

中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资
基金
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	6
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	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
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	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 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	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54

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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金		
基金简称	中金中证 1000 指数增强发起		
基金主代码	017733		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2023 年 3 月 14 日		
基金管理人	中金基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	66,561,728.33 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 1000 指数增强发 起 A	中金中证 1000 指数增强 发起 B	中金中证 1000 指数增强发 起 C
下属分级基金的交 易代码	017733	024091	017734
报告期末下属分级 基金的份额总额	40,357,106.27 份	143,517.77 份	26,061,104.29 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，本基金通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。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 7.75%。
投资策略	本基金主要的股票投资策略为标的指数投资策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合，然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化，力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、可转债投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货、国债期货及股票期权的投资策略；7、转融通投资策略；8、融资投资策略；9、存托凭证投资策略。详见《中金中证 1000 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 1000 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，其预期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。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的业绩表现。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金

	可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰	方圆
	联系电话	010-63211122	95559
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-868-1166	95559
传真		010-66159121	021-62701216
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	中国（上海）自由贸易试验区银 城中路 188 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 B 座 43 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		100004	200336
法定代表人		李金泽	任德奇

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(2025 年 1 月 1 日 -2025 年 6 月 30 日)	2025 年 4 月 21 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 1000 指数增强发 起 A	中金中证 1000 指数增强发 起 B	中金中证 1000 指数增强发 起 C
本期已实现 收益	4,578,043.54	3,025.92	3,015,817.44
本期利润	6,260,655.43	5,471.78	3,514,763.64

加权平均基金份额本期利润	0.1338	0.1128	0.1093
本期加权平均净值利润率	13.17%	10.72%	10.84%
本期基金份额净值增长率	12.61%	7.96%	12.38%
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	2,324,001.04	8,292.24	1,248,052.88
期末可供分配基金份额利润	0.0576	0.0578	0.0479
期末基金资产净值	43,928,869.24	156,244.75	28,107,382.82
期末基金份额净值	1.0885	1.0887	1.0785
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	8.85%	7.96%	7.85%

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 4 月 21 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 1000 指数增强发起 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	5.89%	0.86%	5.20%	0.89%	0.69%	-0.03%
过去三个月	4.11%	1.71%	2.03%	1.73%	2.08%	-0.02%
过去六个月	12.61%	1.50%	6.44%	1.56%	6.17%	-0.06%
过去一年	33.25%	1.79%	28.45%	1.87%	4.80%	-0.08%
自基金合同生效起至今	8.85%	1.53%	-6.24%	1.60%	15.09%	-0.07%

中金中证 1000 指数增强发起 B

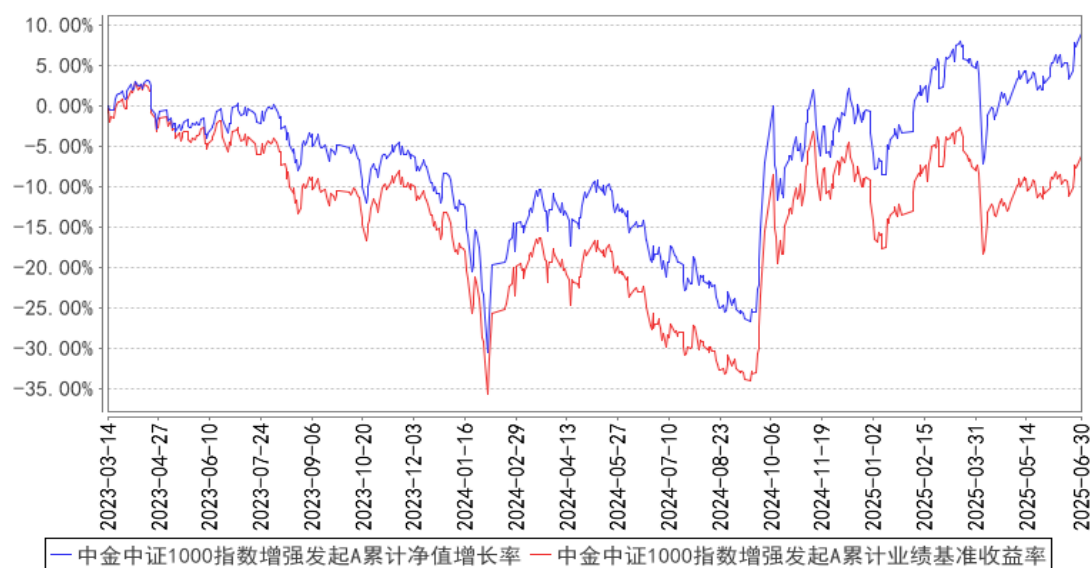
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.88%	0.86%	5.20%	0.89%	0.68%	-0.03%
自基金合同生效起至今	7.96%	0.87%	6.44%	0.93%	1.52%	-0.06%

中金中证 1000 指数增强发起 C

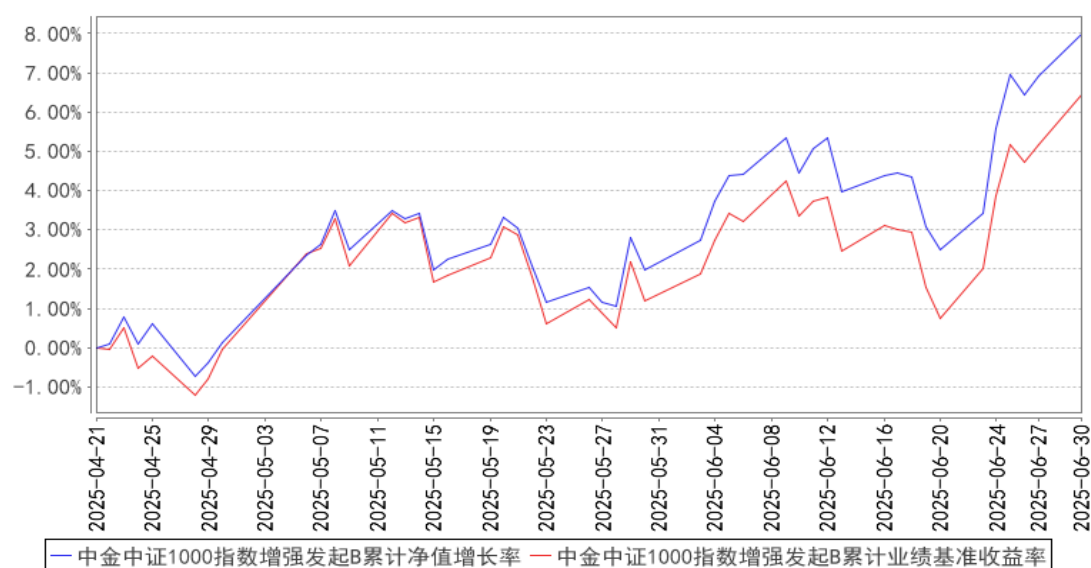
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.85%	0.86%	5.20%	0.89%	0.65%	-0.03%
过去三个月	4.00%	1.71%	2.03%	1.73%	1.97%	-0.02%
过去六个月	12.38%	1.50%	6.44%	1.56%	5.94%	-0.06%
过去一年	32.72%	1.79%	28.45%	1.87%	4.27%	-0.08%
自基金合同生效起至今	7.85%	1.53%	-6.24%	1.60%	14.09%	-0.07%

