.20	303,333,027.70	85.80
中金中证 500C	43,426	3,264.27	66,177.07	0.05	141,687,972.20	99.95
合计	76,716	6,456.20	50,272,657.57	10.15	445,020,999.90	89.85

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人 员持有本基金	中金中证 500A	643,968.43	0.1821
	中金中证 500C	15,914.69	0.0112
	合计	659,883.12	0.1332

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金已成立满三年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日 (2016 年 7 月 22 日) 基金份额总额	10,001,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	341,398,643.90	142,035,883.88
本报告期基金总申购份额	96,454,390.63	37,115,536.84
减：本报告期基金总赎回份额	84,313,526.33	37,397,271.45
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	353,539,508.20	141,754,149.27

§ 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

2024 年 1 月 20 日，本基金管理人发布公告，李金泽先生自 2024 年 1 月 19 日起担任公司董事长、法定代表人；宗喆先生自 2024 年 1 月 19 日起担任公司总经理、董事；胡长生先生自 2024 年 1 月 19 日起不再担任公司董事长、法定代表人，不再代履公司总经理职务。

2024 年 3 月 2 日，本基金管理人发布公告，宗喆先生自 2024 年 2 月 29 日起担任公司财务负责人。

(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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	2	1,262,920,307.89	41.19	436,839.42	41.19	-
中信建投	2	1,143,494,281.61	37.29	395,533.82	37.29	-
华创证券	2	349,946,552.73	11.41	121,085.11	11.42	-

长江证券	2	309,938,910.99	10.11	107,207.31	10.11	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	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服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
广发证券	1,504,685.00	3.95	58,300,000.00	26.46	-	-
中信建投	23,530,260.00	61.85	120,000,000.00	54.47	-	-
华创证券	13,010,585.00	34.20	42,000,000.00	19.06	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-1-19
2	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-1-19
3	中金基金管理有限公司董事长、高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024-1-20
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	2024-2-2
5	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	2024-3-2
6	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	2024-3-7
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	2024-3-21
8	中金基金管理有限公司关于不法分子假冒“中金基金”名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2024-3-22
9	中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-3-29
10	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	中国证监会规定媒介	2024-3-29
11	中金基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-4-20
12	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-4-20
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	2024-4-30
14	中金基金管理有限公司关于上海分公司负责人及注册地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-5-15
15	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	中国证监会规定媒介	2024-6-24

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日