

中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2022年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 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合规守信情况的说明	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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	72
8.1 期末基金资产组合情况	72
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	72
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	74
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	90
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	100
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	100
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	101
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	101
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	101
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	101

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	101
8.12 投资组合报告附注	101
§9 基金份额持有人信息	102
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	102
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	103
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	103
§10 开放式基金份额变动	103
§11 重大事件揭示	104
11.1 基金份额持有人大会决议	104
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	104
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	104
11.4 基金投资策略的改变	104
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	104
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	104
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	104
11.8 其他重大事件	106
§12 影响投资者决策的其他重要信息	115
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	115
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	115
§13 备查文件目录	115
13.1 备查文件目录	115
13.2 存放地点	116
13.3 查阅方式	116

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	中信建投中证500增强	
基金主代码	006440	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年05月09日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	326,857,019.10份	
基金合同存续期	不定期	
下属各类别基金的基金简称	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C
下属各类别基金的交易代码	006440	006441
报告期末下属各类别基金的份额总额	160,154,263.52份	166,702,755.58份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。
投资策略	<p>本基金为指数增强型基金，以中证500指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。</p> <p>指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成分股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子分析模型和机器学习模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，实现超额收益。</p>
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，其预期收益和预期风险

	高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	--

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	中信建投基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟
	联系电话	010-59100208
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn
客户服务电话	4009-108-108	010-60836588
传真	010-59100298	010-60834004
注册地址	北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层
邮政编码	100010	100125
法定代表人	黄凌	张佑君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022年		2021年		2020年05月09日 (基金合同生效日) -2020年12月31日	
	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C
本期已实现收益	-49,334,417.48	-62,845,945.72	24,753,243.01	19,937,116.75	24,485,599.35	21,641,919.03
本期利润	-59,074,829.86	-77,780,612.03	33,111,517.28	21,823,192.34	23,566,183.83	23,989,622.01
加权平均基金份额本期利润	-0.3517	-0.3980	0.3146	0.2024	0.3121	0.3330
本期加权平均净值利润率	-24.14%	-27.41%	19.90%	12.62%	25.79%	28.37%
本期基金份额净值增长率	-18.77%	-19.01%	29.07%	28.67%	30.53%	30.28%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末		2021年末		2020年末	
期末可供分配利润	59,024,129.19	59,630,551.86	125,435,541.89	148,961,209.28	19,014,858.81	13,540,509.81
期末可供分配基金份额利润	0.3685	0.3577	0.6476	0.6395	0.3053	0.3028
期末基金资产净值	219,178,392.71	226,333,307.44	326,313,391.22	390,497,569.13	81,291,345.76	58,260,124.12
期末基金份额净值	1.3685	1.3577	1.6847	1.6763	1.3053	1.3028
3.1.3 累计期末指标	2022年末		2021年末		2020年末	
基金份额累计净值增长率	36.85%	35.77%	68.47%	67.63%	30.53%	30.28%

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、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、所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。

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

中信建投中证500增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.97%	1.03%	2.52%	0.97%	-1.55%	0.06%
过去六个月	-9.05%	1.08%	-8.66%	1.04%	-0.39%	0.04%
过去一年	-18.77%	1.32%	-19.30%	1.31%	0.53%	0.01%
自基金合同生效起至今	36.85%	1.20%	6.45%	1.17%	30.40%	0.03%

中信建投中证500增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.90%	1.02%	2.52%	0.97%	-1.62%	0.05%
过去六个月	-9.18%	1.08%	-8.66%	1.04%	-0.52%	0.04%
过去一年	-19.01%	1.32%	-19.30%	1.31%	0.29%	0.01%
自基金合同生效起至今	35.77%	1.20%	6.45%	1.17%	29.32%	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

