

中金中证优选 300 指数证券投资基金(L0F)

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 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 期末上市基金前十名持有人	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 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	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）		
基金简称	中金中证优选 300 指数（LOF）		
场内简称	金选 300（扩位简称：金选 300LOF）		
基金主代码	501060		
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）		
基金合同生效日	2018 年 8 月 30 日		
基金管理人	中金基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	553,056,536.93 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易场所	上海证券交易所		
上市日期	2018 年 9 月 25 日		
下属分级基金的基金简称	中金中证优选 300 指数（LOF）A	中金中证优选 300 指数（LOF）B	中金中证优选 300 指数（LOF）C
下属分级基金的场内简称	金选 300A（扩位简称：金选 300A 类 LOF）	-	金选 300C（扩位简称：金选 300C 类 LOF）
下属分级基金的交易代码	501060	023711	501061
报告期末下属分级基金的份额总额	463,761,699.48 份	1,018,307.69 份	88,276,529.76 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	席晓峰	王小飞

负责人	联系电话	010-63211122	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-868-1166	021-60637228
传真		010-66159121	021-60635778
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100004	100033
法定代表人		李金泽	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 -2025 年 6 月 30 日)	2025 年 3 月 17 日（基 金合同生效日）-2025 年 6 月 30 日	报告期(2025 年 1 月 1 日 -2025 年 6 月 30 日)
	中金中证优选 300 指数 (LOF)A	中金中证优选 300 指 数(LOF)B	中金中证优选 300 指数 (LOF)C
本期已实现收益	35,809,546.26	24,335.70	9,156,449.51
本期利润	39,923,279.22	44,180.03	7,091,245.80
加权平均基金份额 本期利润	0.0972	0.1776	0.0509
本期加权平均净值 利润率	4.77%	8.46%	2.56%
本期基金份额净值 增长率	4.66%	3.26%	4.53%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
期末可供分配利润	525,897,609.86	1,154,856.77	96,576,410.93
期末可供分配基金份额利润	1.1340	1.1341	1.0940
期末基金资产净值	989,659,309.34	2,173,164.46	184,852,940.69
期末基金份额净值	2.1340	2.1341	2.0940
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
基金份额累计净值增长率	113.40%	3.26%	109.40%

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；

4、本基金自 2025 年 3 月 17 日起增加 B 类基金份额，并自该日起接受投资者对 B 类基金份额的申购和赎回。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金中证优选 300 指数 (LOF) A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.79%	0.50%	1.77%	0.49%	1.02%	0.01%
过去三个月	4.75%	0.93%	3.45%	0.93%	1.30%	0.00%
过去六个月	4.66%	0.83%	3.24%	0.83%	1.42%	0.00%
过去一年	16.26%	1.11%	12.44%	1.12%	3.82%	-0.01%
过去三年	20.89%	0.92%	9.59%	0.93%	11.30%	-0.01%
自基金合同生效起至今	113.40%	1.06%	39.88%	1.07%	73.52%	-0.01%

中金中证优选 300 指数 (LOF) B

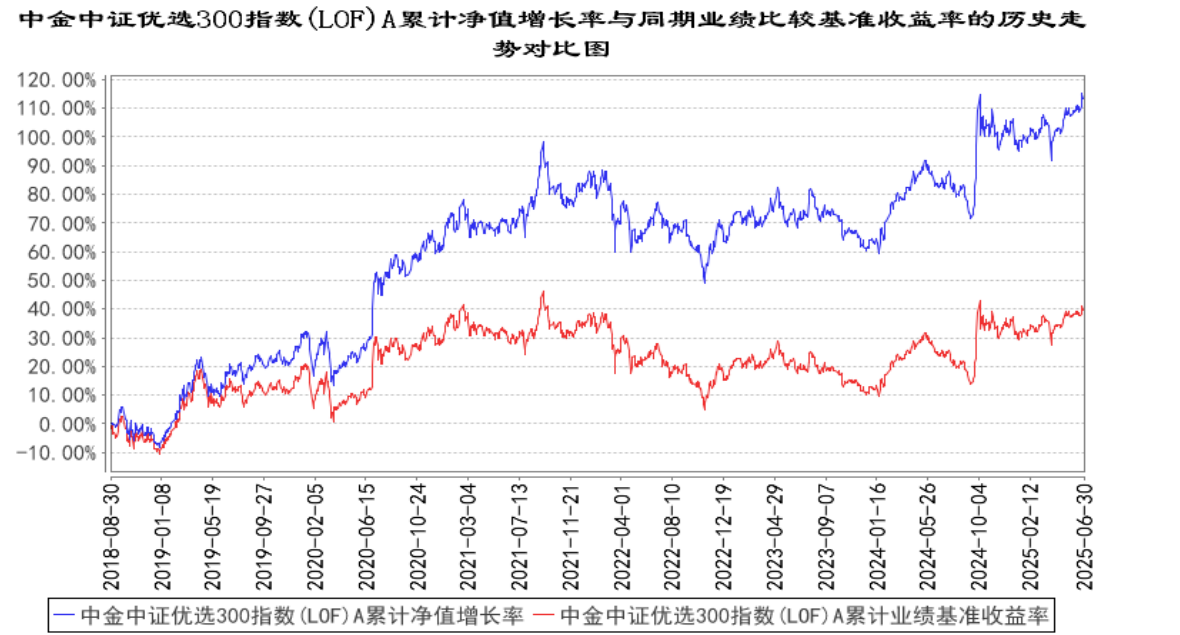
阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	2.79%	0.50%	1.77%	0.49%	1.02%	0.01%
过去三个月	4.75%	0.93%	3.45%	0.93%	1.30%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.26%	0.88%	2.01%	0.88%	1.25%	0.00%

