

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 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。

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	18
4.10 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	18
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
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	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	20
§6 审计报告	21
6.1 审计报告基本信息	21
6.2 审计报告的基本内容	21
§7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表	24
7.2 利润表	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	27
7.4 报表附注	29
§8 投资组合报告	67
8.1 期末基金资产组合情况	67
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	67
8.3 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	69
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	85
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	115
8.6 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	116

8.7 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	116
8.8 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	116
8.9 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	116
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	116
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	117
8.12 投资组合报告附注.....	117
§9 基金份额持有人信息.....	119
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	119
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	119
9.3 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的情况	119
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	120
§10 开放式基金份额变动.....	121
§11 重大事件揭示.....	122
11.1 基金份额持有人大会决议	122
11.2 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	122
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	122
11.4 基金投资策略的改变	122
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	122
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	122
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	123
11.8 其他重大事件	124
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	131
12.1 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.....	131
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	131
§13 备查文件目录.....	132
13.1 备查文件目录.....	132
13.2 存放地点.....	132
13.3 查阅方式.....	132

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中金中证 500	
基金主代码	003016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 22 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	148,763,227.96 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 500A	中金中证 500C
下属分级基金的交易代码:	003016	003578
报告期末下属分级基金的份额总额	77,997,814.79 份	70,765,413.17 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	本基金作为股票指数增强型发起式证券投资基金，股票投资策略为本基金的核心策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合以及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。其他策略还包括债券投资策略和股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券

	型基金与货币市场基金。
--	-------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵璧	郭明
	联系电话	010-63211122	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95588
传真		010-66159121	010-66105798
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100004	100140
法定代表人		胡长生	陈四清

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年		2019 年		2018 年	
	中金中证 500A	中金中证 500C	中金中证 500A	中金中证 500C	中金中证 500A	中金中证 500C
本期已实现收益	30,226,602 .65	26,944,359 .09	13,554,769 .17	3,966,128. 24	-4,542,207 .24	-1,000,8 31.36
本期利润	31,548,104 .47	28,012,804 .74	18,180,922 .40	4,087,244. 60	-5,987,463 .18	-1,106,8 22.86
加权平均基金份额本期利润	0.4204	0.4996	0.2538	0.1948	-0.3030	-0.3069
本期加权平均净值利润率	31.73%	35.61%	25.45%	19.20%	-31.38%	-32.52%
本期基金份额净值增长率	40.72%	40.14%	33.75%	32.83%	-25.69%	-25.62%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	41,392,738 .60	37,296,061 .64	6,250,826. 09	2,579,784. 33	-5,748,514 .36	-1,245,0 40.26
期末可供分配基金份额利润	0.5307	0.5270	0.0878	0.0896	-0.1867	-0.1797
期末基金资产净值	119,390,55 3.39	108,061,47 4.81	77,421,437 .89	31,375,561 .08	25,040,009 .91	5,681,68 6.33
期末基金份额净值	1.5307	1.5270	1.0878	1.0896	0.8133	0.8203
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	

基金份额累计 净值增长率	53.07%	41.43%	8.78%	0.92%	-18.67%	-24.03%
-----------------	--------	--------	-------	-------	---------	---------

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金中证 500A

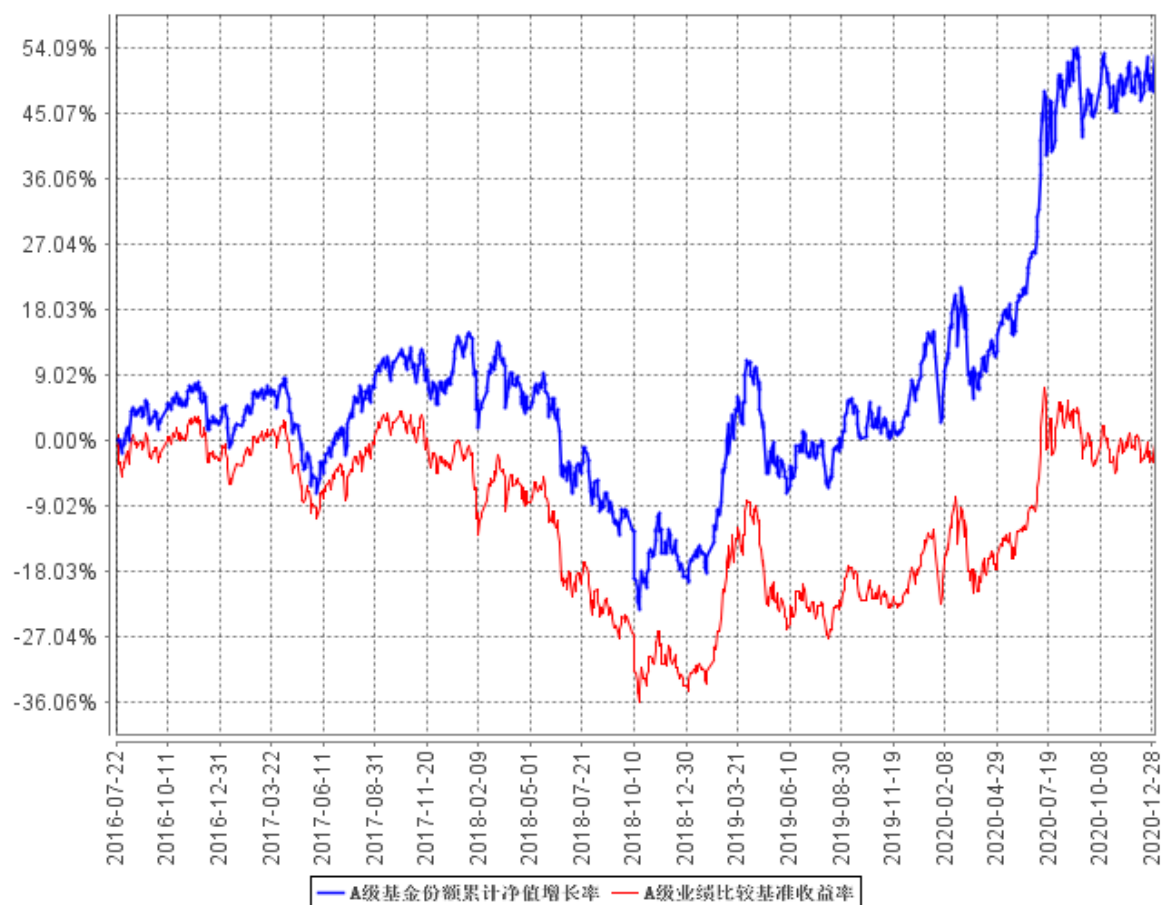
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.30%	1.11%	2.70%	1.10%	2.60%	0.01%
过去六个月	19.47%	1.34%	8.20%	1.38%	11.27%	-0.04%
过去一年	40.72%	1.46%	19.94%	1.54%	20.78%	-0.08%
过去三年	39.85%	1.39%	2.25%	1.46%	37.60%	-0.07%
自基金合同生效起至今	53.07%	1.25%	-0.55%	1.30%	53.62%	-0.05%

中金中证 500C

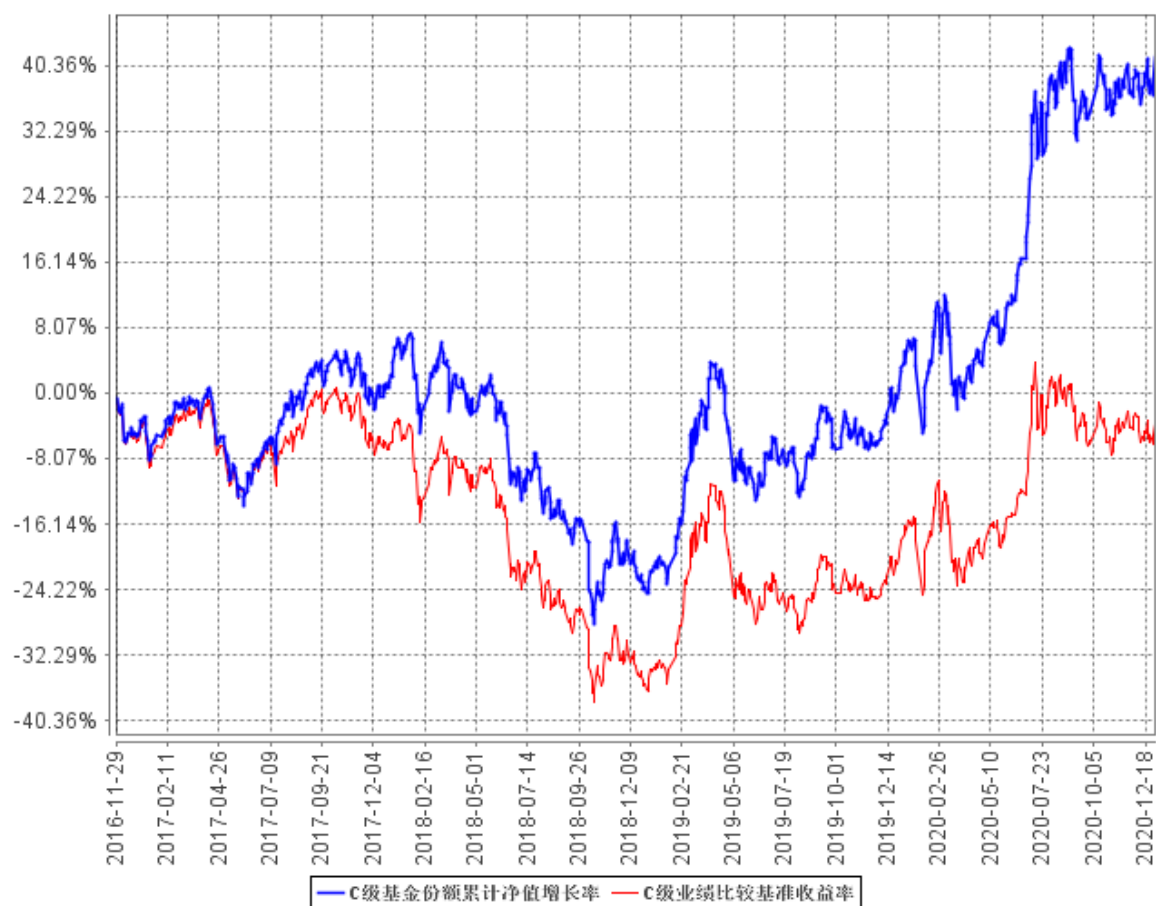
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.19%	1.11%	2.70%	1.10%	2.49%	0.01%
过去六个月	19.23%	1.34%	8.20%	1.38%	11.03%	-0.04%
过去一年	40.14%	1.46%	19.94%	1.54%	20.20%	-0.08%
过去三年	38.45%	1.39%	2.25%	1.46%	36.20%	-0.07%
自基金合同生效起至今	41.43%	1.28%	-0.55%	1.33%	41.98%	-0.05%

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

A级基金份额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

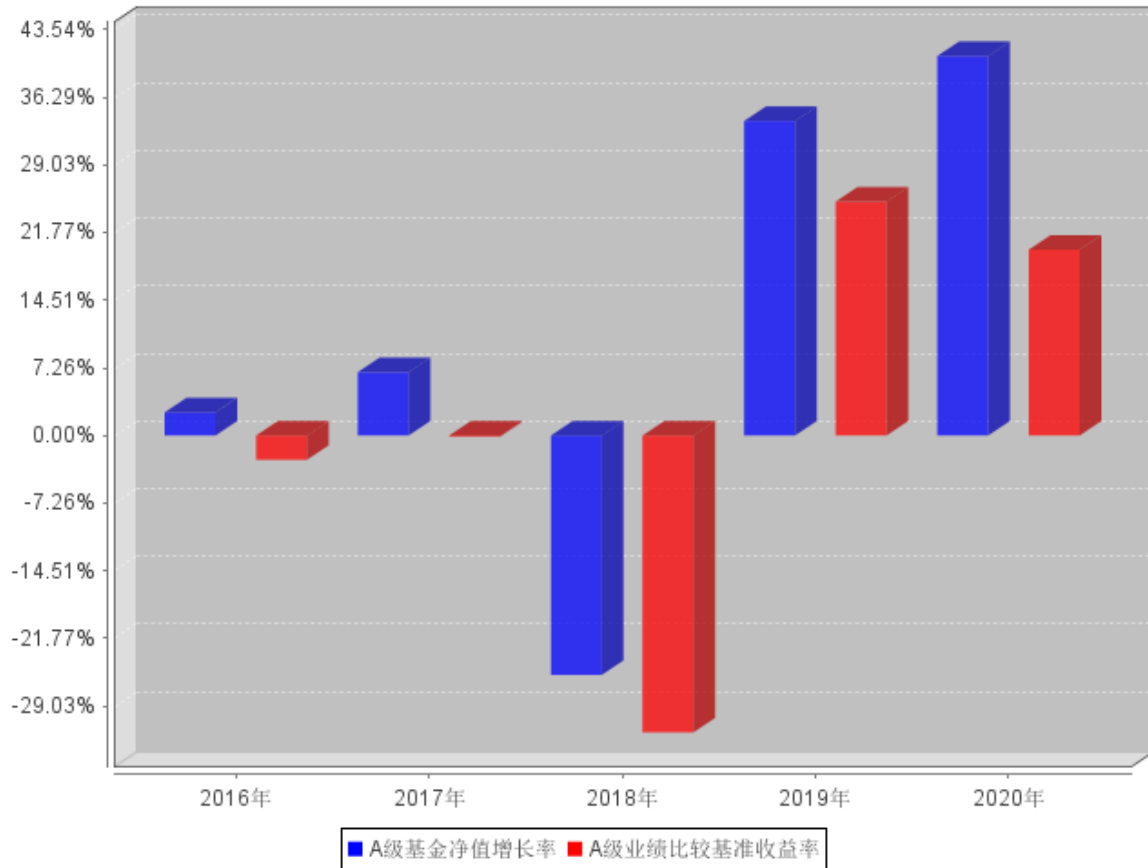


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

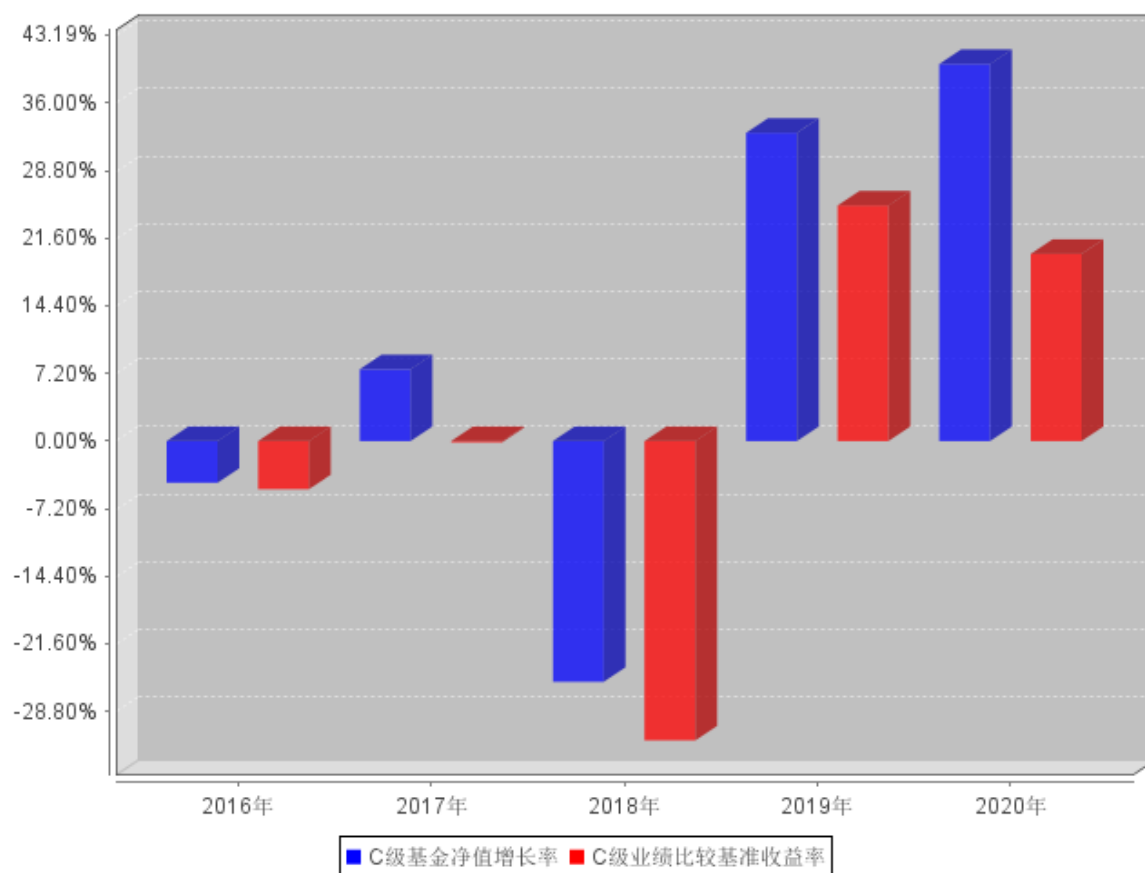


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据基金相关法律法规和基金合同的要求,结合本基金实际运作情况,自成立以来本基金未进行收益分配。

