

中金景气驱动混合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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1. 1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金经理及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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遵规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见	11
§ 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	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	56
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	56
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	56

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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 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	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金景气驱动混合型发起式证券投资基金	
基金简称	中金景气驱动混合发起	
基金主代码	015633	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 5 月 5 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	223,719,694.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金景气驱动混合发起 A	中金景气驱动混合发起 C
下属分级基金的交易代码	015633	015634
报告期末下属分级基金的份额总额	185,858,689.88 份	37,861,004.40 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在密切跟踪和深入研究的基础上，捕捉行业及个股景气边际变化带来的投资机会，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用“自上而下”的分析方法，综合分析宏观经济周期与形势、货币政策、财政政策、利率走势、资金供求、流动性风险、信用风险等因素，分析比较债券市场、股票市场及现金类资产的收益风险特征，动态调整各大类资产的投资比例，控制投资组合的系统性风险。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、普通债券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、可交换债券投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、证券公司短期公司债券投资策略；9、国债期货投资策略；10、股指期货投资策略；11、股票期权投资策略；12、融资业务投资策略；13、信用衍生品投资策略。详见《中金景气驱动混合型发起式证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*85%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*5%+中债-综合全价（总值）指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。 本基金投资于港股通标的股票，还需面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中金基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰
	联系电话	010-63211122
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com
客户服务电话	400-868-1166	021-60637228
传真	010-66159121	021-60635778
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号	北京市西城区金融大街 25 号

	国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100004	100033
法定代表人	李金泽	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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)	
	中金景气驱动混合发起 A	中金景气驱动混合发起 C
本期已实现收益	1,104,685.16	201,703.99
本期利润	2,538,182.34	809,840.76
加权平均基金份额本期利润	0.0273	0.0257
本期加权平均净值利润率	2.53%	2.44%
本期基金份额净值增长率	6.98%	6.55%
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	10,300,778.96	1,079,127.54
期末可供分配基金份额利润	0.0554	0.0285
期末基金资产净值	206,475,539.17	41,011,977.13
期末基金份额净值	1.1109	1.0832
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	11.09%	8.32%

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

中金景气驱动混合发起 A

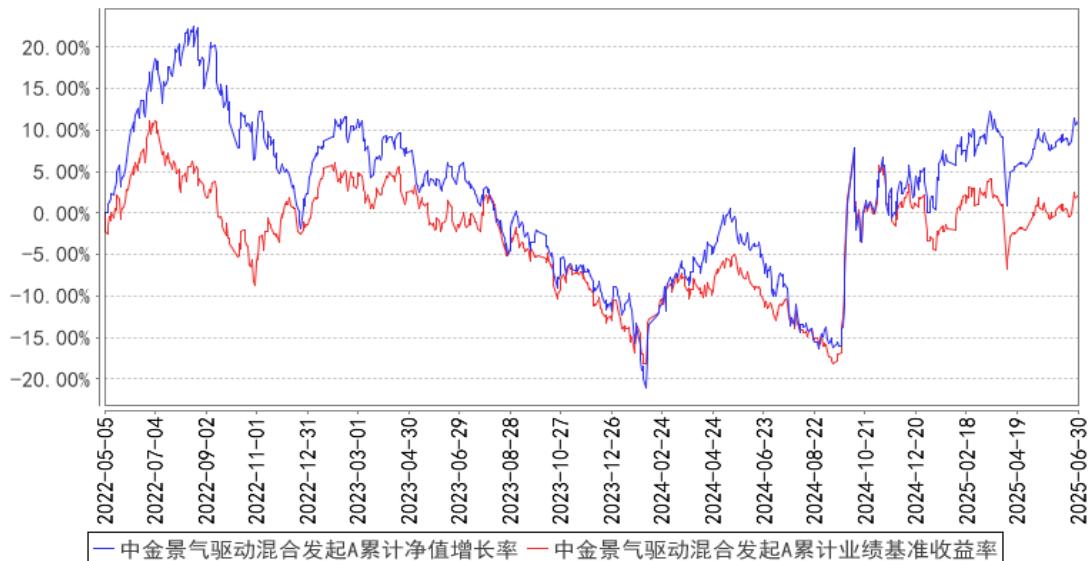
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.14%	0.55%	2.69%	0.56%	0.45%	-0.01%
过去三个月	1.83%	1.06%	1.33%	1.09%	0.50%	-0.03%
过去六个月	6.98%	1.08%	1.68%	1.00%	5.30%	0.08%
过去一年	19.46%	1.47%	15.17%	1.28%	4.29%	0.19%
过去三年	-4.47%	1.16%	-7.74%	1.01%	3.27%	0.15%
自基金合同生效起至今	11.09%	1.16%	2.17%	1.01%	8.92%	0.15%

中金景气驱动混合发起 C

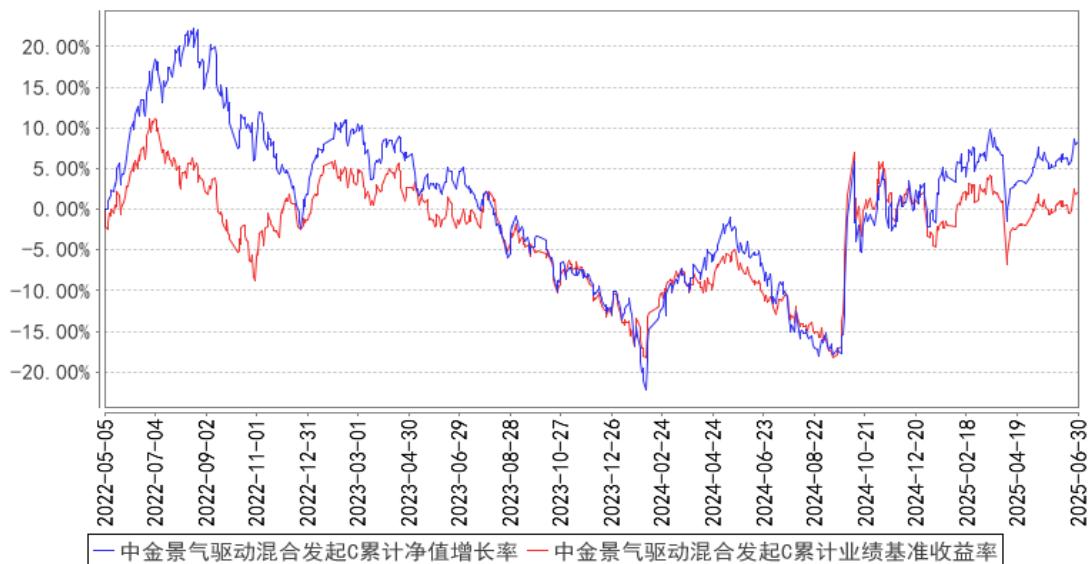
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.07%	0.55%	2.69%	0.56%	0.38%	-0.01%
过去三个月	1.62%	1.06%	1.33%	1.09%	0.29%	-0.03%
过去六个月	6.55%	1.08%	1.68%	1.00%	4.87%	0.08%
过去一年	18.51%	1.46%	15.17%	1.28%	3.34%	0.18%
过去三年	-6.74%	1.16%	-7.74%	1.01%	1.00%	0.15%
自基金合同生效起至今	8.32%	1.16%	2.17%	1.01%	6.15%	0.15%

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

中金景气驱动混合发起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



中金景气驱动混合发起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



§ 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		
王家列	本基金基 金经理	2025 年 3 月 25 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。
丁杨	本基金基 金经理	2022 年 5 月 5 日	2025 年 6 月 16 日	10 年	丁杨先生，经济学硕士。历任蚂蚁集团分析师；中金基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理助理。现任中金基金管理有限公司权益部基金经理。

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、管理人于 2025 年 7 月 4 日发布公告，增聘闫鑫女士担任本基金基金经理。

3、本基金无基金经理助理。

4、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

本报告期内，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，本基金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景气驱动混合发起 A 基金份额净值为 1.1109 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.98%，同期业绩基准收益率为 1.68%；中金景气驱动混合发起 C 基金份额净值为 1.0832 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.55%，同期业绩基准收益率为 1.68%。