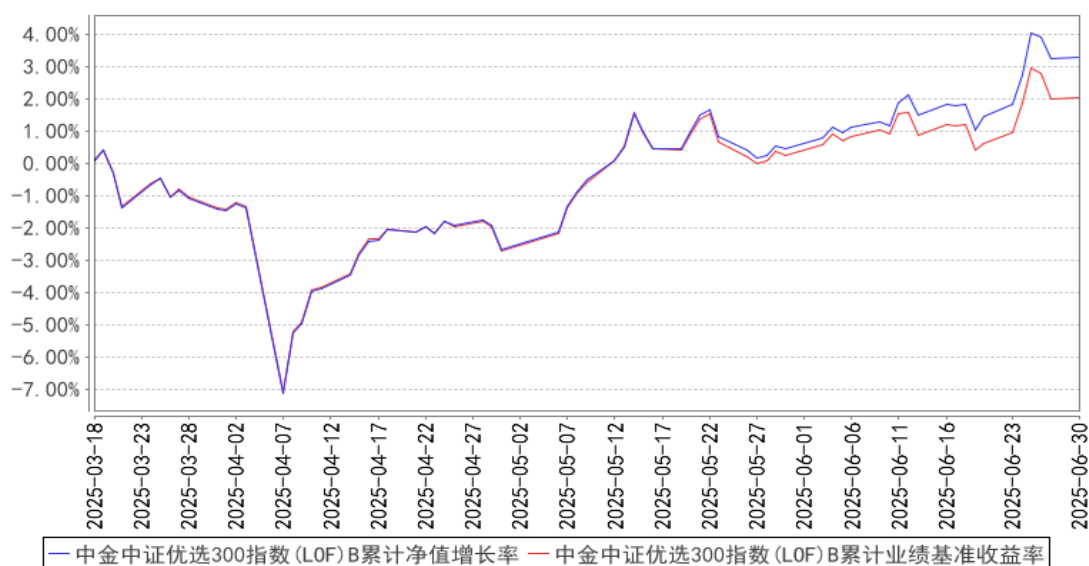
中金中证优选 300 指数（LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.77%	0.50%	1.77%	0.49%	1.00%	0.01%
过去三个月	4.68%	0.93%	3.45%	0.93%	1.23%	0.00%
过去六个月	4.53%	0.83%	3.24%	0.83%	1.29%	0.00%
过去一年	15.96%	1.11%	12.44%	1.12%	3.52%	-0.01%
过去三年	19.98%	0.92%	9.59%	0.93%	10.39%	-0.01%
自基金合同生效起至今	109.40%	1.06%	39.88%	1.07%	69.52%	-0.01%

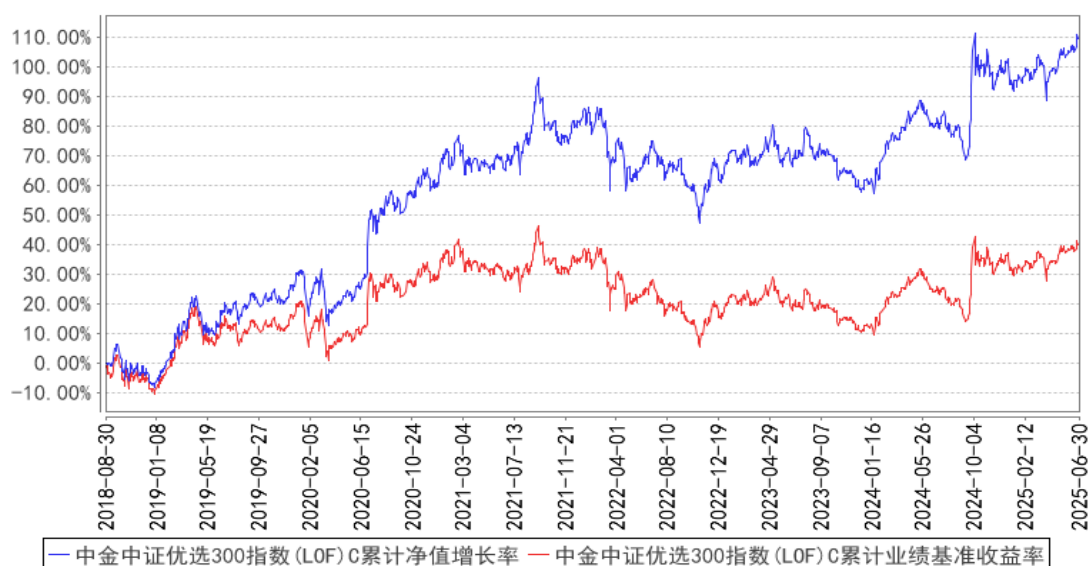
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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



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



注：本基金于 2025 年 3 月 17 日增设中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）B 类份额。

§ 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 7 亿元人民币。母公司中金公司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 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 60 只公募基金，证券投资基金管理规模 2,201.82 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	—	14 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。
张传捷	本基金基金经理助理	2023 年 10 月 26 日	—	8.9 年	张传捷先生，经济学硕士。历任中证指数有限公司研究员；嘉实基金管理有限公司指数投资部研究员；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作出决定确定的任免日期填写；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

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遵规守信情况的说明

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》和其他有关法律法规及本基金合同的约定，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，在严格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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证优选 300 指数（LOF）A 基金份额净值为 2.1340 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.66%，同期业绩基准收益率为 3.24%；中金中证优选 300 指数（LOF）B 基金份额净值为 2.1341 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.26%，同期业绩基准收益率为 2.01%；中金中证优选 300 指数（LOF）C 基金份额净值为 2.0940 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.53%，同期业绩基准收益率为 3.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年，中国经济运行稳中有进，生产稳定增长，需求继续恢复，新动能成长壮大。虽然二季度以来，美国关税政策推出对全球金融市场造成扰动，也对中国经济外部需求造成冲击，但国内经济支持政策对内需继续改善起到了有效的支撑和提振作用，经济增速延续了一季度以来的复苏态势。上半年，GDP 同比增长 5.3%，CPI 同比下降 0.1%，M2 同比增长 8.3%。

经济平稳增长，结构亮点增多，流动性合理充裕，资本市场风险偏好持续改善。在此背景下，A 股市场上半年始终不乏投资主线，体现出了不错的赚钱效应。虽然二季度初在外部冲击下出现快速调整，但市场迅速企稳，逐步反弹，截至年中，主要宽基均基本收复回撤。沪深 300、中证 500、中证 1000 和中证 A500 等代表性规模宽基指数，上半年分别上涨 0.03%、3.31%、6.69% 和 0.47%。风格上，价值相对成长占优，小盘相对表现突出。行业方面，综合金融、有色金属、银行等涨幅较多，食品饮料、房地产、煤炭等相对落后。

展望未来，全球贸易环境不确定性上升已逐渐成为基准假设，预计国内仍将保持战略定力，延续“坚定不移办好自己的事，坚定不移扩大高水平对外开放”的政策基调，宏观经济有望在政策

发力见效的支持下延续平稳增长，经济结构调整深化则将为市场提供较多的投资机遇。上市公司盈利能力有机会延续上半年的改善势头，从而支撑中国资产的内在价值持续提升。当前市场风险溢价处于中性水平，预计未来市场将更多定价基本面的边际变化。

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，本基金本报告期末未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	14,717,519.18	25,155,300.54
结算备付金		5,572,471.22	6,045,726.07
存出保证金		186,509.50	294,750.94
交易性金融资产	6.4.7.2	1,180,810,107.95	1,229,146,211.62
其中：股票投资		1,117,830,353.01	1,164,447,089.07
基金投资		-	-
债券投资		62,979,754.94	64,699,122.55
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		-	7,803,101.86
应收股利		-	-
应收申购款		4,184,018.67	49,338,281.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,205,470,626.52	1,317,783,372.77
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		18,400,000.00	56,997,991.20
应付清算款		1,313,443.87	4,538,993.15
应付赎回款		8,056,136.35	25,377,900.14
应付管理人报酬		472,478.11	463,830.88
应付托管费		141,743.41	139,149.30
应付销售服务费		38,060.32	69,312.52
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	363,349.97	605,036.74
负债合计		28,785,212.03	88,192,213.93
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	553,056,536.93	606,468,445.91
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	623,628,877.56	623,122,712.93
净资产合计		1,176,685,414.49	1,229,591,158.84
负债和净资产总计		1,205,470,626.52	1,317,783,372.77

