

中金中证 500 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	52

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 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	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中金中证 500 指数增强	
基金主代码	003016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 22 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	403,480,581.25 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 500 指数增强 A	中金中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	003016	003578
报告期末下属分级基金的份额总额	291,469,890.89 份	112,010,690.36 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰	郭明
	联系电话	010-63211122	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95588
传真		010-66159121	010-66105798
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100004	100140
法定代表人	李金泽	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	中金中证 500A	中金中证 500C
本期已实现收益	25,142,514.23	9,936,290.56
本期利润	34,544,165.41	13,015,932.58
加权平均基金份额本期利润	0.1187	0.1077
本期加权平均净值利润率	6.95%	6.43%
本期基金份额净值增长率	7.59%	7.37%
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	232,618,857.28	85,335,395.13
期末可供分配基金份额利润	0.7981	0.7619
期末基金资产净值	524,088,748.17	197,346,085.49
期末基金份额净值	1.7981	1.7619
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	79.81%	63.18%

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

2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际

收益水平要低于所列数字；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金中证 500A

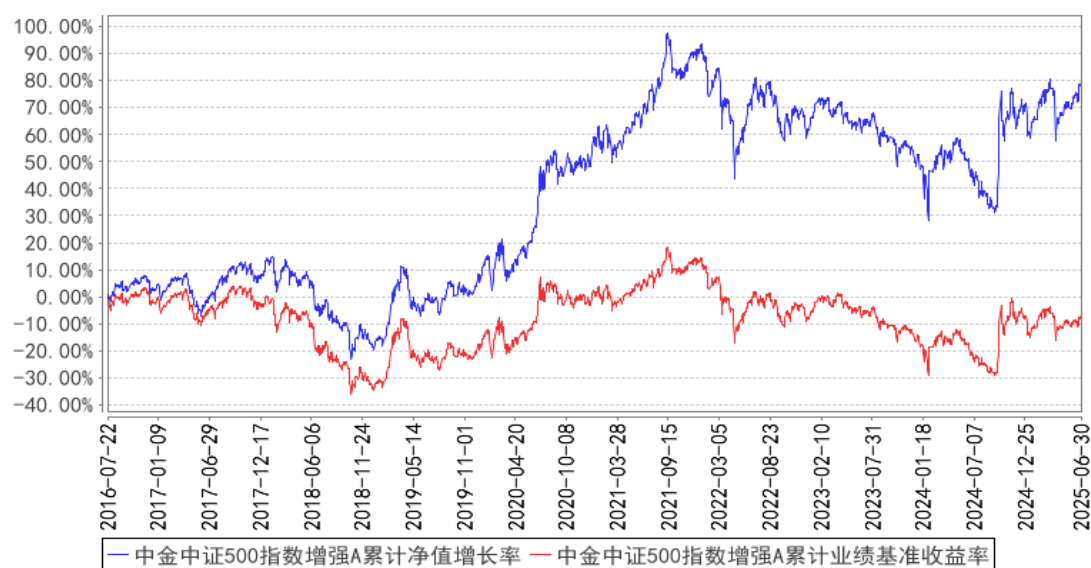
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.31%	0.69%	4.09%	0.75%	1.22%	-0.06%
过去三个月	2.93%	1.43%	0.97%	1.43%	1.96%	0.00%
过去六个月	7.59%	1.25%	3.21%	1.29%	4.38%	-0.04%
过去一年	23.73%	1.55%	18.83%	1.64%	4.90%	-0.09%
过去三年	1.11%	1.22%	-7.61%	1.29%	8.72%	-0.07%
自基金合同生效起至今	79.81%	1.23%	-6.78%	1.27%	86.59%	-0.04%

中金中证 500C

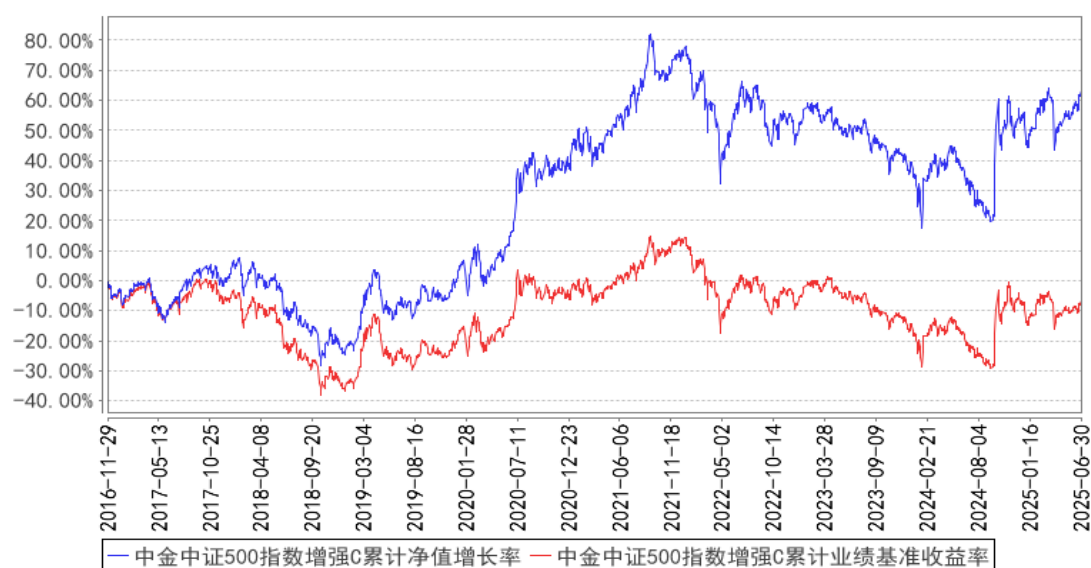
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.28%	0.69%	4.09%	0.75%	1.19%	-0.06%
过去三个月	2.83%	1.43%	0.97%	1.43%	1.86%	0.00%
过去六个月	7.37%	1.25%	3.21%	1.29%	4.16%	-0.04%
过去一年	23.24%	1.55%	18.83%	1.64%	4.41%	-0.09%
过去三年	-0.09%	1.22%	-7.61%	1.29%	7.52%	-0.07%
自基金合同生效起至今	63.18%	1.24%	-6.78%	1.29%	69.96%	-0.05%

