

中金中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1. 1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 3 月 13 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金经理及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52
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	52

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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 A500 指数增强型证券投资基金		
基金简称	中金中证 A500 指数增强		
基金主代码	023522		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2025 年 3 月 13 日		
基金管理人	中金基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	215,104,428.74 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	中金中证 A500 指数增强 A	中金中证 A500 指数增强 B	中金中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023522	023965	023523
报告期末下属分级基金的份额总额	133,192,973.79 份	113,441.24 份	81,798,013.71 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 A500 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收益，力求基金资产的长期增值。
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，然后通过基本面与技术面等多种量化因子构建量化增强策略，并根据策略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、转融通证券出借业务投资策略；8、融资投资策略；9、存托凭证投资策略。详见《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款税后利率 \times 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。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰	冯萌
	联系电话	010-63211122	021-52629999-213310
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95561
传真		010-66159121	021-62159217
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	福建省福州市台江区江滨中大 道 398 号兴业银行大厦
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 B 座 43 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		100004	200120
法定代表人		李金泽	吕家进

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期 间 数据 和 指 标	2025 年 3 月 13 日(基金合 同生效日) -2025 年 6 月 30 日	2025 年 4 月 11 日(基金合 同生效日) -2025 年 6 月 30 日	2025 年 3 月 13 日(基金合 同生效日) -2025 年 6 月 30 日
	中金中证 A500 指数增强 A	中金中证 A500 指数增强 B	中金中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	-5,586,213.33	-3,328.91	-4,130,116.06
本期利润	-1,460,888.61	11,273.61	-2,776,140.63
加权平均基 金份额本期 利润	-0.0097	0.0601	-0.0270

本期加权平均净值利润率	-1.00%	6.23%	-2.81%
本期基金份额净值增长率	-0.37%	7.85%	-0.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)		
期末可供分配利润	-4,644,191.43	-3,954.33	-2,969,626.44
期末可供分配基金份额利润	-0.0349	-0.0349	-0.0363
期末基金资产净值	132,706,805.06	113,028.75	81,377,049.48
期末基金份额净值	0.9963	0.9964	0.9949
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	-0.37%	7.85%	-0.51%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金中证 A500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.72%	0.55%	2.68%	0.57%	1.04%	-0.02%

过去三个月	1. 91%	1. 17%	0. 83%	1. 14%	1. 08%	0. 03%
自基金合同生效起至今	-0. 37%	1. 08%	-0. 90%	1. 09%	0. 53%	-0. 01%

中金中证 A500 指数增强 B

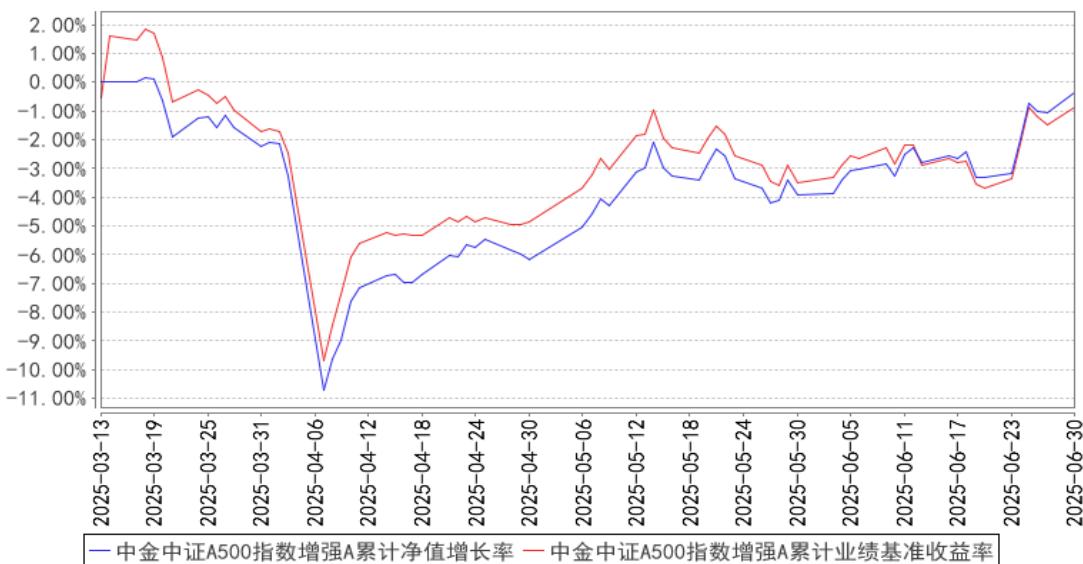
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3. 73%	0. 54%	2. 68%	0. 57%	1. 05%	-0. 03%
自基金合同生效起至今	7. 85%	0. 53%	5. 52%	0. 54%	2. 33%	-0. 01%