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。

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，本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金景气驱动混合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	981,662.08	1,316,682.06
结算备付金		544,610.92	82,686.93
存出保证金		53,761.28	5,052.32
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	246,961,761.65	11,444,861.00
其中：股票投资		232,823,290.01	11,241,469.60
基金投资		—	—
债券投资		14,138,471.64	203,391.40
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		3,440,938.72	—
应收股利		—	—
应收申购款		10,080,300.00	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6. 4. 7. 8	—	—
资产总计		262,063,034.65	12,849,282.31
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		11,000,000.00	—
应付清算款		3,283,599.41	20,733.36
应付赎回款		22,725.32	—

应付管理人报酬		126,135.64	12,976.35
应付托管费		21,022.58	2,162.72
应付销售服务费		34,930.00	3,757.07
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	87,105.40	38,572.54
负债合计		14,575,518.35	78,202.04
净资产：			
实收基金	6. 4. 7. 10	223,719,694.28	12,413,304.94
其他综合收益	6. 4. 7. 11	—	—
未分配利润	6. 4. 7. 12	23,767,822.02	357,775.33
净资产合计		247,487,516.30	12,771,080.27
负债和净资产总计		262,063,034.65	12,849,282.31

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，中金景气驱动混合发起 A 的基金份额净值为 1.1109 元，期末份额总额为 185,858,689.88 份；中金景气驱动混合发起 C 的基金份额净值为 1.0832 元，期末份额总额为 37,861,004.40 份。基金份额总额 223,719,694.28 份。

6.2 利润表

会计主体：中金景气驱动混合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、营业收入		3,967,223.79	319,995.89
1. 利息收入		7,909.37	7,254.14
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	7,398.83	2,157.88
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		510.54	5,096.26
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,898,096.67	201,967.12
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	-744,165.54	45,095.36
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6. 4. 7. 15	41,646.56	—
资产支持证券投资收益	6. 4. 7. 16	—	—
贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	—	—
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	—	—
股利收益	6. 4. 7. 19	2,600,615.65	156,871.76
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, 041, 633. 95	110, 738. 97
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	19, 583. 80	35. 66
减: 二、营业总支出		619, 200. 69	111, 168. 96
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	407, 564. 83	69, 240. 85
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	67, 927. 38	11, 540. 16
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	128, 898. 07	19, 988. 47
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4, 373. 42	-
其中: 卖出回购金融资产支出		4, 373. 42	-
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	10, 436. 99	10, 399. 48
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		3, 348, 023. 10	208, 826. 93
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		3, 348, 023. 10	208, 826. 93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3, 348, 023. 10	208, 826. 93

6.3 净资产变动表

会计主体：中金景气驱动混合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	12, 413, 304. 94	-	357, 775. 33	12, 771, 080. 27
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	12, 413, 304. 94	-	357, 775. 33	12, 771, 080. 27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	211, 306, 389. 34	-	23, 410, 046. 69	234, 716, 436. 03
(一)、综合收益总额	-	-	3, 348, 023. 10	3, 348, 023. 10
(二)、本期基金份额交	211, 306, 389. 34	-	20, 062, 023. 59	231, 368, 412. 93

易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	252,401,809.37	-	23,474,522.97	275,876,332.34
2. 基金赎回款	-41,095,420.03	-	-3,412,499.38	-44,507,919.41
(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	223,719,694.28	-	23,767,822.02	247,487,516.30
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	12,693,742.36	-	-1,187,614.24	11,506,128.12
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	12,693,742.36	-	-1,187,614.24	11,506,128.12
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-125,579.93	-	219,810.95	94,231.02
(一)、综合收益总额	-	-	208,826.93	208,826.93
(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)	-125,579.93	-	10,984.02	-114,595.91
其中：1. 基金申购款	25,055.62	-	-1,144.04	23,911.58
2. 基金赎回款	-150,635.55	-	12,128.06	-138,507.49
(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	12,568,162.43	-	-967,803.29	11,600,359.14

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

中金景气驱动混合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 4 月 11 日证监许可[2022]733 号文注册，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、《中金景气驱动混合型发起式证券投资基金招募说明书》和《中金景气驱动混合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混合型证券投资基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、上海天天基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司及腾安基金销售（深圳）有限公司等共同销售，募集期为 2022 年 4 月 29 日。经向中国证监会备案，《中金景气驱动混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2022 年 5 月 5 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 10,500,000.00 份（含利息转份额 0.00 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。

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《中金景气驱动混合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。在投资人认购/申购基金份额时，收取认购/申购费用，赎回时收取赎回费且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购基金份额时，不收取认购/申购费用，赎回时收取赎回费且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书及基金产品资料概要中具体列示。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。投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。

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《中金景气驱动混合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（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册发行上市的股票）、存

托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、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）、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货、股票期权、银行存款、同业存单、信用衍生品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）。

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《证券投资基金管理信息披露 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	981,662.08
等于: 本金	981,522.32
加: 应计利息	139.76
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		981,662.08

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	230,532,197.28	-	232,823,290.01	2,291,092.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	13,986,832.00	141,221.64	14,138,471.64
	银行间市场	-	-	-
	合计	13,986,832.00	141,221.64	14,138,471.64
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	244,519,029.28	141,221.64	246,961,761.65	2,301,510.73

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 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。

6.4.7.7 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。

6.4.7.8 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	73,521.15
其中：交易所市场	73,521.15
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	9,916.99
其他	3,667.26
合计	87,105.40

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金景气驱动混合发起 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	6,959,381.45	6,959,381.45
本期申购	188,726,902.31	188,726,902.31
本期赎回(以“-”号填列)	-9,827,593.88	-9,827,593.88
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	185,858,689.88	185,858,689.88

中金景气驱动混合发起 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	5,453,923.49	5,453,923.49
本期申购	63,674,907.06	63,674,907.06
本期赎回(以“-”号填列)	-31,267,826.15	-31,267,826.15
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	37,861,004.40	37,861,004.40

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

中金景气驱动混合发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-21,768.91	289,241.37	267,472.46
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-21,768.91	289,241.37	267,472.46
本期利润	1,104,685.16	1,433,497.18	2,538,182.34
本期基金份额交易产生的变动数	9,217,862.71	8,593,331.78	17,811,194.49
其中：基金申购款	9,666,043.37	9,080,699.51	18,746,742.88
基金赎回款	-448,180.66	-487,367.73	-935,548.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,300,778.96	10,316,070.33	20,616,849.29

中金景气驱动混合发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-134,110.17	224,413.04	90,302.87
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	-134,110.17	224,413.04	90,302.87
本期利润	201,703.99	608,136.77	809,840.76
本期基金份额交易产生的变动数	1,011,533.72	1,239,295.38	2,250,829.10
其中：基金申购款	1,774,620.06	2,953,160.03	4,727,780.09
基金赎回款	-763,086.34	-1,713,864.65	-2,476,950.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,079,127.54	2,071,845.19	3,150,972.73

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	6,302.60
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	742.74
其他	353.49
合计	7,398.83

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	-744,165.54
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	-744,165.54

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	88,274,173.51
减：卖出股票成本总额	88,772,093.12
减：交易费用	246,245.93
买卖股票差价收入	-744,165.54

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	43,630.56
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,984.00
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	41,646.56

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	203,980.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	201,984.00
减：应计利息总额	3,980.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-1,984.00

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。

6.4.7.17 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。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,600,615.65
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	2,600,615.65

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	2,041,633.95
股票投资	2,029,711.95
债券投资	11,922.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,041,633.95

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	19,583.80
合计	19,583.80

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	9,916.99
信息披露费	-
证券出借违约金	-
划款手续费	520.00
合计	10,436.99

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
建设银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东
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

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 (%)
中金财富证券	-	-	1,194,256.75	1.63
中金公司	-	-	63,111,388.03	86.15

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

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 (%)
中金财富证券	-	-	370,000.00	0.65
中金公司	-	-	45,100,000.00	79.72

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 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	21,842.90	75.17	12,877.44	64.10
中金财富证券	533.53	1.84	533.53	2.66

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管理费用管理规定》，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	407,564.83	69,240.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	19,198.06	3,931.87
应支付基金管理人的净管理费	388,366.77	65,308.98

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乘以约定的年费率计提，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×管理费率/当年天数。2025 年 3 月 24 日前，本基金管理费率为 1.20%。本基金管理人自 2025 年 3 月 24 日起对本基金实施调整后的基金管理费率，调整后的基金管理费率为 0.60%。

