

中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资  
基金  
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表                              | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 43        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 44        |
| 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       | 45        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 58        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 67        |
| 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      | 67        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 67        |
| 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 ..... | 67        |
| 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 .....    | 67        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 67        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 68        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 68        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>69</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 69        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 69        |
| 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 .....      | 69        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 70        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>70</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>70</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 70        |
| 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 .....      | 70        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 71        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 71        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 71        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....          | 71        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....      | 71        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 72        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>73</b> |
| 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 .....    | 73        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 73        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>73</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 73        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 73        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 73        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                     |                          |                        |                        |
|---------------------|--------------------------|------------------------|------------------------|
| 基金名称                | 中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 |                        |                        |
| 基金简称                | 中金中证 1000 指数增强发起         |                        |                        |
| 基金主代码               | 017733                   |                        |                        |
| 基金运作方式              | 契约型开放式                   |                        |                        |
| 基金合同生效日             | 2023 年 3 月 14 日          |                        |                        |
| 基金管理人               | 中金基金管理有限公司               |                        |                        |
| 基金托管人               | 交通银行股份有限公司               |                        |                        |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 103,029,966.04 份         |                        |                        |
| 基金合同存续期             | 不定期                      |                        |                        |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 中金中证 1000 指数增强发<br>起 A   | 中金中证 1000 指数增强<br>发起 B | 中金中证 1000 指数增强发<br>起 C |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 017733                   | 024091                 | 017734                 |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 53,362,071.38 份          | 920,762.03 份           | 48,747,132.63 份        |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，本基金通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。                                                                                                                                                                        |
| 投资策略   | 本基金主要的股票投资策略为标的指数投资策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合，然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化，力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、可转债投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货、国债期货及股票期权的投资策略；7、转融通投资策略；8、融资投资策略；9、存托凭证投资策略。详见《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。 |
| 业绩比较基准 | 中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型指数增强基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的业绩表现。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。<br>本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金                                                                                                            |

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

## 2.3 基金管理人和基金托管人

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

## 2.4 信息披露方式

|                   |                                                                 |
|-------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 中国证券报                                                           |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | <a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a> |
| 基金中期报告置备地点        | 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(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日) |                    |                    |
|---------------|---------------------------------------|--------------------|--------------------|
|               | 中金中证 1000 指数增强发起 A                    | 中金中证 1000 指数增强发起 B | 中金中证 1000 指数增强发起 C |
| 本期已实现收益       | 10,352,663.71                         | 374,767.69         | 10,007,989.73      |
| 本期利润          | 10,002,823.76                         | 350,065.71         | 9,667,761.41       |
| 加权平均基金份额本期    | 0.1604                                | 0.2239             | 0.1629             |

|               |                       |              |               |
|---------------|-----------------------|--------------|---------------|
| 利润            |                       |              |               |
| 本期加权平均净值利润率   | 11.25%                | 15.70%       | 11.55%        |
| 本期基金份额净值增长率   | 16.23%                | 16.22%       | 15.98%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |              |               |
| 期末可供分配利润      | 27,470,658.90         | 474,263.87   | 24,118,134.87 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.5148                | 0.5151       | 0.4948        |
| 期末基金资产净值      | 80,985,756.79         | 1,397,643.96 | 73,009,042.60 |
| 期末基金份额净值      | 1.5177                | 1.5179       | 1.4977        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |              |               |
| 基金份额累计净值增长率   | 51.77%                | 50.53%       | 49.77%        |

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

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

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

4、本基金自 2025 年 4 月 21 日起增加 B 类基金份额，并自该日起接受投资者对 B 类基金份额的申购和赎回。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 13.75%   | 1.46%       | 14.83%     | 1.53%         | -1.08% | -0.07% |
| 过去六个月      | 16.23%   | 1.49%       | 15.23%     | 1.54%         | 1.00%  | -0.05% |
| 过去一年       | 39.43%   | 1.24%       | 36.53%     | 1.31%         | 2.90%  | -0.07% |
| 过去三年       | 52.14%   | 1.50%       | 32.22%     | 1.57%         | 19.92% | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 51.77%   | 1.45%       | 28.01%     | 1.52%         | 23.76% | -0.07% |

中金中证 1000 指数增强发起 B

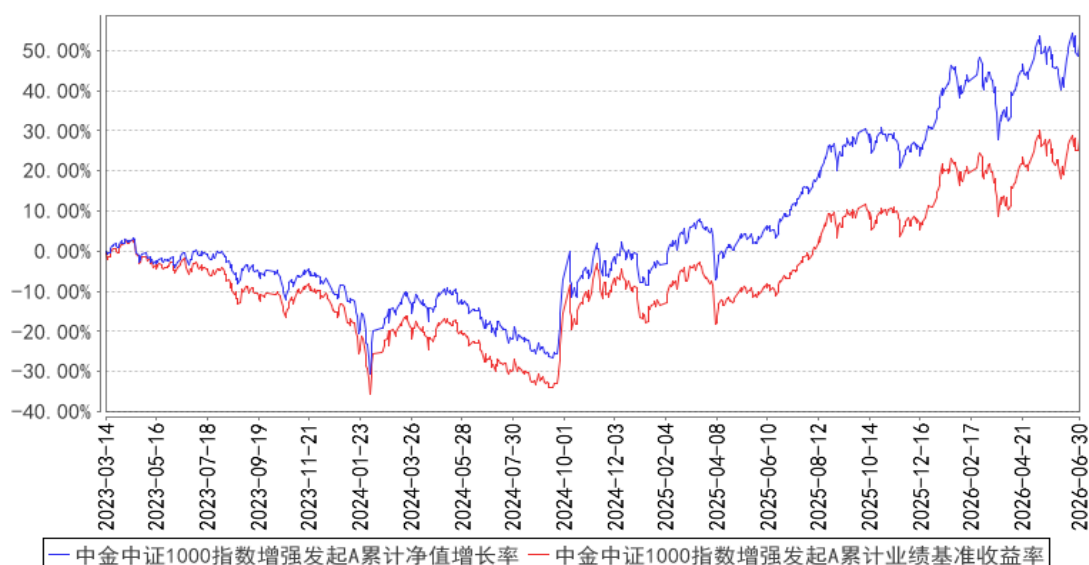
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 13.74%   | 1.46%       | 14.83%     | 1.53%         | -1.09% | -0.07% |
| 过去六个月      | 16.22%   | 1.49%       | 15.23%     | 1.54%         | 0.99%  | -0.05% |
| 过去一年       | 39.42%   | 1.24%       | 36.53%     | 1.31%         | 2.89%  | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 50.53%   | 1.19%       | 45.33%     | 1.25%         | 5.20%  | -0.06% |

中金中证 1000 指数增强发起 C

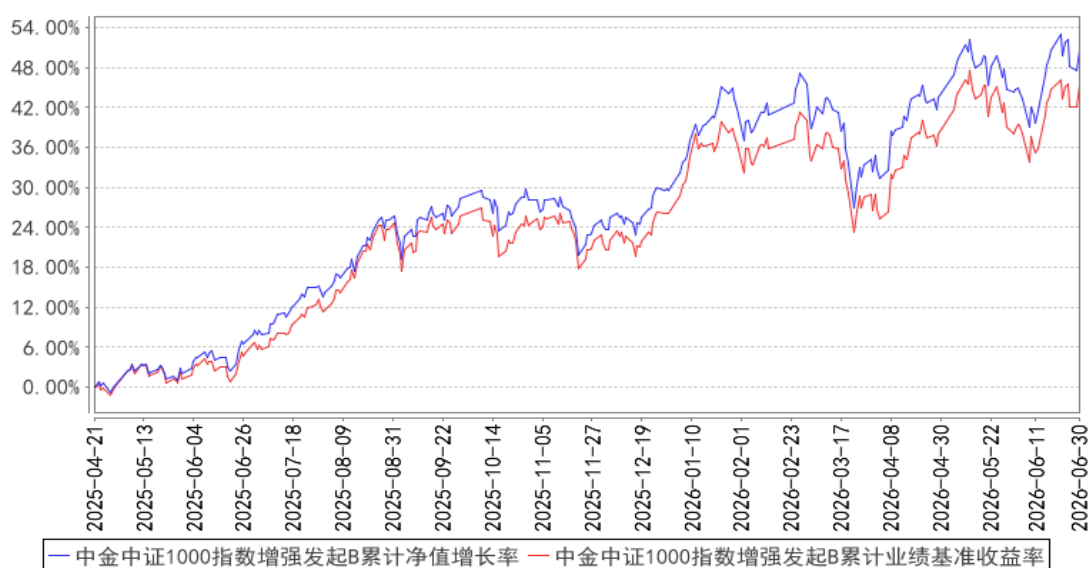
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 13.63%   | 1.46%       | 14.83%     | 1.53%         | -1.20% | -0.07% |
| 过去六个月      | 15.98%   | 1.49%       | 15.23%     | 1.54%         | 0.75%  | -0.05% |
| 过去一年       | 38.87%   | 1.24%       | 36.53%     | 1.31%         | 2.34%  | -0.07% |
| 过去三年       | 50.31%   | 1.50%       | 32.22%     | 1.57%         | 18.09% | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 49.77%   | 1.45%       | 28.01%     | 1.52%         | 21.76% | -0.07% |

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

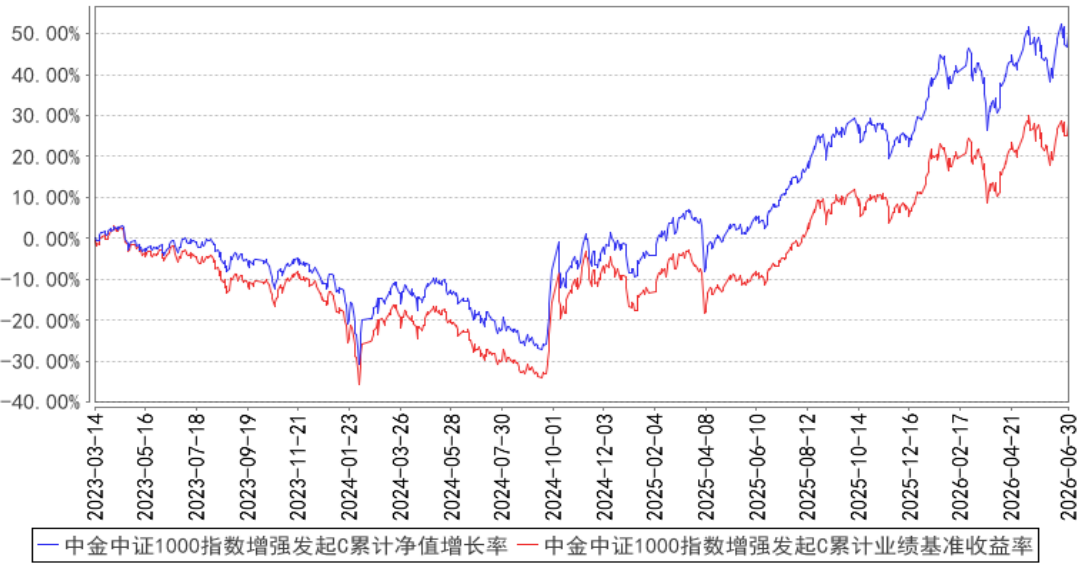
中金中证1000指数增强发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



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



§ 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 10 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 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 79 只公募基金，证券投资基金管理规模 2,772.40 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、中金基金管理有限公司副总经理 | 2023 年 3 月 14 日 | —    | 15 年   | 耿帅军先生，理学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司金融工程分析师；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副总经理、基金经理。 |
| 王阳峰 | 本基金基金经理                | 2023 年 3 月 14 日 | —    | 12 年   | 王阳峰先生，理学硕士。历任泰达宏利基金管理有限公司金融工程部投资经理；嘉                                                                          |

|  |  |  |  |  |                                      |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 实基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------|

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人作出决定确定的任免日期填写；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2、本基金无基金经理助理。

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，本组合严格遵守基金合同的约定，基于深入的研究和完备的风控流程进行组合管理，在严格控制组合偏离度的基础上，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。

2026 年上半年，国内经济延续复苏势头，总量稳中有进，结构向新向优；全球经济依然冷热

不均，地缘冲突频扰，AI 投资火热。在此背景下，A 股市场整体呈现出“中枢抬高、波动增加、风格分化、科技突出”的特征。一季度，A 股市场在估值消化需要和外部事件冲击综合作用下，经历了冲高、整固、回落的过程，市场风格表现也随投资者风险偏好波动快速切换，从年初的成长领涨转向季末的价值占优。进入二季度，地缘冲击烈度逐渐降级，风险资产的波动率中枢下行，资本市场风险偏好抬升，权益市场对基本面景气更加追逐，A 股呈现鲜明的结构性行情，科技成长主线贯穿始终，而传统周期与内需消费板块相对疲软。

上半年，沪深 300、中证 500、中证 1000、科创 50、创业板指等代表指数分别录得 7.55%、20.97%、15.99%、64.25%、35.58% 的涨幅。风格方面，成长显著跑赢价值，中小市值相对大盘占优，微盘风格表现落后。行业方面，电子、通信、建材、基础化工和机械等板块涨幅居前，消费者服务、综合金融、综合、农林牧渔和商贸零售等板块表现承压。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证 1000 指数增强发起 A 基金份额净值为 1.5177 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.23%，同期业绩基准收益率为 15.23%；中金中证 1000 指数增强发起 B 基金份额净值为 1.5179 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.22%，同期业绩基准收益率为 15.23%；中金中证 1000 指数增强发起 C 基金份额净值为 1.4977 元，本报告期基金份额净值增长率为 15.98%，同期业绩基准收益率为 15.23%。

#### 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，国内政策端有望保持“总量适度宽松，发力更加精准”的基调，兼顾发挥存量政策效能和谋划出台增量政策，宏观经济将有较大概率延续“总量稳健、结构优化”的特征。权益市场层面，经历近期“全球共振式”快速调整后，A 股市场估值水平有明显回落，考虑到国内无风险收益率仍处在历史低位区域，A 股市场中长期配置价值进一步提升。结构方面，市场整体风格在叙事新变化和资金再平衡等综合作用下有望进一步趋于均衡，将为自下而上选股类投资者提供更为广阔的选股空间。我们将持续在估值合理性与盈利确定性之间寻求平衡，积极挖掘结构性机会，并始终坚持以高质量研究赋能投资管理的工作范式。

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，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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量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，基金托管人在中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

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

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                        |                          |
| 货币资金        | 6.4.7.1 | 5,389,643.92           | 10,034,913.70            |
| 结算备付金       |         | 1,020,766.73           | 1,313,019.83             |
| 存出保证金       |         | 417,100.80             | 909,552.00               |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 148,785,168.36         | 68,944,863.70            |
| 其中：股票投资     |         | 143,237,887.62         | 68,944,863.70            |
| 基金投资        |         | -                      | -                        |
| 债券投资        |         | 5,547,280.74           | -                        |
| 资产支持证券投资    |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资       |         | -                      | -                        |
| 其他投资        |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产      | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产    | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 债权投资        | 6.4.7.5 | -                      | -                        |
| 其中：债券投资     |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资    |         | -                      | -                        |
| 其他投资        |         | -                      | -                        |
| 其他债权投资      | 6.4.7.6 | -                      | -                        |
| 其他权益工具投资    | 6.4.7.7 | -                      | -                        |
| 应收清算款       |         | -                      | -                        |
| 应收股利        |         | -                      | -                        |
| 应收申购款       |         | 236,697.78             | 246,614.91               |
| 递延所得税资产     |         | -                      | -                        |
| 其他资产        | 6.4.7.8 | -                      | -                        |
| 资产总计        |         | 155,849,377.59         | 81,448,964.14            |
| 负债和净资产      | 附注号     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
| <b>负 债：</b> |         |                        |                          |
| 短期借款        |         | -                      | -                        |
| 交易性金融负债     |         | -                      | -                        |
| 衍生金融负债      | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款   |         | -                      | -                        |
| 应付清算款       |         | -                      | -                        |
| 应付赎回款       |         | 254,654.42             | 102,297.28               |
| 应付管理人报酬     |         | 102,201.48             | 58,281.28                |
| 应付托管费       |         | 19,162.74              | 10,927.73                |
| 应付销售服务费     |         | 24,715.66              | 13,746.40                |
| 应付投资顾问费     |         | -                      | -                        |
| 应交税费        |         | 4,980.07               | 14,176.42                |

|          |          |                |               |
|----------|----------|----------------|---------------|
| 应付利润     |          | -              | -             |
| 递延所得税负债  |          | -              | -             |
| 其他负债     | 6.4.7.9  | 51,219.87      | 105,000.00    |
| 负债合计     |          | 456,934.24     | 304,429.11    |
| 净资产：     |          |                |               |
| 实收基金     | 6.4.7.10 | 103,029,966.04 | 62,474,055.63 |
| 其他综合收益   | 6.4.7.11 | -              | -             |
| 未分配利润    | 6.4.7.12 | 52,362,477.31  | 18,670,479.40 |
| 净资产合计    |          | 155,392,443.35 | 81,144,535.03 |
| 负债和净资产总计 |          | 155,849,377.59 | 81,448,964.14 |