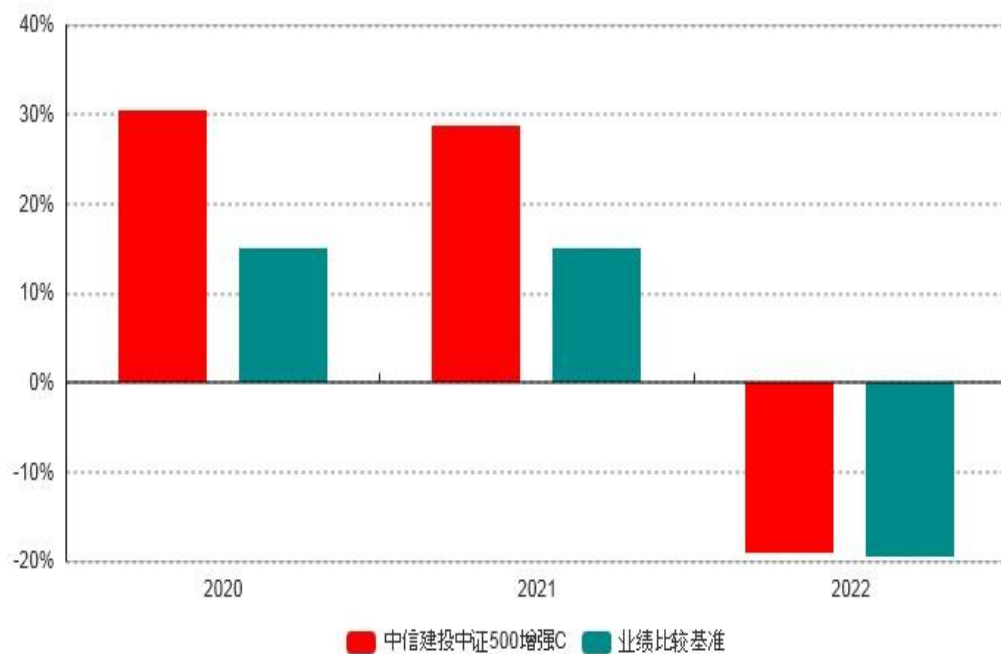
中信建投中证500增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年05月09日-2022年12月31日)



中信建投中证500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
(2020年05月09日-2022年12月31日)



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



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于2013年9月9日在北京成立，注册资本3亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经营基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。中信建投基金全资子公司元达信资本管理（北京）有限公司于2015年6月8日成立，主要经营特定客户资产管理业务和中国证监会许可的其他业务。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，主动投资管理能力大幅提升。同时，中信建投基金加强客户体系建设、积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为资产管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈于客户的信任；致力于经过长期努力，打造具有影响力的品牌。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
王鹏	本基金的 基金经理、 指数与量 化投资部 行政负责 人	2020-05-09	-	7年	中国籍，1984年8月生，哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中财期货分析师、LC M Commodities研究员、CIBC World Market期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、中信建投证券股份有限公司量化投资总监。2019年2

				<p>月加入中信建投基金管理有限公司，曾任权益投资部指数与量化投资部负责人、总监，现任本公司指数与量化投资部行政负责人、基金经理，担任中信建投中证500指数增强型证券投资基金、中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金、中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金、中信建投中证1000指数增强型证券投资基金、中信建投沪深300指数增强型证券投资基金、中信建投红利智选混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、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。

4.2 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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中信建投基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原

则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.3 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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共1次，为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

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

过去的2022年资本市场经历多重考验，有经济周期因素、美国持续加息因素，更有国内新冠疫情因素，其中新冠因素更是年内多次冲击经济数据和市场表现的核心变量，2022年中小盘波动高于大盘股，随着疫情的彻底放开，风险偏好和流动性逐步回升。本产品在此期间更为严格的控制了产品在行业市值上的风险暴露。我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，获取较为确定性的收益增厚机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投中证500增强A基金份额净值为1.3685元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-18.77%，同期业绩比较基准收益率为-19.30%；截至报告期末中信建投中证500增强C基金份额净值为1.3577元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-19.01%，同期业绩比较基准收益率为-19.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年1月，在疫情影响边际转向后，经济短周期基本面迎来快速修复。在2023年中国经济触底回升的预期中，A股市场1月份迎来较为强势的“开门红”行情。经济相关复苏板块领涨，外资相对看好中国市场未来前景，1月份外资持续流入规模再创单月新高达1125亿。在此背景下，市场并未受到节前交投清淡影响，走势持续超出市场预期。各大指数单月均录得较为不错的涨幅。我们有理由对国内权益市场继续维持乐观判断。疫