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	67,927.38	11,540.16

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值乘以约定的年费率计提，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×托管费率/当年天数。2025年3月24日前，本基金托管费率为0.20%。本基金管理人自2025年3月24日起对本基金实施调整后的基金托管费率，调整后的基金托管费率为0.10%。

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		
	中金景气驱动混合发起A	中金景气驱动混合发起C	合计
建设银行	-	75.96	75.96
中金基金	-	120,905.32	120,905.32
合计	-	120,981.28	120,981.28
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		
	中金景气驱动混合发起A	中金景气驱动混合发起C	合计
中金基金	-	18,121.54	18,121.54
合计	-	18,121.54	18,121.54

注：本基金仅针对C类基金份额收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日该类基金资产净值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：C类基金日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.80%/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	
	中金景气驱动混合发起A	中金景气驱动混合发起C
基金合同生效日(2022年5月5日)持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	中金景气驱动混合发起A	中金景气驱动混合发起C
基金合同生效日(2022年5月5日)持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	70.27%	91.70%

注：报告期内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
建设银行	981,662.08	6,302.60	907,719.06	1,403.14

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025年1月1日至2025年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
中金公司	688775	影石创新	网下	1,893	89,482.11

注：本基金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

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	937	15,385.54	15,385.54	-
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	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股流通受限	89.60	139.48	54	4,838.40	7,531.92	-
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	-
603014	威高	2025年5月	6个月	新股流通	26.50	32.68	109	2,888.50	3,562.12	-

	血 净	12 日		受限						
603049	中策 橡胶	2025 年5月 27日	6 个月	新股 流通 受限	46.50	42.85	109	5,068.50	4,670.65	-
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	-
688775	影石 创新	2025 年6月 4日	6 个月	新股 流通 受限	47.27	124.16	190	8,981.30	23,590.40	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日，本基金无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 11,000,000.00 元，于 2025 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。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方法》，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	981,522.32	-	-	139.76	981,662.08
结算备付金	544,558.02	-	-	52.90	544,610.92
存出保证金	53,755.98	-	-	5.30	53,761.28
交易性金融资产	13,997,250.00	-	-	232,964,511.65	246,961,761.65
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	3,440,938.72	3,440,938.72
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	10,080,300.00	10,080,300.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,577,086.32	-	-	246,485,948.33	262,063,034.65
负债					
卖出回购金融资产款	11,000,000.00	-	-	-	11,000,000.00
应付清算款	-	-	-	3,283,599.41	3,283,599.41
应付赎回款	-	-	-	22,725.32	22,725.32
应付销售服务费	-	-	-	34,930.00	34,930.00
应付管理人报酬	-	-	-	126,135.64	126,135.64
应付托管费	-	-	-	21,022.58	21,022.58
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	87,105.40	87,105.40
负债总计	11,000,000.00	-	-	3,575,518.35	14,575,518.35
利率敏感度缺口	4,577,086.32	-	-	242,910,429.98	247,487,516.30
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	1,316,542.32	-	-	139.74	1,316,682.06
结算备付金	82,646.01	-	-	40.92	82,686.93
存出保证金	5,049.90	-	-	2.42	5,052.32
交易性金融资产	200,480.00	-	-	11,244,381.00	11,444,861.00
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	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,604,718.23	-	-	11,244,564.08	12,849,282.31
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	20,733.36	20,733.36
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	3,757.07	3,757.07
应付管理人报酬	-	-	-	12,976.35	12,976.35
应付托管费	-	-	-	2,162.72	2,162.72
应交税费	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	38,572.54	38,572.54
负债总计	-	-	-	78,202.04	78,202.04
利率敏感度缺口	1,604,718.23	-	-	11,166,362.04	12,771,080.27

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	8,548.67	135.57
	市场利率上升 25 个基点	-8,548.67	-135.57

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	232,823,290.01	94.07	11,241,469.60	88.02
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	232,823,290.01	94.07	11,241,469.60	88.02

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%	13,116,838.36	702,409.41
	业绩比较基准下降 5%	-13,116,838.36	-702,409.41

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	232,749,285.48	11,241,469.60
第二层次	14,153,857.18	203,391.40
第三层次	58,618.99	-
合计	246,961,761.65	11,444,861.00

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	232,823,290.01	88.84
	其中：股票	232,823,290.01	88.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,138,471.64	5.40
	其中：债券	14,138,471.64	5.40
	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	1,526,273.00	0.58
8	其他各项资产	13,575,000.00	5.18
9	合计	262,063,034.65	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	2,248,447.00	0.91
B	采矿业	11,626,883.00	4.70
C	制造业	117,491,612.18	47.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,396,638.00	3.39
E	建筑业	4,512,401.00	1.82

F	批发和零售业	569,832.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	8,211,197.00	3.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,119,381.55	4.49
J	金融业	61,799,710.28	24.97
K	房地产业	1,463,963.00	0.59
L	租赁和商务服务业	2,149,509.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	2,531,092.00	1.02
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	702,624.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	232,823,290.01	94.07

7.2.2 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

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	600519	贵州茅台	7,000	9,866,640.00	3.99
2	300750	宁德时代	29,500	7,440,490.00	3.01
3	601318	中国平安	119,900	6,652,052.00	2.69
4	600036	招商银行	137,800	6,331,910.00	2.56
5	601166	兴业银行	185,900	4,338,906.00	1.75
6	600900	长江电力	135,700	4,089,998.00	1.65
7	000333	美的集团	55,900	4,035,980.00	1.63
8	601899	紫金矿业	183,300	3,574,350.00	1.44
9	002594	比亚迪	10,100	3,352,291.00	1.35
10	300059	东方财富	139,600	3,228,948.00	1.30
11	600030	中信证券	107,700	2,974,674.00	1.20
12	601398	工商银行	382,400	2,902,416.00	1.17
13	600276	恒瑞医药	51,000	2,646,900.00	1.07
14	000858	五粮液	21,500	2,556,350.00	1.03
15	601211	国泰海通	129,358	2,478,499.28	1.00
16	601328	交通银行	305,800	2,446,400.00	0.99
17	000651	格力电器	49,500	2,223,540.00	0.90
18	601288	农业银行	366,800	2,156,784.00	0.87
19	600887	伊利股份	72,700	2,026,876.00	0.82
20	600919	江苏银行	168,800	2,015,472.00	0.81
21	603259	药明康德	28,600	1,989,130.00	0.80

22	601816	京沪高铁	337,800	1,942,350.00	0.78
23	002475	立讯精密	55,600	1,928,764.00	0.78
24	688981	中芯国际	21,800	1,922,106.00	0.78
25	600000	浦发银行	135,600	1,882,128.00	0.76
26	000725	京东方 A	424,400	1,693,356.00	0.68
27	002371	北方华创	3,500	1,547,735.00	0.63
28	688256	寒武纪	2,486	1,495,329.00	0.60
29	300760	迈瑞医疗	6,600	1,483,350.00	0.60
30	300502	新易盛	11,560	1,468,351.20	0.59
31	601088	中国神华	36,100	1,463,494.00	0.59
32	688041	海光信息	10,200	1,441,158.00	0.58
33	601601	中国太保	38,100	1,429,131.00	0.58
34	300308	中际旭创	9,700	1,414,842.00	0.57
35	601728	中国电信	180,400	1,398,100.00	0.56
36	300124	汇川技术	21,500	1,388,255.00	0.56
37	601668	中国建筑	240,400	1,387,108.00	0.56
38	000001	平安银行	108,700	1,312,009.00	0.53
39	600016	民生银行	271,400	1,289,150.00	0.52
40	002352	顺丰控股	26,300	1,282,388.00	0.52
41	002714	牧原股份	29,900	1,256,099.00	0.51
42	002230	科大讯飞	26,100	1,249,668.00	0.50
43	600031	三一重工	69,300	1,243,935.00	0.50
44	601229	上海银行	116,200	1,232,882.00	0.50
45	601127	赛力斯	8,900	1,195,448.00	0.48
46	603501	豪威集团	9,300	1,187,145.00	0.48
47	601169	北京银行	173,400	1,184,322.00	0.48
48	000063	中兴通讯	35,200	1,143,648.00	0.46
49	601857	中国石油	132,500	1,132,875.00	0.46
50	603019	中科曙光	16,000	1,126,400.00	0.46
51	300274	阳光电源	16,500	1,118,205.00	0.45
52	600309	万华化学	20,600	1,117,756.00	0.45
53	002415	海康威视	40,300	1,117,519.00	0.45
54	600941	中国移动	9,900	1,114,245.00	0.45
55	688008	澜起科技	13,400	1,098,800.00	0.44
56	600690	海尔智家	44,000	1,090,320.00	0.44
57	601688	华泰证券	60,200	1,072,162.00	0.43
58	601919	中远海控	70,800	1,064,832.00	0.43
59	600660	福耀玻璃	18,300	1,043,283.00	0.42
60	002142	宁波银行	37,100	1,015,056.00	0.41
61	601012	隆基绿能	66,200	994,324.00	0.40
62	300498	温氏股份	58,100	992,348.00	0.40
63	601766	中国中车	140,500	989,120.00	0.40
64	600050	中国联通	184,700	986,298.00	0.40