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500指数增强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500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 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。
王家列	本基金基金经理助理	2023 年 10 月 26 日	-	9 年	王家列先生，金融硕士。历任泰康资产管理有限责任公司金融工程研究员；中金基金管理有限公司量化指数部研究员、基金经理助理。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、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》、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 500A 基金份额净值为 1.7981 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.59%，同期业绩基准收益率为 3.21%；中金中证 500C 基金份额净值为 1.7619 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.37%，同期业绩基准收益率为 3.21%。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：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	8,243,920.24	5,010,399.89
结算备付金		5,871,995.92	3,112,413.10
存出保证金		1,714,959.44	121,047.74
交易性金融资产	6.4.7.2	706,767,854.63	647,665,530.20
其中：股票投资		668,308,441.48	610,863,466.58
基金投资		-	-
债券投资		38,459,413.15	36,802,063.62
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		1,538,120.44	8,412.07
应收股利		-	-
应收申购款		796,043.39	617,645.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		724,932,894.06	656,535,448.49
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2025 年 6 月 30 日	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		-	4, 499, 671. 92
应付清算款		485, 111. 18	297, 236. 11
应付赎回款		2, 059, 656. 68	1, 435, 178. 70
应付管理人报酬		294, 821. 52	283, 672. 33
应付托管费		88, 446. 45	85, 101. 71
应付销售服务费		65, 348. 36	70, 487. 65
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	504, 676. 21	589, 508. 16
负债合计		3, 498, 060. 40	7, 260, 856. 58
净资产：			
实收基金	6. 4. 7. 10	403, 480, 581. 25	390, 698, 760. 56
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	317, 954, 252. 41	258, 575, 831. 35
净资产合计		721, 434, 833. 66	649, 274, 591. 91
负债和净资产总计		724, 932, 894. 06	656, 535, 448. 49

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，中金中证 500A 的基金份额净值为 1.7981 元，期末份
额总额为 291,469,890.89 份；中金中证 500C 的基金份额净值为 1.7619 元，期末份额总额为
112,010,690.36 份。基金份额总额 403,480,581.25 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：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		50, 344, 289. 60	-34, 191, 100. 71
1. 利息收入		22, 863. 13	26, 442. 69
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	22, 863. 13	26, 442. 69
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）		37, 769, 584. 78	-25, 798, 943. 53

其中：股票投资收益	6.4.7.14	30,470,240.34	-36,747,213.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	246,794.48	355,774.79
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	-720,484.78	-
股利收益	6.4.7.19	7,773,034.74	10,592,495.52
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	12,481,293.20	-8,506,622.26
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	70,548.49	88,022.39
减：二、营业总支出		2,784,191.61	2,963,719.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,729,694.11	1,827,618.24
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	518,908.22	548,285.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	400,944.87	417,638.08
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		20,719.04	22,155.21
其中：卖出回购金融资产支出		20,719.04	22,155.21
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	113,925.37	148,022.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		47,560,097.99	-37,154,820.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		47,560,097.99	-37,154,820.19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		47,560,097.99	-37,154,820.19

6.3 净资产变动表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：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	390,698,760.56	-	258,575,831.35	649,274,591.91

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	390,698,760.56	-	258,575,831.35	649,274,591.91
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	12,781,820.69	-	59,378,421.06	72,160,241.75
(一)、综合收益总额	-	-	47,560,097.99	47,560,097.99
(二)、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数(净资产减少以 “-”号填列)	12,781,820.69	-	11,818,323.07	24,600,143.76
其中：1. 基金申购款	169,582,966.19	-	121,762,575.40	291,345,541.59
2. 基金赎回款	-156,801,145.50	-	-109,944,252.33	-266,745,397.83
(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	403,480,581.25	-	317,954,252.41	721,434,833.66
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	483,434,527.78	-	252,182,073.93	735,616,601.71
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	483,434,527.78	-	252,182,073.93	735,616,601.71
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	11,859,129.69	-	-31,029,937.03	-19,170,807.34
(一)、综合收益总额	-	-	-37,154,820.19	-37,154,820.19
(二)、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数(净资产减少以 “-”号填列)	11,859,129.69	-	6,124,883.16	17,984,012.85
其中：1. 基金申购款	133,569,927.47	-	64,312,498.36	197,882,425.83

2. 基金赎回款	-121, 710, 797. 78	-	-58, 187, 615. 20	-179, 898, 412. 98
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	495, 293, 657. 47	-	221, 152, 136. 90	716, 445, 794. 37

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

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

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 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	8,243,920.24
等于：本金	8,243,149.88
加：应计利息	770.36
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	8,243,920.24

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	645,316,354.52	-	668,308,441.48	22,992,086.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	38,178,800.00	360,733.15	38,459,413.15	-80,120.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	38,178,800.00	360,733.15	38,459,413.15	-80,120.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		683,495,154.52	360,733.15	706,767,854.63	22,911,966.96

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	11,291,960.00	-	-	-
其中：股指期货投资	11,291,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,291,960.00	-	-	-

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
IC2507	IC2507	10.00	11,734,800.00	442,840.00
合计				442,840.00
减：可抵销期货暂收款				442,840.00
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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	394,673.55
其中：交易所市场	394,673.55
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
应付指数使用费	23,222.21

合计	504,676.21
----	------------

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 500A

项目	本期	
	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	269,018,993.04	269,018,993.04
本期申购	113,619,343.46	113,619,343.46
本期赎回（以“-”号填列）	-91,168,445.61	-91,168,445.61
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	291,469,890.89	291,469,890.89

中金中证 500C

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	121,679,767.52	121,679,767.52
本期申购	55,963,622.73	55,963,622.73
本期赎回（以“-”号填列）	-65,632,699.89	-65,632,699.89
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	112,010,690.36	112,010,690.36

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

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中金中证 500A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	201,424,486.92	-20,829,539.24	180,594,947.68
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	201,424,486.92	-20,829,539.24	180,594,947.68
本期利润	25,142,514.23	9,401,651.18	34,544,165.41
本期基金份额交易产	18,064,011.15	-584,266.96	17,479,744.19

生的变动数			
其中：基金申购款	91,032,654.57	-7,787,519.91	83,245,134.66
基金赎回款	-72,968,643.42	7,203,252.95	-65,765,390.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	244,631,012.30	-12,012,155.02	232,618,857.28

中金中证 500C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	87,443,646.90	-9,462,763.23	77,980,883.67
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	87,443,646.90	-9,462,763.23	77,980,883.67
本期利润	9,936,290.56	3,079,642.02	13,015,932.58
本期基金份额交易产生的变动数	-7,305,461.71	1,644,040.59	-5,661,421.12
其中：基金申购款	43,389,960.83	-4,872,520.09	38,517,440.74
基金赎回款	-50,695,422.54	6,516,560.68	-44,178,861.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	90,074,475.75	-4,739,080.62	85,335,395.13

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	16,074.98
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	5,092.02
其他	1,696.13
合计	22,863.13

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	30,470,240.34
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	30,470,240.34

