

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资
基金
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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

报告送出日期：2020 年 10 月 28 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2020 年 10 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 中金中证 500 |
| 基金主代码 | 003016 |
| 交易代码 | 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 169,040,929.00 份 |
| 投资目标 | 本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。 |
| 投资策略 | 本基金作为股票指数增强型发起式证券投资基金，股票投资策略为本基金的核心策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合以及量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化。其他策略还包括债券投资策略和股指期货投资策略。 |

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率×95%+ 银行活期存款利率（税后）×5%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 | |
| 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 | |
| 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 | 81,976,378.48 份 | 87,064,550.52 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2020年7月1日—2020年9月30日） | |
|-----------------|---------------------------|----------------|
| | 中金中证 500A | 中金中证 500C |
| 1. 本期已实现收益 | 18,856,870.52 | 23,213,194.13 |
| 2. 本期利润 | 11,485,039.76 | 16,475,595.78 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1503 | 0.1849 |
| 4. 期末基金资产净值 | 119,167,902.66 | 126,390,086.58 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.4537 | 1.4517 |

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。

3.2 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 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 13.46% | 1.54% | 5.36% | 1.60% | 8.10% | -0.06% |

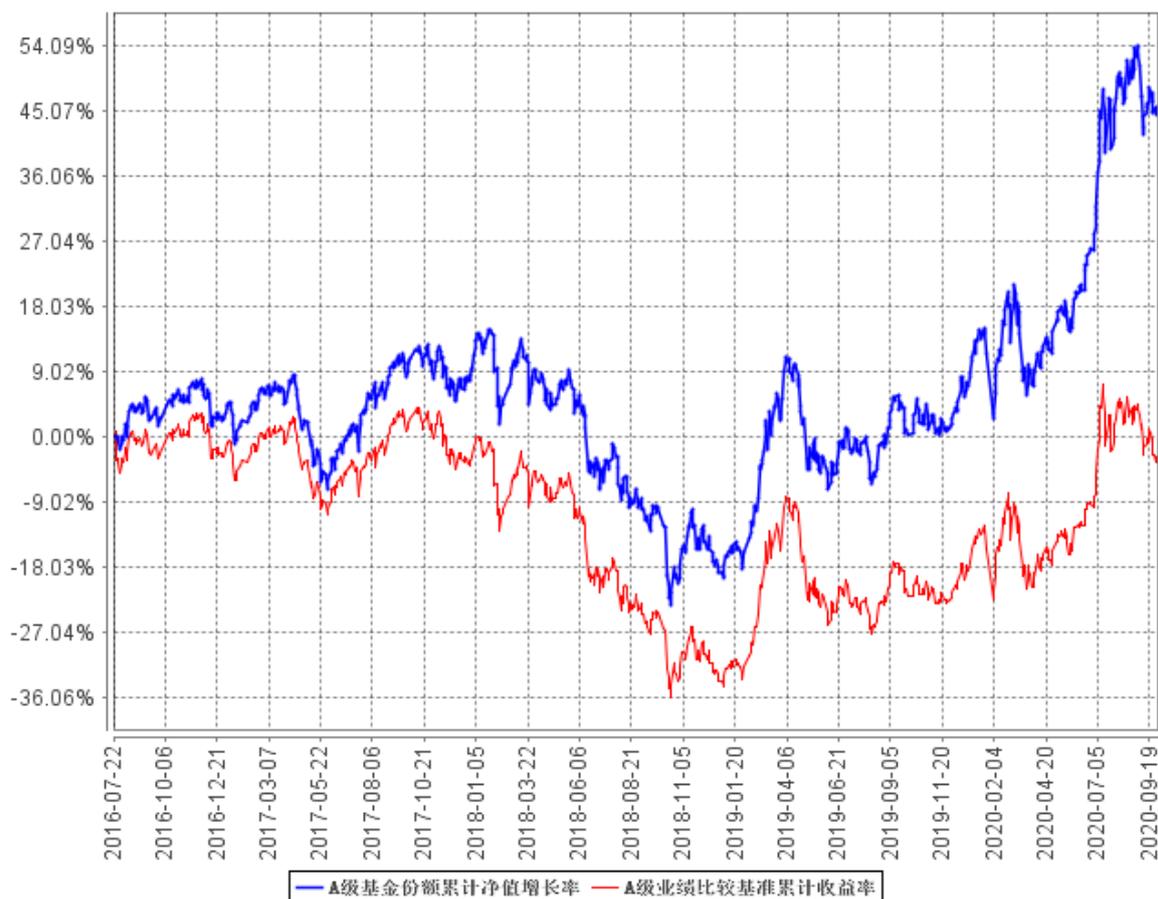
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去六个月 | 35.32% | 1.29% | 21.66% | 1.37% | 13.66% | -0.08% |
| 过去一年 | 44.92% | 1.42% | 24.13% | 1.50% | 20.79% | -0.08% |
| 过去三年 | 31.18% | 1.38% | -5.48% | 1.45% | 36.66% | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 45.37% | 1.26% | -3.16% | 1.31% | 48.53% | -0.05% |