65	000338	潍柴动力	64,000	984,320.00	0.40
66	600406	国电南瑞	43,800	981,558.00	0.40
67	000100	TCL 科技	221,800	960,394.00	0.39
68	000568	泸州老窖	8,300	941,220.00	0.38
69	601138	工业富联	43,800	936,444.00	0.38
70	600809	山西汾酒	5,300	934,867.00	0.38
71	601818	光大银行	219,900	912,585.00	0.37
72	603986	兆易创新	7,200	911,016.00	0.37
73	600028	中国石化	159,100	897,324.00	0.36
74	002027	分众传媒	120,100	876,730.00	0.35
75	601988	中国银行	156,000	876,720.00	0.35
76	688012	中微公司	4,800	875,040.00	0.35
77	601006	大秦铁路	131,800	869,880.00	0.35
78	600926	杭州银行	50,200	844,364.00	0.34
79	600104	上汽集团	52,300	839,415.00	0.34
80	601985	中国核电	89,700	836,004.00	0.34
81	601225	陕西煤业	42,600	819,624.00	0.33
82	600150	中国船舶	24,400	793,976.00	0.32
83	601009	南京银行	67,300	782,026.00	0.32
84	603288	海天味业	19,900	774,309.00	0.31
85	000425	徐工机械	98,400	764,568.00	0.31
86	000792	盐湖股份	44,400	758,352.00	0.31
87	605499	东鹏饮料	2,400	753,720.00	0.30
88	601628	中国人寿	18,200	749,658.00	0.30
89	603993	洛阳钼业	85,200	717,384.00	0.29
90	688111	金山办公	2,551	714,407.55	0.29
91	600999	招商证券	40,600	714,154.00	0.29
92	600760	中航沈飞	12,100	709,302.00	0.29
93	300015	爱尔眼科	56,300	702,624.00	0.28
94	002463	沪电股份	16,300	694,054.00	0.28
95	600905	三峡能源	162,600	692,676.00	0.28
96	000625	长安汽车	54,200	691,592.00	0.28
97	688271	联影医疗	5,400	689,796.00	0.28
98	600111	北方稀土	27,700	689,730.00	0.28
99	600089	特变电工	57,300	683,589.00	0.28
100	600938	中国海油	26,100	681,471.00	0.28
101	601600	中国铝业	95,900	675,136.00	0.27
102	600436	片仔癀	3,300	660,033.00	0.27
103	601658	邮储银行	120,100	656,947.00	0.27
104	300033	同花顺	2,400	655,224.00	0.26
105	601888	中国中免	10,700	652,379.00	0.26
106	002050	三花智控	24,400	643,672.00	0.26
107	300014	亿纬锂能	14,000	641,340.00	0.26

108	600048	保利发展	79,000	639,900.00	0.26
109	600019	宝钢股份	95,900	631,981.00	0.26
110	600547	山东黄金	19,700	629,021.00	0.25
111	601390	中国中铁	111,900	627,759.00	0.25
112	601916	浙商银行	184,000	623,760.00	0.25
113	002241	歌尔股份	26,700	622,644.00	0.25
114	600415	小商品城	30,000	620,400.00	0.25
115	601825	沪农商行	63,100	612,070.00	0.25
116	000538	云南白药	10,800	602,532.00	0.24
117	601989	中国重工	124,400	577,216.00	0.23
118	000977	浪潮信息	11,300	574,944.00	0.23
119	600893	航发动力	14,600	562,684.00	0.23
120	600585	海螺水泥	26,200	562,514.00	0.23
121	002179	中航光电	13,900	561,004.00	0.23
122	601838	成都银行	27,700	556,770.00	0.22
123	002311	海大集团	9,500	556,605.00	0.22
124	000166	申万宏源	110,800	556,216.00	0.22
125	000938	紫光股份	23,100	554,169.00	0.22
126	600570	恒生电子	16,500	553,410.00	0.22
127	600958	东方证券	57,100	552,728.00	0.22
128	603799	华友钴业	14,900	551,598.00	0.22
129	300408	三环集团	16,500	551,100.00	0.22
130	600015	华夏银行	69,400	548,954.00	0.22
131	000776	广发证券	32,300	542,963.00	0.22
132	601336	新华保险	9,100	532,350.00	0.22
133	600584	长电科技	15,600	525,564.00	0.21
134	002028	思源电气	6,800	495,788.00	0.20
135	600438	通威股份	29,500	494,125.00	0.20
136	601998	中信银行	57,800	491,300.00	0.20
137	002049	紫光国微	7,400	487,364.00	0.20
138	300433	蓝思科技	21,800	486,140.00	0.20
139	601077	渝农商行	67,500	481,950.00	0.19
140	600160	巨化股份	16,800	481,824.00	0.19
141	000002	万科 A	74,400	477,648.00	0.19
142	600795	国电电力	97,100	469,964.00	0.19
143	601377	兴业证券	75,400	466,726.00	0.19
144	600489	中金黄金	31,800	465,234.00	0.19
145	600183	生益科技	15,300	461,295.00	0.19
146	601669	中国电建	94,200	458,754.00	0.19
147	000157	中联重科	62,500	451,875.00	0.18
148	601689	拓普集团	9,500	448,875.00	0.18
149	600010	包钢股份	246,800	441,772.00	0.18
150	002422	科伦药业	12,200	438,224.00	0.18

151	600009	上海机场	13,600	432,072.00	0.17
152	002304	洋河股份	6,600	426,030.00	0.17
153	601100	恒立液压	5,900	424,800.00	0.17
154	002736	国信证券	36,600	421,632.00	0.17
155	600066	宇通客车	16,900	420,134.00	0.17
156	000768	中航西飞	15,200	415,568.00	0.17
157	002460	赣锋锂业	12,300	415,371.00	0.17
158	601901	方正证券	52,500	415,275.00	0.17
159	002001	新和成	19,500	414,765.00	0.17
160	600989	宝丰能源	25,300	408,342.00	0.16
161	601881	中国银河	23,700	406,455.00	0.16
162	300394	天孚通信	5,060	403,990.40	0.16
163	601186	中国铁建	50,300	402,903.00	0.16
164	688036	传音控股	5,000	398,500.00	0.16
165	002252	上海莱士	57,800	397,086.00	0.16
166	601360	三六零	38,200	389,640.00	0.16
167	000408	藏格矿业	9,100	388,297.00	0.16
168	000963	华东医药	9,600	387,456.00	0.16
169	600886	国投电力	26,200	386,188.00	0.16
170	002074	国轩高科	11,800	383,028.00	0.15
171	601788	光大证券	21,300	382,974.00	0.15
172	601058	赛轮轮胎	28,700	376,544.00	0.15
173	600115	中国东航	93,300	375,999.00	0.15
174	603369	今世缘	9,600	373,728.00	0.15
175	601868	中国能建	166,900	372,187.00	0.15
176	300442	润泽科技	7,500	371,475.00	0.15
177	601800	中国交建	41,200	366,268.00	0.15
178	002236	大华股份	22,900	363,652.00	0.15
179	601117	中国化学	47,400	363,558.00	0.15
180	688169	石头科技	2,320	363,196.00	0.15
181	000807	云铝股份	22,700	362,746.00	0.15
182	600011	华能国际	50,800	362,712.00	0.15
183	002466	天齐锂业	11,300	362,052.00	0.15
184	601319	中国人保	41,500	361,465.00	0.15
185	000661	长春高新	3,600	357,048.00	0.14
186	600176	中国巨石	31,300	356,820.00	0.14
187	600426	华鲁恒升	16,200	351,054.00	0.14
188	600196	复星医药	13,900	348,751.00	0.14
189	601066	中信建投	14,500	348,725.00	0.14
190	600219	南山铝业	91,000	348,530.00	0.14
191	001979	招商蛇口	39,500	346,415.00	0.14
192	600029	南方航空	58,700	346,330.00	0.14
193	000975	山金国际	18,200	344,708.00	0.14