§ 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，是首家单一股东发起设立的基金公司，注册资本 4 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，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 2020 年 12 月 31 日，公司共管理 37 只开放式基金，证券投资基金管理规模 539.94 亿。

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		
魏宇	本基金的基金经理	2017 年 3 月 28 日	—	10 年	魏宇先生，统计学博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发。2014 年 11 月加入中金基金管理有限公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任量化投资部基金经理。
耿帅军	本基金的基金经理	2020 年 10 月 29 日	—	9 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。2020 年 8 月加入中金基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《中金基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施效果评估、信息披露与报告制度等多方面进行了规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，公司建立了科学合理的投资运作体系和规范的投资流

程，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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，本基金采用量化选股的方法以获取超越业绩基准的收益。2020 年全年，相对于业绩基准，获取了一定的超额收益。我们将继续努力开发和改进选股模型，争取在超额收益方面有更好的表现。

2020 年一季度，突发疫情在全球扩散，打断了 2019 年末全球共振复苏的路径。主要央行联手应对、快速响应，有效缓释了恐慌情绪造成的流动性危机。为对冲疫情产生的负面影响，全球主要经济体普遍推出了强劲财政刺激计划，增加了市场对疫情过后经济增长恢复的信心。中国在疫情防控、复工复产等方面措施得当，经济增长水平在全球主要经济体中居于前列，国内生产及需求景气水平正逐步恢复至疫情前水平。A 股市场在一季度受疫情影响出现明显调整。此后，随着财政、金融政策的推出，以及国内生产需求景气度的回升，市场行情快速回暖。全年来看，主要指数均收获了不同程度上涨，沪深 300 指数、中证 500 指数、中证 800 指数、中证 1000 指数分别上涨 27.21%、20.87%、25.79%和 19.39%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证 500A 基金份额净值为 1.5307 元，本报告期基金份额净值增长率为 40.72%；截至本报告期末中金中证 500C 基金份额净值为 1.5270 元，本报告期基金份额净值增长率为 40.14%；同期业绩比较基准收益率为 19.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于经历了连续两年不俗表现的 A 股市场，2021 年或是一个不乏结构性机会的相对中性年份。从宏观增长看，尽管全球大部分发达经济体仍然面临疫情反复、内部结构性矛盾等负面压力，但随着疫苗推广所带来的疫情相对缓解、财政货币政策效果显现等，全球经济在 2020 年低基数基础上或有一定增长；中国在疫情控制、产能恢复、消费复苏等多方面均有明显优势，2021 年增长前景依然可期。流动性方面，为支持经济恢复，海外主要发达经济体宏观流动性整体上仍维持宽松基调；国内政策环境已开始逐步回归正常化，宏观流动性较去年边际收紧，但应不会“急转弯”，考虑到基金发行、外资流入等微观流动性因素，市场整体或有结构性机会。以下两方面值得关注：一是反映中国经济消费升级、产业升级等长期趋势的泛消费、高端制造、研发创新等产业相关的战略配置机会；二是全球经济复苏、实体需求增加所带动的顺周期、低估值板块的阶段性投资机会。如果抛开周期性波动，以长期战略配置视角看待中国资本市场的结构性变化，机构化、国际化等长线趋势对 A 股的市场生态、投资行为等影响深远，重视基本面变化、关注配置价值的价值投资、长期投资理念将使得基本面高质量同时兼顾一定成长性的大中盘股依然是中长线资金的战略配置标的。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作，强化制度完善及对制度执行情况的监督检查，相关主要工作如下：

(1) 紧密跟踪并组织落实法律法规、自律规则及监管要求，不断完善基金运作管理内部制度建设，促进依法合规展业；(2) 研究、投资交易方面，围绕内幕交易、利用未公开信息交易等重点防范的违法违规行为 and 各项最新监管要求，开展合规培训，进一步提高员工合规守法意识。(3) 营销与销售方面，组织落实《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及配套规则，持续对基金宣传推介材料、销售服务协议等材料文件进行合规审查，定期开展投资者适当性培训及销售业务专项培训，加强销售行为管理。(4) 基金运作保障方面，持续为注册登记、基金会计、资金清算等业务提供合规咨询，适时开展合规检查，为基金运营安全提供法律合规支持。(5) 信息

披露方面，有序执行《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露内容的真实、准确、完整、及时、规范。（6）以中国证监会《季度监察稽核项目表》为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，同时有重点地开展定期不定期的合规检查、内部稽核，促进公司合规运作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施不断完善，坚持维护基金份额持有人合法权益。本基金管理人将继续合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益，提高监察稽核工作的有效性。

4.7 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》、《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。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。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。

4.8 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，本报告期内未实施利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值

低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的管理人——中金基金管理有限公司在中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2102119 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“中金中证 500 基金”）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表、2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了中金中证 500 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中金中证 500 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	中金中证 500 基金管理人中金基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括中金中证 500 基金 2020 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我

	们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中金中证 500 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非中金中证 500 基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督中金中证 500 基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同

	时，根据获取的审计证据，就可能导致对中金中证 500 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中金中证 500 基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	管祎铭	李瑞丛
会计师事务所的地址	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层	
审计报告日期	2021 年 3 月 30 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	3,771,581.11	3,120,817.55
结算备付金		4,845,719.85	2,068,677.10
存出保证金		105,644.12	115,150.75
交易性金融资产	7.4.7.2	225,864,333.76	106,914,239.12
其中：股票投资		213,271,593.76	102,560,827.62
基金投资		—	—
债券投资		12,592,740.00	4,353,411.50
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		4,152,780.53	200,933.53
应收利息	7.4.7.5	219,773.23	58,621.26
应收股利		—	—
应收申购款		413,065.13	270,876.53
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		239,372,897.73	112,749,315.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		6,000,000.00	600,000.00
应付证券清算款		3,005,746.40	51,794.64
应付赎回款		928,091.75	1,987,570.80
应付管理人报酬		98,341.06	51,483.64
应付托管费		29,502.31	15,445.10
应付销售服务费		38,424.52	15,087.19
应付交易费用	7.4.7.7	1,693,108.47	1,180,603.52
应交税费		0.29	3.43
应付利息		-2,345.27	-92.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	130,000.00	50,421.52
负债合计		11,920,869.53	3,952,316.87
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	148,763,227.96	99,966,388.55
未分配利润	7.4.7.10	78,688,800.24	8,830,610.42
所有者权益合计		227,452,028.20	108,796,998.97
负债和所有者权益总计		239,372,897.73	112,749,315.84

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 148,763,227.96 份，其中中金中证 500A 基金份额净值 1.5307 元，份额总额 77,997,814.79 份；中金中证 500C 基金份额净值 1.5270 元，份额总额 70,765,413.17 份；

7.2 利润表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		68,547,312.71	26,345,393.94
1.利息收入		257,457.84	144,774.57
其中：存款利息收入	7.4.7.11	62,475.52	42,614.48
债券利息收入		194,982.32	102,160.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		65,463,540.17	20,774,157.05
其中：股票投资收益	7.4.7.12	63,701,233.72	19,666,841.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	239,196.53	38,138.27
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	15,689.32
股利收益	7.4.7.16	1,523,109.92	1,053,487.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,389,947.47	4,747,269.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	436,367.23	679,192.73
减：二、费用		8,986,403.50	4,077,226.94
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	883,314.28	455,919.18
2. 托管费	7.4.10.2.2	264,994.23	136,775.67
3. 销售服务费		310,163.68	84,862.95

4. 交易费用	7.4.7.19	7, 255, 679. 45	3, 285, 695. 61
5. 利息支出		69, 499. 95	47, 141. 08
其中：卖出回购金融资产支出		69, 499. 95	47, 141. 08
6. 税金及附加		0. 55	57. 37
7. 其他费用	7.4.7.20	202, 751. 36	66, 775. 08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		59, 560, 909. 21	22, 268, 167. 00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		59, 560, 909. 21	22, 268, 167. 00

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	99, 966, 388. 55	8, 830, 610. 42	108, 796, 998. 97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	59, 560, 909. 21	59, 560, 909. 21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	48, 796, 839. 41	10, 297, 280. 61	59, 094, 120. 02
其中：1. 基金申购款	286, 029, 669. 34	87, 907, 451. 66	373, 937, 121. 00

2. 基金赎回款	-237,232,829.93	-77,610,171.05	-314,843,000.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	148,763,227.96	78,688,800.24	227,452,028.20
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	37,715,250.86	-6,993,554.62	30,721,696.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,268,167.00	22,268,167.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	62,251,137.69	-6,444,001.96	55,807,135.73
其中：1. 基金申购款	293,068,189.26	-126,071.26	292,942,118.00
2. 基金赎回款	-230,817,051.57	-6,317,930.70	-237,134,982.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	99,966,388.55	8,830,610.42	108,796,998.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>孙菁</u>	<u>张纳</u>	<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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2016 年 7 月 5 日证监许可[2016]1517 号《关于准予中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资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，托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均

跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股（含存托凭证）。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、存托凭证、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本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的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 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 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况、2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。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。

本基金持有的股票投资和债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

1、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

2、应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

3、除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 1、收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 2、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；
- 3、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：

- 1、所转移金融资产的账面价值
- 2、因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 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，参考类似投资品种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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

7.4.4.8 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。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益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。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的收入差异较小的可采用合同利率。

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、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。

7.4.4.10 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。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的支出差异较小的可采用合同利率。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；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相应类别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；基金收益分配后两类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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估值业务的指导意见》，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，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本期未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《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》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局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》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：

(1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(2) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入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。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从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，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(5) 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。

(6) 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。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后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费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	3,771,581.11	3,120,817.55
定期存款	-	-
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	-	-
合计：	3,771,581.11	3,120,817.55

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		207,733,705.34	213,271,593.76	5,537,888.42
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	12,627,410.00	12,592,740.00	-34,670.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	12,627,410.00	12,592,740.00	-34,670.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		220,361,115.34	225,864,333.76	5,503,218.42
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动

股票		99,486,585.97	102,560,827.62	3,074,241.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	4,314,382.20	4,353,411.50	39,029.30
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,314,382.20	4,353,411.50	39,029.30
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		103,800,968.17	106,914,239.12	3,113,270.95

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	477.47	825.66
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,217.38	842.71
应收债券利息	217,026.02	56,895.91
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-

应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	52.36	56.98
合计	219,773.23	58,621.26

注：其他为应收存出保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金于本期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,693,108.47	1,180,603.52
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,693,108.47	1,180,603.52

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	421.52
应付证券出借违约金	-	-
指数使用费	10,000.00	10,000.00
应付信息披露费	80,000.00	10,000.00
其他	40,000.00	30,000.00
合计	130,000.00	50,421.52

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 500A		
项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	71,170,611.80	71,170,611.80
本期申购	114,271,372.46	114,271,372.46
本期赎回（以“-”号填列）	-107,444,169.47	-107,444,169.47
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	77,997,814.79	77,997,814.79

金额单位：人民币元

中金中证 500C		
项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,795,776.75	28,795,776.75
本期申购	171,758,296.88	171,758,296.88
本期赎回（以“-”号填列）	-129,788,660.46	-129,788,660.46
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	70,765,413.17	70,765,413.17

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金中证 500A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,073,385.67	-2,822,559.58	6,250,826.09
本期利润	30,226,602.65	1,321,501.82	31,548,104.47
本期基金份额交易产生的变动数	2,798,581.54	795,226.50	3,593,808.04
其中：基金申购款	36,865,138.41	-3,014,482.04	33,850,656.37
基金赎回款	-34,066,556.87	3,809,708.54	-30,256,848.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,098,569.86	-705,831.26	41,392,738.60

单位：人民币元

中金中证 500C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,734,031.03	-1,154,246.70	2,579,784.33
本期利润	26,944,359.09	1,068,445.65	28,012,804.74
本期基金份额交易产生的变动数	7,293,568.38	-590,095.81	6,703,472.57
其中：基金申购款	55,965,999.61	-1,909,204.32	54,056,795.29
基金赎回款	-48,672,431.23	1,319,108.51	-47,353,322.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,971,958.50	-675,896.86	37,296,061.64

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
活期存款利息收入	26,309.45	23,556.93

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	35,030.82	18,361.41
其他	1,135.25	696.14
合计	62,475.52	42,614.48

注：其他为存出保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	63,701,233.72	19,666,841.93
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	63,701,233.72	19,666,841.93

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
卖出股票成交总额	2,723,185,844.03	1,224,527,520.78
减：卖出股票成本总额	2,659,484,610.31	1,204,860,678.85
买卖股票差价收入	63,701,233.72	19,666,841.93

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期及上年度均无股票出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	239,196.53	38,138.27
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	239,196.53	38,138.27

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	6,446,640.95	9,964,293.05
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,089,526.13	9,724,233.23
减：应收利息总额	117,918.29	201,921.55
买卖债券差价收入	239,196.53	38,138.27

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本期及上年度均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本期及上年度均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金在本期及上年度均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本期及上年度均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-	16,160.00

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,523,109.92	1,053,487.53
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	1, 523, 109. 92	1, 053, 487. 53
----	-----------------	-----------------

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	2, 389, 947. 47	4, 747, 269. 59
——股票投资	2, 463, 646. 77	4, 705, 740. 29
——债券投资	-73, 699. 30	41, 529. 30
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	2, 389, 947. 47	4, 747, 269. 59

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	436, 048. 35	677, 958. 74
基金转换费收入	318. 88	1, 233. 99
合计	436, 367. 23	679, 192. 73

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	7,255,679.45	3,285,647.40
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
期货交易费用	-	48.21
合计	7,255,679.45	3,285,695.61

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	30,000.00
信息披露费	80,000.00	10,000.00
证券出借违约金	-	-
律师费用	30,000.00	-
指数使用费	40,000.00	23,712.58
汇划手续费	4,751.36	3,062.50
公证费	8,000.00	-
合计	202,751.36	66,775.08

7.4.7.21 分部报告

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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
工商银行	基金托管人
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构
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
中金资本运营有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金浦成投资有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金期货有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中国国际金融（香港）有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金私募股权投资管理有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司