中金中证 A500 指数增强 C

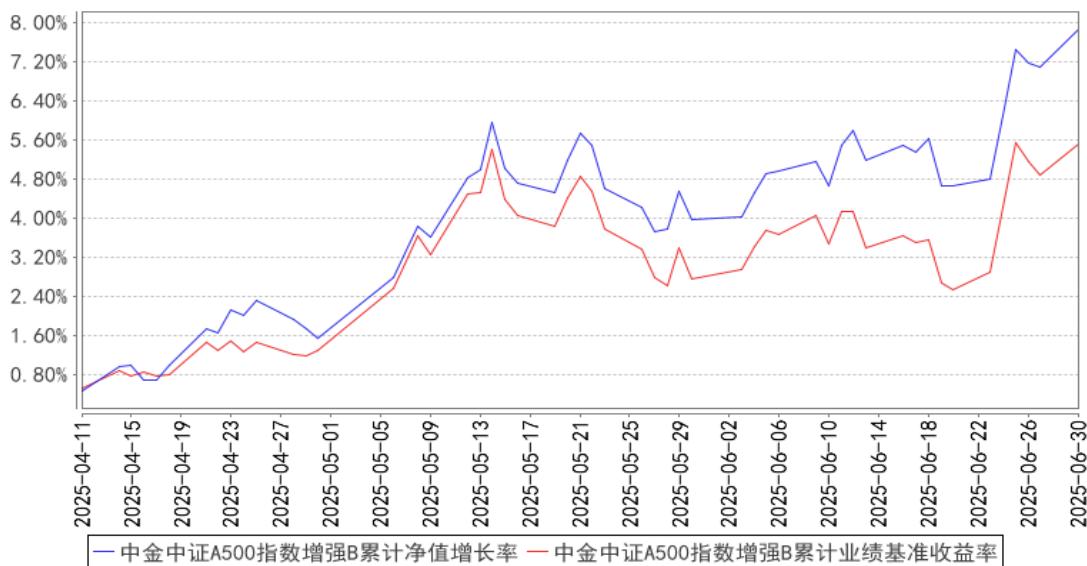
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3. 69%	0. 55%	2. 68%	0. 57%	1. 01%	-0. 02%
过去三个月	1. 79%	1. 17%	0. 83%	1. 14%	0. 96%	0. 03%
自基金合同生效起至今	-0. 51%	1. 08%	-0. 90%	1. 09%	0. 39%	-0. 01%

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

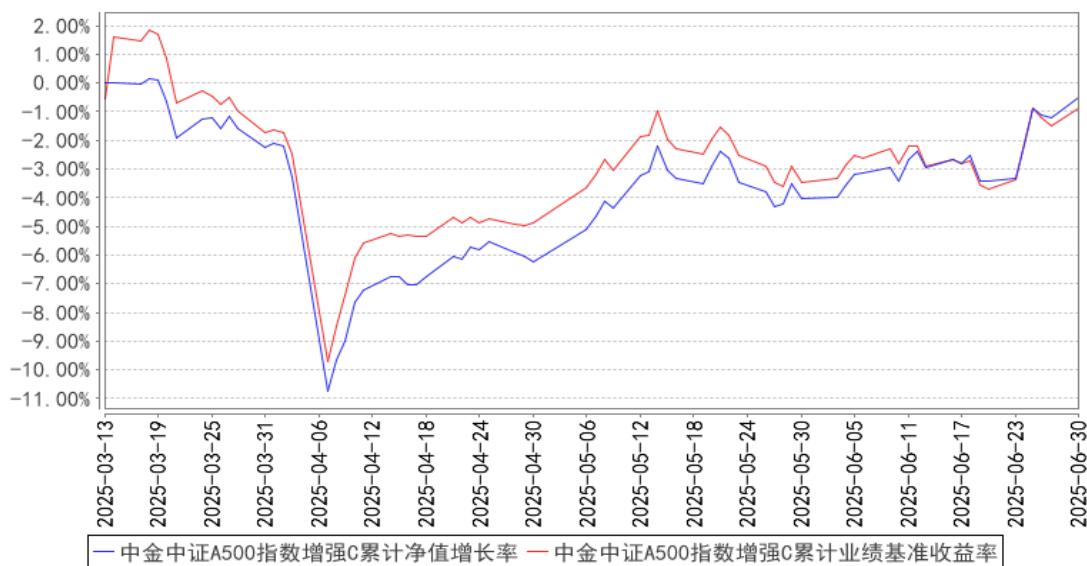
中金中证A500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中金中证A500指数增强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A500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金的基金合同生效日为 2025 年 03 月 13 日，按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

2、本基金自 2025 年 04 月 10 日起增加 B 类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股

的基金公司，注册资本 7 亿元人民币。母公司中金公司致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 60 只公募基金，证券投资基金管理规模 2,201.82 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
耿帅军	本基金基 金经理	2025 年 3 月 13 日	-	14 年	耿帅军先生，理学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所金融工程分析师；中信证券股份有限公司研究部副总裁、金融工程分析师；中国国际金融股份有限公司研究部执行总经理、金融工程分析师。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。
王阳峰	本基金基 金经理	2025 年 3 月 13 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

本报告期内，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公

司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证 A500 指数增强 A 基金份额净值为 0.9963 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.37%，同期业绩基准收益率为 -0.90%；中金中证 A500 指数增强 B 基金份额净值为 0.9964 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.85%，同期业绩基准收益率为 5.52%；中金中证 A500 指数增强 C 基金份额净值为 0.9949 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.51%，同期业绩基准收益率为 -0.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，全球贸易环境不确定性上升已逐渐成为基准假设，预计国内仍将保持战略定力，“延续”坚定不移办好自己的事，“坚定不移扩大高水平对外开放”的政策基调，宏观经济有望在政策发力见效的支持下延续平稳增长，经济结构调整深化则将为市场提供较多的投资机遇。上市公司盈利能力有机会延续上半年的改善势头，从而支撑中国资产的内在价值持续提升。当前市场风险溢价处于中性水平，预计未来市场将更多定价基本面的边际变化。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

基金管理人建立并执行基金估值相关管理制度，设置估值委员会研究、指导基金估值业务。各估值委员会委员和基金会计均具有相关工作经历和专业胜任能力。参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资产：		
货币资金	6. 4. 7. 1	12,971,415.88
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	201,700,607.05
其中：股票投资		201,700,607.05
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6. 4. 7. 3	-
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	-
债权投资	6. 4. 7. 5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6. 4. 7. 6	-
其他权益工具投资	6. 4. 7. 7	-
应收清算款		-
应收股利		-