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

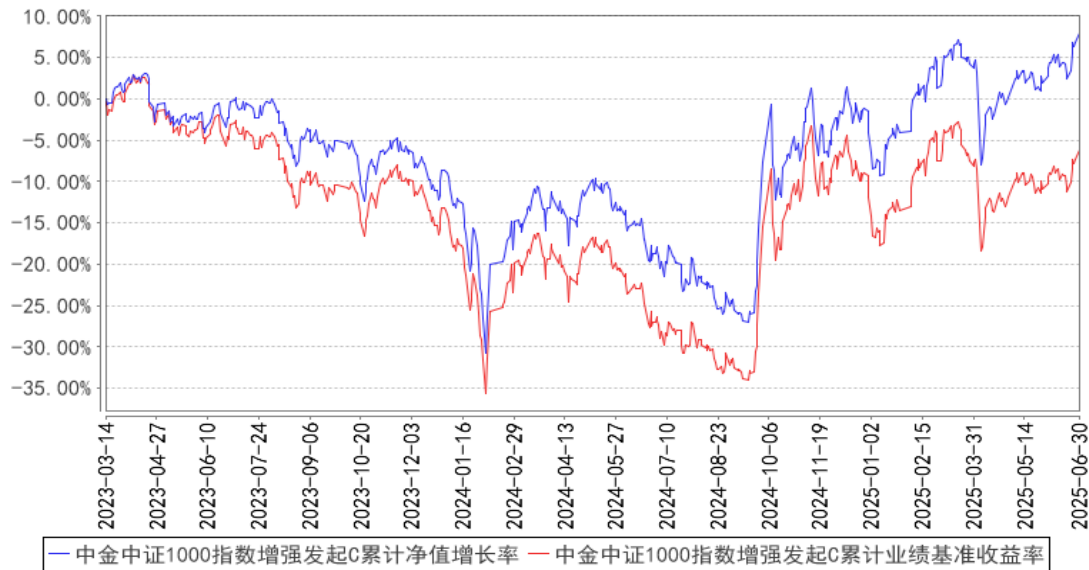
中金中证1000指数增强发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中金中证1000指数增强发起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1000指数增强发起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 4 月 21 日增设中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 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	2023 年 3 月 14 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。

王阳峰	本基金基金经理	2023 年 3 月 14 日	-	12 年	王阳峰先生，理学硕士。历任泰达宏利基金管理有限公司金融工程部投资经理；嘉实基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。
-----	---------	-----------------	---	------	--

注：1、上述任职日期、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、本基金无基金经理助理。

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

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。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证 1000 指数增强发起 A 基金份额净值为 1.0885 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.61%，同期业绩基准收益率为 6.44%；中金中证 1000 指数增强发起 B 基金份额净值为 1.0887 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.96%，同期业绩基准收益率为 6.44%；中金中证 1000 指数增强发起 C 基金份额净值为 1.0785 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.38%，同期业绩基准收益率为 6.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，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。

在组合管理过程中，我们将更加注重在不确定性中寻找相对确定性，坚持系统化投资理念，坚守投资规则和纪律，加强策略跟踪和归因，继续努力开发和改进选股策略，不断储备具备长期风险溢价的投资策略，并基于策略特点动态调整各类风险溢价的配置结构，努力为投资人获取长期稳健超额收益。

4.6 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

本基金为发起式基金，截止本报告期末，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

§ 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，基金托管人在中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，中金基金管理有限公司在中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中金基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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	5,923,706.71	7,871,489.78
结算备付金		553,897.70	569,446.51
存出保证金		754,728.00	428,817.60
交易性金融资产	6.4.7.2	61,354,877.47	79,786,094.39
其中：股票投资		61,354,877.47	79,786,094.39
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,481,790.23	447,642.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		74,069,000.11	89,103,490.93
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,751,261.65	206,299.27
应付管理人报酬		47,618.91	62,885.92
应付托管费		8,928.54	11,791.11
应付销售服务费		9,545.65	12,259.09
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,388.22	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	54,760.33	105,000.00
负债合计		1,876,503.30	398,235.39
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	66,561,728.33	92,020,993.35
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	5,630,768.48	-3,315,737.81
净资产合计		72,192,496.81	88,705,255.54
负债和净资产总计		74,069,000.11	89,103,490.93

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，中金中证 1000 指数增强发起 A 的基金份额净值为 1.0885 元，期末份额总额为 40,357,106.27 份；中金中证 1000 指数增强发起 B 的基金份额净值为 1.0887 元，期末份额总额为 143,517.77 份；中金中证 1000 指数增强发起 C 的基金份额净值为 1.0785 元，期末份额总额为 26,061,104.29 份。基金份额总额 66,561,728.33 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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		10,276,517.22	-11,217,827.86
1. 利息收入		16,287.63	13,954.10
其中：存款利息收入	6.4.7.13	16,287.63	13,954.10
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）		8,024,282.17	-8,061,469.88
其中：股票投资收益	6.4.7.14	7,094,996.06	-8,901,188.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	263.19
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	352,553.25	-40,080.76
股利收益	6.4.7.19	576,732.86	879,536.33

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	2, 184, 003. 95	-3, 172, 836. 08
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	51, 943. 47	2, 524. 00
减：二、营业总支出		495, 626. 37	579, 900. 58
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	317, 567. 02	367, 666. 39
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	59, 543. 79	68, 937. 45
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	64, 472. 17	66, 148. 30
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		1, 975. 12	71. 44
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	52, 068. 27	77, 077. 00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9, 780, 890. 85	-11, 797, 728. 44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9, 780, 890. 85	-11, 797, 728. 44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9, 780, 890. 85	-11, 797, 728. 44

6.3 净资产变动表

会计主体：中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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	92, 020, 993. 35	-	-3, 315, 737. 81	88, 705, 255. 54
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	92,020,993.35	-	-3,315,737.81	88,705,255.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-25,459,265.02	-	8,946,506.29	-16,512,758.73
(一)、综合收益总额	-	-	9,780,890.85	9,780,890.85
(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)	-25,459,265.02	-	-834,384.56	-26,293,649.58
其中：1. 基金申购款	115,620,264.66	-	3,177,257.53	118,797,522.19
2. 基金赎回款	-141,079,529.68	-	-4,011,642.09	-145,091,171.77
(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	66,561,728.33	-	5,630,768.48	72,192,496.81
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	127,722,313.29	-	-10,929,437.03	116,792,876.26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	127,722,313.29	-	-10,929,437.03	116,792,876.26
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-25,747,138.18	-	-7,901,981.26	-33,649,119.44

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-11,797,728.44	-11,797,728.44
(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)	-25,747,138.18	-	3,895,747.18	-21,851,391.00
其中: 1. 基金申购款	6,220,792.11	-	-932,977.94	5,287,814.17
2. 基金赎回款	-31,967,930.29	-	4,828,725.12	-27,139,205.17
(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	101,975,175.11	-	-18,831,418.29	83,143,756.82