注：中金公司全资子公司中金私募股权投资管理有限公司于 2020 年 10 月 30 日成立，自同日起为本基金的关联方。除上述变化外，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的其他关联方未发生变化。以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
中金公司	629,520,223.69	11.49%	1,028,115,418.19	41.22%
中金财富	1,276,418,844.60	23.30%	280,210,548.24	11.24%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
中金公司	215,400.20	1.09%	8,007,417.58	36.68%
中金财富	3,966,295.17	20.10%	4,058,772.61	18.59%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
中金公司	85,300,000.00	12.32%	136,600,000.00	33.40%
中金财富	170,700,000.00	24.66%	84,700,000.00	20.71%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金在本报告期及上年度均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中金公司	460,371.00	11.49%	137,367.31	8.11%
中金财富	933,447.84	23.30%	339,346.00	20.04%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中金公司	751,862.56	41.22%	751,862.56	63.68%
中金财富证券	204,918.17	11.24%	128,372.82	10.87%

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《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还获得证券研究综合服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
当期发生的基金应支付	883,314.28	455,919.18

的管理费		
其中：支付销售机构的客 户维护费	207,863.05	80,735.58

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	264,994.23	136,775.67

注：支付基金托管人工商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。

7.4.10.2.3 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		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	163,593.63	163,593.63
中金公司	-	644.51	644.51
中金财富证券	-	9,177.11	9,177.11
合计	-	173,415.25	173,415.25
获得销售服务费的	上年度可比期间		

各关联方名称	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	4,079.58	4,079.58
中金公司	-	1,053.73	1,053.73
中金财富证券	-	9,163.77	9,163.77
合计	-	14,297.08	14,297.08

注：本基金仅针对 C 类基金份额收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

C 类基金日基金销售服务费=前一日基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本期及上年度均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

本基金在本期及上年度均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	1,014,198.78	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-

报告期间因拆分变动份额	0.00	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	—
报告期末持有的基金份额	1,014,198.78	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.3003%	—

项目	上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	—
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	—
报告期间申购/买入总份额	1,014,198.78	—
报告期间因拆分变动份额	0.00	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	10,000,000.00	—
报告期末持有的基金份额	1,014,198.78	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.4250%	—

注：1、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；
2、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.10.5.2 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

除基金管理人之外的其他关联方在本期末与上年度末均未持有过本基金。

7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	3,771,581.11	26,309.45	3,120,817.55	23,556.93

注：本基金通过“工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于 2020 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 4,951,363.97 元（2019 年 12 月 31 日：人民币 2,183,827.85 元）。

7.4.10.7 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					
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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：份）	总金额
中金公司	688365	光云科技	网下	5,458	58,946.40
中金公司	300831	派瑞股份	网下	1,716	6,829.68
中金公司	688505	复旦张江	网下	5,254	47,023.30
中金公司	688520	神州细胞	网下	2,744	70,356.16
中金公司	688180	君实生物	网下	1,974	109,557.00
中金公司	688165	埃夫特	网下	9,135	58,007.25
中金公司	688981	中芯国际	网下	31,582	867,241.72
中金公司	688256	寒武纪	网下	1,172	75,465.08
中金公司	688338	赛科希德	网下	2,105	105,986.75
中金公司	688185	康希诺	网下	1,026	215,162.46
中金公司	300866	安克创新	网下	2,311	153,265.52
中金公司	688301	奕瑞科技	网下	826	98,789.60
中金公司	603565	中谷物流	网下	1,200	26,628.00
中金公司	003010	若羽臣	网下	562	8,542.40
中金公司	300999	金龙鱼	网下	12,870	330,759.00

中金公司	003012	东鹏控股	网下	2,278	25,855.30
中金公司	300901	中胤时尚	网下	9,611	86,114.56
中金公司	003022	联泓新科	网下	2,304	26,403.84
中金公司	688617	惠泰医疗	网下	769	57,259.74
上上年度可比期间					
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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：份）	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金在本期末未进行过利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券列示如下：

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	新股未上市	74.46	74.46	769	57,259.74	57,259.74	-
300926	博俊	2020 年	2021 年 1	新股未	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-

	科技	12 月 29 日	月 7 日	上市						
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
688027	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 11 日	新股流通受限	36.18	232.16	1,273	46,057.14	295,539.68	-
688289	圣湘生物	2020 年 8 月 20 日	2021 年 3 月 1 日	新股流通受限	50.48	109.84	2,268	114,488.64	249,117.12	-
688561	奇安信-U	2020 年 7 月 16 日	2021 年 1 月 22 日	新股流通受限	56.10	122.83	1,736	97,389.60	213,232.88	-
688508	芯朋微	2020 年 7 月 15 日	2021 年 1 月 22 日	新股流通受限	28.30	91.91	1,684	47,657.20	154,776.44	-
300999	金龙	2020 年 9 月	2021 年 4 月	新股流通受限	25.70	88.29	1,287	33,075.90	113,629.23	-

	鱼	月 29 日	月 15 日	通受限						
688160	步科股份	2020 年 11 月 4 日	2021 年 5 月 12 日	新股流通受限	20.34	31.29	2,771	56,362.14	86,704.59	-
688330	宏力达	2020 年 9 月 28 日	2021 年 4 月 15 日	新股流通受限	88.23	75.87	1,076	94,935.48	81,636.12	-
688668	鼎通科技	2020 年 12 月 11 日	2021 年 6 月 21 日	新股流通受限	20.07	24.56	3,037	60,952.59	74,588.72	-
688590	新致软件	2020 年 11 月 27 日	2021 年 6 月 7 日	新股流通受限	10.73	15.79	4,171	44,754.83	65,860.09	-
688571	杭华股份	2020 年 12 月 2 日	2021 年 6 月 11 日	新股流通受限	5.33	7.92	8,200	43,706.00	64,944.00	-
688557	兰剑智能	2020 年 11 月 25 日	2021 年 6 月 2 日	新股流通受限	27.70	32.75	1,812	50,192.40	59,343.00	-
300900	广联航空	2020 年 10 月 19 日	2021 年 4 月 29 日	新股流通受限	17.87	33.16	726	12,973.62	24,074.16	-
300891	惠云钛业	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 17 日	新股流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300894	火星人	2020 年 12 月 24 日	2021 年 7 月 1 日	新股流通受限	14.07	36.97	473	6,655.11	17,486.81	-
300861	美畅股份	2020 年 8 月 6 日	2021 年 2 月 24 日	新股流通受限	43.76	51.10	322	14,090.72	16,454.20	-
300898	熊猫乳品	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	新股流通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300892	品渥	2020 年 9 月	2021 年 3 月	新股流通受限	26.66	60.01	252	6,718.32	15,122.52	-

	食品	月 11 日	月 30 日	通受限						
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 23 日	新股流 通受限	24.60	61.51	235	5,781.00	14,454.85	-
300878	维康药业	2020 年 8 月 17 日	2021 年 3 月 3 日	新股流 通受限	41.34	48.72	287	11,864.58	13,982.64	-
300890	翔丰华	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 17 日	新股流 通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300909	汇创达	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股流 通受限	29.57	40.67	338	9,994.66	13,746.46	-
300860	锋尚文化	2020 年 8 月 6 日	2021 年 2 月 24 日	新股流 通受限	138.02	126.67	108	14,906.16	13,680.36	-
300887	谱尼测试	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股流 通受限	44.47	74.52	173	7,693.31	12,891.96	-
300895	铜牛信息	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股流 通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300876	蒙泰高新	2020 年 8 月 14 日	2021 年 2 月 24 日	新股流 通受限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300907	康平科技	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股流 通受限	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-
300879	大叶股份	2020 年 8 月 25 日	2021 年 3 月 1 日	新股流 通受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300910	瑞丰新材	2020 年 11 月 20 日	2021 年 5 月 27 日	新股流 通受限	30.26	47.87	257	7,776.82	12,302.59	-
300925	法本信息	2020 年 12 月 21	2021 年 6 月 30 日	新股流 通受限	20.08	37.33	329	6,606.32	12,281.57	-

		日								
300882	万胜智能	2020 年 8 月 27 日	2021 年 3 月 10 日	新股流通受限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300864	南大环境	2020 年 8 月 13 日	2021 年 2 月 25 日	新股流通受限	71.71	90.85	120	8,605.20	10,902.00	-
300911	亿田智能	2020 年 11 月 24 日	2021 年 6 月 3 日	新股流通受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300889	爱克股份	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股流通受限	27.97	30.12	327	9,146.19	9,849.24	-
300893	松原股份	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300881	盛德鑫泰	2020 年 8 月 25 日	2021 年 3 月 3 日	新股流通受限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300922	天秦装备	2020 年 12 月 18 日	2021 年 6 月 25 日	新股流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300917	特发服务	2020 年 12 月 14 日	2021 年 6 月 21 日	新股流通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300886	华业香料	2020 年 9 月 8 日	2021 年 3 月 16 日	新股流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2020 年 12 月 31 日，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 6,000,000.00 元，于 2021 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型股票基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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）。

7.4.13.2.2 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）

7.4.13.2.3 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）

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	—	—
AAA 以下	—	892,026.50
未评级	—	—
合计	—	892,026.50

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.5 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）

7.4.13.2.6 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）

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.3.2 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,771,581.11	-	-	-	3,771,581.11
结算备付金	4,479,608.06	-	-	366,111.79	4,845,719.85
存出保证金	105,644.12	-	-	-	105,644.12
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	213,271,593.76	213,271,593.76
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	12,592,740.00	-	-	-	12,592,740.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	4,152,780.53	4,152,780.53
应收利息	-	-	-	219,773.23	219,773.23
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	413,065.13	413,065.13
资产总计	20,949,573.29	-	-	218,423,324.44	239,372,897.73
负债					
卖出回购金融资产款	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	3,005,746.40	3,005,746.40
应付赎回款	-	-	-	928,091.75	928,091.75
应付管理人报酬	-	-	-	98,341.06	98,341.06

应付托管费	-	-	-	29,502.31	29,502.31
应付交易费用	-	-	-	1,693,108.47	1,693,108.47
应付销售服务费	-	-	-	38,424.52	38,424.52
应交税费	-	-	-	0.29	0.29
应付利息	-	-	-	-2,345.27	-2,345.27
其他负债	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	6,000,000.00	-	-	5,920,869.53	11,920,869.53
利率敏感度缺口	14,949,573.29	-	-	-212,502,454.91	227,452,028.20
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,120,817.55	-	-	-	3,120,817.55
结算备付金	1,702,565.31	-	-	366,111.79	2,068,677.10
存出保证金	115,150.75	-	-	-	115,150.75
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	102,560,827.62	102,560,827.62
交易性金融资产-债券投资	3,461,385.00	842,547.20	49,479.30	-	4,353,411.50
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	200,933.53	200,933.53
应收利息	-	-	-	58,621.26	58,621.26
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	270,876.53	270,876.53
资产总计	8,399,918.61	842,547.20	49,479.30	103,457,370.73	112,749,315.84
负债					
卖出回购金融资产款	600,000.00	-	-	-	600,000.00
应付证券清算款	-	-	-	51,794.64	51,794.64
应付赎回款	-	-	-	1,987,570.80	1,987,570.80
应付管理人报酬	-	-	-	51,483.64	51,483.64
应付托管费	-	-	-	15,445.10	15,445.10
应付交易费用	-	-	-	1,180,603.52	1,180,603.52
应付销售服务费	-	-	-	15,087.19	15,087.19
应交税费	-	-	-	3.43	3.43
应付利息	-	-	-	-92.97	-92.97
其他负债	-	-	-	50,421.52	50,421.52
负债总计	600,000.00	-	-	3,352,316.87	3,952,316.87
利率敏感度缺口	7,799,918.61	842,547.20	49,479.30	100,105,053.86	108,796,998.97

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。

7.4.13.4.1.2 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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	7,225.68	3,917.96
	市场利率上升 25 个基点	-7,225.68	-3,917.96

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）

		(%)		
交易性金融资产-股票投资	213,271,593.76	93.77	102,560,827.62	94.27
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	12,592,740.00	5.54	4,353,411.50	4.00
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	225,864,333.76	99.31	106,914,239.12	98.27

7.4.13.4.3.2 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（2020年12月 31日）	上年度末（2019年12月 31日）
	业绩比较基准上升 5%	10,564,548.55	5,030,936.52
	业绩比较基准下降 5%	-10,564,548.55	-5,030,936.52

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 211,312,943.27 元，第二层次的余额为 14,404,814.80 元，属于第三层次的余额为 146,575.69 元(2019 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 102,968,604.14 元，第二层次的余额为 3,815,476.34 元，属于第三层次的余额为 130,158.64 元)。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次，账面价值为人民币 1,958,650.49 元（2019 年 12 月 31 日：484,249.98 元）。于 2020 年 12 月 31 日，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的三个层次之间没有发生重大转换（于 2019 年 12 月 31 日，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具在三个层次之间发生了转换，由第二层次转换为第一层次，账面价值为人民币 20,171.00 元）。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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。(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2019 年 12 月 31 日，无）。

(d) 其他金融工具的公允价值（年末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	213,271,593.76	89.10
	其中：股票	213,271,593.76	89.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,592,740.00	5.26
	其中：债券	12,592,740.00	5.26
	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	8,617,300.96	3.60
8	其他各项资产	4,891,263.01	2.04
9	合计	239,372,897.73	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	325,794.00	0.14
B	采矿业	6,679,282.00	2.94
C	制造业	132,774,381.55	58.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,584,351.00	1.14
E	建筑业	3,486,375.00	1.53
F	批发和零售业	6,814,362.00	3.00
G	交通运输、仓储和邮政业	7,601,667.00	3.34
H	住宿和餐饮业	1,844,623.00	0.81
I	信息传输、软件和信息技术服务	14,520,502.82	6.38

	业		
J	金融业	4,500,444.70	1.98
K	房地产业	4,789,079.48	2.11
L	租赁和商务服务业	1,486,407.90	0.65
M	科学研究和技术服务业	2,399,573.00	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	2,639,759.00	1.16
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	50,336.00	0.02
Q	卫生和社会工作	1,075,612.00	0.47
R	文化、体育和娱乐业	1,609,844.00	0.71
S	综合	122,194.00	0.05
	合计	195,304,588.45	85.87

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	12,112,551.21	5.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	15,122.52	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,673,547.12	0.74
J	金融业	3,951,562.00	1.74

K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	12,891.96	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	10,902.00	0.00
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	181,453.36	0.08
S	综合	—	—
	合计	17,967,005.31	7.90

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末，本基金未持有港股通投资股票。

8.3 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

8.3.1 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	占基金资产净值比例（%）
1	300496	中科创达	23,700	2,772,900.00	1.22
2	603806	福斯特	31,800	2,715,720.00	1.19
3	601799	星宇股份	12,800	2,566,400.00	1.13
4	600426	华鲁恒升	68,000	2,536,400.00	1.12
5	600132	重庆啤酒	20,635	2,455,358.65	1.08
6	300012	华测检测	87,600	2,397,612.00	1.05
7	002709	天赐材料	22,800	2,366,640.00	1.04
8	600739	辽宁成大	95,200	2,315,264.00	1.02
9	600486	扬农化工	17,500	2,310,000.00	1.02
10	603338	浙江鼎力	22,800	2,307,132.00	1.01