应收申购款		407,061.09
递延所得税资产		-
其他资产	6. 4. 7. 8	-
资产总计		215,079,084.02
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		621,528.18
应付管理人报酬		145,445.72
应付托管费		18,180.71
应付销售服务费		34,479.41
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6. 4. 7. 9	62,566.71
负债合计		882,200.73
净资产:		
实收基金	6. 4. 7. 10	215,104,428.74
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	-907,545.45
净资产合计		214,196,883.29
负债和净资产总计		215,079,084.02

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，中金中证 A500 指数增强 A 的基金份额净值为 0.9963 元，期末份额总额为 133,192,973.79 份；中金中证 A500 指数增强 B 的基金份额净值为 0.9964 元，期末份额总额为 113,441.24 份；中金中证 A500 指数增强 C 的基金份额净值为 0.9949 元，期末份额总额为 81,798,013.71 份。基金份额总额 215,104,428.74 份。

6.2 利润表

会计主体：中金中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 3 月 13 日（基金合同 生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-3,360,748.62

1. 利息收入		21,014.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	21,014.26
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“-”号填列）		-8,876,173.96
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-11,428,145.59
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	2,551,971.63
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	5,493,902.67
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	508.41
減：二、营业总支出		865,007.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	583,449.49
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	72,931.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	146,892.13
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	61,734.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,225,755.63
減：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,225,755.63
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-4,225,755.63

6.3 净资产变动表

会计主体：中金中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	284,403,084.16	-	-	284,403,084.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-69,298,655.42	-	-907,545.45	-70,206,200.87
(一)、综合收益总额	-	-	-4,225,755.63	-4,225,755.63
(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)	-69,298,655.42	-	3,318,210.18	-65,980,445.24
其中：1. 基金申购款	10,773,463.28	-	-477,406.22	10,296,057.06
2. 基金赎回款	-80,072,118.70	-	3,795,616.40	-76,276,502.30
(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	215,104,428.74	-	-907,545.45	214,196,883.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

宗喆

二

白娜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金中证 A500 指数增强型证券投资基金（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 2025 年 2 月 10 日证监许可〔2025〕258 号《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》和《中金中证 A500 指数增强型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股票型基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、腾安基金销售（深圳）有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司等共同销售，募集期为 2025 年 3 月 5 日起至 2025 年 3 月 11 日。经向中国证监会备案，《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2025 年 3 月 13 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 284,403,084.16 份（含利息转份额 31,258.71 份），发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据基金合同和《中金基金管理有限公司关于中金中证 A500 指数增强型证券投资基金增设基金份额并修改法律文件的公告》，本基金于 2025 年 4 月 10 日起增设 B 类份额（基金代码：023965），在本次基金份额增设完成后，本基金原有 A 类基金份额（基金代码：023522）、C 类基金份额（基金代码：023523）的份额类别名称及各项业务规则保持不变。在投资人认购 / 申购时收取认购 / 申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 B 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购 / 申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、B 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、B 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监

会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况、自 2025 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为自 2025 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量

且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

以摊余成本计量的金融负债：初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

以摊余成本计量的金融资产：初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债：初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量：

预期信用损失 是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报：

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销：

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资

产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(a) 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

(b) 投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益（如有）按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益（如有）按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的

个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资及资产支持证券投资（如有），在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

(c) 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产（如有）、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费（如有）在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；由于本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假

设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金管理业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金管理流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》。

通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信 (2021) 20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》财税(2014) 81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

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

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

(d) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	4,034,966.97
等于： 本金	4,034,516.25
加： 应计利息	450.72
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	8,936,448.91
等于： 本金	8,936,355.37
加： 应计利息	93.54
减： 坏账准备	—
合计	12,971,415.88

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	196,206,704.38	-	201,700,607.05	5,493,902.67
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	196,206,704.38	-	201,700,607.05	5,493,902.67

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	61,734.20
其他	832.51
合计	62,566.71

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 A500 指数增强 A

项目	本期 2025年3月13日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	159,696,668.80	159,696,668.80
本期申购	7,314,207.03	7,314,207.03
本期赎回（以“-”号填列）	-33,817,902.04	-33,817,902.04
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	133,192,973.79	133,192,973.79

中金中证 A500 指数增强 B

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	347,327.06	347,327.06
本期赎回(以“-”号填列)	-233,885.82	-233,885.82
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	113,441.24	113,441.24

中金中证 A500 指数增强 C

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	124,706,415.36	124,706,415.36
本期申购	3,111,929.19	3,111,929.19
本期赎回(以“-”号填列)	-46,020,330.84	-46,020,330.84
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	81,798,013.71	81,798,013.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中金中证 A500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-5,586,213.33	4,125,324.72	-1,460,888.61
本期基金份额交易产生的变动数	942,021.90	32,697.98	974,719.88

其中：基金申购款	-254,249.30	-73,597.64	-327,846.94
基金赎回款	1,196,271.20	106,295.62	1,302,566.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,644,191.43	4,158,022.70	-486,168.73

中金中证 A500 指数增强 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-3,328.91	14,602.52	11,273.61
本期基金份额交易产生的变动数	-625.42	-11,060.68	-11,686.10
其中：基金申购款	-9,825.11	-7,995.00	-17,820.11
基金赎回款	9,199.69	-3,065.68	6,134.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,954.33	3,541.84	-412.49

中金中证 A500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-4,130,116.06	1,353,975.43	-2,776,140.63
本期基金份额交易产生的变动数	1,160,489.62	1,194,686.78	2,355,176.40
其中：基金申购款	-117,539.09	-14,200.08	-131,739.17
基金赎回款	1,278,028.71	1,208,886.86	2,486,915.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,969,626.44	2,548,662.21	-420,964.23

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	17,856.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,109.20
结算备付金利息收入	-
其他	48.32
合计	21,014.26

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年3月13日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-11,428,145.59
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	-11,428,145.59

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年3月13日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出股票成交总额	456,063,545.49
减：卖出股票成本总额	466,977,506.75
减：交易费用	514,184.33
买卖股票差价收入	-11,428,145.59