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	2,079,634,952.38
减：卖出股票成本总额	2,047,040,556.46
减：交易费用	2,124,155.58
买卖股票差价收入	30,470,240.34

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	303,755.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-56,960.80
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	246,794.48

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	30,196,650.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	29,756,960.80
减：应计利息总额	496,650.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-56,960.80

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	-720,484.78

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	7,773,034.74
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	7,773,034.74

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	12,038,453.20
股票投资	12,073,942.40

债券投资	-35,489.20
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	442,840.00
权证投资	-
期货投资	442,840.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	12,481,293.20

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	61,048.97
基金转换费收入	9,499.52
合计	70,548.49

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	23,222.21
划款手续费	3,802.47
其他	120.24
合计	113,925.37

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	958,980,487.33	23.00	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	4,995,010.00	15.85	-	-

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 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	66,500,000.00	35.85	-	-
------	---------------	-------	---	---

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	187,886.40	22.99	-	-
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（%）
-	-	-	-	-

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 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	1,729,694.11	1,827,618.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	793,264.14	808,390.14
应支付基金管理人的净管理费	936,429.97	1,019,228.10

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

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.50%/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	518,908.22	548,285.46

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

日托管费=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 500 指数增强 A	中金中证 500 指数增强 C	合计
	强 A	强 C	
中金财富证券	-	29,147.68	29,147.68
中金基金	-	5,694.76	5,694.76
合计	-	34,842.44	34,842.44
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 500 指数增强 A	中金中证 500 指数增强 C	合计
	强 A	强 C	
中金财富证券	-	20,708.30	20,708.30
中金基金	-	30.18	30.18
合计	-	20,738.48	20,738.48

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；
2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40%的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末。其计算公式为：

C 类基金份额每日应计提的销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

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
工商银行	8, 243, 920. 24	16, 074. 98	4, 738, 640. 76	8, 249. 03

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 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
中金公司	688775	影石创新	网下	5,593	264,381.11
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	8,659	196,212.94
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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内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	2025 年 4 月	6 个月	新股流通	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-

	科技	10 日		受限						
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	321	14,926.50	13,754.85	-
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	100	9,350.00	9,066.00	-
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	-
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
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	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	560	26,471.20	69,529.60	-

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	29,800	888,218.69	1,133,890.00	-
--------	------	-----------------	--------	-------	-----------------	-------	--------	------------	--------------	---

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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，本基金无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用

分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市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	8,243,149.88	-	-	770.36	8,243,920.24
结算备付金	2,126,194.21	-	-	3,745,801.71	5,871,995.92
存出保证金	72,080.34	-	-	1,642,879.10	1,714,959.44
交易性金融资产	38,098,680.00	-	-	668,669,174.63	706,767,854.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,538,120.44	1,538,120.44
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	796,043.39	796,043.39
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	48,540,104.43	-	-	676,392,789.63	724,932,894.06
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	485,111.18	485,111.18
应付赎回款	-	-	-	2,059,656.68	2,059,656.68
应付销售服务费	-	-	-	65,348.36	65,348.36
应付管理人报酬	-	-	-	294,821.52	294,821.52
应付托管费	-	-	-	88,446.45	88,446.45
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	504,676.21	504,676.21
负债总计	-	-	-	3,498,060.40	3,498,060.40

利率敏感度缺口	48,540,104.43	-	-	-672,894,729.23	721,434,833.66
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	5,010,039.33	-	-	360.56	5,010,399.89
结算备付金	2,744,942.59	-	-	367,470.51	3,112,413.10
存出保证金	120,987.79	-	-	59.95	121,047.74
交易性金融资产	36,381,270.00	-	-	-611,284,260.20	647,665,530.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	8,412.07	8,412.07
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	617,645.49	617,645.49
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	44,257,239.71	-	-	-612,278,208.78	656,535,448.49
负债					
卖出回购金融资产款	4,500,000.00	-	-	-328.08	4,499,671.92
应付清算款	-	-	-	297,236.11	297,236.11
应付赎回款	-	-	-	1,435,178.70	1,435,178.70
应付销售服务费	-	-	-	70,487.65	70,487.65
应付管理人报酬	-	-	-	283,672.33	283,672.33
应付托管费	-	-	-	85,101.71	85,101.71
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	589,508.16	589,508.16
负债总计	4,500,000.00	-	-	2,760,856.58	7,260,856.58
利率敏感度缺口	39,757,239.71	-	-	-609,517,352.20	649,274,591.91

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	37,828.89	29,682.30
	市场利率上升 25 个基点	-37,828.89	-29,682.30

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	668,308,441.48	92.64	610,863,466.58	94.08
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	668,308,441.48	92.64	610,863,466.58	94.08

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%	33,907,437.18	30,515,905.82
	业绩比较基准下降 5%	-33,907,437.18	-30,515,905.82

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	666,961,331.99	610,492,423.72
第二层次	39,608,688.69	36,829,800.12
第三层次	197,833.95	343,306.36
合计	706,767,854.63	647,665,530.20

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	668,308,441.48	92.19
	其中：股票	668,308,441.48	92.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,459,413.15	5.31
	其中：债券	38,459,413.15	5.31
	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	14,115,916.16	1.95
8	其他各项资产	4,049,123.27	0.56
9	合计	724,932,894.06	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,578,840.00	0.22
B	采矿业	24,398,414.90	3.38
C	制造业	413,555,284.69	57.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,198,390.00	3.08
E	建筑业	5,611,066.00	0.78
F	批发和零售业	19,045,376.88	2.64
G	交通运输、仓储和邮政业	10,222,275.00	1.42
H	住宿和餐饮业	379,828.53	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,013,112.65	7.63
J	金融业	54,250,186.66	7.52
K	房地产业	4,465,540.40	0.62
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,355,040.54	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	4,474,685.60	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	112,608.00	0.02
Q	卫生和社会工作	1,400,507.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	6,023,957.44	0.83
S	综合	1,375,829.00	0.19

	合计	626,460,943.29	86.84
--	----	----------------	-------

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	32,486,191.85	4.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	157,628.00	0.02
E	建筑业	170,304.00	0.02
F	批发和零售业	270,190.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	310,224.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,290,900.38	0.87
J	金融业	868,913.20	0.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,168,084.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	10,948.76	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	114,114.00	0.02
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	41,847,498.19	5.80

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	300476	胜宏科技	85,700	11,516,366.00	1.60
2	002624	完美世界	545,000	8,267,650.00	1.15
3	601555	东吴证券	927,100	8,112,125.00	1.12
4	688122	西部超导	147,479	7,651,210.52	1.06
5	002841	视源股份	220,700	7,636,220.00	1.06
6	603893	瑞芯微	49,700	7,547,442.00	1.05
7	600166	福田汽车	2,761,600	7,483,936.00	1.04
8	600704	物产中大	1,360,600	7,170,362.00	0.99
9	300017	网宿科技	655,904	7,031,290.88	0.97
10	002532	天山铝业	814,360	6,767,331.60	0.94