11	601966	玲珑轮胎	63,800	2,243,846.00	0.99
12	002138	顺络电子	91,100	2,233,772.00	0.98
13	603444	吉比特	5,241	2,232,666.00	0.98
14	603486	科沃斯	24,700	2,185,703.00	0.96
15	002444	巨星科技	68,700	2,137,257.00	0.94
16	002507	涪陵榨菜	50,100	2,119,230.00	0.93
17	601233	桐昆股份	101,700	2,094,003.00	0.92
18	601168	西部矿业	166,300	2,058,794.00	0.91
19	300595	欧普康视	25,050	2,052,096.00	0.90
20	000739	普洛药业	86,600	2,016,048.00	0.89
21	600779	水井坊	24,200	2,009,084.00	0.88
22	002353	杰瑞股份	56,600	1,981,000.00	0.87
23	300357	我武生物	25,515	1,957,000.50	0.86
24	600879	航天电子	260,200	1,946,296.00	0.86
25	002013	中航机电	169,700	1,943,065.00	0.85
26	603883	老百姓	30,400	1,910,032.00	0.84
27	603866	桃李面包	32,000	1,891,200.00	0.83
28	600507	方大特钢	270,100	1,874,494.00	0.82
29	600372	中航电子	94,400	1,854,960.00	0.82
30	002372	伟星新材	98,800	1,847,560.00	0.81
31	002064	华峰化学	182,467	1,841,092.03	0.81
32	002078	太阳纸业	127,200	1,835,496.00	0.81
33	600258	首旅酒店	86,200	1,829,164.00	0.80
34	002670	国盛金控	132,900	1,827,375.00	0.80
35	600038	中直股份	29,000	1,818,590.00	0.80
36	603317	天味食品	22,105	1,817,915.20	0.80
37	600884	杉杉股份	100,500	1,812,015.00	0.80
38	600060	海信视像	157,600	1,809,248.00	0.80

39	002572	索菲亚	69,600	1,802,640.00	0.79
40	600699	均胜电子	70,400	1,785,344.00	0.78
41	600563	法拉电子	16,400	1,763,820.00	0.78
42	000807	云铝股份	233,400	1,757,502.00	0.77
43	002867	周大生	65,500	1,745,575.00	0.77
44	002174	游族网络	132,600	1,745,016.00	0.77
45	601689	拓普集团	45,300	1,740,879.00	0.77
46	000636	风华高科	50,800	1,711,960.00	0.75
47	002056	横店东磁	112,100	1,702,799.00	0.75
48	300001	特锐德	57,100	1,676,456.00	0.74
49	002368	太极股份	63,200	1,650,152.00	0.73
50	000878	云南铜业	113,700	1,645,239.00	0.72
51	600350	山东高速	265,000	1,637,700.00	0.72
52	002294	信立泰	55,900	1,583,647.00	0.70
53	002212	天融信	74,600	1,567,346.00	0.69
54	600737	中粮糖业	161,900	1,567,192.00	0.69
55	002563	森马服饰	152,600	1,529,052.00	0.67
56	600718	东软集团	146,100	1,520,901.00	0.67
57	600167	联美控股	133,300	1,512,955.00	0.67
58	600782	新钢股份	328,200	1,506,438.00	0.66
59	000301	东方盛虹	158,500	1,502,580.00	0.66
60	000813	德展健康	338,300	1,498,669.00	0.66
61	600823	世茂股份	323,000	1,489,030.00	0.65
62	300285	国瓷材料	32,700	1,475,097.00	0.65
63	600970	中材国际	211,600	1,455,808.00	0.64
64	603260	合盛硅业	43,400	1,451,296.00	0.64
65	002080	中材科技	59,200	1,431,456.00	0.63
66	000062	深圳华强	114,800	1,428,112.00	0.63

67	600062	华润双鹤	117,600	1,410,024.00	0.62
68	002468	申通快递	139,300	1,404,144.00	0.62
69	601127	小康股份	82,200	1,403,976.00	0.62
70	300324	旋极信息	330,400	1,397,592.00	0.61
71	603515	欧普照明	45,900	1,386,639.00	0.61
72	000089	深圳机场	168,000	1,372,560.00	0.60
73	002124	天邦股份	93,800	1,369,480.00	0.60
74	600875	东方电气	137,200	1,367,884.00	0.60
75	002818	富森美	95,930	1,355,490.90	0.60
76	600348	华阳股份	241,600	1,355,376.00	0.60
77	600338	西藏珠峰	128,500	1,346,680.00	0.59
78	603712	七一二	32,312	1,345,794.80	0.59
79	002051	中工国际	185,700	1,316,613.00	0.58
80	600266	城建发展	256,536	1,303,202.88	0.57
81	002273	水晶光电	110,100	1,276,059.00	0.56
82	601298	青岛港	194,200	1,248,706.00	0.55
83	300274	阳光电源	15,000	1,084,200.00	0.48
84	601717	郑煤机	98,800	1,079,884.00	0.47
85	002092	中泰化学	171,700	1,055,955.00	0.46
86	300070	碧水源	136,100	1,041,165.00	0.46
87	002266	浙富控股	227,100	1,021,950.00	0.45
88	601928	凤凰传媒	156,700	991,911.00	0.44
89	600291	西水股份	135,800	769,986.00	0.34
90	603882	金域医学	5,800	743,096.00	0.33
91	002038	双鹭药业	68,700	693,870.00	0.31
92	002028	思源电气	26,771	537,026.26	0.24
93	600549	厦门钨业	30,900	520,665.00	0.23
94	603885	吉祥航空	44,200	502,554.00	0.22

95	600195	中牧股份	38,358	491,365.98	0.22
96	603056	德邦股份	37,400	474,606.00	0.21
97	001914	招商积余	21,900	471,507.00	0.21
98	603605	珀莱雅	2,500	445,000.00	0.20
99	603816	顾家家居	6,300	444,213.00	0.20
100	600039	四川路桥	98,300	443,333.00	0.19
101	002030	达安基因	12,600	432,180.00	0.19
102	600566	济川药业	21,200	428,876.00	0.19
103	300207	欣旺达	13,947	428,312.37	0.19
104	600143	金发科技	24,700	423,358.00	0.19
105	002131	利欧股份	138,600	419,958.00	0.18
106	002925	盈趣科技	6,400	411,712.00	0.18
107	600885	宏发股份	7,500	406,650.00	0.18
108	601615	明阳智能	21,399	406,153.02	0.18
109	600497	驰宏锌锗	80,200	384,960.00	0.17
110	000581	威孚高科	16,100	373,359.00	0.16
111	603198	迎驾贡酒	10,500	366,450.00	0.16
112	000690	宝新能源	49,700	362,810.00	0.16
113	600765	中航重机	13,600	340,000.00	0.15
114	300244	迪安诊断	9,700	332,516.00	0.15
115	300474	景嘉微	4,700	328,577.00	0.14
116	002382	蓝帆医疗	15,100	318,459.00	0.14
117	002223	鱼跃医疗	11,100	313,131.00	0.14
118	601003	柳钢股份	59,500	308,805.00	0.14
119	600901	江苏租赁	55,600	306,356.00	0.13
120	300133	华策影视	49,400	305,292.00	0.13
121	000513	丽珠集团	7,507	304,033.50	0.13
122	603708	家家悦	14,200	302,460.00	0.13

123	002434	万里扬	33,800	301,496.00	0.13
124	002648	卫星石化	11,500	300,380.00	0.13
125	002155	湖南黄金	35,200	299,552.00	0.13
126	300115	长盈精密	12,100	298,265.00	0.13
127	600639	浦东金桥	23,800	295,120.00	0.13
128	002511	中顺洁柔	14,000	292,180.00	0.13
129	002244	滨江集团	63,300	290,547.00	0.13
130	002233	塔牌集团	22,754	289,885.96	0.13
131	002408	齐翔腾达	34,600	289,256.00	0.13
132	300271	华宇软件	12,000	286,440.00	0.13
133	000778	新兴铸管	77,500	285,200.00	0.13
134	000975	银泰黄金	32,900	283,269.00	0.12
135	002416	爱施德	37,700	281,242.00	0.12
136	000060	中金岭南	58,200	280,524.00	0.12
137	002423	中粮资本	28,300	273,944.00	0.12
138	601098	中南传媒	28,600	272,558.00	0.12
139	603786	科博达	4,000	270,480.00	0.12
140	002603	以岭药业	10,500	267,750.00	0.12
141	600446	金证股份	16,500	267,465.00	0.12
142	000401	冀东水泥	18,900	267,435.00	0.12
143	601865	福莱特	6,600	263,340.00	0.12
144	603868	飞科电器	5,600	261,968.00	0.12
145	002920	德赛西威	3,100	260,834.00	0.11
146	603568	伟明环保	13,600	257,448.00	0.11
147	000519	中兵红箭	25,600	256,512.00	0.11
148	300618	寒锐钴业	2,700	256,257.00	0.11
149	002281	光迅科技	8,800	255,552.00	0.11
150	002815	崇达技术	17,500	252,700.00	0.11

151	600804	鹏博士	37,200	249,984.00	0.11
152	600216	浙江医药	18,300	248,880.00	0.11
153	600056	中国医药	17,200	246,476.00	0.11
154	002375	亚厦股份	33,100	246,264.00	0.11
155	002831	裕同科技	8,000	244,960.00	0.11
156	601200	上海环境	22,400	244,160.00	0.11
157	000021	深科技	12,700	241,427.00	0.11
158	002807	江阴银行	56,300	240,964.00	0.11
159	002583	海能达	39,100	240,074.00	0.11
160	000400	许继电气	16,600	240,036.00	0.11
161	002156	通富微电	9,500	239,780.00	0.11
162	000932	华菱钢铁	50,000	239,000.00	0.11
163	002185	华天科技	17,200	234,264.00	0.10
164	601000	唐山港	94,400	234,112.00	0.10
165	002250	联化科技	9,700	232,703.00	0.10
166	600643	爱建集团	30,600	230,112.00	0.10
167	002399	海普瑞	13,300	229,026.00	0.10
168	000738	航发控制	9,600	220,128.00	0.10
169	002074	国轩高科	5,600	219,072.00	0.10
170	002544	杰赛科技	12,900	216,462.00	0.10
171	000937	冀中能源	52,000	216,320.00	0.10
172	300418	昆仑万维	10,800	215,460.00	0.09
173	002557	洽洽食品	4,000	215,400.00	0.09
174	002901	大博医疗	2,900	213,817.00	0.09
175	601992	金隅集团	70,400	209,088.00	0.09
176	002745	木林森	14,142	206,331.78	0.09
177	600410	华胜天成	23,000	203,780.00	0.09
178	300002	神州泰岳	39,000	199,290.00	0.09

179	600985	淮北矿业	17,800	199,182.00	0.09
180	300482	万孚生物	2,200	196,262.00	0.09
181	300088	长信科技	21,600	192,024.00	0.08
182	600053	九鼎投资	9,434	184,434.70	0.08
183	002268	卫 士 通	11,000	183,700.00	0.08
184	000988	华工科技	7,900	183,201.00	0.08
185	002242	九阳股份	5,600	179,424.00	0.08
186	603345	安井食品	900	173,583.00	0.08
187	603983	丸美股份	3,300	172,293.00	0.08
188	600141	兴发集团	15,600	172,068.00	0.08
189	002048	宁波华翔	10,800	168,156.00	0.07
190	688088	虹软科技	2,392	167,248.64	0.07
191	600259	广晟有色	5,500	165,935.00	0.07
192	000039	中集集团	11,000	164,890.00	0.07
193	600755	厦门国贸	24,600	164,328.00	0.07
194	600667	太极实业	17,300	163,485.00	0.07
195	603228	景旺电子	5,400	162,810.00	0.07
196	002458	益生股份	14,500	161,675.00	0.07
197	002019	亿帆医药	8,500	160,905.00	0.07
198	002465	海格通信	14,600	158,118.00	0.07
199	600598	北大荒	8,100	155,925.00	0.07
200	600517	国网英大	25,600	155,648.00	0.07
201	688002	睿创微纳	1,402	155,622.00	0.07
202	300315	掌趣科技	30,400	155,344.00	0.07
203	601139	深圳燃气	21,200	153,488.00	0.07
204	000623	吉林敖东	9,300	153,171.00	0.07
205	600580	卧龙电驱	9,700	151,320.00	0.07
206	600649	城投控股	27,800	150,954.00	0.07

207	600717	天津港	31,000	148,180.00	0.07
208	002385	大北农	15,300	147,798.00	0.06
209	000729	燕京啤酒	17,300	147,396.00	0.06
210	600026	中远海能	22,000	146,960.00	0.06
211	600380	健康元	10,400	144,664.00	0.06
212	600657	信达地产	35,600	144,180.00	0.06
213	600835	上海机电	7,400	144,004.00	0.06
214	600329	中新药业	8,200	143,664.00	0.06
215	600273	嘉化能源	15,500	143,220.00	0.06
216	002221	东华能源	14,100	142,974.00	0.06
217	600312	平高电气	20,000	142,800.00	0.06
218	300630	普利制药	3,400	142,426.00	0.06
219	300459	金科文化	44,500	141,955.00	0.06
220	000877	天山股份	9,400	141,940.00	0.06
221	600895	张江高科	8,300	141,432.00	0.06
222	002317	众生药业	12,800	141,056.00	0.06
223	000563	陕国投 A	37,400	140,998.00	0.06
224	600728	佳都科技	18,400	139,656.00	0.06
225	002203	海亮股份	18,800	138,932.00	0.06
226	600729	重庆百货	4,800	138,720.00	0.06
227	600776	东方通信	11,700	138,645.00	0.06
228	600325	华发股份	22,300	138,483.00	0.06
229	603858	步长制药	6,000	138,420.00	0.06
230	601975	招商南油	54,900	137,799.00	0.06
231	002002	鸿达兴业	45,800	137,400.00	0.06
232	000537	广宇发展	21,900	137,313.00	0.06
233	000543	皖能电力	32,800	137,104.00	0.06
234	600968	海油发展	57,200	136,708.00	0.06

235	002004	华邦健康	24,500	135,730.00	0.06
236	001872	招商港口	8,500	135,320.00	0.06
237	601969	海南矿业	22,400	133,952.00	0.06
238	000830	鲁西化工	10,400	132,912.00	0.06
239	300463	迈克生物	2,800	130,480.00	0.06
240	002705	新宝股份	2,900	122,525.00	0.05
241	600801	华新水泥	5,900	121,717.00	0.05
242	000718	苏宁环球	35,100	120,393.00	0.05
243	300058	蓝色光标	19,700	118,200.00	0.05
244	600131	国网信通	8,300	118,109.00	0.05
245	600633	浙数文化	14,100	114,774.00	0.05
246	600567	山鹰国际	38,000	114,760.00	0.05
247	600315	上海家化	3,200	111,136.00	0.05
248	600435	北方导航	11,700	105,300.00	0.05
249	000600	建投能源	18,700	104,907.00	0.05
250	300212	易华录	3,400	104,210.00	0.05
251	002839	张家港行	16,800	102,480.00	0.05
252	600409	三友化工	9,600	98,400.00	0.04
253	002568	百润股份	900	93,861.00	0.04
254	600575	淮河能源	39,900	92,568.00	0.04
255	000028	国药一致	2,000	91,600.00	0.04
256	600282	南钢股份	29,100	90,792.00	0.04
257	300146	汤臣倍健	3,700	89,355.00	0.04
258	600079	人福医药	2,600	88,088.00	0.04
259	000883	湖北能源	21,200	82,256.00	0.04
260	002701	奥瑞金	16,300	80,522.00	0.04
261	603355	莱克电气	2,500	75,575.00	0.03
262	002690	美亚光电	1,700	75,276.00	0.03