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月13日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,551,971.63
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,551,971.63

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年3月13日（基金合同生效日）至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	5,493,902.67
股票投资	5,493,902.67
债券投资	-

资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,493,902.67

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年3月13日（基金合同生效日）至2025年6月30日
基金赎回费收入	508.41
合计	508.41

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年3月13日（基金合同生效日）至2025年6月30日
审计费用	16,836.60
信息披露费	44,897.60
证券出借违约金	-
合计	61,734.20

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
兴业银行	基金托管人
中国中金财富证券有限公司（以下简称“中金财富证券”）	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月13日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	583,449.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	203,624.57
应支付基金管理人的净管理费	379,824.92

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月13日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	72,931.19

注：支付基金托管人兴业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 3 月 13 日（基金合同生效日）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 A500 指数增强 A	中金中证 A500 指数增强 B	中金中证 A500 指数增强 C	合计
中金财富证券	-	-	15.66	15.66
合计	-	-	15.66	15.66

注：本基金 A 类、B 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 0.50%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×0.50%/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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入
兴业银行	4,034,966.97	17,856.74

注：本基金的活期银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期在承销期内未参与认购关联方承销的证券。本基金基金合同生效日为 2025 年 3 月 13 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未实施利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	16.42	16.42	937	15,385.54	15,385.54	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	9,400	268,441.26	357,670.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型指数增强基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金、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。

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。

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。

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。

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。

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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性压力测试、流动性风险预警、指标超标及危机的处理、流动性风险管理工具、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司投资风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性指标进行监控。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	12,970,871.62	-	-	544.26	12,971,415.88
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	201,700,607.05	201,700,607.05
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	-	-	-	407,061.09	407,061.09
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,970,871.62	-	-	202,108,212.40	215,079,084.02
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	621,528.18	621,528.18
应付销售服务费	-	-	-	34,479.41	34,479.41
应付管理人报酬	-	-	-	145,445.72	145,445.72
应付托管费	-	-	-	18,180.71	18,180.71
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	62,566.71	62,566.71
负债总计	-	-	-	882,200.73	882,200.73
利率敏感度缺口	12,970,871.62	-	-	-201,226,011.67	214,196,883.29

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	201,700,607.05	94.17
交易性金融资产—基金投资	-	-
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	201,700,607.05	94.17

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日
第一层次	201,327,551.51
第二层次	373,055.54
第三层次	-
合计	201,700,607.05

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	201,700,607.05	93.78
	其中：股票	201,700,607.05	93.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,971,415.88	6.03
8	其他各项资产	407,061.09	0.19
9	合计	215,079,084.02	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,180,481.00	0.55
B	采矿业	10,240,359.00	4.78
C	制造业	114,294,657.51	53.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,828,362.00	2.25
E	建筑业	3,774,553.00	1.76
F	批发和零售业	4,263,058.00	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	5,661,211.00	2.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,695,707.60	4.53
J	金融业	30,558,232.00	14.27
K	房地产业	1,153,298.00	0.54
L	租赁和商务服务业	685,498.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	2,880,761.00	1.34
N	水利、环境和公共设施管理业	1,407,103.00	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,893,216.00	0.88
R	文化、体育和娱乐业	2,336,440.00	1.09
S	综合	-	-
	合计	194,852,937.11	90.97

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	118,160.00	0.06
C	制造业	4,022,628.54	1.88

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	474,051.00	0.22
E	建筑业	196,839.00	0.09
F	批发和零售业	487,799.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	238,944.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	799,474.00	0.37
J	金融业	275,848.00	0.13
K	房地产业	127,584.00	0.06
L	租赁和商务服务业	60,264.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	19,006.40	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	27,072.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,847,669.94	3.20

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	600519	贵州茅台	4,800	6,765,696.00	3.16
2	300750	宁德时代	21,200	5,347,064.00	2.50
3	000333	美的集团	64,300	4,642,460.00	2.17
4	601899	紫金矿业	237,200	4,625,400.00	2.16
5	600036	招商银行	87,900	4,039,005.00	1.89
6	601318	中国平安	65,400	3,628,392.00	1.69
7	600000	浦发银行	239,200	3,320,096.00	1.55
8	603259	药明康德	41,420	2,880,761.00	1.34
9	300502	新易盛	22,040	2,799,520.80	1.31
10	300476	胜宏科技	20,000	2,687,600.00	1.25
11	600919	江苏银行	216,100	2,580,234.00	1.20