194	600482	中国动力	14,800	341,436.00	0.14
195	600674	川投能源	21,200	340,048.00	0.14
196	300661	圣邦股份	4,670	339,835.90	0.14
197	301236	软通动力	6,200	338,768.00	0.14
198	600460	士兰微	13,600	337,552.00	0.14
199	688126	沪硅产业	18,000	336,960.00	0.14
200	600346	恒力石化	23,000	327,980.00	0.13
201	601878	浙商证券	30,000	327,300.00	0.13
202	600741	华域汽车	18,400	324,760.00	0.13
203	601111	中国国航	41,000	323,490.00	0.13
204	300418	昆仑万维	9,600	322,848.00	0.13
205	601877	正泰电器	14,200	321,914.00	0.13
206	600372	中航机载	26,500	319,590.00	0.13
207	002648	卫星化学	18,400	318,872.00	0.13
208	003816	中国广核	85,600	311,584.00	0.13
209	002916	深南电路	2,870	309,414.70	0.13
210	002920	德赛西威	3,000	306,390.00	0.12
211	300347	泰格医药	5,700	303,924.00	0.12
212	601021	春秋航空	5,400	300,510.00	0.12
213	000630	铜陵有色	89,600	299,264.00	0.12
214	600588	用友网络	22,300	298,151.00	0.12
215	301269	华大九天	2,400	297,312.00	0.12
216	300896	爱美客	1,700	297,177.00	0.12
217	002601	龙佰集团	18,300	296,643.00	0.12
218	002493	荣盛石化	35,500	293,940.00	0.12
219	000596	古井贡酒	2,200	292,930.00	0.12
220	300782	卓胜微	4,100	292,617.00	0.12
221	601633	长城汽车	13,600	292,128.00	0.12
222	000786	北新建材	11,000	291,280.00	0.12
223	002600	领益智造	33,000	283,470.00	0.11
224	001965	招商公路	23,600	283,200.00	0.11
225	302132	中航成飞	3,200	281,408.00	0.11
226	600039	四川路桥	28,400	281,160.00	0.11
227	000895	双汇发展	11,400	278,274.00	0.11
228	600085	同仁堂	7,600	274,056.00	0.11
229	688396	华润微	5,800	273,528.00	0.11
230	600600	青岛啤酒	3,900	270,894.00	0.11
231	002129	TCL 中环	35,200	270,336.00	0.11
232	603296	华勤技术	3,300	266,244.00	0.11
233	600362	江西铜业	11,300	264,759.00	0.11
234	002709	天赐材料	14,600	264,552.00	0.11
235	300122	智飞生物	13,100	256,629.00	0.10
236	601618	中国中冶	84,800	252,704.00	0.10

237	603392	万泰生物	4,100	250,100.00	0.10
238	002180	纳思达	10,900	250,046.00	0.10
239	600161	天坛生物	13,000	249,470.00	0.10
240	300832	新产业	4,300	243,896.00	0.10
241	002938	鹏鼎控股	7,600	243,428.00	0.10
242	300628	亿联网络	7,000	243,320.00	0.10
243	600233	圆通速递	18,800	242,332.00	0.10
244	600875	东方电气	14,400	241,056.00	0.10
245	600845	宝信软件	10,200	240,924.00	0.10
246	000301	东方盛虹	28,900	240,737.00	0.10
247	688047	龙芯中科	1,800	240,102.00	0.10
248	300759	康龙化成	9,700	238,038.00	0.10
249	601898	中煤能源	21,700	237,398.00	0.10
250	600188	兖矿能源	19,500	237,315.00	0.10
251	688506	百利天恒	800	236,896.00	0.10
252	600023	浙能电力	44,000	233,200.00	0.09
253	000876	新希望	24,800	232,624.00	0.09
254	000999	华润三九	7,300	228,344.00	0.09
255	688223	晶科能源	43,925	227,970.75	0.09
256	605117	德业股份	4,300	226,438.00	0.09
257	600018	上港集团	39,400	224,974.00	0.09
258	600332	白云山	8,400	221,424.00	0.09
259	600025	华能水电	23,100	220,605.00	0.09
260	601872	招商轮船	35,100	219,726.00	0.09
261	600027	华电国际	39,900	218,253.00	0.09
262	002459	晶澳科技	21,600	215,568.00	0.09
263	300999	金龙鱼	7,200	212,616.00	0.09
264	600061	国投资本	27,900	209,808.00	0.08
265	688599	天合光能	14,400	209,232.00	0.08
266	600803	新奥股份	11,000	207,900.00	0.08
267	000617	中油资本	27,500	200,750.00	0.08
268	601799	星宇股份	1,600	200,000.00	0.08
269	000983	山西焦煤	31,100	199,040.00	0.08
270	600918	中泰证券	30,300	194,829.00	0.08
271	300316	晶盛机电	7,100	192,765.00	0.08
272	601698	中国卫通	9,200	188,324.00	0.08
273	603260	合盛硅业	3,900	184,860.00	0.07
274	601607	上海医药	10,200	182,376.00	0.07
275	000708	中信特钢	15,500	182,280.00	0.07
276	601059	信达证券	10,600	181,260.00	0.07
277	601238	广汽集团	24,200	181,258.00	0.07
278	300413	芒果超媒	8,200	178,924.00	0.07
279	688009	中国通号	31,800	163,452.00	0.07

280	600026	中远海能	15,200	157,016.00	0.06
281	688303	大全能源	7,000	149,240.00	0.06
282	688472	阿特斯	16,180	148,047.00	0.06
283	603806	福斯特	11,400	147,744.00	0.06
284	603195	公牛集团	3,020	145,715.00	0.06
285	601699	潞安环能	13,100	138,205.00	0.06
286	688082	盛美上海	1,200	136,728.00	0.06
287	688187	时代电气	3,098	132,129.70	0.05
288	603833	欧派家居	2,300	129,835.00	0.05
289	601236	红塔证券	15,300	129,591.00	0.05
290	601865	福莱特	8,300	126,243.00	0.05
291	601136	首创证券	6,000	119,280.00	0.05
292	601808	中海油服	6,500	89,440.00	0.04
293	300979	华利集团	1,700	89,369.00	0.04
294	600377	宁沪高速	5,400	82,836.00	0.03
295	000800	一汽解放	10,600	72,716.00	0.03
296	001391	国货航	9,400	63,262.00	0.03
297	001289	龙源电力	1,700	27,506.00	0.01
298	688775	影石创新	190	23,590.40	0.01
299	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
300	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
301	301590	优优绿能	54	7,531.92	0.00
302	688581	安杰思	100	6,483.00	0.00
303	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
304	603049	中策橡胶	109	4,670.65	0.00
305	603014	威高血净	109	3,562.12	0.00
306	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
307	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	13,385,508.00	104.81
2	300750	宁德时代	8,998,814.00	70.46
3	601318	中国平安	7,445,235.00	58.30
4	600036	招商银行	7,233,748.00	56.64
5	000333	美的集团	4,976,856.00	38.97
6	601166	兴业银行	4,827,196.00	37.80
7	600900	长江电力	4,601,576.00	36.03
8	002594	比亚迪	4,372,452.00	34.24
9	601899	紫金矿业	4,096,450.00	32.08
10	300059	东方财富	3,767,924.00	29.50
11	600030	中信证券	3,408,331.00	26.69