263	000826	启迪环境	11,100	75,036.00	0.03
264	600908	无锡银行	11,800	71,744.00	0.03
265	600623	华谊集团	12,000	69,600.00	0.03
266	000402	金 融 街	10,708	69,066.60	0.03
267	600903	贵州燃气	5,400	68,580.00	0.03
268	600535	天士力	4,100	60,639.00	0.03
269	603927	中科软	1,500	60,135.00	0.03
270	601958	金钼股份	9,100	56,511.00	0.02
271	601866	中远海发	19,000	56,430.00	0.02
272	300257	开山股份	4,100	55,965.00	0.02
273	600673	东阳光	10,700	53,821.00	0.02
274	000009	中国宝安	7,100	53,463.00	0.02
275	603377	东方时尚	2,600	50,336.00	0.02
276	300699	光威复材	500	44,525.00	0.02
277	600392	盛和资源	4,800	42,672.00	0.02
278	601608	中信重工	10,500	41,580.00	0.02
279	600388	龙净环保	4,600	40,848.00	0.02
280	000050	深天马 A	2,300	33,902.00	0.01
281	600064	南京高科	3,300	33,891.00	0.01
282	600582	天地科技	10,600	32,648.00	0.01
283	600528	中铁工业	3,700	32,338.00	0.01
284	601997	贵阳银行	3,700	29,415.00	0.01
285	002791	坚朗五金	200	28,800.00	0.01
286	601128	常熟银行	3,900	28,782.00	0.01
287	002249	大洋电机	6,300	28,350.00	0.01
288	603638	艾迪精密	400	27,576.00	0.01
289	000997	新 大 陆	1,800	27,504.00	0.01
290	000686	东北证券	2,800	27,496.00	0.01

291	002926	华西证券	2,200	27,456.00	0.01
292	000999	华润三九	1,100	27,434.00	0.01
293	000156	华数传媒	2,900	24,824.00	0.01
294	000046	泛海控股	7,500	24,600.00	0.01
295	002128	露天煤业	2,200	24,068.00	0.01
296	600008	首创股份	7,800	22,074.00	0.01
297	603893	瑞芯微	300	21,705.00	0.01
298	600859	王府井	600	19,548.00	0.01
299	600006	东风汽车	2,000	18,880.00	0.01
300	002966	苏州银行	2,400	18,432.00	0.01
301	002683	宏大爆破	500	17,975.00	0.01
302	600597	光明乳业	1,100	17,886.00	0.01
303	000990	诚志股份	1,500	17,790.00	0.01
304	000012	南玻A	2,300	16,974.00	0.01
305	600171	上海贝岭	1,200	16,824.00	0.01
306	600201	生物股份	800	16,712.00	0.01
307	600820	隧道股份	3,000	16,230.00	0.01
308	002396	星网锐捷	700	16,142.00	0.01
309	002946	新乳业	900	15,849.00	0.01
310	000960	锡业股份	1,400	15,680.00	0.01
311	600754	锦江酒店	300	15,459.00	0.01
312	002075	沙钢股份	1,400	15,358.00	0.01
313	000898	鞍钢股份	5,000	15,200.00	0.01
314	601512	中新集团	1,500	14,910.00	0.01
315	600867	通化东宝	1,100	14,718.00	0.01
316	600707	彩虹股份	2,200	14,652.00	0.01
317	601801	皖新传媒	3,000	14,250.00	0.01
318	600642	申能股份	2,700	14,094.00	0.01

319	000959	首钢股份	3,500	13,405.00	0.01
320	688099	晶晨股份	166	13,069.18	0.01
321	600808	马钢股份	4,800	12,768.00	0.01
322	002010	传化智联	2,700	12,717.00	0.01
323	603650	彤程新材	400	12,400.00	0.01
324	600022	山东钢铁	8,500	12,155.00	0.01
325	300009	安科生物	800	11,744.00	0.01
326	002936	郑州银行	2,600	11,596.00	0.01
327	300180	华峰超纤	1,900	11,229.00	0.00
328	600089	特变电工	1,100	11,165.00	0.00
329	601860	紫金银行	2,600	10,946.00	0.00
330	000717	韶钢松山	2,500	10,675.00	0.00
331	600126	杭钢股份	2,000	10,580.00	0.00
332	600928	西安银行	1,900	10,564.00	0.00
333	000887	中鼎股份	900	10,539.00	0.00
334	600827	百联股份	700	10,220.00	0.00
335	600511	国药股份	200	9,862.00	0.00
336	000547	航天发展	357	9,817.50	0.00
337	600862	中航高科	300	9,030.00	0.00
338	300017	网宿科技	1,300	8,957.00	0.00
339	002110	三钢闽光	1,300	8,749.00	0.00
340	300026	红日药业	1,900	8,702.00	0.00
341	601118	海南橡胶	1,700	8,194.00	0.00
342	600170	上海建工	2,700	8,127.00	0.00
343	600460	士兰微	300	7,500.00	0.00
344	002093	国脉科技	1,000	7,290.00	0.00
345	002948	青岛银行	1,200	7,116.00	0.00
346	601598	中国外运	1,600	7,040.00	0.00

347	000630	铜陵有色	2,700	6,939.00	0.00
348	300316	晶盛机电	200	6,016.00	0.00
349	000528	柳 工	800	5,888.00	0.00
350	600316	洪都航空	100	5,687.00	0.00
351	002429	兆驰股份	900	5,580.00	0.00
352	600037	歌华有线	600	5,520.00	0.00
353	600556	天下秀	400	5,060.00	0.00
354	600529	山东药玻	100	5,015.00	0.00
355	600500	中化国际	900	4,743.00	0.00
356	600959	江苏有线	1,400	4,634.00	0.00
357	601005	重庆钢铁	3,100	4,588.00	0.00
358	000598	兴蓉环境	900	4,320.00	0.00
359	000031	大悦城	900	3,960.00	0.00
360	000027	深圳能源	600	3,654.00	0.00
361	603000	人民网	200	3,380.00	0.00
362	600398	海澜之家	400	2,568.00	0.00
363	601880	辽港股份	1,200	2,316.00	0.00
364	002387	维信诺	200	2,280.00	0.00
365	600645	中源协和	100	1,961.00	0.00
366	002152	广电运通	100	1,068.00	0.00
367	600373	中文传媒	100	1,009.00	0.00
368	601228	广州港	200	672.00	0.00

8.3.2 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	占基金资产净值比例（%）
1	300124	汇川技术	13,800	1,287,540.00	0.57

2	600690	海尔智家	43,500	1,270,635.00	0.56
3	000768	中航西飞	34,500	1,265,460.00	0.56
4	601318	中国平安	14,500	1,261,210.00	0.55
5	601336	新华保险	21,600	1,252,152.00	0.55
6	000725	京东方 A	205,700	1,234,200.00	0.54
7	600161	天坛生物	29,500	1,230,150.00	0.54
8	002001	新 和 成	36,200	1,219,216.00	0.54
9	000708	中信特钢	55,600	1,211,524.00	0.53
10	600570	恒生电子	11,400	1,195,860.00	0.53
11	002142	宁波银行	27,000	954,180.00	0.42
12	601012	隆基股份	7,300	673,060.00	0.30
13	002773	康弘药业	11,000	529,650.00	0.23
14	601601	中国太保	9,400	360,960.00	0.16
15	600309	万华化学	3,300	300,432.00	0.13
16	688027	国盾量子	1,273	295,539.68	0.13
17	688289	圣湘生物	2,268	249,117.12	0.11
18	688561	奇安信-U	1,736	213,232.88	0.09
19	688608	恒玄科技	597	197,607.00	0.09
20	601877	正泰电器	4,800	187,968.00	0.08
21	300251	光线传媒	13,900	167,773.00	0.07
22	688508	芯朋微	1,684	154,776.44	0.07
23	600036	招商银行	2,800	123,060.00	0.05
24	300999	金龙鱼	1,287	113,629.23	0.05
25	688160	步科股份	2,771	86,704.59	0.04
26	688330	宏力达	1,076	81,636.12	0.04
27	688668	鼎通科技	3,037	74,588.72	0.03
28	688590	新致软件	4,171	65,860.09	0.03
29	688571	杭华股份	8,200	64,944.00	0.03

30	688557	兰剑智能	1,812	59,343.00	0.03
31	688617	惠泰医疗	769	57,259.74	0.03
32	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.02
33	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
34	300900	广联航空	726	24,074.16	0.01
35	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
36	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01
37	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
38	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
39	300894	火星人	473	17,486.81	0.01
40	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
41	300861	美畅股份	322	16,454.20	0.01
42	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.01
43	300892	品渥食品	252	15,122.52	0.01
44	300919	中伟股份	235	14,454.85	0.01
45	300878	维康药业	287	13,982.64	0.01
46	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.01
47	300909	汇创达	338	13,746.46	0.01
48	300860	锋尚文化	108	13,680.36	0.01
49	300887	谱尼测试	173	12,891.96	0.01
50	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.01
51	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.01
52	300907	康平科技	473	12,700.05	0.01
53	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.01
54	300910	瑞丰新材	257	12,302.59	0.01
55	300925	法本信息	329	12,281.57	0.01
56	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
57	300864	南大环境	120	10,902.00	0.00

58	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
59	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
60	300889	爱克股份	327	9,849.24	0.00
61	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
62	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
63	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
64	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
65	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
66	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
67	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
68	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	603882	金域医学	15,386,476.90	14.14
2	002414	高德红外	15,084,974.55	13.87
3	603816	顾家家居	15,003,514.46	13.79
4	300285	国瓷材料	14,909,290.38	13.70
5	603444	吉比特	14,282,174.44	13.13
6	002439	启明星辰	14,176,267.09	13.03
7	600885	宏发股份	13,800,475.41	12.68
8	603605	珀莱雅	13,525,058.50	12.43
9	603233	大参林	13,327,363.43	12.25
10	601098	中南传媒	13,291,322.02	12.22
11	603883	老百姓	13,152,982.54	12.09

12	300088	长信科技	13,096,715.05	12.04
13	601615	明阳智能	12,955,063.16	11.91
14	002019	亿帆医药	12,618,066.80	11.60
15	000547	航天发展	12,544,583.72	11.53
16	603939	益丰药房	12,376,724.48	11.38
17	601966	玲珑轮胎	12,321,305.72	11.33
18	600782	新钢股份	12,315,276.00	11.32
19	600201	生物股份	12,292,915.43	11.30
20	600298	安琪酵母	12,068,939.23	11.09
21	603486	科沃斯	11,997,569.60	11.03
22	601168	西部矿业	11,968,107.00	11.00
23	600373	中文传媒	11,938,990.78	10.97
24	002174	游族网络	11,772,372.88	10.82
25	603712	七一二	11,689,995.32	10.74
26	002353	杰瑞股份	11,462,974.84	10.54
27	600380	健康元	11,434,845.24	10.51
28	000739	普洛药业	11,405,548.91	10.48
29	601799	星宇股份	11,354,154.00	10.44
30	300274	阳光电源	11,352,352.97	10.43
31	600273	嘉化能源	11,244,140.13	10.33
32	000513	丽珠集团	11,123,875.90	10.22
33	000975	银泰黄金	10,900,491.00	10.02
34	600132	重庆啤酒	10,856,451.52	9.98
35	600901	江苏租赁	10,471,751.00	9.63
36	600521	华海药业	10,469,295.40	9.62
37	600507	方大特钢	10,447,964.77	9.60
38	601000	唐山港	10,373,785.00	9.53
39	600060	海信视像	10,322,968.00	9.49

40	000690	宝新能源	10,226,113.84	9.40
41	600216	浙江医药	10,225,114.00	9.40
42	002507	涪陵榨菜	10,200,846.37	9.38
43	600167	联美控股	10,049,983.00	9.24
44	002223	鱼跃医疗	10,043,287.00	9.23
45	600765	中航重机	10,009,374.40	9.20
46	600039	四川路桥	9,955,613.34	9.15
47	002925	盈趣科技	9,948,539.95	9.14
48	000738	航发控制	9,787,935.42	9.00
49	600426	华鲁恒升	9,707,466.00	8.92
50	002557	洽洽食品	9,706,920.44	8.92
51	002250	联化科技	9,687,812.00	8.90
52	600258	首旅酒店	9,611,061.76	8.83
53	603866	桃李面包	9,594,297.25	8.82
54	601958	金钼股份	9,558,094.04	8.79
55	002080	中材科技	9,556,532.03	8.78
56	002268	卫 士 通	9,367,311.00	8.61
57	002064	华峰化学	9,302,157.42	8.55
58	002273	水晶光电	9,234,329.76	8.49
59	600062	华润双鹤	9,221,044.40	8.48
60	002444	巨星科技	9,219,741.40	8.47
61	002434	万里扬	9,102,519.00	8.37
62	600563	法拉电子	9,089,600.00	8.35
63	603707	健友股份	9,077,397.62	8.34
64	000528	柳 工	9,020,276.65	8.29
65	002013	中航机电	8,988,634.12	8.26
66	600570	恒生电子	8,913,679.20	8.19
67	601233	桐昆股份	8,848,702.58	8.13

68	002242	九阳股份	8,811,942.60	8.10
69	603556	海兴电力	8,771,323.76	8.06
70	002244	滨江集团	8,744,634.00	8.04
71	600729	重庆百货	8,707,532.68	8.00
72	002124	天邦股份	8,694,183.50	7.99
73	600410	华胜天成	8,658,706.60	7.96
74	600125	铁龙物流	8,645,460.54	7.95
75	000401	冀东水泥	8,617,053.04	7.92
76	000623	吉林敖东	8,600,384.00	7.90
77	601865	福莱特	8,582,378.55	7.89
78	000778	新兴铸管	8,561,355.00	7.87
79	603056	德邦股份	8,517,468.16	7.83
80	600582	天地科技	8,505,725.00	7.82
81	600694	大商股份	8,468,333.76	7.78
82	600195	中牧股份	8,431,277.80	7.75
83	600446	金证股份	8,352,382.00	7.68
84	300014	亿纬锂能	8,343,799.37	7.67
85	603515	欧普照明	8,343,601.99	7.67
86	000878	云南铜业	8,334,549.00	7.66
87	000050	深天马 A	8,295,361.26	7.62
88	600862	中航高科	8,291,495.00	7.62
89	601128	常熟银行	8,268,526.00	7.60
90	300595	欧普康视	8,266,839.08	7.60
91	000807	云铝股份	8,222,769.00	7.56
92	603338	浙江鼎力	8,219,606.11	7.55
93	600486	扬农化工	8,145,259.67	7.49
94	601012	隆基股份	8,134,038.00	7.48
95	600998	九州通	8,111,711.00	7.46

96	600874	创业环保	8,086,055.00	7.43
97	002572	索菲亚	8,011,039.48	7.36
98	000581	威孚高科	7,935,386.00	7.29
99	002709	天赐材料	7,903,334.90	7.26
100	600026	中远海能	7,886,650.00	7.25
101	000932	华菱钢铁	7,858,799.60	7.22
102	601717	郑煤机	7,845,786.99	7.21
103	300357	我武生物	7,838,766.24	7.20
104	002583	海能达	7,804,197.00	7.17
105	300257	开山股份	7,801,098.00	7.17
106	603355	莱克电气	7,786,557.28	7.16
107	002916	深南电路	7,765,092.59	7.14
108	002745	木林森	7,756,524.06	7.13
109	603786	科博达	7,747,861.76	7.12
110	600549	厦门钨业	7,740,680.20	7.11
111	002373	千方科技	7,694,283.72	7.07
112	000988	华工科技	7,649,988.62	7.03
113	300418	昆仑万维	7,620,734.00	7.00
114	002028	思源电气	7,606,213.60	6.99
115	600598	北大荒	7,595,687.00	6.98
116	603228	景旺电子	7,594,702.10	6.98
117	002648	卫星石化	7,574,543.59	6.96
118	002128	露天煤业	7,565,827.00	6.95
119	600153	建发股份	7,532,912.61	6.92
120	600325	华发股份	7,511,804.00	6.90
121	300482	万孚生物	7,507,534.79	6.90
122	002382	蓝帆医疗	7,482,525.00	6.88
123	300115	长盈精密	7,444,257.63	6.84