12	688008	澜起科技	31,171	2,556,022.00	1.19
13	300274	阳光电源	36,940	2,503,423.80	1.17
14	600031	三一重工	127,600	2,290,420.00	1.07
15	600276	恒瑞医药	41,600	2,159,040.00	1.01
16	000725	京东方 A	535,400	2,136,246.00	1.00
17	601919	中远海控	141,400	2,126,656.00	0.99
18	002001	新和成	96,700	2,056,809.00	0.96
19	603288	海天味业	52,499	2,042,736.09	0.95
20	600900	长江电力	66,800	2,013,352.00	0.94
21	600030	中信证券	71,500	1,974,830.00	0.92
22	300015	爱尔眼科	151,700	1,893,216.00	0.88
23	601319	中国人保	214,600	1,869,166.00	0.87
24	000001	平安银行	154,100	1,859,987.00	0.87
25	601328	交通银行	229,200	1,833,600.00	0.86
26	600183	生益科技	59,400	1,790,910.00	0.84
27	000858	五粮液	14,700	1,747,830.00	0.82
28	000651	格力电器	38,300	1,720,436.00	0.80
29	600160	巨化股份	59,400	1,703,592.00	0.80
30	600989	宝丰能源	103,818	1,675,622.52	0.78
31	600887	伊利股份	59,800	1,667,224.00	0.78
32	600482	中国动力	69,800	1,610,286.00	0.75
33	601868	中国能建	694,600	1,548,958.00	0.72
34	600166	福田汽车	554,400	1,502,424.00	0.70
35	600704	物产中大	282,000	1,486,140.00	0.69
36	000100	TCL 科技	328,000	1,420,240.00	0.66
37	600335	国机汽车	214,900	1,386,105.00	0.65
38	300124	汇川技术	21,200	1,368,884.00	0.64
39	002594	比亚迪	4,100	1,360,831.00	0.64
40	300627	华测导航	38,780	1,357,300.00	0.63
41	600563	法拉电子	12,400	1,352,716.00	0.63
42	601288	农业银行	228,400	1,342,992.00	0.63
43	601601	中国太保	35,600	1,335,356.00	0.62
44	300395	菲利华	26,100	1,333,710.00	0.62
45	000425	徐工机械	170,200	1,322,454.00	0.62
46	603486	科沃斯	22,400	1,304,352.00	0.61
47	600219	南山铝业	339,600	1,300,668.00	0.61
48	601628	中国人寿	31,200	1,285,128.00	0.60
49	601658	邮储银行	229,500	1,255,365.00	0.59
50	603816	顾家家居	47,800	1,219,856.00	0.57
51	600690	海尔智家	48,500	1,201,830.00	0.56
52	603993	洛阳钼业	141,700	1,193,114.00	0.56
53	688256	寒武纪	1,967	1,183,150.50	0.55
54	002714	牧原股份	28,100	1,180,481.00	0.55

55	300017	网宿科技	108,200	1,159,904.00	0.54
56	000988	华工科技	24,500	1,151,745.00	0.54
57	000975	山金国际	60,400	1,143,976.00	0.53
58	600050	中国联通	213,100	1,137,954.00	0.53
59	600547	山东黄金	35,200	1,123,936.00	0.52
60	600176	中国巨石	98,000	1,117,200.00	0.52
61	601766	中国中车	158,500	1,115,840.00	0.52
62	300059	东方财富	46,900	1,084,797.00	0.51
63	603087	甘李药业	19,700	1,079,166.00	0.50
64	002230	科大讯飞	22,500	1,077,300.00	0.50
65	002410	广联达	78,800	1,056,708.00	0.49
66	603596	伯特利	20,000	1,053,800.00	0.49
67	600460	士兰微	41,700	1,034,994.00	0.48
68	601816	京沪高铁	177,500	1,020,625.00	0.48
69	000157	中联重科	136,800	989,064.00	0.46
70	000538	云南白药	17,700	987,483.00	0.46
71	300408	三环集团	29,300	978,620.00	0.46
72	601117	中国化学	126,900	973,323.00	0.45
73	601988	中国银行	168,000	944,160.00	0.44
74	688213	思特威	9,000	919,980.00	0.43
75	605499	东鹏饮料	2,900	910,745.00	0.43
76	603799	华友钴业	24,500	906,990.00	0.42
77	300251	光线传媒	44,400	899,988.00	0.42
78	600998	九州通	174,900	898,986.00	0.42
79	000408	藏格矿业	21,000	896,070.00	0.42
80	688235	百济神州	3,800	887,832.00	0.41
81	002138	顺络电子	31,300	880,156.00	0.41
82	601600	中国铝业	125,000	880,000.00	0.41
83	002202	金风科技	83,900	859,975.00	0.40
84	002414	高德红外	83,200	852,800.00	0.40
85	603129	春风动力	3,900	844,350.00	0.39
86	300628	亿联网络	24,200	841,192.00	0.39
87	300182	捷成股份	152,000	837,520.00	0.39
88	688608	恒玄科技	2,400	835,152.00	0.39
89	000563	陕国投 A	231,700	827,169.00	0.39
90	002244	滨江集团	84,600	824,850.00	0.39
91	601857	中国石油	96,200	822,510.00	0.38
92	002624	完美世界	53,400	810,078.00	0.38
93	300699	光威复材	25,500	807,585.00	0.38
94	600019	宝钢股份	117,800	776,302.00	0.36
95	600104	上汽集团	48,300	775,215.00	0.36
96	601233	桐昆股份	72,400	767,440.00	0.36
97	600011	华能国际	103,200	736,848.00	0.34

98	601216	君正集团	133,200	735,264.00	0.34
99	601398	工商银行	95,100	721,809.00	0.34
100	300088	长信科技	121,100	721,756.00	0.34
101	603501	豪威集团	5,600	714,840.00	0.33
102	600988	赤峰黄金	28,700	714,056.00	0.33
103	002266	浙富控股	230,800	710,864.00	0.33
104	600499	科达制造	71,900	704,620.00	0.33
105	002463	沪电股份	16,300	694,054.00	0.32
106	601668	中国建筑	118,300	682,591.00	0.32
107	300604	长川科技	15,100	678,141.00	0.32
108	002352	顺丰控股	13,300	648,508.00	0.30
109	600905	三峡能源	152,200	648,372.00	0.30
110	688111	金山办公	2,314	648,035.70	0.30
111	002595	豪迈科技	10,800	639,576.00	0.30
112	603568	伟明环保	33,300	635,364.00	0.30
113	002493	荣盛石化	76,000	629,280.00	0.29
114	002027	分众传媒	86,200	629,260.00	0.29
115	600066	宇通客车	25,100	623,986.00	0.29
116	600004	白云机场	68,000	618,800.00	0.29
117	600885	宏发股份	27,040	603,262.40	0.28
118	300033	同花顺	2,200	600,622.00	0.28
119	300014	亿纬锂能	13,100	600,111.00	0.28
120	002739	万达电影	52,400	598,932.00	0.28
121	002340	格林美	92,700	588,645.00	0.27
122	601877	正泰电器	25,100	569,017.00	0.27
123	600674	川投能源	34,900	559,796.00	0.26
124	300454	深信服	5,900	555,662.00	0.26
125	000568	泸州老窖	4,800	544,320.00	0.25
126	600008	首创环保	174,600	527,292.00	0.25
127	002245	蔚蓝锂芯	37,000	474,710.00	0.22
128	000708	中信特钢	39,800	468,048.00	0.22
129	600699	均胜电子	25,700	448,208.00	0.21
130	601866	中远海发	178,800	441,636.00	0.21
131	000932	华菱钢铁	98,500	433,400.00	0.20
132	600660	福耀玻璃	7,300	416,173.00	0.19
133	601728	中国电信	50,500	391,375.00	0.18
134	603659	璞泰来	20,000	375,600.00	0.18
135	688122	西部超导	7,091	367,881.08	0.17
136	002920	德赛西威	3,600	367,668.00	0.17
137	002130	沃尔核材	15,300	364,446.00	0.17
138	002475	立讯精密	10,500	364,245.00	0.17
139	300054	鼎龙股份	12,600	361,368.00	0.17
140	000792	盐湖股份	20,800	355,264.00	0.17

