# 中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年中期报告

2021年6月30日

基金管理人: 中金基金管理有限公司

基金托管人: 中国工商银行股份有限公司

送出日期: 2021年8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、董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2021 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

### 1.2 目录

<b>§1</b>	重要	提示及目录	2
	1.1	重要提示	2
	1.2	目录	3
<b>§2</b>	基金	简介	6
	2.1	基金基本情况	6
	2.2	基金产品说明	6
	2.3	基金管理人和基金托管人	7
	2.4	信息披露方式	7
	2.5	其他相关资料	7
<b>§3</b>	主要	财务指标和基金净值表现	8
	3.1	主要会计数据和财务指标	8
	3.2	基金净值表现	8
<b>§4</b>	管理	人报告	11
	4.1	基金管理人及基金经理情况	11
	4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
	4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
	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	12
	4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
	4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
	4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
	4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§</b> 5	托管	人报告	14
	5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
	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	14
	5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§</b> 6	半年	度财务会计报告(未经审计)	15
	6.1	资产负债表	15
	6.2	利润表	16
	6.3	所有者权益(基金净值)变动表	17

	6.4 报表附注	18
§7	投资组合报告	46
	7.1 期末基金资产组合情况	46
	7.2 期末按行业分类的股票投资组合	46
	7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
	7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
	7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
	7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	65
	7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	65
	7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	65
	7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	65
	7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
	7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
	7.12 投资组合报告附注	66
<b>§8</b>	基金份额持有人信息	68
	8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
	8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
	8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	68
	8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	68
<b>§9</b>	开放式基金份额变动	69
§10	0 重大事件揭示	70
	10.1 基金份额持有人大会决议	70
	10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
	10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
	10.4 基金投资策略的改变	70
	10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
	10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	70
	10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
	10.8 其他重大事件	72
<b>§1</b> 1	1 影响投资者决策的其他重要信息	75

	11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	75
	11.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§12	备查文件目录	76
	12.1 备查文件目录	76
	12.2 存放地点	76
	12.3 查阅方式	76

### § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	<b> </b>		
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	203, 058, 186. 99 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	121, 993, 115. 23 份	81, 065, 071. 76 份	

### 2.2 基金产品说明

	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
   投资目标	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
汉页日你 	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%。
	1、资产配置策略
	本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金,股票投资比例范围为基金资产
	的 90%-95%,大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各
	类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股
	票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后,对基金资产配置做出
	合适调整。
	2、股票投资策略
	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。本基金股票投资主要策略为标的指数投资策略,通过复制目标股票指
	数作为基本投资组合,然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因
投资策略	素,找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子,并根据因子对应的股
	票权重调整基本投资组合,最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关
	优化,力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。
	3、债券投资策略
	出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量,本基金适时对债券进行
	投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动
	情况,采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅
	度,确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率,确定债券资产配置。
	4、股指期货投资策略
	本基金可投资股指期货。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期
	保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用

	股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差, 达到有效跟踪标的指数的目的。				
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	
	姓名	赵璧	郭明	
信息披露负责人	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

基金级别	中金中证 500A	中金中证 500C	
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021	报告期(2021年1月1日 -	
	年 6 月 30 日)	2021年6月30日)	
本期已实现收益	20, 145, 266. 80	13, 253, 215. 47	
本期利润	21, 241, 309. 92	11, 726, 362. 06	
加权平均基金份额本期利润	0. 2161	0. 1706	
本期加权平均净值利润率	13. 44%	10. 69%	
本期基金份额净值增长率	12. 03%	11.82%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年	年6月30日)	
期末可供分配利润	87, 217, 392. 37	57, 350, 029. 77	
期末可供分配基金份额利润	0. 7149	0. 7075	
期末基金资产净值	209, 210, 507. 60	138, 415, 101. 53	
期末基金份额净值	1. 7149	1. 7075	
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年	年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	71. 49%	58. 15%	

- 注: 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
- 2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;
- 3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数;
- 4、本基金合同生效日为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。

### 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金中证 500A

阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	1)-3	2-4
过去一个月	1. 98%	0. 81%	1. 12%	0. 69%	0.86%	0. 12%
过去三个月	9.86%	0. 68%	8. 41%	0. 65%	1.45%	0. 03%
过去六个月	12.03%	1. 02%	6. 61%	0. 94%	5. 42%	0. 08%
过去一年	33. 85%	1. 20%	15. 35%	1. 19%	18. 50%	0. 01%
过去三年	76. 54%	1. 35%	29. 32%	1. 40%	47. 22%	-0. 05%

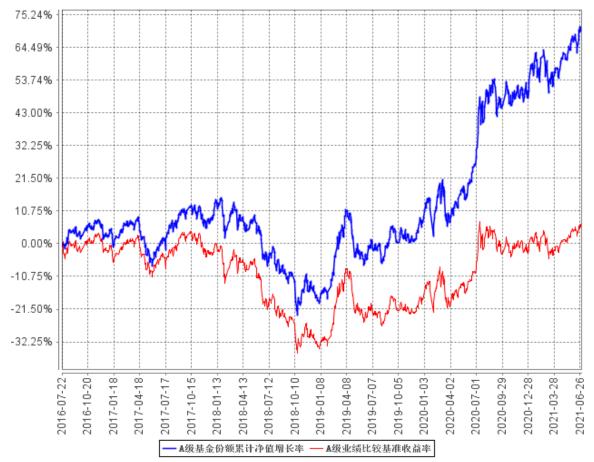
自基金合同						
生效起至今	71. 49%	1. 23%	6. 02%	1. 27%	65. 47%	-0. 04%

中金中证 500C

阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	1)-3)	2-4
过去一个月	1. 95%	0.81%	1. 12%	0. 69%	0.83%	0. 12%
过去三个月	9. 76%	0. 68%	8. 41%	0. 65%	1.35%	0.03%
过去六个月	11.82%	1. 02%	6. 61%	0. 94%	5. 21%	0.08%
过去一年	33. 33%	1. 20%	15. 35%	1. 19%	17. 98%	0.01%
过去三年	74. 09%	1. 35%	29. 32%	1. 40%	44.77%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	58. 15%	1. 26%	2. 55%	1. 29%	55. 60%	-0. 03%

# 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



### § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司(简称"中金基金"、"公司")成立于 2014 年 2 月,由中国国际金融股份有限公司(简称"中金公司")作为全资股东,是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司,注册资本 5 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 2021 年 6 月 30 日,公司共管理 37 只公募基金,证券投资基金管理规模 680.27 亿元。

### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	III 夕	任本基金的基金组	<b>全理(助理)期限</b>	证券从	说明
姓名	职务	任职日期	离任日期	业年限	
魏字	本基金基金	2017年3月28日		10年	魏字先生,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 指数部基金经理。
耿帅军	本基金经理	2020年10月29日		10年	耿帅军先生,理学硕士。 历任国泰君安证券股份有 限公司研究所金融工程分 析师,中信证券股份有限 公司研究部副总裁、金融 工程分析师,中国国际金 融股份有限公司研究部执 行总经理、金融工程分析 师。现任中金基金管理有 限公司量化指数部基金经 理。

- 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《证券业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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期,本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内,本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在中证 500 指数成分股内,建立多因子模型构建超额收益策略信号,利用信号组合模型生成策略,并最终通过组合优化器构建组合,力求在风险可控的情况下获取超额收益。利用股票的底仓市值结合基金经理的判断参与新股的网下发行,力争获取新股申购收益。

#### 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 1.7149 元,本报告期基金份额净值增长率为 12.03%;截至本报告期末中金中证 500C 基金份额净值为 1.7075 元,本报告期基金份额净值增长率为 11.82%;同期业绩比较基准收益率为 6.61%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年宏观经济运行和资本市场表现,伴随主要经济体短期增长高点在上半年的接连确 第 12 页 共 76 页 认,全球资本市场关注点逐渐经历了从高度关注通胀到更加关注增长可持续性的转变;在此期间,周期/防御、价值/成长、大/小市值风格的阶段性表现差异明显。 A股市场在经历春节前快速上涨和春节后明显调整的指数级别行情后,逐渐进入指数震荡、结构分化的行情阶段,不同风格、不同行业之间表现差异较大。整个上半年,沪深 300 指数上涨 0.24%,中证 500 指数上涨 6.93%。

展望下半年,为实现"宏观政策跨周期调节,保持经济运行在合理区间"等政策目标,国内宏观政策或将呈现"松货币、宽财政、紧信用"的组合。货币政策料将整体稳健,以保持流动性合理充裕,助力中小企业和困难行业持续恢复;财政及准财政政策有望发挥更积极高效的作用;信用条件在高基数背景下或将继续收敛。这一宏观背景下,市场对无风险收益率超预期上行的担忧或将得到明显缓解,市场整体风险偏好水平则有望保持稳定。行业景气程度较高、产业前景相对明确、估值和业绩匹配度好、具有中长期成长潜力的公司或更具配置价值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《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历。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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体:中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日: 2021年6月30日

		, No. 1	<b>丰</b> 医: 八〇四元
资 产	附注号	本期末	上年度末
	, <b>.</b>	2021年6月30日	2020年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	5, 513, 413. 53	3, 771, 581. 11
结算备付金		4, 991, 331. 07	4, 845, 719. 85
存出保证金		120, 569. 42	105, 644. 12
交易性金融资产	6.4.7.2	342, 762, 283. 49	225, 864, 333. 76
其中: 股票投资		325, 652, 533. 49	213, 271, 593. 76
基金投资		-	
债券投资		17, 109, 750. 00	12, 592, 740. 00
资产支持证券投资		-	_
贵金属投资		-	_
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1, 348, 791. 58	4, 152, 780. 53
应收利息	6.4.7.5	322, 353. 83	219, 773. 23
应收股利		-	-
应收申购款		1, 261, 060. 47	413, 065. 13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		356, 319, 803. 39	239, 372, 897. 73
At Att of the Att and Att and Att	W(1.55), ET	本期末	上年度末
负债和所有者权益	附注号	2021年6月30日	2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	_
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3, 000, 000. 00	6, 000, 000. 00
应付证券清算款		2, 778, 749. 54	3, 005, 746. 40
应付赎回款		667, 736. 21	928, 091. 75
应付管理人报酬		137, 831. 86	98, 341. 06
应付托管费		41, 349. 56	29, 502. 31
应付销售服务费		43, 186. 25	38, 424. 52
应付交易费用	6.4.7.7	1, 921, 672. 15	1, 693, 108. 47
应交税费		-	0.29
- · · · - ·	1		

应付利息		_	-2, 345. 27
			2, 343. 21
应付利润		1	1
递延所得税负债		l	I
其他负债	6.4.7.8	103, 668. 69	130, 000. 00
负债合计		8, 694, 194. 26	11, 920, 869. 53
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	203, 058, 186. 99	148, 763, 227. 96
未分配利润	6.4.7.10	144, 567, 422. 14	78, 688, 800. 24
所有者权益合计		347, 625, 609. 13	227, 452, 028. 20
负债和所有者权益总计		356, 319, 803. 39	239, 372, 897. 73

注:报告截止日 2021 年 6 月 30 日,中金中证 500A 基金份额净值 1.7149 元,基金份额总额 121,993,115.23 份;中金中证 500C 基金份额净值 1.7075 元,基金份额总额 81,065,071.76 份。中金中证 500 份额总额合计为 203,058,186.99 份。

### 6.2 利润表

会计主体:中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期: 2021年1月1日至2021年6月30日

	附注号	本期	上年度可比期间
项 目		2021年1月1日至	2020年1月1日至2020
		2021年6月30日	年 6 月 30 日
一、收入		40, 142, 228. 29	21, 591, 364. 19
1.利息收入		210, 391. 70	84, 525. 03
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	41, 912. 86	24, 016. 00
债券利息收入		168, 478. 84	60, 509. 03
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)		40, 291, 879. 58	17, 851, 347. 41
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	38, 231, 372. 06	16, 897, 922. 70
基金投资收益		_	_
债券投资收益	6.4.7.13	-26, 707. 58	43, 240. 61
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	_
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	_
衍生工具收益	6.4.7.15	-	_
股利收益	6.4.7.16	2, 087, 215. 10	910, 184. 10
3.公允价值变动收益(损失以	6.4.7.17	-430, 810. 29	3, 394, 856. 02
"-"号填列)		-450, 610. 29	3, 394, 630. 02
4.汇兑收益(损失以"-"号填		_	_
列)			

5.其他收入(损失以"-"号填 列)	6.4.7.18	70, 767. 30	260, 635. 73
减:二、费用		7, 174, 556. 31	2, 512, 589. 39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	661, 541. 68	275, 027. 90
2. 托管费	6.4.10.2.2	198, 462. 48	82, 508. 35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	216, 881. 17	56, 806. 30
4. 交易费用	6.4.7.19	5, 899, 039. 74	1, 997, 534. 53
5. 利息支出		82, 957. 20	18, 894. 39
其中: 卖出回购金融资产支出		82, 957. 20	18, 894. 39
6. 税金及附加			0.11
7. 其他费用	6.4.7.20	115, 674. 04	81, 817. 81
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		32, 967, 671. 98	19, 078, 774. 80
减: 所得税费用			
四、净利润(净亏损以"-"号 填列)		32, 967, 671. 98	19, 078, 774. 80

### 6.3 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: 2021年1月1日至2021年6月30日

	2021年1	本期 2021年1月1日至 2021年6月30日			
项目	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)	148, 763, 227. 96	78, 688, 800. 24	227, 452, 028. 20		
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	32, 967, 671. 98	32, 967, 671. 98		
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)	54, 294, 959. 03	32, 910, 949. 92	87, 205, 908. 95		
其中: 1.基金申购款	152, 198, 525. 28	90, 630, 116. 02	242, 828, 641. 30		
2. 基金赎回款	-97, 903, 566. 25	-57, 719, 166. 10	-155, 622, 732. 35		
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	1	-			

少以"-"号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	203, 058, 186. 99	144, 567, 422. 14	347, 625, 609. 13
		上年度可比期间	
	2020年1	月1日至2020年6月3	0 日
项目	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)	I	19, 078, 774. 80	19, 078, 774. 80
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)	-8, 893, 019. 72	-2, 308, 429. 06	-11, 201, 448. 78
其中: 1.基金申购款	98, 088, 017. 79	13, 116, 014. 55	111, 204, 032. 34
2. 基金赎回款	-106, 981, 037. 51	-15, 424, 443. 61	-122, 405, 481. 12
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)	91, 073, 368. 83	25, 600, 956. 16	116, 674, 324. 99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

孙菁		白娜
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》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。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)、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。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况、2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 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 [2018]1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]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 [2017]56号《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对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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

福日	本期末
项目	2021年6月30日

活期存款	5, 513, 413. 53
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:	5, 513, 413. 53

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

		本期末				
	项目	2021 年 6 月 30 日				
		成本	公允价值	公允价值变动		
股票		320, 586, 205. 36	325, 652, 533. 49	5, 066, 328. 13		
贵金属	投资-金交所					
黄金合约		_				
债券	交易所市场	17, 103, 670. 00	17, 109, 750. 00	6, 080. 00		
灰分	银行间市场		_	_		
	合计	17, 103, 670. 00	17, 109, 750. 00	6, 080. 00		
资产支:	持证券		-	-		
基金		ı	_	-		
其他		-	-	-		
合计		337, 689, 875. 36	342, 762, 283. 49	5, 072, 408. 13		

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

项目 本期末
--------

	2021年6月30日
应收活期存款利息	454. 40
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, 081. 30
应收债券利息	319, 763. 83
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	54. 30
合计	322, 353. 83

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1, 921, 672. 15
银行间市场应付交易费用	_
合计	1, 921, 672. 15

### 6.4.7.8 其他负债

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	_
应付赎回费	_
应付证券出借违约金	_
预提费用	91, 739. 85
指数使用费	11, 928. 84
应付信息披露费	-
其他	-
合计	103, 668. 69

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

中金中证 500A		
	本期	
项目	2021年1月1日	日至 2021 年 6 月 30 日
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	77, 997, 814. 79	77, 997, 814. 79
本期申购	89, 155, 751. 52	89, 155, 751. 52
本期赎回(以"-"号填列)	-45, 160, 451. 08	-45, 160, 451. 08
- 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	121, 993, 115. 23	121, 993, 115. 23

金额单位:人民币元

中金中证 500C		
	本期	
项目	2021年1月1日	日至 2021 年 6 月 30 日
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	70, 765, 413. 17	70, 765, 413. 17
本期申购	63, 042, 773. 76	63, 042, 773. 76
本期赎回(以"-"号填列)	-52, 743, 115. 17	-52, 743, 115. 17
- 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	81, 065, 071. 76	81, 065, 071. 76

注: 申购含红利再投、转换入份额, 赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 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	42, 098, 569. 86	-705, 831. 26	41, 392, 738. 60
本期利润	20, 145, 266. 80	1, 096, 043. 12	21, 241, 309. 92
本期基金份额交易 产生的变动数	27, 444, 790. 36	-2, 861, 446. 51	24, 583, 343. 85
其中:基金申购款	55, 761, 599. 39	-3, 821, 584. 38	51, 940, 015. 01
基金赎回款	-28, 316, 809. 03	960, 137. 87	-27, 356, 671. 16

本期已分配利润	_	-	-
本期末	89, 688, 627. 02	-2, 471, 234. 65	87, 217, 392. 37

### 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	37, 971, 958. 50	-675, 896. 86	37, 296, 061. 64
本期利润	13, 253, 215. 47	-1, 526, 853. 41	11, 726, 362. 06
本期基金份额交易 产生的变动数	7, 806, 828. 35	520, 777. 72	8, 327, 606. 07
其中:基金申购款	40, 189, 961. 21	-1, 499, 860. 20	38, 690, 101. 01
基金赎回款	-32, 383, 132. 86	2, 020, 637. 92	-30, 362, 494. 94
本期已分配利润		-	
本期末	59, 032, 002. 32	-1, 681, 972. 55	57, 350, 029. 77

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	10, 047. 60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	30, 899. 99
其他	965. 27
合计	41, 912. 86

### 6.4.7.12 股票投资收益

### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	2, 206, 170, 597. 03
减: 卖出股票成本总额	2, 167, 939, 224. 97
买卖股票差价收入	38, 231, 372. 06

### 6.4.7.13 债券投资收益

### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位:人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30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	-26, 707. 58
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	-26, 707. 58

### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交 总额	7, 775, 998. 51	
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付) 成本总额	7, 633, 110. 00	
减: 应收利息总额	169, 596. 09	
买卖债券差价收入	-26, 707. 58	

### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无赎回差价收入。

### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无申购差价收入。

### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

### 6.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
股票投资产生的股利收益	2, 087, 215. 10		
其中:证券出借权益补偿收入	-		
基金投资产生的股利收益	_		
合计	2, 087, 215. 10		

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期		
7.5.6.14	2021年1月1日至2021年6月30日		
1. 交易性金融资产	-430, 810. 29		
——股票投资	-471, 560. 29		
——债券投资	40, 750. 00		
——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	-430, 810. 29		

### 6.4.7.18 其他收入

	本期		
项目	2021年1月1日至2021年6月30日		

基金赎回费收入	70, 594. 16
003016	75. 77
003578	97. 37
基金转换费收入-003016	_
合计	70, 767. 30

### 6.4.7.19 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	5, 899, 039. 74
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	_
合计	5, 899, 039. 74

### 6.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
审计费用	32, 232. 48		
信息披露费	59, 507. 37		
证券出借违约金	_		
指数使用费	21, 928. 84		
汇划手续费	2, 005. 35		
其他	_		
合计	115, 674. 04		

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系		
中金基金管理有限公司("中金基金")	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构、基		
小亚圣亚自垤有限公司( 小亚圣亚 /	金销售机构		
中国工商银行股份有限公司("工商银	   基金托管人		
行")	<b>本立</b> 九昌八		
中国国际金融股份有限公司("中金公	   基金管理人的股东、基金销售机构		
司")	<del>至</del> 並自垤八的放示、至並拥 告机构		
中国中金财富证券有限公司("中金财富			
证券"原"中国中投证券有限责任公	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构		
司")			

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

本其		本期	上年度可比期间	
关 联方名称	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
大妖刀石柳	成交金额	占当期股票	<b>武六人</b> 痴	占当期股票
	风义並领	成交总额的比例	成交金额	成交总额的比例
中金公司	355, 690, 001. 60	7. 94%	150, 194, 064. 56	10. 02%
中金财富证券	247, 035, 470. 90	5. 51%	424, 484, 684. 51	28. 32%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

	本期		上年度可比期间	
关联方名称	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
大联刀石柳	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	1, 003, 900. 00	5. 09%	11, 500. 00	0. 15%
中金财富证券	_	-	1, 945, 393. 38	24. 82%

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
回购成交金额		占当期债券回购 成交总额的比例	回烟成交全额	占当期债券回购 成交总额的比例
中金公司	136, 300, 000. 00	16. 37%	20, 700, 000. 00	11. 53%
中金财富证券	24, 000, 000. 00	2.88%	63, 200, 000. 00	35. 19%

### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

	本期			
关联方名称	2021年1月1日至2021年6月30日			
大联刀石柳	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金
	<b>一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一</b>	量的比例		总额的比例
中金公司	260, 118. 88	7. 94%	189, 321. 81	9.85%
中金财富证券	180, 657. 80	5. 51%	180, 657. 80	9. 40%
上年度可比期间				
<b>光</b>	2020年1月1日至2020年6月30日			
关联方名称 -	业期佣人	占当期佣金	用金	占期末应付佣金
	当期佣金	总量的比例	期末应付佣金余额	总额的比例
中金公司	109, 837. 94	10.02%	_	_
中金财富证券	310, 427. 58	28. 32%	_	_