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:

宗喆

二

白娜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金中证 1000 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 2022 年 12 月 16 日证监许可[2022]3195 号文《关于准予中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》和《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式指数型基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金,托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

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、申万宏源证券有限公司及申万宏源西部证券有限公司等共同销售，募集期为 2023 年 2 月 27 日起至 2023 年 3 月 10 日。经向中国证监会备案，《中金中证 1000 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 2023 年 3 月 14 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 203,460,403.33 份（含利息转份额 51,321.57 份），发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购费、申购费、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/申购时收取认/申购费用，赎回时收取赎回费但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认/申购时不收取认/申购费用，赎回时收取赎回费但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值，计算公式为计算日某类基金份额净值=该计算日该类基金份额的基金资产净值/该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 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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》、财税[2014] 81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、中投信（2021）20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部

公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按

照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(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。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	2,797,290.69
等于：本金	2,796,878.96
加：应计利息	411.73
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	3,126,416.02
等于：本金	3,126,297.66
加：应计利息	118.36
减：坏账准备	-
合计	5,923,706.71

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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	59,648,935.50	-	61,354,877.47	1,705,941.97

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		59,648,935.50	-	61,354,877.47	1,705,941.97

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,960,480.00	-	-	-
其中：股指期货投资	5,960,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,960,480.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2507	IM2507	5.00	6,289,400.00	328,920.00
合计				328,920.00
减：可抵销期货暂收款				328,920.00
净额				-

注：1、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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	2.06

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	52,068.27
其他	2,690.00
合计	54,760.33

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 1000 指数增强发起 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	56,418,310.20	56,418,310.20
本期申购	86,567,039.25	86,567,039.25
本期赎回（以“-”号填列）	-102,628,243.18	-102,628,243.18
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	40,357,106.27	40,357,106.27

中金中证 1000 指数增强发起 B

项目	本期	
	2025 年 4 月 21 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	190,348.65	190,348.65
本期赎回（以“-”号填列）	-46,830.88	-46,830.88
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	143,517.77	143,517.77

中金中证 1000 指数增强发起 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	35,602,683.15	35,602,683.15
本期申购	28,862,876.76	28,862,876.76
本期赎回（以“-”号填列）	-38,404,455.62	-38,404,455.62
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	26,061,104.29	26,061,104.29

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 1000 指数增强发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,456,661.40	574,513.09	-1,882,148.31
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-2,456,661.40	574,513.09	-1,882,148.31
本期利润	4,578,043.54	1,682,611.89	6,260,655.43
本期基金份额交易产生的变动数	202,618.90	-1,009,363.05	-806,744.15
其中：基金申购款	1,403,637.68	729,936.91	2,133,574.59
基金赎回款	-1,201,018.78	-1,739,299.96	-2,940,318.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,324,001.04	1,247,761.93	3,571,762.97

中金中证 1000 指数增强发起 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	3,025.92	2,445.86	5,471.78
本期基金份额交易产生的变动数	5,266.32	1,988.88	7,255.20
其中：基金申购款	7,479.83	2,694.72	10,174.55
基金赎回款	-2,213.51	-705.84	-2,919.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,292.24	4,434.74	12,726.98

中金中证 1000 指数增强发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,792,896.26	359,306.76	-1,433,589.50
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	-1,792,896.26	359,306.76	-1,433,589.50
本期利润	3,015,817.44	498,946.20	3,514,763.64
本期基金份额交易产生的变动数	25,131.70	-60,027.31	-34,895.61
其中：基金申购款	349,938.95	683,569.44	1,033,508.39
基金赎回款	-324,807.25	-743,596.75	-1,068,404.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,248,052.88	798,225.65	2,046,278.53

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	10,084.25
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	5,169.11
其他	1,034.27
合计	16,287.63

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	7,094,996.06
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	7,094,996.06

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	386,111,725.24
减：卖出股票成本总额	378,641,897.45
减：交易费用	374,831.73
买卖股票差价收入	7,094,996.06

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

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	352,553.25

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	576,732.86
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	576,732.86

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	1,792,212.17
股票投资	1,792,212.17
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	395,709.84
权证投资	—
期货投资	395,709.84
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	3,918.06
合计	2,184,003.95

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	51,943.17
基金转换费收入	0.30
合计	51,943.47

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	12,396.69
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	52,068.27

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
交通银行	基金托管人、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（以下简称“中金财富证券”）	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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 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管理费	317,567.02	367,666.39
其中：应支付销售机构的客户维护费	131,856.96	156,901.92
应支付基金管理人的净管理费	185,710.06	210,764.47

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 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/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	59,543.79	68,937.45

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

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 1000 指数增强发起 A	中金中证 1000 指数增强发起 B	中金中证 1000 指数增强发起 C	合计
交通银行	-	-	20,308.96	20,308.96
中金财富证券	-	-	17,972.62	17,972.62
中金基金	-	-	14,300.05	14,300.05
合计	-	-	52,581.63	52,581.63
获得销售服务费	上年度可比期间			

的各关联方名称	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 1000 指数增强发起 A	中金中证 1000 指数增强发起 B	中金中证 1000 指 数增强发起 C	合计
交通银行	-	-	34,706.25	34,706.25
中金财富证券	-	-	763.64	763.64
中金基金	-	-	8,476.81	8,476.81
合计	-	-	43,946.70	43,946.70

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C 类基金日基金销售服务费=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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	本期 2025 年 4 月 21 日 (基金合同生效 日)至 2025 年 6 月 30 日	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
	中金中证 1000 指数增强 发起 A	中金中证 1000 指数 增强发起 B	中金中证 1000 指数增强 发起 C
基金合同生效日 (2023 年 3 月 14 日)持有的基金份额	5,000,900.00	-	5,000,900.00

报告期初持有的基金份额	5,000,900.00	—	5,000,900.00
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	5,000,900.00	—	5,000,900.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.39%	—	19.19%
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 —	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	中金中证 1000 指数增强发起 A	中金中证 1000 指数增强发起 B	中金中证 1000 指数增强发起 C
基金合同生效日（2023 年 3 月 14 日）持有的基金份额	5,000,900.00	—	5,000,900.00
报告期初持有的基金份额	5,000,900.00	—	5,000,900.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	—	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	—	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	—	0.00
报告期末持有的基金份额	5,000,900.00	—	5,000,900.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.65%	—	13.65%

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
交通银行股份有限公司	2,797,290.69	7,931.93	1,496,294.68	5,051.43

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间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（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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	1,600	47,059.00	60,880.00	-
000627	*ST 天茂	2025 年 5 月 6 日	重大事项停牌	2.74	2025 年 7 月 8 日	2.60	7,000	19,180.00	19,180.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

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

本基金属于股票型指数增强基金，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。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理