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，中金中证 1000 指数增强发起 A 的基金份额净值为 1.5177 元，期末份额总额为 53,362,071.38 份；中金中证 1000 指数增强发起 B 的基金份额净值为 1.5179 元，期末份额总额为 920,762.03 份；中金中证 1000 指数增强发起 C 的基金份额净值为 1.4977 元，期末份额总额为 48,747,132.63 份。基金份额总额 103,029,966.04 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目               | 附注号      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入           |          | 21,072,214.71                            | 10,276,517.22                                 |
| 1. 利息收入           |          | 14,811.10                                | 16,287.63                                     |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.13 | 14,811.10                                | 16,287.63                                     |
| 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） |          | 21,728,442.86                            | 8,024,282.17                                  |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.14 | 19,103,062.71                            | 7,094,996.06                                  |
| 基金投资收益            |          | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益            | 6.4.7.15 | 43,754.20                                | -                                             |
| 资产支持证券投资          | 6.4.7.16 | -                                        | -                                             |
| 收益                |          | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益           | 6.4.7.17 | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益            | 6.4.7.18 | 1,858,646.21                             | 352,553.25                                    |
| 股利收益              | 6.4.7.19 | 722,979.74                               | 576,732.86                                    |

|                            |            |               |              |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 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   | -714,770.25   | 2,184,003.95 |
| 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   | 43,731.00     | 51,943.47    |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 1,051,563.83  | 495,626.37   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 691,487.33    | 317,567.02   |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -             | -            |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 129,653.88    | 59,543.79    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 165,364.87    | 64,472.17    |
| 4. 投资顾问费                   |            | -             | -            |
| 5. 利息支出                    |            | 6,986.64      | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 6,986.64      | -            |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22   | -             | -            |
| 7. 税金及附加                   |            | 6,851.24      | 1,975.12     |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 51,219.87     | 52,068.27    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 20,020,650.88 | 9,780,890.85 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 20,020,650.88 | 9,780,890.85 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 20,020,650.88 | 9,780,890.85 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 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 | 62,474,055.63                         | -      | 18,670,479.40 | 81,144,535.03 |
| 加：会计政策变更  | -                                     | -      | -             | -             |
| 前期差错更正    | -                                     | -      | -             | -             |

|                                          |                                            |        |                 |                 |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|-----------------|-----------------|
| 其他                                       | -                                          | -      | -               | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 62,474,055.63                              | -      | 18,670,479.40   | 81,144,535.03   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 40,555,910.41                              | -      | 33,691,997.91   | 74,247,908.32   |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -      | 20,020,650.88   | 20,020,650.88   |
| (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)      | 40,555,910.41                              | -      | 13,671,347.03   | 54,227,257.44   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 291,184,878.68                             | -      | 123,128,439.56  | 414,313,318.24  |
| 2. 基金赎回款                                 | -250,628,968.27                            | -      | -109,457,092.53 | -360,086,060.80 |
| (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                                | 103,029,966.04                             | -      | 52,362,477.31   | 155,392,443.35  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        |                 |                 |
|                                          | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润           | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产                                | 92,020,993.35                              | -      | -3,315,737.81   | 88,705,255.54   |
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -               | -               |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -               | -               |
| 其他                                       | -                                          | -      | -               | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 92,020,993.35                              | -      | -3,315,737.81   | 88,705,255.54   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”                         | -25,459,265.02                             | -      | 8,946,506.29    | -16,512,758.73  |

|                                          |                 |   |               |                 |
|------------------------------------------|-----------------|---|---------------|-----------------|
| 号填列)                                     |                 |   |               |                 |
| (一)、综合收益总额                               | -               | - | 9,780,890.85  | 9,780,890.85    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | -25,459,265.02  | - | -834,384.56   | -26,293,649.58  |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 115,620,264.66  | - | 3,177,257.53  | 118,797,522.19  |
| 2. 基金赎回款                                 | -141,079,529.68 | - | -4,011,642.09 | -145,091,171.77 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -               | - | -             | -               |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -               | - | -             | -               |
| 四、本期期末净资产                                | 66,561,728.33   | - | 5,630,768.48  | 72,192,496.81   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| <u>宗喆</u> | 二         | <u>白娜</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人   |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

理人为中金基金，托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国中金财富证券有限公司、申万宏源证券有限公司及申万宏源西部证券有限公司等共同销售，募集期为 2023 年 2 月 27 日起至 2023 年 3 月 10 日。经向中国证监会备案，《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2023 年 3 月 14 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 203,460,403.33 份（含利息转份额 51,321.57 份），发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认/申购时收取认/申购费用，赎回时收取赎回费但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认/申购时不收取认/申购费用，赎回时收取赎回费但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值，计算公式为计算日某类基金份额净值=该计算日该类基金份额的基金资产净值/该计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 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

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[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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本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，股票的股息、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) 对本基金从上市公司、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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本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。对本基金通过沪港通、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) 本基金卖出股票按 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。对于本基金通过沪港通、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) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 3,260,266.02           |
| 等于：本金          | 3,259,975.20           |
| 加：应计利息         | 290.82                 |
| 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           | 2,129,377.90           |
| 等于：本金          | 2,129,323.48           |
| 加：应计利息         | 54.42                  |
| 减：坏账准备         | —                      |
| 合计             | 5,389,643.92           |

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |           |                |            |
|---------------|-------|------------------------|-----------|----------------|------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息      | 公允价值           | 公允价值变动     |
| 股票            |       | 142,914,054.83         | -         | 143,237,887.62 | 323,832.79 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -         | -              | -          |
| 债券            | 交易所市场 | 5,501,933.94           | 42,910.74 | 5,547,280.74   | 2,436.06   |
|               | 银行间市场 | -                      | -         | -              | -          |
|               | 合计    | 5,501,933.94           | 42,910.74 | 5,547,280.74   | 2,436.06   |
| 资产支持证券        |       | -                      | -         | -              | -          |
| 基金            |       | -                      | -         | -              | -          |
| 其他            |       | -                      | -         | -              | -          |
| 合计            |       | 148,415,988.77         | 42,910.74 | 148,785,168.36 | 326,268.85 |

#### 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<br>2026 年 6 月 30 日 |      |    |    |
|-----------|------------------------|------|----|----|
|           | 合同/名义<br>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    | 3,427,640.00           | -    | -  | -  |
| 其中：股指期货投资 | 3,427,640.00           | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具    | -                      | -    | -  | -  |
| 合计        | 3,427,640.00           | -    | -  | -  |

##### 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    |
|------------|--------|----------|--------------|-----------|
| IM2607     | IM2607 | 2.00     | 3,475,840.00 | 48,200.00 |
| 合计         |        |          |              | 48,200.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 |        |          |              | 48,200.00 |
| 净额         |        |          |              | -         |

注：1、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，

结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026 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      | -                      |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 51,219.87              |
| 合计          | 51,219.87              |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 1000 指数增强发起 A

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 30,320,411.25                         | 30,320,411.25   |
| 本期申购          | 161,607,313.95                        | 161,607,313.95  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -138,565,653.82                       | -138,565,653.82 |
| 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           | 53,362,071.38                         | 53,362,071.38   |

中金中证 1000 指数增强发起 B

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |               |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额          |
| 上年度末          | 2,172,755.27                          | 2,172,755.27  |
| 本期申购          | 1,725,347.21                          | 1,725,347.21  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,977,340.45                         | -2,977,340.45 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -             |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -             |
| 本期申购          | -                                     | -             |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -             |
| 本期末           | 920,762.03                            | 920,762.03    |

中金中证 1000 指数增强发起 C

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |      |
|----|---------------------------------------|------|
|    | 基金份额（份）                               | 账面金额 |

|               |                 |                 |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末          | 29,980,889.11   | 29,980,889.11   |
| 本期申购          | 127,852,217.52  | 127,852,217.52  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -109,085,974.00 | -109,085,974.00 |
| 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           | 48,747,132.63   | 48,747,132.63   |

#### 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 1000 指数增强发起 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | 8,722,939.57   | 550,488.75    | 9,273,428.32   |
| 加：会计政策变更       | -              | -             | -              |
| 前期差错更正         | -              | -             | -              |
| 其他             | -              | -             | -              |
| 本期期初           | 8,722,939.57   | 550,488.75    | 9,273,428.32   |
| 本期利润           | 10,352,663.71  | -349,839.95   | 10,002,823.76  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 8,395,055.62   | -47,622.29    | 8,347,433.33   |
| 其中：基金申购款       | 64,400,554.27  | 5,804,240.43  | 70,204,794.70  |
| 基金赎回款          | -56,005,498.65 | -5,851,862.72 | -61,857,361.37 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 27,470,658.90  | 153,026.51    | 27,623,685.41  |

中金中证 1000 指数增强发起 B

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分       | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 上年度末           | 625,655.53    | 39,401.38   | 665,056.91    |
| 加：会计政策变更       | -             | -           | -             |
| 前期差错更正         | -             | -           | -             |
| 其他             | -             | -           | -             |
| 本期期初           | 625,655.53    | 39,401.38   | 665,056.91    |
| 本期利润           | 374,767.69    | -24,701.98  | 350,065.71    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -526,159.35   | -12,081.34  | -538,240.69   |
| 其中：基金申购款       | 620,057.16    | 102,874.75  | 722,931.91    |
| 基金赎回款          | -1,146,216.51 | -114,956.09 | -1,261,172.60 |
| 本期已分配利润        | -             | -           | -             |
| 本期末            | 474,263.87    | 2,618.06    | 476,881.93    |

中金中证 1000 指数增强发起 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----|-------|-------|---------|
|----|-------|-------|---------|

|                |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | 8,191,986.00   | 540,008.17    | 8,731,994.17   |
| 加：会计政策变更       | -              | -             | -              |
| 前期差错更正         | -              | -             | -              |
| 其他             | -              | -             | -              |
| 本期期初           | 8,191,986.00   | 540,008.17    | 8,731,994.17   |
| 本期利润           | 10,007,989.73  | -340,228.32   | 9,667,761.41   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 5,918,159.14   | -56,004.75    | 5,862,154.39   |
| 其中：基金申购款       | 47,810,162.17  | 4,390,550.78  | 52,200,712.95  |
| 基金赎回款          | -41,892,003.03 | -4,446,555.53 | -46,338,558.56 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 24,118,134.87  | 143,775.10    | 24,261,909.97  |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 8,501.31                              |
| 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 | 6,151.20                              |
| 其他        | 158.59                                |
| 合计        | 14,811.10                             |

#### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 19,103,062.71              |
| 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               | 19,103,062.71              |

##### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 876,339,515.75                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 856,340,929.60                        |
| 减：交易费用     | 895,523.44                            |
| 买卖股票差价收入   | 19,103,062.71                         |

#### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 40,324.26                  |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 3,429.94                   |
| 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                           | 43,754.20                  |

##### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 8,365,631.23               |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 8,304,917.06               |
| 减：应计利息总额               | 57,284.23                  |
| 减：交易费用                 | —                          |
| 买卖债券差价收入               | 3,429.94                   |

##### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 股指期货投资收益 | 1,858,646.21                          |

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 722,979.74                            |
| 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            | 722,979.74                            |

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -274,894.32                           |
| 股票投资       | -277,330.38                           |
| 债券投资       | 2,436.06                              |
| 资产支持证券投资   | -                                     |

|                        |               |
|------------------------|---------------|
| 基金投资                   | -             |
| 贵金属投资                  | -             |
| 其他                     | -             |
| 2. 衍生工具                | -451, 129. 56 |
| 权证投资                   | -             |
| 期货投资                   | -451, 129. 56 |
| 3. 其他                  | -             |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -11, 253. 63  |
| 合计                     | -714, 770. 25 |

6. 4. 7. 21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 43, 728. 79                           |
| 基金转换费收入 | 2. 21                                 |
| 合计      | 43, 731. 00                           |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 11, 548. 29                           |
| 信息披露费   | 39, 671. 58                           |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 合计      | 51, 219. 87                           |

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、关联关系

6. 4. 9. 1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6. 4. 9. 2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系               |
|-------|-----------------------|
| 中金基金  | 基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及 |

|                            |                        |
|----------------------------|------------------------|
|                            | 基金销售机构                 |
| 交通银行                       | 基金托管人、基金销售机构           |
| 中国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               |
| 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 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 | 1,019,406,332.64                      | 56.42           | -                                          | -               |

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 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（%） |
| 中金财富证券 | 22,115,198.00                         | 100.00          | -                                          | -               |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                   | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 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 | 125,980,000.00                        | 100.00            | -                                          | -                 |

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<br>2026年1月1日至2026年6月30日      |                   |              |                     |
|--------|---------------------------------|-------------------|--------------|---------------------|
|        | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 中金财富证券 | 199,724.07                      | 58.49             | -            | -                   |
| 关联方名称  | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |                   |              |                     |
|        | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 中金财富证券 | -                               | -                 | -            | -                   |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年<br>6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 691,487.33                               | 317,567.02                                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 282,022.42                               | 131,856.96                                    |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 409,464.91                               | 185,710.06                                    |

注：支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年<br>6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 129,653.88                               | 59,543.79                                     |

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日      |                    |                    |            |
|----------------|--------------------------------------------|--------------------|--------------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                    |                    |            |
|                | 中金中证 1000 指数增强发起 A                         | 中金中证 1000 指数增强发起 B | 中金中证 1000 指数增强发起 C | 合计         |
| 交通银行           | -                                          | -                  | 30,931.54          | 30,931.54  |
| 中金财富证券         | -                                          | -                  | 79,729.57          | 79,729.57  |
| 中金基金           | -                                          | -                  | 30,308.91          | 30,308.91  |
| 合计             | -                                          | -                  | 140,970.02         | 140,970.02 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                    |                    |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                    |                    |            |
|                | 中金中证 1000 指数增强发起 A                         | 中金中证 1000 指数增强发起 B | 中金中证 1000 指数增强发起 C | 合计         |
| 交通银行           | -                                          | -                  | 20,308.96          | 20,308.96  |
| 中金财富证券         | -                                          | -                  | 17,972.62          | 17,972.62  |
| 中金基金           | -                                          | -                  | 14,300.05          | 14,300.05  |
| 合计             | -                                          | -                  | 52,581.63          | 52,581.63  |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C 类基金日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期                                         |                                                      |                                            |
|---------------------------------|--------------------------------------------|------------------------------------------------------|--------------------------------------------|
|                                 | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日            |                                                      |                                            |
|                                 | 中金中证 1000 指数增强发起 A                         | 中金中证 1000 指数增强发起 B                                   | 中金中证 1000 指数增强发起 C                         |
| 基金合同生效日（2023 年 3 月 14 日）持有的基金份额 | 5,000,900.00                               | —                                                    | 5,000,900.00                               |
| 报告期初持有的基金份额                     | 5,000,900.00                               | —                                                    | 5,000,900.00                               |
| 报告期间申购/买入总份额                    | —                                          | —                                                    | —                                          |
| 报告期间因拆分变动份额                     | —                                          | —                                                    | —                                          |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | —                                          | —                                                    | —                                          |
| 报告期末持有的基金份额                     | 5,000,900.00                               | —                                                    | 5,000,900.00                               |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 9.37%                                      | —                                                    | 10.26%                                     |
| 项目                              | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|                                 | 中金中证 1000 指数增强发起 A                         | 中金中证 1000 指数增强发起 B                                   | 中金中证 1000 指数增强发起 C                         |
| 基金合同生效日（2023 年 3 月 14 日）持有的基金份额 | 5,000,900.00                               | —                                                    | 5,000,900.00                               |
| 报告期初持有的基金份额                     | 5,000,900.00                               | —                                                    | 5,000,900.00                               |
| 报告期间申购/买入总份额                    | —                                          | —                                                    | —                                          |

|                     |              |   |              |
|---------------------|--------------|---|--------------|
| 报告期间因拆分变动份额         | -            | - | -            |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -            | - | -            |
| 报告期末持有的基金份额         | 5,000,900.00 | - | 5,000,900.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 12.39%       | - | 19.19%       |