### 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

	本期	上年度可比期间		
项目	2021年1月1日至2021年6	2020年1月1日至2020年6月30		
	月 30 日	日		
当期发生的基金应支付	661, 541. 68	275, 027. 90		
的管理费	001, 341. 00	215, 021. 90		
其中:支付销售机构的客	161 046 02	75 670 00		
户维护费	161, 846. 83	75, 670. 92		

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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

	本期	上年度可比期间		
项目	2021年1月1日至2021年6	2020年1月1日至2020年6月30		
	月 30 日	日		
当期发生的基金应支付	100 469 40	92 509 25		
的托管费	198, 462. 48	82, 508. 35		

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

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

	本期						
<b>共和以住职</b> 夕弗的	2021年1月1日至2021年6月30日						
获得销售服务费的	当	期发生的基金应支付的	的销售服务费				
各关联方名称	中金中证 500A	中金中证 500C	合计				
	1 312 1 ML OOOM	1 312 1 ML 0000	□ V)				
中金基金	_	112, 095. 10	112, 095. 10				
中金公司	_	481.80	481.80				
中金财富证券	_	4, 063. 91	4, 063. 91				
合计	_	116, 640. 81	116, 640. 81				
	上年度可比期间						
	2020年1月1日至2020年6月30日						
获得销售服务费的	当期发生的基金应支付的销售服务费						
各关联方名称							
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计				
中金基金	_	4, 247. 31	4, 247. 31				
中金公司	_	290. 44	290. 44				
中金财富证券	_	4, 664. 50	4, 664. 50				
合计	_	9, 202. 25	9, 202. 25				

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

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期					
	2021年1月1日至2021年6月30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	10, 000, 000. 00	-				
额						
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		_				
报告期间因拆分变动份额		_				
减:报告期间赎回/卖出总份						
额						
报告期末持有的基金份额	1, 014, 198. 78	_				
报告期末持有的基金份额	0, 8314%					
占基金总份额比例	0.0314%					

项目	上年度可比期间				
	2020年1月1日至2020年6月30日				
	中金中证 500A	中金中证 500C			
基金合同生效日(2016年7	10,000,000,00				
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	_	_			
报告期间因拆分变动份额		_			
减:报告期间赎回/卖出总份	1	_			

额		
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	1, 4900%	
占基金总份额比例	1.4900%	_

- 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。

### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

* 14 <del></del>	本期	1	上年度可比期间		
关联方	2021年1月1日至2	2021年6月30日	2020年1月1日至	2020年6月30日	
名称	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入	
工商银行	5, 513, 413. 53	10, 047. 60	3, 147, 982. 89	13, 115. 44	

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

### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位: 人民币元

<u> </u>					
			本期		
		2021年1月1日	日至 2021 年	6月30日	
<b>子</b> 段士 夕 秒	江半母司	   证券名称	<b>坐</b> /5/大士	基金在承销	肖期内买入
关联方名称	证券代码	近分石州	发行方式	数量(单位: 份)	总金额
中金公司	003033	征和工业	网下	301	7, 007. 28
中金公司	688696	极米科技	网下	537	71, 813. 01
中金公司	688316	青云科技	网下	984	62, 680. 80
中金公司	605090	九丰能源	网下	1,090	37, 681. 30
中金公司	601156	东航物流	网下	2, 090	32, 959. 30
中金公司	688425	铁建重工	网下	37, 802 108, 491	
		上年	度可比期间		
		2020年1月1日	日至 2020 年	6月30日	
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基	金在承销期内买入
大联刀石物	<b>业分</b> 代码	以		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	网下 1,716 6,	
中金公司	688505	复旦张江	网下	5, 732	51, 301. 40
中金公司	688520	神州细胞	网下	3, 019	77, 407. 16

### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

### 6.4.12 期末 (2021年6月30日) 本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1	5.4.12.1.1 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
688087	英科 再生	2021 年 6月 30 日		新股未 上市	21. 96	21. 96	2, 469	54, 219. 24	54, 219. 24	_
301021	英诺激光	2021年 6月28 日		新股未 上市	9. 46	9. 46	2, 899	27, 424. 54	27, 424. 54	_
688226	威腾 电气	2021 年 6月28 日		新股未 上市	6. 42	6. 42	2, 693	17, 289. 06	17, 289. 06	_
605287	德才 股份	2021 年 6月 28 日		新股未 上市	31. 56	31. 56	349	11, 014. 44	11, 014. 44	_
605162	新中港	2021 年 6月29 日		新股未 上市	6. 07	6. 07	1, 377	8, 358. 39	8, 358. 39	_
688499	利元 亨	2021年 6月23 日		新股未 上市	38.85	38. 85	2, 149	83, 488. 65	83, 488. 65	_
688665		2021 年 2月2日	2021 年8月 9日	新股流 通受限	29. 53	129. 46	1, 687	49, 817. 11	218, 399. 02	_
688677	海泰新光	2021年 2月18 日	2021 年8月 26日	新股流 通受限	35. 76	103. 23	1, 547	55, 320. 72	159, 696. 81	_
688601	力芯微	2021 年 6月 18 日		新股流 通受限	36. 48	133. 69	1, 174	42, 827. 52	156, 952. 06	_
688345	博力	2021年	2021	新股流	25. 91	55 <b>.</b> 53	2, 332	60, 422. 12	129, 495. 96	_

	威	6月3日	年 12 月 13 日	通受限						
688661	和林微纳	2021年 3月19 日	2021 年9月 29日	新股流 通受限	17. 71	84. 01	1, 452	25, 714. 92	121, 982. 52	_
688625	呈和 科技	2021 年 5月31 日	2021 年 12 月 7 日	新股流 通受限	16. 48	42. 63	2, 672	44, 034. 56	113, 907. 36	_
688656	浩欧 博	2021 年 1月6日	2021 年7月 13日	新股流 通受限	35. 26	72. 60	1, 288	45, 414. 88	93, 508. 80	_
688628	优利 德	2021 年 1月22 日	2021 年8月 2日	新股流 通受限	19. 11	32. 62	2, 789	53, 297. 79	90, 977. 18	_
688468	科美诊断	2021 年 3月31 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	7. 15	16. 50	3, 919	28, 020. 85	64, 663. 50	_
688328	深科达	2021 年 3月1日	2021 年9月 9日	新股流 通受限	16. 49	37. 79	1, 499	24, 718. 51	56, 647. 21	_
688260	昀冢 科技	2021年 3月25 日	2021 年 10 月 6 日	新股流 通受限	9. 63	16. 41	2, 990	28, 793. 70	49, 065. 90	_
300957	贝泰妮	2021 年 3月18 日		新股流通受限	47. 33	251. 96	155	7, 336. 15	39, 053. 80	_
688681		2021 年 6月4日		新股流通受限	9. 56	14. 54	1, 899	18, 154. 44	27, 611. 46	_
300973		2021 年 4月8日		新股流 通受限	28. 28	115. 71	222	6, 278. 16	25, 687. 62	_
301009		2021 年 6月8日		新股流 通受限	12. 54	27. 89	801	10, 044. 54	22, 339. 89	_
300953	震裕 科技	2021 年 3月11 日	2021 年9月 20日	新股流通受限	28. 77	99. 85	209	6, 012. 93	20, 868. 65	_

301015	百洋 医药	2021 年 6月22 日	2021 年 12 月 30 日		7. 64	38. 83	462	3, 529. 68	17, 939. 46	_
300981	中红 医疗	2021 年 4月19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流 通受限	48. 59	90. 39	193	9, 377. 87	17, 445. 27	-
300982	苏文 电能	2021 年 4月19 日		新股流 通受限	15. 83	45. 29	317	5, 018. 11	14, 356. 93	
300940	南极 光	2021 年 1月27 日		新股流 通受限	12. 76	43. 38	307	3, 917. 32	13, 317. 66	1
300614	百川畅银	2021 年 5月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9. 19	40. 38	329	3, 023. 51	13, 285. 02	_
300937	药易 购	2021年 1月20 日		新股流 通受限	12. 25	53. 71	244	2, 989. 00	13, 105. 24	-
300968		2021 年 4月6日			6. 87	12. 07	1, 069	7, 344. 03	12, 902. 83	_
300942	易瑞 生物	2021 年 2月2日	2021 年8月 9日	新股流 通受限	5. 31	28. 52	443	2, 352. 33	12, 634. 36	_
300932	三友 联众	2021 年 1月15 日	2021 年7月 22日	新股流 通受限	24. 69	31. 71	394	9, 727. 86	12, 493. 74	_
300997	欢乐 家	2021 年 5月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股流 通受限	4. 94	13. 05	928	4, 584. 32	12, 110. 40	-
301002	崧盛 股份	2021年 5月27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	18. 71	57. 62	201	3, 760. 71	11, 581. 62	-
300955	嘉亨 家化	2021 年 3月16 日		新股流 通受限	16. 53	46. 07	232	3, 834. 96	10, 688. 24	-
300996	普联 软件	2021年 5月26	2021 年 12	新股流 通受限	20. 81	42. 23	241	5, 015. 21	10, 177. 43	_

		日	月3日							
300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021	新股流通受限	12. 85	25. 80	371	4, 767. 35	9, 571. 80	_
300962	中金辐照	2021年 3月29 日	2021 年 10 月 11 日	新股流 通受限	3. 40	16. 37	576	1, 958. 40	9, 429. 12	_
300952		2021 年 3月3日	2021 年9月 13日	新股流 通受限	11. 72	27. 08	340	3, 984. 80	9, 207. 20	l
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流 通受限	13. 75	32. 98	275	3, 781. 25	9, 069. 50	l
300966	共同 药业	2021 年 3月31 日	2021 年 10 月 11 日	新股流 通受限	8. 24	31. 54	286	2, 356. 64	9, 020. 44	l
300945	曼卡 龙	2021 年 2月3日	2021 年8月 10日	新股流通受限	4. 56	18. 88	474	2, 161. 44	8, 949. 12	
300948	冠中 生态	2021 年 2月18 日		新股流 通受限	13. 00	27. 42	324	2, 808. 00	8, 884. 08	数量 包含 送股
300931	通用电梯	2021 年 1月13 日		新股流通受限	4. 31	13. 11	672	2, 896. 32	8, 809. 92	_
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日		新股流 通受限	8. 48	22. 07	394	3, 341. 12	8, 695. 58	_
300950	德固 特	2021 年 2月24 日		新股流 通受限	8. 41	39. 13	219	1, 841. 79	8, 569. 47	_
300986	志特 新材	2021 年 4月21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流 通受限	14. 79	30. 57	264	3, 904. 56	8, 070. 48	-
300987	川网传媒	2021 年 4月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股流 通受限	6. 79	26. 81	301	2, 043. 79	8, 069. 81	-
300978	东箭 科技	2021 年 4月15		新股流 通受限	8. 42	13. 60	593	4, 993. 06	8, 064. 80	_

		日	月 26							
			日							
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021	新股流通受限	10. 76	22. 20	359	3, 862. 84	7, 969. 80	_
300930	屹通 新材	2021 年 1月13 日		新股流通受限	13. 11	24. 48	322	4, 221. 42	7, 882. 56	-
300985	致远 新能	2021 年 4月21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流 通受限	24. 90	24. 81	283	7, 046. 70	7, 021. 23	-
300927	江天 化学	2020年 12月29 日		新股流通受限	13. 39	30. 10	217	2, 905. 63	6, 531. 70	_
300975	商络 电子	2021 年 4月14 日		新股流通受限	5. 48	13. 03	492	2, 696. 16	6, 410. 76	_
300963	中洲特材	2021 年 3月30 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	12. 13	22. 49	283	3, 432. 79	6, 364. 67	_
300933	中辰股份	2021年 1月15 日		新股流 通受限	3. 37	10. 44	572	1, 927. 64	5, 971. 68	-
301011		2021 年 6月9日			14. 20	33. 84	175	2, 485. 00	5, 922. 00	l
300943		2021 年 2月3日	2021 年8月 10日	新股流 通受限	9. 79	23. 01	255	2, 496. 45	5, 867. 55	-
300967		2021 年 4月2日			4. 54	11. 54	507	2, 301. 78	5, 850. 78	_
300972		2021 年 4月8日			7. 19	12. 65	430	3, 091. 70	5, 439. 50	-
300929		2021 年 1月12		新股流 通受限	13. 87	29. 55	183	2, 538. 21	5, 407. 65	_

		日	20 日							
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年9月 29日	新股流通受限	12. 08	23. 06	234	2, 826. 72	5, 396. 04	_
300995	奇德 新材	2021 年 5月17 日	牛 11	新股流通受限	1/1 7/2	23. 32	191	2, 811. 52	4, 454. 12	
301007	1	2021 年 6月4日	-		5. 29	14. 44	303	1, 602. 87	4, 375. 32	l
300998	宁波 方正	2021 年 5月25 日		新股流 通受限	6. 02	21. 32	201	1, 210. 02	4, 285. 32	_
301012	扬电 科技	2021 年 6月15 日	牛 12	新股流通受限	8. 05	24. 26	170	1, 368. 50	4, 124. 20	
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	华Ⅱ	新股流通受限	9. 36	20. 32	200	1, 872. 00	4, 064. 00	_
301010		2021 年 6月9日			7. 83	17. 61	218	1, 706. 94	3, 838. 98	_
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年7月 2日	新股流通受限	24. 60	163. 00	235	5, 781. 00	38, 305. 00	_

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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型股票基金,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。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约,或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超

过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外,本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库,对发行人及债券投资进行内部评级,对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度,以控制可能出现的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。(上年度末:同)

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。(上年度末:同)

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。(上年度末:同)

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资(上年度末:同)。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。(上年度末:同)

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。(上年度末:同)

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面:一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期

日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,以备支付基金份额持有人的赎回款项,可以满足短期少量赎回的流动性需要;其次,基于分散投资的原则,本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%,在个券方面无高集中度的特征;第三,本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所,主要投资对象为具有良好流动性的金融工具,且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%,正常市场环境下,大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5, 513, 413. 53	_	_	_	5, 513, 413. 53
结算备付金	4, 625, 219. 28	_	_	366, 111. 79	4, 991, 331. 07
存出保证金	120, 569. 42	_	_	_	120, 569. 42
交易性金融资产	-	_	_	325, 652, 533. 49	325, 652, 533. 49
-股票投资					
交易性金融资产	17, 109, 750. 00	-	_	-	17, 109, 750. 00
-债券投资、资产					
支持证券					
买入返售金融资	-	_	_	-	-
产					

应收证券清算款	_	-	_	1, 348, 791. 58	1, 348, 791. 58
应收利息	_	-	-	322, 353. 83	322, 353. 83
应收股利	_	_	_	_	_
应收申购款	_	_	_	1, 261, 060. 47	1, 261, 060. 47
资产总计	27, 368, 952. 23		_	328, 950, 851. 16	356, 319, 803. 39
负债					
卖出回购金融资	3, 000, 000. 00	_	_	_	3, 000, 000. 00
产款				0 770 740 54	0 770 740 54
应付证券清算款	_			2, 778, 749. 54	
应付赎回款	_		_	667, 736. 21	667, 736. 21
应付管理人报酬	_		_	137, 831. 86	
应付托管费	_		_	41, 349. 56	
应付交易费用	_		-	1, 921, 672. 15	
应付销售服务费	_		_	43, 186. 25	43, 186. 25
应交税费	_		_	_	
应付利息	_		_	100 000 00	100 660 60
其他负债		_	-	103, 668. 69	
负债总计	3, 000, 000. 00	_	_	5, 694, 194. 26	
利率敏感度缺口	24, 368, 952. 23		-	323, 256, 656. 90	347, 625, 609. 13
上年度末	. Ant t				A 31
2020年12月31	1年以内	1-5年	5年以上	个计息 	合计
E No.					
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	_	_	_	213, 271, 593. 76	213, 271, 593. 76
-股票投资					
交易性金融资产	12, 592, 740. 00	_	-	_	12, 592, 740. 00
-债券投资、资产					
支持证券					
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	
负债	·				
卖出回购金融资	6, 000, 000. 00	_	_	_	6, 000, 000. 00
产款					
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

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

	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原险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。						
假设	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。				
	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)					
八七	相大风险文里的文列	本期末(2021年6月30日)	上年度末 ( 2020 年 12 月 31 日 )				
分析	市场利率下降 25 个基点	7, 269. 57	7, 225. 68				
市场利率上升 25 个 基点 -7, 269. 57 -7, 225. 68							

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

# 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

	本期末 2021 年 6 月 30	日	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
项目	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	325, 652, 533. 49	93. 68	213, 271, 593. 76	93. 77	
交易性金融资产-基金投资	_	_	_	_	
交易性金融资产-贵金属投 资	_	_	_	_	
衍生金融资产一权证投资	_	_	_	_	
其他	_	_	_	_	
合计	325, 652, 533. 49	93. 68	213, 271, 593. 76	93. 77	

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变				
		对资产负债表品	日基金资产净值的		
	   相关风险变量的变动	影响金额(单位:人民币元)			
八七	相大风险文里的文约	本期末 ( 2021 年 6 月	上年度末( 2020 年 12 月		
分析		30 日 )	31 日 )		
	业绩比较基准上升 5%	17, 054, 831. 64	10, 564, 548. 55		
	业绩比较基准下降 5%	-17, 054, 831. 64	-10, 564, 548. 55		

### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

# § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	325, 652, 533. 49	91. 39
	其中: 股票	325, 652, 533. 49	91. 39
2	基金投资	_	_
3	固定收益投资	17, 109, 750. 00	4.80
	其中:债券	17, 109, 750. 00	4.80
	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	10, 504, 744. 60	2. 95
8	其他各项资产	3, 052, 775. 30	0.86
9	合计	356, 319, 803. 39	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7, 628, 260. 00	2. 19
В	采矿业	9, 012, 355. 00	2. 59
С	制造业	211, 182, 424. 71	60.75
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	5, 360, 052. 94	1. 54
Е	建筑业	6, 197, 933. 00	1.78
F	批发和零售业	4, 849, 246. 00	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	3, 292, 280. 00	0.95
Н	住宿和餐饮业	4, 373, 760. 00	1. 26
Ι	信息传输、软件和信息技术服 务业	14, 834, 983. 15	4. 27
Ј	金融业	15, 926, 099. 00	4. 58
K	房地产业	5, 019, 213. 00	1.44
L	租赁和商务服务业	3, 300, 822. 00	0. 95

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3, 590, 088. 90	1.03
0	居民服务、修理和其他服务业	-	_
P	教育	2, 638, 292. 00	0.76
Q	卫生和社会工作	4, 006, 180. 00	1. 15
R	文化、体育和娱乐业	3, 739, 315. 50	1.08
S	综合		
	合计	304, 951, 305. 20	87. 72

### 7.2.2 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 (元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11, 290. 28	0.00
В	采矿业	-	_
C	制造业	14, 301, 221. 60	4. 11
D	电力、热力、燃气及水生产	13, 020. 39	0.00
	和供应业	·	
Е	建筑业	25, 371. 37	0. 01
F	批发和零售业	46, 404. 58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	_	-
Н	住宿和餐饮业	_	_
I	信息传输、软件和信息技术	1, 672, 601. 64	0. 48
1	服务业	1, 012, 001. 01	0. 10
J	金融业	3, 075, 182. 10	0.88
K	房地产业	_	_
L	租赁和商务服务业	941.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	1, 518, 923. 00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理 业	36, 272. 33	0. 01
0	居民服务、修理和其他服务		
0	业	_	_
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	
R	文化、体育和娱乐业	_	
S	综合	_	-
	合计	20, 701, 228. 29	5. 96

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

# 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

# 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000799	酒鬼酒	24, 700	6, 313, 320. 00	1. 82
2	002074	国轩高科	130, 300	5, 675, 868. 00	1. 63
3	002340	格林美	594, 300	5, 556, 705. 00	1.60
4	600089	特变电工	423, 113	5, 437, 002. 05	1. 56
5	600884	杉杉股份	209, 000	4, 873, 880. 00	1. 40
6	601636	旗滨集团	260, 500	4, 834, 880. 00	1. 39
7	300037	新宙邦	47, 700	4, 774, 770. 00	1. 37
8	002648	卫星石化	120, 040	4, 704, 367. 60	1. 35
9	002353	杰瑞股份	103, 900	4, 644, 330. 00	1. 34
10	300146	汤臣倍健	140, 800	4, 632, 320. 00	1. 33
11	002625	光启技术	221, 800	4, 615, 658. 00	1. 33
12	600862	中航高科	142, 300	4, 379, 994. 00	1. 26
13	600754	锦江酒店	76, 800	4, 373, 760. 00	1. 26
14	600392	盛和资源	251, 800	4, 371, 248. 00	1. 26
15	603444	吉比特	8, 241	4, 367, 730. 00	1. 26
16	002180	纳思达	134, 700	4, 337, 340. 00	1. 25
17	600549	厦门钨业	208, 200	4, 336, 806. 00	1. 25
18	300088	长信科技	522, 600	4, 316, 676. 00	1. 24
19	002080	中材科技	162, 400	4, 250, 008. 00	1. 22
20	000998	隆平高科	260, 300	4, 175, 212. 00	1. 20
21	601717	郑煤机	358, 100	4, 164, 703. 00	1. 20
22	601128	常熟银行	668, 600	4, 145, 320. 00	1. 19
23	002013	中航机电	411, 300	4, 141, 791. 00	1. 19
24	600068	葛洲坝	549, 200	4, 113, 508. 00	1. 18
25	002511	中顺洁柔	149, 100	4, 107, 705. 00	1. 18
26	600667	太极实业	448, 300	4, 079, 530. 00	1. 17
27	000825	太钢不锈	544, 600	4, 079, 054. 00	1. 17
28	600188	兖州煤业	263, 600	4, 048, 896. 00	1. 16
29	600038	中直股份	76, 300	4, 024, 062. 00	1. 16
30	300244	迪安诊断	104, 600	4, 006, 180. 00	1. 15
31	600529	山东药玻	118, 000	4, 006, 100. 00	1. 15
32	000012	南玻A	386, 900	3, 961, 856. 00	1. 14
33	600580	卧龙电驱	292, 600	3, 891, 580. 00	1. 12