141	603986	兆易创新	2,800	354,284.00	0.17
142	600085	同仁堂	9,800	353,388.00	0.16
143	600009	上海机场	10,800	343,116.00	0.16
144	600535	天士力	21,500	336,475.00	0.16
145	300308	中际旭创	2,300	335,478.00	0.16
146	601727	上海电气	44,600	329,594.00	0.15
147	600150	中国船舶	10,000	325,400.00	0.15
148	601618	中国中冶	108,000	321,840.00	0.15
149	000625	长安汽车	24,200	308,792.00	0.14
150	300573	兴齐眼药	5,960	308,668.40	0.14
151	601985	中国核电	33,000	307,560.00	0.14
152	603939	益丰药房	12,500	305,875.00	0.14
153	000338	潍柴动力	19,800	304,524.00	0.14
154	600018	上港集团	53,200	303,772.00	0.14
155	600111	北方稀土	12,000	298,800.00	0.14
156	000977	浪潮信息	5,300	269,664.00	0.13
157	300207	欣旺达	13,300	266,798.00	0.12
158	600487	亨通光电	17,100	261,630.00	0.12
159	688266	泽璟制药	2,400	258,024.00	0.12
160	002841	视源股份	7,400	256,040.00	0.12
161	600089	特变电工	21,300	254,109.00	0.12
162	300763	锦浪科技	4,400	252,516.00	0.12
163	000887	中鼎股份	14,300	251,537.00	0.12
164	002407	多氟多	20,500	249,895.00	0.12
165	002603	以岭药业	17,700	249,570.00	0.12
166	000547	航天发展	29,200	245,280.00	0.11
167	600745	闻泰科技	7,300	244,769.00	0.11
168	300769	德方纳米	7,400	244,348.00	0.11
169	000301	东方盛虹	28,600	238,238.00	0.11
170	002371	北方华创	500	221,105.00	0.10
171	601168	西部矿业	13,100	217,853.00	0.10
172	002236	大华股份	13,400	212,792.00	0.10
173	000039	中集集团	26,900	211,434.00	0.10
174	600362	江西铜业	8,900	208,527.00	0.10
175	000630	铜陵有色	62,000	207,080.00	0.10
176	601677	明泰铝业	16,400	203,688.00	0.10
177	600131	国网信通	11,500	203,550.00	0.10
178	600741	华域汽车	11,400	201,210.00	0.09
179	600352	浙江龙盛	19,700	200,152.00	0.09
180	603613	国联股份	8,400	198,996.00	0.09
181	300919	中伟股份	5,900	193,992.00	0.09
182	002078	太阳纸业	14,400	193,824.00	0.09
183	600332	白云山	7,300	192,428.00	0.09

184	002409	雅克科技	3,500	191,415.00	0.09
185	601127	赛力斯	1,400	188,048.00	0.09
186	601607	上海医药	10,400	185,952.00	0.09
187	600667	太极实业	28,000	184,240.00	0.09
188	688009	中国通号	35,600	182,984.00	0.09
189	600208	衢州发展	59,200	175,232.00	0.08
190	688012	中微公司	800	145,840.00	0.07
191	002294	信立泰	3,000	141,990.00	0.07
192	688981	中芯国际	1,600	141,072.00	0.07
193	300866	安克创新	1,200	136,320.00	0.06
194	601989	中国重工	28,800	133,632.00	0.06
195	002180	纳思达	5,700	130,758.00	0.06
196	600760	中航沈飞	2,100	123,102.00	0.06
197	002415	海康威视	4,054	112,417.42	0.05
198	688188	柏楚电子	840	110,594.40	0.05
199	002709	天赐材料	6,100	110,532.00	0.05
200	600256	广汇能源	18,000	108,360.00	0.05
201	000002	万科 A	16,800	107,856.00	0.05
202	601225	陕西煤业	4,800	92,352.00	0.04
203	300760	迈瑞医疗	400	89,900.00	0.04
204	688617	惠泰医疗	290	86,130.00	0.04
205	601018	宁波港	23,500	86,010.00	0.04
206	000063	中兴通讯	2,600	84,474.00	0.04
207	002318	久立特材	3,300	77,187.00	0.04
208	601088	中国神华	1,900	77,026.00	0.04
209	601360	三六零	7,200	73,440.00	0.03
210	601633	长城汽车	3,400	73,032.00	0.03
211	002456	欧菲光	6,000	71,100.00	0.03
212	600309	万华化学	1,200	65,112.00	0.03
213	000623	吉林敖东	3,700	62,715.00	0.03
214	300118	东方日升	6,500	62,270.00	0.03
215	600323	瀚蓝环境	2,500	60,875.00	0.03
216	601615	明阳智能	5,100	58,599.00	0.03
217	600941	中国移动	500	56,275.00	0.03
218	600028	中国石化	9,500	53,580.00	0.03
219	002185	华天科技	5,300	53,530.00	0.02
220	600585	海螺水泥	2,300	49,381.00	0.02
221	600406	国电南瑞	2,200	49,302.00	0.02
222	002273	水晶光电	2,400	47,928.00	0.02
223	600048	保利发展	5,600	45,360.00	0.02
224	002064	华峰化学	6,500	42,965.00	0.02
225	600436	片仔癀	200	40,002.00	0.02
226	601390	中国中铁	6,900	38,709.00	0.02