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，中金中证优选 300 指数（LOF）A 的基金份额净值为 2.1340 元，期末份额总额为 463,761,699.48 份；中金中证优选 300 指数（LOF）B 的基金份额净值为 2.1341 元，期末份额总额为 1,018,307.69 份；中金中证优选 300 指数（LOF）C 的基金份额净值为 2.0940 元，期末份额总额为 88,276,529.76 份。基金份额总额 553,056,536.93 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		51,276,357.87	45,470,818.11
1. 利息收入		60,628.25	36,228.90
其中：存款利息收入	6.4.7.13	60,628.25	36,228.90
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）		49,114,008.69	33,187,736.19
其中：股票投资收益	6.4.7.14	28,488,845.66	21,555,854.44
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	371,784.42	262,981.96
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	20,253,378.61	11,368,899.79
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	2,068,373.58	12,190,339.31
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	33,347.35	56,513.71
减：二、营业总支出		4,217,652.82	2,118,211.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,768,171.82	1,300,264.94
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	830,451.48	390,079.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	347,403.55	131,107.82
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		128,632.30	114,534.92
其中：卖出回购金融资产支出		128,632.30	114,534.92
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	142,993.67	182,224.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		47,058,705.05	43,352,606.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		47,058,705.05	43,352,606.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		47,058,705.05	43,352,606.73

6.3 净资产变动表

会计主体：中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	606,468,445.91	-	623,122,712.93	1,229,591,158.84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	606,468,445.91	-	623,122,712.93	1,229,591,158.84
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-53,411,908.98	-	506,164.63	-52,905,744.35
(一)、综合收益总额	-	-	47,058,705.05	47,058,705.05
(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)	-53,411,908.98	-	-46,552,540.42	-99,964,449.40
其中: 1. 基金申购款	291,205,614.74	-	299,844,437.68	591,050,052.42
2. 基金赎回款	-344,617,523.72	-	-346,396,978.10	-691,014,501.82
(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	553,056,536.93	-	623,628,877.56	1,176,685,414.49
项目	上年度可比期间 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	145,815,183.79	-	93,068,416.53	238,883,600.32
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	145,815,183.79	-	93,068,416.53	238,883,600.32
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	304,743,316.49	-	279,156,961.93	583,900,278.42
(一)、综合收益总额	-	-	43,352,606.73	43,352,606.73
(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)	304,743,316.49	-	235,804,355.20	540,547,671.69

其中：1. 基金申购款	447,392,438.03	-	351,132,707.05	798,525,145.08
2. 基金赎回款	-142,649,121.54	-	-115,328,351.85	-257,977,473.39
（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	450,558,500.28	-	372,225,378.46	822,783,878.74

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

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

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国中金财富证券有限公司(以下简称“中金财富证券”，原“中国中投证券有限责任公司”)、中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)、中国银河证券股份有限公司及招商证券股份有限公司等共同销售，募集期为 2018 年 7 月 23 日起至 2018 年 8 月 23 日。经向中国证监会备案，《中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2018 年 8 月 30 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 274,597,597.22 份(含于 2018 年 9 月 21 日银行结息转份额 63,842.40 份)，发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报

告。

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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的要求,真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 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》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延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》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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对证券投资基金从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。

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。

(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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	14,717,519.18
等于：本金	14,716,296.79
加：应计利息	1,222.39
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	14,717,519.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,068,678,369.04	-	1,117,830,353.01	49,151,983.97
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	62,546,005.34	571,384.94	62,979,754.94	-137,635.34
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	62,546,005.34	571,384.94	62,979,754.94	-137,635.34
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,131,224,374.38	571,384.94	1,180,810,107.95	49,014,348.63

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	639.89
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	218,234.28
其中：交易所市场	218,234.28
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,739.85
应付指数使用费	51,068.82
其他	1,667.13
合计	363,349.97

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证优选 300 指数（LOF）A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	412,765,276.20	412,765,276.20
本期申购	201,246,547.42	201,246,547.42

本期赎回 (以“-”号填列)	-150,250,124.14	-150,250,124.14
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	463,761,699.48	463,761,699.48

中金中证优选 300 指数 (LOF) B

项目	本期 2025 年 3 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	1,081,749.10	1,081,749.10
本期赎回 (以“-”号填列)	-63,441.41	-63,441.41
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	1,018,307.69	1,018,307.69

中金中证优选 300 指数 (LOF) C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	193,703,169.71	193,703,169.71
本期申购	88,877,318.22	88,877,318.22
本期赎回 (以“-”号填列)	-194,303,958.17	-194,303,958.17
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	88,276,529.76	88,276,529.76

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中金中证优选 300 指数 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	436,411,963.11	-7,610,161.44	428,801,801.67
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	436,411,963.11	-7,610,161.44	428,801,801.67
本期利润	35,809,546.26	4,113,732.96	39,923,279.22
本期基金份额交易产生的变动数	58,500,957.64	-1,328,428.67	57,172,528.97
其中：基金申购款	220,635,158.00	-8,972,237.03	211,662,920.97
基金赎回款	-162,134,200.36	7,643,808.36	-154,490,392.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	530,722,467.01	-4,824,857.15	525,897,609.86

中金中证优选 300 指数 (LOF) B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	24,335.70	19,844.33	44,180.03
本期基金份额交易产生的变动数	1,141,114.73	-30,437.99	1,110,676.74
其中：基金申购款	1,212,323.57	-31,436.72	1,180,886.85
基金赎回款	-71,208.84	998.73	-70,210.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,165,450.43	-10,593.66	1,154,856.77

中金中证优选 300 指数 (LOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	197,956,127.39	-3,635,216.13	194,320,911.26
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	197,956,127.39	-3,635,216.13	194,320,911.26
本期利润	9,156,449.51	-2,065,203.71	7,091,245.80
本期基金份额交易产生的变动数	-109,572,091.18	4,736,345.05	-104,835,746.13
其中：基金申购款	92,306,838.50	-5,306,208.64	87,000,629.86
基金赎回款	-201,878,929.68	10,042,553.69	-191,836,375.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	97,540,485.72	-964,074.79	96,576,410.93

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	32,564.15
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	4,682.40
其他	23,381.70
合计	60,628.25

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	28,488,845.66
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	28,488,845.66

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	776,966,277.06
减：卖出股票成本总额	747,705,365.59
减：交易费用	772,065.81
买卖股票差价收入	28,488,845.66

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	453,198.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-81,413.85
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	371,784.42

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	37,309,500.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	36,775,690.85

减：应计利息总额	615,223.02
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	-81,413.85