11	300627	华测导航	190,680	6,673,800.00	0.93
12	600299	安迪苏	680,230	6,564,219.50	0.91
13	000050	深天马 A	738,700	6,293,724.00	0.87
14	688213	思特威	61,046	6,240,122.12	0.86
15	603816	顾家家居	241,000	6,150,320.00	0.85
16	600873	梅花生物	567,900	6,070,851.00	0.84
17	300573	兴齐眼药	116,860	6,052,179.40	0.84
18	000783	长江证券	856,200	5,933,466.00	0.82
19	300207	欣旺达	286,017	5,737,501.02	0.80
20	002202	金风科技	540,300	5,538,075.00	0.77
21	688278	特宝生物	76,213	5,495,719.43	0.76
22	000988	华工科技	116,003	5,453,301.03	0.76
23	300373	扬杰科技	104,400	5,418,360.00	0.75
24	603486	科沃斯	91,700	5,339,691.00	0.74
25	002410	广联达	397,340	5,328,329.40	0.74
26	688582	芯动联科	77,187	5,186,966.40	0.72
27	300395	菲利华	97,600	4,987,360.00	0.69
28	600578	京能电力	1,110,100	4,984,349.00	0.69
29	600582	天地科技	831,880	4,982,961.20	0.69
30	601991	大唐发电	1,557,600	4,937,592.00	0.68
31	601168	西部矿业	296,180	4,925,473.40	0.68
32	002595	豪迈科技	82,100	4,861,962.00	0.67
33	600563	法拉电子	43,400	4,734,506.00	0.66
34	000987	越秀资本	689,400	4,729,284.00	0.66
35	300604	长川科技	104,000	4,670,640.00	0.65
36	600685	中船防务	170,100	4,625,019.00	0.64
37	000893	亚钾国际	153,200	4,617,448.00	0.64
38	300699	光威复材	145,460	4,606,718.20	0.64
39	000528	柳 工	478,900	4,602,229.00	0.64
40	603529	爱玛科技	131,900	4,537,360.00	0.63
41	002266	浙富控股	1,452,820	4,474,685.60	0.62
42	688425	铁建重工	1,095,732	4,470,586.56	0.62
43	002517	恺英网络	224,100	4,327,371.00	0.60
44	600739	辽宁成大	391,299	4,304,289.00	0.60
45	603379	三美股份	89,000	4,282,680.00	0.59
46	688387	信科移动	742,213	4,193,503.45	0.58
47	600298	安琪酵母	119,124	4,189,591.08	0.58
48	600062	华润双鹤	219,900	4,103,334.00	0.57
49	600885	宏发股份	183,035	4,083,510.85	0.57
50	600998	九州通	776,292	3,990,140.88	0.55
51	688578	艾力斯	42,345	3,939,778.80	0.55
52	603858	步长制药	242,400	3,936,576.00	0.55
53	000563	陕国投 A	1,074,800	3,837,036.00	0.53

54	000709	河钢股份	1, 774, 800	3, 833, 568. 00	0. 53
55	601216	君正集团	692, 300	3, 821, 496. 00	0. 53
56	300803	指南针	47, 270	3, 812, 798. 20	0. 53
57	600008	首创环保	1, 231, 800	3, 720, 036. 00	0. 52
58	603087	甘李药业	66, 800	3, 659, 304. 00	0. 51
59	689009	九号公司	61, 520	3, 640, 138. 40	0. 50
60	601568	北元集团	873, 773	3, 626, 157. 95	0. 50
61	688469	芯联集成	747, 897	3, 567, 468. 69	0. 49
62	000959	首钢股份	1, 045, 298	3, 554, 013. 20	0. 49
63	002500	山西证券	599, 000	3, 498, 160. 00	0. 48
64	002939	长城证券	409, 700	3, 433, 286. 00	0. 48
65	688100	威胜信息	92, 254	3, 418, 010. 70	0. 47
66	002850	科达利	29, 800	3, 372, 466. 00	0. 47
67	688099	晶晨股份	47, 126	3, 346, 417. 26	0. 46
68	688608	恒玄科技	9, 517	3, 311, 725. 66	0. 46
69	300251	光线传媒	162, 600	3, 295, 902. 00	0. 46
70	603156	养元饮品	153, 600	3, 250, 176. 00	0. 45
71	600909	华安证券	553, 000	3, 223, 990. 00	0. 45
72	600688	上海石化	1, 106, 700	3, 154, 095. 00	0. 44
73	000997	新 大 陆	97, 000	3, 140, 860. 00	0. 44
74	002138	顺络电子	111, 500	3, 135, 380. 00	0. 43
75	601717	中创智领	188, 133	3, 126, 770. 46	0. 43
76	688188	柏楚电子	23, 243	3, 060, 173. 38	0. 42
77	002414	高德红外	291, 234	2, 985, 148. 50	0. 41
78	000683	博源化工	623, 100	2, 984, 649. 00	0. 41
79	000009	中国宝安	331, 000	2, 939, 280. 00	0. 41
80	601958	金钼股份	266, 850	2, 919, 339. 00	0. 40
81	688772	珠海冠宇	203, 123	2, 902, 627. 67	0. 40
82	600348	华阳股份	435, 000	2, 897, 100. 00	0. 40
83	600988	赤峰黄金	115, 500	2, 873, 640. 00	0. 40
84	603596	伯特利	53, 940	2, 842, 098. 60	0. 39
85	002958	青农商行	776, 300	2, 802, 443. 00	0. 39
86	000878	云南铜业	219, 700	2, 794, 584. 00	0. 39
87	600096	云天化	127, 100	2, 792, 387. 00	0. 39
88	601233	桐昆股份	262, 500	2, 782, 500. 00	0. 39
89	600352	浙江龙盛	270, 500	2, 748, 280. 00	0. 38
90	600499	科达制造	279, 400	2, 738, 120. 00	0. 38
91	002572	索菲亚	195, 400	2, 737, 554. 00	0. 38
92	600483	福能股份	282, 600	2, 724, 264. 00	0. 38
93	000898	鞍钢股份	1, 172, 800	2, 720, 896. 00	0. 38
94	000960	锡业股份	176, 900	2, 706, 570. 00	0. 38
95	600699	均胜电子	154, 753	2, 698, 892. 32	0. 37
96	000932	华菱钢铁	607, 700	2, 673, 880. 00	0. 37