方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	5,923,176.62	-	-	530.09	5,923,706.71
结算备付金	553,668.56	-	-	229.14	553,897.70
存出保证金	-	-	-	754,728.00	754,728.00
交易性金融资产	-	-	-	61,354,877.47	61,354,877.47
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	-	-	-	5,481,790.23	5,481,790.23
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,476,845.18	-	-	67,592,154.93	74,069,000.11
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,751,261.65	1,751,261.65
应付销售服务费	-	-	-	9,545.65	9,545.65
应付管理人报酬	-	-	-	47,618.91	47,618.91
应付托管费	-	-	-	8,928.54	8,928.54
应交税费	-	-	-	4,388.22	4,388.22
其他负债	-	-	-	54,760.33	54,760.33
负债总计	-	-	-	1,876,503.30	1,876,503.30
利率敏感度缺口	6,476,845.18	-	-	65,715,651.63	72,192,496.81
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	7,870,833.34	-	-	656.44	7,871,489.78
结算备付金	569,213.65	-	-	232.86	569,446.51
存出保证金	-	-	-	428,817.60	428,817.60
交易性金融资产	-	-	-	79,786,094.39	79,786,094.39
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	-	-	-	447,642.65	447,642.65
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	8,440,046.99	-	-	80,663,443.94	89,103,490.93
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	206,299.27	206,299.27
应付销售服务费	-	-	-	12,259.09	12,259.09
应付管理人报酬	-	-	-	62,885.92	62,885.92
应付托管费	-	-	-	11,791.11	11,791.11
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	105,000.00	105,000.00
负债总计	-	-	-	398,235.39	398,235.39
利率敏感度缺口	8,440,046.99	-	-	80,265,208.55	88,705,255.54

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

本期末本基金未持有交易性债券投资（不含可转换债券、可交换债券）和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（上年度末：同）

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	61,354,877.47	84.99	79,786,094.39	89.95
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	61,354,877.47	84.99	79,786,094.39	89.95

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%	3,429,143.60	4,213,499.64
	业绩比较基准下降 5%	-3,429,143.60	-4,213,499.64

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	61,274,817.47	79,781,447.99
第二层次	80,060.00	4,646.40
第三层次	－	－

合计	61,354,877.47	79,786,094.39
----	---------------	---------------

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	61,354,877.47	82.83
	其中：股票	61,354,877.47	82.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,477,604.41	8.75
8	其他各项资产	6,236,518.23	8.42
9	合计	74,069,000.11	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	199,054.00	0.28
B	采矿业	516,564.00	0.72
C	制造业	40,025,307.37	55.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,778,746.80	2.46
E	建筑业	862,164.00	1.19
F	批发和零售业	2,333,321.00	3.23
G	交通运输、仓储和邮政业	1,306,990.50	1.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,134,477.78	8.50
J	金融业	808,362.00	1.12
K	房地产业	983,405.00	1.36
L	租赁和商务服务业	1,158,884.00	1.61
M	科学研究和技术服务业	364,524.30	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	433,146.00	0.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	235,000.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	1,431,402.00	1.98
S	综合	-	-
	合计	58,571,348.75	81.13

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	13,691.00	0.02
C	制造业	2,435,301.72	3.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,021.00	0.02
E	建筑业	6,566.00	0.01
F	批发和零售业	44,605.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	49,660.00	0.07

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,544.00	0.07
J	金融业	19,180.00	0.03
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	-	-
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	152,960.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	2,783,528.72	3.86

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	603766	隆鑫通用	49,200	627,792.00	0.87
2	600866	星湖科技	82,400	569,384.00	0.79
3	300777	中简科技	15,100	547,375.00	0.76
4	600675	中华企业	186,400	536,832.00	0.74
5	600179	安通控股	191,400	528,264.00	0.73
6	002249	大洋电机	78,100	513,898.00	0.71
7	300185	通裕重工	175,200	501,072.00	0.69
8	601678	滨化股份	117,900	488,106.00	0.68
9	600728	佳都科技	88,200	480,690.00	0.67
10	603236	移远通信	5,580	478,764.00	0.66
11	688088	虹软科技	9,900	477,675.00	0.66
12	601311	骆驼股份	51,800	467,754.00	0.65
13	000657	中钨高新	38,000	450,680.00	0.62
14	688208	道通科技	14,643	448,075.80	0.62
15	300666	江丰电子	5,800	429,780.00	0.60
16	600073	光明肉业	57,000	420,660.00	0.58
17	603588	高能环境	73,300	413,412.00	0.57

18	300850	新强联	11,400	408,348.00	0.57
19	300088	长信科技	68,400	407,664.00	0.56
20	600635	大众公用	103,100	402,090.00	0.56
21	002706	良信股份	45,000	400,950.00	0.56
22	688018	乐鑫科技	2,731	398,999.10	0.55
23	600335	国机汽车	61,300	395,385.00	0.55
24	601900	南方传媒	24,800	387,872.00	0.54
25	600273	嘉化能源	45,100	381,546.00	0.53
26	002139	拓邦股份	27,200	375,632.00	0.52
27	600320	振华重工	85,900	375,383.00	0.52
28	300548	长芯博创	5,500	367,235.00	0.51
29	300083	创世纪	44,500	365,790.00	0.51
30	301031	中熔电气	4,564	363,522.60	0.50
31	300232	洲明科技	49,700	359,828.00	0.50
32	002396	星网锐捷	15,500	347,975.00	0.48
33	002649	博彦科技	23,400	340,002.00	0.47
34	300762	上海瀚讯	14,800	334,924.00	0.46
35	601126	四方股份	20,500	333,535.00	0.46
36	002597	金禾实业	14,100	332,055.00	0.46
37	002242	九阳股份	34,600	328,700.00	0.46
38	601777	千里科技	38,700	328,563.00	0.46
39	300596	利安隆	11,400	327,978.00	0.45
40	002171	楚江新材	33,500	325,955.00	0.45
41	603612	索通发展	17,693	325,197.34	0.45
42	688076	诺泰生物	8,677	322,957.94	0.45
43	002745	木林森	40,900	322,292.00	0.45
44	600169	太原重工	130,600	316,052.00	0.44
45	300182	捷成股份	57,200	315,172.00	0.44
46	600338	西藏珠峰	28,400	314,956.00	0.44
47	688343	云天励飞	6,348	313,718.16	0.43
48	300755	华致酒行	16,100	310,730.00	0.43
49	300768	迪普科技	18,000	308,700.00	0.43
50	600966	博汇纸业	68,500	302,770.00	0.42
51	600710	苏美达	31,100	298,871.00	0.41
52	601096	宏盛华源	72,000	298,080.00	0.41
53	002701	奥瑞金	50,000	297,500.00	0.41
54	688128	中国电研	12,132	297,234.00	0.41
55	600662	外服控股	57,800	295,358.00	0.41
56	603456	九洲药业	19,200	292,032.00	0.40
57	600075	新疆天业	68,700	290,601.00	0.40
58	600640	国脉文化	23,900	289,668.00	0.40
59	300009	安科生物	34,600	289,602.00	0.40
60	600718	东软集团	29,400	286,650.00	0.40