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	20,253,378.61
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	20,253,378.61

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,068,373.58
股票投资	2,187,687.73
债券投资	-119,314.15
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	2,068,373.58

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	32,875.44
基金转换费收入	28.53
其他	443.38
合计	33,347.35

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

指数使用费	51,068.82
划款手续费	185.00
合计	142,993.67

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人及基金销售机构
建设银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中金财富证券	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中金公司	434,761,776.11	29.47	964,691,247.24	80.66

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
中金公司	36,457,162.00	76.19	34,254,721.00	73.41

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
中金公司	949,300,000.00	55.20	847,650,000.00	64.68

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	85,174.48	29.47	15,128.04	6.93
关联方名称	上年度可比期间			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	333,679.98	65.92	250,116.23	59.18

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《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。该类佣金协议已根据此规定完成了更新。

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
----	----	---------

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,768,171.82	1,300,264.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,060,009.97	497,057.08
应支付基金管理人的净管理费	1,708,161.85	803,207.86

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	830,451.48	390,079.46

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中金中证优选 300 指数 (LOF) A	中金中证优选 300 指数 (LOF) B	中金中证优选 300 指数 (LOF) C	合计
中金财富证券	-	-	59,179.05	59,179.05
中金公司	-	-	1,503.13	1,503.13
中金基金	-	-	10.22	10.22
合计	-	-	60,692.40	60,692.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	中金中证优选 300 指数 (LOF) A	中金中证优选 300 指数 (LOF) B	中金中证优选 300 指数 (LOF) C	合计
中金财富证券	-	-	17,197.16	17,197.16

中金公司	-	-	991.48	991.48
中金基金	-	-	16,667.32	16,667.32
合计	-	-	34,855.96	34,855.96

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

2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.25% 的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

$$C \text{ 类基金份额每日应计提的销售服务费} = C \text{ 类基金份额前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中金中证优选 300 指数 (LOF) A

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	936,540.00	0.20	679,391.00	0.16

份额单位：份

中金中证优选 300 指数 (LOF) C

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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	522,487.00	0.59	675,752.00	0.35

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	14,717,519.18	32,564.15	15,554,073.39	21,282.83

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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	3,818	86,515.88
中金公司	301588	美新科技	网下	2,568	37,236.00
中金公司	301536	星辰科技	网下	4,809	77,713.44
中金公司	688530	欧莱新材	网下	3,437	32,995.20

注：本基金本报告期在承销期内未参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金为完全按照有关指数构成比例进行证券投资的基金，本报告期内依法合规投资基金托管人建设银行发行的股票。于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有建设银行的 A 股 0 股，占本基金资产净值的比例为 0%。（2024 年 6 月 30 日，本基金持有建设银行的 A 股 649,500 股，占本基金资产净值的比例为 0.58%。）

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末实施利润分配。

6.4.12 期末（2025 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
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-

603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	46.50	42.85	447	20,785.50	19,153.95	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	150	14,025.00	13,599.00	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-

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 2025 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 2025 年 06 月 30 日，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 18,400,000.00 元，于 2025 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

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

2025 年 6 月 30 日					
资产					
货币资金	14,716,296.79	-	-	1,222.39	14,717,519.18
结算备付金	5,571,929.52	-	-	541.70	5,572,471.22
存出保证金	186,491.30	-	-	18.20	186,509.50
交易性金融资产	62,408,370.00	-	-	1,118,401,737.95	1,180,810,107.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,184,018.67	4,184,018.67
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	82,883,087.61	-	-	1,122,587,538.91	1,205,470,626.52
负债					
卖出回购金融资产款	18,400,000.00	-	-	-	18,400,000.00
应付清算款	-	-	-	1,313,443.87	1,313,443.87
应付赎回款	-	-	-	8,056,136.35	8,056,136.35
应付销售服务费	-	-	-	38,060.32	38,060.32
应付管理人报酬	-	-	-	472,478.11	472,478.11
应付托管费	-	-	-	141,743.41	141,743.41
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	363,349.97	363,349.97
负债总计	18,400,000.00	-	-	10,385,212.03	28,785,212.03
利率敏感度缺口	64,483,087.61	-	-	1,112,202,326.88	1,176,685,414.49
上年度末 2024 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	25,152,740.08	-	-	2,560.46	25,155,300.54
结算备付金	6,042,734.84	-	-	2,991.23	6,045,726.07
存出保证金	294,605.08	-	-	145.86	294,750.94
交易性金融资产	64,048,990.00	-	-	1,165,097,221.62	1,229,146,211.62
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	7,803,101.86	7,803,101.86
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	49,338,281.74	49,338,281.74
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	95,539,070.00	-	-	1,222,244,302.77	1,317,783,372.77
负债					
卖出回购金融资产款	57,000,000.00	-	-	-2,008.80	56,997,991.20
应付清算款	-	-	-	4,538,993.15	4,538,993.15
应付赎回款	-	-	-	25,377,900.14	25,377,900.14
应付销售服务费	-	-	-	69,312.52	69,312.52
应付管理人报酬	-	-	-	463,830.88	463,830.88

应付托管费	-	-	-	139,149.30	139,149.30
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	605,036.74	605,036.74
负债总计	57,000,000.00	-	-	31,192,213.93	88,192,213.93
利率敏感度缺口	38,539,070.00	-	-	-1,191,052,088.84	1,229,591,158.84

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	59,971.03	66,397.80
	市场利率上升 25 个基点	-59,971.03	-66,397.80

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	1,117,830,353.01	95.00	1,164,447,089.07	94.70
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	1,117,830,353.01	95.00	1,164,447,089.07	94.70

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	58,245,928.02	60,864,762.36
	业绩比较基准下降 5%	-58,245,928.02	-60,864,762.36

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	1,117,684,715.01	1,164,076,046.21

第二层次	62,995,140.48	64,726,859.05
第三层次	130,252.46	343,306.36
合计	1,180,810,107.95	1,229,146,211.62

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	1,117,830,353.01	92.73
	其中：股票	1,117,830,353.01	92.73
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	62,979,754.94	5.22
	其中：债券	62,979,754.94	5.22
	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	20,289,990.40	1.68
8	其他各项资产	4,370,528.17	0.36
9	合计	1,205,470,626.52	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	546,960.00	0.05
B	采矿业	81,317,533.44	6.91
C	制造业	425,499,492.98	36.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	62,600,209.42	5.32
E	建筑业	25,744,647.00	2.19
F	批发和零售业	11,138,820.80	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	21,705,521.35	1.84
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,873,784.95	1.52
J	金融业	417,697,546.75	35.50
K	房地产业	8,194,953.00	0.70
L	租赁和商务服务业	14,400,033.00	1.22
M	科学研究和技术服务业	22,353,370.00	1.90
N	水利、环境和公共设施管理业	1,954,144.32	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	214,680.00	0.02
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	6,443,018.00	0.55
S	综合	—	—
	合计	1,117,684,715.01	94.99