34     002396     星网锐捷     174,500     3,725,575.00       35     000970     中科三环     379,800     3,627,090.00       36     000039     中集集团     199,400     3,625,092.00       37     002212     天融信     182,500     3,608,025.00       38     600875     东方电气     321,700     3,529,049.00       39     002390     信邦制药     330,200     3,460,496.00	1. 07 1. 04 1. 04 1. 02 1. 00 0. 99 0. 98
36     000039     中集集团     199,400     3,625,092.00       37     002212     天融信     182,500     3,608,025.00       38     600875     东方电气     321,700     3,529,049.00	1. 04 1. 04 1. 02 1. 00 0. 99
37     002212     天融信     182,500     3,608,025.00       38     600875     东方电气     321,700     3,529,049.00	1. 04 1. 02 1. 00 0. 99
38 600875 东方电气 321,700 3,529,049.00	1. 02 1. 00 0. 99
	1. 00 0. 99
【 39	0. 99
50 00000 jih/jihq23 000, 200 0, 100, 100, 100	
40 002299 圣农发展 144,600 3,453,048.00	0.98
41 000750 国海证券 805, 100 3, 413, 624. 00	
42 600728 佳都科技 443,000 3,282,630.00	0.94
43 002294 信立泰 96,200 3,164,980.00	0.91
44 002250	0.91
45 002557 洽洽食品 73,200 3,154,920.00	0.91
46 002368 太极股份 155,440 3,118,126.40	0.90
47 603355 莱克电气 49,200 3,061,716.00	0.88
48 000999 华润三九 112,700 3,014,725.00	0.87
49 002030 达安基因 139,700 2,967,228.00	0.85
50 002683 宏大爆破 105,500 2,929,735.00	0.84
51 601997 贵阳银行 401,900 2,877,604.00	0.83
52 002183 恰亚通 501,400 2,873,022.00	0.83
53 002078 太阳纸业 214,700 2,866,245.00	0.82
54 300207 欣旺达 88,000 2,865,280.00	0.82
55 600623 华谊集团 322,000 2,836,820.00	0.82
56 002444 巨星科技 83,100 2,832,048.00	0.81
57 002056 横店东磁 212,600 2,763,800.00	0.80
58 000967 盈峰环境 401,300 2,756,931.00	0. 79
59 000686 东北证券 323,500 2,733,575.00	0. 79
60 603377 东方时尚 246,800 2,638,292.00	0. 76
61 002925 盈趣科技 66,650 2,593,351.50	0.75
62 600755 厦门国贸 309,300 2,539,353.00	0.73
63 600707 彩虹股份 268,700 2,528,467.00	0. 73
64 600642 申能股份 397,921 2,443,234.94	0.70
65 603707 健友股份 58,500 2,442,375.00	0.70
66 600177 雅戈尔 360,700 2,377,013.00	0.68
67 600195 中牧股份 196,648 2,351,910.08	0.68
68 300072 三聚环保 401,930 2,307,078.20	0.66
69 603225 新凤鸣 105,900 2,149,770.00	0.62
70 300741 华宝股份 42,300 2,145,456.00	0.62
71 002429 兆驰股份 351,800 2,135,426.00	0.61
72 000690 宝新能源 405,400 2,071,594.00	0.60

7.0	000005	<b>→ &gt;+</b> ₹1 <b>+</b> +	100,000	0 000 047 00	0.50
73	002635	安洁科技	136, 900		0. 58
74	600120	浙江东方	453, 600		0. 56
75	000671	阳光城	361, 700	· · · ·	0. 54
76	600998	九州通	112, 600		0. 50
77	600373	中文传媒	170, 300	1, 679, 158. 00	0. 48
78	603228	景旺电子	61, 700	1, 616, 540. 00	0. 47
79	002203	海亮股份	146, 700	1, 560, 888. 00	0. 45
80	002387	维信诺	143, 700	1, 498, 791. 00	0. 43
81	601098	中南传媒	146, 600	1, 293, 012. 00	0. 37
82	603638	艾迪精密	27, 960	1, 198, 645. 20	0. 34
83	601611	中国核建	162, 400	1, 172, 528. 00	0.34
84	603786	科博达	15, 400	1, 162, 700. 00	0. 33
85	603885	吉祥航空	75, 400	1, 150, 604. 00	0. 33
86	300308	中际旭创	28, 900	1, 113, 228. 00	0. 32
87	000089	深圳机场	139, 400	1, 083, 138. 00	0.31
88	600064	南京高科	114, 500	1, 063, 705. 00	0.31
89	600787	中储股份	198, 600	1, 058, 538. 00	0.30
90	600782	新钢股份	173, 300	967, 014. 00	0. 28
91	002595	豪迈科技	34, 900	931, 830. 00	0. 27
92	000090	天健集团	164, 900	911, 897. 00	0. 26
93	002233	塔牌集团	86, 236	886, 506. 08	0. 26
94	600348	华阳股份	118, 600	880, 012. 00	0. 25
95	600737	中粮糖业	87, 400	874, 874. 00	0. 25
96	300001	特锐德	28, 700	864, 157. 00	0. 25
97	600835	上海机电	52, 600	854, 750. 00	0. 25
98	600803	新奥股份	51, 100	843, 661. 00	0. 24
99	000959	首钢股份	147, 900	831, 198. 00	0. 24
100	600563	法拉电子	5, 000	791, 800. 00	0. 23
101	600985	淮北矿业	64, 200	783, 882. 00	0. 23
102	603712	七一二	19, 100	689, 510. 00	0. 20
103	600388	龙净环保	78, 900	672, 228. 00	0. 19
104	000402	金融街	93, 500	631, 125. 00	0. 18
105	000826	启迪环境	112, 400	601, 340. 00	0. 17
106	603708	家家悦	33, 300	578, 421. 00	0. 17
107	600376	首开股份	94, 100	526, 960. 00	0. 15
108	002797	第一创业	66, 400	474, 096. 00	0. 14
109	601928	凤凰传媒	61, 925	442, 144. 50	0. 13
110	600037	歌华有线	45, 600	438, 216. 00	
111	000061	农产品	77, 500	·	

113   600507   方大特領						
114   001914   招商税余   22,800   391,704.00   0.11     115   601168   西部市业   31,000   369,830.00   0.11     116   000717   韶何松山   77,500   355,725.00   0.10     117   002532   天山信业   41,100   344,829.00   0.10     118   600390   五矿资本   56,700   339,066.00   0.10     119   000961   中南建设   55,600   329,152.00   0.05     120   601801   皖新传媒   68,000   320,960.00   0.05     121   002266   浙富控股   46,310   231,086.90   0.07     122   60062   华河双鹤   17,300   206,043.00   0.06     123   002690   美亚光电   3,500   195,160.00   0.06     124   600266   城建发展   40,800   193,392.00   0.06     125   002408   齐翔腾达   14,700   182,574.00   0.06     126   000723   美锦能源   16,600   125,496.00   0.07     127   002223   鱼跃医疗   2,600   99,138.00   0.03     128   600498   烽火通信   4,100   76,383.00   0.02     129   002110   三纲闽光   9,200   62,008.00   0.02     130   002709   天暘材料   200   21,316.00   0.01     131   688088   虹软科技   1,300   8,075.00   0.00     133   300133   年華科技   1,900   8,075.00   0.00     134   002048   宁波华翔   100   1,950.00   0.00     135   002174   游族网络   100   1,950.00   0.00     136   000528   柳	112	300474	景嘉微	4, 040	395, 596. 80	0. 11
115   601168 西部企业   31,000   369,830.00   0.11     116   000717   韶栩松山   77,500   355,725.00   0.10     117   002532   天山铝业   41,100   344,829.00   0.10     118   600390   五ず資本   56,700   339,066.00   0.10     119   000961   中南建设   55,600   329,152.00   0.05     120   601801   蛇新传媒   68,000   320,960.00   0.05     121   002266   浙富空股   46,310   231,086.90   0.07     122   600062   华润双鹤   17,300   206,043.00   0.06     123   002690   美亚光电   3,500   195,160.00   0.06     124   600266   城建发展   40,800   193,392.00   0.06     125   002408   齐州勝达   14,700   182,574.00   0.05     126   000723   美館能源   16,600   125,496.00   0.04     127   002223   色妖疾庁   2,600   99,138.00   0.02     128   600498   烽火通信   4,100   76,383.00   0.02     129   002110   三朝岡光   9,200   62,008.00   0.02     130   002709   天賜材料   200   21,316.00   0.01     131   688088   虹软科技   173   9,644.75   0.06     133   300133   华策影視   500   2,960.00   0.06     134   002048   宁波华翔   100   1,950.00   0.06     135   002174   游族网络   100   1,717.00   0.06     136   000528   柳	113	600507	方大特钢	58, 100	393, 918. 00	0. 11
116   000717   韶柳松山	114	001914	招商积余	22, 800	391, 704. 00	0. 11
117   002532   天山铝业   41,100   344,829.00   0.10     118   600390   五矿资本   56,700   339,066.00   0.10     119   000961   中南建设   55,600   329,152.00   0.05     120   601801   蛇新传媒   68,000   320,960.00   0.05     121   002266   浙高控股   46,310   231,086.90   0.07     122   600062   华消双鹤   17,300   206,043.00   0.06     123   002690   美亚光电   3,500   195,160.00   0.06     124   600266   城建发展   40,800   193,392.00   0.06     125   002408   齐翔腾达   14,700   182,574.00   0.05     126   000723   美棉能源   16,600   125,496.00   0.02     127   002223   鱼跃医疗   2,600   99,138.00   0.02     128   600498   烽火通信   4,100   76,383.00   0.02     129   002110   三辆固光   9,200   62,008.00   0.02     130   002709   天賜材料   200   21,316.00   0.01     131   688088   虹软科技   173   9,644.75   0.00     133   300133   华策影視   500   2,960.00   0.00     134   002048   宁波华翔   100   1,950.00   0.00     135   002174   沖族网络   100   1,717.00   0.00     136   000528   柳	115	601168	西部矿业	31,000	369, 830. 00	0.11
118   600390   五矿资本   56,700   339,066.00   0.10     119   000961   中南建设   55,600   329,152.00   0.05     120   601801   皖新传媒   68,000   320,960.00   0.05     121   002266   浙富注股   46,310   231,086.90   0.07     122   600062   华河双鶴   17,300   206,043.00   0.06     123   002690   美亚光电   3,500   195,160.00   0.06     124   600266   城建发展   40,800   193,392.00   0.06     125   002408   齐翔腾达   14,700   182,574.00   0.05     126   000723   美舘能源   16,600   125,496.00   0.04     127   002223   鱼跃医疗   2,600   99,138.00   0.03     128   600498   烽火通信   4,100   76,383.00   0.02     129   002110   三铜闽光   9,200   62,008.00   0.02     130   002709   天赐材料   200   21,316.00   0.01     131   688088   虹软科技   173   9,644.75   0.00     133   300133   华策影视   500   2,960.00   0.00     134   002048   宁波华翔   100   1,950.00   0.00     135   002174   游族网络   100   1,717.00   0.00     136   000528   和 工   200   1,640.00   0.00     137   000598   兴赛环境   300   1,563.00   0.00     138   002244   滨江集团   300   1,257.00   0.00     139   300251   光线传媒   100   1,081.00   0.00     140   002191   効嘉股份   100   1,081.00   0.00     141   600637   东方明珠   100   819.00   0.00     142   600153   建发股份   100   819.00   0.00     143   600141   兴发集团   40   753.20   0.00     144   002966   苏州银行   100   735.00   0.00     145   300070   碧水源   100   674.00   0.00     146   600325   华发股份   100   674.00   0.00     147   002500   山西证券   100   671.00   0.00     148   600325   425	116	000717	韶钢松山	77, 500	355, 725. 00	0.10
119   000961 中南建设   55,600   329,152.00   0.06     120   601801   院新传媒   68,000   320,960.00   0.05     121   002266   浙富拴股   46,310   231,086.90   0.07     122   600062   华河双鶴   17,300   206,043.00   0.06     123   002690   美亚光电   3,500   195,160.00   0.06     124   600266   城建发展   40,800   193,392.00   0.06     125   002408   齐翔腾达   14,700   182,574.00   0.05     126   000723   美術能源   16,600   125,496.00   0.04     127   002223   鱼跃医疗   2,600   99,138.00   0.03     128   600498   烽火通信   4,100   76,383.00   0.02     129   002110   三朝闽光   9,200   62,008.00   0.02     130   002709   天赐材料   200   21,316.00   0.01     131   688088   虹软科技   173   9,644.75   0.00     132   300315   掌趣科技   1,900   8,075.00   0.00     133   300133   华策影视   500   2,960.00   0.00     134   002048   宁波华翔   100   1,950.00   0.00     135   002174   浙族网络   100   1,717.00   0.00     136   000528   柳	117	002532	天山铝业	41, 100	344, 829. 00	0. 10
120       601801       皖新传媒       68,000       320,960.00       0.05         121       002266       浙富控股       46,310       231,086.90       0.07         122       600062       华润双鹤       17,300       206,043.00       0.06         123       002690       美亚光电       3,500       195,160.00       0.06         124       600266       城建发展       40,800       193,392.00       0.06         125       002408       齐翔腾达       14,700       182,574.00       0.05         126       000723       美锦能源       16,600       125,496.00       0.04         127       002223       鱼跃医疗       2,600       99,138.00       0.03         128       600498       烽火通信       4,100       76,383.00       0.02         129       002110       三纲闽光       9,200       62,008.00       0.02         130       002709       天赐材料       200       21,316.00       0.01         131       688088       虹软科技       173       9,644.75       0.00         132       300315       掌趣科技       1,900       8,075.00       0.00         133       300133       华策影网       500       2,960.00       0.00<	118	600390	五矿资本	56, 700	339, 066. 00	0. 10
121       002266       浙富控股       46,310       231,086.90       0.07         122       600062       华润双鹤       17,300       206,043.00       0.06         123       002690       美亚光电       3,500       195,160.00       0.06         124       600266       城建发展       40,800       193,392.00       0.06         125       002408       齐翔腾达       14,700       182,574.00       0.06         126       000723       美棉能源       16,600       125,496.00       0.04         127       002223       鱼跃医疗       2,600       99,138.00       0.03         128       600498       烽火通信       4,100       76,383.00       0.02         129       002110       三網闽光       9,200       62,008.00       0.02         130       002709       天陽材料       200       21,316.00       0.01         131       688088       虹秋科技       173       9,644.75       0.06         132       300315       掌趣科技       1,900       8,075.00       0.06         133       300133       华策影視       500       2,960.00       0.06         134       002048       宁达华翔       100       1,717.00       0.06	119	000961	中南建设	55, 600	329, 152. 00	0.09
122       600062       华润双鹤       17,300       206,043.00       0.06         123       002690       美亚光电       3,500       195,160.00       0.06         124       600266       城建发展       40,800       193,392.00       0.06         125       002408       齐翔腾达       14,700       182,574.00       0.06         126       000723       美锦能源       16,600       125,496.00       0.04         127       002223       鱼跃医疗       2,600       99,138.00       0.03         128       600498       烽火通信       4,100       76,383.00       0.02         129       002110       三纲闽光       9,200       62,008.00       0.02         130       002709       天赐材料       200       21,316.00       0.01         131       688088       虹软科技       173       9,644.75       0.06         132       300315       掌趣科技       1,900       8,075.00       0.06         133       300133       华策影视       500       2,960.00       0.06         134       002048       宁波华翔       100       1,717.00       0.06         135       002174       游庆网络       100       1,640.00       0.06     <	120	601801	皖新传媒	68, 000	320, 960. 00	0.09
123     002690     美亚光电     3,500     195,160.00     0.06       124     600266     城建发展     40,800     193,392.00     0.06       125     002408     齐翔腾达     14,700     182,574.00     0.05       126     000723     美锦能源     16,600     125,496.00     0.04       127     002223     鱼跃医疗     2,600     99,138.00     0.03       128     600498     烽火通信     4,100     76,383.00     0.02       129     002110     三锅闽光     9,200     62,008.00     0.02       130     002709     天赐材料     200     21,316.00     0.01       131     688088     虹软科技     173     9,644.75     0.06       132     300315     掌趣科技     1,900     8,075.00     0.06       133     300133     华策影視     500     2,960.00     0.06       134     002048     宁波华謝     100     1,717.00     0.06       135     002174     游族网络     100     1,717.00     0.06       136     000528     柳     工     200     1,640.00     0.06       137     000598     兴蓉环境     300     1,563.00     0.06       138     002244     滨江集团     300     1,064.00	121	002266	浙富控股	46, 310	231, 086. 90	0.07
124       600266       城建发展       40,800       193,392.00       0.06         125       002408       齐翔腾达       14,700       182,574.00       0.05         126       000723       美锦能源       16,600       125,496.00       0.04         127       002223       鱼跃医疗       2,600       99,138.00       0.03         128       600498       烽火通信       4,100       76,383.00       0.02         129       002110       三锅闽光       9,200       62,008.00       0.02         130       002709       天賜材料       200       21,316.00       0.01         131       688088       虹软科技       173       9,644.75       0.00         132       300315       掌趣科技       1,900       8,075.00       0.00         133       300133       华策影視       500       2,960.00       0.00         134       002048       宁波华謝       100       1,717.00       0.00         135       002174       游族网络       100       1,717.00       0.00         136       000528       加       200       1,640.00       0.00         137       000598       兴養环境       300       1,563.00       0.00 <tr< td=""><td>122</td><td>600062</td><td>华润双鹤</td><td>17, 300</td><td>206, 043. 00</td><td>0.06</td></tr<>	122	600062	华润双鹤	17, 300	206, 043. 00	0.06
125       002408       齐翔腾达       14,700       182,574.00       0.05         126       000723       美锦能源       16,600       125,496.00       0.04         127       002223       鱼跃医疗       2,600       99,138.00       0.03         128       600498       烽火通信       4,100       76,383.00       0.02         129       002110       三纲闽光       9,200       62,008.00       0.02         130       002709       天赐材料       200       21,316.00       0.01         131       688088       虹软科技       173       9,644.75       0.00         132       300315       掌趣科技       1,900       8,075.00       0.00         133       300133       华策影视       500       2,960.00       0.00         134       002048       宁波华翔       100       1,950.00       0.00         135       002174       游族网络       100       1,717.00       0.00         136       000528       柳       工       200       1,640.00       0.00         137       00598       兴蓉环境       300       1,563.00       0.00         138       002244       滚江集団       300       1,081.00       0.00 </td <td>123</td> <td>002690</td> <td>美亚光电</td> <td>3, 500</td> <td>195, 160. 00</td> <td>0.06</td>	123	002690	美亚光电	3, 500	195, 160. 00	0.06
126       000723       美锦能源       16,600       125,496.00       0.04         127       002223       鱼跃医疗       2,600       99,138.00       0.03         128       600498       烽火通信       4,100       76,383.00       0.02         129       002110       三锅闽光       9,200       62,008.00       0.02         130       002709       天赐材料       200       21,316.00       0.01         131       688088       虹软科技       173       9,644.75       0.00         132       300315       掌趣科技       1,900       8,075.00       0.00         133       300133       华策影视       500       2,960.00       0.00         134       002048       宁波华翔       100       1,717.00       0.00         135       002174       游族网络       100       1,717.00       0.00         136       000528       柳       工       200       1,640.00       0.00         137       000598       兴蓉环境       300       1,563.00       0.00         138       002244       滨江東闭       300       1,257.00       0.00         140       002191       効嘉股份       100       1,064.00       0.00	124	600266	城建发展	40, 800	193, 392. 00	0.06
127     002223     鱼跃医疗     2,600     99,138.00     0.03       128     600498     烽火通信     4,100     76,383.00     0.02       129     002110     三钢闽光     9,200     62,008.00     0.02       130     002709     天赐材料     200     21,316.00     0.01       131     688088     虹软科技     173     9,644.75     0.00       132     300315     掌趣科技     1,900     8,075.00     0.00       133     300133     华策影视     500     2,960.00     0.00       134     002048     宁波华翔     100     1,950.00     0.00       135     002174     游族网络     100     1,717.00     0.00       136     000528     柳     工     200     1,640.00     0.00       137     000598     兴蓉环境     300     1,563.00     0.00       138     002244     濱江集团     300     1,257.00     0.00       140     002191     劲嘉股份     100     1,064.00     0.00       141     600637     东方明珠     100     819.00     0.00       142     600153     建发股份     100     810.00     0.00       144     002966     苏州银行     100     735.00     0.00	125	002408	齐翔腾达	14, 700	182, 574. 00	0.05
128       600498       烽火通信       4,100       76,383.00       0.02         129       002110       三钢闽光       9,200       62,008.00       0.02         130       002709       天陽材料       200       21,316.00       0.01         131       688088       虹软科技       173       9,644.75       0.00         132       300315       掌趣科技       1,900       8,075.00       0.00         133       300133       华策影视       500       2,960.00       0.00         134       002048       宁波华翔       100       1,950.00       0.00         135       002174       游族网络       100       1,717.00       0.00         136       000528       柳       工       200       1,640.00       0.00         137       000598       兴蓉环境       300       1,563.00       0.00         138       002244       滨江集团       300       1,257.00       0.00         140       002191       劲嘉股份       100       1,064.00       0.00         141       600637       东方明珠       100       810.00       0.00         142       600153       建发股份       100       810.00       0.00	126	000723	美锦能源	16, 600	125, 496. 00	0.04
129       002110       三钢闽光       9,200       62,008.00       0.02         130       002709       天赐材料       200       21,316.00       0.01         131       688088       虹软科技       173       9,644.75       0.00         132       300315       掌趣科技       1,900       8,075.00       0.00         133       300133       华策影视       500       2,960.00       0.00         134       002048       宁波华翔       100       1,950.00       0.00         135       002174       游族网络       100       1,717.00       0.00         136       000528       柳       工       200       1,640.00       0.00         137       000598       兴蓉环境       300       1,563.00       0.00         138       002244       滨江集团       300       1,257.00       0.00         139       300251       光线传媒       100       1,064.00       0.00         140       002191       劲嘉股份       100       819.00       0.00         142       600153       建发股份       100       810.00       0.00         143       600141       兴发集团       40       753.20       0.00 <td< td=""><td>127</td><td>002223</td><td>鱼跃医疗</td><td>2, 600</td><td>99, 138. 00</td><td>0.03</td></td<>	127	002223	鱼跃医疗	2, 600	99, 138. 00	0.03
130     002709     天赐材料     200     21,316.00     0.01       131     688088     虹软科技     173     9,644.75     0.00       132     300315     掌趣科技     1,900     8,075.00     0.00       133     300133     华策影视     500     2,960.00     0.00       134     002048     宁波华翔     100     1,950.00     0.00       135     002174     游族网络     100     1,717.00     0.00       136     000528     柳     工     200     1,640.00     0.00       137     000598     兴蓉环境     300     1,563.00     0.00       138     002244     滨江集团     300     1,257.00     0.00       139     300251     光线传媒     100     1,081.00     0.00       140     002191     劲嘉股份     100     1,064.00     0.00       141     600637     东方明珠     100     819.00     0.00       142     600153     建发股份     100     810.00     0.00       144     002966     苏州银行     100     735.00     0.00       145     300070     碧水源     100     674.00     0.00       146     600325     华发股份     100     674.00     0.00	128	600498	烽火通信	4, 100	76, 383. 00	0.02
131       688088       虹软科技       173       9,644.75       0.00         132       300315       掌趣科技       1,900       8,075.00       0.00         133       300133       华策影视       500       2,960.00       0.00         134       002048       宁波华翔       100       1,950.00       0.00         135       002174       游族网络       100       1,717.00       0.00         136       000528       柳       工       200       1,640.00       0.00         137       000598       兴蓉环境       300       1,563.00       0.00         138       002244       滨江集团       300       1,257.00       0.00         139       300251       光线传媒       100       1,081.00       0.00         140       002191       劲嘉股份       100       1,064.00       0.00         141       600637       东方明珠       100       819.00       0.00         142       600153       建发股份       100       810.00       0.00         144       002966       苏州银行       100       735.00       0.00         145       300070       碧水源       100       731.00       0.00         146 </td <td>129</td> <td>002110</td> <td>三钢闽光</td> <td>9, 200</td> <td>62, 008. 00</td> <td>0.02</td>	129	002110	三钢闽光	9, 200	62, 008. 00	0.02
132       300315       掌趣科技       1,900       8,075.00       0.00         133       300133       华策影视       500       2,960.00       0.00         134       002048       宁波华翔       100       1,950.00       0.00         135       002174       游族网络       100       1,717.00       0.00         136       000528       柳       工       200       1,640.00       0.00         137       000598       兴蓉环境       300       1,563.00       0.00         138       002244       滨江集团       300       1,257.00       0.00         139       300251       光线传媒       100       1,081.00       0.00         140       002191       劲嘉股份       100       1,064.00       0.00         141       600637       东方明珠       100       819.00       0.00         142       600153       建发股份       100       810.00       0.00         143       600141       兴发集团       40       753.20       0.00         144       002966       苏州银行       100       735.00       0.00         145       300070       碧水源       100       731.00       0.00         146	130	002709	天赐材料	200	21, 316. 00	0.01
133     300133     华策影视     500     2,960.00     0.00       134     002048     宁波华翔     100     1,950.00     0.00       135     002174     游族网络     100     1,717.00     0.00       136     000528     柳     工     200     1,640.00     0.00       137     000598     兴春环境     300     1,563.00     0.00       138     002244     滨江集团     300     1,257.00     0.00       139     300251     光线传媒     100     1,081.00     0.00       140     002191     劲嘉股份     100     1,064.00     0.00       141     600637     东方明珠     100     819.00     0.00       142     600153     建发股份     100     810.00     0.00       143     600141     兴发集团     40     753.20     0.00       144     002966     苏州银行     100     735.00     0.00       145     300070     碧水源     100     674.00     0.00       146     600325     华发股份     100     674.00     0.00       147     002500     山西证券     100     671.00     0.00	131	688088	虹软科技	173	9, 644. 75	0.00
134     002048     宁波华翔     100     1,950.00     0.00       135     002174     游族网络     100     1,717.00     0.00       136     000528     柳     工     200     1,640.00     0.00       137     000598     兴蓉环境     300     1,563.00     0.00       138     002244     滨江集团     300     1,257.00     0.00       139     300251     光线传媒     100     1,081.00     0.00       140     002191     劲嘉股份     100     1,064.00     0.00       141     600637     东方明珠     100     819.00     0.00       142     600153     建发股份     100     810.00     0.00       143     600141     兴发集团     40     753.20     0.00       144     002966     苏州银行     100     735.00     0.00       145     300070     碧水源     100     731.00     0.00       146     600325     华发股份     100     674.00     0.00       147     002500     山西证券     100     671.00     0.00	132	300315	掌趣科技	1, 900	8, 075. 00	0.00
135       002174       游族网络       100       1,717.00       0.00         136       000528       柳       工       200       1,640.00       0.00         137       000598       兴蓉环境       300       1,563.00       0.00         138       002244       滨江集团       300       1,257.00       0.00         139       300251       光线传媒       100       1,081.00       0.00         140       002191       劲嘉股份       100       1,064.00       0.00         141       600637       东方明珠       100       819.00       0.00         142       600153       建发股份       100       810.00       0.00         143       600141       兴发集团       40       753.20       0.00         144       002966       苏州银行       100       735.00       0.00         145       300070       碧水源       100       674.00       0.00         146       600325       华发股份       100       674.00       0.00         147       002500       山西证券       100       671.00       0.00	133	300133	华策影视	500	2, 960. 00	0.00
136     000528     柳 工     200     1,640.00     0.00       137     000598     兴蓉环境     300     1,563.00     0.00       138     002244     滨江集团     300     1,257.00     0.00       139     300251     光线传媒     100     1,081.00     0.00       140     002191     劲嘉股份     100     1,064.00     0.00       141     600637     东方明珠     100     819.00     0.00       142     600153     建发股份     100     810.00     0.00       143     600141     兴发集团     40     753.20     0.00       144     002966     苏州银行     100     731.00     0.00       145     300070     碧水源     100     674.00     0.00       146     600325     华发股份     100     674.00     0.00       147     002500     山西证券     100     671.00     0.00	134	002048	宁波华翔	100	1, 950. 00	0.00
137     000598     兴蓉环境     300     1,563.00     0.00       138     002244     滨江集团     300     1,257.00     0.00       139     300251     光线传媒     100     1,081.00     0.00       140     002191     劲嘉股份     100     1,064.00     0.00       141     600637     东方明珠     100     819.00     0.00       142     600153     建发股份     100     810.00     0.00       143     600141     兴发集团     40     753.20     0.00       144     002966     苏州银行     100     735.00     0.00       145     300070     碧水源     100     731.00     0.00       146     600325     华发股份     100     674.00     0.00       147     002500     山西证券     100     671.00     0.00	135	002174	游族网络	100	1, 717. 00	0.00
138     002244     滨江集团     300     1,257.00     0.00       139     300251     光线传媒     100     1,081.00     0.00       140     002191     劲嘉股份     100     1,064.00     0.00       141     600637     东方明珠     100     819.00     0.00       142     600153     建发股份     100     810.00     0.00       143     600141     兴发集团     40     753.20     0.00       144     002966     苏州银行     100     735.00     0.00       145     300070     碧水源     100     731.00     0.00       146     600325     华发股份     100     674.00     0.00       147     002500     山西证券     100     671.00     0.00	136	000528	柳 工	200	1, 640. 00	0.00
139     300251     光线传媒     100     1,081.00     0.00       140     002191     劲嘉股份     100     1,064.00     0.00       141     600637     东方明珠     100     819.00     0.00       142     600153     建发股份     100     810.00     0.00       143     600141     兴发集团     40     753.20     0.00       144     002966     苏州银行     100     735.00     0.00       145     300070     碧水源     100     731.00     0.00       146     600325     华发股份     100     674.00     0.00       147     002500     山西证券     100     671.00     0.00	137	000598	兴蓉环境	300	1, 563. 00	0.00
140       002191       劲嘉股份       100       1,064.00       0.00         141       600637       东方明珠       100       819.00       0.00         142       600153       建发股份       100       810.00       0.00         143       600141       兴发集团       40       753.20       0.00         144       002966       苏州银行       100       735.00       0.00         145       300070       碧水源       100       731.00       0.00         146       600325       华发股份       100       674.00       0.00         147       002500       山西证券       100       671.00       0.00	138	002244	滨江集团	300	1, 257. 00	0.00
141     600637     东方明珠     100     819.00     0.00       142     600153     建发股份     100     810.00     0.00       143     600141     兴发集团     40     753.20     0.00       144     002966     苏州银行     100     735.00     0.00       145     300070     碧水源     100     731.00     0.00       146     600325     华发股份     100     674.00     0.00       147     002500     山西证券     100     671.00     0.00	139	300251	光线传媒	100	1, 081. 00	0.00
142       600153       建发股份       100       810.00       0.00         143       600141       兴发集团       40       753.20       0.00         144       002966       苏州银行       100       735.00       0.00         145       300070       碧水源       100       731.00       0.00         146       600325       华发股份       100       674.00       0.00         147       002500       山西证券       100       671.00       0.00	140	002191	劲嘉股份	100	1, 064. 00	0.00
143     600141     兴发集团     40     753. 20     0.00       144     002966     苏州银行     100     735. 00     0.00       145     300070     碧水源     100     731. 00     0.00       146     600325     华发股份     100     674. 00     0.00       147     002500     山西证券     100     671. 00     0.00	141	600637	东方明珠	100	819.00	0.00
144     002966     苏州银行     100     735.00     0.00       145     300070     碧水源     100     731.00     0.00       146     600325     华发股份     100     674.00     0.00       147     002500     山西证券     100     671.00     0.00	142	600153	建发股份	100	810.00	0.00
145     300070     碧水源     100     731.00     0.00       146     600325     华发股份     100     674.00     0.00       147     002500     山西证券     100     671.00     0.00	143	600141	兴发集团	40	753. 20	0.00
146     600325     华发股份     100     674.00     0.00       147     002500     山西证券     100     671.00     0.00	144	002966	苏州银行	100	735. 00	0.00
147 002500 山西证券 100 671.00 0.00	145	300070	碧水源	100	731. 00	0.00
	146	600325	华发股份	100	674. 00	0.00
148 600823 世茂股份 100 404.00 0.00	147	002500	山西证券	100	671.00	0.00
	148	600823	世茂股份	100	404.00	0.00