124	002555	三七互娱	7, 437, 945. 20	6. 84
125	002233	塔牌集团	7, 405, 379. 46	6. 81
126	300166	东方国信	7, 395, 954. 00	6. 80
127	603806	福斯特	7, 366, 199. 54	6. 77
128	002048	宁波华翔	7, 340, 543. 49	6. 75
129	600779	水井坊	7, 269, 798. 00	6. 68
130	000012	南 玻 A	7, 255, 297. 17	6. 67
131	600823	世茂股份	7, 185, 768. 00	6. 60
132	000060	中金岭南	7, 101, 199. 98	6. 53
133	002138	顺络电子	7, 089, 613. 40	6. 52
134	002266	浙富控股	7, 058, 139. 00	6. 49
135	600967	内蒙一机	7, 032, 481. 92	6. 46
136	002463	沪电股份	7, 013, 016. 00	6. 45
137	002078	太阳纸业	6, 997, 225. 62	6. 43
138	300496	中科创达	6, 984, 240. 94	6. 42
139	600657	信达地产	6, 976, 825. 00	6. 41
140	603708	家家悦	6, 955, 687. 08	6. 39
141	603858	步长制药	6, 937, 602. 20	6. 38
142	601808	中海油服	6, 930, 843. 00	6. 37
143	002416	爱施德	6, 909, 005. 52	6. 35
144	000661	长春高新	6, 878, 397. 00	6. 32
145	600777	新潮能源	6, 861, 995. 00	6. 31
146	002185	华天科技	6, 845, 249. 05	6. 29
147	002030	达安基因	6, 827, 300. 00	6. 28
148	000157	中联重科	6, 795, 157. 44	6. 25
149	300347	泰格医药	6, 784, 388. 01	6. 24
150	600259	广晟有色	6, 774, 422. 00	6. 23
151	600643	爱建集团	6, 744, 571. 76	6. 20

152	601139	深圳燃气	6,731,271.91	6.19
153	600639	浦东金桥	6,725,150.51	6.18
154	600739	辽宁成大	6,690,881.00	6.15
155	000937	冀中能源	6,668,986.50	6.13
156	000786	北新建材	6,643,071.08	6.11
157	600908	无锡银行	6,619,466.00	6.08
158	002056	横店东磁	6,555,715.95	6.03
159	300207	欣旺达	6,552,127.70	6.02
160	601689	拓普集团	6,398,493.00	5.88
161	000598	兴蓉环境	6,395,698.00	5.88
162	002818	富森美	6,353,036.94	5.84
163	300315	掌趣科技	6,326,339.29	5.81
164	002241	歌尔股份	6,314,720.75	5.80
165	000997	新大陆	6,312,268.61	5.80
166	000600	建投能源	6,310,015.20	5.80
167	603317	天味食品	6,303,261.45	5.79
168	600763	通策医疗	6,253,661.94	5.75
169	600737	中粮糖业	6,172,858.90	5.67
170	300558	贝达药业	6,172,388.84	5.67
171	001914	招商积余	6,145,264.02	5.65
172	600704	物产中大	6,144,514.00	5.65
173	002511	中顺洁柔	6,093,231.81	5.60
174	002281	光迅科技	6,072,097.00	5.58
175	000930	中粮科技	6,061,730.00	5.57
176	603256	宏和科技	6,012,230.00	5.53
177	600183	生益科技	5,983,445.20	5.50
178	002001	新和成	5,982,301.82	5.50
179	601975	招商南油	5,942,827.00	5.46

180	603986	兆易创新	5,924,841.00	5.45
181	600266	城建发展	5,916,663.36	5.44
182	002920	德赛西威	5,898,266.84	5.42
183	300253	卫宁健康	5,881,413.00	5.41
184	000686	东北证券	5,880,014.00	5.40
185	600845	宝信软件	5,856,740.00	5.38
186	601016	节能风电	5,838,393.00	5.37
187	600787	中储股份	5,827,935.00	5.36
188	000712	锦龙股份	5,824,629.00	5.35
189	000028	国药一致	5,824,022.50	5.35
190	002081	金螳螂	5,779,366.00	5.31
191	600008	首创股份	5,774,972.00	5.31
192	601231	环旭电子	5,752,923.44	5.29
193	300002	神州泰岳	5,744,290.00	5.28
194	002690	美亚光电	5,678,065.25	5.22
195	600909	华安证券	5,667,317.96	5.21
196	000400	许继电气	5,590,244.00	5.14
197	000636	风华高科	5,586,188.00	5.13
198	600895	张江高科	5,571,235.00	5.12
199	002387	维信诺	5,564,910.22	5.11
200	600757	长江传媒	5,557,504.30	5.11
201	300133	华策影视	5,549,758.47	5.10
202	603899	晨光文具	5,544,309.04	5.10
203	002092	中泰化学	5,544,075.00	5.10
204	600022	山东钢铁	5,476,415.00	5.03
205	600329	中新药业	5,473,386.00	5.03
206	000415	渤海租赁	5,460,391.00	5.02
207	600350	山东高速	5,439,456.00	5.00

208	600811	东方集团	5,428,008.24	4.99
209	002831	裕同科技	5,425,083.41	4.99
210	600143	金发科技	5,421,611.00	4.98
211	600875	东方电气	5,402,326.00	4.97
212	600141	兴发集团	5,393,269.03	4.96
213	000537	广宇发展	5,376,868.00	4.94
214	300630	普利制药	5,338,000.16	4.91
215	002368	太极股份	5,327,416.20	4.90
216	002423	中粮资本	5,320,960.00	4.89
217	300618	寒锐钴业	5,302,498.00	4.87
218	300244	迪安诊断	5,296,006.00	4.87
219	600633	浙数文化	5,258,085.00	4.83
220	600315	上海家化	5,227,611.98	4.80
221	002603	以岭药业	5,226,599.98	4.80
222	000021	深科技	5,215,631.00	4.79
223	601811	新华文轩	5,195,963.18	4.78
224	600053	九鼎投资	5,178,655.28	4.76
225	002155	湖南黄金	5,159,648.59	4.74
226	600529	山东药玻	5,145,823.28	4.73
227	000717	韶钢松山	5,065,561.88	4.66
228	000848	承德露露	5,058,896.52	4.65
229	600021	上海电力	5,037,609.00	4.63
230	002051	中工国际	5,011,471.72	4.61
231	300433	蓝思科技	4,986,968.00	4.58
232	600748	上实发展	4,955,585.60	4.55
233	002926	华西证券	4,952,823.00	4.55
234	600058	五矿发展	4,948,150.00	4.55
235	600718	东软集团	4,906,888.00	4.51

236	002372	伟星新材	4,890,756.87	4.50
237	600835	上海机电	4,839,076.54	4.45
238	600808	马钢股份	4,812,602.00	4.42
239	002465	海格通信	4,764,235.00	4.38
240	600161	天坛生物	4,753,710.00	4.37
241	002821	凯莱英	4,750,245.00	4.37
242	002212	天融信	4,740,793.00	4.36
243	600717	天津港	4,725,112.00	4.34
244	300012	华测检测	4,713,871.95	4.33
245	600879	航天电子	4,685,775.00	4.31
246	601200	上海环境	4,640,957.70	4.27
247	600755	厦门国贸	4,622,420.00	4.25
248	000402	金 融 街	4,620,016.00	4.25
249	601336	新华保险	4,608,525.00	4.24
250	603501	韦尔股份	4,567,639.00	4.20
251	002004	华邦健康	4,545,502.00	4.18
252	300124	汇川技术	4,519,897.38	4.15
253	600388	龙净环保	4,516,897.83	4.15
254	002127	南极电商	4,513,299.40	4.15
255	300010	豆神教育	4,510,153.00	4.15
256	600528	中铁工业	4,494,406.00	4.13
257	603799	华友钴业	4,453,647.88	4.09
258	603198	迎驾贡酒	4,439,895.00	4.08
259	600312	平高电气	4,439,258.00	4.08
260	600699	均胜电子	4,435,075.00	4.08
261	600770	综艺股份	4,423,427.00	4.07
262	002714	牧原股份	4,413,146.00	4.06
263	600751	海航科技	4,409,814.00	4.05

264	600745	闻泰科技	4,408,273.00	4.05
265	600572	康恩贝	4,375,813.50	4.02
266	600776	东方通信	4,371,730.64	4.02
267	600115	东方航空	4,359,041.00	4.01
268	600996	贵广网络	4,350,368.00	4.00
269	600754	锦江酒店	4,338,663.00	3.99
270	000883	湖北能源	4,318,293.00	3.97
271	002624	完美世界	4,294,135.52	3.95
272	603983	丸美股份	4,293,521.00	3.95
273	601869	长飞光纤	4,291,848.90	3.94
274	600637	东方明珠	4,280,446.38	3.93
275	603650	彤程新材	4,275,773.00	3.93
276	000718	苏宁环球	4,263,232.00	3.92
277	603766	隆鑫通用	4,262,398.50	3.92
278	600073	上海梅林	4,239,573.00	3.90
279	600728	佳都科技	4,237,061.00	3.89
280	600155	华创阳安	4,207,874.00	3.87
281	002429	兆驰股份	4,198,085.00	3.86
282	603868	飞科电器	4,184,529.00	3.85
283	000725	京东方 A	4,183,288.00	3.85
284	600827	百联股份	4,177,602.00	3.84
285	600557	康缘药业	4,176,643.81	3.84
286	000563	陕国投 A	4,168,821.00	3.83
287	002390	信邦制药	4,164,898.00	3.83
288	600079	人福医药	4,145,638.00	3.81
289	600409	三友化工	4,136,738.00	3.80
290	600466	蓝光发展	4,115,345.65	3.78
291	600588	用友网络	4,107,326.43	3.78

292	600138	中青旅	4,095,067.00	3.76
293	002110	三钢闽光	4,090,652.00	3.76
294	601001	晋控煤业	4,063,832.00	3.74
295	000800	一汽解放	4,020,795.00	3.70
296	600120	浙江东方	4,004,378.00	3.68
297	300001	特锐德	3,994,965.00	3.67
298	002396	星网锐捷	3,974,258.00	3.65
299	002653	海思科	3,968,653.03	3.65
300	601326	秦港股份	3,959,207.00	3.64
301	000543	皖能电力	3,949,154.00	3.63
302	000813	德展健康	3,941,846.75	3.62
303	002408	齐翔腾达	3,912,417.00	3.60
304	002595	豪迈科技	3,882,429.00	3.57
305	002500	山西证券	3,881,896.90	3.57
306	600029	南方航空	3,838,233.00	3.53
307	600648	外高桥	3,826,076.12	3.52
308	002156	通富微电	3,819,705.00	3.51
309	601969	海南矿业	3,815,544.00	3.51
310	300251	光线传媒	3,783,991.00	3.48
311	600348	华阳股份	3,779,147.97	3.47
312	300271	华宇软件	3,765,579.00	3.46
313	000983	山西焦煤	3,759,850.00	3.46
314	300017	网宿科技	3,755,465.00	3.45
315	600536	中国软件	3,705,421.00	3.41
316	000089	深圳机场	3,696,582.00	3.40
317	601318	中国平安	3,654,626.00	3.36
318	603568	伟明环保	3,628,468.68	3.34
319	600372	中航电子	3,605,472.59	3.31

320	300070	碧水源	3,603,661.00	3.31
321	300324	旋极信息	3,592,442.00	3.30
322	000090	天健集团	3,570,280.19	3.28
323	002179	中航光电	3,541,314.16	3.25
324	002271	东方雨虹	3,540,440.50	3.25
325	002544	杰赛科技	3,539,716.34	3.25
326	600809	山西汾酒	3,519,412.00	3.23
327	002670	国盛金控	3,514,599.00	3.23
328	002050	三花智控	3,513,179.00	3.23
329	601801	皖新传媒	3,500,863.00	3.22
330	300059	东方财富	3,491,180.00	3.21
331	002375	亚厦股份	3,456,591.00	3.18
332	600565	迪马股份	3,451,763.00	3.17
333	600707	彩虹股份	3,431,615.56	3.15
334	000999	华润三九	3,409,986.76	3.13
335	002217	合力泰	3,352,817.00	3.08
336	601928	凤凰传媒	3,331,103.72	3.06
337	600038	中直股份	3,314,421.00	3.05
338	002399	海普瑞	3,287,090.26	3.02
339	603885	吉祥航空	3,275,678.00	3.01
340	600276	恒瑞医药	3,267,374.00	3.00
341	300383	光环新网	3,237,473.00	2.98
342	002807	江阴银行	3,231,842.60	2.97
343	601877	正泰电器	3,172,468.00	2.92
344	600064	南京高科	3,141,546.50	2.89
345	002815	崇达技术	3,134,947.00	2.88
346	600820	隧道股份	3,119,684.00	2.87
347	002317	众生药业	3,110,613.00	2.86

348	002249	大洋电机	3,089,210.00	2.84
349	600011	华能国际	3,059,410.00	2.81
350	601088	中国神华	3,037,329.00	2.79
351	600056	中国医药	3,029,664.33	2.78
352	601003	柳钢股份	3,020,724.00	2.78
353	000729	燕京啤酒	3,017,267.79	2.77
354	600673	东阳光	3,014,924.00	2.77
355	300212	易华录	2,990,158.00	2.75
356	603160	汇顶科技	2,910,010.00	2.67
357	601633	长城汽车	2,909,906.00	2.67
358	600667	太极实业	2,888,166.71	2.65
359	600584	长电科技	2,847,385.00	2.62
360	601878	浙商证券	2,839,288.98	2.61
361	000006	深振业 A	2,819,429.00	2.59
362	002640	跨境通	2,814,466.56	2.59
363	600801	华新水泥	2,796,472.00	2.57
364	600623	华谊集团	2,795,734.00	2.57
365	002901	大博医疗	2,753,670.32	2.53
366	600415	小商品城	2,743,816.00	2.52
367	600837	海通证券	2,722,305.00	2.50
368	600171	上海贝岭	2,717,550.00	2.50
369	600309	万华化学	2,682,193.00	2.47
370	600566	济川药业	2,667,912.87	2.45
371	000960	锡业股份	2,661,439.00	2.45
372	002797	第一创业	2,637,379.00	2.42
373	002867	周大生	2,631,254.50	2.42
374	000553	安道麦 A	2,630,224.00	2.42
375	002563	森马服饰	2,617,305.00	2.41

376	601019	山东出版	2,575,405.00	2.37
377	600126	杭钢股份	2,564,535.00	2.36
378	300529	健帆生物	2,549,074.10	2.34
379	603000	人民网	2,528,636.00	2.32
380	002601	龙蟠佰利	2,516,849.34	2.31
381	600436	片仔癀	2,513,295.00	2.31
382	002475	立讯精密	2,500,081.00	2.30
383	000967	盈峰环境	2,491,042.00	2.29
384	002191	劲嘉股份	2,466,586.27	2.27
385	600674	川投能源	2,462,282.96	2.26
386	600066	宇通客车	2,450,601.00	2.25
387	002027	分众传媒	2,434,944.72	2.24
388	002049	紫光国微	2,428,947.00	2.23
389	002008	大族激光	2,421,548.64	2.23
390	000961	中南建设	2,405,066.41	2.21
391	002458	益生股份	2,403,870.60	2.21
392	002385	大北农	2,395,599.00	2.20
393	300308	中际旭创	2,387,041.39	2.19
394	300009	安科生物	2,382,392.00	2.19
395	002938	鹏鼎控股	2,376,496.00	2.18
396	300628	亿联网络	2,376,326.50	2.18
397	300033	同花顺	2,371,008.00	2.18
398	603288	海天味业	2,356,716.00	2.17
399	000708	中信特钢	2,315,076.00	2.13
400	002508	老板电器	2,313,905.00	2.13
401	000061	农产品	2,304,529.00	2.12
402	002491	通鼎互联	2,298,110.00	2.11
403	601068	中铝国际	2,293,379.00	2.11

404	601628	中国人寿	2,285,106.00	2.10
405	002410	广联达	2,257,420.00	2.07
406	000858	五 粮 液	2,253,982.00	2.07
407	000758	中色股份	2,247,517.76	2.07
408	600917	重庆燃气	2,244,640.00	2.06
409	601512	中新集团	2,240,527.00	2.06
410	603833	欧派家居	2,217,206.00	2.04
411	600500	中化国际	2,191,709.00	2.01
412	002440	闰土股份	2,187,326.50	2.01