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	142,715.34	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—

M	科学研究和技术服务业	2,922.66	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	145,638.00	0.01

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	601166	兴业银行	2,135,700	49,847,238.00	4.24
2	600519	贵州茅台	34,400	48,487,488.00	4.12
3	600900	长江电力	1,572,200	47,386,108.00	4.03
4	000333	美的集团	632,000	45,630,400.00	3.88
5	601899	紫金矿业	2,116,800	41,277,600.00	3.51
6	600030	中信证券	1,254,415	34,646,942.30	2.94
7	000858	五粮液	249,400	29,653,660.00	2.52
8	601211	国泰海通	1,451,920	27,818,787.20	2.36
9	601328	交通银行	3,427,900	27,423,200.00	2.33
10	000651	格力电器	575,900	25,869,428.00	2.20
11	601288	农业银行	4,101,900	24,119,172.00	2.05
12	600919	江苏银行	1,886,800	22,528,392.00	1.91
13	603259	药明康德	321,400	22,353,370.00	1.90
14	600000	浦发银行	1,508,800	20,942,144.00	1.78
15	601668	中国建筑	2,655,600	15,322,812.00	1.30
16	600016	民生银行	3,190,193	15,153,416.75	1.29
17	600031	三一重工	762,600	13,688,670.00	1.16
18	601229	上海银行	1,277,900	13,558,519.00	1.15
19	600941	中国移动	116,009	13,056,812.95	1.11
20	601169	北京银行	1,901,700	12,988,611.00	1.10
21	601857	中国石油	1,456,700	12,454,785.00	1.06
22	601919	中远海控	810,400	12,188,416.00	1.04
23	600690	海尔智家	482,100	11,946,438.00	1.02
24	600660	福耀玻璃	205,900	11,738,359.00	1.00
25	601688	华泰证券	657,400	11,708,294.00	1.00

26	601766	中国中车	1,562,380	10,999,155.20	0.93
27	601138	工业富联	510,200	10,908,076.00	0.93
28	601988	中国银行	1,839,300	10,336,866.00	0.88
29	600926	杭州银行	590,500	9,932,210.00	0.84
30	601818	光大银行	2,385,000	9,897,750.00	0.84
31	601225	陕西煤业	498,331	9,587,888.44	0.81
32	600104	上汽集团	594,800	9,546,540.00	0.81
33	002027	分众传媒	1,299,200	9,484,160.00	0.81
34	601628	中国人寿	214,100	8,818,779.00	0.75
35	601009	南京银行	755,900	8,783,558.00	0.75
36	000425	徐工机械	1,057,100	8,213,667.00	0.70
37	601658	邮储银行	1,416,800	7,749,896.00	0.66
38	603993	洛阳钼业	903,100	7,604,102.00	0.65
39	600019	宝钢股份	1,125,600	7,417,704.00	0.63
40	601825	沪农商行	744,000	7,216,800.00	0.61
41	600585	海螺水泥	308,500	6,623,495.00	0.56
42	601916	浙商银行	1,939,430	6,574,667.70	0.56
43	601838	成都银行	326,900	6,570,690.00	0.56
44	600958	东方证券	672,400	6,508,832.00	0.55
45	000538	云南白药	114,600	6,393,534.00	0.54
46	000776	广发证券	379,400	6,377,714.00	0.54
47	000166	申万宏源	1,159,000	5,818,180.00	0.49
48	601998	中信银行	681,400	5,791,900.00	0.49
49	601077	渝农商行	794,900	5,675,586.00	0.48
50	601377	兴业证券	887,300	5,492,387.00	0.47
51	600489	中金黄金	373,700	5,467,231.00	0.46
52	002966	苏州银行	574,200	5,041,476.00	0.43
53	601881	中国银河	279,300	4,789,995.00	0.41
54	600183	生益科技	156,000	4,703,400.00	0.40
55	000157	中联重科	639,000	4,619,970.00	0.39
56	600989	宝丰能源	282,600	4,561,164.00	0.39
57	601555	东吴证券	510,900	4,470,375.00	0.38
58	000408	藏格矿业	100,900	4,305,403.00	0.37
59	002736	国信证券	370,800	4,271,616.00	0.36
60	002001	新 和 成	197,500	4,200,825.00	0.36
61	600196	复星医药	163,500	4,102,215.00	0.35
62	001979	招商蛇口	466,300	4,089,451.00	0.35
63	002236	大华股份	254,400	4,039,872.00	0.34
64	600674	川投能源	250,527	4,018,453.08	0.34
65	601066	中信建投	166,900	4,013,945.00	0.34
66	601117	中国化学	470,500	3,608,735.00	0.31
67	601319	中国人保	410,600	3,576,326.00	0.30
68	600741	华域汽车	202,500	3,574,125.00	0.30

69	601168	西部矿业	214,700	3,570,461.00	0.30
70	600176	中国巨石	308,700	3,519,180.00	0.30
71	600219	南山铝业	894,300	3,425,169.00	0.29
72	600352	浙江龙盛	334,800	3,401,568.00	0.29
73	600039	四川路桥	335,400	3,320,460.00	0.28
74	000895	双汇发展	133,400	3,256,294.00	0.28
75	002709	天赐材料	172,300	3,122,076.00	0.27
76	601577	长沙银行	310,300	3,084,382.00	0.26
77	002532	天山铝业	358,400	2,978,304.00	0.25
78	000783	长江证券	425,900	2,951,487.00	0.25
79	600873	梅花生物	256,400	2,740,916.00	0.23
80	002202	金风科技	266,500	2,731,625.00	0.23
81	000728	国元证券	337,000	2,658,930.00	0.23
82	600875	东方电气	156,500	2,619,810.00	0.22
83	600061	国投资本	328,500	2,470,320.00	0.21
84	601216	君正集团	434,300	2,397,336.00	0.20
85	000932	华菱钢铁	533,000	2,345,200.00	0.20
86	600153	建发股份	223,600	2,318,732.00	0.20
87	601717	中创智领	138,500	2,301,870.00	0.20
88	000878	云南铜业	180,600	2,297,232.00	0.20
89	600025	华能水电	231,100	2,207,005.00	0.19
90	600398	海澜之家	309,300	2,152,728.00	0.18
91	600909	华安证券	361,600	2,108,128.00	0.18
92	600704	物产中大	400,000	2,108,000.00	0.18
93	000623	吉林敖东	122,900	2,083,155.00	0.18
94	002318	久立特材	87,800	2,053,642.00	0.17
95	600018	上港集团	359,400	2,052,174.00	0.17
96	000528	柳 工	207,200	1,991,192.00	0.17
97	001696	宗申动力	88,000	1,975,600.00	0.17
98	300088	长信科技	321,900	1,918,524.00	0.16
99	600901	江苏金租	296,980	1,799,698.80	0.15
100	002015	协鑫能科	124,700	1,737,071.00	0.15
101	002939	长城证券	206,800	1,732,984.00	0.15
102	603486	科沃斯	29,600	1,723,608.00	0.15
103	600132	重庆啤酒	31,000	1,708,100.00	0.15
104	603920	世运电路	55,700	1,699,407.00	0.14
105	000513	丽珠集团	46,700	1,683,068.00	0.14
106	002080	中材科技	86,200	1,680,900.00	0.14
107	603444	吉比特	5,500	1,660,725.00	0.14
108	600998	九州通	323,000	1,660,220.00	0.14
109	603816	顾家家居	63,600	1,623,072.00	0.14
110	603589	口子窖	46,100	1,604,280.00	0.14
111	002244	滨江集团	159,900	1,559,025.00	0.13