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

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	002179	中航光电	19, 800	1, 564, 596. 00	0. 45
2	603160	汇顶科技	12,000	1, 555, 560. 00	0. 45
3	600019	宝钢股份	202, 742	1, 548, 948. 88	0. 45
4	002050	三花智控	63, 900	1, 532, 322. 00	0. 44
5	002241	歌尔股份	35, 700	1, 525, 818. 00	0. 44
6	603259	药明康德	9, 700	1, 518, 923. 00	0. 44
7	600426	华鲁恒升	48, 900	1, 513, 455. 00	0. 44
8	300136	信维通信	44, 400	1, 371, 072. 00	0.39
9	002153	石基信息	57, 200	1, 344, 772. 00	0.39
10	300433	蓝思科技	40, 800	1, 199, 928. 00	0. 35
11	601328	交通银行	219, 600	1, 076, 040. 00	0.31
12	600919	江苏银行	137, 600	976, 960. 00	0. 28
13	300059	东方财富	23, 500	770, 565. 00	0. 22
14	002821	凯莱英	1,600	596, 160. 00	0. 17
15	002230	科大讯飞	4, 400	297, 352. 00	0.09
16	688665	四方光电	1, 687	218, 399. 02	0.06
17	601628	中国人寿	6, 400	216, 896. 00	0.06
18	688677	海泰新光	1, 547	159, 696. 81	0. 05
19	688601	力芯微	1, 174	156, 952. 06	0.05
20	688345	博力威	2, 332	129, 495. 96	0.04
21	688661	和林微纳	1, 452	121, 982. 52	0.04
22	688625	呈和科技	2, 672	113, 907. 36	0. 03
23	688656	浩欧博	1, 288	93, 508. 80	0. 03
24	688628	优利德	2, 789	90, 977. 18	0. 03
25	688499	利元亨	2, 149	83, 488. 65	0. 02
26	688468	科美诊断	3, 919	64, 663. 50	0. 02
27	688328	深科达	1, 499	56, 647. 21	0. 02
28	688087	英科再生	2, 469	54, 219. 24	0. 02
29	688260	昀冢科技	2, 990	49, 065. 90	0.01
30	300957	贝泰妮	155	39, 053. 80	0. 01
31	300919	中伟股份	235	38, 305. 00	0. 01
32	601528	瑞丰银行	2, 230	34, 721. 10	0. 01
33	688681	科汇股份	1, 899	27, 611. 46	0. 01
34	301021	英诺激光	2, 899	27, 424. 54	0.01

35	300973	立高食品	222	25, 687. 62	0. 01
36	301009	可靠股份	801	22, 339. 89	
37	300953	<b>震裕科技</b>	209	20, 868. 65	0.01
38	301015	百洋医药	462	17, 939. 46	0.01
39	300981	中红医疗	193	17, 445. 27	0.01
40	688226	威腾电气	2, 693	17, 289. 06	0.00
41	300982	苏文电能	317	14, 356. 93	0.00
42	001208	华菱线缆	1, 754	13, 558. 42	0.00
43	300940	南极光	307	13, 317. 66	0.00
44	300614	百川畅银	329	13, 285. 02	0.00
45	300937	药易购	244	13, 105. 24	0.00
46	300968	格林精密	1, 069	12, 902. 83	0.00
47	300942	易瑞生物	443	12, 634. 36	0.00
48	300932	三友联众	394	12, 493. 74	0.00
49	603171	税友股份	637	12, 230. 40	0.00
50	300997	欢乐家	928	12, 110. 40	0.00
51	301002	崧盛股份	201	11, 581. 62	0.00
52	605287	德才股份	349	11, 014. 44	0.00
53	300955	嘉亨家化	232	10, 688. 24	0.00
54	300996	普联软件	241	10, 177. 43	0.00
55	300956	英力股份	371	9, 571. 80	0.00
56	300962	中金辐照	576	9, 429. 12	0.00
57	300952	恒辉安防	340	9, 207. 20	0.00
58	301016	雷尔伟	275	9, 069. 50	0.00
59	300966	共同药业	286	9, 020. 44	0.00
60	300945	曼卡龙	474	8, 949. 12	0.00
61	300948	冠中生态	324	8, 884. 08	0.00
62	300931	通用电梯	672	8, 809. 92	0.00
63	300961	深水海纳	394	8, 695. 58	0.00
64	300950	德固特	219	8, 569. 47	0.00
65	605162	新中港	1, 377	8, 358. 39	0.00
66	300986	志特新材	264	8, 070. 48	0.00
67	300987	川网传媒	301	8, 069. 81	0.00
68	300978	东箭科技	593	8, 064. 80	0.00
69	300926	博俊科技	359	7, 969. 80	0.00
70	300930	屹通新材	322	7, 882. 56	0.00
71	300985	致远新能	283	7, 021. 23	0.00
72	300927	江天化学	217	6, 531. 70	
73	300975	商络电子	第 52 頁 井 76 頁	6, 410. 76	0.00

74	300963	中洲特材	283	6, 364. 67	0.00
75	300933	中辰股份	572	5, 971. 68	0.00
76	301011	华立科技	175	5, 922. 00	0.00
77	300943	春晖智控	255	5, 867. 55	0.00
78	300967	晓鸣股份	507	5, 850. 78	0.00
79	300972	万辰生物	430	5, 439. 50	0.00
80	300929	华骐环保	183	5, 407. 65	0.00
81	300960	通业科技	234	5, 396. 04	0.00
82	605011	杭州热电	525	4, 662. 00	0.00
83	300995	奇德新材	191	4, 454. 12	0.00
84	301007	德迈仕	303	4, 375. 32	0.00
85	300998	宁波方正	201	4, 285. 32	0.00
86	301012	扬电科技	170	4, 124. 20	0.00
87	300992	泰福泵业	200	4, 064. 00	0.00
88	301010	晶雪节能	218	3, 838. 98	0.00
89	000063	中兴通讯	35	1, 163. 05	0.00
90	002027	分众传媒	100	941.00	0.00

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	002250	联化科技	16, 774, 911. 15	7. 38
2	600884	杉杉股份	15, 012, 529. 34	6. 60
3	603444	吉比特	14, 695, 554. 34	6. 46
4	300146	汤臣倍健	14, 493, 432. 03	6. 37
5	002340	格林美	13, 239, 884. 00	5. 82
6	600827	百联股份	12, 628, 680. 36	5. 55
7	300274	阳光电源	12, 512, 567. 72	5. 50
8	300207	欣旺达	12, 122, 586. 00	5. 33
9	000012	南玻 A	11, 897, 653. 95	5. 23
10	601233	桐昆股份	11, 332, 005. 00	4. 98
11	603377	东方时尚	11, 196, 770. 00	4. 92
12	600707	彩虹股份	11, 083, 879. 00	4. 87
13	600216	浙江医药	10, 943, 103. 00	4.81