12	000858	五 粮 液	3,361,075.32	26.32
13	601398	工商银行	3,143,479.00	24.61
14	600276	恒瑞医药	2,869,540.00	22.47
15	000651	格力电器	2,836,449.00	22.21
16	601211	国泰海通	2,630,317.00	20.60
17	002475	立讯精密	2,624,716.00	20.55
18	600887	伊利股份	2,586,359.00	20.25
19	603259	药明康德	2,526,053.00	19.78
20	601328	交通银行	2,449,550.00	19.18
21	601816	京沪高铁	2,367,426.00	18.54
22	601288	农业银行	2,284,122.00	17.89
23	688981	中芯国际	2,266,404.03	17.75
24	000725	京东方 A	2,192,460.00	17.17
25	600919	江苏银行	2,184,155.00	17.10
26	300124	汇川技术	1,899,783.03	14.88
27	688256	寒武纪	1,859,195.20	14.56
28	300760	迈瑞医疗	1,850,895.00	14.49
29	600000	浦发银行	1,784,342.00	13.97
30	002371	北方华创	1,765,177.00	13.82
31	601668	中国建筑	1,683,429.00	13.18
32	601728	中国电信	1,683,119.00	13.18
33	688041	海光信息	1,672,892.78	13.10
34	601088	中国神华	1,642,066.00	12.86
35	600309	万华化学	1,581,042.00	12.38
36	600031	三一重工	1,559,955.00	12.21
37	601229	上海银行	1,544,826.00	12.10
38	601988	中国银行	1,535,363.00	12.02
39	601601	中国太保	1,534,036.00	12.01
40	002415	海康威视	1,501,643.00	11.76
41	000001	平安银行	1,476,983.00	11.57
42	603501	豪威集团	1,447,891.00	11.34
43	000568	泸州老窖	1,416,451.00	11.09
44	002352	顺丰控股	1,399,249.00	10.96
45	601857	中国石油	1,398,668.00	10.95
46	000063	中兴通讯	1,394,234.50	10.92
47	002714	牧原股份	1,386,977.00	10.86
48	600941	中国移动	1,385,542.00	10.85
49	002230	科大讯飞	1,384,790.00	10.84
50	600690	海尔智家	1,381,212.00	10.82
51	600016	民生银行	1,379,433.00	10.80
52	601919	中远海控	1,378,584.00	10.79
53	300274	阳光电源	1,376,515.00	10.78
54	601127	赛力斯	1,365,764.00	10.69

55	600809	山西汾酒	1,335,964.00	10.46
56	600660	福耀玻璃	1,323,935.00	10.37
57	601766	中国中车	1,320,831.00	10.34
58	601688	华泰证券	1,313,161.00	10.28
59	601012	隆基绿能	1,288,907.00	10.09
60	601169	北京银行	1,281,780.00	10.04
61	600406	国电南瑞	1,280,225.00	10.02
62	600050	中国联通	1,259,467.00	9.86
63	300502	新易盛	1,255,081.00	9.83
64	603019	中科曙光	1,238,730.00	9.70
65	688111	金山办公	1,218,879.06	9.54
66	300308	中际旭创	1,209,473.00	9.47
67	000100	TCL 科技	1,207,758.00	9.46
68	300498	温氏股份	1,202,330.00	9.41
69	688008	澜起科技	1,182,205.44	9.26
70	000338	潍柴动力	1,180,046.00	9.24
71	601138	工业富联	1,152,349.00	9.02
72	002142	宁波银行	1,134,641.00	8.88
73	603993	洛阳钼业	1,125,686.00	8.81
74	002027	分众传媒	1,118,116.00	8.76
75	600422	昆药集团	1,116,725.00	8.74
76	601818	光大银行	1,112,197.00	8.71
77	600028	中国石化	1,105,097.00	8.65
78	688012	中微公司	1,092,030.00	8.55
79	601225	陕西煤业	1,036,599.00	8.12
80	603986	兆易创新	1,033,918.00	8.10
81	601006	大秦铁路	1,013,326.00	7.93
82	601628	中国人寿	1,007,008.00	7.89
83	000425	徐工机械	992,764.00	7.77
84	601985	中国核电	986,341.00	7.72
85	603288	海天味业	972,681.00	7.62
86	600926	杭州银行	968,183.00	7.58
87	601600	中国铝业	964,080.00	7.55
88	600104	上汽集团	937,359.00	7.34
89	600999	招商证券	910,027.00	7.13
90	300926	博俊科技	899,742.10	7.05
91	600150	中国船舶	892,840.00	6.99
92	600019	宝钢股份	884,749.00	6.93
93	300033	同花顺	883,131.00	6.92
94	601009	南京银行	882,536.00	6.91
95	000792	盐湖股份	867,963.00	6.80
96	300015	爱尔眼科	858,042.00	6.72
97	300628	亿联网络	831,568.00	6.51

98	601658	邮储银行	830,923.00	6.51
99	600905	三峡能源	821,271.00	6.43
100	600089	特变电工	818,065.00	6.41
101	002050	三花智控	817,384.00	6.40
102	000625	长安汽车	813,763.00	6.37
103	000938	紫光股份	813,135.00	6.37
104	000977	浪潮信息	798,816.00	6.25
105	600938	中国海油	798,439.00	6.25
106	600048	保利发展	793,313.00	6.21
107	601390	中国中铁	791,603.00	6.20
108	688271	联影医疗	788,757.78	6.18
109	300408	三环集团	787,520.00	6.17
110	002241	歌尔股份	786,931.00	6.16
111	000039	中集集团	786,462.00	6.16
112	300433	蓝思科技	782,435.00	6.13
113	601888	中国中免	779,365.00	6.10
114	600436	片仔癀	779,301.00	6.10
115	603518	锦泓集团	778,053.60	6.09
116	300014	亿纬锂能	776,087.00	6.08
117	600958	东方证券	771,220.00	6.04
118	002463	沪电股份	768,447.00	6.02
119	600111	北方稀土	767,080.00	6.01
120	688088	虹软科技	745,551.69	5.84
121	600585	海螺水泥	745,256.00	5.84
122	002028	思源电气	740,162.00	5.80
123	601916	浙商银行	730,599.00	5.72
124	605499	东鹏饮料	720,621.00	5.64
125	600015	华夏银行	718,212.00	5.62
126	000166	申万宏源	711,744.00	5.57
127	000538	云南白药	711,216.00	5.57
128	002179	中航光电	705,318.00	5.52
129	002967	广电计量	703,062.00	5.51
130	000776	广发证券	686,461.00	5.38
131	601825	沪农商行	684,986.00	5.36
132	600570	恒生电子	681,620.00	5.34
133	600438	通威股份	671,911.00	5.26
134	002948	青岛银行	671,830.00	5.26
135	603799	华友钴业	666,727.00	5.22
136	605338	巴比食品	659,050.99	5.16
137	001206	依依股份	646,233.00	5.06
138	601989	中国重工	643,078.00	5.04
139	600547	山东黄金	639,911.00	5.01
140	600584	长电科技	638,554.00	5.00

141	600760	中航沈飞	637,088.00	4.99
142	601336	新华保险	636,981.00	4.99
143	600893	航发动力	626,682.00	4.91
144	000002	万科 A	619,487.00	4.85
145	601669	中国电建	616,497.00	4.83
146	601100	恒立液压	602,230.00	4.72
147	002595	豪迈科技	599,627.00	4.70
148	002311	海大集团	591,431.00	4.63
149	601689	拓普集团	589,480.00	4.62
150	002252	上海莱士	588,478.00	4.61
151	002648	卫星化学	585,973.00	4.59
152	600066	宇通客车	582,900.00	4.56
153	002049	紫光国微	581,577.00	4.55
154	002304	洋河股份	574,786.00	4.50
155	601838	成都银行	573,417.00	4.49
156	000807	云铝股份	570,853.00	4.47
157	603369	今世缘	568,870.00	4.45
158	002001	新和成	564,177.00	4.42
159	600415	小商品城	560,525.00	4.39
160	600183	生益科技	558,840.00	4.38
161	601901	方正证券	555,956.00	4.35
162	601377	兴业证券	551,799.00	4.32
163	600160	巨化股份	542,639.00	4.25
164	601117	中国化学	541,357.00	4.24
165	000157	中联重科	539,513.00	4.22
166	601077	渝农商行	539,304.00	4.22
167	601186	中国铁建	537,942.00	4.21
168	600010	包钢股份	533,783.00	4.18
169	300001	特锐德	531,600.00	4.16
170	600060	海信视像	528,064.00	4.13
171	600009	上海机场	523,796.00	4.10
172	002422	科伦药业	523,651.00	4.10
173	600741	华域汽车	516,799.00	4.05
174	002736	国信证券	516,097.00	4.04
175	000963	华东医药	514,061.00	4.03
176	688036	传音控股	511,497.15	4.01
177	600795	国电电力	511,125.00	4.00
178	600489	中金黄金	508,850.00	3.98
179	688235	百济神州	508,092.05	3.98
180	601998	中信银行	501,807.00	3.93
181	600745	闻泰科技	499,579.00	3.91
182	000951	中国重汽	498,898.00	3.91
183	600989	宝丰能源	497,812.00	3.90