中金中证 500C

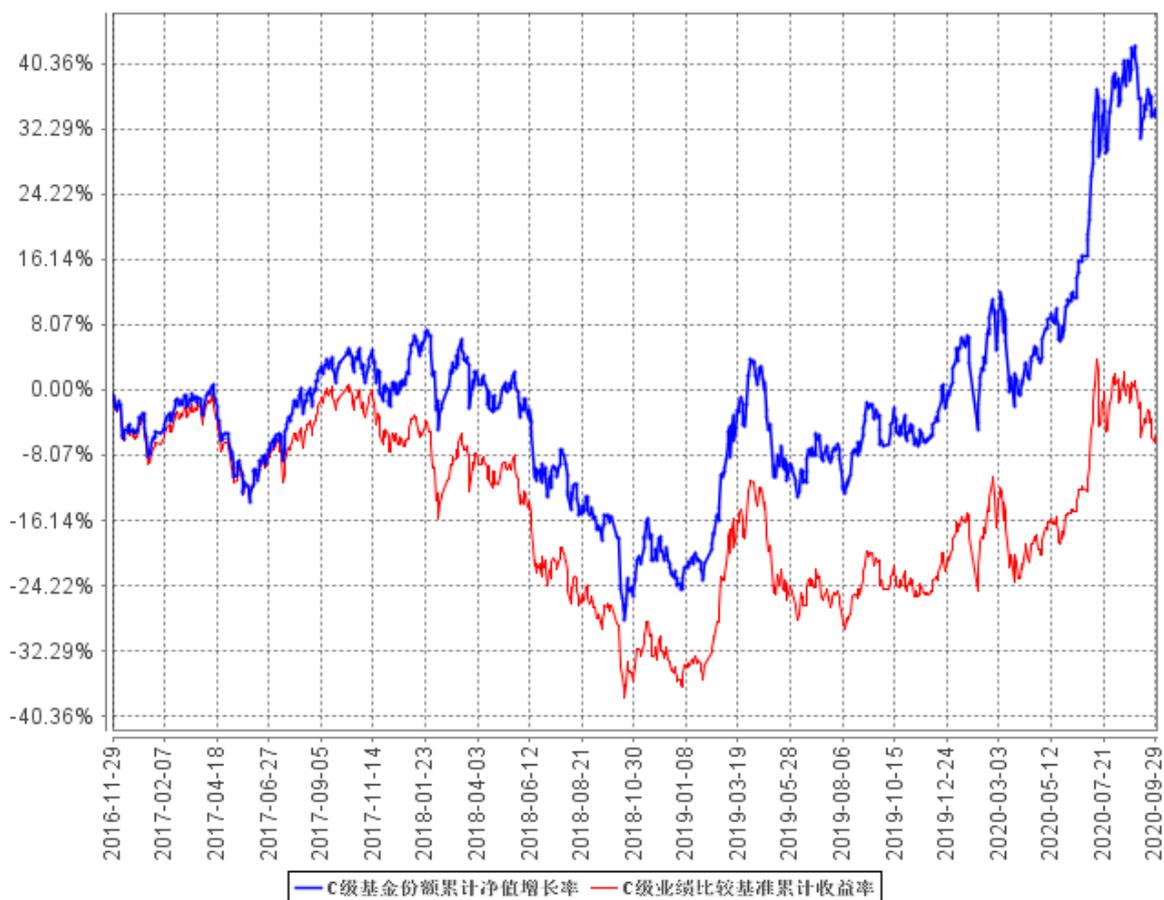
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准收 益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|---------------|----------------|-------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 13.35% | 1.53% | 5.36% | 1.60% | 7.99% | -0.07% |
| 过去六个月 | 35.04% | 1.29% | 21.66% | 1.37% | 13.38% | -0.08% |
| 过去一年 | 44.33% | 1.42% | 24.13% | 1.50% | 20.20% | -0.08% |
| 过去三年 | 30.07% | 1.38% | -5.48% | 1.45% | 35.55% | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 34.45% | 1.29% | -3.16% | 1.34% | 37.61% | -0.05% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 魏宇 | 本基金的基金经理 | 2017 年 3 月 28 日 | - | 10 年 | 魏宇先生，统计学博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发。2014 年 11 月加入中金基金管理有限公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任量化投资部基金经理。 |