14   600201   生物股份					
16   600862	14	600201	生物股份	10, 823, 411. 00	4. 76
17   600132   重庆啤酒   10,294,472.24   4.53     18   002138   順路电子   10,276,188.87   4.52     19   603345   安井食品   10,179,378.80   4.48     20   002212   天融信   10,131,442.79   4.45     21   601799   星字股份   10,101,845.76   4.44     22   002557   治治食品   10,071,845.20   4.43     23   002705   新宝股份   10,025,026.18   4.41     24   600426   华鲁恒升   9,903,057.70   4.35     25   300115   长盈精密   9,764,863.70   4.29     26   600038   中直股份   9,683,300.00   4.26     27   000898   鞍钢股份   9,624,766.42   4.23     28   603355   東克屯气   9,624,090.00   4.23     29   601689   拓音集团   9,560,282.42   4.20     30   000960   锡业股份   9,541,163.30   4.19     31   002709   天陽材料   9,447,483.02   4.15     32   600258   首旅福店   9,443,773.08   4.15     33   600549   厦门钨业   9,430,076.00   4.15     34   600079   人福医药   9,305,515.00   4.09     35   603882   金域医学   9,305,515.00   4.09     36   600392   盛和资源   9,259,225.40   4.07     37   000999   华河三九   9,165,545.50   4.03     38   300009   安科生物   9,093,524.72   4.00     39   002390   信再制药   9,018,732.00   3.97     40   002511   中順治采   8,952,989.00   3.94     41   002080   中材科技   8,947,699.93   3.93     42   600141   ※发集団   8,939,142.08   3.93     43   002078   太阳纸业   8,887,613.08   3.91     44   002368   太板股份   8,850,328.79   3.89     45   600089   特突电工   8,762,658.00   3.85     46   688002   容別微纳   8,722,747.04   3.88     47   001914   招商科余   8,662,663.00   3.81	15	600409	三友化工	10, 350, 773. 00	4. 55
18   002138   順络电子	16	600862	中航高科	10, 312, 579. 44	4. 53
19   603345 安井食品	17	600132	重庆啤酒	10, 294, 472. 24	4. 53
20       002212       天融信       10,131,442.79       4.45         21       601799       星字股份       10,101,845.76       4.44         22       002557       治治食品       10,071,845.20       4.43         23       002705       新宝股份       10,025,026.18       4.41         24       600426       华鲁恒升       9,903,057.70       4.35         25       300115       长盈精密       9,764,863.70       4.29         26       600038       中直股份       9,683,300.00       4.26         27       000898       鞍朝股份       9,624,766.42       4.23         28       603355       莱克电气       9,624,090.00       4.23         29       601689       拓普集团       9,560,282.42       4.20         30       000960       锡业股份       9,541,163.30       4.19         31       002709       天赐材料       9,447,483.02       4.15         32       600258       首旅酒店       9,443,773.08       4.15         33       600549       厦门蚂业       9,430,076.00       4.15         34       600079       人福医药       9,355,515.00       4.09         35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09 <td>18</td> <td>002138</td> <td>顺络电子</td> <td>10, 276, 188. 87</td> <td>4. 52</td>	18	002138	顺络电子	10, 276, 188. 87	4. 52
21       601799       星宇股份       10,101,845.76       4.44         22       002557       治治食品       10,071,845.20       4.43         23       002705       新宝股份       10,025,026.18       4.41         24       600426       华鲁恒升       9,903,057.70       4.35         25       300115       长盈精密       9,764,863.70       4.29         26       600038       中直股份       9,683,300.00       4.26         27       000898       鞍翎股份       9,624,766.42       4.23         28       603355       萊克电气       9,624,090.00       4.23         29       601689       拓音集团       9,560,282.42       4.20         30       000960       锡业股份       9,541,163.30       4.19         31       002709       天赐材料       9,447,483.02       4.15         32       600258       首旅酒店       9,443,773.08       4.15         33       600549       厦门钨业       9,430,076.00       4.15         34       60079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       60382       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       600392       盛和資産       9,259,225.40       4.07	19	603345	安井食品	10, 179, 378. 80	4. 48
22       002557       洽洽食品       10,071,845.20       4.43         23       002705       新宝股份       10,025,026.18       4.41         24       600426       华鲁恒升       9,903,057.70       4.35         25       300115       长盈精密       9,764,863.70       4.29         26       600038       中直股份       9,683,300.00       4.26         27       000898       鞍領股份       9,624,766.42       4.23         28       603355       東克电气       9,624,090.00       4.23         29       601689       拓普集団       9,560,282.42       4.20         30       000960       锡业股份       9,541,163.30       4.19         31       002709       天賜材料       9,447,483.02       4.15         32       600258       首旅酒店       9,443,773.08       4.15         33       600549       厦门钨业       9,430,076.00       4.15         34       600079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       60382       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       60392       盛和簽源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03	20	002212	天融信	10, 131, 442. 79	4. 45
23       002705       新宝股份       10,025,026.18       4.41         24       600426       华鲁恒升       9,903,057.70       4.35         25       300115       长盈精密       9,764,863.70       4.29         26       600038       中直股份       9,683,300.00       4.26         27       000898       鞍钢股份       9,624,766.42       4.23         28       603355       莱克电气       9,624,090.00       4.23         29       601689       拓普集团       9,560,282.42       4.20         30       000960       锡业股份       9,541,163.30       4.19         31       002709       天赐材料       9,447,483.02       4.15         32       600258       首旅酒店       9,443,773.08       4.15         33       600549       厦门钨业       9,430,076.00       4.15         34       600079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       60392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       300009       安科生物       9,093,524.72       4.00	21	601799	星宇股份	10, 101, 845. 76	4. 44
24       600426       华鲁恒升       9,903,057.70       4.35         25       300115       长盈精密       9,764,863.70       4.29         26       600038       中直股份       9,683,300.00       4.26         27       000898       鞍钢股份       9,624,766.42       4.23         28       603355       莱克电气       9,624,090.00       4.23         29       601689       拓普集团       9,560,282.42       4.20         30       000960       锡业股份       9,541,163.30       4.19         31       002709       天賜材料       9,447,483.02       4.15         32       600258       首旅酒店       9,443,773.08       4.15         33       600549       厦门钨业       9,430,076.00       4.15         34       600079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       60392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       300009       安科生物       9,093,524.72       4.00         39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.94	22	002557	治治食品	10, 071, 845. 20	4. 43
25       300115       长盈精密       9,764,863.70       4.29         26       600038       中直股份       9,683,300.00       4.26         27       000898       鞍钢股份       9,624,766.42       4.23         28       603355       萊克电气       9,624,090.00       4.23         29       601689       拓普集团       9,560,282.42       4.20         30       000960       锡业股份       9,541,163.30       4.19         31       002709       天赐材料       9,447,483.02       4.15         32       600258       首旅酒店       9,443,773.08       4.15         33       600549       厦门钨业       9,430,076.00       4.15         34       600079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       600392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       300009       安科生物       9,093,524.72       4.00         39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.97         40       002511       中順活柔       8,952,989.00       3.94	23	002705	新宝股份	10, 025, 026. 18	4. 41
26       600038       中直股份       9,683,300.00       4.26         27       000898       鞍钢股份       9,624,766.42       4.23         28       603355       莱克电气       9,624,090.00       4.23         29       601689       拓普集团       9,560,282.42       4.20         30       000960       锡业股份       9,541,163.30       4.19         31       002709       天赐材料       9,447,483.02       4.15         32       600258       首旅酒店       9,443,773.08       4.15         33       600549       厦门钨业       9,430,076.00       4.15         34       600079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       60392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       30009       安科生物       9,018,732.00       3.97         40       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.94         41       002080       中材科技       8,952,989.00       3.93         42       600141       兴发集团       8,939,142.08       3.93	24	600426	华鲁恒升	9, 903, 057. 70	4. 35
27       000898       鞍钢股份       9,624,766.42       4.23         28       603355       莱克电气       9,624,090.00       4.23         29       601689       拓普集团       9,560,282.42       4.20         30       000960       锡业股份       9,541,163.30       4.19         31       002709       天赐材料       9,447,483.02       4.15         32       600258       首旅酒店       9,443,773.08       4.15         33       600549       厦门钨业       9,430,076.00       4.15         34       600079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       600392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       30009       安科生物       9,093,524.72       4.00         39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.97         40       002511       中顺活柔       8,952,989.00       3.94         41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,887,613.08       3.91	25	300115	长盈精密	9, 764, 863. 70	4. 29
28       603355       莱克电气       9,624,090.00       4.23         29       601689       拓普集团       9,560,282.42       4.20         30       000960       锡业股份       9,541,163.30       4.19         31       002709       天赐材料       9,447,483.02       4.15         32       600258       首旅酒店       9,443,773.08       4.15         33       600549       厦门钨业       9,430,076.00       4.15         34       600079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       600392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       300009       安科生物       9,093,524.72       4.00         39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.97         40       002511       中顺洁柔       8,952,989.00       3.94         41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89	26	600038	中直股份	9, 683, 300. 00	4. 26
29       601689       拓普集团       9,560,282.42       4.20         30       000960       锡业股份       9,541,163.30       4.19         31       002709       天賜材料       9,447,483.02       4.15         32       600258       首旅酒店       9,443,773.08       4.15         33       600549       厦门钨业       9,430,076.00       4.15         34       600079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       600392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       300009       安科生物       9,093,524.72       4.00         39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.97         40       002511       中顺活柔       8,952,989.00       3.94         41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,876,613.08       3.91         43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89	27	000898	鞍钢股份	9, 624, 766. 42	4. 23
30       000960       锡业股份       9,541,163.30       4.19         31       002709       天赐材料       9,447,483.02       4.15         32       600258       首旅酒店       9,443,773.08       4.15         33       600549       厦门钨业       9,430,076.00       4.15         34       600079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       600392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       300009       安科生物       9,093,524.72       4.00         39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.97         40       002511       中顺活柔       8,952,989.00       3.94         41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,939,142.08       3.93         43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85	28	603355	莱克电气	9, 624, 090. 00	4. 23
31       002709       天赐材料       9,447,483.02       4.15         32       600258       首旅酒店       9,443,773.08       4.15         33       600549       厦门钨业       9,430,076.00       4.15         34       600079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       600392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       300009       安科生物       9,093,524.72       4.00         39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.97         40       002511       中顺活柔       8,952,989.00       3.94         41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,939,142.08       3.93         43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       春创微纳       8,722,747.04       3.83	29	601689	拓普集团	9, 560, 282. 42	4. 20
32       600258       首旅酒店       9,443,773.08       4.15         33       600549       厦门钨业       9,430,076.00       4.15         34       600079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       600392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       300009       安科生物       9,093,524.72       4.00         39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.97         40       002511       中順洁柔       8,952,989.00       3.94         41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,939,142.08       3.93         43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       春创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,678,217.00       3.82	30	000960	锡业股份	9, 541, 163. 30	4. 19
33       600549       厦门钨业       9,430,076.00       4.15         34       600079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       600392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       300009       安科生物       9,093,524.72       4.00         39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.97         40       002511       中顺洁柔       8,952,989.00       3.94         41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,893,142.08       3.93         43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       睿创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,662,663.00       3.81         48       300357       我武生物       8,662,663.00       3.81	31	002709	天赐材料	9, 447, 483. 02	4. 15
34       600079       人福医药       9,335,862.78       4.10         35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       600392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       300009       安科生物       9,093,524.72       4.00         39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.97         40       002511       中顺洁柔       8,952,989.00       3.94         41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,939,142.08       3.93         43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       睿创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,662,663.00       3.81         48       300357       我武生物       8,662,663.00       3.81	32	600258	首旅酒店	9, 443, 773. 08	4. 15
35       603882       金域医学       9,305,515.00       4.09         36       600392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       300009       安科生物       9,093,524.72       4.00         39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.97         40       002511       中顺洁柔       8,952,989.00       3.94         41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,939,142.08       3.93         43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       睿创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,678,217.00       3.82         48       300357       我武生物       8,662,663.00       3.81	33	600549	厦门钨业	9, 430, 076. 00	4. 15
36       600392       盛和资源       9,259,225.40       4.07         37       000999       华润三九       9,165,545.50       4.03         38       300009       安科生物       9,093,524.72       4.00         39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.97         40       002511       中顺洁柔       8,952,989.00       3.94         41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,8939,142.08       3.93         43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       春创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,678,217.00       3.82         48       300357       我武生物       8,662,663.00       3.81	34	600079	人福医药	9, 335, 862. 78	4. 10
37       000999       华润三九       9, 165, 545. 50       4. 03         38       300009       安科生物       9, 093, 524. 72       4. 00         39       002390       信邦制药       9, 018, 732. 00       3. 97         40       002511       中顺洁柔       8, 952, 989. 00       3. 94         41       002080       中材科技       8, 947, 699. 93       3. 93         42       600141       兴发集团       8, 893, 142. 08       3. 93         43       002078       太阳纸业       8, 887, 613. 08       3. 91         44       002368       太极股份       8, 850, 328. 79       3. 89         45       600089       特变电工       8, 762, 658. 00       3. 85         46       688002       春创微纳       8, 722, 747. 04       3. 83         47       001914       招商积余       8, 678, 217. 00       3. 82         48       300357       我武生物       8, 662, 663. 00       3. 81	35	603882	金域医学	9, 305, 515. 00	4. 09
38       300009       安科生物       9,093,524.72       4.00         39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.97         40       002511       中顺洁柔       8,952,989.00       3.94         41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,939,142.08       3.93         43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       春创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,678,217.00       3.82         48       300357       我武生物       8,662,663.00       3.81	36	600392	盛和资源	9, 259, 225. 40	4. 07
39       002390       信邦制药       9,018,732.00       3.97         40       002511       中顺洁柔       8,952,989.00       3.94         41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,939,142.08       3.93         43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       春创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,678,217.00       3.82         48       300357       我武生物       8,662,663.00       3.81	37	000999	华润三九	9, 165, 545. 50	4. 03
40       002511       中順洁柔       8,952,989.00       3.94         41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,939,142.08       3.93         43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       睿创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,678,217.00       3.82         48       300357       我武生物       8,662,663.00       3.81	38	300009	安科生物	9, 093, 524. 72	4. 00
41       002080       中材科技       8,947,699.93       3.93         42       600141       兴发集团       8,939,142.08       3.93         43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       春创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,678,217.00       3.82         48       300357       我武生物       8,662,663.00       3.81	39	002390	信邦制药	9, 018, 732. 00	3. 97
42       600141       兴发集团       8,939,142.08       3.93         43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       春创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,678,217.00       3.82         48       300357       我武生物       8,662,663.00       3.81	40	002511	中顺洁柔	8, 952, 989. 00	3. 94
43       002078       太阳纸业       8,887,613.08       3.91         44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       睿创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,678,217.00       3.82         48       300357       我武生物       8,662,663.00       3.81	41	002080	中材科技	8, 947, 699. 93	3. 93
44       002368       太极股份       8,850,328.79       3.89         45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       睿创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,678,217.00       3.82         48       300357       我武生物       8,662,663.00       3.81	42	600141	兴发集团	8, 939, 142. 08	3. 93
45       600089       特变电工       8,762,658.00       3.85         46       688002       睿创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,678,217.00       3.82         48       300357       我武生物       8,662,663.00       3.81	43	002078	太阳纸业	8, 887, 613. 08	3. 91
46       688002       睿创微纳       8,722,747.04       3.83         47       001914       招商积余       8,678,217.00       3.82         48       300357       我武生物       8,662,663.00       3.81	44	002368	太极股份	8, 850, 328. 79	3. 89
47     001914     招商积余     8,678,217.00     3.82       48     300357     我武生物     8,662,663.00     3.81	45	600089	特变电工	8, 762, 658. 00	3. 85
48 300357 我武生物 8,662,663.00 3.81	46	688002	<b>睿创微纳</b>	8, 722, 747. 04	3. 83
	47	001914	招商积余	8, 678, 217. 00	3. 82
49 002028 思源电气 8,522,042.90 3.75	48	300357	我武生物	8, 662, 663. 00	3. 81
	49	002028	思源电气	8, 522, 042. 90	3. 75

			<del>_</del>	
50	600460	士兰微	8, 515, 925. 00	3. 74
51	002925	盈趣科技	8, 487, 517. 92	3. 73
52	601966	玲珑轮胎	8, 479, 462. 29	3. 73
53	002625	光启技术	8, 461, 644. 00	3. 72
54	002223	鱼跃医疗	8, 452, 163. 80	3. 72
55	002444	巨星科技	8, 382, 163. 32	3. 69
56	600511	国药股份	8, 128, 117. 00	3. 57
57	002074	国轩高科	8, 109, 606. 56	3. 57
58	002568	百润股份	8, 102, 406. 14	3. 56
59	002124	天邦股份	7, 967, 965. 84	3. 50
60	002156	通富微电	7, 959, 919. 80	3. 50
61	603486	科沃斯	7, 878, 434. 00	3. 46
62	600754	锦江酒店	7, 770, 413. 14	3. 42
63	300001	特锐德	7, 766, 395. 70	3. 41
64	300496	中科创达	7, 713, 494. 48	3. 39
65	000690	宝新能源	7, 634, 449. 00	3. 36
66	000830	鲁西化工	7, 594, 931. 00	3. 34
67	600546	山煤国际	7, 546, 293. 23	3. 32
68	000959	首钢股份	7, 501, 933. 66	3. 30
69	300699	光威复材	7, 500, 583. 20	3. 30
70	000807	云铝股份	7, 488, 112. 00	3. 29
71	603638	艾迪精密	7, 447, 545. 56	3. 27
72	002294	信立泰	7, 436, 989. 64	3. 27
73	002648	卫星石化	7, 434, 980. 38	3. 27
74	603885	吉祥航空	7, 430, 018. 20	3. 27
75	002092	中泰化学	7, 413, 189. 00	3. 26
76	600623	华谊集团	7, 352, 613. 85	3. 23
77	600348	华阳股份	7, 327, 287. 00	3. 22
78	600765	中航重机	7, 284, 049. 00	3. 20
79	002203	海亮股份	7, 133, 644. 57	3. 14
80	300088	长信科技	7, 116, 317. 00	3. 13
81	603228	景旺电子	7, 095, 089. 73	3. 12
82	603708	家家悦	7, 064, 924. 00	3. 11
83	000301	东方盛虹	7, 055, 298. 00	3. 10
84	002791	坚朗五金	7, 000, 025. 00	3. 08
85	600563	法拉电子	6, 929, 021. 00	3. 05
_				

86	600160	巨化股份	6, 916, 629. 00	3. 04
87	600329	中新药业	6, 912, 651. 00	3. 04
88	601098	中南传媒	6, 897, 814. 00	3. 03
89	603317	天味食品	6, 847, 852. 10	3. 01
90	002683	宏大爆破	6, 843, 348. 00	3. 01
91	300482	万孚生物	6, 838, 063. 00	3. 01
92	601717	郑煤机	6, 837, 312. 00	3. 01
93	603225	新凤鸣	6, 833, 610. 00	3. 00
94	600985	淮北矿业	6, 829, 106. 45	3. 00
95	603338	浙江鼎力	6, 787, 428. 40	2. 98
96	600699	均胜电子	6, 777, 335. 69	2. 98
97	300072	三聚环保	6, 765, 896. 00	2. 97
98	300024	机器人	6, 765, 463. 84	2. 97
99	002183	怡亚通	6, 724, 048. 00	2. 96
100	300012	华测检测	6, 691, 774. 00	2. 94
101	600350	山东高速	6, 656, 658. 00	2. 93
102	002797	第一创业	6, 649, 502. 00	2. 92
103	600580	卧龙电驱	6, 599, 942. 82	2. 90
104	000998	隆平高科	6, 567, 661. 05	2. 89
105	600535	天士力	6, 563, 642. 60	2.89
106	000090	天健集团	6, 537, 312. 00	2. 87
107	601128	常熟银行	6, 474, 626. 00	2. 85
108	600060	海信视像	6, 419, 709. 51	2. 82
109	600529	山东药玻	6, 369, 523. 56	2. 80
110	600158	中体产业	6, 367, 429. 34	2. 80
111	600260	凯乐科技	6, 352, 951. 00	2. 79
112	601611	中国核建	6, 351, 958. 00	2. 79
113	000750	国海证券	6, 321, 738. 00	2. 78
114	002317	众生药业	6, 319, 068. 06	2. 78
115	002831	裕同科技	6, 262, 921. 00	2. 75
116	000799	酒鬼酒	6, 179, 482. 00	2. 72
117	600642	申能股份	6, 157, 882. 41	2. 71
118	002155	湖南黄金	6, 129, 761. 00	2. 69
119	600733	北汽蓝谷	6, 114, 721. 00	2. 69
120	601168	西部矿业	6, 103, 793. 00	2. 68
121	300058	蓝色光标	6, 076, 382. 00	2. 67