97	601615	明阳智能	230,800	2,651,892.00	0.37
98	600737	中粮糖业	271,800	2,568,510.00	0.36
99	603565	中谷物流	266,000	2,540,300.00	0.35
100	688235	百济神州	10,800	2,523,312.00	0.35
101	600498	烽火通信	119,676	2,516,786.28	0.35
102	600871	石化油服	1,287,800	2,511,210.00	0.35
103	002340	格林美	394,500	2,505,075.00	0.35
104	300054	鼎龙股份	87,200	2,500,896.00	0.35
105	000825	太钢不锈	684,900	2,458,791.00	0.34
106	002244	滨江集团	252,100	2,457,975.00	0.34
107	002507	涪陵榨菜	191,900	2,454,401.00	0.34
108	601880	辽港股份	1,630,200	2,445,300.00	0.34
109	002155	湖南黄金	136,610	2,438,488.50	0.34
110	600170	上海建工	1,010,000	2,413,900.00	0.33
111	300458	全志科技	60,600	2,405,214.00	0.33
112	600435	北方导航	153,600	2,394,624.00	0.33
113	603659	璞泰来	125,200	2,351,256.00	0.33
114	688120	华海清科	13,610	2,296,007.00	0.32
115	000060	中金岭南	494,200	2,263,436.00	0.31
116	000636	风华高科	164,460	2,259,680.40	0.31
117	600517	国网英大	427,300	2,179,230.00	0.30
118	000513	丽珠集团	60,100	2,166,004.00	0.30
119	600959	江苏有线	624,100	2,146,904.00	0.30
120	300595	欧普康视	140,000	2,137,800.00	0.30
121	002080	中材科技	109,500	2,135,250.00	0.30
122	600380	健康元	193,292	2,132,010.76	0.30
123	603868	飞科电器	59,100	2,119,917.00	0.29
124	688538	和辉光电	894,600	2,093,364.00	0.29
125	601333	广深铁路	705,800	2,039,762.00	0.28
126	000027	深圳能源	319,100	2,035,858.00	0.28
127	000728	国元证券	257,800	2,034,042.00	0.28
128	300677	英科医疗	81,400	1,927,552.00	0.27
129	600131	国网信通	108,000	1,911,600.00	0.26
130	600535	天士力	121,193	1,896,670.45	0.26
131	300888	稳健医疗	46,000	1,890,600.00	0.26
132	601965	中国汽研	105,100	1,865,525.00	0.26
133	600392	盛和资源	141,400	1,862,238.00	0.26
134	600132	重庆啤酒	33,600	1,851,360.00	0.26
135	600497	驰宏锌锗	343,400	1,816,586.00	0.25
136	688183	生益电子	34,200	1,751,040.00	0.24
137	300454	深信服	18,500	1,742,330.00	0.24
138	000921	海信家电	67,300	1,729,610.00	0.24
139	002739	万达电影	148,700	1,699,641.00	0.24

140	603979	金诚信	35,700	1,657,908.00	0.23
141	002683	广东宏大	48,400	1,642,696.00	0.23
142	301165	锐捷网络	26,720	1,642,211.20	0.23
143	600820	隧道股份	269,100	1,641,510.00	0.23
144	002461	珠江啤酒	142,100	1,604,309.00	0.22
145	300140	节能环保	259,500	1,601,115.00	0.22
146	601118	海南橡胶	334,500	1,578,840.00	0.22
147	600707	彩虹股份	243,750	1,574,625.00	0.22
148	001696	宗申动力	70,000	1,571,500.00	0.22
149	300496	中科创达	27,300	1,562,106.00	0.22
150	300558	贝达药业	26,700	1,547,265.00	0.21
151	600928	西安银行	390,500	1,530,760.00	0.21
152	002130	沃尔核材	62,700	1,493,514.00	0.21
153	600673	东阳光	118,300	1,375,829.00	0.19
154	688180	君实生物	40,153	1,364,398.94	0.19
155	600884	杉杉股份	142,300	1,346,158.00	0.19
156	002430	杭氧股份	67,900	1,318,618.00	0.18
157	600637	东方明珠	172,800	1,290,816.00	0.18
158	601918	新集能源	193,000	1,246,780.00	0.17
159	000429	粤高速 A	91,800	1,223,694.00	0.17
160	600487	亨通光电	79,700	1,219,410.00	0.17
161	300763	锦浪科技	21,200	1,216,668.00	0.17
162	002603	以岭药业	85,300	1,202,730.00	0.17
163	002153	石基信息	137,280	1,188,844.80	0.16
164	600056	中国医药	110,800	1,145,672.00	0.16
165	600325	华发股份	233,500	1,137,145.00	0.16
166	601665	齐鲁银行	173,000	1,093,360.00	0.15
167	003022	联泓新科	66,600	1,054,278.00	0.15
168	603129	春风动力	4,600	995,900.00	0.14
169	600511	国药股份	34,000	991,440.00	0.14
170	300919	中伟股份	30,100	989,688.00	0.14
171	600271	航天信息	106,800	986,832.00	0.14
172	600529	山东药玻	43,700	967,518.00	0.13
173	300073	当升科技	21,400	938,818.00	0.13
174	002273	水晶光电	47,000	938,590.00	0.13
175	002078	太阳纸业	69,300	932,778.00	0.13
176	600862	中航高科	35,600	928,448.00	0.13
177	600143	金发科技	89,900	926,869.00	0.13
178	002385	大北农	226,600	915,464.00	0.13
179	002409	雅克科技	16,700	913,323.00	0.13
180	603298	杭叉集团	43,100	902,945.00	0.13
181	000729	燕京啤酒	69,800	902,514.00	0.13
182	600312	平高电气	57,900	891,081.00	0.12