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |          |
|------------|---------------------------------------|----------|--------------------------------------------|----------|
|            | 期末余额                                  | 当期利息收入   | 期末余额                                       | 当期利息收入   |
| 交通银行股份有限公司 | 3,260,266.02                          | 6,279.06 | 2,797,290.69                               | 7,931.93 |
| 中金财富证券     | 1,401,271.73                          | 1,124.20 | -                                          | -        |

注：1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率或约定利率计息；  
2、本基金的证券交易结算资金存放在基金证券经纪商中金财富证券的基金专用证券账户的，按协议约定利率计息。

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 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                                       | 001399 | 惠科股份  | 网下   | 1,897      | 19,197.64 |
| 中金公司                                       | 001248 | 华润新能源 | 网下   | 6,896      | 69,718.56 |
| 中金公司                                       | 301531 | 春光集团  | 网下   | 2,436      | 32,398.80 |
| 上年度可比期间<br>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       |
| -                                          | -      | -     | -    | -          | -         |

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（2026 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 |
| 001248               | 华润新能源 | 2026 年 6 月 24 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 10.11 | 10.11  | 6,896    | 69,718.56 | 69,718.56 | -  |
| 001365               | 天海电子  | 2026 年 5 月 11 日 | 6 个月      | 新股流通受限 | 27.19 | 31.31  | 200      | 5,438.00  | 6,262.00  | -  |
| 001393               | 维通利   | 2026 年 5 月 8 日  | 6 个月      | 新股流通受限 | 30.38 | 38.99  | 137      | 4,162.06  | 5,341.63  | -  |
| 001399               | 惠科股份  | 2026 年 6 月 16 日 | 6 个月      | 新股流通受限 | 10.12 | 27.73  | 759      | 7,681.08  | 21,047.07 | -  |
| 301531               | 春光集团  | 2026 年 4 月 28 日 | 6 个月      | 新股流通受限 | 13.30 | 51.56  | 244      | 3,245.20  | 12,580.64 | -  |
| 301599               | 理奇智能  | 2026 年 4 月 22 日 | 6 个月      | 新股流通受限 | 13.91 | 32.47  | 282      | 3,922.62  | 9,156.54  | -  |
| 301669               | 高特电   | 2026 年 6 月 2 日  | 6 个月      | 新股流通受限 | 7.08  | 28.40  | 288      | 2,039.04  | 8,179.20  | -  |

|        |      |                 |      |        |       |          |    |          |            |   |
|--------|------|-----------------|------|--------|-------|----------|----|----------|------------|---|
|        | 子    | 日               |      |        |       |          |    |          |            |   |
| 603435 | 嘉德利  | 2026 年 5 月 15 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 15.76 | 46.71    | 82 | 1,292.32 | 3,830.22   | - |
| 688635 | 长进光子 | 2026 年 5 月 20 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 40.98 | 308.19   | 73 | 2,991.54 | 22,497.87  | - |
| 688797 | 臻宝科技 | 2026 年 6 月 16 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 44.56 | 468.67   | 58 | 2,584.48 | 27,182.86  | - |
| 688808 | 联讯仪器 | 2026 年 4 月 16 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 81.88 | 1,584.33 | 65 | 5,322.20 | 102,981.45 | - |

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 |
|--------|------|-----------------|--------|--------|-----------------|--------|-------|------------|------------|----|
| 688072 | 拓荆科技 | 2026 年 6 月 29 日 | 重大事项停牌 | 879.53 | 2026 年 7 月 13 日 | 890.99 | 400   | 252,833.00 | 351,812.00 | -  |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型指数增强基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本

基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

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

|                          |               |       |       |                |                |
|--------------------------|---------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 2026 年 6 月 30 日          |               |       |       |                |                |
| 资产                       |               |       |       |                |                |
| 货币资金                     | 5,389,298.68  | -     | -     | 345.24         | 5,389,643.92   |
| 结算备付金                    | 1,020,436.98  | -     | -     | 329.75         | 1,020,766.73   |
| 存出保证金                    | -             | -     | -     | 417,100.80     | 417,100.80     |
| 交易性金融资产                  | 5,504,370.00  | -     | -     | 143,280,798.36 | 148,785,168.36 |
| 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                    | -             | -     | -     | 236,697.78     | 236,697.78     |
| 其他资产                     | -             | -     | -     | -              | -              |
| 资产总计                     | 11,914,105.66 | -     | -     | 143,935,271.93 | 155,849,377.59 |
| 负债                       |               |       |       |                |                |
| 卖出回购金融资产款                | -             | -     | -     | -              | -              |
| 应付清算款                    | -             | -     | -     | -              | -              |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -     | 254,654.42     | 254,654.42     |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 24,715.66      | 24,715.66      |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 102,201.48     | 102,201.48     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 19,162.74      | 19,162.74      |
| 应交税费                     | -             | -     | -     | 4,980.07       | 4,980.07       |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 51,219.87      | 51,219.87      |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 456,934.24     | 456,934.24     |
| 利率敏感度缺口                  | 11,914,105.66 | -     | -     | 143,478,337.69 | 155,392,443.35 |
| 上年度末<br>2025 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                     | 10,034,360.62 | -     | -     | 553.08         | 10,034,913.70  |
| 结算备付金                    | 1,312,681.68  | -     | -     | 338.15         | 1,313,019.83   |
| 存出保证金                    | -             | -     | -     | 909,552.00     | 909,552.00     |
| 交易性金融资产                  | -             | -     | -     | 68,944,863.70  | 68,944,863.70  |
| 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                    | -             | -     | -     | 246,614.91     | 246,614.91     |
| 其他资产                     | -             | -     | -     | -              | -              |
| 资产总计                     | 11,347,042.30 | -     | -     | 70,101,921.84  | 81,448,964.14  |
| 负债                       |               |       |       |                |                |
| 卖出回购金融资产款                | -             | -     | -     | -              | -              |
| 应付清算款                    | -             | -     | -     | -              | -              |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -     | 102,297.28     | 102,297.28     |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 13,746.40      | 13,746.40      |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 58,281.28      | 58,281.28      |

|         |               |   |   |               |               |
|---------|---------------|---|---|---------------|---------------|
| 应付托管费   | -             | - | - | 10,927.73     | 10,927.73     |
| 应交税费    | -             | - | - | 14,176.42     | 14,176.42     |
| 其他负债    | -             | - | - | 105,000.00    | 105,000.00    |
| 负债总计    | -             | - | - | 304,429.11    | 304,429.11    |
| 利率敏感度缺口 | 11,347,042.30 | - | - | 69,797,492.73 | 81,144,535.03 |

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（2026 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2025 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下降 25 个基点                                                  | 5,646.75                    | -                      |
|    | 市场利率上升 25 个基点                                                  | -5,646.75                   | -                      |

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|----|------------------------|--------------------------|
|----|------------------------|--------------------------|

|               | 公允价值           | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值          | 占基金资产净值<br>比例（%） |
|---------------|----------------|------------------|---------------|------------------|
| 交易性金融资产—股票投资  | 143,237,887.62 | 92.18            | 68,944,863.70 | 84.97            |
| 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            | 143,237,887.62 | 92.18            | 68,944,863.70 | 84.97            |

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（2026 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2025 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 7,225,748.62                | 3,773,220.88           |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | -7,225,748.62               | -3,773,220.88          |

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：<br><br>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；<br><br>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；<br><br>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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 142,597,297.58         | 68,886,749.70            |
| 第二层次          | 5,968,811.30           | 58,114.00                |
| 第三层次          | 219,059.48             | —                        |
| 合计            | 148,785,168.36         | 68,944,863.70            |

#### 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     | 143,237,887.62 | 91.91        |
|    | 其中：股票    | 143,237,887.62 | 91.91        |
| 2  | 基金投资     | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资   | 5,547,280.74   | 3.56         |
|    | 其中：债券    | 5,547,280.74   | 3.56         |
|    | 资产支持证券   | —              | —            |
| 4  | 贵金属投资    | —              | —            |
| 5  | 金融衍生品投资  | —              | —            |
| 6  | 买入返售金融资产 | —              | —            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 6,410,410.65   | 4.11   |
| 8 | 其他各项资产            | 653,798.58     | 0.42   |
| 9 | 合计                | 155,849,377.59 | 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         | 479,220.00     | 0.31         |
| B  | 采矿业              | 3,366,658.00   | 2.17         |
| C  | 制造业              | 97,659,231.99  | 62.85        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,120,937.00   | 0.72         |
| E  | 建筑业              | 1,186,515.00   | 0.76         |
| F  | 批发和零售业           | 3,633,450.60   | 2.34         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,549,793.00   | 1.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 12,919,660.05  | 8.31         |
| J  | 金融业              | 1,816,490.90   | 1.17         |
| K  | 房地产业             | 687,733.00     | 0.44         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,660,892.58   | 2.36         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 2,284,824.20   | 1.47         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 1,706,598.40   | 1.10         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 179,444.00     | 0.12         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 1,049,161.00   | 0.68         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 133,300,609.72 | 85.78        |

### 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 | 26,413.00    | 0.02         |
| B  | 采矿业      | -            | -            |
| C  | 制造业      | 7,608,863.62 | 4.90         |

|   |                  |              |      |
|---|------------------|--------------|------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 69,718.56    | 0.04 |
| E | 建筑业              | 406,141.00   | 0.26 |
| F | 批发和零售业           | 102,747.00   | 0.07 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 303,961.00   | 0.20 |
| H | 住宿和餐饮业           | -            | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 223,460.00   | 0.14 |
| J | 金融业              | -            | -    |
| K | 房地产业             | 174,250.00   | 0.11 |
| L | 租赁和商务服务业         | 918.60       | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业       | 198,392.80   | 0.13 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 686,780.32   | 0.44 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -    |
| P | 教育               | -            | -    |
| Q | 卫生和社会工作          | 135,632.00   | 0.09 |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -            | -    |
| S | 综合               | -            | -    |
|   | 合计               | 9,937,277.90 | 6.39 |