122   002946   新乳业   6,068,001.26   2.67     123   300244   迪安冷断   6,057,260.78   2.66     124   603983   丸美取份   6,054,556.79   2.66     125   660398   海浦之家   5,924,058.00   2.60     126   600497   地交特替   5,887,163.00   2.59     127   002353   杰瑞股份   5,886,564.28   2.59     128   000009   中国宝安   5,885,750.00   2.59     129   300010   豆神教育   5,864,964.82   2.58     130   002985   北摩高科   5,806,890.73   2.55     131   603806   福斯特   5,800,784.00   2.55     132   603260   企確性业   5,792,707.60   2.55     133   601928   风风传媒   5,792,036.75   2.55     134   603816   順家家居   5,783,934.88   2.54     135   002396   星四曼徒   5,780,057.00   2.54     136   688099   品足股份   5,693,275.02   2.50     137   000729   熊京啤酒   5,682,131.00   2.50     138   002385   大北衣   5,677,144.00   2.50     140   600956   新天緑能   5,662,259.00   2.49     141   600315   上海家化   5,622,544.65   2.47     142   000990   滅志股份   5,622,944.65   2.47     143   600155   华砂阳安   5,622,446.52   2.47     144   000636   风华高科   5,546,567.67   2.44     145   603893   海遊歌   5,546,567.67   2.44     146   600171   上海贝岭   5,546,056.57   2.44     147   600338   西藏珠峰   5,540,113.08   2.44     148   600068   海洲坝   5,538,539.00   2.44     149   600782   新部財   5,513,258.00   2.49     150   600039   四川路桥   5,513,258.00   2.49     151   600704   物产中大   5,499,280.00   2.42     152   002572   索菲亚   5,481,226.00   2.41     153   601598   中国外运   5,543,471.85   2.35     156   603290   那达半号   5,403,397.00   2.38     157   600801   华新水泥   5,343,471.85   2.35					
124       603983       丸美股份       6,054,556.79       2.66         125       600398       海澜之家       5,924,058.00       2.60         126       600497       雖玄锌锗       5,887,163.00       2.59         127       002353       杰瑞股份       5,886,564.28       2.59         128       000009       中国宝安       5,885,750.00       2.59         129       300010       豆种教育       5,864,964.82       2.58         130       002985       北摩高科       5,805,890.73       2.55         131       603806       福斯特       5,800,784.00       2.55         132       603260       合産硅建业       5,792,707.60       2.55         133       601928       风屋传媒       5,792,036.75       2.55         134       603816       順家家居       5,783,934.88       2.54         135       002396       星网锁捷       5,780,057.00       2.54         136       688099       品层股份       5,693,275.02       2.50         137       000729       熊京啤酒       5,682,131.00       2.50         138       002385       大北农       5,677,144.00       2.50         139       600820       隧道股份       5,622,259.00       2.49 </td <td>122</td> <td>002946</td> <td>新乳业</td> <td>6, 068, 001. 26</td> <td>2. 67</td>	122	002946	新乳业	6, 068, 001. 26	2. 67
125   600398   海湖之家   5,924,058.00   2.60     126   600497   地玄铃ל   5,887,163.00   2.59     127   002353   杰瑞股份   5,886,564.28   2.59     128   000009   中国宝安   5,885,750.00   2.59     129   300010   豆汁教育   5,864,964.82   2.58     130   002985   北摩高科   5,805,890.73   2.55     131   603806   福斯特   5,800,784.00   2.55     132   603260   合盛硅业   5,792,707.60   2.55     133   601928   风屋传媒   5,792,036.75   2.55     134   603816   陳家家居   5,783,934.88   2.54     135   002396   星四锐捷   5,780,057.00   2.54     136   688099   晶层股份   5,693,275.02   2.50     137   000729   燕京啤酒   5,682,131.00   2.50     138   002385   大北衣   5,677,144.00   2.50     139   600820   隆道股份   5,662,259.00   2.49     140   600956   新天欽能   5,648,755.00   2.48     141   600315   上海家化   5,622,944.65   2.47     142   000990   诚志股份   5,622,944.65   2.47     143   600155   华创阳安   5,562,468.52   2.47     144   000636   风华高科   5,562,468.52   2.47     145   603893   ၂萬古敬   5,546,567.67   2.44     146   600171   上海贝岭   5,546,056.57   2.44     147   600338   西藏珠峰   5,540,113.08   2.44     148   600068   高洲坝   5,538,539.00   2.44     149   600782   新朝股份   5,517,848.00   2.45     149   600782   新朝股份   5,517,848.00   2.45     150   600039   四川路桥   5,513,258.00   2.42     151   600704   物产中大   5,499,280.00   2.42     153   601598   中国外运   5,477,666.00   2.41     154   600728   佳都科技   5,459,636.00   2.40     155   000967   盈峰环境   5,403,397.00   2.38     156   603290   斯达半导   5,403,397.00   2.38	123	300244	迪安诊断	6, 057, 260. 78	2. 66
126       600497       熟密锌锗       5,887,163.00       2.59         127       002353       杰瑞胺份       5,886,564.28       2.59         128       000009       中国宝安       5,885,760.00       2.59         129       300010       豆种教育       5,864,964.82       2.58         130       002985       北摩商科       5,805,890.73       2.55         131       603806       福斯特       5,800,784.00       2.55         132       603260       合盛硅业       5,792,707.60       2.55         133       601928       风风度传媒       5,792,036.75       2.55         134       603816       顾家家居       5,783,934.88       2.54         135       002396       星网锐捷       5,780,057.00       2.54         136       688099       晶晨股份       5,693,275.02       2.50         137       000729       燕京啤酒       5,682,131.00       2.50         138       002385       大北农       5,677,144.00       2.50         139       600820       隧道股份       5,682,259.00       2.49         140       600956       新天綠能       5,622,590.00       2.49         141       600315       上海家化       5,622,944.65       2.47 </td <td>124</td> <td>603983</td> <td>丸美股份</td> <td>6, 054, 556. 79</td> <td>2. 66</td>	124	603983	丸美股份	6, 054, 556. 79	2. 66
127       002353       杰瑞股份       5,886,564.28       2.59         128       000009       中国宝安       5,885,750.00       2.59         129       300010       豆神教育       5,864,964.82       2.58         130       002985       北摩高科       5,805,890.73       2.55         131       603806       福斯特       5,800,784.00       2.55         132       603260       合盛硅业       5,792,707.60       2.55         133       601928       风風传媒       5,792,036.75       2.55         134       603816       顾家家居       5,783,934.88       2.54         135       002396       星网锐捷       5,780,057.00       2.54         136       688099       晶晨股份       5,693,275.02       2.50         137       000729       燕京啤酒       5,682,131.00       2.50         138       002385       大北衣       5,677,144.00       2.50         139       600820       隧道股份       5,662,259.00       2.49         140       600956       新天绿能       5,618,755.00       2.48         141       600315       上海家化       5,622,944.65       2.47         142       000990       域志股份       5,622,944.65       2.47 <td>125</td> <td>600398</td> <td>海澜之家</td> <td>5, 924, 058. 00</td> <td>2.60</td>	125	600398	海澜之家	5, 924, 058. 00	2.60
128   000009 中国宝安   5,885,750.00   2.59     129   300010   豆神教育   5,864,964.82   2.58     130   002985   北摩商科   5,805,890.73   2.55     131   603806   福斯特   5,800,784.00   2.55     132   603260   合盛住业   5,792,707.60   2.55     133   601928   风凰传媒   5,792,036.75   2.55     134   603816   顾家家居   5,783,934.88   2.54     135   002396   星网锐捷   5,780,057.00   2.54     136   688099   品晨股份   5,693,275.02   2.50     137   000729   燕京啤酒   5,682,131.00   2.50     138   002385   大北农   5,677,144.00   2.50     139   600820   隧道股份   5,693,275.00   2.49     140   600956   新天緑館   5,648,755.00   2.48     141   600315   上海家化   5,627,559.00   2.47     142   000990   城志股份   5,622,944.65   2.47     143   600155   华创阳安   5,622,468.52   2.47     144   00636   风华高科   5,568,188.00   2.45     145   603893   瑞芯微   5,546,567.67   2.44     146   600171   上海贝岭   5,546,056.57   2.44     147   600338   西藏珠峰   5,540,113.08   2.44     148   60068   西湖珠峰   5,510,113.08   2.44     149   600782   新朝股份   5,517,848.00   2.43     150   600039   四川路桥   5,518,258.00   2.42     151   600704   物)中中大   5,499,280.00   2.42     152   002572   索菲亚   5,481,226.00   2.41     153   601598   中国外运   5,477,666.00   2.41     154   600728   佳都科技   5,459,636.00   2.40     155   000967   盆峰环境   5,403,397.00   2.38     156   603290   新达半导   5,403,397.00   2.38	126	600497	驰宏锌锗	5, 887, 163. 00	2. 59
129       300010       豆神教育       5,864,964.82       2.58         130       002985       北摩高科       5,805,890.73       2.55         131       603806       福斯特       5,800,784.00       2.55         132       603260       合盛柱业       5,792,707.60       2.55         133       601928       凤凰传媒       5,792,036.75       2.55         134       603816       顾家家居       5,783,934.88       2.54         135       002396       星网锐捷       5,780,057.00       2.54         136       688099       品层股份       5,693,275.02       2.50         137       000729       燕京啤酒       5,682,131.00       2.50         138       002385       大北农       5,677,144.00       2.50         139       600820       隧道股份       5,662,259.00       2.49         140       600956       新天绿能       5,648,755.00       2.48         141       600315       上海家化       5,627,559.00       2.47         142       000990       滅志股份       5,622,944.65       2.47         144       000636       风华高和       5,568,188.00       2.45         145       603893       瑞老衛       5,568,188.00       2.44 <td>127</td> <td>002353</td> <td>杰瑞股份</td> <td>5, 886, 564. 28</td> <td>2. 59</td>	127	002353	杰瑞股份	5, 886, 564. 28	2. 59
130   002985   北摩高科	128	000009	中国宝安	5, 885, 750. 00	2. 59
131   603806   福斯特	129	300010	豆神教育	5, 864, 964. 82	2. 58
132   603260   合盛佳业   5,792,707.60   2.55     133   601928   凤凰传媒   5,792,036.75   2.55     134   603816   顾家家居   5,783,934.88   2.54     135   002396   星网锐捷   5,780,057.00   2.54     136   688099   届晨股份   5,693,275.02   2.50     137   000729   燕京啤酒   5,682,131.00   2.50     138   002385   大北农   5,677,144.00   2.50     139   600820   隧道股份   5,662,259.00   2.49     140   600956   新天绿能   5,648,755.00   2.48     141   600315   上海家化   5,627,559.00   2.47     142   000990   诚志股份   5,622,944.65   2.47     143   600155   华创阳安   5,622,468.52   2.47     144   000636   风华高科   5,568,188.00   2.45     145   603893   瑞芯微   5,546,567.67   2.44     146   600171   上海贝岭   5,546,056.57   2.44     147   600338   西藤珠峰   5,540,113.08   2.44     148   600068   蔣州坝   5,538,539.00   2.44     149   600782   新翎股份   5,513,258.00   2.42     150   600039   四川路桥   5,513,258.00   2.42     151   600704   物产中大   5,499,280.00   2.42     152   002572   索非亚   5,481,226.00   2.41     153   601598   中国外运   5,477,666.00   2.41     154   600728   佳都科技   5,459,636.00   2.40     155   000967   盈峰环境   5,403,397.00   2.38     156   603290   斯达半导   5,403,397.00   2.38	130	002985	北摩高科	5, 805, 890. 73	2. 55
133   601928   凤風传媒   5,792,036.75   2.55     134   603816   顾家家居   5,783,934.88   2.54     135   002396   星网锐捷   5,780,057.00   2.54     136   688099   届晨股份   5,693,275.02   2.50     137   000729   燕京啤酒   5,682,131.00   2.50     138   002385   大北农   5,677,144.00   2.50     139   600820   隧道股份   5,662,259.00   2.49     140   600956   新天绿能   5,648,755.00   2.48     141   600315   上海家化   5,627,559.00   2.47     142   000990   诚志股份   5,622,944.65   2.47     143   600155   华创阳安   5,522,468.52   2.47     144   000636   风华高科   5,568,188.00   2.45     145   603893   瑞志微   5,546,567.67   2.44     146   600171   上海贝岭   5,546,056.57   2.44     147   600338   西藏珠峰   5,540,113.08   2.44     148   600068   葛洲坝   5,538,539.00   2.44     149   600782   新钢股份   5,517,848.00   2.43     150   600039   四川路桥   5,513,258.00   2.42     151   600704   物产中大   5,499,280.00   2.42     152   002572   索菲亚   5,481,226.00   2.41     153   601598   中国外运   5,477,666.00   2.41     154   600728   佳都科技   5,459,636.00   2.40     155   000967   盈峰环境   5,403,397.00   2.38     156   603290   斯达半导   5,403,397.00   2.38     156   603290   斯达半导   5,403,397.00   2.38     156   603290   斯达半导   5,403,397.00   2.38     157   100000000000000000000000000000000000	131	603806	福斯特	5, 800, 784. 00	2. 55
134   603816   顾家家居   5,783,934.88   2.54     135   002396   星网锐捷   5,780,057.00   2.54     136   688099   晶晨股份   5,693,275.02   2.50     137   000729   燕京啤酒   5,682,131.00   2.50     138   002385   大北农   5,677,144.00   2.50     139   600820   隧道股份   5,662,259.00   2.49     140   600956   新天緑能   5,648,755.00   2.48     141   600315   上海家化   5,627,559.00   2.47     142   000990   诚志股份   5,622,944.65   2.47     143   600155   华创阳安   5,622,468.52   2.47     144   000636   风华高科   5,568,188.00   2.45     145   603893   瑞芯微   5,546,567.67   2.44     146   600171   上海贝岭   5,546,056.57   2.44     147   600338   西藏珠峰   5,540,113.08   2.44     148   600068   葛洲坝   5,538,539.00   2.44     149   600782   新钢股份   5,517,848.00   2.43     150   600039   四川路桥   5,513,258.00   2.42     151   600704   物产中大   5,499,280.00   2.42     152   002572   索非亚   5,481,260.00   2.41     154   600728   佳都科技   5,459,636.00   2.40     155   000967   盈峰环境   5,436,709.07   2.39     156   603290   斯达半导   5,403,397.00   2.38	132	603260	合盛硅业	5, 792, 707. 60	2. 55
135       002396       星网锐捷       5,780,057.00       2.54         136       688099       晶晨股份       5,693,275.02       2.50         137       000729       燕京啤酒       5,682,131.00       2.50         138       002385       大北农       5,677,144.00       2.50         139       600820       隧道股份       5,662,259.00       2.49         140       600956       新天绿能       5,648,755.00       2.48         141       600315       上海家化       5,627,559.00       2.47         142       000990       诚志股份       5,622,944.65       2.47         143       600155       华创阳安       5,622,468.52       2.47         144       000636       风华高科       5,568,188.00       2.45         145       603893       瑞志徽       5,546,567.67       2.44         146       600171       上海贝岭       5,546,056.57       2.44         147       600338       西藏珠峰       5,540,113.08       2.44         149       600782       新翎股份       5,517,848.00       2.43         150       600039       四川路桥       5,513,258.00       2.42         151       600704       物产中大       5,499,280.00       2.42 <td>133</td> <td>601928</td> <td>凤凰传媒</td> <td>5, 792, 036. 75</td> <td>2. 55</td>	133	601928	凤凰传媒	5, 792, 036. 75	2. 55
136       688099       晶晨股份       5,693,275.02       2.50         137       000729       燕京啤酒       5,682,131.00       2.50         138       002385       大北农       5,677,144.00       2.50         139       600820       隧道股份       5,662,259.00       2.49         140       600956       新天緑能       5,648,755.00       2.48         141       600315       上海家化       5,627,559.00       2.47         142       000990       诚志股份       5,622,944.65       2.47         143       600155       华创阳安       5,622,468.52       2.47         144       000636       风华高科       5,568,188.00       2.45         145       63893       瑞芯徽       5,546,567.67       2.44         146       600171       上海贝岭       5,546,056.57       2.44         147       600338       西藏珠峰       5,540,113.08       2.44         149       600782       新钢股份       5,517,848.00       2.43         150       600039       四川路桥       5,513,258.00       2.42         151       600704       物产中大       5,499,280.00       2.42         152       002572       索菲亚       5,481,226.00       2.41	134	603816	顾家家居	5, 783, 934. 88	2. 54
137   000729   燕京啤酒   5,682,131.00   2.50     138   002385   大北农   5,677,144.00   2.50     139   600820   隆道股份   5,662,259.00   2.49     140   600956   新天绿能   5,648,755.00   2.48     141   600315   上海家化   5,627,559.00   2.47     142   000990   诚志股份   5,622,944.65   2.47     143   600155   华创阳安   5,622,468.52   2.47     144   000636   风华高科   5,568,188.00   2.45     145   603893   瑞芯徽   5,546,567.67   2.44     146   600171   上海贝岭   5,546,056.57   2.44     147   600338   西藏珠峰   5,540,113.08   2.44     148   600068   葛洲坝   5,538,539.00   2.44     149   600782   新钢股份   5,517,848.00   2.43     150   600039   四川路桥   5,513,258.00   2.42     151   600704   物产中大   5,499,280.00   2.42     152   002572   索非亚   5,481,226.00   2.41     153   601598   中国外运   5,477,666.00   2.41     154   600728   佳都科技   5,459,636.00   2.40     155   000967   盈峰环境   5,403,397.00   2.38     156   603290   斯达半导   5,403,397.00   2.38	135	002396	星网锐捷	5, 780, 057. 00	2. 54
138       002385       大北农       5,677,144.00       2.50         139       600820       隧道股份       5,662,259.00       2.49         140       600956       新天绿能       5,648,755.00       2.48         141       600315       上海家化       5,627,559.00       2.47         142       000990       诚志股份       5,622,944.65       2.47         143       600155       华创阳安       5,562,468.52       2.47         144       00636       风华高科       5,568,188.00       2.45         145       603893       瑞芯徽       5,546,567.67       2.44         146       600171       上海贝岭       5,546,056.57       2.44         147       600338       西藏珠峰       5,540,113.08       2.44         148       60068       葛洲坝       5,538,539.00       2.44         149       600782       新钢股份       5,517,848.00       2.43         150       600039       四川路桥       5,513,258.00       2.42         151       600704       物产中大       5,499,280.00       2.42         152       002572       索菲亚       5,481,226.00       2.41         153       601598       中国外运       5,477,666.00       2.41	136	688099	晶晨股份	5, 693, 275. 02	2. 50
139   600820   隧道股份   5,662,259.00   2.49     140   600956   新天绿能   5,648,755.00   2.48     141   600315   上海家化   5,627,559.00   2.47     142   000990   诚志股份   5,622,944.65   2.47     143   600155   华创阳安   5,622,468.52   2.47     144   000636   风华高科   5,568,188.00   2.45     145   603893   瑞志微   5,546,567.67   2.44     146   600171   上海贝岭   5,546,056.57   2.44     147   600338   西藏珠峰   5,540,113.08   2.44     148   600068   葛洲坝   5,538,539.00   2.44     149   600782   新钢股份   5,517,848.00   2.43     150   600039   四川路桥   5,513,258.00   2.42     151   600704   物产中大   5,499,280.00   2.42     152   002572   索菲亚   5,481,226.00   2.41     153   601598   中国外运   5,477,666.00   2.41     154   600728   佳都科技   5,459,636.00   2.40     155   000967   盈峰环境   5,436,709.07   2.39     156   603290   斯达半导   5,403,397.00   2.38	137	000729	燕京啤酒	5, 682, 131. 00	2. 50
140       600956       新天緑能       5,648,755.00       2.48         141       600315       上海家化       5,627,559.00       2.47         142       000990       诚志股份       5,622,944.65       2.47         143       600155       华创阳安       5,622,468.52       2.47         144       000636       风华高科       5,568,188.00       2.45         145       603893       瑞芯微       5,546,567.67       2.44         146       600171       上海贝岭       5,546,056.57       2.44         147       600338       西藏珠峰       5,540,113.08       2.44         148       60068       葛洲坝       5,538,539.00       2.44         149       600782       新钢股份       5,517,848.00       2.43         150       600039       四川路桥       5,513,258.00       2.42         151       600704       物产中大       5,499,280.00       2.42         152       002572       索菲亚       5,481,226.00       2.41         153       601598       中国外运       5,477,666.00       2.41         154       600728       佳都科技       5,436,709.07       2.39         155       000967       盈峰环境       5,436,709.07       2.39	138	002385	大北农	5, 677, 144. 00	2. 50
141       600315       上海家化       5,627,559.00       2.47         142       000990       诚志股份       5,622,944.65       2.47         143       600155       华创阳安       5,622,468.52       2.47         144       000636       风华高科       5,568,188.00       2.45         145       603893       瑞芯徽       5,546,567.67       2.44         146       600171       上海贝岭       5,546,056.57       2.44         147       60038       西藏珠峰       5,540,113.08       2.44         148       60068       葛洲坝       5,538,539.00       2.44         149       600782       新钢股份       5,517,848.00       2.43         150       600039       四川路桥       5,513,258.00       2.42         151       600704       物产中大       5,499,280.00       2.42         152       002572       索菲亚       5,481,226.00       2.41         153       601598       中国外运       5,477,666.00       2.41         154       600728       佳都科技       5,459,636.00       2.40         155       000967       盈峰环境       5,403,397.00       2.39         156       603290       斯达半导       5,403,397.00       2.38	139	600820	隧道股份	5, 662, 259. 00	2. 49
142       000990       诚志股份       5, 622, 944. 65       2. 47         143       600155       华创阳安       5, 622, 468. 52       2. 47         144       000636       风华高科       5, 568, 188. 00       2. 45         145       603893       瑞芯微       5, 546, 567. 67       2. 44         146       600171       上海贝岭       5, 546, 056. 57       2. 44         147       600338       西藏珠峰       5, 540, 113. 08       2. 44         148       600068       葛洲坝       5, 538, 539. 00       2. 44         149       600782       新钢股份       5, 517, 848. 00       2. 43         150       600039       四川路桥       5, 513, 258. 00       2. 42         151       600704       物产中大       5, 499, 280. 00       2. 42         152       002572       索菲亚       5, 481, 226. 00       2. 41         153       601598       中国外运       5, 477, 666. 00       2. 41         154       600728       佳都科技       5, 459, 636. 00       2. 40         155       000967       盈峰环境       5, 436, 709. 07       2. 39         156       603290       斯达半导       5, 403, 397. 00       2. 38	140	600956	新天绿能	5, 648, 755. 00	2. 48
143       600155       华创阳安       5,622,468.52       2.47         144       000636       风华高科       5,568,188.00       2.45         145       603893       瑞芯微       5,546,567.67       2.44         146       600171       上海贝岭       5,546,056.57       2.44         147       600338       西藏珠峰       5,540,113.08       2.44         148       600068       葛洲坝       5,538,539.00       2.44         149       600782       新钢股份       5,517,848.00       2.43         150       600039       四川路桥       5,513,258.00       2.42         151       600704       物产中大       5,499,280.00       2.42         152       002572       索菲亚       5,481,226.00       2.41         153       601598       中国外运       5,477,666.00       2.41         154       600728       佳都科技       5,459,636.00       2.40         155       000967       盈峰环境       5,436,709.07       2.39         156       603290       斯达半导       5,403,397.00       2.38	141	600315	上海家化	5, 627, 559. 00	2. 47
144       000636       风华高科       5,568,188.00       2.45         145       603893       瑞芯微       5,546,567.67       2.44         146       600171       上海贝岭       5,546,056.57       2.44         147       600338       西藏珠峰       5,540,113.08       2.44         148       600068       葛洲坝       5,538,539.00       2.44         149       600782       新钢股份       5,517,848.00       2.43         150       600039       四川路桥       5,513,258.00       2.42         151       600704       物产中大       5,499,280.00       2.42         152       002572       索菲亚       5,481,226.00       2.41         153       601598       中国外运       5,477,666.00       2.41         154       600728       佳都科技       5,459,636.00       2.40         155       000967       盈峰环境       5,436,709.07       2.39         156       603290       斯达半导       5,403,397.00       2.38	142	000990	诚志股份	5, 622, 944. 65	2. 47
145       603893       瑞芯微       5,546,567.67       2.44         146       600171       上海贝岭       5,546,056.57       2.44         147       600338       西藏珠峰       5,540,113.08       2.44         148       600068       葛洲坝       5,538,539.00       2.44         149       600782       新钢股份       5,517,848.00       2.43         150       600039       四川路桥       5,513,258.00       2.42         151       600704       物产中大       5,499,280.00       2.42         152       002572       索菲亚       5,481,226.00       2.41         153       601598       中国外运       5,477,666.00       2.41         154       600728       佳都科技       5,459,636.00       2.40         155       000967       盈峰环境       5,436,709.07       2.39         156       603290       斯达半导       5,403,397.00       2.38	143	600155	华创阳安	5, 622, 468. 52	2. 47
146       600171       上海贝岭       5,546,056.57       2.44         147       600338       西藏珠峰       5,540,113.08       2.44         148       600068       葛洲坝       5,538,539.00       2.44         149       600782       新钢股份       5,517,848.00       2.43         150       600039       四川路桥       5,513,258.00       2.42         151       600704       物产中大       5,499,280.00       2.42         152       002572       索菲亚       5,481,226.00       2.41         153       601598       中国外运       5,477,666.00       2.41         154       600728       佳都科技       5,459,636.00       2.40         155       000967       盈峰环境       5,436,709.07       2.39         156       603290       斯达半导       5,403,397.00       2.38	144	000636	风华高科	5, 568, 188. 00	2. 45
147       600338       西藏珠峰       5,540,113.08       2.44         148       600068       葛洲坝       5,538,539.00       2.44         149       600782       新钢股份       5,517,848.00       2.43         150       600039       四川路桥       5,513,258.00       2.42         151       600704       物产中大       5,499,280.00       2.42         152       002572       索菲亚       5,481,226.00       2.41         153       601598       中国外运       5,477,666.00       2.41         154       600728       佳都科技       5,459,636.00       2.40         155       000967       盈峰环境       5,436,709.07       2.39         156       603290       斯达半导       5,403,397.00       2.38	145	603893	瑞芯微	5, 546, 567. 67	2. 44
148       600068       葛洲坝       5,538,539.00       2.44         149       600782       新钢股份       5,517,848.00       2.43         150       600039       四川路桥       5,513,258.00       2.42         151       600704       物产中大       5,499,280.00       2.42         152       002572       索菲亚       5,481,226.00       2.41         153       601598       中国外运       5,477,666.00       2.41         154       600728       佳都科技       5,459,636.00       2.40         155       000967       盈峰环境       5,436,709.07       2.39         156       603290       斯达半导       5,403,397.00       2.38	146	600171	上海贝岭	5, 546, 056. 57	2. 44
149       600782       新钢股份       5,517,848.00       2.43         150       600039       四川路桥       5,513,258.00       2.42         151       600704       物产中大       5,499,280.00       2.42         152       002572       索菲亚       5,481,226.00       2.41         153       601598       中国外运       5,477,666.00       2.41         154       600728       佳都科技       5,459,636.00       2.40         155       000967       盈峰环境       5,436,709.07       2.39         156       603290       斯达半导       5,403,397.00       2.38	147	600338	西藏珠峰	5, 540, 113. 08	2. 44
150       600039       四川路桥       5,513,258.00       2.42         151       600704       物产中大       5,499,280.00       2.42         152       002572       索菲亚       5,481,226.00       2.41         153       601598       中国外运       5,477,666.00       2.41         154       600728       佳都科技       5,459,636.00       2.40         155       000967       盈峰环境       5,436,709.07       2.39         156       603290       斯达半导       5,403,397.00       2.38	148	600068	葛洲坝	5, 538, 539. 00	2. 44
151     600704     物产中大     5, 499, 280. 00     2. 42       152     002572     索菲亚     5, 481, 226. 00     2. 41       153     601598     中国外运     5, 477, 666. 00     2. 41       154     600728     佳都科技     5, 459, 636. 00     2. 40       155     000967     盈峰环境     5, 436, 709. 07     2. 39       156     603290     斯达半导     5, 403, 397. 00     2. 38	149	600782	新钢股份	5, 517, 848. 00	2. 43
152     002572     索菲亚     5,481,226.00     2.41       153     601598     中国外运     5,477,666.00     2.41       154     600728     佳都科技     5,459,636.00     2.40       155     000967     盈峰环境     5,436,709.07     2.39       156     603290     斯达半导     5,403,397.00     2.38	150	600039	四川路桥	5, 513, 258. 00	2. 42
153     601598     中国外运     5,477,666.00     2.41       154     600728     佳都科技     5,459,636.00     2.40       155     000967     盈峰环境     5,436,709.07     2.39       156     603290     斯达半导     5,403,397.00     2.38	151	600704	物产中大	5, 499, 280. 00	2. 42
154       600728       佳都科技       5, 459, 636. 00       2. 40         155       000967       盈峰环境       5, 436, 709. 07       2. 39         156       603290       斯达半导       5, 403, 397. 00       2. 38	152	002572	索菲亚	5, 481, 226. 00	2. 41
155     000967     盈峰环境     5,436,709.07     2.39       156     603290     斯达半导     5,403,397.00     2.38	153	601598	中国外运	5, 477, 666. 00	2. 41
156 603290 斯达半导 5,403,397.00 2.38	154	600728	佳都科技	5, 459, 636. 00	2. 40
	155	000967	盈峰环境	5, 436, 709. 07	2. 39
157 600801 华新水泥 5,343,471.85 2.35	156	603290	斯达半导	5, 403, 397. 00	2. 38
	157	600801	华新水泥	5, 343, 471. 85	2. 35