112	000708	中信特钢	130,200	1,531,152.00	0.13
113	600535	天士力	96,200	1,505,530.00	0.13
114	002056	横店东磁	104,100	1,473,015.00	0.13
115	600499	科达制造	148,100	1,451,380.00	0.12
116	000062	深圳华强	53,600	1,439,696.00	0.12
117	600483	福能股份	143,400	1,382,376.00	0.12
118	002701	奥瑞金	230,600	1,372,070.00	0.12
119	601958	金钼股份	123,900	1,355,466.00	0.12
120	600663	陆家嘴	151,400	1,341,404.00	0.11
121	600282	南钢股份	316,200	1,328,040.00	0.11
122	603833	欧派家居	23,500	1,326,575.00	0.11
123	000987	越秀资本	193,200	1,325,352.00	0.11
124	600285	羚锐制药	58,200	1,319,394.00	0.11
125	600216	浙江医药	86,800	1,283,772.00	0.11
126	600582	天地科技	212,300	1,271,677.00	0.11
127	601866	中远海发	506,600	1,251,302.00	0.11
128	603699	纽威股份	39,500	1,231,215.00	0.10
129	002430	杭氧股份	63,300	1,229,286.00	0.10
130	002698	博实股份	78,800	1,224,552.00	0.10
131	601098	中南传媒	92,600	1,214,912.00	0.10
132	600064	南京高科	156,300	1,205,073.00	0.10
133	600755	厦门国贸	195,100	1,180,355.00	0.10
134	002048	宁波华翔	62,700	1,154,307.00	0.10
135	002270	华明装备	68,900	1,153,386.00	0.10
136	300573	兴齐眼药	22,040	1,141,451.60	0.10
137	600517	国网英大	220,000	1,122,000.00	0.10
138	000902	新洋丰	80,400	1,111,932.00	0.09
139	002315	焦点科技	24,300	1,110,267.00	0.09
140	002649	博彦科技	75,400	1,095,562.00	0.09
141	601928	凤凰传媒	97,700	1,091,309.00	0.09
142	002032	苏泊尔	20,500	1,073,995.00	0.09
143	600750	江中药业	48,900	1,067,487.00	0.09
144	600210	紫江企业	155,700	1,063,431.00	0.09
145	600273	嘉化能源	124,900	1,056,654.00	0.09
146	601126	四方股份	64,500	1,049,415.00	0.09
147	601636	旗滨集团	207,000	1,037,070.00	0.09
148	002706	良信股份	115,900	1,032,669.00	0.09
149	603565	中谷物流	107,957	1,030,989.35	0.09
150	002597	金禾实业	43,600	1,026,780.00	0.09
151	600801	华新水泥	86,100	1,019,424.00	0.09
152	002539	云图控股	108,400	1,016,792.00	0.09
153	600057	厦门象屿	144,600	1,016,538.00	0.09
154	002345	潮宏基	68,500	1,002,155.00	0.09

155	300026	红日药业	269,400	994,086.00	0.08
156	600056	中国医药	96,020	992,846.80	0.08
157	002003	伟星股份	90,600	988,446.00	0.08
158	603233	大参林	58,800	958,440.00	0.08
159	600461	洪城环境	99,200	956,288.00	0.08
160	000156	华数传媒	119,700	950,418.00	0.08
161	603393	新天然气	32,800	949,560.00	0.08
162	002215	诺普信	90,500	934,865.00	0.08
163	600350	山东高速	86,900	926,354.00	0.08
164	002091	江苏国泰	126,200	917,474.00	0.08
165	000429	粤高速 A	67,200	895,776.00	0.08
166	603588	高能环境	157,000	885,480.00	0.08
167	600236	桂冠电力	141,000	884,070.00	0.08
168	600063	皖维高新	189,800	869,284.00	0.07
169	301035	润丰股份	14,500	860,430.00	0.07
170	000915	华特达因	24,100	851,935.00	0.07
171	600729	重庆百货	28,300	844,189.00	0.07
172	600106	重庆路桥	136,400	836,132.00	0.07
173	000685	中山公用	94,700	831,466.00	0.07
174	601311	骆驼股份	90,000	812,700.00	0.07
175	002626	金达威	39,100	799,986.00	0.07
176	002895	川恒股份	35,100	791,856.00	0.07
177	601369	陕鼓动力	89,200	782,284.00	0.07
178	601298	青岛港	90,000	782,100.00	0.07
179	600507	方大特钢	178,800	775,992.00	0.07
180	601208	东材科技	81,200	769,776.00	0.07
181	601019	山东出版	81,000	767,070.00	0.07
182	002690	美亚光电	45,200	762,524.00	0.06
183	600531	豫光金铅	98,300	760,842.00	0.06
184	600269	赣粤高速	149,500	756,470.00	0.06
185	002761	浙江建投	84,000	745,080.00	0.06
186	600866	星湖科技	106,400	735,224.00	0.06
187	300360	炬华科技	46,500	732,375.00	0.06
188	600502	安徽建工	155,600	731,320.00	0.06
189	601900	南方传媒	46,300	724,132.00	0.06
190	600757	长江传媒	77,900	722,912.00	0.06
191	002925	盈趣科技	40,200	722,796.00	0.06
192	600389	江山股份	38,800	721,680.00	0.06
193	688696	极米科技	6,274	717,494.64	0.06
194	000935	四川双马	39,100	712,402.00	0.06
195	002545	东方铁塔	80,000	711,200.00	0.06
196	300119	瑞普生物	36,100	701,062.00	0.06
197	000928	中钢国际	111,200	698,336.00	0.06