61	300303	聚飞光电	45,100	285,934.00	0.40
62	000791	甘肃能源	44,500	283,910.00	0.39
63	300236	上海新阳	7,300	283,240.00	0.39
64	300319	麦捷科技	26,000	279,240.00	0.39
65	000156	华数传媒	35,100	278,694.00	0.39
66	300363	博腾股份	16,200	276,696.00	0.38
67	002516	旷达科技	53,500	275,525.00	0.38
68	300482	万孚生物	12,900	275,415.00	0.38
69	002315	焦点科技	6,000	274,140.00	0.38
70	300360	炬华科技	17,400	274,050.00	0.38
71	000927	中国铁物	106,000	272,420.00	0.38
72	002489	浙江永强	73,600	269,376.00	0.37
73	600125	铁龙物流	47,300	267,718.00	0.37
74	300027	华谊兄弟	99,800	267,464.00	0.37
75	000950	重药控股	53,000	264,470.00	0.37
76	688185	康希诺	4,421	263,624.23	0.37
77	300525	博思软件	18,100	263,536.00	0.37
78	688289	圣湘生物	12,833	262,819.84	0.36
79	603678	火炬电子	6,900	262,407.00	0.36
80	002239	奥特佳	90,200	261,580.00	0.36
81	600667	太极实业	39,700	261,226.00	0.36
82	002063	远光软件	43,400	258,230.00	0.36
83	600490	鹏欣资源	58,500	256,815.00	0.36
84	603267	鸿远电子	5,100	256,377.00	0.36
85	300296	利亚德	41,900	255,590.00	0.35
86	600285	羚锐制药	11,200	253,904.00	0.35
87	300972	万辰集团	1,400	252,336.00	0.35
88	300685	艾德生物	11,680	251,470.40	0.35
89	601208	东材科技	26,500	251,220.00	0.35
90	002011	盾安环境	21,600	250,560.00	0.35
91	300134	大富科技	20,400	249,492.00	0.35
92	603103	横店影视	15,300	245,565.00	0.34
93	002698	博实股份	15,800	245,532.00	0.34
94	300401	花园生物	15,900	241,839.00	0.33
95	600664	哈药股份	65,100	239,568.00	0.33
96	301029	怡合达	10,400	237,744.00	0.33
97	688400	凌云光	8,600	237,102.00	0.33
98	301511	德福科技	11,400	235,980.00	0.33
99	601677	明泰铝业	18,700	232,254.00	0.32
100	300570	太辰光	2,400	231,312.00	0.32
101	600186	莲花控股	38,200	229,200.00	0.32
102	600552	凯盛科技	19,700	222,610.00	0.31
103	300738	奥飞数据	10,600	221,858.00	0.31

104	688019	安集科技	1,459	221,476.20	0.31
105	600780	通宝能源	36,800	218,224.00	0.30
106	688629	华丰科技	3,800	217,360.00	0.30
107	600986	浙文互联	26,500	216,505.00	0.30
108	002434	万里扬	28,900	211,837.00	0.29
109	603876	鼎胜新材	23,200	210,888.00	0.29
110	301090	华润材料	28,000	210,840.00	0.29
111	002034	旺能环境	12,500	209,875.00	0.29
112	301526	国际复材	57,600	209,664.00	0.29
113	600587	新华医疗	13,800	208,932.00	0.29
114	600305	恒顺醋业	26,900	207,937.00	0.29
115	000727	冠捷科技	84,700	205,821.00	0.29
116	688586	江航装备	18,082	203,422.50	0.28
117	000589	贵州轮胎	44,500	203,365.00	0.28
118	600163	中闽能源	39,700	203,264.00	0.28
119	000090	天健集团	56,500	200,010.00	0.28
120	002081	金螳螂	58,200	199,626.00	0.28
121	688007	光峰科技	13,800	199,548.00	0.28
122	688389	普门科技	15,393	198,877.56	0.28
123	300226	上海钢联	8,700	198,708.00	0.28
124	301069	凯盛新材	12,300	198,153.00	0.27
125	300702	天宇股份	8,400	195,384.00	0.27
126	002314	南山控股	72,800	191,464.00	0.27
127	688150	莱特光电	7,600	187,872.00	0.26
128	002145	中核钛白	45,100	187,165.00	0.26
129	600961	株冶集团	16,500	184,470.00	0.26
130	688131	皓元医药	3,786	183,053.10	0.25
131	300035	中科电气	10,800	182,304.00	0.25
132	300456	赛微电子	10,600	182,214.00	0.25
133	000970	中科三环	15,400	181,258.00	0.25
134	001339	智微智能	3,700	178,821.00	0.25
135	600206	有研新材	9,300	177,723.00	0.25
136	688351	微电生理	9,000	177,300.00	0.25
137	300821	东岳硅材	22,400	176,064.00	0.24
138	688252	天德钰	7,200	175,536.00	0.24
139	600771	广誉远	8,700	175,392.00	0.24
140	001227	兰州银行	69,800	174,500.00	0.24
141	600216	浙江医药	11,500	170,085.00	0.24
142	688048	长光华芯	2,939	169,697.86	0.24
143	600507	方大特钢	38,100	165,354.00	0.23
144	600020	中原高速	34,500	164,910.00	0.23
145	002487	大金重工	5,000	164,500.00	0.23
146	000767	晋控电力	56,700	162,162.00	0.22

147	688270	臻镭科技	3,477	161,889.12	0.22
148	603306	华懋科技	3,700	160,950.00	0.22
149	601369	陕鼓动力	18,200	159,614.00	0.22
150	603027	千禾味业	13,600	157,896.00	0.22
151	603039	泛微网络	2,800	155,960.00	0.22
152	600420	国药现代	14,600	155,490.00	0.22
153	002219	新里程	69,400	152,680.00	0.21
154	603444	吉比特	500	150,975.00	0.21
155	688306	均普智能	15,000	147,600.00	0.20
156	688003	天准科技	3,200	146,880.00	0.20
157	600963	岳阳林纸	33,000	146,190.00	0.20
158	300492	华图山鼎	2,140	145,263.20	0.20
159	600064	南京高科	18,700	144,177.00	0.20
160	300183	东软载波	8,400	141,204.00	0.20
161	688123	聚辰股份	1,717	139,059.83	0.19
162	600195	中牧股份	18,900	138,537.00	0.19
163	688209	英集芯	7,492	138,377.24	0.19
164	300119	瑞普生物	7,100	137,882.00	0.19
165	001287	中电港	7,500	137,325.00	0.19
166	605296	神农集团	4,400	135,256.00	0.19
167	601519	大智慧	13,200	134,508.00	0.19
168	002004	华邦健康	32,200	134,274.00	0.19
169	000600	建投能源	19,400	134,054.00	0.19
170	603866	桃李面包	24,800	133,920.00	0.19
171	002777	久远银海	7,300	133,298.00	0.18
172	600100	同方股份	18,300	132,492.00	0.18
173	600531	豫光金铅	17,100	132,354.00	0.18
174	688232	新点软件	4,400	132,176.00	0.18
175	002747	埃斯顿	6,500	131,560.00	0.18
176	600058	五矿发展	17,000	131,410.00	0.18
177	688698	伟创电气	2,773	130,885.60	0.18
178	688177	百奥泰	5,212	130,612.72	0.18
179	600267	海正药业	13,700	126,725.00	0.18
180	600757	长江传媒	13,600	126,208.00	0.17
181	300101	振芯科技	5,508	124,646.04	0.17
182	605599	菜百股份	7,300	119,355.00	0.17
183	002010	传化智联	21,300	118,854.00	0.16
184	603025	大豪科技	8,420	118,048.40	0.16
185	605020	永和股份	5,000	115,200.00	0.16
186	002948	青岛银行	23,100	115,038.00	0.16
187	600458	时代新材	8,200	112,504.00	0.16
188	300672	国科微	1,300	110,396.00	0.15
189	688798	艾为电子	1,600	109,120.00	0.15