情影响趋弱，经济刺激政策频出，国内权益市场表现值得期待。随着经济见底回升，基本面数据持续得到验证，市场信心或将进一步得到提振。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人结合法律法规和业务发展需要，进一步修订、完善了公司内部制度；组织多项合规培训，加强员工的风险意识和合规意识；针对投资研究等重点业务，加大检查力度，促进公司业务合法合规、稳健经营；积极参与新产品、新业务的设计，提出合规建议，对基金宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收益部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部门的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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

本基金本报告期未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情形。

§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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中信建投中证500指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，中信建投基金管理有限公司在中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由中信建投基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中信建投中证500指数增强型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第24528号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信建投中证500指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容

	<p>我们审计了中信建投中证500指数增强型证券投资基金(以下简称"中信建投中证500增强基金")的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了中信建投中证500增强基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中信建投中证500增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>中信建投中证500增强基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层对其他信息负责。其他信息包括中信建投中证500增强基金2022年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在</p>

	<p>重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中信建投中证500增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中信建投中证500增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中信建投中证500增强基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未</p>

	<p>能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中信建投中证500增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中信建投中证500增强基金不能持续经营。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	薛竞	郭蕙心
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼	
审计报告日期	2023-03-31	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中信建投中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	29,621,148.05	44,726,419.22
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	416,878,335.19	674,161,400.26
其中：股票投资		416,534,772.21	674,161,400.26
基金投资		-	-
债券投资		343,562.98	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		546,101.96	1,721,157.41

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	14,531.44
资产总计		447,045,585.20	720,623,508.33
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		870,070.84	3,085,302.98
应付管理人报酬		287,088.00	463,254.59
应付托管费		38,278.42	61,767.28
应付销售服务费		58,388.15	101,236.18
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4.62	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	280,055.02	100,986.95
负债合计		1,533,885.05	3,812,547.98
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	326,857,019.10	426,644,107.85
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	118,654,681.05	290,166,852.50
净资产合计		445,511,700.15	716,810,960.35
负债和净资产总计		447,045,585.20	720,623,508.33

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额总额326,857,019.10份，其中A类基金份额净值1.3685元，基金份额160,154,263.52份；C类基金份额净值1.3577元，基金份额166,702,755.58份。

7.2 利润表

会计主体：中信建投中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-131,106,754.95	69,025,197.97
1.利息收入		258,125.39	247,326.66
其中：存款利息收入	7.4.7.9	258,125.39	247,326.66
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-107,001,842.39	56,499,936.28
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-114,752,044.97	53,282,383.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	32,730.13	-
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	7,717,472.45	3,217,553.10
以摊余成本计量的金 融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.14	-24,675,078.69	10,244,349.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	312,040.74	2,033,585.17
减：二、营业总支出		5,748,686.94	14,090,488.35
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,981,273.47	2,526,144.05
2. 托管费	7.4.10.2.2	530,836.50	336,819.21
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	856,176.35	516,831.47
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.62	-
8. 其他费用	7.4.7.16	380,400.00	10,710,693.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-136,855,441.89	54,934,709.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-136,855,441.89	54,934,709.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-136,855,441.89	54,934,709.62

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中信建投中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净	426,644,107.85	-	290,166,852.50	716,810,960.35

值)				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	426,644,107.85	-	290,166,852.50	716,810,960.35
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-99,787,088.75	-	-171,512,171.45	-271,299,260.20
（一）、综合收益总额	-	-	-136,855,441.89	-136,855,441.89
（二）、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)	-99,787,088.75	-	-34,656,729.56	-134,443,818.31
其中：1.基金申购款	228,716,331.87	-	111,591,494.34	340,307,826.21
2.基金赎回款	-328,503,420.62	-	-146,248,223.90	-474,751,644.52
（三）、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)	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净	326,857,019.10	-	118,654,681.05	445,511,700.15

