

中加中证500指数增强型证券投资基金

2021年第3季度报告

2021年09月30日

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:中信建投证券股份有限公司

报告送出日期:2021年10月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月25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2021年07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中加中证500指数增强
基金主代码	010153
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年09月27日
报告期末基金份额总额	123,393,603.16份
投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的

	指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	中加基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中加中证500指数增强A	中加中证500指数增强C
下属分级基金的交易代码	010153	010154
报告期末下属分级基金的份额总额	66,351,414.23份	57,042,188.93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(2021年07月01日 - 2021年09月30日)	
	中加中证500指数增强A	中加中证500指数增强C
1. 本期已实现收益	4,737,907.33	3,602,848.02
2. 本期利润	724,453.52	-240,795.30
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0134	-0.0058
4. 期末基金资产净值	74,950,093.92	64,213,249.76
5. 期末基金份额净值	1.1296	1.1257

注：1. 上述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。

2. 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。

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

中加中证500指数增强A净值表现

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	1.43%	1.01%	4.14%	1.07%	-2.71%	-0.06%
过去	11.22%	0.87%	12.90%	0.89%	-1.68%	-0.02%

六个月						
过去一年	12.91%	0.92%	14.02%	1.01%	-1.11%	-0.09%
自基金合同生效起至今	12.96%	0.92%	13.25%	1.01%	-0.29%	-0.09%

中加中证500指数增强C净值表现

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	1.34%	1.01%	4.14%	1.07%	-2.80%	-0.06%
过去六个月	11.05%	0.87%	12.90%	0.89%	-1.85%	-0.02%
过去一年	12.52%	0.92%	14.02%	1.01%	-1.50%	-0.09%
自基金合同生效起至今	12.57%	0.92%	13.25%	1.01%	-0.68%	-0.09%

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

中加中证500指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



中加中证500指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2020 年 9 月 27 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年。

2、根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，截至本报告期末，已完成建仓，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§ 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		
钟伟	本基金基金经理	2020-09-27	-	12	钟伟先生，复旦大学数学博士。2009年7月至2016年5月，先后在广发基金管理有限公司金融工程部、数量投资部任研究员、基金经理。2013年11月7日至2015年8月任广发中债金融债指数基金的基金经理。2015年2月至2016年5月任广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2016年5月至2020年3月，任吉富创业投资股份有限公司量化投资部总经理、基金经理。2020年3月加入中加基金管理有限公司，现任中加中证500指数增强型证券投资基金（2020年9月27日至今）和中加心享灵活配置混合型证券投资基金（2021年08月13日至今）的基金经理。

- 1、任职日期说明：基金经理的任职日期为基金合同生效公告日期。
- 2、离任日期说明：无。
- 3、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
- 4、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本报告期内，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了同日反向交易控制的规则，并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时，公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，定期对组合间的同向交易进行分析。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%。投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果，表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年三季度，A股市场呈现震荡行情，指数分化明显。沪深300、上证50和创业板指三季度跌幅超过6%，而中证500和中证1000指数三季度涨幅超过4%。三季度，大周期板块和大消费板块呈现明显的跷跷板效应。受益于“碳中和”主题和大宗商品价格的上涨，低估值的顺周期板块表现抢眼，采掘、有色金属、钢铁和化工等行业领涨市场。而受疫情影响，消费数据增长乏力，大消费板块则表现低迷，医药生物、休闲服务和食品饮料等行业跌幅居前。

中国制造业采购经理指数9月份跌破枯荣线，显示中国经济面临较大的下行压力。预计四季度货币政策易松难紧，市场流动性会适度宽裕。近期中美关系有所缓和，中美经贸关系有望改善，有利于提振市场风险偏好。中证500指数经过9月中下旬的下跌调整后，估值位于历史底部区域，具备较高的安全边际。

本基金采用量化多因子模型选股模型对股票投资价值做定量分析，在此基础上构建股票投资组合，基金的持股非常分散。报告期内，基金保持仓位稳定，在严格控制跟踪误差的基础上，力争获得持续稳定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加中证500指数增强A基金份额净值为1.1296元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.43%，同期业绩比较基准收益率为4.14%；截至报告期末中加中证500指数增强C基金份额净值为1.1257元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.34%，同期业绩比较基准收益率为4.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于人民币五千万元的情形。