158	002595	豪迈科技	5, 326, 855. 94	2. 34
159	603198	迎驾贡酒	5, 276, 874. 13	2. 32
160	002048	宁波华翔	5, 226, 703. 73	2. 30
161	600143	金发科技	5, 184, 454. 00	2. 28
162	600188	兖州煤业	5, 157, 741. 66	2. 27
163	603737	三棵树	5, 114, 530. 28	2. 25
164	600006	东风汽车	5, 102, 815. 02	2. 24
165	600177	雅戈尔	5, 090, 707. 04	2. 24
166	300285	国瓷材料	5, 077, 344. 00	2. 23
167	600787	中储股份	5, 076, 196. 00	2. 23
168	002030	达安基因	5, 042, 395. 42	2. 22
169	603786	科博达	5, 026, 632. 00	2. 21
170	000039	中集集团	5, 022, 147. 60	2. 21
171	000739	普洛药业	5, 017, 040. 40	2. 21
172	002701	奥瑞金	5, 012, 699. 15	2. 20
173	600373	中文传媒	5, 009, 512. 00	2. 20
174	600120	浙江东方	4, 994, 142. 10	2. 20
175	600507	方大特钢	4, 979, 875. 00	2. 19
176	002174	游族网络	4, 964, 739. 00	2. 18
177	002920	德赛西威	4, 921, 489. 00	2. 16
178	601636	旗滨集团	4, 917, 760. 00	2. 16
179	002408	齐翔腾达	4, 912, 520. 08	2. 16
180	000887	中鼎股份	4, 883, 907. 91	2. 15
181	002299	圣农发展	4, 873, 846. 00	2. 14
182	600053	九鼎投资	4, 825, 439. 00	2. 12
183	600556	天下秀	4, 809, 055. 00	2. 11
184	000623	吉林敖东	4, 800, 005. 22	2. 11
185	300316	晶盛机电	4, 776, 154. 00	2. 10
186	300017	网宿科技	4, 770, 655. 00	2. 10
187	601828	美凯龙	4, 735, 315. 50	2. 08
188	600195	中牧股份	4, 718, 205. 04	2. 07
189	002221	东华能源	4, 708, 799. 00	2. 07
190	000501	鄂武商 A	4, 707, 616. 94	2. 07
191	000975	银泰黄金	4, 706, 431. 76	2. 07
192	002926	华西证券	4, 680, 055. 00	2. 06
193	002242	九阳股份	4, 665, 197. 00	2. 05
			<del></del>	

194	600729	重庆百货	4, 644, 928. 00	2.04
195	002013	中航机电	4, 616, 479. 00	2. 03
196	300037	新宙邦	4, 571, 611. 00	2. 01

注: "买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

下号   股票名称					と以下 団・ ノマグラウ
2       600132       重庆啤酒       13,812,617.40       6.6         3       603486       科沃斯       13,422,677.00       5.6         4       601233       桐昆股份       13,321,095.38       5.6         5       002250       联化科技       13,164,764.16       5.7         6       603444       吉比特       12,926,878.00       5.6         7       600884       杉杉股份       12,922,741.60       5.6         8       601799       星宇股份       12,910,738.01       5.6         9       002709       天赐材料       12,852,410.90       5.6         10       002138       顺绛电子       12,575,174.00       5.6         11       600827       百联股份       11,875,970.00       5.2         12       600426       华鲁恒升       11,624,447.40       5.1         13       600258       首旅酒店       11,491,312.13       5.6         14       300496       中科创达       11,253,056.10       4.5         15       300357       我武生物股份       10,874,043.00       4.7         16       600201       生物股份       10,894,889.15       4.8         16       600216       浙江医药       10,809,732.00       4.7	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(%)
3       603486       科沃斯       13, 422, 677. 00       5.6         4       601233       桐昆股份       13, 321, 095. 38       5.8         5       002250       联化科技       13, 164, 764. 16       5.7         6       603444       吉比特       12, 926, 878. 00       5.6         7       600884       杉杉股份       12, 922, 741. 60       5.6         8       601799       星宇股份       12, 910, 738. 01       5.6         9       002709       天賜材料       12, 852, 410. 90       5.6         10       002138       顺络电子       12, 575, 174. 00       5.6         11       600827       百联股份       11, 875, 970. 00       5.2         12       600426       华鲁恒升       11, 624, 447. 40       5.1         13       600258       首旅酒店       11, 491, 312. 13       5.6         14       300496       中科创达       11, 253, 056. 10       4.5         15       300357       我武生物       10, 984, 889. 15       4.8         16       600201       生物股份       10, 874, 043. 00       4.7         17       600216       浙江医药       10, 809, 732. 00       4.7         18       601966       玲珑轮胎       10, 798, 537.	1	300274	阳光电源	14, 265, 670. 00	6. 27
4 601233 桐昆股份 13, 321, 095. 38 5.8 5 002250 联化科技 13, 164, 764. 16 5.7 6 66 603444 吉比特 12, 926, 878. 00 5.6 7 600884 杉杉股份 12, 922, 741. 60 5.6 8 601799 星字股份 12, 910, 738. 01 5.6 9 002709 天賜材料 12, 852, 410. 90 5.6 10 002138 顺络电子 12, 575, 174. 00 5.8 11 600827 百联股份 11, 875, 970. 00 5.2 12 600426 华鲁恒升 11, 624, 447. 40 5.3 13 600258 首旅酒店 11, 491, 312. 13 5.6 14 300496 中科创达 11, 253, 056. 10 4.8 15 300357 我武生物 10, 984, 889. 15 4.8 16 600201 生物股份 10, 874, 043. 00 4.7 17 600216 浙江医药 10, 809, 732. 00 4.7 18 601966 玲珑轮胎 10, 798, 537. 39 4.7 19 000960 锡业股份 10, 695, 697. 05 4.7 20 600409 三友化工 10, 614, 520. 69 4.6 21 601689 拓普集团 10, 452, 624. 55 4.6 22 603882 金域医学 10, 411, 969. 00 4.8 24 300115 长盈精密 9, 914, 045. 20 4.3	2	600132	重庆啤酒	13, 812, 617. 40	6. 07
5       002250       联化科技       13, 164, 764. 16       5. 7         6       603444       吉比特       12, 926, 878. 00       5. 6         7       600884       杉杉股份       12, 922, 741. 60       5. 6         8       601799       星宇股份       12, 910, 738. 01       5. 6         9       002709       天赐材料       12, 852, 410. 90       5. 6         10       002138       顺络电子       12, 575, 174. 00       5. 5         11       600827       百联股份       11, 875, 970. 00       5. 2         12       600426       华鲁恒升       11, 624, 447. 40       5. 1         13       600258       首旅酒店       11, 491, 312. 13       5. 6         14       300496       中科创达       11, 253, 056. 10       4. 8         15       300357       我武生物       10, 984, 889. 15       4. 8         16       600201       生物股份       10, 874, 043. 00       4. 7         17       600216       浙江医药       10, 809, 732. 00       4. 7         18       601966       玲珑轮胎       10, 798, 537. 39       4. 7         20       600409       三友化工       10, 614, 520. 69       4. 6         21       601689       拓普集团	3	603486	科沃斯	13, 422, 677. 00	5. 90
6 603444 吉比特 12,926,878.00 5.6 7 600884 杉杉股份 12,922,741.60 5.6 8 601799 星宇股份 12,910,738.01 5.6 9 002709 天赐材料 12,852,410.90 5.6 10 002138 顺络电子 12,575,174.00 5.5 11 600827 百联股份 11,875,970.00 5.2 12 600426 华鲁恒升 11,624,447.40 5.1 13 600258 首旅酒店 11,491,312.13 5.6 14 300496 中科创达 11,253,056.10 4.9 15 300357 我武生物 10,984,889.15 4.8 16 600201 生物股份 10,874,043.00 4.7 17 600216 浙江医药 10,809,732.00 4.7 18 601966 玲珑轮胎 10,798,537.39 4.7 19 000960 锡业股份 10,695,697.05 4.7 20 600409 三友化工 10,614,520.69 4.6 21 601689 拓普集团 10,452,624.55 4.6 22 603882 金域医学 10,411,969.00 4.8 23 000898 鞍钢股份 10,269,820.54 4.8 24 300115 长盈精密 9,914,045.20 4.3	4	601233	桐昆股份	13, 321, 095. 38	5. 86
7 600884 杉杉股份 12,922,741.60 5.6 8 601799 星宇股份 12,910,738.01 5.6 9 002709 天賜材料 12,852,410.90 5.6 10 002138 順络电子 12,575,174.00 5.5 11 600827 百联股份 11,875,970.00 5.2 12 600426 华鲁恒升 11,624,447.40 5.1 13 600258 首旅酒店 11,491,312.13 5.0 14 300496 中科创达 11,253,056.10 4.5 15 300357 我武生物 10,984,889.15 4.8 16 600201 生物股份 10,874,043.00 4.7 17 600216 浙江医药 10,809,732.00 4.7 18 601966 玲珑轮胎 10,798,537.39 4.7 19 000960 锡业股份 10,695,697.05 4.7 20 600409 三友化工 10,614,520.69 4.6 21 601689 拓普集团 10,452,624.55 4.6 22 603882 金域医学 10,411,969.00 4.3 23 000898 鞍钢股份 10,269,820.54 4.3 24 300115 长盈精密 9,914,045.20 4.3 25 600141 兴发集团 9,840,665.80 4.3	5	002250	联化科技	13, 164, 764. 16	5. 79
8       601799       星宇股份       12,910,738.01       5.6         9       002709       天赐材料       12,852,410.90       5.6         10       002138       顺络电子       12,575,174.00       5.8         11       600827       百联股份       11,875,970.00       5.2         12       600426       华鲁恒升       11,624,447.40       5.1         13       600258       首旅酒店       11,491,312.13       5.6         14       300496       中科创达       11,253,056.10       4.8         15       300357       我武生物       10,984,889.15       4.8         16       600201       生物股份       10,874,043.00       4.7         17       600216       浙江医药       10,809,732.00       4.3         18       601966       玲珑轮胎       10,798,537.39       4.3         19       000960       锡业股份       10,614,520.69       4.6         20       600409       三友化工       10,614,520.69       4.6         21       601689       拓普集团       10,452,624.55       4.6         22       603882       金域医学       10,411,969.00       4.8         23       000898       鞍钢股份       10,269,820.54       4.8	6	603444	吉比特	12, 926, 878. 00	5. 68
9       002709       天赐材料       12,852,410.90       5.6         10       002138       顺络电子       12,575,174.00       5.8         11       600827       百联股份       11,875,970.00       5.2         12       600426       华鲁恒升       11,624,447.40       5.1         13       600258       首旅酒店       11,491,312.13       5.6         14       300496       中科创达       11,253,056.10       4.9         15       300357       我武生物       10,984,889.15       4.8         16       600201       生物股份       10,874,043.00       4.7         17       600216       浙江医药       10,809,732.00       4.7         18       601966       玲珑轮胎       10,798,537.39       4.7         19       000960       锡业股份       10,695,697.05       4.7         20       60409       三友化工       10,614,520.69       4.6         21       601689       拓普集团       10,452,624.55       4.6         22       603882       金域医学       10,411,969.00       4.5         23       000898       鞍钢股份       10,269,820.54       4.5         24       300115       长盈精密       9,914,045.20       4.3	7	600884	杉杉股份	12, 922, 741. 60	5. 68
10       002138       顺络电子       12,575,174.00       5.5         11       600827       百联股份       11,875,970.00       5.2         12       600426       华鲁恒升       11,624,447.40       5.1         13       600258       首旅酒店       11,491,312.13       5.0         14       300496       中科创达       11,253,056.10       4.8         15       300357       我武生物       10,984,889.15       4.8         16       600201       生物股份       10,874,043.00       4.7         17       600216       浙江医药       10,809,732.00       4.7         18       601966       玲珑轮胎       10,798,537.39       4.7         19       000960       锡业股份       10,695,697.05       4.7         20       600409       三友化工       10,614,520.69       4.6         21       601689       拓普集团       10,452,624.55       4.6         22       603882       金域医学       10,411,969.00       4.5         23       000898       鞍钢股份       10,269,820.54       4.5         24       300115       长盈精密       9,914,045.20       4.5         25       600141       兴发集团       9,840,665.80       4.3    <	8	601799	星宇股份	12, 910, 738. 01	5. 68
11       600827       百联股份       11,875,970.00       5.2         12       600426       华鲁恒升       11,624,447.40       5.1         13       600258       首旅酒店       11,491,312.13       5.0         14       300496       中科创达       11,253,056.10       4.9         15       300357       我武生物       10,984,889.15       4.8         16       600201       生物股份       10,874,043.00       4.7         17       600216       浙江医药       10,809,732.00       4.7         18       601966       玲珑轮胎       10,798,537.39       4.7         19       000960       锡业股份       10,695,697.05       4.7         20       600409       三友化工       10,614,520.69       4.6         21       601689       拓普集团       10,452,624.55       4.6         22       603882       金域医学       10,411,969.00       4.5         23       000898       鞍钢股份       10,269,820.54       4.5         24       300115       长盈精密       9,914,045.20       4.3         25       600141       兴发集团       9,840,665.80       4.3	9	002709	天赐材料	12, 852, 410. 90	5. 65
12       600426       华鲁恒升       11,624,447.40       5.1         13       600258       首旅酒店       11,491,312.13       5.0         14       300496       中科创达       11,253,056.10       4.5         15       300357       我武生物       10,984,889.15       4.8         16       600201       生物股份       10,874,043.00       4.7         17       600216       浙江医药       10,809,732.00       4.7         18       601966       玲珑轮胎       10,798,537.39       4.7         19       000960       锡业股份       10,695,697.05       4.7         20       600409       三友化工       10,614,520.69       4.6         21       601689       拓普集团       10,452,624.55       4.6         22       603882       金域医学       10,411,969.00       4.5         23       000898       鞍钢股份       10,269,820.54       4.5         24       300115       长盈精密       9,914,045.20       4.3         25       600141       兴发集团       9,840,665.80       4.3	10	002138	顺络电子	12, 575, 174. 00	5. 53
13       600258       首旅酒店       11,491,312.13       5.6         14       300496       中科创达       11,253,056.10       4.9         15       300357       我武生物       10,984,889.15       4.8         16       600201       生物股份       10,874,043.00       4.7         17       600216       浙江医药       10,809,732.00       4.7         18       601966       玲珑轮胎       10,798,537.39       4.7         19       000960       锡业股份       10,695,697.05       4.7         20       600409       三友化工       10,614,520.69       4.6         21       601689       拓普集团       10,452,624.55       4.6         22       603882       金域医学       10,411,969.00       4.5         23       000898       鞍钢股份       10,269,820.54       4.5         24       300115       长盈精密       9,914,045.20       4.3         25       600141       兴发集团       9,840,665.80       4.3	11	600827	百联股份	11, 875, 970. 00	5. 22
14       300496       中科创达       11, 253, 056. 10       4. 9         15       300357       我武生物       10, 984, 889. 15       4. 8         16       600201       生物股份       10, 874, 043. 00       4. 7         17       600216       浙江医药       10, 809, 732. 00       4. 7         18       601966       玲珑轮胎       10, 798, 537. 39       4. 7         19       000960       锡业股份       10, 695, 697. 05       4. 7         20       600409       三友化工       10, 614, 520. 69       4. 6         21       601689       拓普集团       10, 452, 624. 55       4. 6         22       603882       金域医学       10, 411, 969. 00       4. 5         23       000898       鞍钢股份       10, 269, 820. 54       4. 5         24       300115       长盈精密       9, 914, 045. 20       4. 3         25       600141       兴发集团       9, 840, 665. 80       4. 3	12	600426	华鲁恒升	11, 624, 447. 40	5. 11
15       300357       我武生物       10,984,889.15       4.8         16       600201       生物股份       10,874,043.00       4.7         17       600216       浙江医药       10,809,732.00       4.7         18       601966       玲珑轮胎       10,798,537.39       4.7         19       000960       锡业股份       10,695,697.05       4.7         20       600409       三友化工       10,614,520.69       4.6         21       601689       拓普集团       10,452,624.55       4.6         22       603882       金域医学       10,411,969.00       4.5         23       000898       鞍钢股份       10,269,820.54       4.5         24       300115       长盈精密       9,914,045.20       4.3         25       600141       兴发集团       9,840,665.80       4.3	13	600258	首旅酒店	11, 491, 312. 13	5. 05
16       600201       生物股份       10,874,043.00       4.7         17       600216       浙江医药       10,809,732.00       4.7         18       601966       玲珑轮胎       10,798,537.39       4.7         19       000960       锡业股份       10,695,697.05       4.7         20       600409       三友化工       10,614,520.69       4.6         21       601689       拓普集团       10,452,624.55       4.6         22       603882       金域医学       10,411,969.00       4.5         23       000898       鞍钢股份       10,269,820.54       4.5         24       300115       长盈精密       9,914,045.20       4.3         25       600141       兴发集团       9,840,665.80       4.3	14	300496	中科创达	11, 253, 056. 10	4. 95
17       600216       浙江医药       10,809,732.00       4.7         18       601966       玲珑轮胎       10,798,537.39       4.7         19       000960       锡业股份       10,695,697.05       4.7         20       600409       三友化工       10,614,520.69       4.6         21       601689       拓普集团       10,452,624.55       4.6         22       603882       金域医学       10,411,969.00       4.5         23       000898       鞍钢股份       10,269,820.54       4.5         24       300115       长盈精密       9,914,045.20       4.3         25       600141       兴发集团       9,840,665.80       4.3	15	300357	我武生物	10, 984, 889. 15	4. 83
18       601966       玲珑轮胎       10,798,537.39       4.7         19       000960       锡业股份       10,695,697.05       4.7         20       600409       三友化工       10,614,520.69       4.6         21       601689       拓普集团       10,452,624.55       4.6         22       603882       金域医学       10,411,969.00       4.5         23       000898       鞍钢股份       10,269,820.54       4.5         24       300115       长盈精密       9,914,045.20       4.3         25       600141       兴发集团       9,840,665.80       4.3	16	600201	生物股份	10, 874, 043. 00	4. 78
19       000960       锡业股份       10,695,697.05       4.7         20       600409       三友化工       10,614,520.69       4.6         21       601689       拓普集团       10,452,624.55       4.6         22       603882       金域医学       10,411,969.00       4.5         23       000898       鞍钢股份       10,269,820.54       4.5         24       300115       长盈精密       9,914,045.20       4.3         25       600141       兴发集团       9,840,665.80       4.3	17	600216	浙江医药	10, 809, 732. 00	4. 75
20       600409       三友化工       10,614,520.69       4.6         21       601689       拓普集团       10,452,624.55       4.6         22       603882       金域医学       10,411,969.00       4.5         23       000898       鞍钢股份       10,269,820.54       4.5         24       300115       长盈精密       9,914,045.20       4.3         25       600141       兴发集团       9,840,665.80       4.3	18	601966	玲珑轮胎	10, 798, 537. 39	4. 75
21       601689       拓普集团       10, 452, 624. 55       4. 6         22       603882       金域医学       10, 411, 969. 00       4. 5         23       000898       鞍钢股份       10, 269, 820. 54       4. 5         24       300115       长盈精密       9, 914, 045. 20       4. 3         25       600141       兴发集团       9, 840, 665. 80       4. 3	19	000960	锡业股份	10, 695, 697. 05	4. 70
22     603882     金域医学     10,411,969.00     4.5       23     000898     鞍钢股份     10,269,820.54     4.5       24     300115     长盈精密     9,914,045.20     4.3       25     600141     兴发集团     9,840,665.80     4.3	20	600409	三友化工	10, 614, 520. 69	4. 67
23     000898     鞍钢股份     10, 269, 820. 54     4. 5       24     300115     长盈精密     9, 914, 045. 20     4. 5       25     600141     兴发集团     9, 840, 665. 80     4. 5	21	601689	拓普集团	10, 452, 624. 55	4. 60
24     300115     长盈精密     9,914,045.20     4.3       25     600141     兴发集团     9,840,665.80     4.3	22	603882	金域医学	10, 411, 969. 00	4. 58
25 600141 兴发集团 9,840,665.80 4.3	23	000898	鞍钢股份	10, 269, 820. 54	4. 52
	24	300115	长盈精密	9, 914, 045. 20	4. 36
26 300012 华测检测 9,725,258.40 4.2	25	600141	兴发集团	9, 840, 665. 80	4. 33
	26	300012	华测检测	9, 725, 258. 40	4. 28
27 000807 云铝股份 9,666,568.00 4.2	27	000807	云铝股份	9, 666, 568. 00	4. 25
28 600699 均胜电子 9,644,686.00 4.2	28	600699	均胜电子	9, 644, 686. 00	4. 24
29 300207 欣旺达 9,642,478.40 4.2	29	300207	欣旺达	9, 642, 478. 40	4. 24