184	301061	匠心家居	496,097.00	3.88
185	000630	铜陵有色	491,451.00	3.85
186	002460	赣锋锂业	487,376.00	3.82
187	300442	润泽科技	486,543.00	3.81
188	600372	中航机载	480,893.00	3.77
189	600219	南山铝业	474,875.00	3.72
190	601058	赛轮轮胎	473,272.00	3.71
191	000895	双汇发展	472,757.00	3.70
192	601360	三六零	468,901.00	3.67
193	600011	华能国际	467,774.00	3.66
194	601868	中国能建	467,164.00	3.66
195	601881	中国银河	467,040.00	3.66
196	603317	天味食品	466,005.00	3.65
197	002601	龙佰集团	465,676.00	3.65
198	688169	石头科技	464,934.00	3.64
199	002920	德赛西威	463,581.00	3.63
200	601066	中信建投	459,914.00	3.60
201	601319	中国人保	458,503.00	3.59
202	600176	中国巨石	457,646.00	3.58
203	300476	胜宏科技	457,530.00	3.58
204	600845	宝信软件	455,438.00	3.57
205	600886	国投电力	454,345.00	3.56
206	002236	大华股份	451,217.00	3.53
207	001979	招商蛇口	448,785.00	3.51
208	000596	古井贡酒	445,943.00	3.49
209	601800	中国交建	445,130.00	3.49
210	600196	复星医药	444,069.00	3.48
211	601877	正泰电器	443,352.00	3.47
212	002468	申通快递	442,151.00	3.46
213	000768	中航西飞	442,012.00	3.46
214	002938	鹏鼎控股	441,754.00	3.46
215	601633	长城汽车	438,929.00	3.44
216	601618	中国中冶	436,734.00	3.42
217	000408	藏格矿业	430,165.00	3.37
218	601788	光大证券	428,358.00	3.35
219	600115	中国东航	424,063.00	3.32
220	600426	华鲁恒升	423,891.00	3.32
221	600188	兖矿能源	421,985.00	3.30
222	600346	恒力石化	421,803.00	3.30
223	600029	南方航空	421,284.00	3.30
224	000661	长春高新	415,069.00	3.25
225	605020	永和股份	413,398.00	3.24
226	600023	浙能电力	410,610.00	3.22

227	688606	奥泰生物	410,532.51	3.21
228	000975	山金国际	410,212.00	3.21
229	600482	中国动力	410,047.00	3.21
230	600674	川投能源	408,162.00	3.20
231	300782	卓胜微	406,104.00	3.18
232	002466	天齐锂业	405,592.00	3.18
233	601878	浙商证券	403,011.00	3.16
234	002493	荣盛石化	402,979.00	3.16
235	002245	蔚蓝锂芯	402,881.00	3.15
236	688392	骄成超声	398,815.85	3.12
237	300759	康龙化成	398,664.00	3.12
238	603565	中谷物流	398,425.00	3.12
239	688126	沪硅产业	395,115.68	3.09
240	600588	用友网络	392,068.00	3.07
241	002555	三七互娱	391,053.00	3.06
242	300661	圣邦股份	390,546.00	3.06
243	600460	士兰微	389,203.00	3.05
244	002916	深南电路	388,442.00	3.04
245	601898	中煤能源	388,406.00	3.04
246	605117	德业股份	380,557.60	2.98
247	300418	昆仑万维	378,851.00	2.97
248	000786	北新建材	374,938.00	2.94
249	601111	中国国航	374,550.00	2.93
250	600875	东方电气	373,029.00	2.92
251	300684	中石科技	370,107.00	2.90
252	003816	中国广核	369,592.00	2.89
253	002074	国轩高科	369,504.00	2.89
254	002129	TCL 中环	369,326.00	2.89
255	300394	天孚通信	367,956.00	2.88
256	601607	上海医药	367,884.00	2.88
257	300122	智飞生物	365,223.00	2.86
258	300896	爱美客	363,327.00	2.84
259	301236	软通动力	360,889.00	2.83
260	001965	招商公路	358,047.00	2.80
261	688581	安杰思	358,035.05	2.80
262	600018	上港集团	356,456.00	2.79
263	688223	晶科能源	355,287.25	2.78
264	601021	春秋航空	350,996.00	2.75
265	300832	新产业	349,580.00	2.74
266	000983	山西焦煤	347,617.00	2.72
267	600061	国投资本	347,215.00	2.72
268	600600	青岛啤酒	346,459.00	2.71
269	301269	华大九天	346,039.00	2.71

270	300347	泰格医药	344,246.00	2.70
271	603699	纽威股份	336,139.00	2.63
272	603392	万泰生物	334,964.00	2.62
273	002007	华兰生物	328,679.00	2.57
274	600085	同仁堂	327,886.00	2.57
275	002709	天赐材料	323,159.56	2.53
276	002180	纳思达	321,070.00	2.51
277	002444	巨星科技	320,312.00	2.51
278	002459	晶澳科技	319,982.00	2.51
279	600362	江西铜业	314,435.00	2.46
280	603766	隆鑫通用	313,724.00	2.46
281	002271	东方雨虹	312,586.00	2.45
282	688396	华润微	310,625.73	2.43
283	600161	天坛生物	310,521.00	2.43
284	002128	电投能源	306,249.00	2.40
285	603296	华勤技术	306,028.00	2.40
286	688009	中国通号	302,668.00	2.37
287	603659	璞泰来	302,421.00	2.37
288	302132	中航成飞	300,807.00	2.36
289	002600	领益智造	300,112.00	2.35
290	000301	东方盛虹	298,919.00	2.34
291	600233	圆通速递	292,367.00	2.29
292	300693	盛弘股份	289,294.00	2.27
293	300450	先导智能	288,487.00	2.26
294	600039	四川路桥	283,108.00	2.22
295	601872	招商轮船	282,316.00	2.21
296	000999	华润三九	281,072.00	2.20
297	000876	新希望	278,824.00	2.18
298	601236	红塔证券	278,081.00	2.18
299	601238	广汽集团	273,382.00	2.14
300	300999	金龙鱼	264,415.00	2.07
301	688599	天合光能	264,091.57	2.07
302	600027	华电国际	263,362.00	2.06
303	300316	晶盛机电	263,352.00	2.06
304	600332	白云山	261,166.00	2.04
305	300413	芒果超媒	260,324.00	2.04
306	688591	泰凌微	259,682.81	2.03
307	601799	星宇股份	257,684.00	2.02

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	600519	贵州茅台	2,230,537.00	17.47
2	300750	宁德时代	1,458,337.00	11.42

3	600036	招商银行	1,287,703.00	10.08
4	601318	中国平安	1,274,849.00	9.98
5	600422	昆药集团	1,081,222.00	8.47
6	300926	博俊科技	883,924.35	6.92
7	600900	长江电力	813,281.00	6.37
8	000039	中集集团	789,349.00	6.18
9	601899	紫金矿业	782,867.00	6.13
10	601166	兴业银行	782,436.00	6.13
11	603518	锦泓集团	753,033.40	5.90
12	002967	广电计量	749,783.00	5.87
13	000333	美的集团	700,212.00	5.48
14	002948	青岛银行	673,651.90	5.27
15	688088	虹软科技	669,076.24	5.24
16	601988	中国银行	655,580.00	5.13
17	605338	巴比食品	649,876.00	5.09
18	603259	药明康德	647,987.00	5.07
19	002906	华阳集团	625,430.00	4.90
20	000651	格力电器	617,596.00	4.84
21	300059	东方财富	609,110.00	4.77
22	002594	比亚迪	606,689.00	4.75
23	001206	依依股份	606,106.00	4.75
24	002444	巨星科技	591,436.00	4.63
25	600919	江苏银行	577,513.00	4.52
26	300001	特锐德	570,472.00	4.47
27	002891	中宠股份	563,689.00	4.41
28	600887	伊利股份	563,141.00	4.41
29	002595	豪迈科技	560,163.00	4.39
30	600030	中信证券	535,356.00	4.19
31	600060	海信视像	530,395.00	4.15
32	601398	工商银行	525,821.00	4.12
33	601127	赛力斯	519,373.00	4.07
34	000951	中国重汽	517,265.70	4.05
35	300628	亿联网络	508,158.00	3.98
36	002128	电投能源	503,954.00	3.95
37	688235	百济神州	488,887.52	3.83
38	000858	五 粮 液	478,175.00	3.74
39	601816	京沪高铁	472,974.00	3.70
40	600745	闻泰科技	461,710.00	3.62
41	603317	天味食品	457,708.00	3.58
42	600276	恒瑞医药	453,146.00	3.55
43	300502	新易盛	447,560.00	3.50
44	688606	奥泰生物	445,610.20	3.49
45	002468	申通快递	445,261.00	3.49