198	002258	利尔化学	62,100	685,584.00	0.06
199	002233	塔牌集团	92,000	680,800.00	0.06
200	002061	浙江交科	171,300	678,348.00	0.06
201	600295	鄂尔多斯	75,900	661,089.00	0.06
202	605599	菜百股份	40,300	658,905.00	0.06
203	300443	金雷股份	28,600	646,360.00	0.05
204	600710	苏美达	66,800	641,948.00	0.05
205	600846	同济科技	56,200	639,556.00	0.05
206	601869	长飞光纤	15,700	639,304.00	0.05
207	603166	福达股份	41,300	638,911.00	0.05
208	002533	金杯电工	65,500	637,970.00	0.05
209	002043	兔宝宝	64,700	634,060.00	0.05
210	603328	依顿电子	64,600	633,726.00	0.05
211	600073	光明肉业	83,800	618,444.00	0.05
212	002705	新宝股份	41,600	611,520.00	0.05
213	003006	百亚股份	22,200	607,836.00	0.05
214	300019	硅宝科技	30,600	604,044.00	0.05
215	300138	晨光生物	49,400	598,728.00	0.05
216	000823	超声电子	48,400	573,540.00	0.05
217	601619	嘉泽新能	156,500	560,270.00	0.05
218	002293	罗莱生活	64,000	559,360.00	0.05
219	300684	中石科技	23,300	556,404.00	0.05
220	000048	京基智农	34,400	546,960.00	0.05
221	601609	金田股份	76,500	536,265.00	0.05
222	002206	海利得	104,600	534,506.00	0.05
223	605305	中际联合	19,000	527,820.00	0.04
224	601801	皖新传媒	75,800	517,714.00	0.04
225	601107	四川成渝	84,100	506,282.00	0.04
226	002448	中原内配	60,200	503,874.00	0.04
227	600299	安迪苏	51,900	500,835.00	0.04
228	000672	上峰水泥	62,800	496,120.00	0.04
229	002803	吉宏股份	34,400	490,544.00	0.04
230	000719	中原传媒	39,500	490,195.00	0.04
231	002516	旷达科技	94,300	485,645.00	0.04
232	600449	宁夏建材	36,500	480,340.00	0.04
233	603855	华荣股份	21,700	480,221.00	0.04
234	600548	深高速	45,800	479,526.00	0.04
235	002034	旺能环境	28,000	470,120.00	0.04
236	600987	航民股份	66,300	468,741.00	0.04
237	603112	华翔股份	28,000	463,120.00	0.04
238	601921	浙版传媒	57,000	459,420.00	0.04
239	600479	千金药业	44,100	458,640.00	0.04
240	000404	长虹华意	63,400	450,140.00	0.04

241	300206	理邦仪器	37,100	445,942.00	0.04
242	002884	凌霄泵业	27,500	438,350.00	0.04
243	002367	康力电梯	62,100	436,563.00	0.04
244	002543	万和电气	38,400	426,624.00	0.04
245	600713	南京医药	84,300	426,558.00	0.04
246	002083	孚日股份	86,100	415,863.00	0.04
247	605168	三人行	13,600	400,248.00	0.03
248	601330	绿色动力	51,300	391,932.00	0.03
249	603998	方盛制药	39,900	391,818.00	0.03
250	002728	特一药业	46,300	389,383.00	0.03
251	301367	瑞迈特	4,600	386,860.00	0.03
252	002014	永新股份	31,600	382,992.00	0.03
253	000030	富奥股份	64,500	379,905.00	0.03
254	002632	道明光学	40,500	376,650.00	0.03
255	603277	银都股份	23,445	375,120.00	0.03
256	300664	鹏鹞环保	68,400	374,832.00	0.03
257	605183	确成股份	21,300	372,750.00	0.03
258	300400	劲拓股份	22,000	370,480.00	0.03
259	002029	七匹狼	54,600	368,004.00	0.03
260	002749	国光股份	24,100	359,572.00	0.03
261	300066	三川智慧	81,300	359,346.00	0.03
262	300703	创源股份	16,400	347,024.00	0.03
263	601158	重庆水务	74,600	346,144.00	0.03
264	600261	阳光照明	103,400	339,152.00	0.03
265	300739	明阳电路	22,300	330,932.00	0.03
266	300990	同飞股份	6,600	329,340.00	0.03
267	603889	新澳股份	55,900	324,220.00	0.03
268	600982	宁波能源	73,000	324,120.00	0.03
269	002275	桂林三金	22,600	323,406.00	0.03
270	603203	快克智能	12,900	320,823.00	0.03
271	002658	雪迪龙	40,900	320,247.00	0.03
272	001207	联科科技	13,000	319,020.00	0.03
273	603989	艾华集团	20,700	318,780.00	0.03
274	603730	岱美股份	55,360	314,998.40	0.03
275	688015	交控科技	14,800	308,432.00	0.03
276	301109	军信股份	20,289	301,900.32	0.03
277	600956	新天绿能	39,100	301,852.00	0.03
278	603109	神驰机电	10,700	298,958.00	0.03
279	600618	氯碱化工	29,200	281,196.00	0.02
280	603966	法兰泰克	30,000	278,400.00	0.02
281	601339	百隆东方	58,900	278,008.00	0.02
282	002404	嘉欣丝绸	42,500	274,975.00	0.02
283	301187	欧圣电气	9,640	266,064.00	0.02

284	001308	康冠科技	11,600	262,392.00	0.02
285	603515	欧普照明	14,500	260,855.00	0.02
286	688128	中国电研	10,600	259,700.00	0.02
287	605337	李子园	20,200	258,560.00	0.02
288	001206	依依股份	11,900	249,900.00	0.02
289	603489	八方股份	9,101	247,001.14	0.02
290	002911	佛燃能源	23,909	245,306.34	0.02
291	300788	中信出版	7,200	230,976.00	0.02
292	688196	卓越新能	4,800	230,736.00	0.02
293	603868	飞科电器	6,300	225,981.00	0.02
294	603600	永艺股份	21,200	225,568.00	0.02
295	601811	新华文轩	15,400	224,378.00	0.02
296	605098	行动教育	6,000	214,680.00	0.02
297	300154	瑞凌股份	22,700	204,300.00	0.02
298	603408	建霖家居	17,400	190,878.00	0.02
299	605099	共创草坪	5,100	171,309.00	0.01
300	603680	今创集团	14,600	166,878.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
2	603049	中策橡胶	447	19,153.95	0.00
3	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
4	603202	天有为	150	13,599.00	0.00
5	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
6	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
7	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
8	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
9	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
10	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
11	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
12	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
13	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
14	603382	海阳科技	105	2,350.95	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	000333	美的集团	51,426,367.00	4.18
2	000858	五粮液	34,162,675.16	2.78
3	601211	国泰海通	22,699,037.26	1.85

4	601166	兴业银行	22,338,874.00	1.82
5	603259	药明康德	20,585,864.00	1.67
6	600900	长江电力	16,224,393.00	1.32
7	601668	中国建筑	16,198,734.00	1.32
8	600519	贵州茅台	14,735,782.00	1.20
9	600690	海尔智家	13,039,203.00	1.06
10	601899	紫金矿业	12,770,675.00	1.04
11	601857	中国石油	12,765,335.00	1.04
12	601328	交通银行	11,287,498.00	0.92
13	601988	中国银行	11,252,359.00	0.92
14	600030	中信证券	11,153,568.00	0.91
15	600104	上汽集团	10,267,414.00	0.84
16	601138	工业富联	10,169,209.00	0.83
17	000651	格力电器	9,223,355.00	0.75
18	600019	宝钢股份	8,262,274.00	0.67
19	601288	农业银行	7,839,521.00	0.64
20	603993	洛阳钼业	7,067,179.00	0.57