### 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  | 688766 | 普冉股份 | 2,593   | 1,987,793.80 | 1.28         |
| 2  | 688110 | 东芯股份 | 9,058   | 1,845,114.60 | 1.19         |
| 3  | 301511 | 德福科技 | 9,500   | 1,366,575.00 | 0.88         |
| 4  | 600320 | 振华重工 | 309,200 | 1,276,996.00 | 0.82         |
| 5  | 300672 | 国科微  | 4,300   | 1,268,500.00 | 0.82         |
| 6  | 688388 | 嘉元科技 | 28,150  | 1,238,600.00 | 0.80         |
| 7  | 603083 | 剑桥科技 | 4,800   | 1,223,376.00 | 0.79         |
| 8  | 600037 | 歌华有线 | 191,100 | 1,198,197.00 | 0.77         |
| 9  | 688321 | 微芯生物 | 45,000  | 1,184,850.00 | 0.76         |
| 10 | 688779 | 五矿新能 | 143,797 | 1,166,193.67 | 0.75         |
| 11 | 002545 | 东方铁塔 | 71,400  | 1,158,108.00 | 0.75         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 12 | 600361 | 创新新材 | 305,900 | 1,101,240.00 | 0.71 |
| 13 | 002484 | 江海股份 | 10,400  | 1,092,000.00 | 0.70 |
| 14 | 300323 | 华灿光电 | 52,500  | 1,071,000.00 | 0.69 |
| 15 | 300098 | 高新兴  | 230,500 | 1,057,995.00 | 0.68 |
| 16 | 000612 | 焦作万方 | 98,700  | 1,045,233.00 | 0.67 |
| 17 | 301215 | 中汽股份 | 200,100 | 1,038,519.00 | 0.67 |
| 18 | 688127 | 蓝特光学 | 10,619  | 1,036,414.40 | 0.67 |
| 19 | 600662 | 外服控股 | 257,100 | 1,036,113.00 | 0.67 |
| 20 | 000567 | 海德股份 | 173,500 | 1,035,795.00 | 0.67 |
| 21 | 300438 | 鹏辉能源 | 12,500  | 1,035,625.00 | 0.67 |
| 22 | 688630 | 芯基微装 | 1,881   | 1,033,402.59 | 0.67 |
| 23 | 002636 | 金安国纪 | 8,500   | 1,019,745.00 | 0.66 |
| 24 | 603025 | 大豪科技 | 74,720  | 1,019,180.80 | 0.66 |
| 25 | 300184 | 力源信息 | 58,000  | 1,017,900.00 | 0.66 |
| 26 | 603588 | 高能环境 | 52,732  | 1,012,454.40 | 0.65 |
| 27 | 600654 | 中安科  | 371,200 | 987,392.00   | 0.64 |
| 28 | 601096 | 宏盛华源 | 224,100 | 972,594.00   | 0.63 |
| 29 | 600335 | 国机汽车 | 206,200 | 965,016.00   | 0.62 |
| 30 | 301500 | 飞南资源 | 36,200  | 943,010.00   | 0.61 |
| 31 | 688372 | 伟测科技 | 4,974   | 925,164.00   | 0.60 |
| 32 | 600929 | 雪天盐业 | 190,700 | 865,778.00   | 0.56 |
| 33 | 603876 | 鼎胜新材 | 33,280  | 865,612.80   | 0.56 |
| 34 | 688586 | 江航装备 | 72,809  | 851,137.21   | 0.55 |
| 35 | 688025 | 杰普特  | 1,800   | 846,000.00   | 0.54 |
| 36 | 601126 | 四方股份 | 13,200  | 834,240.00   | 0.54 |
| 37 | 688503 | 聚和材料 | 6,173   | 819,157.10   | 0.53 |
| 38 | 002563 | 森马服饰 | 161,400 | 813,456.00   | 0.52 |
| 39 | 600201 | 生物股份 | 64,600  | 752,590.00   | 0.48 |
| 40 | 603317 | 天味食品 | 55,900  | 727,259.00   | 0.47 |
| 41 | 688700 | 东威科技 | 8,116   | 725,570.40   | 0.47 |
| 42 | 000810 | 创维数字 | 54,600  | 723,450.00   | 0.47 |
| 43 | 300034 | 钢研高纳 | 42,000  | 719,880.00   | 0.46 |
| 44 | 601208 | 东材科技 | 10,000  | 707,900.00   | 0.46 |
| 45 | 000636 | 风华高科 | 9,700   | 700,728.00   | 0.45 |
| 46 | 688519 | 南亚新材 | 1,758   | 668,110.32   | 0.43 |
| 47 | 688559 | 海目星  | 7,940   | 666,324.80   | 0.43 |
| 48 | 688400 | 凌云光  | 10,000  | 662,000.00   | 0.43 |
| 49 | 600961 | 株冶集团 | 20,400  | 660,756.00   | 0.43 |
| 50 | 002716 | 湖南白银 | 81,300  | 657,717.00   | 0.42 |
| 51 | 002497 | 雅化集团 | 32,215  | 656,219.55   | 0.42 |
| 52 | 002947 | 恒铭达  | 8,500   | 646,425.00   | 0.42 |
| 53 | 688150 | 莱特光电 | 9,301   | 638,234.62   | 0.41 |
| 54 | 603327 | 福蓉科技 | 74,400  | 630,912.00   | 0.41 |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 55 | 600872 | 中炬高新 | 35,600  | 618,016.00 | 0.40 |
| 56 | 000990 | 诚志股份 | 75,400  | 616,772.00 | 0.40 |
| 57 | 002468 | 申通快递 | 42,300  | 615,888.00 | 0.40 |
| 58 | 688409 | 富创精密 | 2,000   | 612,500.00 | 0.39 |
| 59 | 600490 | 鹏欣资源 | 105,000 | 611,100.00 | 0.39 |
| 60 | 603013 | 亚普股份 | 38,600  | 609,494.00 | 0.39 |
| 61 | 688368 | 晶丰明源 | 2,800   | 606,256.00 | 0.39 |
| 62 | 688327 | 云从科技 | 48,107  | 599,413.22 | 0.39 |
| 63 | 688717 | 艾罗能源 | 7,200   | 594,504.00 | 0.38 |
| 64 | 300257 | 开山股份 | 20,700  | 593,676.00 | 0.38 |
| 65 | 301216 | 万凯新材 | 25,800  | 593,142.00 | 0.38 |
| 66 | 600664 | 哈药股份 | 196,700 | 588,133.00 | 0.38 |
| 67 | 600572 | 康恩贝  | 149,900 | 587,608.00 | 0.38 |
| 68 | 000811 | 冰轮环境 | 10,400  | 584,688.00 | 0.38 |
| 69 | 600728 | 佳都科技 | 136,900 | 583,194.00 | 0.38 |
| 70 | 002010 | 传化智联 | 130,400 | 582,888.00 | 0.38 |
| 71 | 688390 | 固德威  | 5,358   | 581,396.58 | 0.37 |
| 72 | 600623 | 华谊集团 | 71,700  | 578,619.00 | 0.37 |
| 73 | 300613 | 富瀚微  | 7,200   | 576,576.00 | 0.37 |
| 74 | 688627 | 精智达  | 800     | 572,000.00 | 0.37 |
| 75 | 000902 | 新洋丰  | 49,000  | 566,440.00 | 0.36 |
| 76 | 001337 | 四川黄金 | 15,400  | 564,564.00 | 0.36 |
| 77 | 688158 | 优刻得  | 15,265  | 561,141.40 | 0.36 |
| 78 | 688403 | 汇成股份 | 14,117  | 560,444.90 | 0.36 |
| 79 | 603508 | 思维列控 | 25,900  | 553,224.00 | 0.36 |
| 80 | 601801 | 皖新传媒 | 111,700 | 550,681.00 | 0.35 |
| 81 | 601068 | 中铝国际 | 127,300 | 549,936.00 | 0.35 |
| 82 | 001267 | 汇绿生态 | 10,200  | 545,700.00 | 0.35 |
| 83 | 600577 | 精达股份 | 55,200  | 539,856.00 | 0.35 |
| 84 | 002378 | 章源钨业 | 16,100  | 539,028.00 | 0.35 |
| 85 | 600388 | 紫金龙净 | 36,429  | 530,041.95 | 0.34 |
| 86 | 600210 | 紫江企业 | 83,900  | 520,180.00 | 0.33 |
| 87 | 600006 | 东风股份 | 101,200 | 519,156.00 | 0.33 |
| 88 | 688048 | 长光华芯 | 1,018   | 511,036.00 | 0.33 |
| 89 | 300768 | 迪普科技 | 37,100  | 510,867.00 | 0.33 |
| 90 | 301489 | 思泉新材 | 3,100   | 510,198.00 | 0.33 |
| 91 | 688536 | 思瑞浦  | 1,400   | 509,726.00 | 0.33 |
| 92 | 002174 | 游族网络 | 40,200  | 506,922.00 | 0.33 |
| 93 | 000950 | 重药控股 | 100,200 | 502,002.00 | 0.32 |
| 94 | 000420 | 吉林化纤 | 123,200 | 498,960.00 | 0.32 |
| 95 | 601949 | 中国出版 | 107,200 | 498,480.00 | 0.32 |
| 96 | 600928 | 西安银行 | 152,200 | 497,694.00 | 0.32 |
| 97 | 301207 | 华兰疫苗 | 30,400  | 495,216.00 | 0.32 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 98  | 301217 | 铜冠铜箔 | 3,000   | 495,210.00 | 0.32 |
| 99  | 000973 | 佛塑科技 | 34,400  | 493,640.00 | 0.32 |
| 100 | 601038 | 一拖股份 | 45,800  | 485,022.00 | 0.31 |
| 101 | 002488 | 金固股份 | 54,100  | 482,031.00 | 0.31 |
| 102 | 688262 | 国芯科技 | 10,897  | 471,077.31 | 0.30 |
| 103 | 605123 | 派克新材 | 4,800   | 465,648.00 | 0.30 |
| 104 | 601333 | 广深铁路 | 168,900 | 464,475.00 | 0.30 |
| 105 | 603826 | 坤彩科技 | 18,100  | 462,636.00 | 0.30 |
| 106 | 000688 | 国城矿业 | 13,500  | 462,105.00 | 0.30 |
| 107 | 000676 | 智度股份 | 89,600  | 457,856.00 | 0.29 |
| 108 | 301219 | 腾远钴业 | 8,300   | 454,840.00 | 0.29 |
| 109 | 688147 | 微导纳米 | 2,800   | 453,264.00 | 0.29 |
| 110 | 300236 | 上海新阳 | 3,400   | 447,100.00 | 0.29 |
| 111 | 605118 | 力鼎光电 | 12,600  | 439,614.00 | 0.28 |
| 112 | 603057 | 紫燕食品 | 19,700  | 439,310.00 | 0.28 |
| 113 | 603132 | 金徽股份 | 28,100  | 437,798.00 | 0.28 |
| 114 | 688449 | 联芸科技 | 4,981   | 429,910.11 | 0.28 |
| 115 | 688141 | 杰华特  | 2,800   | 429,800.00 | 0.28 |
| 116 | 300199 | 翰宇药业 | 19,300  | 426,144.00 | 0.27 |
| 117 | 688690 | 纳微科技 | 9,632   | 424,771.20 | 0.27 |
| 118 | 600718 | 东软集团 | 57,600  | 417,024.00 | 0.27 |
| 119 | 600726 | 华电能源 | 58,500  | 416,520.00 | 0.27 |
| 120 | 002041 | 登海种业 | 52,500  | 413,175.00 | 0.27 |
| 121 | 301268 | 铭利达  | 29,500  | 412,410.00 | 0.27 |
| 122 | 000680 | 山推股份 | 41,000  | 412,050.00 | 0.27 |
| 123 | 001287 | 中电港  | 13,200  | 411,180.00 | 0.26 |
| 124 | 603638 | 艾迪精密 | 17,400  | 408,030.00 | 0.26 |
| 125 | 601311 | 骆驼股份 | 52,200  | 406,638.00 | 0.26 |
| 126 | 600746 | 江苏索普 | 77,000  | 402,710.00 | 0.26 |
| 127 | 300814 | 中富电路 | 1,900   | 388,550.00 | 0.25 |
| 128 | 301602 | 超研股份 | 28,000  | 384,720.00 | 0.25 |
| 129 | 601677 | 明泰铝业 | 23,100  | 383,460.00 | 0.25 |
| 130 | 600338 | 西藏珠峰 | 25,100  | 382,524.00 | 0.25 |
| 131 | 002204 | 大连重工 | 72,100  | 380,688.00 | 0.24 |
| 132 | 600869 | 远东股份 | 11,300  | 378,211.00 | 0.24 |
| 133 | 002250 | 联化科技 | 27,500  | 375,925.00 | 0.24 |
| 134 | 688522 | 纳睿雷达 | 18,720  | 374,774.40 | 0.24 |
| 135 | 300723 | 一品红  | 9,900   | 369,072.00 | 0.24 |
| 136 | 002534 | 西子洁能 | 19,800  | 367,290.00 | 0.24 |
| 137 | 603118 | 共进股份 | 30,100  | 364,511.00 | 0.23 |
| 138 | 688392 | 骄成超声 | 1,600   | 363,488.00 | 0.23 |
| 139 | 601069 | 西部黄金 | 16,500  | 363,000.00 | 0.23 |
| 140 | 002246 | 北化股份 | 19,100  | 359,080.00 | 0.23 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 141 | 688102 | 斯瑞新材 | 7,604   | 358,756.72 | 0.23 |
| 142 | 601969 | 海南矿业 | 44,800  | 354,368.00 | 0.23 |
| 143 | 600330 | 天通股份 | 11,300  | 348,492.00 | 0.22 |
| 144 | 300738 | 奥飞数据 | 17,200  | 347,784.00 | 0.22 |
| 145 | 300806 | 斯迪克  | 3,100   | 347,200.00 | 0.22 |
| 146 | 301345 | 涛涛车业 | 1,500   | 346,500.00 | 0.22 |
| 147 | 300398 | 飞凯材料 | 5,600   | 345,800.00 | 0.22 |
| 148 | 688128 | 中国电研 | 14,013  | 332,668.62 | 0.21 |
| 149 | 002110 | 三钢闽光 | 114,200 | 328,896.00 | 0.21 |
| 150 | 000534 | 万泽股份 | 12,000  | 328,320.00 | 0.21 |
| 151 | 002408 | 齐翔腾达 | 69,800  | 327,362.00 | 0.21 |
| 152 | 002354 | 天娱数科 | 35,200  | 327,360.00 | 0.21 |
| 153 | 002511 | 中顺洁柔 | 49,200  | 327,180.00 | 0.21 |
| 154 | 603929 | 亚翔集成 | 1,200   | 326,424.00 | 0.21 |
| 155 | 300357 | 我武生物 | 13,900  | 324,148.00 | 0.21 |
| 156 | 301175 | 中科环保 | 65,200  | 322,740.00 | 0.21 |
| 157 | 688252 | 天德钰  | 13,442  | 322,608.00 | 0.21 |
| 158 | 600740 | 山西焦化 | 101,100 | 322,509.00 | 0.21 |
| 159 | 300185 | 通裕重工 | 116,800 | 318,864.00 | 0.21 |
| 160 | 688177 | 百奥泰  | 18,914  | 318,133.48 | 0.20 |
| 161 | 002925 | 盈趣科技 | 12,900  | 318,114.00 | 0.20 |
| 162 | 301153 | 中科江南 | 18,900  | 307,881.00 | 0.20 |
| 163 | 002192 | 融捷股份 | 3,400   | 303,960.00 | 0.20 |
| 164 | 300127 | 银河磁体 | 10,800  | 301,860.00 | 0.19 |
| 165 | 002922 | 伊戈尔  | 9,100   | 298,480.00 | 0.19 |
| 166 | 300134 | 大富科技 | 34,600  | 295,830.00 | 0.19 |
| 167 | 688088 | 虹软科技 | 8,189   | 291,118.95 | 0.19 |
| 168 | 600552 | 凯盛科技 | 8,900   | 289,962.00 | 0.19 |
| 169 | 688006 | 杭可科技 | 7,917   | 289,366.35 | 0.19 |
| 170 | 688531 | 日联科技 | 1,600   | 284,544.00 | 0.18 |
| 171 | 002077 | 大港股份 | 14,600  | 281,634.00 | 0.18 |
| 172 | 002237 | 恒邦股份 | 18,600  | 273,234.00 | 0.18 |
| 173 | 688523 | 航天环宇 | 5,200   | 272,480.00 | 0.18 |
| 174 | 688195 | 腾景科技 | 1,400   | 269,612.00 | 0.17 |
| 175 | 301389 | 隆扬电子 | 3,100   | 269,049.00 | 0.17 |
| 176 | 600773 | 西藏城投 | 20,800  | 267,696.00 | 0.17 |
| 177 | 688658 | 悦康药业 | 20,600  | 264,916.00 | 0.17 |
| 178 | 003039 | 顺控发展 | 23,600  | 259,836.00 | 0.17 |
| 179 | 002004 | 华邦健康 | 65,200  | 256,236.00 | 0.16 |
| 180 | 300322 | 硕贝德  | 10,000  | 252,000.00 | 0.16 |
| 181 | 600619 | 海立股份 | 15,800  | 250,430.00 | 0.16 |
| 182 | 301018 | 申菱环境 | 2,160   | 249,717.60 | 0.16 |
| 183 | 601975 | 招商南油 | 66,900  | 249,537.00 | 0.16 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 184 | 002099 | 海翔药业 | 46,700 | 246,576.00 | 0.16 |
| 185 | 603026 | 石大胜华 | 2,700  | 241,299.00 | 0.16 |
| 186 | 002518 | 科士达  | 4,500  | 241,155.00 | 0.16 |
| 187 | 301339 | 通行宝  | 23,460 | 239,995.80 | 0.15 |
| 188 | 002290 | 禾盛新材 | 2,600  | 238,862.00 | 0.15 |
| 189 | 688596 | 正帆科技 | 3,000  | 237,180.00 | 0.15 |
| 190 | 603301 | 振德医疗 | 2,700  | 235,332.00 | 0.15 |
| 191 | 301205 | 联特科技 | 700    | 233,870.00 | 0.15 |
| 192 | 000935 | 四川双马 | 8,900  | 232,201.00 | 0.15 |
| 193 | 301396 | 宏景科技 | 700    | 232,120.00 | 0.15 |
| 194 | 002747 | 埃斯顿  | 6,200  | 231,446.00 | 0.15 |
| 195 | 600963 | 岳阳林纸 | 76,000 | 231,040.00 | 0.15 |
| 196 | 000962 | 东方钨业 | 2,500  | 226,500.00 | 0.15 |
| 197 | 300684 | 中石科技 | 3,700  | 225,700.00 | 0.15 |
| 198 | 002913 | 奥士康  | 3,500  | 223,790.00 | 0.14 |
| 199 | 688800 | 瑞可达  | 2,320  | 222,650.40 | 0.14 |
| 200 | 300455 | 航天智装 | 10,300 | 221,862.00 | 0.14 |
| 201 | 688107 | 安路科技 | 4,800  | 218,880.00 | 0.14 |
| 202 | 301031 | 中熔电气 | 1,827  | 218,235.15 | 0.14 |
| 203 | 605376 | 博迁新材 | 800    | 217,040.00 | 0.14 |
| 204 | 301665 | 泰禾股份 | 10,300 | 215,888.00 | 0.14 |
| 205 | 600072 | 中船科技 | 25,400 | 215,646.00 | 0.14 |
| 206 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 11,500 | 215,165.00 | 0.14 |
| 207 | 600273 | 嘉化能源 | 32,800 | 213,856.00 | 0.14 |
| 208 | 300503 | 昊志机电 | 2,300  | 212,290.00 | 0.14 |
| 209 | 688232 | 新点软件 | 11,897 | 211,528.66 | 0.14 |
| 210 | 688146 | 中船特气 | 600    | 209,994.00 | 0.14 |
| 211 | 300821 | 东岳硅材 | 10,200 | 209,712.00 | 0.13 |
| 212 | 000058 | 深赛格  | 33,997 | 208,741.58 | 0.13 |
| 213 | 300296 | 利亚德  | 37,100 | 207,760.00 | 0.13 |
| 214 | 002373 | 千方科技 | 28,900 | 207,502.00 | 0.13 |
| 215 | 603305 | 旭升集团 | 17,100 | 207,252.00 | 0.13 |
| 216 | 301622 | 英思特  | 4,400  | 207,240.00 | 0.13 |
| 217 | 300077 | 国民技术 | 6,600  | 206,910.00 | 0.13 |
| 218 | 603127 | 昭衍新药 | 5,400  | 206,388.00 | 0.13 |
| 219 | 002258 | 利尔化学 | 16,100 | 204,631.00 | 0.13 |
| 220 | 300593 | 新雷能  | 6,800  | 204,408.00 | 0.13 |
| 221 | 301035 | 润丰股份 | 4,400  | 204,160.00 | 0.13 |
| 222 | 002063 | 远光软件 | 39,400 | 200,940.00 | 0.13 |
| 223 | 002588 | 史丹利  | 25,300 | 199,870.00 | 0.13 |
| 224 | 300459 | 汤姆猫  | 58,800 | 199,332.00 | 0.13 |
| 225 | 603530 | 神马电力 | 3,900  | 198,510.00 | 0.13 |
| 226 | 600259 | 中稀有  | 1,900  | 193,059.00 | 0.12 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 227 | 002428 | 云南锗业 | 1,600  | 192,288.00 | 0.12 |
| 228 | 002745 | 木林森  | 15,200 | 190,760.00 | 0.12 |
| 229 | 002170 | 芭田股份 | 17,400 | 188,964.00 | 0.12 |
| 230 | 688439 | 振华风光 | 4,050  | 187,110.00 | 0.12 |
| 231 | 002755 | 奥赛康  | 13,600 | 185,232.00 | 0.12 |
| 232 | 301371 | 敷尔佳  | 7,100  | 184,600.00 | 0.12 |
| 233 | 600331 | 宏达股份 | 16,600 | 182,434.00 | 0.12 |
| 234 | 301662 | 宏工科技 | 1,800  | 182,376.00 | 0.12 |
| 235 | 600686 | 金龙汽车 | 16,100 | 181,769.00 | 0.12 |
| 236 | 000035 | 中国天楹 | 37,400 | 180,642.00 | 0.12 |
| 237 | 688593 | 新相微  | 4,600  | 179,032.00 | 0.12 |
| 238 | 600618 | 氯碱化工 | 17,800 | 178,890.00 | 0.12 |
| 239 | 301510 | 固高科技 | 5,600  | 178,808.00 | 0.12 |
| 240 | 300153 | 科泰电源 | 7,900  | 178,698.00 | 0.11 |
| 241 | 002215 | 诺普信  | 21,500 | 176,945.00 | 0.11 |
| 242 | 301392 | 汇成真空 | 600    | 173,184.00 | 0.11 |
| 243 | 301262 | 海看股份 | 9,600  | 172,512.00 | 0.11 |
| 244 | 601200 | 上海环境 | 26,100 | 172,260.00 | 0.11 |
| 245 | 688063 | 派能科技 | 3,200  | 170,464.00 | 0.11 |
| 246 | 600114 | 东睦股份 | 4,500  | 169,920.00 | 0.11 |
| 247 | 301177 | 迪阿股份 | 6,100  | 168,177.00 | 0.11 |
| 248 | 600206 | 有研新材 | 2,500  | 166,500.00 | 0.11 |
| 249 | 600184 | 光电股份 | 5,200  | 166,452.00 | 0.11 |
| 250 | 301267 | 华夏眼科 | 11,400 | 166,326.00 | 0.11 |
| 251 | 600649 | 城投控股 | 47,900 | 165,255.00 | 0.11 |
| 252 | 002531 | 天顺风能 | 19,300 | 162,699.00 | 0.10 |
| 253 | 688691 | 灿芯股份 | 1,400  | 162,302.00 | 0.10 |
| 254 | 002838 | 道恩股份 | 5,300  | 162,286.00 | 0.10 |
| 255 | 688182 | 灿勤科技 | 3,737  | 160,952.59 | 0.10 |
| 256 | 300457 | 赢合科技 | 7,500  | 158,100.00 | 0.10 |
| 257 | 600267 | 海正药业 | 15,400 | 155,694.00 | 0.10 |
| 258 | 600185 | 珠免集团 | 33,700 | 151,650.00 | 0.10 |
| 259 | 002216 | 三全食品 | 13,100 | 151,043.00 | 0.10 |
| 260 | 605020 | 永和股份 | 3,700  | 150,664.00 | 0.10 |
| 261 | 688432 | 有研硅  | 3,748  | 149,807.56 | 0.10 |
| 262 | 300773 | 拉卡拉  | 9,720  | 148,716.00 | 0.10 |
| 263 | 603027 | 千禾味业 | 20,700 | 144,279.00 | 0.09 |
| 264 | 002536 | 飞龙股份 | 3,000  | 141,540.00 | 0.09 |
| 265 | 300693 | 盛弘股份 | 2,900  | 141,375.00 | 0.09 |
| 266 | 300579 | 数字认证 | 6,700  | 138,690.00 | 0.09 |
| 267 | 300870 | 欧陆通  | 400    | 138,276.00 | 0.09 |
| 268 | 688433 | 华曙高科 | 1,600  | 136,960.00 | 0.09 |
| 269 | 000059 | 华锦股份 | 35,900 | 134,625.00 | 0.09 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 270 | 300573 | 兴齐眼药 | 3,255  | 132,673.80 | 0.09 |
| 271 | 688548 | 广钢气体 | 2,535  | 132,073.50 | 0.08 |
| 272 | 300657 | 弘信电子 | 3,000  | 132,060.00 | 0.08 |
| 273 | 000049 | 德赛电池 | 5,600  | 130,872.00 | 0.08 |
| 274 | 600395 | 盘江股份 | 27,900 | 127,224.00 | 0.08 |
| 275 | 002867 | 周大生  | 11,400 | 127,110.00 | 0.08 |
| 276 | 300008 | 天海防务 | 20,800 | 126,048.00 | 0.08 |
| 277 | 002239 | 奥特佳  | 50,500 | 124,735.00 | 0.08 |
| 278 | 603613 | 国联股份 | 6,700  | 123,414.00 | 0.08 |
| 279 | 600266 | 城建发展 | 31,200 | 121,992.00 | 0.08 |
| 280 | 000650 | 仁和药业 | 23,700 | 120,633.00 | 0.08 |
| 281 | 002338 | 奥普光电 | 2,100  | 120,120.00 | 0.08 |
| 282 | 603883 | 老百姓  | 10,900 | 119,464.00 | 0.08 |
| 283 | 600389 | 江山股份 | 6,100  | 119,072.00 | 0.08 |
| 284 | 600787 | 中储股份 | 28,400 | 118,712.00 | 0.08 |
| 285 | 000880 | 潍柴重机 | 5,000  | 115,050.00 | 0.07 |
| 286 | 002768 | 国恩股份 | 2,156  | 112,241.36 | 0.07 |
| 287 | 300260 | 新莱应材 | 1,100  | 110,506.00 | 0.07 |
| 288 | 600916 | 中国黄金 | 16,100 | 110,124.00 | 0.07 |
| 289 | 603279 | 景津装备 | 9,000  | 108,000.00 | 0.07 |
| 290 | 002911 | 佛燃能源 | 11,200 | 106,288.00 | 0.07 |
| 291 | 600782 | 新钢股份 | 42,600 | 105,648.00 | 0.07 |
| 292 | 688306 | 均普智能 | 10,400 | 105,040.00 | 0.07 |
| 293 | 603730 | 岱美股份 | 9,360  | 104,551.20 | 0.07 |
| 294 | 301589 | 诺瓦星云 | 700    | 104,286.00 | 0.07 |
| 295 | 300872 | 天阳科技 | 6,600  | 104,280.00 | 0.07 |
| 296 | 002127 | 南极电商 | 37,600 | 103,024.00 | 0.07 |
| 297 | 300687 | 赛意信息 | 3,300  | 102,300.00 | 0.07 |
| 298 | 600761 | 安徽合力 | 6,200  | 101,432.00 | 0.07 |
| 299 | 300428 | 立中集团 | 5,500  | 99,990.00  | 0.06 |
| 300 | 605099 | 共创草坪 | 3,100  | 99,820.00  | 0.06 |
| 301 | 002176 | 江特电机 | 9,900  | 99,099.00  | 0.06 |
| 302 | 600075 | 新疆天业 | 24,400 | 98,576.00  | 0.06 |
| 303 | 603663 | 三祥新材 | 1,000  | 96,300.00  | 0.06 |
| 304 | 002901 | 大博医疗 | 2,300  | 96,094.00  | 0.06 |
| 305 | 688208 | 道通科技 | 3,783  | 95,293.77  | 0.06 |
| 306 | 300171 | 东富龙  | 8,600  | 95,116.00  | 0.06 |
| 307 | 600246 | 万通发展 | 4,900  | 93,100.00  | 0.06 |
| 308 | 301297 | 富乐德  | 1,500  | 91,860.00  | 0.06 |
| 309 | 002053 | 云南能投 | 9,100  | 89,453.00  | 0.06 |
| 310 | 000923 | 河钢资源 | 7,200  | 89,352.00  | 0.06 |
| 311 | 002151 | 北斗星通 | 2,800  | 88,900.00  | 0.06 |
| 312 | 000552 | 甘肃能化 | 39,600 | 88,704.00  | 0.06 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 313 | 300861 | 美畅股份 | 3,500  | 88,165.00 | 0.06 |
| 314 | 300607 | 拓斯达  | 2,100  | 86,583.00 | 0.06 |
| 315 | 600478 | 科力远  | 17,000 | 85,680.00 | 0.06 |
| 316 | 603100 | 川仪股份 | 4,700  | 84,835.00 | 0.05 |
| 317 | 603950 | 长源东谷 | 1,000  | 84,430.00 | 0.05 |
| 318 | 600710 | 苏美达  | 8,800  | 84,128.00 | 0.05 |
| 319 | 603171 | 税友股份 | 2,100  | 83,685.00 | 0.05 |
| 320 | 002701 | 奥瑞金  | 19,600 | 83,496.00 | 0.05 |
| 321 | 688205 | 德科立  | 400    | 83,276.00 | 0.05 |
| 322 | 600452 | 涪陵电力 | 8,900  | 83,037.00 | 0.05 |
| 323 | 600596 | 新安股份 | 5,200  | 82,992.00 | 0.05 |
| 324 | 002326 | 永太科技 | 3,500  | 82,775.00 | 0.05 |
| 325 | 000813 | 德展健康 | 27,200 | 82,416.00 | 0.05 |
| 326 | 603516 | 淳中科技 | 600    | 80,766.00 | 0.05 |
| 327 | 601678 | 滨化股份 | 12,200 | 80,398.00 | 0.05 |
| 328 | 603063 | 禾望电气 | 1,500  | 79,335.00 | 0.05 |
| 329 | 300568 | 星源材质 | 4,200  | 78,624.00 | 0.05 |
| 330 | 002761 | 浙江建投 | 11,300 | 74,919.00 | 0.05 |
| 331 | 688668 | 鼎通科技 | 200    | 74,660.00 | 0.05 |
| 332 | 600640 | 国脉文化 | 7,700  | 74,459.00 | 0.05 |
| 333 | 688062 | 迈威生物 | 2,634  | 74,410.50 | 0.05 |
| 334 | 300319 | 麦捷科技 | 2,500  | 74,075.00 | 0.05 |
| 335 | 301238 | 瑞泰新材 | 3,000  | 73,200.00 | 0.05 |
| 336 | 002961 | 瑞达期货 | 3,600  | 70,488.00 | 0.05 |
| 337 | 002183 | 怡亚通  | 13,200 | 70,356.00 | 0.05 |
| 338 | 600509 | 天富能源 | 8,300  | 70,135.00 | 0.05 |
| 339 | 601003 | 柳钢股份 | 20,800 | 70,096.00 | 0.05 |
| 340 | 000600 | 建投能源 | 8,000  | 70,000.00 | 0.05 |
| 341 | 002043 | 兔宝宝  | 6,200  | 68,696.00 | 0.04 |
| 342 | 002458 | 益生股份 | 8,500  | 66,045.00 | 0.04 |
| 343 | 603337 | 杰克科技 | 1,800  | 65,214.00 | 0.04 |
| 344 | 300348 | 长亮科技 | 7,300  | 64,240.00 | 0.04 |
| 345 | 300327 | 中颖电子 | 2,000  | 64,100.00 | 0.04 |
| 346 | 600827 | 百联股份 | 8,600  | 63,726.00 | 0.04 |
| 347 | 600057 | 厦门象屿 | 11,600 | 62,872.00 | 0.04 |
| 348 | 002557 | 洽洽食品 | 3,500  | 62,860.00 | 0.04 |
| 349 | 603328 | 依顿电子 | 5,000  | 62,650.00 | 0.04 |
| 350 | 603009 | 北特科技 | 1,300  | 62,361.00 | 0.04 |
| 351 | 600556 | 天下秀  | 14,000 | 61,880.00 | 0.04 |
| 352 | 600328 | 中盐化工 | 10,300 | 61,800.00 | 0.04 |
| 353 | 603992 | 松霖科技 | 1,900  | 61,560.00 | 0.04 |
| 354 | 603162 | 海通发展 | 6,800  | 60,996.00 | 0.04 |
| 355 | 601568 | 北元化工 | 17,800 | 60,520.00 | 0.04 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 356 | 000712 | 锦龙股份  | 6,700  | 59,362.00 | 0.04 |
| 357 | 600151 | 航天机电  | 5,000  | 56,100.00 | 0.04 |
| 358 | 601606 | 长城军工  | 2,000  | 54,980.00 | 0.04 |
| 359 | 300337 | 银邦股份  | 4,600  | 53,636.00 | 0.03 |
| 360 | 600022 | 山东钢铁  | 42,500 | 52,700.00 | 0.03 |
| 361 | 301571 | 国科天成  | 800    | 52,144.00 | 0.03 |
| 362 | 300363 | 博腾股份  | 3,200  | 51,968.00 | 0.03 |
| 363 | 603039 | 泛微网络  | 1,400  | 50,498.00 | 0.03 |
| 364 | 002948 | 青岛银行  | 9,600  | 48,768.00 | 0.03 |
| 365 | 688091 | 上海谊众  | 1,189  | 47,797.80 | 0.03 |
| 366 | 603612 | 索通发展  | 2,600  | 47,138.00 | 0.03 |
| 367 | 002985 | 北摩高科  | 1,700  | 47,090.00 | 0.03 |
| 368 | 688031 | 星环科技  | 400    | 46,072.00 | 0.03 |
| 369 | 300855 | 图南股份  | 1,400  | 43,764.00 | 0.03 |
| 370 | 600216 | 浙江医药  | 3,800  | 43,320.00 | 0.03 |
| 371 | 002936 | 郑州银行  | 25,000 | 41,250.00 | 0.03 |
| 372 | 600908 | 无锡银行  | 7,900  | 40,132.00 | 0.03 |
| 373 | 000029 | 深深房 A | 1,800  | 39,690.00 | 0.03 |
| 374 | 300342 | 天银机电  | 800    | 37,600.00 | 0.02 |
| 375 | 002251 | 步步高   | 11,100 | 37,518.00 | 0.02 |
| 376 | 600366 | 宁波韵升  | 2,500  | 36,700.00 | 0.02 |
| 377 | 688001 | 华兴源创  | 400    | 34,280.00 | 0.02 |
| 378 | 688005 | 容百科技  | 1,050  | 32,130.00 | 0.02 |
| 379 | 600353 | 旭光电子  | 700    | 31,920.00 | 0.02 |
| 380 | 300026 | 红日药业  | 10,900 | 31,610.00 | 0.02 |
| 381 | 688549 | 中巨芯   | 800    | 29,448.00 | 0.02 |
| 382 | 002006 | 精工科技  | 2,000  | 29,420.00 | 0.02 |
| 383 | 300166 | 东方国信  | 1,600  | 28,336.00 | 0.02 |
| 384 | 600739 | 辽宁成大  | 2,600  | 26,286.00 | 0.02 |
| 385 | 000685 | 中山公用  | 2,300  | 25,668.00 | 0.02 |
| 386 | 688131 | 皓元医药  | 242    | 22,893.20 | 0.01 |
| 387 | 601375 | 中原证券  | 5,600  | 22,344.00 | 0.01 |
| 388 | 600575 | 淮河能源  | 6,900  | 22,011.00 | 0.01 |
| 389 | 688333 | 铂力特   | 200    | 20,480.00 | 0.01 |
| 390 | 600268 | 国电南自  | 1,700  | 19,754.00 | 0.01 |
| 391 | 300070 | 碧水源   | 5,800  | 18,502.00 | 0.01 |
| 392 | 002928 | 华夏航空  | 2,600  | 18,174.00 | 0.01 |
| 393 | 000682 | 东方电子  | 1,400  | 17,682.00 | 0.01 |
| 394 | 688380 | 中微半导  | 217    | 14,302.47 | 0.01 |
| 395 | 688326 | 经纬恒润  | 200    | 14,176.00 | 0.01 |
| 396 | 300244 | 迪安诊断  | 700    | 13,118.00 | 0.01 |
| 397 | 600248 | 陕建股份  | 4,500  | 12,015.00 | 0.01 |
| 398 | 002389 | 航天彩虹  | 600    | 10,662.00 | 0.01 |