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券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。

4.1.1 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，本基金不存在基金管理人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合规守信情况的说明

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》和其他有关法律法规及本基金合同的约定，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，在严格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 公平交易专项说明

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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，本基金采用量化模型进行选股来增强指数。2020 年三季度，相对于业绩基准，获取了一定的超额收益。我们将继续努力开发和改进选股模型，争取在超额收益方面有更好的表现。

本季度，欧美经济增长延续复苏，但由于欧洲疫情的二次爆发，制造业与服务业趋势结构出现分化，同时美国第二轮财政刺激法案的落地时间和力度以及美国最终大选结果是海外目前的两大不确定性因素。从国内来看，经济增长仍然维持高位，但有边际放缓迹象。A 股市场由季度初的快速拉升，迅速转为震荡，市场成交量也屡创新低。

展望未来，进入了四季度，疫情即使有局部反复，对经济的伤害可能也明显小于上半年；中国经济增长仍将继续复苏，中国面临的增长形势也明显优于外围，下半年上市公司盈利同比可能恢复至正增长；股市流动性可能依然相对宽裕，局部估值压力也在盘整中有所缓解；随着美国大选逐步明朗，无论谁当选，拿“中美关系”做文章的必要性暂时下降，中美摩擦有可能进入暂时的平静期，对市场负面拖累阶段性减小。综合来看，复苏深化仍是主线，围绕疫情、增长、外围环境等方面的不确定性有可能逐步明朗，市场表现有望稳中有升。未来可以关注新能源、光伏及新能源汽车产业链；基于中国增长继续复苏态势，关注消费中偏落后、估值仍不高的汽车零部件、家电、轻工家居等；老经济中关注券商及保险龙头、部分原材料，中期逢低吸纳代表消费及产业升级趋势的优质龙头。

4.5 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 1.4537 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.46%；截至本报告期末中金中证 500C 基金份额净值为 1.4517 元，本报告期基金份额净值增长