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	70,349,209.00	5.72
2	601318	中国平安	57,333,100.02	4.66
3	601398	工商银行	34,630,844.00	2.82
4	600887	伊利股份	26,045,639.96	2.12
5	600519	贵州茅台	18,710,721.00	1.52
6	601088	中国神华	17,607,216.23	1.43
7	601728	中国电信	16,911,072.00	1.38
8	601988	中国银行	15,543,186.50	1.26
9	601601	中国太保	15,239,202.00	1.24
10	000001	平安银行	15,216,571.00	1.24
11	600900	长江电力	15,178,308.00	1.23
12	601166	兴业银行	14,659,980.00	1.19
13	000568	泸州老窖	12,942,121.00	1.05
14	600050	中国联通	12,396,926.00	1.01
15	601899	紫金矿业	11,901,857.00	0.97
16	000338	潍柴动力	11,646,890.00	0.95
17	002142	宁波银行	11,597,045.00	0.94
18	600030	中信证券	11,289,535.35	0.92
19	600999	招商证券	8,837,417.00	0.72
20	000651	格力电器	8,616,799.00	0.70

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	698,900,941.80
卖出股票收入（成交）总额	776,966,277.06

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	62,979,754.94	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	62,979,754.94	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	019749	24 国债 15	167,000	16,912,186.08	1.44
2	019766	25 国债 01	166,000	16,673,162.80	1.42
3	019773	25 国债 08	115,000	11,535,536.58	0.98
4	019723	23 国债 20	99,000	10,089,776.22	0.86
5	019758	24 国债 21	77,000	7,769,093.26	0.66

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司本期出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	186,509.50
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,184,018.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,370,528.17

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公	占基金资产净	流通受限情况说明
----	------	------	----------	--------	----------

			允价值	值比例（%）	
1	301458	钧崑电子	23,911.11	0.00	新股流通受限
2	603049	中策橡胶	19,153.95	0.00	新股流通受限
3	001388	信通电子	15,385.54	0.00	新股流通受限
4	603202	天有为	13,599.00	0.00	新股流通受限
5	688758	赛分科技	13,185.69	0.00	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 （户）	户均持有的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 （%）	持有份额	占总份 额比例 （%）
中金中证优 选 300 指数 （LOF）A	70,321	6,594.92	194,608,921.34	41.96	269,152,778.14	58.04
中金中证优 选 300 指数 （LOF）B	608	1,674.85	0.00	0.00	1,018,307.69	100.00
中金中证优 选 300 指数 （LOF）C	5,753	15,344.43	33,846,910.96	38.34	54,429,618.80	61.66
合计	76,682	7,212.34	228,455,832.30	41.31	324,600,704.63	58.69

8.2 期末上市基金前十名持有人

中金中证优选 300 指数（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中荷人寿保险有限公司	2,500,000.00	15.34
2	中国国际金融股份有限公司	936,540.00	5.75
3	杨凯	920,000.00	5.65
4	吴洪才	680,300.00	4.18
5	罗淑芳	499,500.00	3.07
6	张明亮	250,500.00	1.54
7	李振	245,654.00	1.51
8	纪锋	240,000.00	1.47
9	戈文俊	230,700.00	1.42

10	赵伟	200,000.00	1.23
----	----	------------	------

中金中证优选 300 指数 (LOF) C

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国国际金融股份有限公司	522,487.00	23.06
2	泰康人寿保险有限责任公司一分红—团体分红—019L—FH001 沪	456,204.00	20.13
3	泰康人寿保险有限责任公司一分红—个人分红—019L—FH002 沪	373,500.00	16.48
4	杨凯	222,500.00	9.82
5	陈蓓文	210,000.00	9.27
6	李文燕	70,081.00	3.09
7	陈小亚	69,200.00	3.05
8	张鸿鹏	53,800.00	2.37
9	陈敏	50,022.00	2.21
10	王旭	30,500.00	1.35

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金中证优选 300 指数 (LOF) A	621,387.55	0.1340
	中金中证优选 300 指数 (LOF) B	7,866.67	0.7725
	中金中证优选 300 指数 (LOF) C	14,060.35	0.0159
	合计	643,314.57	0.1163

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金中证优选 300 指数 (LOF) A	10~50
	中金中证优选 300 指数 (LOF) B	0
	中金中证优选 300 指数 (LOF) C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证优选 300 指数 (LOF) A	0~10
	中金中证优选 300 指数 (LOF) B	0
	中金中证优选 300 指数 (LOF) C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证优选 300 指数 (LOF) A	中金中证优选 300 指数 (LOF) B	中金中证优选 300 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2018 年 8 月)	196,888,672.87	—	77,708,924.35

30 日）基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	412,765,276.20	-	193,703,169.71
本报告期基金总申购份额	201,246,547.42	1,081,749.10	88,877,318.22
减：本报告期基金总赎回份额	150,250,124.14	63,441.41	194,303,958.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	463,761,699.48	1,018,307.69	88,276,529.76

§ 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	2	1,036,724,903.63	70.28	203,106.24	70.28	-
中金公司	2	434,761,776.11	29.47	85,174.48	29.47	-
东北证券	2	3,639,303.00	0.25	712.90	0.25	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好，资本充足，财务指标等符合监管要求；
- (2) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 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；
- (4) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；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) 本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》《证券综合服务协议》
- (注：被动股票型基金不通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用)。

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	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证

		比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额的 比例 (%)
国信证 券	11,391,500.00	23.81	742,300,000.00	43.16	-	-
中金公 司	36,457,162.00	76.19	949,300,000.00	55.20	-	-
东北证 券	-	-	28,100,000.00	1.63	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
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 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-1-22
2	中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2025-1-22
3	中金基金管理有限公司关于中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）增设基金份额并修改法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2025-3-17
4	中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同	中国证监会规定媒介	2025-3-17
5	中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议	中国证监会规定媒介	2025-3-17
6	中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025-3-17
7	中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025-3-17
8	中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同	中国证监会规定媒介	2025-3-19
9	中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议	中国证监会规定媒介	2025-3-19
10	关于中金基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会规定媒介	2025-3-19
11	中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2025 年第 2	中国证监会规定媒介	2025-3-21

	号)		
12	中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新（2025 年第 2 号）	中国证监会规定媒介	2025-3-21
13	中金基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-3-28
14	中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）2024 年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-3-28
15	中金基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-4-22
16	中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2025-4-22
17	中金基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-4-24

§ 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优选 300 指数证券投资基金（LOF）募集注册的文件
- 2、《中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、《中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新
- 5、中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）申请募集注册的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、报告期内中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：（86）010-63211122 400-868-1166

传真：（86）010-66159121

中金基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日