|     |        |      |       |          |      |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 399 | 688584 | 上海合晶 | 268   | 9,634.60 | 0.01 |
| 400 | 688083 | 中望软件 | 128   | 8,288.00 | 0.01 |
| 401 | 002060 | 广东建工 | 2,500 | 7,575.00 | 0.00 |
| 402 | 688612 | 威迈斯  | 250   | 7,397.50 | 0.00 |
| 403 | 001339 | 智微智能 | 70    | 7,159.60 | 0.00 |
| 404 | 688591 | 泰凌微  | 191   | 6,566.58 | 0.00 |
| 405 | 688097 | 博众精工 | 100   | 6,305.00 | 0.00 |
| 406 | 688003 | 天准科技 | 39    | 4,964.70 | 0.00 |
| 407 | 688153 | 唯捷创芯 | 140   | 4,496.80 | 0.00 |
| 408 | 301196 | 唯科科技 | 30    | 3,762.60 | 0.00 |
| 409 | 688206 | 概伦电子 | 64    | 2,839.68 | 0.00 |
| 410 | 002396 | 星网锐捷 | 110   | 2,108.70 | 0.00 |
| 411 | 688382 | 益方生物 | 116   | 2,088.00 | 0.00 |
| 412 | 688486 | 龙迅股份 | 30    | 1,907.40 | 0.00 |
| 413 | 002048 | 宁波华翔 | 73    | 1,679.00 | 0.00 |
| 414 | 002987 | 京北方  | 120   | 1,167.60 | 0.00 |
| 415 | 603888 | 新华网  | 64    | 1,089.92 | 0.00 |
| 416 | 301263 | 泰恩康  | 40    | 819.60   | 0.00 |
| 417 | 603323 | 苏农银行 | 170   | 657.90   | 0.00 |
| 418 | 600305 | 恒顺醋业 | 99    | 624.69   | 0.00 |
| 419 | 603236 | 移远通信 | 12    | 614.04   | 0.00 |
| 420 | 688660 | 电气风电 | 18    | 155.16   | 0.00 |
| 421 | 300415 | 伊之密  | 6     | 119.46   | 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  | 000553 | 安道麦 A | 80,100 | 428,535.00 | 0.28         |
| 2  | 688072 | 拓荆科技  | 400    | 351,812.00 | 0.23         |
| 3  | 002379 | 宏桥控股  | 23,200 | 342,664.00 | 0.22         |
| 4  | 688498 | 源杰科技  | 180    | 339,480.00 | 0.22         |
| 5  | 002266 | 浙富控股  | 64,800 | 327,888.00 | 0.21         |
| 6  | 601872 | 招商轮船  | 17,300 | 303,961.00 | 0.20         |
| 7  | 600595 | 中孚实业  | 48,500 | 272,570.00 | 0.18         |
| 8  | 000599 | 青岛双星  | 60,300 | 254,466.00 | 0.16         |
| 9  | 301090 | 华润材料  | 39,900 | 250,173.00 | 0.16         |
| 10 | 688355 | 明志科技  | 11,415 | 219,738.75 | 0.14         |
| 11 | 301578 | 辰奕智能  | 10,300 | 210,017.00 | 0.14         |
| 12 | 301037 | 保立佳   | 17,200 | 206,400.00 | 0.13         |
| 13 | 301519 | 舜禹股份  | 18,900 | 205,065.00 | 0.13         |
| 14 | 301228 | 实朴检测  | 2,500  | 195,400.00 | 0.13         |
| 15 | 688663 | 新风光   | 2,200  | 194,612.00 | 0.13         |
| 16 | 001309 | 德明利   | 200    | 188,580.00 | 0.12         |
| 17 | 603909 | 建发合诚  | 21,800 | 185,954.00 | 0.12         |