183	600398	海澜之家	127,300	886,008.00	0.12
184	601456	国联民生	83,100	860,085.00	0.12
185	600970	中材国际	98,900	848,562.00	0.12
186	002773	康弘药业	28,800	834,336.00	0.12
187	601158	重庆水务	179,800	834,272.00	0.12
188	600038	中直股份	21,300	826,653.00	0.11
189	688475	萤石网络	25,369	799,630.88	0.11
190	300748	金力永磁	33,300	793,872.00	0.11
191	002318	久立特材	32,900	769,531.00	0.11
192	600956	新天绿能	95,600	738,032.00	0.10
193	301498	乖宝宠物	6,700	732,779.00	0.10
194	600968	海油发展	177,000	722,160.00	0.10
195	600528	中铁工业	97,483	719,424.54	0.10
196	601577	长沙银行	71,500	710,710.00	0.10
197	600606	绿地控股	433,800	707,094.00	0.10
198	601156	东航物流	53,600	701,624.00	0.10
199	688777	中控技术	15,129	679,443.39	0.09
200	002558	巨人网络	27,000	635,850.00	0.09
201	600060	海信视像	27,100	623,842.00	0.09
202	605589	圣泉集团	21,100	585,525.00	0.08
203	300001	特锐德	24,400	584,868.00	0.08
204	603225	新凤鸣	54,200	577,230.00	0.08
205	688568	中科星图	15,400	554,554.00	0.08
206	000623	吉林敖东	32,480	550,536.00	0.08
207	600763	通策医疗	13,200	544,896.00	0.08
208	603939	益丰药房	22,100	540,787.00	0.07
209	003031	中瓷电子	9,900	526,779.00	0.07
210	601099	太平洋	132,500	520,725.00	0.07
211	600109	国金证券	59,100	518,307.00	0.07
212	603589	口子窖	14,700	511,560.00	0.07
213	601598	中国外运	102,900	507,297.00	0.07
214	000426	兴业银锡	31,700	500,860.00	0.07
215	688617	惠泰医疗	1,664	494,208.00	0.07
216	600282	南钢股份	116,800	490,560.00	0.07
217	601128	常熟银行	66,358	489,058.46	0.07
218	601016	节能风电	168,600	487,254.00	0.07
219	002670	国盛金控	32,300	486,115.00	0.07
220	300529	健帆生物	22,500	485,325.00	0.07
221	002152	广电运通	36,100	485,184.00	0.07
222	002673	西部证券	59,800	471,224.00	0.07
223	600208	衢州发展	158,615	469,500.40	0.07
224	003035	南网能源	102,200	469,098.00	0.07
225	688361	中科飞测	5,543	466,665.17	0.06

226	002926	华西证券	51,900	463,986.00	0.06
227	002294	信立泰	9,800	463,834.00	0.06
228	601636	旗滨集团	91,800	459,918.00	0.06
229	601098	中南传媒	35,000	459,200.00	0.06
230	301358	湖南裕能	14,700	458,493.00	0.06
231	603233	大参林	27,900	454,770.00	0.06
232	000034	神州数码	11,900	447,916.00	0.06
233	600098	广州发展	71,300	445,625.00	0.06
234	000739	普洛药业	31,800	445,200.00	0.06
235	603688	石英股份	12,600	443,772.00	0.06
236	688819	天能股份	15,957	442,966.32	0.06
237	300567	精测电子	7,300	442,453.00	0.06
238	301267	华夏眼科	22,700	435,159.00	0.06
239	002439	启明星辰	26,800	428,532.00	0.06
240	600764	中国海防	12,500	425,000.00	0.06
241	601139	深圳燃气	66,800	424,848.00	0.06
242	002821	凯莱英	4,800	423,600.00	0.06
243	600580	卧龙电驱	21,340	421,891.80	0.06
244	603338	浙江鼎力	8,900	421,860.00	0.06
245	002025	航天电器	8,200	421,562.00	0.06
246	002044	美年健康	81,800	420,452.00	0.06
247	002056	横店东磁	29,400	416,010.00	0.06
248	603927	中科软	21,413	414,127.42	0.06
249	603605	珀莱雅	5,000	413,950.00	0.06
250	002984	森麒麟	21,956	411,675.00	0.06
251	601921	浙版传媒	50,400	406,224.00	0.06
252	603737	三棵树	10,960	403,876.00	0.06
253	002203	海亮股份	38,900	401,448.00	0.06
254	603885	吉祥航空	29,800	401,406.00	0.06
255	600895	张江高科	15,600	400,920.00	0.06
256	000039	中集集团	50,500	396,930.00	0.06
257	002653	海思科	9,400	396,868.00	0.06
258	600808	马钢股份	112,300	387,435.00	0.05
259	000539	粤电力 A	85,200	386,808.00	0.05
260	688234	天岳先进	6,600	386,430.00	0.05
261	688052	纳芯微	2,200	383,878.00	0.05
262	600329	达仁堂	11,500	383,640.00	0.05
263	603179	新泉股份	8,100	380,457.00	0.05
264	600258	首旅酒店	26,881	379,828.53	0.05
265	600612	老凤祥	7,600	378,100.00	0.05
266	300751	迈为股份	5,400	375,624.00	0.05
267	002281	光迅科技	7,600	374,832.00	0.05
268	000887	中鼎股份	21,000	369,390.00	0.05

269	000723	美锦能源	83,900	362,448.00	0.05
270	301301	川宁生物	29,900	359,996.00	0.05
271	600995	南网储能	36,800	359,904.00	0.05
272	603556	海兴电力	14,100	359,127.00	0.05
273	002299	圣农发展	25,000	357,250.00	0.05
274	600801	华新水泥	29,200	345,728.00	0.05
275	002508	老板电器	17,800	338,378.00	0.05
276	600816	建元信托	106,000	312,700.00	0.04
277	002120	韵达股份	46,200	309,540.00	0.04
278	002261	拓维信息	10,000	309,500.00	0.04
279	300037	新宙邦	7,900	278,080.00	0.04
280	002945	华林证券	16,000	229,920.00	0.03
281	002429	兆驰股份	46,000	201,480.00	0.03
282	002472	双环传动	5,900	197,591.00	0.03
283	000537	中绿电	14,300	119,548.00	0.02
284	603786	科博达	2,100	116,361.00	0.02
285	002607	中公教育	36,800	112,608.00	0.02
286	002563	森马服饰	21,300	112,038.00	0.02
287	601928	凤凰传媒	9,800	109,466.00	0.02
288	600486	扬农化工	1,800	104,400.00	0.01
289	600872	中炬高新	5,160	98,040.00	0.01
290	600925	苏能股份	12,000	62,760.00	0.01
291	000830	鲁西化工	6,000	61,800.00	0.01
292	601019	山东出版	5,652	53,524.44	0.01
293	601866	中远海发	21,600	53,352.00	0.01
294	000423	东阿阿胶	779	40,741.70	0.01
295	300339	润和软件	700	35,581.00	0.00
296	688385	复旦微电	667	32,863.09	0.00
297	002966	苏州银行	3,200	28,096.00	0.00
298	688072	拓荆科技	172	26,438.12	0.00
299	603345	安井食品	300	24,126.00	0.00
300	688248	南网科技	649	20,417.54	0.00
301	688032	禾迈股份	175	17,475.50	0.00
302	688297	中无人机	195	10,413.00	0.00
303	688375	国博电子	167	10,021.67	0.00
304	688520	神州细胞	161	9,635.85	0.00
305	688002	睿创微纳	135	9,412.20	0.00
306	688778	厦钨新能	168	9,394.56	0.00
307	688563	航材股份	165	9,343.95	0.00
308	688363	华熙生物	175	8,986.25	0.00
309	688065	凯赛生物	107	5,039.70	0.00
310	688349	三一重能	189	4,713.66	0.00
311	688153	唯捷创芯	126	3,907.26	0.00