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002414	高德红外	17,256,668.78	15.86
2	603882	金域医学	16,698,645.68	15.35
3	603816	顾家家居	15,025,285.00	13.81
4	600885	宏发股份	14,797,042.53	13.60
5	603444	吉比特	13,894,518.21	12.77
6	300285	国瓷材料	13,858,897.28	12.74
7	601615	明阳智能	13,714,694.95	12.61
8	002439	启明星辰	13,687,002.71	12.58
9	300088	长信科技	13,487,191.26	12.40
10	603605	珀莱雅	13,436,062.25	12.35
11	603233	大参林	13,400,444.95	12.32
12	601098	中南传媒	13,095,755.50	12.04
13	603939	益丰药房	13,010,934.12	11.96
14	002019	亿帆医药	12,807,854.45	11.77

15	000547	航天发展	12,714,388.50	11.69
16	600201	生物股份	12,272,642.81	11.28
17	600298	安琪酵母	12,200,825.64	11.21
18	300274	阳光电源	11,897,650.84	10.94
19	601966	玲珑轮胎	11,884,867.25	10.92
20	600373	中文传媒	11,864,386.02	10.91
21	600380	健康元	11,864,071.63	10.90
22	603883	老百姓	11,632,472.10	10.69
23	600901	江苏租赁	11,323,706.72	10.41
24	600273	嘉化能源	11,119,687.00	10.22
25	603486	科沃斯	11,106,490.80	10.21
26	601958	金钼股份	10,889,909.38	10.01
27	600782	新钢股份	10,868,231.00	9.99
28	000738	航发控制	10,774,512.03	9.90
29	002925	盈趣科技	10,733,354.11	9.87
30	603712	七一二	10,716,805.00	9.85
31	601168	西部矿业	10,424,509.00	9.58
32	000513	丽珠集团	10,416,044.75	9.57
33	601000	唐山港	10,383,819.00	9.54
34	600765	中航重机	10,380,213.00	9.54
35	002174	游族网络	10,366,219.93	9.53
36	000975	银泰黄金	10,313,455.01	9.48
37	601799	星宇股份	10,297,890.00	9.47
38	600521	华海药业	10,291,460.00	9.46
39	000690	宝新能源	10,085,498.44	9.27
40	600216	浙江医药	10,066,724.00	9.25
41	002557	洽洽食品	9,867,876.48	9.07
42	000528	柳 工	9,790,739.64	9.00

43	603707	健友股份	9,756,191.85	8.97
44	002353	杰瑞股份	9,712,606.66	8.93
45	600060	海信视像	9,577,042.00	8.80
46	600132	重庆啤酒	9,531,928.28	8.76
47	002223	鱼跃医疗	9,506,050.10	8.74
48	600039	四川路桥	9,400,569.18	8.64
49	600410	华胜天成	9,317,469.55	8.56
50	600062	华润双鹤	9,313,336.93	8.56
51	002250	联化科技	9,269,853.80	8.52
52	300014	亿纬锂能	9,208,326.52	8.46
53	600874	创业环保	9,193,093.00	8.45
54	601865	福莱特	9,164,331.00	8.42
55	000739	普洛药业	9,123,289.24	8.39
56	600729	重庆百货	9,070,313.36	8.34
57	002048	宁波华翔	8,907,154.18	8.19
58	002268	卫 士 通	8,841,510.00	8.13
59	002080	中材科技	8,815,096.00	8.10
60	002444	巨星科技	8,813,707.15	8.10
61	002028	思源电气	8,790,699.19	8.08
62	603355	莱克电气	8,772,550.93	8.06
63	002434	万里扬	8,755,068.00	8.05
64	002244	滨江集团	8,724,016.06	8.02
65	300166	东方国信	8,687,832.68	7.99
66	002463	沪电股份	8,683,424.46	7.98
67	000623	吉林敖东	8,632,209.05	7.93
68	603556	海兴电力	8,628,912.77	7.93
69	600507	方大特钢	8,623,293.62	7.93
70	002128	露天煤业	8,594,893.19	7.90

71	000050	深天马 A	8,588,919.54	7.89
72	601012	隆基股份	8,567,662.39	7.87
73	600167	联美控股	8,566,674.95	7.87
74	600125	铁龙物流	8,556,960.24	7.87
75	600582	天地科技	8,550,474.00	7.86
76	000988	华工科技	8,535,863.00	7.85
77	002745	木林森	8,461,345.84	7.78
78	600486	扬农化工	8,451,867.60	7.77
79	300418	昆仑万维	8,451,367.73	7.77
80	603866	桃李面包	8,399,531.83	7.72
81	600694	大商股份	8,397,291.41	7.72
82	601128	常熟银行	8,394,905.00	7.72
83	601717	郑煤机	8,391,668.77	7.71
84	000778	新兴铸管	8,341,124.00	7.67
85	600563	法拉电子	8,333,797.95	7.66
86	000997	新大陆	8,318,297.84	7.65
87	002064	华峰化学	8,309,711.30	7.64
88	603858	步长制药	8,166,304.70	7.51
89	002242	九阳股份	8,126,908.75	7.47
90	002273	水晶光电	8,118,286.94	7.46
91	000401	冀东水泥	8,101,323.84	7.45
92	600998	九州通	8,098,104.18	7.44
93	600570	恒生电子	8,092,203.61	7.44
94	600258	首旅酒店	8,077,959.80	7.42
95	600598	北大荒	7,984,772.00	7.34
96	600549	厦门钨业	7,897,916.20	7.26
97	002507	涪陵榨菜	7,878,914.43	7.24
98	600643	爱建集团	7,862,581.00	7.23

99	600862	中航高科	7,858,124.00	7.22
100	600446	金证股份	7,844,447.00	7.21
101	300257	开山股份	7,811,149.00	7.18
102	002583	海能达	7,725,380.00	7.10
103	600426	华鲁恒升	7,720,302.88	7.10
104	603056	德邦股份	7,676,764.16	7.06
105	600777	新潮能源	7,675,537.00	7.05
106	600153	建发股份	7,663,344.00	7.04
107	600026	中远海能	7,626,415.91	7.01
108	600195	中牧股份	7,606,719.87	6.99
109	300115	长盈精密	7,605,716.20	6.99
110	002648	卫星石化	7,562,286.62	6.95
111	000581	威孚高科	7,523,484.00	6.92
112	002373	千方科技	7,482,377.45	6.88
113	002916	深南电路	7,464,545.86	6.86
114	600325	华发股份	7,405,665.00	6.81
115	000932	华菱钢铁	7,403,715.00	6.81
116	603786	科博达	7,398,178.00	6.80
117	002416	爱施德	7,320,199.90	6.73
118	000930	中粮科技	7,272,452.86	6.68
119	603228	景旺电子	7,262,574.90	6.68
120	000060	中金岭南	7,243,796.07	6.66
121	002555	三七互娱	7,210,408.13	6.63
122	000012	南玻A	7,208,341.44	6.63
123	300347	泰格医药	7,170,834.40	6.59
124	600967	内蒙一机	7,108,782.20	6.53
125	600908	无锡银行	7,090,354.00	6.52
126	002382	蓝帆医疗	7,052,917.00	6.48

127	603515	欧普照明	7,039,549.20	6.47
128	002013	中航机电	7,018,815.99	6.45
129	002124	天邦股份	7,001,735.05	6.44
130	600657	信达地产	6,998,795.00	6.43
131	002709	天赐材料	6,992,208.64	6.43
132	601808	中海油服	6,979,029.68	6.41
133	000937	冀中能源	6,954,509.00	6.39
134	000157	中联重科	6,932,010.56	6.37
135	601233	桐昆股份	6,881,674.00	6.33
136	002030	达安基因	6,873,333.87	6.32
137	002233	塔牌集团	6,835,512.97	6.28
138	000878	云南铜业	6,807,205.47	6.26
139	600779	水井坊	6,801,628.62	6.25
140	300482	万孚生物	6,788,529.89	6.24
141	000786	北新建材	6,727,045.64	6.18
142	000598	兴蓉环境	6,611,691.00	6.08
143	000807	云铝股份	6,576,898.00	6.05
144	600259	广晟有色	6,575,623.15	6.04
145	002185	华天科技	6,574,161.00	6.04
146	600329	中新药业	6,566,479.50	6.04
147	600845	宝信软件	6,554,506.00	6.02
148	601139	深圳燃气	6,526,842.89	6.00
149	000661	长春高新	6,520,488.10	5.99
150	601016	节能风电	6,518,454.00	5.99
151	600763	通策医疗	6,510,062.84	5.98
152	600143	金发科技	6,391,249.00	5.87
153	002241	歌尔股份	6,384,256.55	5.87
154	600787	中储股份	6,374,100.86	5.86

155	000600	建投能源	6,314,929.00	5.80
156	600823	世茂股份	6,310,235.00	5.80
157	002690	美亚光电	6,253,273.92	5.75
158	600639	浦东金桥	6,221,716.60	5.72
159	002078	太阳纸业	6,217,042.33	5.71
160	603338	浙江鼎力	6,215,182.52	5.71
161	000686	东北证券	6,196,385.00	5.70
162	600704	物产中大	6,192,755.82	5.69
163	000712	锦龙股份	6,178,941.00	5.68
164	300595	欧普康视	6,162,495.32	5.66
165	603256	宏和科技	6,160,822.00	5.66
166	601975	招商南油	6,137,862.10	5.64
167	603986	兆易创新	6,126,955.20	5.63
168	600183	生益科技	6,099,995.09	5.61
169	300357	我武生物	6,092,752.38	5.60
170	300207	欣旺达	6,029,327.55	5.54
171	600717	天津港	5,985,517.64	5.50
172	300315	掌趣科技	5,984,942.00	5.50
173	600557	康缘药业	5,977,282.19	5.49
174	601231	环旭电子	5,969,772.05	5.49
175	603708	家家悦	5,951,273.34	5.47
176	002266	浙富控股	5,922,150.00	5.44
177	002572	索菲亚	5,919,862.00	5.44
178	600909	华安证券	5,913,349.00	5.44
179	300253	卫宁健康	5,904,613.50	5.43
180	600008	首创股份	5,884,952.00	5.41
181	002081	金螳螂	5,881,981.00	5.41
182	300558	贝达药业	5,879,859.50	5.40

183	000400	许继电气	5,829,365.00	5.36
184	603899	晨光文具	5,825,852.00	5.35
185	600058	五矿发展	5,825,119.00	5.35
186	002920	德赛西威	5,819,268.94	5.35
187	300433	蓝思科技	5,815,031.00	5.34
188	300002	神州泰岳	5,807,862.00	5.34
189	000028	国药一致	5,784,695.70	5.32
190	002281	光迅科技	5,751,551.00	5.29
191	002387	维信诺	5,699,272.00	5.24
192	600895	张江高科	5,641,355.00	5.19
193	600811	东方集团	5,633,848.34	5.18
194	600022	山东钢铁	5,616,368.00	5.16
195	002511	中顺洁柔	5,563,064.79	5.11
196	600751	海航科技	5,521,366.00	5.07
197	002821	凯莱英	5,520,989.00	5.07
198	002818	富森美	5,497,806.20	5.05
199	600757	长江传媒	5,476,009.00	5.03
200	001914	招商积余	5,411,761.69	4.97
201	603806	福斯特	5,382,329.40	4.95
202	600728	佳都科技	5,367,814.00	4.93
203	603650	彤程新材	5,356,543.00	4.92
204	600748	上实发展	5,345,037.12	4.91
205	600633	浙数文化	5,343,976.02	4.91
206	300133	华策影视	5,333,446.35	4.90
207	600529	山东药玻	5,323,536.99	4.89
208	002056	横店东磁	5,310,471.66	4.88
209	000537	广宇发展	5,275,056.00	4.85
210	600141	兴发集团	5,269,183.00	4.84

211	600266	城建发展	5,237,823.60	4.81
212	000848	承德露露	5,236,713.18	4.81
213	603317	天味食品	5,187,397.10	4.77
214	300618	寒锐钴业	5,183,800.49	4.76
215	000415	渤海租赁	5,168,537.00	4.75
216	600138	中青旅	5,154,113.00	4.74
217	600315	上海家化	5,148,785.72	4.73
218	600120	浙江东方	5,142,302.42	4.73
219	601689	拓普集团	5,105,407.95	4.69
220	002831	裕同科技	5,104,718.42	4.69
221	601811	新华文轩	5,075,541.28	4.67
222	002423	中粮资本	5,016,538.00	4.61
223	300244	迪安诊断	5,008,553.68	4.60
224	600745	闻泰科技	4,970,509.00	4.57
225	002926	华西证券	4,968,124.00	4.57
226	300630	普利制药	4,965,334.00	4.56
227	600737	中粮糖业	4,956,591.00	4.56
228	002092	中泰化学	4,946,477.00	4.55
229	600021	上海电力	4,941,906.00	4.54
230	600808	马钢股份	4,941,220.00	4.54
231	000717	韶钢松山	4,933,229.00	4.53
232	002603	以岭药业	4,905,931.00	4.51
233	300496	中科创达	4,872,509.56	4.48
234	000021	深科技	4,854,446.00	4.46
235	600718	东软集团	4,845,790.00	4.45
236	603501	韦尔股份	4,832,337.00	4.44
237	002004	华邦健康	4,831,033.00	4.44
238	600835	上海机电	4,830,006.18	4.44

239	600466	蓝光发展	4,824,887.00	4.43
240	002155	湖南黄金	4,815,022.35	4.43
241	002127	南极电商	4,805,761.00	4.42
242	002001	新 和 成	4,802,965.80	4.41
243	600053	九鼎投资	4,753,130.00	4.37
244	601326	秦港股份	4,729,693.00	4.35
245	603766	隆鑫通用	4,724,038.50	4.34
246	600073	上海梅林	4,686,135.00	4.31
247	002138	顺络电子	4,680,699.20	4.30
248	603198	迎驾贡酒	4,673,001.00	4.30
249	002465	海格通信	4,615,183.00	4.24
250	603799	华友钴业	4,606,713.06	4.23
251	600770	综艺股份	4,561,188.00	4.19
252	000402	金 融 街	4,524,031.08	4.16
253	000543	皖能电力	4,470,822.00	4.11
254	600755	厦门国贸	4,464,065.00	4.10
255	600528	中铁工业	4,459,378.80	4.10
256	000718	苏宁环球	4,449,968.00	4.09
257	601200	上海环境	4,446,026.00	4.09
258	601001	晋控煤业	4,441,375.00	4.08
259	600739	辽宁成大	4,426,718.00	4.07
260	600572	康恩贝	4,424,384.50	4.07
261	601969	海南矿业	4,417,181.37	4.06
262	600776	东方通信	4,417,105.00	4.06
263	002714	牧原股份	4,409,963.50	4.05
264	600809	山西汾酒	4,395,451.00	4.04
265	000883	湖北能源	4,390,996.00	4.04
266	600312	平高电气	4,388,410.00	4.03