227	600118	中国卫星	1,300	37,141.00	0.02
228	600938	中国海油	1,400	36,554.00	0.02
229	002459	晶澳科技	3,600	35,928.00	0.02
230	600637	东方明珠	4,700	35,109.00	0.02
231	601012	隆基绿能	2,300	34,546.00	0.02
232	002131	利欧股份	9,100	31,850.00	0.01
233	600188	兖矿能源	2,600	31,642.00	0.01
234	000617	中油资本	4,200	30,660.00	0.01
235	600839	四川长虹	3,000	29,160.00	0.01
236	603000	人民网	1,400	28,294.00	0.01
237	688041	海光信息	200	28,258.00	0.01
238	600893	航发动力建	700	26,978.00	0.01
239	601111	中国国航	3,200	25,248.00	0.01
240	601800	中国交建	2,800	24,892.00	0.01
241	000009	中国宝安	2,800	24,864.00	0.01
242	300433	蓝思科技	1,100	24,530.00	0.01
243	601006	大秦铁路	3,700	24,420.00	0.01
244	601888	中国中免	400	24,388.00	0.01
245	002179	中航光电	600	24,216.00	0.01
246	600029	南方航空	3,800	22,420.00	0.01
247	600521	华海药业	1,200	22,356.00	0.01
248	002241	歌尔股份	900	20,988.00	0.01
249	600584	长电科技	600	20,214.00	0.01
250	002938	鹏鼎控股	600	19,218.00	0.01
251	003816	中国广核	5,200	18,928.00	0.01
252	600346	恒力石化	1,300	18,538.00	0.01
253	603392	万泰生物	300	18,300.00	0.01
254	300558	贝达药业	300	17,385.00	0.01
255	300001	特锐德	700	16,779.00	0.01
256	600438	通威股份	1,000	16,750.00	0.01
257	600886	国投电力	1,100	16,214.00	0.01
258	002625	光启技术	400	15,992.00	0.01
259	688036	传音控股	200	15,940.00	0.01
260	600010	包钢股份	8,600	15,394.00	0.01
261	600177	雅戈尔	2,000	14,600.00	0.01
262	601689	拓普集团	300	14,175.00	0.01
263	603019	中科曙光	200	14,080.00	0.01
264	002050	三花智控	500	13,190.00	0.01
265	002831	裕同科技	500	11,710.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688183	生益电子	7,800	399,360.00	0.19

2	688313	仕佳光子	9,400	357,670.00	0.17
3	300548	长芯博创	4,800	320,496.00	0.15
4	600926	杭州银行	16,400	275,848.00	0.13
5	000554	泰山石油	35,700	252,399.00	0.12
6	603444	吉比特	800	241,560.00	0.11
7	603113	金能科技	34,800	241,164.00	0.11
8	600216	浙江医药	16,200	239,598.00	0.11
9	000553	安道麦 A	32,900	237,538.00	0.11
10	600703	三安光电	19,000	235,980.00	0.11
11	600739	辽宁成大	21,400	235,400.00	0.11
12	300369	绿盟科技	30,000	233,100.00	0.11
13	300570	太辰光	2,400	231,312.00	0.11
14	600167	联美控股	40,100	225,362.00	0.11
15	002102	能特科技	71,100	224,676.00	0.10
16	601003	柳钢股份	63,600	223,872.00	0.10
17	600179	安通控股	76,500	211,140.00	0.10
18	002268	电科网安	11,000	201,190.00	0.09
19	688685	迈信林	3,600	201,060.00	0.09
20	603379	三美股份	3,900	187,668.00	0.09
21	603766	隆鑫通用	13,700	174,812.00	0.08
22	600675	中华企业	44,300	127,584.00	0.06
23	003010	若羽臣	2,040	123,624.00	0.06
24	601699	潞安环能	11,200	118,160.00	0.06
25	603586	金麒麟	5,500	100,760.00	0.05
26	002081	金螳螂	29,200	100,156.00	0.05
27	603529	爱玛科技	2,900	99,760.00	0.05
28	000893	亚钾国际	3,300	99,462.00	0.05
29	600578	京能电力	22,100	99,229.00	0.05
30	002761	浙江建投	10,900	96,683.00	0.05
31	002479	富春环保	19,200	96,192.00	0.04
32	600884	杉杉股份	9,600	90,816.00	0.04
33	300048	合康新能	15,200	89,224.00	0.04
34	000898	鞍钢股份	29,300	67,976.00	0.03
35	002010	传化智联	10,800	60,264.00	0.03
36	600956	新天绿能	6,900	53,268.00	0.02
37	600983	惠而浦	4,800	49,824.00	0.02
38	300879	大叶股份	1,100	43,208.00	0.02
39	001872	招商港口	1,400	27,804.00	0.01
40	603588	高能环境	4,800	27,072.00	0.01
41	300484	蓝海华腾	1,200	26,844.00	0.01
42	300999	金龙鱼	700	20,671.00	0.01
43	300492	华图山鼎	280	19,006.40	0.01
44	002290	禾盛新材	500	15,625.00	0.01