30	600079	人福医药	9, 520, 349. 29	4. 19
31	603345	安井食品	9, 445, 487. 76	4. 15
32	002705	新宝股份	9, 384, 591. 22	4. 13
33	300146	汤臣倍健	9, 373, 968. 30	4. 12
34	002028	思源电气	9, 176, 446. 25	4.03
35	002223	鱼跃医疗	9, 077, 025. 00	3. 99
36	002124	天邦股份	9, 041, 702. 08	3. 98
37	002092	中泰化学	9, 014, 324. 30	3. 96
38	300009	安科生物	8, 979, 576. 00	3. 95
39	600060	海信视像	8, 875, 889. 00	3. 90
40	000301	东方盛虹	8, 790, 443. 00	3.86
41	603338	浙江鼎力	8, 700, 214. 16	3. 83
42	688002	睿创微纳	8, 642, 682. 45	3. 80
43	600460	士兰微	8, 606, 261. 00	3. 78
44	002568	百润股份	8, 547, 248. 00	3. 76
45	600707	彩虹股份	8, 544, 975. 00	3. 76
46	000830	鲁西化工	8, 507, 846. 00	3. 74
47	603806	福斯特	8, 496, 069. 00	3. 74
48	002156	通富微电	8, 382, 773. 16	3. 69
49	603317	天味食品	8, 269, 073. 20	3. 64
50	600350	山东高速	8, 204, 420. 00	3. 61
51	000012	南玻 A	8, 200, 902. 39	3. 61
52	001914	招商积余	8, 150, 729. 00	3. 58
53	603260	合盛硅业	8, 129, 804. 04	3. 57
54	002340	格林美	8, 080, 425. 00	3. 55
55	600348	华阳股份	8, 044, 068. 98	3. 54
56	002078	太阳纸业	7, 982, 131. 00	3. 51
57	300001	特锐德	7, 966, 764. 95	3. 50
58	600563	法拉电子	7, 960, 041. 00	3. 50
59	300699	光威复材	7, 954, 475. 60	3. 50
60	002444	巨星科技	7, 917, 883. 48	3. 48
61	600765	中航重机	7, 911, 499. 29	3. 48
62	601168	西部矿业	7, 637, 794. 00	3. 36
63	603377	东方时尚	7, 629, 511. 00	3. 35
64	600511	国药股份	7, 579, 109. 00	3. 33
65	002212	天融信	7, 536, 547. 49	3. 31
66	002791	坚朗五金	7, 323, 766. 00	3. 22
67	600546	山煤国际	7, 282, 911. 03	3. 20
	•		1	

68	600329	中新药业	7, 197, 213. 00	3. 16
69	000329	索菲亚	7, 179, 320. 52	3. 16
70	300285	国瓷材料	7, 179, 320. 32	3. 16
71	000739	普洛药业	7, 122, 725. 00	3. 13
72	300482	万孚生物	7, 084, 658. 90	3. 11
73	603355	莱克电气	7, 039, 895. 66	3. 10
74	002368	太极股份	7, 033, 290. 60	3. 09
75	300595	欧普康视	7, 027, 216. 50	3. 09
76	000959	首钢股份	6, 982, 974. 26	3. 07
77	600038	中直股份	6, 959, 334. 00	3. 06
78	300024	机器人	6, 936, 156. 92	3. 05
79	002557	治治食品	6, 890, 269. 92	3. 03
80	002174	游族网络	6, 848, 233. 28	3. 01
81	600160	巨化股份	6, 814, 105. 50	3. 00
82	002080	中材科技	6, 796, 407. 80	2. 99
83	000636	风华高科	6, 747, 343. 00	2. 97
84	600535	天士力	6, 738, 666. 00	2. 96
85	600862	中航高科	6, 662, 174. 48	2. 93
86	600507	方大特钢	6, 643, 174. 40	2. 92
87	603708	家家悦	6, 631, 207. 00	2.92
88	002155	湖南黄金	6, 564, 939. 00	2.89
89	000009	中国宝安	6, 564, 560. 87	2.89
90	600704	物产中大	6, 544, 276. 41	2.88
91	600338	西藏珠峰	6, 474, 750. 00	2.85
92	600985	淮北矿业	6, 443, 141. 68	2. 83
93	603885	吉祥航空	6, 432, 017. 00	2. 83
94	002317	众生药业	6, 392, 110. 00	2. 81
95	600782	新钢股份	6, 390, 302. 99	2.81
96	002797	第一创业	6, 376, 244. 78	2.80
97	002831	裕同科技	6, 375, 594. 00	2.80
98	601928	凤凰传媒	6, 370, 452. 00	2.80
99	603983	丸美股份	6, 301, 686. 00	2.77
100	600158	中体产业	6, 263, 350. 85	2. 75
101	603893	瑞芯微	6, 248, 943. 40	2. 75
102	000999	华润三九	6, 213, 011. 00	2. 73
103	002203	海亮股份	6, 192, 365. 60	2.72
104	600315	上海家化	6, 085, 458. 00	2. 68
105	603737	三棵树	6, 077, 030. 48	2.67
	1	<u> </u>		

		<del>,</del>		
106	600549	厦门钨业	6, 060, 764. 76	2. 66
107	603638	艾迪精密	6, 055, 556. 60	2. 66
108	600039	四川路桥	6, 043, 515. 00	2. 66
109	300058	蓝色光标	6, 041, 038. 00	2. 66
110	600260	凯乐科技	6, 013, 766. 00	2. 64
111	002563	森马服饰	5, 985, 236. 70	2. 63
112	600171	上海贝岭	5, 978, 433. 98	2. 63
113	600486	扬农化工	5, 964, 907. 00	2. 62
114	600155	华创阳安	5, 953, 717. 24	2. 62
115	002925	盈趣科技	5, 894, 302. 15	2. 59
116	000729	燕京啤酒	5, 891, 638. 00	2. 59
117	600497	驰宏锌锗	5, 886, 887. 98	2. 59
118	603816	顾家家居	5, 878, 547. 00	2. 58
119	002946	新乳业	5, 857, 171. 75	2. 58
120	600733	北汽蓝谷	5, 838, 251. 00	2. 57
121	603198	迎驾贡酒	5, 823, 805. 00	2. 56
122	002511	中顺洁柔	5, 822, 424. 00	2. 56
123	603883	老百姓	5, 790, 658. 00	2. 55
124	002294	信立泰	5, 763, 190. 00	2. 53
125	600956	新天绿能	5, 725, 145. 00	2. 52
126	600398	海澜之家	5, 719, 199. 00	2. 51
127	601098	中南传媒	5, 679, 889. 00	2. 50
128	601598	中国外运	5, 671, 298. 62	2. 49
129	300010	豆神教育	5, 666, 244. 00	2. 49
130	000990	诚志股份	5, 655, 025. 00	2.49
131	600739	辽宁成大	5, 652, 547. 00	2.49
132	300316	晶盛机电	5, 646, 072. 95	2.48
133	002390	信邦制药	5, 624, 766. 00	2. 47
134	002985	北摩高科	5, 587, 801. 30	2. 46
135	002670	国盛金控	5, 581, 901. 11	2. 45
136	000090	天健集团	5, 578, 086. 17	2. 45
137	600820	隧道股份	5, 556, 229. 00	2. 44
138	600143	金发科技	5, 526, 015. 11	2. 43
139	600801	华新水泥	5, 509, 618. 00	2. 42
140	603228	景旺电子	5, 484, 985. 47	2. 41
141	601611	中国核建	5, 470, 437. 17	2. 41
142	002408	齐翔腾达	5, 430, 364. 92	2. 39
143	002385	大北农	5, 410, 865. 00	2. 38

144	688099	晶晨股份	5, 278, 368. 49	2. 32
145	002048	宁波华翔	5, 229, 515. 87	2. 30
146	603290	斯达半导	5, 216, 914. 00	2. 29
147	002920	德赛西威	5, 203, 305. 00	2. 29
148	002221	东华能源	5, 201, 702. 00	2. 29
149	000690	宝新能源	5, 138, 091. 99	2. 26
150	600053	九鼎投资	5, 070, 650. 42	2. 23
151	002038	双鹭药业	5, 058, 529. 00	2. 22
152	603225	新凤鸣	5, 023, 861. 86	2. 21
153	000887	中鼎股份	5, 013, 232. 00	2. 20
154	688088	虹软科技	5, 010, 391. 88	2. 20
155	002507	涪陵榨菜	4, 997, 266. 01	2. 20
156	600006	东风汽车	4, 982, 922. 00	2. 19
157	600623	华谊集团	4, 969, 894. 15	2. 19
158	002273	水晶光电	4, 964, 663. 00	2. 18
159	600729	重庆百货	4, 950, 252. 13	2. 18
160	600879	航天电子	4, 942, 421. 00	2. 17
161	600517	国网英大	4, 925, 113. 00	2. 17
162	600372	中航电子	4, 918, 623. 04	2. 16
163	002701	奥瑞金	4, 907, 003. 00	2. 16
164	000623	吉林敖东	4, 899, 263. 00	2. 15
165	000975	银泰黄金	4, 894, 926. 00	2. 15
166	603712	七一二	4, 834, 308. 64	2. 13
167	300017	网宿科技	4, 831, 368. 52	2. 12
168	600392	盛和资源	4, 818, 852. 96	2. 12
169	000513	丽珠集团	4, 803, 480. 64	2. 11
170	002242	九阳股份	4, 778, 763. 17	2. 10
171	601828	美凯龙	4, 778, 721. 43	2. 10
172	000988	华工科技	4, 778, 698. 00	2. 10
173	601003	柳钢股份	4, 762, 204. 00	2. 09
174	000501	鄂武商 A	4, 682, 430. 00	2.06
175	600556	天下秀	4, 638, 142. 81	2. 04
176	002281	光迅科技	4, 562, 075. 56	2. 01

注:"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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

卖出股票收入(成交)总额	2, 206, 170, 597. 03
--------------	----------------------

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	国家债券	17, 109, 750. 00	4. 92
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	17, 109, 750. 00	4. 92

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	019640	20 国债 10	126, 000	12, 600, 000. 00	3. 62
2	019645	20 国债 15	30, 000	3, 009, 300. 00	0.87
3	019654	21 国债 06	15, 000	1, 500, 450. 00	0. 43

- 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细本基金本报告期末未持有资产支持证券。
- **7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细** 本基金本报告期末未持有贵金属。
- 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 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

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

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	120, 569. 42
2	应收证券清算款	1, 348, 791. 58
3	应收股利	_
4	应收利息	322, 353. 83
5	应收申购款	1, 261, 060. 47
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	3, 052, 775. 30

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

# § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

	11. 1. 1		持有人结构				
份额	持有人	户均持有的	机构投	资者	个人投资	当	
级别	户数 (户)	基金份额	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	12, 796	9, 533. 69	50, 864, 104. 38	41. 69%	71, 129, 010. 85	58. 31%	
中 金 中 证 500C	7, 568	10, 711. 56	43, 889, 959. 98	54. 14%	37, 175, 111. 78	45. 86%	
合计	20, 364	9, 971. 43	94, 754, 064. 36	46.66%	108, 304, 122. 63	53. 34%	

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额 比例
	中金中证 500A	1, 420, 274. 82	1. 1642%
基金管理人所有从业人员 持有本基金	中金中证 500C	3, 049. 47	0. 0038%
	合计	1, 423, 324. 29	0. 7009%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	中金中证 500A	>100
投资和研究部门负责人持	中金中证 500C	0
有本开放式基金	合计	>100
* # ^ # ^ # ~ # # * * * * *	中金中证 500A	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 5000	0
<b>从八</b> 至並	合计	0

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金已成立满三年,本报告期内无发起式资金持有份额情况。

# § 9 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	中金中证 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	1.
本报告期期初基金份额总额	77, 997, 814. 79	70, 765, 413. 17
本报告期基金总申购份额	89, 155, 751. 52	63, 042, 773. 76
减:本报告期基金总赎回份额	45, 160, 451. 08	52, 743, 115. 17
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	121, 993, 115. 23	81, 065, 071. 76

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。

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

2021年3月5日,本基金管理人发布公告,赵璧先生自2021年3月3日担任公司督察长; 李虹女士同日起不再担任公司督察长。同日,本基金管理人发布公告,公司股东中金公司于2021年3月作出股东决定,赵璧先生不再担任公司第三届董事会董事,任命邱延冰先生担任公司第三届董事会董事。

2021年6月2日,本基金管理人发布公告,杨毓莹女士自2021年6月1日起担任公司独立董事;王元先生同日起不再担任公司独立董事。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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稽查或处罚。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

		股票多	股票交易		应支付该券商的佣金	
券商名称	交易单元 数量	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	备注
招商证券	2	798, 685, 064. 26	17. 83%	584, 079. 23	17.83%	_
兴业证券	2	798, 540, 122. 99	17.82%	583, 974. 33	17.82%	_

太平洋	2	654, 680, 424. 66	14.61%	478, 769. 42	14.61%	_
东兴证券	1	447, 702, 946. 26	9. 99%	327, 407. 30	9. 99%	_
长江证券	4	412, 704, 677. 77	9. 21%	301, 812. 65	9. 21%	-
中金公司	2	355, 690, 001. 60	7. 94%	260, 118. 88	7. 94%	_
华创证券	2	315, 624, 641. 80	7. 04%	230, 816. 58	7. 04%	_
中金财富证 券	2	247, 035, 470. 90	5. 51%	180, 657. 80	5. 51%	_
天风证券	2	185, 670, 732. 16	4. 14%	135, 782. 59	4.14%	-
申港证券	1	147, 541, 907. 58	3. 29%	107, 897. 34	3. 29%	-
海通证券	2	116, 472, 312. 32	2. 60%	85, 175. 87	2. 60%	-
国盛证券	2	_	-	_	-	_
浙商证券	2	_	-	_	-	-
山西证券	1	_	-	_	-	-

- 注: 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、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,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。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

		债券交易		债券回购交易		权证交易	
券商名	称	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		占当期权证 成交总额的 比例
招商证	券	2, 007, 000. 00	10. 18%	180, 100, 000. 00	21. 63%	_	_
兴业证	券	2, 486. 00	0.01%	153, 500, 000. 00	18. 44%	-	-

太平洋	1, 501, 650. 00	7. 62%	84, 000, 000. 00	10. 09%	_	-
东兴证券	_	_	-	-	-	_
长江证券	_	_	76, 700, 000. 00	9. 21%	_	_
中金公司	1, 003, 900. 00	5. 09%	136, 300, 000. 00	16. 37%	_	_
华创证券	5, 437. 99	0. 03%	90, 000, 000. 00	10.81%	-	_
中金财富证 券	_	-	24, 000, 000. 00	2.88%	_	-
天风证券	15, 188, 600. 00	77. 06%	47, 000, 000. 00	5. 64%	_	-
申港证券	-	-	_	-	-	_
海通证券	_	_	41, 000, 000. 00	4. 92%	_	_
国盛证券	-	-	-	_	_	_
浙商证券	-	-	-	_	-	-
山西证券	_	_	_	_	_	_

# 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司关于 旗下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	2021年1月5日
2	中金基金管理有限公司关于 设立上海分公司的公告	中国证监会规定媒介	2021年1月16日
3	中金基金管理有限公司旗下 基金 2020 年第 4 季度报告提 示性公告	中国证监会规定媒介	2021年1月22日
4	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2021年1月22日
5	中金基金管理有限公司关于 终止包商银行股份有限公司 办理本公司旗下基金销售业 务的公告	中国证监会规定媒介	2021年2月8日
6	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	2021年2月24日
7	中金基金管理有限公司高级 管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2021年3月5日
8	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	2021年3月5日
9	中金基金管理有限公司关于 设立厦门分公司的公告	中国证监会规定媒介	2021年3月6日
10	中金基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2021年3月6日

	旗下基金投资关联方承销期 内承销证券的公告		
11	中金基金管理有限公司关于 旗下部分基金根据《公开募集 证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基 金合同部分条款的公告	中国证监会规定媒介	2021年3月30日
12	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	2021年3月30日
13	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(2021 年第1号)	中国证监会规定媒介	2021年3月30日
14	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	2021年3月30日
15	中金基金管理有限公司旗下 全部基金 2020 年年度报告提 示性公告	中国证监会规定媒介	2021年3月31日
16	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年年度报告及摘要	中国证监会规定媒介	2021年3月31日
17	中金基金管理有限公司旗下 全部基金 2021 年第 1 季度报 告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021年4月22日
18	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年第 1季度报告	中国证监会规定媒介	2021年4月22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	2021年5月18日
20	关于不法分子假冒"中金基 金"名义进行诈骗的风险提 示	中国证监会规定媒介	2021年5月26日
21	关于不法分子假冒"中金基金"名义虚构"中金基金静态战略投资项目"进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2021年5月27日
22	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	2021年5月29日
23	中金基金管理有限公司关于 公司独立董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2021年6月2日
24	中金基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2021年6月12日

旗下基金投资关联方承销期	
内承销证券的公告	

# § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

本报告期内,本基金单一投资者持有份额比例没有达到或超过总份额20%的情况。

#### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内, 本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

### § 12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金募集的注册文件
- 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、中国证监会要求的其他文件

#### 12.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人和/或及基金托管人住所。

#### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人。

咨询电话: 010-63211122 400-868-1166

传真: 010-66159121

中金基金管理有限公司 2021年8月31日