§ 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	130,493,854.72	93.35
	其中：股票	130,493,854.72	93.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,543,241.51	5.40
8	其他资产	1,756,348.72	1.26
9	合计	139,793,444.95	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	2,287,554.00	1.64
B	采矿业	3,559,740.00	2.56
C	制造业	72,226,446.02	51.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,623,139.48	2.60
E	建筑业	1,895,598.00	1.36
F	批发和零售业	5,314,404.40	3.82
G	交通运输、仓储和邮政业	1,557,925.00	1.12
H	住宿和餐饮业	472,745.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,863,050.20	7.81
J	金融业	6,123,972.00	4.40
K	房地产业	3,540,726.95	2.54
L	租赁和商务服务业	722,210.00	0.52
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,062,598.00	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	461,826.00	0.33
S	综合	101,654.00	0.07
	合计	113,813,589.05	81.78

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	22,976.00	0.02
B	采矿业	826,750.00	0.59
C	制造业	9,657,449.49	6.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	450,785.00	0.32
E	建筑业	91,987.00	0.07

F	批发和零售业	544,376.42	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	516,326.40	0.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,596,057.16	1.87
J	金融业	968,245.20	0.70
K	房地产业	697,486.00	0.50
L	租赁和商务服务业	113,519.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	41,976.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	147,616.00	0.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	4,716.00	0.00
	合计	16,680,265.67	11.99

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	002138	顺络电子	124,000	4,207,320.00	3.02
2	603486	科沃斯	27,090	4,114,971.00	2.96
3	000990	诚志股份	245,800	3,991,792.00	2.87
4	000830	鲁西化工	203,000	3,816,400.00	2.74
5	601233	桐昆股份	171,400	3,760,516.00	2.70
6	000799	酒鬼酒	15,000	3,715,950.00	2.67
7	603444	吉比特	9,300	3,638,904.00	2.61

8	600803	新奥股份	184,766	3,377,522.48	2.43
9	300316	晶盛机电	44,500	2,863,575.00	2.06
10	603883	老百姓	59,500	2,784,600.00	2.00

5.3.2 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	688188	柏楚电子	2,122	930,878.96	0.67
2	688368	晶丰明源	2,443	912,460.50	0.66
3	600809	山西汾酒	2,220	700,410.00	0.50
4	600426	华鲁恒升	20,900	688,237.00	0.49
5	300750	宁德时代	1,300	683,449.00	0.49

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-27,120.00

股指期货投资本期公允价值变动（元）	-
-------------------	---

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以卖出套保交易为主，主要在期现折价不高，预测市场可能发生下跌时进行卖出套保操作。同时，也会运用股指期货交易来应对相对小额的申赎对基金股票仓位的影响。基金的股指期货投资符合基金合同的相关约定。

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

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 本报告期内，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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,225.99
5	应收申购款	1,755,122.73
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,756,348.72

5.11.4 报告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。

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 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未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，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	中加中证500指数增强A	中加中证500指数增强C
报告期期初基金份额总额	10,972,569.74	40,406,315.25
报告期期间基金总申购份额	60,780,427.38	25,609,055.48
减：报告期期间基金总赎回份额	5,401,582.89	8,973,181.80
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	66,351,414.23	57,042,188.93

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210701-20210816	19,495,077.49	0.00	0.00	19,495,077.49	15.80%
	2	20210705-20210930	0.00	27,966,341.83	0.00	27,966,341.83	22.66%
产品特有风险							
<p>本基金报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该投资者所持有的基金份额的占比较大，该投资者在赎回所持有的基金份额时，存在基金份额净值波动的风险；另外，该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时，基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。</p>							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中加中证500指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加中证500指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加中证500指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼

基金托管人地址：北京市东城区朝内大街2号凯恒中心B座10层

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：www.bobbns.com

中加基金管理有限公司

2021年10月26日