45	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
46	002701	奥瑞金	2,500	14,875.00	0.01
47	603858	步长制药	800	12,992.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	13,696,684.00	6.39
2	300750	宁德时代	11,784,084.00	5.50
3	600036	招商银行	10,051,557.00	4.69
4	000333	美的集团	9,350,258.00	4.37
5	601899	紫金矿业	8,425,667.00	3.93
6	000858	五粮液	7,589,551.00	3.54
7	600900	长江电力	6,484,919.00	3.03
8	601318	中国平安	6,277,676.00	2.93
9	002714	牧原股份	5,470,369.40	2.55
10	601919	中远海控	5,422,353.00	2.53
11	000001	平安银行	5,371,792.00	2.51
12	601328	交通银行	5,171,535.00	2.41
13	300502	新易盛	5,148,976.60	2.40
14	601288	农业银行	4,961,247.00	2.32
15	600276	恒瑞医药	4,905,802.76	2.29
16	600919	江苏银行	4,756,623.00	2.22
17	600000	浦发银行	4,694,417.00	2.19
18	601988	中国银行	4,681,620.00	2.19
19	600031	三一重工	4,662,031.00	2.18
20	688008	澜起科技	4,614,917.87	2.15
21	000725	京东方A	4,567,266.00	2.13
22	601628	中国人寿	4,557,851.00	2.13
23	601816	京沪高铁	4,510,428.00	2.11
24	601658	邮储银行	4,442,638.00	2.07
25	600887	伊利股份	4,387,494.00	2.05
26	000651	格力电器	4,372,268.00	2.04
27	603288	海天味业	4,364,303.22	2.04
28	688111	金山办公	4,332,348.87	2.02

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	6,088,036.00	2.84
2	600036	招商银行	5,924,763.00	2.77

3	600519	贵州茅台	5,624,921.00	2.63
4	000858	五粮液	5,307,976.00	2.48
5	600900	长江电力	4,888,940.00	2.28
6	000333	美的集团	4,550,744.00	2.12
7	002714	牧原股份	4,298,882.00	2.01
8	601899	紫金矿业	4,181,422.00	1.95
9	601288	农业银行	3,966,524.00	1.85
10	601988	中国银行	3,820,851.00	1.78
11	000001	平安银行	3,632,242.00	1.70
12	601816	京沪高铁	3,558,109.00	1.66
13	601919	中远海控	3,526,155.00	1.65
14	601328	交通银行	3,493,159.00	1.63
15	300866	安克创新	3,328,544.00	1.55
16	601628	中国人寿	3,317,504.00	1.55
17	688111	金山办公	3,268,192.94	1.53
18	300001	特锐德	3,189,275.00	1.49
19	601658	邮储银行	3,146,358.00	1.47
20	601117	中国化学	3,124,852.00	1.46

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	663,184,211.13
卖出股票收入（成交）总额	456,063,545.49

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	407,061.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	407,061.09

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	688313	仕佳光子	357,670.00	0.17	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	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
中金中证 A500 指数增强 A	669	199,092.64	7,525,391.07	5.65	125,667,582.72	94.35
中金中证 A500 指数增强 B	25	4,537.65	0.00	0.00	113,441.24	100.00
中金中证 A500 指数增强 C	642	127,411.24	6,501.62	0.01	81,791,512.09	99.99
合计	1,336	161,006.31	7,531,892.69	3.50	207,572,536.05	96.50

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 A500 指数增强 A	-	-
	中金中证 A500 指数增强 B	11,905.18	10.4946
	中金中证 A500 指数增强 C	-	-
	合计	11,905.18	0.0055

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、基金经理和研究部门负责人持有本开放式基金	中金中证 A500 指数增强 A	0
	中金中证 A500 指数增强 B	0
	中金中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 A500 指数增强 A	0
	中金中证 A500 指数增强 B	0
	中金中证 A500 指数增强 C	0

	合计	0
--	----	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 A500 指数增强 A	中金中证 A500 指数增强 B	中金中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 3 月 13 日）基金份额总额	159,696,668.80	-	124,706,415.36
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	7,314,207.03	347,327.06	3,111,929.19
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	33,817,902.04	233,885.82	46,020,330.84
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	133,192,973.79	113,441.24	81,798,013.71

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
太平洋证 券	2	1,119,232,37 1.08	100.00	214,395.48	100.00	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

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

2、基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

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	中金中证 A500 指数增强型证券投资 基金基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2025-2-28
2	中金中证 A500 指数增强型证券投资 基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2025-2-28
3	中金中证 A500 指数增强型证券投资 基金托管协议	中国证监会规定媒介	2025-2-28
4	中金中证 A500 指数增强型证券投资 基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025-2-28
5	中金中证 A500 指数增强型证券投资 基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2025-2-28
6	关于中金中证 A500 指数增强型证券 投资基金提前结束募集的公告	中国证监会规定媒介	2025-3-11
7	中金中证 A500 指数增强型证券投资 基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2025-3-14
8	关于中金中证 A500 指数增强型证券 投资基金开放申购、赎回（转换、定期定额投资）业务的公告	中国证监会规定媒介	2025-4-7
9	中金中证 A500 指数增强型证券投资 基金更新招募说明书（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025-4-10
10	中金基金管理有限公司关于中金中证 A500 指数增强型证券投资基金增设基 金份额并修改法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2025-4-10
11	中金中证 A500 指数增强型证券投资 基金托管协议	中国证监会规定媒介	2025-4-10
12	中金中证 A500 指数增强型证券投资 基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025-4-10
13	中金中证 A500 指数增强型证券投资 基金基金产品资料概要更新（2025 年 第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025-4-10
14	中金基金管理有限公司关于董事变更 的公告	中国证监会规定媒介	2025-4-24

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金中证 A500 指数增强型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、《中金中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金中证 A500 指数增强型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 A500 指数增强型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日