|    |        |       |        |            |      |
|----|--------|-------|--------|------------|------|
| 18 | 605287 | 德才股份  | 4,400  | 182,556.00 | 0.12 |
| 19 | 300358 | 楚天科技  | 22,600 | 180,800.00 | 0.12 |
| 20 | 002285 | 世联行   | 85,000 | 174,250.00 | 0.11 |
| 21 | 601106 | 中国一重  | 50,500 | 166,650.00 | 0.11 |
| 22 | 300490 | 华自科技  | 12,500 | 165,375.00 | 0.11 |
| 23 | 688373 | 盟科药业  | 36,200 | 163,986.00 | 0.11 |
| 24 | 688055 | 龙腾光电  | 28,400 | 163,584.00 | 0.11 |
| 25 | 002645 | 华宏科技  | 5,700  | 156,807.00 | 0.10 |
| 26 | 002738 | 中矿资源  | 2,600  | 153,374.00 | 0.10 |
| 27 | 688221 | 前沿生物  | 6,800  | 152,320.00 | 0.10 |
| 28 | 301093 | 华兰股份  | 1,100  | 149,193.00 | 0.10 |
| 29 | 003016 | 欣贺股份  | 23,700 | 145,281.00 | 0.09 |
| 30 | 600202 | 哈空调   | 31,800 | 142,464.00 | 0.09 |
| 31 | 605138 | 盛泰集团  | 25,700 | 141,864.00 | 0.09 |
| 32 | 603936 | 博敏电子  | 5,300  | 141,563.00 | 0.09 |
| 33 | 300854 | 中兰环保  | 7,400  | 141,192.00 | 0.09 |
| 34 | 301308 | 江波龙   | 200    | 140,760.00 | 0.09 |
| 35 | 301260 | 格力博   | 10,300 | 139,153.00 | 0.09 |
| 36 | 002219 | 新里程   | 78,400 | 135,632.00 | 0.09 |
| 37 | 300308 | 中际旭创  | 100    | 127,000.00 | 0.08 |
| 38 | 000338 | 潍柴动力  | 4,300  | 117,175.00 | 0.08 |
| 39 | 688808 | 联讯仪器  | 65     | 102,981.45 | 0.07 |
| 40 | 002558 | 巨人网络  | 3,500  | 96,460.00  | 0.06 |
| 41 | 002068 | 黑猫股份  | 6,100  | 91,683.00  | 0.06 |
| 42 | 301159 | 三维天地  | 2,900  | 84,390.00  | 0.05 |
| 43 | 301526 | 国际复材  | 1,700  | 79,339.00  | 0.05 |
| 44 | 600841 | 动力新科  | 13,000 | 79,300.00  | 0.05 |
| 45 | 688378 | 奥来德   | 1,200  | 74,400.00  | 0.05 |
| 46 | 002493 | 荣盛石化  | 6,700  | 72,025.00  | 0.05 |
| 47 | 603629 | 利通电子  | 400    | 71,524.00  | 0.05 |
| 48 | 001248 | 华润新能源 | 6,896  | 69,718.56  | 0.04 |
| 49 | 605117 | 德业股份  | 600    | 63,708.00  | 0.04 |
| 50 | 002169 | 智光电气  | 4,300  | 62,952.00  | 0.04 |
| 51 | 301060 | 兰卫医学  | 7,600  | 62,092.00  | 0.04 |
| 52 | 000881 | 中广核技  | 9,100  | 58,968.00  | 0.04 |
| 53 | 601700 | 风范股份  | 13,100 | 57,116.00  | 0.04 |
| 54 | 300463 | 迈克生物  | 6,800  | 56,168.00  | 0.04 |
| 55 | 601869 | 长飞光纤  | 100    | 54,590.00  | 0.04 |
| 56 | 688667 | 菱电电控  | 400    | 53,460.00  | 0.03 |
| 57 | 300569 | 天能重工  | 10,800 | 52,056.00  | 0.03 |
| 58 | 300424 | 航新科技  | 3,300  | 51,942.00  | 0.03 |
| 59 | 300720 | 海川智能  | 500    | 48,100.00  | 0.03 |
| 60 | 300694 | 蠡湖股份  | 4,900  | 47,040.00  | 0.03 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 61  | 000703 | 恒逸石化 | 3,200  | 43,424.00 | 0.03 |
| 62  | 688111 | 金山办公 | 200    | 42,610.00 | 0.03 |
| 63  | 605189 | 富春染织 | 3,500  | 42,175.00 | 0.03 |
| 64  | 301448 | 开创电气 | 900    | 40,842.00 | 0.03 |
| 65  | 603719 | 良品铺子 | 4,700  | 40,655.00 | 0.03 |
| 66  | 600606 | 绿地控股 | 31,100 | 37,631.00 | 0.02 |
| 67  | 600429 | 三元股份 | 8,500  | 34,340.00 | 0.02 |
| 68  | 688331 | 荣昌生物 | 230    | 29,959.80 | 0.02 |
| 69  | 000782 | 恒申新材 | 3,700  | 29,896.00 | 0.02 |
| 70  | 301068 | 大地海洋 | 1,200  | 28,560.00 | 0.02 |
| 71  | 688797 | 臻宝科技 | 58     | 27,182.86 | 0.02 |
| 72  | 600257 | 大湖股份 | 6,100  | 26,413.00 | 0.02 |
| 73  | 300620 | 光库科技 | 68     | 25,717.60 | 0.02 |
| 74  | 600801 | 华新建材 | 1,500  | 23,400.00 | 0.02 |
| 75  | 688635 | 长进光子 | 73     | 22,497.87 | 0.01 |
| 76  | 001399 | 惠科股份 | 759    | 21,047.07 | 0.01 |
| 77  | 603335 | 迪生力  | 2,100  | 19,005.00 | 0.01 |
| 78  | 300842 | 帝科股份 | 200    | 17,834.00 | 0.01 |
| 79  | 600685 | 中船防务 | 700    | 17,808.00 | 0.01 |
| 80  | 002202 | 金风科技 | 700    | 16,730.00 | 0.01 |
| 81  | 688475 | 萤石网络 | 600    | 16,410.00 | 0.01 |
| 82  | 300233 | 金城医药 | 1,300  | 16,120.00 | 0.01 |
| 83  | 300801 | 泰和科技 | 400    | 12,920.00 | 0.01 |
| 84  | 301531 | 春光集团 | 244    | 12,580.64 | 0.01 |
| 85  | 688420 | 美腾科技 | 527    | 11,103.89 | 0.01 |
| 86  | 600884 | 杉杉股份 | 700    | 9,485.00  | 0.01 |
| 87  | 301599 | 理奇智能 | 282    | 9,156.54  | 0.01 |
| 88  | 301669 | 高特电子 | 288    | 8,179.20  | 0.01 |
| 89  | 688081 | 兴图新科 | 200    | 8,176.00  | 0.01 |
| 90  | 688329 | 艾隆科技 | 400    | 8,084.00  | 0.01 |
| 91  | 688209 | 英集芯  | 250    | 7,270.00  | 0.00 |
| 92  | 002111 | 威海广泰 | 800    | 7,200.00  | 0.00 |
| 93  | 301338 | 凯格精机 | 40     | 6,515.60  | 0.00 |
| 94  | 688485 | 九州一轨 | 100    | 6,406.00  | 0.00 |
| 95  | 688090 | 瑞松科技 | 60     | 6,387.00  | 0.00 |
| 96  | 301150 | 中一科技 | 100    | 6,311.00  | 0.00 |
| 97  | 001365 | 天海电子 | 200    | 6,262.00  | 0.00 |
| 98  | 688679 | 通源环境 | 148    | 6,229.32  | 0.00 |
| 99  | 300998 | 宁波方正 | 200    | 5,566.00  | 0.00 |
| 100 | 300953 | 震裕科技 | 40     | 5,348.00  | 0.00 |
| 101 | 001393 | 维通利  | 137    | 5,341.63  | 0.00 |
| 102 | 688236 | 春立医疗 | 305    | 4,410.30  | 0.00 |
| 103 | 688007 | 光峰科技 | 328    | 4,362.40  | 0.00 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 104 | 603435 | 嘉德利  | 82  | 3,830.22 | 0.00 |
| 105 | 301310 | 鑫宏业  | 60  | 3,314.40 | 0.00 |
| 106 | 300938 | 信测标准 | 60  | 2,992.80 | 0.00 |
| 107 | 300226 | 上海钢联 | 60  | 918.60   | 0.00 |
| 108 | 688538 | 和辉光电 | 139 | 361.40   | 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  | 601126 | 四方股份 | 4,606,188.00 | 5.68           |
| 2  | 002497 | 雅化集团 | 4,574,700.95 | 5.64           |
| 3  | 600320 | 振华重工 | 4,478,720.00 | 5.52           |
| 4  | 603588 | 高能环境 | 4,321,140.40 | 5.33           |
| 5  | 600037 | 歌华有线 | 4,243,217.00 | 5.23           |
| 6  | 300438 | 鹏辉能源 | 3,845,032.00 | 4.74           |
| 7  | 688390 | 固德威  | 3,817,240.72 | 4.70           |
| 8  | 603083 | 剑桥科技 | 3,696,190.00 | 4.56           |
| 9  | 600201 | 生物股份 | 3,661,398.00 | 4.51           |
| 10 | 301217 | 铜冠铜箔 | 3,660,661.00 | 4.51           |
| 11 | 688779 | 五矿新能 | 3,632,700.86 | 4.48           |
| 12 | 300098 | 高新兴  | 3,573,888.00 | 4.40           |
| 13 | 600490 | 鹏欣资源 | 3,542,696.00 | 4.37           |
| 14 | 600595 | 中孚实业 | 3,479,425.00 | 4.29           |
| 15 | 600654 | 中安科  | 3,439,535.00 | 4.24           |
| 16 | 600114 | 东睦股份 | 3,390,840.00 | 4.18           |
| 17 | 301215 | 中汽股份 | 3,344,324.00 | 4.12           |
| 18 | 601208 | 东材科技 | 3,304,462.00 | 4.07           |
| 19 | 002518 | 科士达  | 3,233,542.00 | 3.98           |
| 20 | 688559 | 海目星  | 3,233,044.86 | 3.98           |
| 21 | 002895 | 川恒股份 | 3,230,866.00 | 3.98           |
| 22 | 002545 | 东方铁塔 | 3,223,792.00 | 3.97           |
| 23 | 000612 | 焦作万方 | 3,210,475.00 | 3.96           |
| 24 | 300257 | 开山股份 | 3,201,077.00 | 3.94           |
| 25 | 688206 | 概伦电子 | 3,190,455.03 | 3.93           |
| 26 | 300548 | 长芯博创 | 3,186,792.20 | 3.93           |
| 27 | 000603 | 盛达资源 | 3,184,177.00 | 3.92           |
| 28 | 001309 | 德明利  | 3,153,046.00 | 3.89           |
| 29 | 300475 | 香农芯创 | 3,148,426.00 | 3.88           |
| 30 | 688321 | 微芯生物 | 3,140,924.30 | 3.87           |
| 31 | 600269 | 赣粤高速 | 3,112,837.00 | 3.84           |
| 32 | 605020 | 永和股份 | 3,102,413.00 | 3.82           |
| 33 | 600552 | 凯盛科技 | 3,069,224.00 | 3.78           |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 34 | 002048 | 宁波华翔   | 3,060,311.35 | 3.77 |
| 35 | 600100 | 同方股份   | 3,044,860.00 | 3.75 |
| 36 | 002484 | 江海股份   | 3,008,997.00 | 3.71 |
| 37 | 301511 | 德福科技   | 2,989,950.00 | 3.68 |
| 38 | 300672 | 国科微    | 2,970,774.00 | 3.66 |
| 39 | 300602 | 飞荣达    | 2,969,919.00 | 3.66 |
| 40 | 603118 | 共进股份   | 2,954,906.00 | 3.64 |
| 41 | 601801 | 皖新传媒   | 2,954,548.00 | 3.64 |
| 42 | 300357 | 我武生物   | 2,928,858.00 | 3.61 |
| 43 | 002204 | 大连重工   | 2,916,557.00 | 3.59 |
| 44 | 688127 | 蓝特光学   | 2,916,369.67 | 3.59 |
| 45 | 600335 | 国机汽车   | 2,910,575.00 | 3.59 |
| 46 | 600361 | 创新新材   | 2,904,066.00 | 3.58 |
| 47 | 688690 | 纳微科技   | 2,891,576.59 | 3.56 |
| 48 | 688209 | 英集芯    | 2,881,994.73 | 3.55 |
| 49 | 002396 | 星网锐捷   | 2,858,596.00 | 3.52 |
| 50 | 002378 | 章源钨业   | 2,857,856.00 | 3.52 |
| 51 | 002373 | 千方科技   | 2,849,681.00 | 3.51 |
| 52 | 603505 | 金石资源   | 2,833,982.00 | 3.49 |
| 53 | 000935 | 四川双马   | 2,809,733.00 | 3.46 |
| 54 | 688372 | 伟测科技   | 2,803,236.49 | 3.45 |
| 55 | 688088 | 虹软科技   | 2,801,144.30 | 3.45 |
| 56 | 300593 | 新雷能    | 2,786,318.00 | 3.43 |
| 57 | 600353 | 旭光电子   | 2,774,189.00 | 3.42 |
| 58 | 600728 | 佳都科技   | 2,728,052.00 | 3.36 |
| 59 | 688519 | 南亚新材   | 2,725,978.99 | 3.36 |
| 60 | 688331 | 荣昌生物   | 2,718,318.09 | 3.35 |
| 61 | 600388 | 紫金龙净   | 2,716,324.75 | 3.35 |
| 62 | 600961 | 株冶集团   | 2,703,301.00 | 3.33 |
| 63 | 600718 | 东软集团   | 2,681,766.00 | 3.30 |
| 64 | 600782 | 新钢股份   | 2,679,181.00 | 3.30 |
| 65 | 300762 | 上海瀚讯   | 2,667,056.00 | 3.29 |
| 66 | 603888 | 新华网    | 2,661,999.00 | 3.28 |
| 67 | 603730 | 岱美股份   | 2,661,594.00 | 3.28 |
| 68 | 600662 | 外服控股   | 2,649,125.51 | 3.26 |
| 69 | 002668 | TCL 智家 | 2,633,339.00 | 3.25 |
| 70 | 601678 | 滨化股份   | 2,625,904.00 | 3.24 |
| 71 | 300772 | 运达股份   | 2,617,230.00 | 3.23 |
| 72 | 002563 | 森马服饰   | 2,607,457.00 | 3.21 |
| 73 | 600577 | 精达股份   | 2,602,661.00 | 3.21 |
| 74 | 300323 | 华灿光电   | 2,594,800.00 | 3.20 |
| 75 | 603100 | 川仪股份   | 2,588,054.00 | 3.19 |
| 76 | 688333 | 铂力特    | 2,587,687.75 | 3.19 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 77  | 603236 | 移远通信 | 2,564,484.00 | 3.16 |
| 78  | 600252 | 中恒集团 | 2,528,168.00 | 3.12 |
| 79  | 000811 | 冰轮环境 | 2,500,031.00 | 3.08 |
| 80  | 000589 | 贵州轮胎 | 2,477,110.00 | 3.05 |
| 81  | 000600 | 建投能源 | 2,473,901.00 | 3.05 |
| 82  | 601375 | 中原证券 | 2,433,213.00 | 3.00 |
| 83  | 603556 | 海兴电力 | 2,430,216.00 | 2.99 |
| 84  | 002967 | 广电计量 | 2,410,504.00 | 2.97 |
| 85  | 301031 | 中熔电气 | 2,403,571.52 | 2.96 |
| 86  | 002174 | 游族网络 | 2,379,381.00 | 2.93 |
| 87  | 002222 | 福晶科技 | 2,369,017.00 | 2.92 |
| 88  | 600210 | 紫江企业 | 2,364,581.00 | 2.91 |
| 89  | 601020 | 华钰矿业 | 2,358,440.00 | 2.91 |
| 90  | 002544 | 普天科技 | 2,337,314.00 | 2.88 |
| 91  | 688131 | 皓元医药 | 2,337,049.46 | 2.88 |
| 92  | 603915 | 国茂股份 | 2,322,359.00 | 2.86 |
| 93  | 603025 | 大豪科技 | 2,289,983.00 | 2.82 |
| 94  | 002258 | 利尔化学 | 2,258,843.00 | 2.78 |
| 95  | 688153 | 唯捷创芯 | 2,253,437.69 | 2.78 |
| 96  | 688403 | 汇成股份 | 2,252,867.35 | 2.78 |
| 97  | 300775 | 三角防务 | 2,240,615.00 | 2.76 |
| 98  | 688141 | 杰华特  | 2,233,205.58 | 2.75 |
| 99  | 300738 | 奥飞数据 | 2,221,500.00 | 2.74 |
| 100 | 688443 | 智翔金泰 | 2,214,297.29 | 2.73 |
| 101 | 603866 | 桃李面包 | 2,210,009.00 | 2.72 |
| 102 | 000059 | 华锦股份 | 2,209,872.00 | 2.72 |
| 103 | 600478 | 科力远  | 2,206,042.00 | 2.72 |
| 104 | 603613 | 国联股份 | 2,203,671.00 | 2.72 |
| 105 | 600338 | 西藏珠峰 | 2,191,797.00 | 2.70 |
| 106 | 688498 | 源杰科技 | 2,188,899.60 | 2.70 |
| 107 | 601003 | 柳钢股份 | 2,187,194.00 | 2.70 |
| 108 | 301339 | 通行宝  | 2,187,056.00 | 2.70 |
| 109 | 300244 | 迪安诊断 | 2,150,007.00 | 2.65 |
| 110 | 600623 | 华谊集团 | 2,140,087.00 | 2.64 |
| 111 | 688327 | 云从科技 | 2,136,083.67 | 2.63 |
| 112 | 603256 | 宏和科技 | 2,132,559.00 | 2.63 |
| 113 | 002399 | 海普瑞  | 2,129,420.00 | 2.62 |
| 114 | 600850 | 电科数字 | 2,123,920.00 | 2.62 |
| 115 | 002239 | 奥特佳  | 2,119,692.00 | 2.61 |
| 116 | 600776 | 东方通信 | 2,100,906.00 | 2.59 |
| 117 | 002489 | 浙江永强 | 2,097,153.00 | 2.58 |
| 118 | 000567 | 海德股份 | 2,085,940.00 | 2.57 |
| 119 | 001337 | 四川黄金 | 2,084,303.00 | 2.57 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 120 | 300363 | 博腾股份 | 2,077,457.00 | 2.56 |
| 121 | 688630 | 芯碁微装 | 2,076,185.27 | 2.56 |
| 122 | 601908 | 京运通  | 2,062,406.00 | 2.54 |
| 123 | 603328 | 依顿电子 | 2,056,726.00 | 2.53 |
| 124 | 688439 | 振华风光 | 2,054,843.30 | 2.53 |
| 125 | 603663 | 三祥新材 | 2,054,674.00 | 2.53 |
| 126 | 688182 | 灿勤科技 | 2,049,986.52 | 2.53 |
| 127 | 600572 | 康恩贝  | 2,029,802.00 | 2.50 |
| 128 | 002487 | 大金重工 | 2,012,478.00 | 2.48 |
| 129 | 688700 | 东威科技 | 2,010,734.97 | 2.48 |
| 130 | 300953 | 震裕科技 | 2,008,085.99 | 2.47 |
| 131 | 600315 | 上海家化 | 2,006,913.00 | 2.47 |
| 132 | 002170 | 芭田股份 | 2,003,124.00 | 2.47 |
| 133 | 605118 | 力鼎光电 | 2,000,496.00 | 2.47 |
| 134 | 300031 | 宝通科技 | 1,998,658.00 | 2.46 |
| 135 | 002911 | 佛燃能源 | 1,998,585.16 | 2.46 |
| 136 | 002099 | 海翔药业 | 1,995,968.00 | 2.46 |
| 137 | 002390 | 信邦制药 | 1,985,103.00 | 2.45 |
| 138 | 603678 | 火炬电子 | 1,985,061.00 | 2.45 |
| 139 | 688150 | 莱特光电 | 1,979,244.45 | 2.44 |
| 140 | 688586 | 江航装备 | 1,974,715.57 | 2.43 |
| 141 | 688110 | 东芯股份 | 1,960,397.39 | 2.42 |
| 142 | 300034 | 钢研高纳 | 1,960,259.00 | 2.42 |
| 143 | 300726 | 宏达电子 | 1,946,442.00 | 2.40 |
| 144 | 002011 | 盾安环境 | 1,925,827.00 | 2.37 |
| 145 | 601096 | 宏盛华源 | 1,925,095.00 | 2.37 |
| 146 | 300308 | 中际旭创 | 1,919,362.00 | 2.37 |
| 147 | 600643 | 爱建集团 | 1,916,324.00 | 2.36 |
| 148 | 688158 | 优刻得  | 1,914,354.88 | 2.36 |
| 149 | 600929 | 雪天盐业 | 1,913,544.00 | 2.36 |
| 150 | 000680 | 山推股份 | 1,908,253.00 | 2.35 |
| 151 | 300171 | 东富龙  | 1,907,955.00 | 2.35 |
| 152 | 688584 | 上海合晶 | 1,905,846.85 | 2.35 |
| 153 | 600366 | 宁波韵升 | 1,905,022.00 | 2.35 |
| 154 | 000848 | 承德露露 | 1,894,527.00 | 2.33 |
| 155 | 002010 | 传化智联 | 1,894,413.00 | 2.33 |
| 156 | 300185 | 通裕重工 | 1,882,115.00 | 2.32 |
| 157 | 600325 | 华发股份 | 1,878,047.00 | 2.31 |
| 158 | 600686 | 金龙汽车 | 1,862,781.00 | 2.30 |
| 159 | 002716 | 湖南白银 | 1,840,737.00 | 2.27 |
| 160 | 600928 | 西安银行 | 1,839,862.00 | 2.27 |
| 161 | 688313 | 仕佳光子 | 1,826,123.18 | 2.25 |
| 162 | 601869 | 长飞光纤 | 1,823,293.00 | 2.25 |