190	603662	柯力传感	1,700	108,681.00	0.15
191	000902	新洋丰	7,800	107,874.00	0.15
192	600114	东睦股份	5,200	105,768.00	0.15
193	002891	中宠股份	1,700	105,179.00	0.15
194	300953	震裕科技	1,000	101,350.00	0.14
195	300776	帝尔激光	1,900	101,099.00	0.14
196	002668	TCL 智家	10,200	99,654.00	0.14
197	300151	昌红科技	7,900	97,249.00	0.13
198	603055	台华新材	10,600	96,778.00	0.13
199	002245	蔚蓝锂芯	7,500	96,225.00	0.13
200	688690	纳微科技	4,143	94,584.69	0.13
201	600869	远东股份	18,600	94,488.00	0.13
202	600480	凌云股份	7,760	94,439.20	0.13
203	603171	税友股份	2,200	94,402.00	0.13
204	300184	力源信息	9,500	93,290.00	0.13
205	301510	固高科技	3,100	93,155.00	0.13
206	002497	雅化集团	8,000	91,200.00	0.13
207	300655	晶瑞电材	9,000	90,090.00	0.12
208	603308	应流股份	3,900	90,012.00	0.12
209	300113	顺网科技	4,500	88,920.00	0.12
210	002936	郑州银行	42,900	88,374.00	0.12
211	688433	华曙高科	2,400	88,200.00	0.12
212	601137	博威合金	4,900	87,171.00	0.12
213	000686	东北证券	11,400	86,982.00	0.12
214	003006	百亚股份	3,100	84,878.00	0.12
215	002405	四维图新	9,800	83,692.00	0.12
216	688536	思瑞浦	600	83,232.00	0.12
217	002324	普利特	7,800	82,914.00	0.11
218	600063	皖维高新	18,100	82,898.00	0.11
219	301239	普瑞眼科	2,100	82,320.00	0.11
220	600812	华北制药	13,300	82,194.00	0.11
221	603197	保隆科技	2,100	82,047.00	0.11
222	002588	史丹利	9,200	81,052.00	0.11
223	002258	利尔化学	7,300	80,592.00	0.11
224	688327	云从科技	5,800	79,982.00	0.11
225	600861	北京人力	4,100	79,130.00	0.11
226	688776	国光电气	749	79,004.52	0.11
227	002154	报喜鸟	20,700	77,832.00	0.11
228	688686	奥普特	800	76,496.00	0.11
229	688001	华兴源创	3,024	76,416.48	0.11
230	002901	大博医疗	2,100	76,104.00	0.11
231	002626	金达威	3,700	75,702.00	0.10
232	600120	浙江东方	12,200	73,810.00	0.10

233	600057	厦门象屿	10,200	71,706.00	0.10
234	605222	起帆电缆	4,700	71,158.00	0.10
235	300641	正丹股份	3,100	70,649.00	0.10
236	300415	伊之密	3,500	70,525.00	0.10
237	600782	新钢股份	19,800	70,092.00	0.10
238	688522	纳睿雷达	1,365	69,915.30	0.10
239	605376	博迁新材	1,800	68,994.00	0.10
240	600729	重庆百货	2,300	68,609.00	0.10
241	002545	东方铁塔	7,700	68,453.00	0.09
242	300049	福瑞股份	2,100	68,103.00	0.09
243	600269	赣粤高速	13,400	67,804.00	0.09
244	600266	城建发展	14,900	67,646.00	0.09
245	688029	南微医学	1,000	67,550.00	0.09
246	002550	千红制药	8,000	67,200.00	0.09
247	300102	乾照光电	5,800	67,106.00	0.09
248	601619	嘉泽新能	18,600	66,588.00	0.09
249	000688	国城矿业	5,000	66,550.00	0.09
250	600478	科力远	10,600	66,250.00	0.09
251	600012	皖通高速	3,900	66,222.00	0.09
252	605168	三人行	2,200	64,746.00	0.09
253	600446	金证股份	3,400	64,498.00	0.09
254	603609	禾丰股份	7,800	64,428.00	0.09
255	603118	共进股份	5,700	64,239.00	0.09
256	002216	三全食品	5,800	64,206.00	0.09
257	300475	香农芯创	1,800	64,134.00	0.09
258	603477	巨星农牧	3,100	63,798.00	0.09
259	600259	广晟有色	1,200	63,744.00	0.09
260	603638	艾迪精密	3,600	62,964.00	0.09
261	601801	皖新传媒	9,200	62,836.00	0.09
262	603730	岱美股份	10,960	62,362.40	0.09
263	603583	捷昌驱动	1,700	62,084.00	0.09
264	603613	国联股份	2,600	61,594.00	0.09
265	301377	鼎泰高科	1,700	61,132.00	0.08
266	300687	赛意信息	2,200	61,116.00	0.08
267	603218	日月股份	4,800	60,912.00	0.08
268	002091	江苏国泰	8,300	60,341.00	0.08
269	002402	和而泰	2,600	60,242.00	0.08
270	600595	中孚实业	13,700	60,006.00	0.08
271	603005	晶方科技	2,100	59,619.00	0.08
272	300443	金雷股份	2,600	58,760.00	0.08
273	600882	妙可蓝多	1,900	58,007.00	0.08
274	002127	南极电商	14,600	57,962.00	0.08
275	600550	保变电气	6,700	57,620.00	0.08

276	688502	茂莱光学	200	57,532.00	0.08
277	300913	兆龙互连	1,220	57,120.40	0.08
278	601869	长飞光纤	1,400	57,008.00	0.08
279	002036	联创电子	5,200	56,212.00	0.08
280	000030	富奥股份	9,100	53,599.00	0.07
281	688631	莱斯信息	600	53,520.00	0.07
282	688612	威迈斯	2,000	53,480.00	0.07
283	000498	山东路桥	9,000	52,920.00	0.07
284	002617	露笑科技	7,000	52,710.00	0.07
285	300593	新雷能	3,900	52,260.00	0.07
286	601963	重庆银行	4,800	52,128.00	0.07
287	600740	山西焦化	14,000	51,940.00	0.07
288	600428	中远海特	8,258	51,612.50	0.07
289	601068	中铝国际	11,100	50,727.00	0.07
290	688141	杰华特	1,556	50,694.48	0.07
291	000837	秦川机床	4,200	50,484.00	0.07
292	600967	内蒙一机	2,600	50,310.00	0.07
293	000690	宝新能源	11,000	50,050.00	0.07
294	002947	恒铭达	1,500	49,785.00	0.07
295	300166	东方国信	4,500	49,050.00	0.07
296	002911	佛燃能源	4,730	48,529.80	0.07
297	600033	福建高速	13,700	48,498.00	0.07
298	000672	上峰水泥	6,100	48,190.00	0.07
299	601083	锦江航运	4,300	47,773.00	0.07
300	601860	紫金银行	15,900	47,700.00	0.07
301	300100	双林股份	1,000	47,080.00	0.07
302	600976	健民集团	1,200	47,052.00	0.07
303	000029	深深房 A	2,300	43,286.00	0.06
304	688200	华峰测控	300	43,260.00	0.06
305	603920	世运电路	1,400	42,714.00	0.06
306	601609	金田股份	5,900	41,359.00	0.06
307	002705	新宝股份	2,800	41,160.00	0.06
308	603063	禾望电气	1,200	40,632.00	0.06
309	300428	立中集团	2,200	40,084.00	0.06
310	300674	宇信科技	1,300	39,377.00	0.05
311	605123	派克新材	500	38,950.00	0.05
312	002126	银轮股份	1,600	38,848.00	0.05
313	301078	孩子王	2,900	37,903.00	0.05
314	002978	安宁股份	1,200	37,896.00	0.05
315	601718	际华集团	9,500	37,240.00	0.05
316	688331	荣昌生物	600	36,300.00	0.05
317	688105	诺唯赞	1,600	36,208.00	0.05
318	002761	浙江建投	4,000	35,480.00	0.05