率为 13.35%；同期业绩比较基准收益率为 5.36%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 229,626,882.16 | 91.60 |
| | 其中：股票 | 229,626,882.16 | 91.60 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 12,574,900.00 | 5.02 |
| | 其中：债券 | 12,574,900.00 | 5.02 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 6,080,534.36 | 2.43 |
| 8 | 其他资产 | 2,400,866.02 | 0.96 |
| 9 | 合计 | 250,683,182.54 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,010,950.00 | 0.82 |
| B | 采矿业 | 5,237,008.00 | 2.13 |
| C | 制造业 | 129,970,652.27 | 52.93 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,588,219.00 | 1.05 |
| E | 建筑业 | 239,825.95 | 0.10 |
| F | 批发和零售业 | 10,552,211.56 | 4.30 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 8,464,452.00 | 3.45 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| H | 住宿和餐饮业 | 1,821,150.00 | 0.74 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 11,307,820.02 | 4.60 |
| J | 金融业 | 6,879,815.00 | 2.80 |
| K | 房地产业 | 7,219,674.05 | 2.94 |
| L | 租赁和商务服务业 | 73,746.00 | 0.03 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,337,138.00 | 1.36 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,331,854.00 | 1.76 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 4,514,112.00 | 1.84 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 4,762,514.23 | 1.94 |
| S | 综合 | 2,026,134.00 | 0.83 |
| | 合计 | 205,337,276.08 | 83.62 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 11,602,677.94 | 4.73 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,188,569.85 | 1.30 |
| E | 建筑业 | 13,029.12 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | 1,803,610.63 | 0.73 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,863,895.24 | 2.39 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 1,781,731.00 | 0.73 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 12,203.42 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 11,095.20 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 12,793.68 | 0.01 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 24,289,606.08 | 9.89 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末，本基金未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 002821 | 凯莱英 | 13,100 | 3,451,719.00 | 1.41 |
| 2 | 600298 | 安琪酵母 | 55,200 | 3,366,648.00 | 1.37 |
| 3 | 300012 | 华测检测 | 136,600 | 3,337,138.00 | 1.36 |
| 4 | 600143 | 金发科技 | 199,700 | 3,141,281.00 | 1.28 |
| 5 | 002507 | 涪陵榨菜 | 64,900 | 3,054,194.00 | 1.24 |
| 6 | 300496 | 中科创达 | 34,400 | 2,963,904.00 | 1.21 |
| 7 | 603882 | 金域医学 | 28,000 | 2,863,840.00 | 1.17 |
| 8 | 002414 | 高德红外 | 81,800 | 2,827,826.00 | 1.15 |
| 9 | 002030 | 达安基因 | 78,800 | 2,758,788.00 | 1.12 |
| 10 | 002223 | 鱼跃医疗 | 83,200 | 2,728,960.00 | 1.11 |

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 002241 | 歌尔股份 | 45,336 | 1,832,934.48 | 0.75 |
| 2 | 000157 | 中联重科 | 224,800 | 1,823,128.00 | 0.74 |
| 3 | 600674 | 川投能源 | 184,800 | 1,812,888.00 | 0.74 |
| 4 | 002008 | 大族激光 | 55,000 | 1,809,500.00 | 0.74 |
| 5 | 600637 | 东方明珠 | 185,800 | 1,800,402.00 | 0.73 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 12,574,900.00 | 5.12 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|---------------|------|
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 12,574,900.00 | 5.12 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 019627 | 20 国债 01 | 76,000 | 7,592,400.00 | 3.09 |
| 2 | 019640 | 20 国债 10 | 50,000 | 4,982,500.00 | 2.03 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

5.7 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

本报告期末，本基金未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本报告期末，本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末，本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末，本基金未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末，本基金未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末，本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末，本基金未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除金发科技股份有限公司（金发科技）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2020 年 9 月 23 日，金发科技股份有限公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局下发的《关于对金发科技股份有限公司、袁志敏、宁凯军采取出示警示函措施的决定》（〔2020〕130 号），对金发科技未及时履行重大合同进展信息披露义务，未及时充分揭示相关风险等违法违规事实进行处罚。

金发科技是中证 500 指数成分股，而本基金合同要求投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，故按照量化模型投资于该股票，同时判断上述处罚不会对公司经营产生重大影响，因此没有调低该股票在模型中的权重。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 59,785.96 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,889,040.37 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 148,335.63 |
| 5 | 应收申购款 | 303,704.06 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|--------------|
| 8 | 合计 | 2,400,866.02 |
|---|----|--------------|

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中金中证 500A | 中金中证 500C |
|---------------------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 68,068,792.29 | 23,004,576.54 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 40,231,082.23 | 115,081,645.14 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 26,323,496.04 | 51,021,671.16 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 81,976,378.48 | 87,064,550.52 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

| | |
|------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 1,014,198.78 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |

| | |
|---------------------------|--------------|
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 1,014,198.78 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 0.60 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 报告期末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 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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超过总份额 20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金依法合规参与了部分基金管理人股东中金公司承销期内承销的证券，具体情况请见本基金本报告期内发布的有关重大关联交易的公告。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、本基金申请募集注册的法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 7、中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：（86）010-63211122 400-868-1166

传真：（86）010-66159121

中金基金管理有限公司

2020 年 10 月 28 日