|     |        |       |              |      |
|-----|--------|-------|--------------|------|
| 163 | 605123 | 派克新材  | 1,821,572.00 | 2.24 |
| 164 | 000927 | 中国铁物  | 1,817,961.00 | 2.24 |
| 165 | 688208 | 道通科技  | 1,816,950.17 | 2.24 |
| 166 | 600867 | 通化东宝  | 1,806,587.00 | 2.23 |
| 167 | 002946 | 新乳业   | 1,792,549.00 | 2.21 |
| 168 | 000688 | 国城矿业  | 1,790,813.00 | 2.21 |
| 169 | 603305 | 旭升集团  | 1,786,759.00 | 2.20 |
| 170 | 688400 | 凌云光   | 1,780,309.01 | 2.19 |
| 171 | 600869 | 远东股份  | 1,764,105.00 | 2.17 |
| 172 | 601949 | 中国出版  | 1,760,916.54 | 2.17 |
| 173 | 603327 | 福蓉科技  | 1,751,191.00 | 2.16 |
| 174 | 688800 | 瑞可达   | 1,746,623.06 | 2.15 |
| 175 | 688270 | ST 臻镭 | 1,745,957.22 | 2.15 |
| 176 | 688766 | 普冉股份  | 1,744,728.00 | 2.15 |
| 177 | 600331 | 宏达股份  | 1,740,678.00 | 2.15 |
| 178 | 300134 | 大富科技  | 1,726,668.00 | 2.13 |
| 179 | 301381 | 赛维时代  | 1,703,997.00 | 2.10 |
| 180 | 600416 | 湘电股份  | 1,703,036.00 | 2.10 |
| 181 | 601900 | 南方传媒  | 1,699,679.00 | 2.09 |
| 182 | 300428 | 立中集团  | 1,697,805.00 | 2.09 |
| 183 | 300184 | 力源信息  | 1,683,361.00 | 2.07 |
| 184 | 600120 | 浙江东方  | 1,677,293.00 | 2.07 |
| 185 | 002127 | 南极电商  | 1,662,256.00 | 2.05 |
| 186 | 600022 | 山东钢铁  | 1,653,770.00 | 2.04 |
| 187 | 688063 | 派能科技  | 1,652,361.30 | 2.04 |
| 188 | 300296 | 利亚德   | 1,650,495.00 | 2.03 |
| 189 | 600020 | 中原高速  | 1,647,025.00 | 2.03 |
| 190 | 688262 | 国芯科技  | 1,642,542.05 | 2.02 |
| 191 | 301508 | 中机认检  | 1,639,860.00 | 2.02 |
| 192 | 000672 | 上峰材料  | 1,636,424.55 | 2.02 |
| 193 | 600185 | 珠免集团  | 1,636,206.00 | 2.02 |
| 194 | 002947 | 恒铭达   | 1,629,262.00 | 2.01 |
| 195 | 600726 | 华电能源  | 1,628,094.00 | 2.01 |
| 196 | 688382 | 益方生物  | 1,625,190.17 | 2.00 |