319	002048	宁波华翔	1,900	34,979.00	0.05
320	603297	永新光学	400	34,940.00	0.05
321	300432	富临精工	2,660	34,766.20	0.05
322	300180	华峰超纤	3,600	34,308.00	0.05
323	600366	宁波韵升	3,100	33,666.00	0.05
324	002755	奥赛康	2,100	33,558.00	0.05
325	603698	航天工程	1,900	33,478.00	0.05
326	002276	万马股份	2,300	33,212.00	0.05
327	002468	申通快递	3,100	33,139.00	0.05
328	603083	剑桥科技	700	33,110.00	0.05
329	002484	江海股份	1,600	32,784.00	0.05
330	603997	继峰股份	2,500	32,600.00	0.05
331	002611	东方精工	2,700	32,562.00	0.05
332	688380	中微半导	1,200	32,520.00	0.05
333	000969	安泰科技	2,500	32,200.00	0.04
334	300398	飞凯材料	1,600	31,952.00	0.04
335	002946	新乳业	1,700	31,909.00	0.04
336	605009	豪悦护理	800	31,824.00	0.04
337	600330	天通股份	4,400	31,548.00	0.04
338	000089	深圳机场	4,500	31,050.00	0.04
339	300660	江苏雷利	700	30,968.00	0.04
340	002925	盈趣科技	1,700	30,566.00	0.04
341	600933	爱柯迪	1,900	30,419.00	0.04
342	600623	华谊集团	4,000	30,280.00	0.04
343	300026	红日药业	8,200	30,258.00	0.04
344	300723	一品红	600	30,072.00	0.04
345	600789	鲁抗医药	3,000	30,030.00	0.04
346	002539	云图控股	3,200	30,016.00	0.04
347	600596	新安股份	3,700	29,970.00	0.04
348	002100	天康生物	4,800	29,712.00	0.04
349	300602	飞荣达	1,400	29,694.00	0.04
350	301035	润丰股份	500	29,670.00	0.04
351	002815	崇达技术	2,600	29,458.00	0.04
352	002204	大连重工	4,900	29,253.00	0.04
353	002079	苏州固锔	3,000	29,250.00	0.04
354	002194	武汉凡谷	2,000	28,920.00	0.04
354	600006	东风股份	4,000	28,920.00	0.04
355	603337	杰克股份	800	28,704.00	0.04
356	002096	易普力	2,300	28,543.00	0.04
357	000930	中粮科技	5,100	28,458.00	0.04
358	000928	中钢国际	4,500	28,260.00	0.04
359	600502	安徽建工	6,000	28,200.00	0.04
360	600313	农发种业	4,500	28,170.00	0.04

361	000990	诚志股份	3,700	27,972.00	0.04
362	600835	上海机电	1,300	27,625.00	0.04
363	000968	蓝焰控股	3,800	27,550.00	0.04
364	601038	一拖股份	2,100	27,447.00	0.04
365	000049	德赛电池	1,200	27,312.00	0.04
366	001308	康冠科技	1,200	27,144.00	0.04
367	600577	精达股份	3,600	26,784.00	0.04
368	600746	江苏索普	3,400	26,554.00	0.04
369	002913	奥士康	900	26,469.00	0.04
370	300133	华策影视	3,500	26,285.00	0.04
371	300080	易成新能	6,200	25,916.00	0.04
372	600597	光明乳业	3,000	25,230.00	0.03
373	000813	德展健康	7,600	24,472.00	0.03
374	301381	赛维时代	1,200	23,940.00	0.03
375	300188	国投智能	1,700	23,460.00	0.03
376	688696	极米科技	200	22,872.00	0.03
377	000035	中国天楹	4,600	19,734.00	0.03
378	300470	中密控股	500	18,385.00	0.03
379	600643	爱建集团	2,100	15,582.00	0.02
380	001301	尚太科技	300	14,628.00	0.02
381	002456	欧菲光	1,200	14,220.00	0.02
382	000567	海德股份	2,300	13,616.00	0.02
383	600987	航民股份	1,800	12,726.00	0.02
384	000059	华锦股份	2,200	11,858.00	0.02
385	688262	国芯科技	400	10,668.00	0.01
386	301606	绿联科技	200	10,286.00	0.01
387	301316	慧博云通	200	8,616.00	0.01
388	002840	华统股份	600	6,246.00	0.01
389	600621	华鑫股份	400	6,124.00	0.01
390	600123	兰花科创	900	5,868.00	0.01
391	600248	陕建股份	1,500	5,715.00	0.01
392	600572	康恩贝	1,100	4,818.00	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	688183	生益电子	3,503	179,353.60	0.25
2	688608	恒玄科技	462	160,766.76	0.22
3	001696	宗申动力	5,200	116,740.00	0.16
4	300476	胜宏科技	800	107,504.00	0.15
5	600110	诺德股份	14,700	102,753.00	0.14
6	603466	风语筑	10,000	100,900.00	0.14
7	300869	康泰医学	7,000	100,380.00	0.14
8	603586	金麒麟	5,300	97,096.00	0.13