46	605080	浙江自然	443,716.00	3.47
47	301061	匠心家居	438,686.00	3.43
48	002475	立讯精密	433,986.00	3.40
49	605333	沪光股份	426,694.00	3.34
50	601229	上海银行	426,681.00	3.34
51	002245	蔚蓝锂芯	422,436.00	3.31
52	300476	胜宏科技	421,498.00	3.30
53	688111	金山办公	420,600.37	3.29
54	300124	汇川技术	412,344.00	3.23
55	605020	永和股份	411,504.00	3.22
56	000725	京东方 A	410,943.00	3.22
57	603993	洛阳钼业	410,214.00	3.21
58	601288	农业银行	390,911.00	3.06
59	002555	三七互娱	390,414.00	3.06
60	688392	骄成超声	388,816.08	3.04
61	601211	国泰海通	386,986.58	3.03
62	603565	中谷物流	382,319.00	2.99
63	002352	顺丰控股	362,198.00	2.84
64	600000	浦发银行	359,931.00	2.82
65	601668	中国建筑	357,675.00	2.80
66	000977	浪潮信息	355,490.00	2.78
67	001380	华纬科技	349,057.00	2.73
68	601919	中远海控	347,372.00	2.72
69	002371	北方华创	339,594.00	2.66
70	002273	水晶光电	338,247.00	2.65
71	002970	锐明技术	335,582.00	2.63
72	002007	华兰生物	332,846.00	2.61
73	300684	中石科技	331,407.00	2.59
74	601601	中国太保	329,762.00	2.58
75	688208	道通科技	327,523.36	2.56
76	601857	中国石油	325,594.00	2.55
77	601628	中国人寿	324,740.00	2.54
78	600941	中国移动	324,452.00	2.54
79	688581	安杰思	323,027.05	2.53
80	300035	中科电气	318,439.00	2.49
81	603766	隆鑫通用	313,310.00	2.45
82	688981	中芯国际	309,920.00	2.43
83	603697	有友食品	308,812.00	2.42
84	000568	泸州老窖	306,564.00	2.40
85	688775	影石创新	306,462.14	2.40
86	600406	国电南瑞	303,697.00	2.38
87	603699	纽威股份	302,606.00	2.37
88	688019	安集科技	301,984.46	2.36

89	300450	先导智能	300,683.00	2.35
90	300760	迈瑞医疗	297,522.00	2.33
91	601728	中国电信	295,607.00	2.31
92	600016	民生银行	293,634.00	2.30
93	300433	蓝思科技	291,182.00	2.28
94	600415	小商品城	286,418.00	2.24
95	300308	中际旭创	286,116.00	2.24
96	601766	中国中车	283,166.00	2.22
97	603338	浙江鼎力	281,206.00	2.20
98	601138	工业富联	278,347.00	2.18
99	600096	云天化	277,246.00	2.17
100	600660	福耀玻璃	272,600.00	2.13
101	601088	中国神华	272,411.00	2.13
102	603659	璞泰来	270,533.00	2.12
103	002027	分众传媒	270,171.00	2.12
104	601818	光大银行	269,428.00	2.11
105	300693	盛弘股份	261,943.00	2.05
106	002281	光迅科技	258,658.00	2.03
107	603799	华友钴业	257,194.00	2.01
108	000001	平安银行	256,107.00	2.01

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	308,324,201.58
卖出股票收入（成交）总额	88,274,173.51

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	14,138,471.64	5.71
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	14,138,471.64	5.71

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019749	24 国债 15	65,000	6,582,587.40	2.66
2	019758	24 国债 21	50,000	5,044,865.75	2.04
3	019766	25 国债 01	25,000	2,511,018.49	1.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	53,761.28
2	应收清算款	3,440,938.72

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,080,300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,575,000.00

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

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(%)
中金景气驱动混合发起 A	170	1,093,286.41	183,734,459.36	98.86	2,124,230.52	1.14
中金景气驱动混合发起 C	71	533,253.58	37,453,133.91	98.92	407,870.49	1.08
合计	241	928,297.49	221,187,593.27	98.87	2,532,101.01	1.13

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	中金景气驱动混合发起 A	1,055,923.82	0.5681
	中金景气驱动混合发起 C	21,379.52	0.0565
	合计	1,077,303.34	0.4815

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	中金景气驱动混合发起 A	0~10

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金景气驱动混合发起 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中金景气驱动混合发起 A	0~10
	中金景气驱动混合发起 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	中金景气驱动混合发起 A	中金景气驱动混合发起 C
基金合同生效日(2022年5月5日)基金份额总额	5,500,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	6,959,381.45	5,453,923.49
本报告期基金总申购份额	188,726,902.31	63,674,907.06
减：本报告期基金总赎回份额	9,827,593.88	31,267,826.15
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	185,858,689.88	37,861,004.40

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。

§ 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，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

建设银行研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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(%)	
中邮证券	2	276,543,404.20	69.79	123,316.01	69.79	-
财通证券	2	119,710,062.61	30.21	53,380.40	30.21	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	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、个股分析的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 (%)
中邮证券	11,491,357.00	82.16	32,840,000.00	41.39	-	-
财通证券	2,495,475.00	17.84	46,500,000.00	58.61	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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	中金景气驱动混合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	中金景气驱动混合型发起式证券投资基金产品资料概要更新（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025-3-24
4	中金景气驱动混合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	2025-3-24
5	中金景气驱动混合型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2025-3-24
6	中金景气驱动混合型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025-3-24
7	关于中金景气驱动混合型发起式证券投资基金调低基金管理费率及基金托管费率并修订相关法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2025-3-24
8	中金景气驱动混合型发起式证券投资	中国证监会规定媒介	2025-3-27

	基金基金经理变更公告		
9	中金景气驱动混合型发起式证券投资 基金更新招募说明书(2025 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2025-3-27
10	中金景气驱动混合型发起式证券投资 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	2025-3-27
11	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
12	中金景气驱动混合型发起式证券投资 基金 2024 年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-3-28
13	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
14	中金景气驱动混合型发起式证券投资 基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2025-4-22
15	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
16	关于中金景气驱动混合型发起式证券 投资基金暂停大额申购（包括转换转 入、定期定额投资）业务的公告	中国证监会规定媒介	2025-5-22
17	中金景气驱动混合型发起式证券投资 基金更新招募说明书(2025 年第 3 号)	中国证监会规定媒介	2025-5-22
18	中金景气驱动混合型发起式证券投资 基金基金产品资料概要更新 (2025 年 第 3 号)	中国证监会规定媒介	2025-5-22
19	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
20	中金景气驱动混合型发起式证券投资 基金更新招募说明书(2025 年第 4 号)	中国证监会规定媒介	2025-6-17
21	中金景气驱动混合型发起式证券投资 基金基金产品资料概要更新 (2025 年 第 4 号)	中国证监会规定媒介	2025-6-17
22	中金景气驱动混合型发起式证券投资 基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2025-6-17

§ 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

投 资 者 类 别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序 号	持有基金份额比例达 到或者超过 20%的时 间区间	期初 份额	申购 份额	赎回 份额	持有份额	份 额 占 比 (%)
机 构	1	2025 年 03 月 26 日 -2025 年 06 月 30 日	0.00	54,431,642.93	0.00	54,431,642.93	24.33

	2	2025 年 05 月 16 日 -2025 年 06 月 30 日	0.00	72,965,661.34	0.00	72,965,661.34	32.61
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形。如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，从而可能面临基金合同终止等基金合同中约定的情形。							

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景气驱动混合型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金景气驱动混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金景气驱动混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金景气驱动混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金景气驱动混合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、报告期内中金景气驱动混合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