#### 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  | 601126 | 四方股份 | 4,857,617.00 | 5.99           |
| 2  | 301217 | 铜冠铜箔 | 4,685,073.00 | 5.77           |
| 3  | 603588 | 高能环境 | 4,219,569.32 | 5.20           |
| 4  | 300438 | 鹏辉能源 | 4,133,388.00 | 5.09           |
| 5  | 002497 | 雅化集团 | 4,085,253.00 | 5.03           |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 6  | 001309 | 德明利    | 4,045,219.00 | 4.99 |
| 7  | 600114 | 东睦股份   | 3,888,615.00 | 4.79 |
| 8  | 300475 | 香农芯创   | 3,847,852.00 | 4.74 |
| 9  | 300548 | 长芯博创   | 3,800,087.00 | 4.68 |
| 10 | 688498 | 源杰科技   | 3,691,030.07 | 4.55 |
| 11 | 300602 | 飞荣达    | 3,673,211.00 | 4.53 |
| 12 | 688209 | 英集芯    | 3,564,706.27 | 4.39 |
| 13 | 688206 | 概伦电子   | 3,535,278.28 | 4.36 |
| 14 | 688390 | 固德威    | 3,494,914.27 | 4.31 |
| 15 | 688519 | 南亚新材   | 3,469,242.46 | 4.28 |
| 16 | 002895 | 川恒股份   | 3,468,078.00 | 4.27 |
| 17 | 002518 | 科士达    | 3,453,519.00 | 4.26 |
| 18 | 600552 | 凯盛科技   | 3,402,195.00 | 4.19 |
| 19 | 002396 | 星网锐捷   | 3,369,724.00 | 4.15 |
| 20 | 601208 | 东材科技   | 3,367,855.00 | 4.15 |
| 21 | 603256 | 宏和科技   | 3,361,271.00 | 4.14 |
| 22 | 603083 | 剑桥科技   | 3,351,907.00 | 4.13 |
| 23 | 300257 | 开山股份   | 3,300,877.00 | 4.07 |
| 24 | 600490 | 鹏欣资源   | 3,298,314.00 | 4.06 |
| 25 | 002484 | 江海股份   | 3,278,142.00 | 4.04 |
| 26 | 605020 | 永和股份   | 3,273,704.00 | 4.03 |
| 27 | 600269 | 赣粤高速   | 3,270,916.00 | 4.03 |
| 28 | 600037 | 歌华有线   | 3,246,716.00 | 4.00 |
| 29 | 600320 | 振华重工   | 3,175,461.00 | 3.91 |
| 30 | 603730 | 岱美股份   | 3,156,808.00 | 3.89 |
| 31 | 600353 | 旭光电子   | 3,150,945.00 | 3.88 |
| 32 | 600595 | 中孚实业   | 3,117,257.00 | 3.84 |
| 33 | 600654 | 中安科    | 3,112,469.00 | 3.84 |
| 34 | 600100 | 同方股份   | 3,106,615.00 | 3.83 |
| 35 | 688690 | 纳微科技   | 3,043,048.79 | 3.75 |
| 36 | 603505 | 金石资源   | 3,039,368.50 | 3.75 |
| 37 | 000603 | 盛达资源   | 3,017,031.00 | 3.72 |
| 38 | 603118 | 共进股份   | 2,998,771.00 | 3.70 |
| 39 | 002048 | 宁波华翔   | 2,988,509.00 | 3.68 |
| 40 | 601678 | 滨化股份   | 2,973,428.00 | 3.66 |
| 41 | 688331 | 荣昌生物   | 2,971,547.33 | 3.66 |
| 42 | 000600 | 建投能源   | 2,958,239.00 | 3.65 |
| 43 | 688127 | 蓝特光学   | 2,894,584.08 | 3.57 |
| 44 | 300357 | 我武生物   | 2,858,666.00 | 3.52 |
| 45 | 002668 | TCL 智家 | 2,826,951.49 | 3.48 |
| 46 | 688559 | 海目星    | 2,815,850.90 | 3.47 |
| 47 | 300762 | 上海瀚讯   | 2,794,695.00 | 3.44 |
| 48 | 300593 | 新雷能    | 2,772,527.00 | 3.42 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 49 | 600961 | 株冶集团 | 2,759,355.00 | 3.40 |
| 50 | 000935 | 四川双马 | 2,737,398.00 | 3.37 |
| 51 | 600201 | 生物股份 | 2,716,754.00 | 3.35 |
| 52 | 688443 | 智翔金泰 | 2,709,113.25 | 3.34 |
| 53 | 301511 | 德福科技 | 2,680,444.00 | 3.30 |
| 54 | 603236 | 移远通信 | 2,658,443.00 | 3.28 |
| 55 | 600478 | 科力远  | 2,645,143.00 | 3.26 |
| 56 | 601375 | 中原证券 | 2,614,474.00 | 3.22 |
| 57 | 688131 | 皓元医药 | 2,605,516.77 | 3.21 |
| 58 | 601020 | 华钰矿业 | 2,598,851.00 | 3.20 |
| 59 | 600782 | 新钢股份 | 2,592,819.00 | 3.20 |
| 60 | 000589 | 贵州轮胎 | 2,579,204.00 | 3.18 |
| 61 | 000811 | 冰轮环境 | 2,574,255.00 | 3.17 |
| 62 | 301031 | 中熔电气 | 2,541,095.00 | 3.13 |
| 63 | 603915 | 国茂股份 | 2,525,695.00 | 3.11 |
| 64 | 300772 | 运达股份 | 2,524,798.00 | 3.11 |
| 65 | 300323 | 华灿光电 | 2,514,033.00 | 3.10 |
| 66 | 603888 | 新华网  | 2,513,396.52 | 3.10 |
| 67 | 601801 | 皖新传媒 | 2,498,290.00 | 3.08 |
| 68 | 688088 | 虹软科技 | 2,491,818.16 | 3.07 |
| 69 | 002373 | 千方科技 | 2,483,328.00 | 3.06 |
| 70 | 600252 | 中恒集团 | 2,481,633.00 | 3.06 |
| 71 | 688403 | 汇成股份 | 2,476,487.57 | 3.05 |
| 72 | 688333 | 铂力特  | 2,467,835.70 | 3.04 |
| 73 | 603328 | 依顿电子 | 2,467,218.00 | 3.04 |
| 74 | 603613 | 国联股份 | 2,460,593.05 | 3.03 |
| 75 | 688372 | 伟测科技 | 2,453,648.66 | 3.02 |
| 76 | 601869 | 长飞光纤 | 2,452,076.00 | 3.02 |
| 77 | 688584 | 上海合晶 | 2,440,714.85 | 3.01 |
| 78 | 300098 | 高新兴  | 2,437,196.00 | 3.00 |
| 79 | 688313 | 仕佳光子 | 2,416,950.87 | 2.98 |
| 80 | 300953 | 震裕科技 | 2,397,225.00 | 2.95 |
| 81 | 603100 | 川仪股份 | 2,388,101.00 | 2.94 |
| 82 | 688779 | 五矿新能 | 2,381,863.21 | 2.94 |
| 83 | 002967 | 广电计量 | 2,373,494.00 | 2.93 |
| 84 | 002222 | 福晶科技 | 2,367,712.34 | 2.92 |
| 85 | 002378 | 章源钨业 | 2,360,556.00 | 2.91 |
| 86 | 300672 | 国科微  | 2,341,469.00 | 2.89 |
| 87 | 000612 | 焦作万方 | 2,339,466.00 | 2.88 |
| 88 | 600718 | 东软集团 | 2,321,504.00 | 2.86 |
| 89 | 002399 | 海普瑞  | 2,320,517.00 | 2.86 |
| 90 | 002544 | 普天科技 | 2,288,581.00 | 2.82 |
| 91 | 601908 | 京运通  | 2,262,021.00 | 2.79 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 92  | 301215 | 中汽股份 | 2,259,281.00 | 2.78 |
| 93  | 688321 | 微芯生物 | 2,257,064.45 | 2.78 |
| 94  | 603663 | 三祥新材 | 2,248,388.00 | 2.77 |
| 95  | 002204 | 大连重工 | 2,231,605.00 | 2.75 |
| 96  | 603866 | 桃李面包 | 2,228,418.00 | 2.75 |
| 97  | 300363 | 博腾股份 | 2,226,006.00 | 2.74 |
| 98  | 688182 | 灿勤科技 | 2,224,664.43 | 2.74 |
| 99  | 300775 | 三角防务 | 2,218,063.00 | 2.73 |
| 100 | 600315 | 上海家化 | 2,199,700.00 | 2.71 |
| 101 | 688141 | 杰华特  | 2,199,690.30 | 2.71 |
| 102 | 002011 | 盾安环境 | 2,194,296.00 | 2.70 |
| 103 | 601003 | 柳钢股份 | 2,190,952.00 | 2.70 |
| 104 | 600388 | 紫金龙净 | 2,190,032.00 | 2.70 |
| 105 | 600776 | 东方通信 | 2,180,043.00 | 2.69 |
| 106 | 002489 | 浙江永强 | 2,152,674.00 | 2.65 |
| 107 | 600867 | 通化东宝 | 2,152,121.00 | 2.65 |
| 108 | 002545 | 东方铁塔 | 2,143,075.00 | 2.64 |
| 109 | 688208 | 道通科技 | 2,133,767.64 | 2.63 |
| 110 | 300185 | 通裕重工 | 2,116,472.00 | 2.61 |
| 111 | 600728 | 佳都科技 | 2,111,306.00 | 2.60 |
| 112 | 600643 | 爱建集团 | 2,098,431.00 | 2.59 |
| 113 | 603556 | 海兴电力 | 2,085,402.00 | 2.57 |
| 114 | 002487 | 大金重工 | 2,079,470.00 | 2.56 |
| 115 | 000848 | 承德露露 | 2,074,976.40 | 2.56 |
| 116 | 000927 | 中国铁物 | 2,060,979.00 | 2.54 |
| 117 | 688153 | 唯捷创芯 | 2,050,918.19 | 2.53 |
| 118 | 600210 | 紫江企业 | 2,047,183.00 | 2.52 |
| 119 | 300308 | 中际旭创 | 2,040,769.00 | 2.51 |
| 120 | 600120 | 浙江东方 | 2,027,323.00 | 2.50 |
| 121 | 300244 | 迪安诊断 | 2,005,443.00 | 2.47 |
| 122 | 600577 | 精达股份 | 1,999,290.00 | 2.46 |
| 123 | 002170 | 芭田股份 | 1,995,182.00 | 2.46 |
| 124 | 600361 | 创新新材 | 1,995,036.00 | 2.46 |
| 125 | 688630 | 芯碁微装 | 1,992,867.24 | 2.46 |
| 126 | 688700 | 东威科技 | 1,990,041.96 | 2.45 |
| 127 | 000059 | 华锦股份 | 1,987,763.00 | 2.45 |
| 128 | 002174 | 游族网络 | 1,987,024.91 | 2.45 |
| 129 | 301381 | 赛维时代 | 1,981,898.00 | 2.44 |
| 130 | 600869 | 远东股份 | 1,966,624.00 | 2.42 |
| 131 | 300031 | 宝通科技 | 1,943,923.00 | 2.40 |
| 132 | 002239 | 奥特佳  | 1,941,612.00 | 2.39 |
| 133 | 002390 | 信邦制药 | 1,937,134.00 | 2.39 |
| 134 | 002258 | 利尔化学 | 1,925,111.00 | 2.37 |

|     |        |       |              |      |
|-----|--------|-------|--------------|------|
| 135 | 301339 | 通行宝   | 1,916,719.20 | 2.36 |
| 136 | 600335 | 国机汽车  | 1,896,744.00 | 2.34 |
| 137 | 300726 | 宏达电子  | 1,890,629.00 | 2.33 |
| 138 | 600325 | 华发股份  | 1,886,113.00 | 2.32 |
| 139 | 601900 | 南方传媒  | 1,884,667.00 | 2.32 |
| 140 | 688439 | 振华风光  | 1,883,827.41 | 2.32 |
| 141 | 601083 | 锦江航运  | 1,882,318.66 | 2.32 |
| 142 | 002946 | 新乳业   | 1,882,049.00 | 2.32 |
| 143 | 688800 | 瑞可达   | 1,880,127.73 | 2.32 |
| 144 | 688150 | 莱特光电  | 1,879,683.36 | 2.32 |
| 145 | 603678 | 火炬电子  | 1,879,167.00 | 2.32 |
| 146 | 600338 | 西藏珠峰  | 1,869,510.00 | 2.30 |
| 147 | 300428 | 立中集团  | 1,860,331.00 | 2.29 |
| 148 | 605118 | 力鼎光电  | 1,852,679.00 | 2.28 |
| 149 | 600686 | 金龙汽车  | 1,843,215.00 | 2.27 |
| 150 | 000672 | 上峰材料  | 1,815,975.80 | 2.24 |
| 151 | 600623 | 华谊集团  | 1,814,629.00 | 2.24 |
| 152 | 600662 | 外服控股  | 1,811,597.00 | 2.23 |
| 153 | 600366 | 宁波韵升  | 1,805,907.00 | 2.23 |
| 154 | 002091 | 江苏国泰  | 1,777,464.00 | 2.19 |
| 155 | 600105 | 永鼎股份  | 1,774,257.00 | 2.19 |
| 156 | 600022 | 山东钢铁  | 1,754,624.00 | 2.16 |
| 157 | 688327 | 云从科技  | 1,745,065.48 | 2.15 |
| 158 | 600850 | 电科数字  | 1,733,754.00 | 2.14 |
| 159 | 688380 | 中微半导  | 1,729,847.46 | 2.13 |
| 160 | 300171 | 东富龙   | 1,722,456.00 | 2.12 |
| 161 | 603005 | 晶方科技  | 1,719,225.00 | 2.12 |
| 162 | 688062 | 迈威生物  | 1,718,834.65 | 2.12 |
| 163 | 600933 | 爱柯迪   | 1,704,880.00 | 2.10 |
| 164 | 002563 | 森马服饰  | 1,682,882.00 | 2.07 |
| 165 | 002073 | 软控股份  | 1,682,255.00 | 2.07 |
| 166 | 688270 | ST 臻镭 | 1,681,164.93 | 2.07 |
| 167 | 600640 | 国脉文化  | 1,670,538.00 | 2.06 |
| 168 | 688726 | 拉普拉斯  | 1,670,034.71 | 2.06 |
| 169 | 002237 | 恒邦股份  | 1,662,342.00 | 2.05 |
| 170 | 001227 | 兰州银行  | 1,660,850.00 | 2.05 |
| 171 | 688382 | 益方生物  | 1,659,533.49 | 2.05 |
| 172 | 300738 | 奥飞数据  | 1,653,960.00 | 2.04 |
| 173 | 600572 | 康恩贝   | 1,653,784.00 | 2.04 |
| 174 | 301508 | 中机认检  | 1,649,618.00 | 2.03 |
| 175 | 300443 | 金雷股份  | 1,648,618.30 | 2.03 |
| 176 | 300296 | 利亚德   | 1,648,230.00 | 2.03 |
| 177 | 002911 | 佛燃能源  | 1,644,981.00 | 2.03 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 178 | 600305 | 恒顺醋业 | 1,640,980.26 | 2.02 |
| 179 | 600416 | 湘电股份 | 1,632,317.00 | 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 | 930,911,283.90 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 876,339,515.75 |

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      | 5,547,280.74 | 3.57         |
| 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        | 5,547,280.74 | 3.57         |

#### 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  | 019792 | 25 国债 19 | 29,000 | 2,930,427.75 | 1.89         |
| 2  | 019827 | 26 国债 01 | 26,000 | 2,616,852.99 | 1.68         |

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本

和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

### 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 | 417,100.80 |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 236,697.78 |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 653,798.58 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限股票。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|------|------|-------------|--------------|----------|
|----|------|------|-------------|--------------|----------|

|   |        |      |            |      |        |
|---|--------|------|------------|------|--------|
| 1 | 688072 | 拓荆科技 | 351,812.00 | 0.23 | 重大事项停牌 |
|---|--------|------|------------|------|--------|

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<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例<br>(%) | 持有份额          | 占总份<br>额比例<br>(%) |
| 中金中证<br>1000 指数<br>增强发起<br>A | 1,058            | 50,436.74     | 12,836,949.02 | 24.06             | 40,525,122.36 | 75.94             |
| 中金中证<br>1000 指数<br>增强发起<br>B | 216              | 4,262.79      | —             | —                 | 920,762.03    | 100.00            |
| 中金中证<br>1000 指数<br>增强发起<br>C | 686              | 71,059.96     | 20,156,911.77 | 41.35             | 28,590,220.86 | 58.65             |
| 合计                           | 1,960            | 52,566.31     | 32,993,860.79 | 32.02             | 70,036,105.25 | 67.98             |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别               | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|--------------------|------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 中金中证 1000 指数增强发起 A | 350,193.82 | 0.6563      |
|                  | 中金中证 1000 指数增强发起 B | 116.93     | 0.0127      |
|                  | 中金中证 1000 指数增强发起 C | 20.00      | 0.0000      |
|                  | 合计                 | 350,330.75 | 0.3400      |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别               | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|--------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 中金中证 1000 指数增强发起 A | 10~50             |
|                                | 中金中证 1000 指数增强发起 B | 0                 |
|                                | 中金中证 1000 指数增强发起 C | 0                 |

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

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 1000 指数增强<br>发起 A | 中金中证 1000 指数增强<br>发起 B | 中金中证 1000 指数增强<br>发起 C |
|-------------------------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| 基金合同生效<br>日（2023 年 3<br>月 14 日）基金<br>份额总额 | 115,561,785.72         | —                      | 87,898,617.61          |
| 本报告期期初<br>基金份额总额                          | 30,320,411.25          | 2,172,755.27           | 29,980,889.11          |
| 本报告期基金<br>总申购份额                           | 161,607,313.95         | 1,725,347.21           | 127,852,217.52         |
| 减：本报告期<br>基金总赎回份<br>额                     | 138,565,653.82         | 2,977,340.45           | 109,085,974.00         |
| 本报告期基金<br>拆分变动份额                          | —                      | —                      | —                      |
| 本报告期期末<br>基金份额总额                          | 53,362,071.38          | 920,762.03             | 48,747,132.63          |

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，本基金管理人未发生重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本基金管理人在本报告期内未受到调查或处罚。

#### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本基金管理人相关从业人员在本报告期内未受到调查或处罚。

#### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

#### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

#### 10.7.1 基金租用或者通过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 (%) |    |
| 中金财富证券 | 3      | 1,019,406,332.64 | 56.42            | 199,724.07 | 58.49          | —  |
| 华西证券   | 2      | 787,510,728.68   | 43.58            | 141,752.13 | 41.51          | —  |

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好，资本充足，财务指标等符合监管要求；
- (2) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

- 2、基金交易单元的选择程序如下：
- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
  - (2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订《交易单元租用协议》《证券综合服务协议》
- (注：被动股票型基金不通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用)。

10.7.2 基金租用或者通过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(%) |
| 中金财富证券 | 22,115,198.00 | 100.00          | 125,980,000.00 | 100.00            | -    | -               |
| 华西证券   | -             | -               | -              | -                 | -    | -               |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|-------------------------------------|-----------|------------|
| 1  | 中金基金管理有限公司关于旗下部分基金投资北交所股票及相关风险提示的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2026-02-07 |
| 2  | 中金基金管理有限公司关于新增基金直销账户的公告             | 中国证监会规定媒介 | 2026-04-21 |
| 3  | 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 | 2026-04-29 |
| 4  | 中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告    | 中国证监会规定媒介 | 2026-06-17 |
| 5  | 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 | 2026-06-25 |
| 6  | 中金基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合    | 中国证监会规定媒介 | 2026-06-26 |

|   |                                 |           |            |
|---|---------------------------------|-----------|------------|
|   | 同等法律文件的公告                       |           |            |
| 7 | 中金基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金估值调整情况的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2026-06-27 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金申请募集注册的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、报告期内中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日