312	688249	晶合集成	157	3,182.39	0.00
313	002262	恩华药业	67	1,392.26	0.00
314	300724	捷佳伟创	22	1,194.60	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688108	赛诺医疗	203,401	2,282,159.22	0.32
2	300685	艾德生物	104,400	2,247,732.00	0.31
3	688208	道通科技	72,740	2,225,844.00	0.31
4	600458	时代新材	156,500	2,147,180.00	0.30
5	300369	绿盟科技	233,700	1,815,849.00	0.25
6	688313	仕佳光子	29,800	1,133,890.00	0.16
7	688636	智明达	31,651	1,069,487.29	0.15
8	688280	精进电动	143,432	1,042,750.64	0.14
9	300048	合康新能	171,600	1,007,292.00	0.14
10	300502	新易盛	7,776	987,707.52	0.14
11	688256	寒武纪	1,600	962,400.00	0.13
12	603444	吉比特	3,000	905,850.00	0.13
13	300879	大叶股份	22,800	895,584.00	0.12
14	002487	大金重工	26,900	885,010.00	0.12
15	688262	国芯科技	29,522	787,351.74	0.11
16	603456	九洲药业	50,800	772,668.00	0.11
17	600866	星湖科技	109,400	755,954.00	0.10
18	688008	澜起科技	8,800	721,600.00	0.10
19	000553	安道麦 A	99,600	719,112.00	0.10
20	600460	士兰微	28,800	714,816.00	0.10
21	002010	传化智联	127,800	713,124.00	0.10
22	300866	安克创新	6,021	683,985.60	0.09
23	002408	齐翔腾达	132,200	592,256.00	0.08
24	000333	美的集团	7,300	527,060.00	0.07
25	300548	长芯博创	7,000	467,390.00	0.06
26	301236	软通动力	8,500	464,440.00	0.06
27	002769	普路通	47,000	454,960.00	0.06
28	002268	电科网安	24,400	446,276.00	0.06
29	002407	多氟多	33,900	413,241.00	0.06
30	688331	荣昌生物	6,747	408,193.50	0.06
31	601567	三星医疗	18,000	403,560.00	0.06
32	688567	孚能科技	27,582	399,939.00	0.06
33	600760	中航沈飞	6,600	386,892.00	0.05
34	300199	翰宇药业	22,800	377,340.00	0.05
35	300118	东方日升	39,200	375,536.00	0.05
36	300769	德方纳米	11,200	369,824.00	0.05
37	003010	若羽臣	6,060	367,236.00	0.05

38	603113	金能科技	52,100	361,053.00	0.05
39	002690	美亚光电	21,190	357,475.30	0.05
40	600216	浙江医药	23,600	349,044.00	0.05
41	600016	民生银行	70,000	332,500.00	0.05
42	002728	特一药业	39,500	332,195.00	0.05
43	688516	奥特维	9,940	330,405.60	0.05
44	300824	北鼎股份	26,900	320,917.00	0.04
45	600372	中航机载	26,100	314,766.00	0.04
46	600176	中国巨石	27,600	314,640.00	0.04
47	600179	安通控股	112,400	310,224.00	0.04
48	002290	禾盛新材	9,800	306,250.00	0.04
49	003038	鑫铂股份	15,500	302,095.00	0.04
50	002373	千方科技	31,000	288,300.00	0.04
51	603586	金麒麟	15,700	287,624.00	0.04
52	002846	英联股份	14,300	285,428.00	0.04
53	302132	中航成飞	3,200	281,408.00	0.04
54	600983	惠而浦	26,700	277,146.00	0.04
55	002867	周大生	20,500	270,190.00	0.04
56	300737	科顺股份	54,400	262,208.00	0.04
57	300045	华力创通	13,500	257,715.00	0.04
58	603288	海天味业	5,900	229,569.00	0.03
59	603093	南华期货	9,800	218,834.00	0.03
60	603095	越剑智能	12,540	206,032.20	0.03
61	600703	三安光电	15,400	191,268.00	0.03
62	002019	亿帆医药	14,400	187,056.00	0.03
63	002761	浙江建投	19,200	170,304.00	0.02
64	000778	新兴铸管	45,700	170,004.00	0.02
65	002625	光启技术	4,100	163,918.00	0.02
66	600926	杭州银行	9,700	163,154.00	0.02
67	002701	奥瑞金	26,600	158,270.00	0.02
68	002557	洽洽食品	5,593	120,920.66	0.02
69	600223	福瑞达	13,900	114,258.00	0.02
70	000035	中国天楹	26,600	114,114.00	0.02
71	688005	容百科技	4,648	103,743.36	0.01
72	601702	华峰铝业	5,600	88,984.00	0.01
73	603799	华友钴业	2,400	88,848.00	0.01
74	688266	泽璟制药	800	86,008.00	0.01
75	688775	影石创新	560	69,529.60	0.01
76	688246	嘉和美康	2,000	58,780.00	0.01
77	002479	富春环保	11,400	57,114.00	0.01
78	002179	中航光电	1,400	56,504.00	0.01
79	601939	建设银行	5,700	53,808.00	0.01
80	603323	苏农银行	9,320	52,285.20	0.01

81	300782	卓胜微	700	49,959.00	0.01
82	688357	建龙微纳	1,715	49,374.85	0.01
83	601988	中国银行	8,600	48,332.00	0.01
84	301153	中科江南	1,700	44,540.00	0.01
85	002976	瑞玛精密	1,700	44,200.00	0.01
86	300451	创业慧康	6,500	36,725.00	0.01
87	000531	穗恒运 A	5,300	32,595.00	0.00
88	300568	星源材质	2,300	29,164.00	0.00
89	600674	川投能源	1,700	27,268.00	0.00
90	688095	福昕软件	400	27,164.00	0.00
91	603501	豪威集团	200	25,530.00	0.00
92	688639	华恒生物	800	25,360.00	0.00
93	600602	云赛智联	1,200	24,204.00	0.00
94	688049	炬芯科技	400	24,200.00	0.00
95	301458	钧崑电子	701	23,911.11	0.00
96	600025	华能水电	2,500	23,875.00	0.00
97	688007	光峰科技	1,600	23,136.00	0.00
98	688088	虹软科技	450	21,712.50	0.00
99	002859	洁美科技	1,000	19,910.00	0.00
100	301162	国能日新	360	18,604.80	0.00
101	688147	微导纳米	600	18,108.00	0.00
102	601985	中国核电	1,800	16,776.00	0.00
103	600845	宝信软件	700	16,534.00	0.00
104	688630	芯碁微装	200	15,874.00	0.00
105	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
106	603049	中策橡胶	321	13,754.85	0.00
107	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
108	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
109	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
110	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
111	603202	天有为	100	9,066.00	0.00
112	688131	皓元医药	166	8,026.10	0.00
113	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
114	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
115	688185	康希诺	110	6,559.30	0.00
116	688196	卓越新能	120	5,768.40	0.00
117	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
118	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
119	688216	气派科技	196	4,494.28	0.00
120	688276	百克生物	186	3,906.00	0.00
121	688369	致远互联	124	3,272.36	0.00
122	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
123	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00