9	603985	恒润股份	6,200	96,596.00	0.13
10	002728	特一药业	10,800	90,828.00	0.13
11	002130	沃尔核材	3,200	76,224.00	0.11
12	601003	柳钢股份	21,200	74,624.00	0.10
13	300458	全志科技	1,700	67,473.00	0.09
14	688685	迈信林	1,200	67,020.00	0.09
15	688313	仕佳光子	1,600	60,880.00	0.08
16	688388	嘉元科技	3,002	60,280.16	0.08
17	688582	芯动联科	891	59,875.20	0.08
18	301180	万祥科技	3,500	51,555.00	0.07
19	300484	蓝海华腾	2,300	51,451.00	0.07
20	002977	天箭科技	1,200	50,964.00	0.07
21	000553	安道麦 A	6,900	49,818.00	0.07
22	603565	中谷物流	5,200	49,660.00	0.07
23	300199	翰宇药业	3,000	49,650.00	0.07
24	600983	惠而浦	4,700	48,786.00	0.07
25	002624	完美世界	3,200	48,544.00	0.07
26	000893	亚钾国际	1,600	48,224.00	0.07
27	002739	万达电影	4,200	48,006.00	0.07
28	002102	能特科技	14,600	46,136.00	0.06
29	603989	艾华集团	2,700	41,580.00	0.06
30	300573	兴齐眼药	800	41,432.00	0.06
31	603123	翠微股份	2,100	35,805.00	0.05
32	300879	大叶股份	900	35,352.00	0.05
33	603858	步长制药	1,900	30,856.00	0.04
34	300990	同飞股份	600	29,940.00	0.04
35	600685	中船防务	1,000	27,190.00	0.04
36	600714	金瑞矿业	2,100	25,683.00	0.04
37	600105	永鼎股份	3,100	25,079.00	0.03
38	000959	首钢股份	7,300	24,820.00	0.03
39	000825	太钢不锈	6,900	24,771.00	0.03
40	600582	天地科技	4,100	24,559.00	0.03
41	002050	三花智控	900	23,742.00	0.03
42	603486	科沃斯	400	23,292.00	0.03
43	603489	八方股份	800	21,712.00	0.03
44	000333	美的集团	300	21,660.00	0.03
45	603288	海天味业	500	19,455.00	0.03
46	000627	*ST 天茂	7,000	19,180.00	0.03
47	300824	北鼎股份	1,400	16,702.00	0.02
48	600299	安迪苏	1,700	16,405.00	0.02
49	600578	京能电力	2,900	13,021.00	0.02
50	600678	四川金顶	1,500	12,720.00	0.02
51	603113	金能科技	1,400	9,702.00	0.01

52	600739	辽宁成大	800	8,800.00	0.01
53	000869	张裕 A	400	8,492.00	0.01
54	300483	首华燃气	700	8,036.00	0.01
55	002461	珠江啤酒	700	7,903.00	0.01
56	600219	南山铝业	1,900	7,277.00	0.01
57	001267	汇绿生态	700	6,566.00	0.01
58	600871	石化油服	2,900	5,655.00	0.01
59	300251	光线传媒	200	4,054.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600273	嘉化能源	1,547,843.00	1.74
2	002139	拓邦股份	1,545,077.00	1.74
3	600064	南京高科	1,517,765.00	1.71
4	603588	高能环境	1,504,416.00	1.70
5	688088	虹软科技	1,501,312.61	1.69
6	300185	通裕重工	1,484,297.00	1.67
7	600643	爱建集团	1,470,570.50	1.66
8	601777	千里科技	1,440,239.00	1.62
9	600866	星湖科技	1,430,921.00	1.61
10	300679	电连技术	1,415,284.00	1.60
11	002063	远光软件	1,401,370.00	1.58
12	601311	骆驼股份	1,398,425.00	1.58
13	603766	隆鑫通用	1,359,514.00	1.53
14	600335	国机汽车	1,318,753.00	1.49
15	300101	振芯科技	1,311,461.00	1.48
16	600966	博汇纸业	1,299,331.00	1.46
17	600458	时代新材	1,286,574.00	1.45
18	600075	新疆天业	1,280,402.00	1.44
19	300682	朗新集团	1,265,027.00	1.43
20	300232	洲明科技	1,249,226.00	1.41

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	300682	朗新集团	1,975,338.76	2.23
2	605589	圣泉集团	1,856,256.00	2.09
3	600850	电科数字	1,848,868.00	2.08
4	002906	华阳集团	1,748,413.00	1.97
5	300627	华测导航	1,617,497.60	1.82

6	688123	聚辰股份	1,608,996.23	1.81
7	002139	拓邦股份	1,604,111.00	1.81
8	600064	南京高科	1,602,779.00	1.81
9	600718	东软集团	1,588,093.00	1.79
10	600643	爱建集团	1,581,968.00	1.78
11	601777	千里科技	1,558,631.00	1.76
12	603588	高能环境	1,526,005.00	1.72
13	002004	华邦健康	1,500,291.00	1.69
14	300772	运达股份	1,482,891.50	1.67
15	600267	海正药业	1,482,162.00	1.67
16	605333	沪光股份	1,460,732.00	1.65
17	300685	艾德生物	1,444,171.00	1.63
18	603989	艾华集团	1,430,382.00	1.61
19	603699	纽威股份	1,421,271.00	1.60
20	603766	隆鑫通用	1,402,327.00	1.58

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	358,418,468.36
卖出股票收入（成交）总额	386,111,725.24

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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	754,728.00
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	5,481,790.23
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,236,518.23

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股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
中金中证 1000 指数 增强发起 A	712	56,681.33	6,006,101.16	14.88	34,351,005.11	85.12
中金中证 1000 指数 增强发起 B	92	1,559.98	0.00	0.00	143,517.77	100.00
中金中证 1000 指数 增强发起 C	455	57,277.15	5,085,122.61	19.51	20,975,981.68	80.49
合计	1,259	52,868.73	11,091,223.77	16.66	55,470,504.56	83.34

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 1000 指数增强发起 A	348,339.00	0.8631
	中金中证 1000 指数增强发起 B	116.93	0.0815
	中金中证 1000 指数增强发起 C	20.00	0.0001
	合计	348,475.93	0.5235

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 1000 指数增强发起 A	10~50
	中金中证 1000 指数增强发起 B	0
	中金中证 1000 指数增强发起 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 1000 指数增强发起 A	0~10
	中金中证 1000 指数增强发起	0

	B	
	中金中证 1000 指数增强发起	0
	C	
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,800.00	15.03	10,001,800.00	15.03	自基金合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,800.00	15.03	10,001,800.00	15.03	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 1000 指数增强发起 A	中金中证 1000 指数增强发起 B	中金中证 1000 指数增强发起 C
基金合同生效日（2023 年 3 月 14 日）基金份额总额	115,561,785.72	-	87,898,617.61
本报告期期初基金份额总额	56,418,310.20	-	35,602,683.15
本报告期基金总申购份额	86,567,039.25	190,348.65	28,862,876.76
减：本报告期基金总赎回份额	102,628,243.18	46,830.88	38,404,455.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	40,357,106.27	143,517.77	26,061,104.29

§ 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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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 (%)	
华西证券	2	744,530,193.60	100.00	134,017.96	100.00	-

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；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(%)
华西证券	-	-	-	-	-	-

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 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2025-1-22
3	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025-3-27
4	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025-3-27
5	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
6	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-3-28
7	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025-4-21
8	中金中证 1000 指数增强型发起式证	中国证监会规定媒介	2025-4-21

	券投资基金托管协议		
9	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 2 号）	中国证监会规定媒介	2025-4-21
10	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（2025 年第 2 号）	中国证监会规定媒介	2025-4-21
11	中金基金管理有限公司关于中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金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	2025-4-21
12	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
13	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2025-4-22
14	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 1000 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 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金中证 1000 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 1000 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 1000 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

2025 年 8 月 29 日