267	600388	龙净环保	4,384,755.00	4.03
268	600820	隧道股份	4,349,233.00	4.00
269	600115	东方航空	4,344,822.00	3.99
270	000006	深振业 A	4,319,404.50	3.97
271	603983	丸美股份	4,314,619.00	3.97
272	002390	信邦制药	4,253,162.00	3.91
273	600064	南京高科	4,162,540.40	3.83
274	600637	东方明珠	4,161,587.00	3.83
275	600155	华创阳安	4,158,915.00	3.82
276	600875	东方电气	4,151,801.00	3.82
277	601869	长飞光纤	4,131,879.00	3.80
278	600996	贵广网络	4,117,677.00	3.78
279	300010	豆神教育	4,114,373.00	3.78
280	600588	用友网络	4,106,520.90	3.77
281	600754	锦江酒店	4,104,048.00	3.77
282	000800	一汽解放	4,093,186.56	3.76
283	002110	三钢闽光	4,072,571.00	3.74
284	000090	天健集团	4,062,239.54	3.73
285	600409	三友化工	4,049,561.00	3.72
286	000563	陕国投 A	4,041,020.14	3.71
287	600827	百联股份	4,035,655.00	3.71
288	000983	山西焦煤	4,035,493.90	3.71
289	600079	人福医药	4,017,542.53	3.69
290	600648	外高桥	4,011,772.01	3.69
291	002595	豪迈科技	4,011,688.00	3.69
292	002429	兆驰股份	3,981,065.88	3.66
293	002624	完美世界	3,975,759.00	3.65
294	000636	风华高科	3,967,386.00	3.65

295	002396	星网锐捷	3,939,143.54	3.62
296	002500	山西证券	3,929,371.60	3.61
297	002653	海思科	3,893,104.10	3.58
298	300251	光线传媒	3,877,578.40	3.56
299	600029	南方航空	3,867,365.00	3.55
300	002384	东山精密	3,815,191.27	3.51
301	002051	中工国际	3,770,735.04	3.47
302	600536	中国软件	3,759,490.16	3.46
303	600584	长电科技	3,723,678.00	3.42
304	600415	小商品城	3,719,619.00	3.42
305	002408	齐翔腾达	3,660,499.53	3.36
306	000967	盈峰环境	3,644,221.00	3.35
307	002179	中航光电	3,608,513.20	3.32
308	002156	通富微电	3,607,329.83	3.32
309	603868	飞科电器	3,585,070.00	3.30
310	002050	三花智控	3,566,867.00	3.28
311	601633	长城汽车	3,565,935.77	3.28
312	600161	天坛生物	3,529,817.93	3.24
313	002217	合力泰	3,486,920.00	3.20
314	002375	亚厦股份	3,479,833.00	3.20
315	300017	网宿科技	3,472,814.00	3.19
316	300059	东方财富	3,457,984.00	3.18
317	601801	皖新传媒	3,450,357.00	3.17
318	002271	东方雨虹	3,431,331.65	3.15
319	600350	山东高速	3,420,700.00	3.14
320	300124	汇川技术	3,409,128.58	3.13
321	603025	大豪科技	3,402,631.70	3.13
322	002807	江阴银行	3,400,433.00	3.13

323	000027	深圳能源	3,400,314.85	3.13
324	300383	光环新网	3,390,273.00	3.12
325	002544	杰赛科技	3,338,602.14	3.07
326	000999	华润三九	3,309,883.00	3.04
327	601336	新华保险	3,305,745.00	3.04
328	002368	太极股份	3,304,770.00	3.04
329	600707	彩虹股份	3,280,892.00	3.02
330	002640	跨境通	3,254,211.92	2.99
331	600565	迪马股份	3,241,805.00	2.98
332	600276	恒瑞医药	3,215,293.20	2.96
333	300271	华宇软件	3,214,305.66	2.95
334	000061	农产品	3,110,743.70	2.86
335	002180	纳思达	3,098,428.00	2.85
336	002372	伟星新材	3,082,402.11	2.83
337	601088	中国神华	3,074,667.93	2.83
338	000729	燕京啤酒	3,023,708.17	2.78
339	600623	华谊集团	3,018,100.99	2.77
340	600673	东阳光	3,012,544.00	2.77
341	000725	京东方 A	2,994,350.00	2.75
342	600011	华能国际	2,988,778.25	2.75
343	603568	伟明环保	2,968,612.24	2.73
344	002249	大洋电机	2,948,863.00	2.71
345	002317	众生药业	2,947,608.00	2.71
346	600699	均胜电子	2,919,411.00	2.68
347	002212	天融信	2,919,350.29	2.68
348	002399	海普瑞	2,898,207.40	2.66
349	002815	崇达技术	2,891,208.00	2.66
350	603160	汇顶科技	2,888,095.97	2.65

351	601877	正泰电器	2,884,035.99	2.65
352	600917	重庆燃气	2,857,949.00	2.63
353	601878	浙商证券	2,835,707.00	2.61
354	600879	航天电子	2,832,049.00	2.60
355	600056	中国医药	2,791,274.00	2.57
356	603885	吉祥航空	2,759,431.00	2.54
357	000877	天山股份	2,743,341.00	2.52
358	601003	柳钢股份	2,740,153.00	2.52
359	600667	太极实业	2,732,597.00	2.51
360	002221	东华能源	2,703,126.00	2.48
361	002601	龙蟠佰利	2,687,485.52	2.47
362	300212	易华录	2,654,950.20	2.44
363	000813	德展健康	2,645,648.00	2.43
364	600801	华新水泥	2,619,629.00	2.41
365	000960	锡业股份	2,599,471.00	2.39
366	600837	海通证券	2,595,136.00	2.39
367	300529	健帆生物	2,594,176.40	2.38
368	002797	第一创业	2,591,040.00	2.38
369	000553	安道麦 A	2,582,876.00	2.37
370	600171	上海贝岭	2,580,331.00	2.37
371	300070	碧水源	2,579,251.00	2.37
372	300012	华测检测	2,537,160.59	2.33
373	600348	华阳股份	2,512,241.78	2.31
374	600066	宇通客车	2,510,266.00	2.31
375	002191	劲嘉股份	2,504,815.00	2.30
376	600436	片仔癀	2,496,568.00	2.29
377	002027	分众传媒	2,480,580.00	2.28
378	601019	山东出版	2,478,874.00	2.28

379	002475	立讯精密	2,477,309.00	2.28
380	601611	中国核建	2,474,211.00	2.27
381	603000	人民网	2,430,421.00	2.23
382	600674	川投能源	2,423,151.00	2.23
383	601318	中国平安	2,413,204.00	2.22
384	002049	紫光国微	2,411,831.28	2.22
385	300026	红日药业	2,402,592.50	2.21
386	002440	闰土股份	2,387,625.00	2.19
387	000750	国海证券	2,386,951.00	2.19
388	300033	同花顺	2,375,428.00	2.18
389	002901	大博医疗	2,366,922.00	2.18
390	002385	大北农	2,365,381.00	2.17
391	300001	特锐德	2,356,586.00	2.17
392	603377	东方时尚	2,355,060.00	2.16
393	600309	万华化学	2,350,984.00	2.16
394	000758	中色股份	2,334,753.70	2.15
395	601628	中国人寿	2,331,411.00	2.14
396	002938	鹏鼎控股	2,316,977.46	2.13
397	000858	五 粮 液	2,311,052.00	2.12
398	000961	中南建设	2,300,304.00	2.11
399	002508	老板电器	2,293,046.88	2.11
400	603659	璞泰来	2,287,585.00	2.10
401	300009	安科生物	2,285,653.82	2.10
402	002008	大族激光	2,282,928.00	2.10
403	601928	凤凰传媒	2,282,659.56	2.10
404	600566	济川药业	2,282,447.00	2.10
405	002152	广电运通	2,266,450.00	2.08
406	603288	海天味业	2,265,555.58	2.08

407	600126	杭钢股份	2,259,368.00	2.08
408	600511	国药股份	2,257,425.89	2.07
409	600317	营口港	2,255,428.00	2.07
410	002460	赣锋锂业	2,247,730.84	2.07
411	000008	神州高铁	2,240,681.00	2.06
412	000089	深圳机场	2,240,389.00	2.06
413	601068	中铝国际	2,238,248.00	2.06
414	601100	恒立液压	2,221,533.00	2.04
415	601512	中新集团	2,220,270.00	2.04
416	300628	亿联网络	2,211,555.57	2.03
417	300324	旋极信息	2,209,950.00	2.03
418	600500	中化国际	2,192,666.00	2.02
419	300308	中际旭创	2,182,734.00	2.01

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,754,206,130.68
卖出股票收入（成交）总额	2,723,185,844.03

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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。

8.5 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	12,592,740.00	5.54
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	12,592,740.00	5.54

8.6 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	019627	20 国债 01	76,000	7,599,240.00	3.34
2	019640	20 国债 10	50,000	4,993,500.00	2.20

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

8.12.3 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	105,644.12
2	应收证券清算款	4,152,780.53
3	应收股利	—
4	应收利息	219,773.23
5	应收申购款	413,065.13
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,891,263.01

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 500A	6,474	12,047.86	24,068,635.66	30.86%	53,929,179.13	69.14%
中 金 中 证 500C	5,334	13,266.86	39,394,804.81	55.67%	31,370,608.36	44.33%
合计	11,808	12,598.51	63,463,440.47	42.66%	85,299,787.49	57.34%

9.2 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 500A	1,352,166.87	1.7336%
	中金中证 500C	35,420.14	0.0501%
	合计	1,387,587.01	0.9327%

9.3 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的情况

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 500A	0~10
	中金中证 500C	0
	合计	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 500A	0
	中金中证 500C	0
	合计	0

9.4 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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）基金 份额总额	10,001,000.00	—
本报告期期初基金份额总额	71,170,611.80	28,795,776.75
本报告期基金总申购份额	114,271,372.46	171,758,296.88
减:本报告期基金总赎回份额	107,444,169.47	129,788,660.46
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	—	—
本报告期期末基金份额总额	77,997,814.79	70,765,413.17

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金自 2020 年 7 月 29 日至 2020 年 8 月 30 日 17:00 止以通讯开会方式召开基金份额持有人大会，审议《关于中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金变更投资范围、投资限制和调整赎回费有关事项的议案》。会议议案于 2020 年 8 月 31 日获得通过，大会决议自同日起生效。自生效之日起，中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务并实施调整后的赎回费率。

11.2 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

2020 年 5 月 28 日，本基金管理人发布公告，公司产生第三届董事会，由以下九名董事组成：楚钢先生、黄劲峰先生、徐翌成先生、孙菁女士、赵璧先生、汤琰女士、冒大卫先生（独立董事）、王元先生（独立董事）、江勇先生（独立董事）。原第二届董事会成员陈刚先生、李永先生、张春先生（独立董事）不再担任公司董事职务。

2020 年 6 月 30 日，本基金管理人发布公告，邱延冰先生自 2020 年 6 月 30 日起担任公司副总经理，分管公司投资研究业务；李永先生自同日起不再担任公司副总经理。

2020 年 12 月 24 日，本基金管理人发布公告，胡长生先生自 2020 年 12 月 23 日担任公司董事长；楚钢自同日起不再担任公司董事长。

(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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。本基金本报告期内应支付审计费用 40,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
长江证券	4	1,411,273,958.18	25.77%	1,032,068.98	25.77%	—
中投证券	2	1,276,418,844.60	23.30%	933,447.84	23.30%	—
招商证券	2	935,044,097.67	17.07%	683,798.17	17.07%	—
华创证券	2	702,787,649.34	12.83%	513,951.98	12.83%	—
中金公司	2	629,520,223.69	11.49%	460,371.00	11.49%	—
山西证券	1	201,131,778.04	3.67%	147,088.23	3.67%	—
申港证券	1	139,036,994.25	2.54%	101,678.39	2.54%	—
兴业证券	2	102,706,615.63	1.88%	75,109.70	1.88%	—
天风证券	2	79,471,813.31	1.45%	58,119.07	1.45%	—

1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 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；
- (3) 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，具有开发量化投资组合模型的能力；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) 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。

11.7.2 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
长江证券	3,217,182.10	16.30%	189,300,000.00	27.35%	—	—
中投证券	3,966,295.17	20.10%	170,700,000.00	24.66%	—	—
招商证券	5,575,259.15	28.25%	103,000,000.00	14.88%	—	—
华创证券	6,758,540.00	34.25%	108,800,000.00	15.72%	—	—
中金公司	215,400.20	1.09%	85,300,000.00	12.32%	—	—
兴业证券	—	—	15,600,000.00	2.25%	—	—
天风证券	—	—	19,500,000.00	2.82%	—	—
山西证券	—	—	—	—	—	—
申港证券	—	—	—	—	—	—

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 18 日
2	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 18 日
3	中金基金管理有限公司关于旗下 28 只基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 18 日

4	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同、托管协议	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 18 日
5	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书及其摘要（2020 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 21 日
6	关于 2020 年春节假期延长及休市的相关通知	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 31 日
7	中金基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 3 月 21 日
8	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 21 日
9	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2019 年年度报告及其摘要	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 21 日
10	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 22 日
11	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 22 日
12	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	2020 年 4 月 23 日
13	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 28 日

	内承销证券的公告		
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	2020 年 5 月 28 日
15	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	2020 年 6 月 11 日
16	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	2020 年 6 月 18 日
17	中金基金管理有限公司副总经理变更公告	中国证监会规定媒介	2020 年 6 月 30 日
18	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	2020 年 7 月 7 日
19	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 9 日
20	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	2020 年 7 月 11 日
21	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	2020 年 7 月 11 日
22	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 21 日
23	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 21 日

24	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	2020 年 7 月 28 日
25	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 29 日
26	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 30 日
27	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 31 日
28	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	2020 年 8 月 5 日
29	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书(2020 年第 2 号)及摘要	中国证监会规定媒介	2020 年 8 月 8 日
30	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	2020 年 8 月 13 日
31	中金基金管理有限公司旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 8 月 29 日
32	中金中证 500 指数增强型发	中国证监会规定媒介	2020 年 8 月 29 日

	起式证券投资基金 2020 年中 期报告及摘要		
33	中金中证 500 指数增强型发 起式证券投资基金基金合同 及托管协议提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 1 日
34	中金基金管理有限公司中金 中证 500 指数增强型发起式 证券投资基金基金合同及托 管协议	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 1 日
35	中金中证 500 指数增强型发 起式证券投资基金(中金中证 500A 份额)基金产品资料概要 (更新)	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 1 日
36	中金基金管理有限公司关于 中金中证 500 指数增强型发 起式证券投资基金基金份额 持有人大会表决结果暨决议 生效的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 1 日
37	中金中证 500 指数增强型发 起式证券投资基金更新招募 说明书(2020 年第 3 号)	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 3 日
38	中金中证 500 指数增强型发 起式证券投资基金基金产品 资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 3 日
39	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	2020 年 9 月 10 日
40	中金基金管理有限公司关于 旗下基金投资关联方承销期	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 19 日

	内承销证券的公告		
41	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	2020 年 9 月 19 日
42	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	2020 年 9 月 30 日
43	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	2020 年 10 月 10 日
44	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	2020 年 10 月 20 日
45	中金基金管理有限公司旗下 基金 2020 年第 3 季度报告提 示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 10 月 28 日
46	中金中证 500 指数增强型发 起式证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2020 年 10 月 28 日
47	中金中证 500 指数增强型发 起式证券投资基金基金经理 变更公告	中国证监会规定媒介	2020 年 10 月 29 日
48	中金中证 500 指数增强型发 起式证券投资基金更新招募 说明书(2020 年第 4 号)	中国证监会规定媒介	2020 年 10 月 30 日
49	中金中证 500 指数增强型发 起式证券投资基金基金产品 资料概要(更新)(2020 年第 4 号)	中国证监会规定媒介	2020 年 10 月 30 日

50	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	2020 年 11 月 28 日
51	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	2020 年 12 月 18 日
52	中金基金管理有限公司董事长变更公告	中国证监会规定媒介	2020 年 12 月 24 日
53	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 12 月 26 日
54	中金基金管理有限公司中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2020 年 12 月 26 日
55	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书(2020 年第 5 号)	中国证监会规定媒介	2020 年 12 月 30 日
56	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2020 年 12 月 30 日
57	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	2020 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 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、本报告期内在指定媒介上披露的有关本基金的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人和/或基金托管人住所。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2021 年 3 月 31 日