124	688533	上声电子	106	2,854.58	0.00
125	688128	中国电研	107	2,621.50	0.00
126	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
127	688658	悦康药业	105	1,999.20	0.00
128	688588	凌志软件	114	1,660.98	0.00
129	688660	电气风电	167	1,449.56	0.00
130	300628	亿联网络	36	1,251.36	0.00
131	688055	龙腾光电	113	418.10	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	688469	芯联集成	13,317,437.93	2.05
2	603893	瑞芯微	13,002,367.00	2.00
3	600166	福田汽车	12,997,564.00	2.00
4	300803	指南针	12,573,995.00	1.94
5	603816	顾家家居	12,480,866.94	1.92
6	002624	完美世界	12,280,631.00	1.89
7	300017	网宿科技	12,108,332.00	1.86
8	601555	东吴证券	11,902,436.00	1.83
9	688278	特宝生物	11,590,130.67	1.79
10	688425	铁建重工	11,419,091.65	1.76
11	002410	广联达	11,252,891.40	1.73
12	002841	视源股份	11,207,038.00	1.73
13	300699	光威复材	11,117,609.56	1.71
14	601168	西部矿业	10,923,044.00	1.68
15	000988	华工科技	10,801,500.00	1.66
16	000783	长江证券	10,733,954.00	1.65
17	300476	胜宏科技	10,629,559.00	1.64
18	300207	欣旺达	10,607,967.00	1.63
19	000987	越秀资本	9,869,572.14	1.52
20	300373	扬杰科技	9,785,509.76	1.51

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	002558	巨人网络	14,992,861.00	2.31
2	300476	胜宏科技	14,910,697.00	2.30
3	300866	安克创新	14,784,345.00	2.28
4	000997	新大陆	13,937,583.00	2.15
5	600096	云天化	13,838,820.00	2.13

6	002683	广东宏大	12,969,537.00	2.00
7	300558	贝达药业	12,964,272.00	2.00
8	002625	光启技术	12,865,278.00	1.98
9	688002	睿创微纳	12,698,445.63	1.96
10	688578	艾力斯	11,777,502.22	1.81
11	601168	西部矿业	11,449,396.00	1.76
12	603129	春风动力	11,364,704.00	1.75
13	002410	广联达	11,066,376.80	1.70
14	300699	光威复材	11,063,915.00	1.70
15	002517	恺英网络	10,959,751.00	1.69
16	002273	水晶光电	10,779,499.00	1.66
17	601399	国机重装	10,309,752.00	1.59
18	600487	亨通光电	10,280,034.00	1.58
19	300207	欣旺达	10,276,312.00	1.58
20	688469	芯联集成	10,194,724.07	1.57

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	2,092,029,656.42
卖出股票收入（成交）总额	2,079,634,952.38

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	38,459,413.15	5.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	38,459,413.15	5.33

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	019766	25 国债 01	210,000	21,092,555.34	2.92
2	019723	23 国债 20	55,000	5,605,431.23	0.78

3	019758	24 国债 21	50,000	5,044,865.75	0.70
4	019683	22 国债 18	46,000	4,691,149.32	0.65
5	019749	24 国债 15	20,000	2,025,411.51	0.28

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中，东吴证券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	1,714,959.44
2	应收清算款	1,538,120.44
3	应收股利	—

4	应收利息	-
5	应收申购款	796,043.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,049,123.27

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	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 500 指 数增强 A	100,255	2,907.29	11,335,445.77	3.89	280,134,445.12	96.11
中金中证 500 指 数增强 C	34,824	3,216.48	5,438,912.58	4.86	106,571,777.78	95.14
合计	135,079	2,987.00	16,774,358.35	4.16	386,706,222.90	95.84

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 500 指数增 强 A	600,261.57	0.2059
	中金中证 500 指数增 强 C	7,417.10	0.0066
	合计	607,678.67	0.1506

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 500 指数增强 A	10~50
	中金中证 500 指数增强 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 500 指数增强 A	0~10
	中金中证 500 指数增强 C	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金已成立满三年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）基金份额总额	10,001,000.00	—
本报告期期初基金份额总额	269,018,993.04	121,679,767.52
本报告期基金总申购份额	113,619,343.46	55,963,622.73
减：本报告期基金总赎回份额	91,168,445.61	65,632,699.89
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	291,469,890.89	112,010,690.36

§ 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

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰海通	4	1,185,504,992.03	28.43	232,310.94	28.43	-
中金公司	2	958,980,487.33	23.00	187,886.40	22.99	-
申万宏源	2	754,276,129.52	18.09	147,858.14	18.09	-
广发证券	2	667,344,656.02	16.00	130,795.42	16.00	-
中信建投	4	604,230,398.92	14.49	118,371.86	14.48	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国联民生	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 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）。

3、国泰君安证券股份有限公司自合并交割日 2025 年 3 月 14 日起吸收合并海通证券股份有限公司。根据《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自 2025 年 4 月 3 日起，国泰君安证券股份有限公司中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

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 (%)
国泰海通	20,969,750.00	66.55	15,000,000.00	8.09	-	-
中金公司	4,995,010.00	15.85	66,500,000.00	35.85	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

广发证 券	5, 545, 100. 00	17. 60	83, 000, 000. 00	44. 74	-	-
中信建 投	-	-	21, 000, 000. 00	11. 32	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国联民 生	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司旗下基金 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 500 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 500 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	2025-3-19
4	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金托管协议	中国证监会规定媒介	2025-3-19

5	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
6	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025-3-21
7	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025-3-21
8	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
9	中金中证 500 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
10	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
11	中金中证 500 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
12	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
13	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2025-6-5

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金申请募集注册的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照

8、报告期内中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告

9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人和/或基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/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，可咨询本基金管理人。

咨询电话：010-63211122 400-868-1166

传真：010-66159121

中金基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日