资产（基金净值）				
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	106,996,101.26	-	32,555,368.62	139,551,469.88
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	106,996,101.26	-	32,555,368.62	139,551,469.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	319,648,006.59	-	257,611,483.88	577,259,490.47
（一）、综合收益总额	-	-	54,934,709.62	54,934,709.62
（二）、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）	319,648,006.59	-	202,676,774.26	522,324,780.85
其中：1.基金申购款	797,849,267.00	-	486,043,283.11	1,283,892,550.11
2.基金赎回款	-478,201,260.41	-	-283,366,508.85	-761,567,769.26
（三）、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	426,644,107.85	-	290,166,852.50	716,810,960.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

黄凌

谭淼

谭保民

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中信建投中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2020)第367号《关于准予中信建投同顺量化逆向策略股票型证券投资基金变更注册的批复》核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0003号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》于2020年5月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为272,396,616.24份基金份额,其中认购资金利息折合146,489.89份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《中信建投中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,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,但不再从本类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额,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认购/申购费用的一类基金份额,称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费

用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票(含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债券、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、证券公司短期公司债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款等)、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或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)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保持的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或投资于到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发〔2017〕6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告〔2017〕13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号--套期会计》及《企业会计准则第37号--金融工具列报》(以下合称"新金融工具准则")，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a)金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、应收利息和应收申购款，金额分别为44,726,419.22元、14,531.44元和1,721,157.41元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为44,740,256.13元、0.00元和1,721,851.94元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为674,161,400.26元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为674,161,400.26元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为3,085,302.98元、463,254.59元、61,767.28元、101,236.18元和50,986.95元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为3,085,302.98元、463,254.59元、61,767.28元、101,236.18元和50,986.95元。

于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2012〕

85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2016〕36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日

活期存款	13,419,613.00	16,491,879.86
等于：本金	13,413,567.55	16,491,879.86
加：应计利息	6,045.45	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以 内	-	-
存款期限1-3个 月	-	-
存款期限3个月 以上	-	-
其他存款	16,201,535.05	28,234,539.36
等于：本金	16,199,923.65	28,234,539.36
加：应计利息	1,611.40	-
减：坏账准备	-	-
合计	29,621,148.05	44,726,419.22

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	429,586,640.04	-	416,534,772.21	-13,051,867.83	
贵金属投资-金交 所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	294,000.00	136.52	343,562.98	49,426.46
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	294,000.00	136.52	343,562.98	49,426.46
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	429,880,640.04	136.52	416,878,335.19	-13,002,441.37
项目	上年度末 2021年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	662,488,762.94	-	674,161,400.26	11,672,637.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	662,488,762.94	-	674,161,400.26	11,672,637.32

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	14,531.44

其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	14,531.44

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	55.02	986.95
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	50,000.00
其他应付	100,000.00	50,000.00
合计	280,055.02	100,986.95

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 中信建投中证500增强A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强A)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	193,697,880.00	193,697,880.00
本期申购	71,141,146.06	71,141,146.06
本期赎回（以“-”号填列）	-104,684,762.54	-104,684,762.54
本期末	160,154,263.52	160,154,263.52

7.4.7.7.2 中信建投中证500增强C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强C)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	232,946,227.85	232,946,227.85
本期申购	157,575,185.81	157,575,185.81
本期赎回(以“-”号填列)	-223,818,658.08	-223,818,658.08
本期末	166,702,755.58	166,702,755.58

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 中信建投中证500增强A

单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	125,435,541.89	7,179,969.33	132,615,511.22
本期利润	-49,334,417.48	-9,740,412.38	-59,074,829.86
本期基金份额交易产生的变动数	-14,317,312.46	-199,239.71	-14,516,552.17
其中：基金申购款	33,772,175.42	-422,883.60	33,349,291.82
基金赎回款	-48,089,487.88	223,643.89	-47,865,843.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	61,783,811.95	-2,759,682.76	59,024,129.19

7.4.7.8.2 中信建投中证500增强C

单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	148,961,209.28	8,590,132.00	157,551,341.28
本期利润	-62,845,945.72	-14,934,666.31	-77,780,612.03
本期基金份额交易产生的变动数	-23,634,416.82	3,494,239.43	-20,140,177.39

其中：基金申购款	81,125,494.03	-2,883,291.51	78,242,202.52
基金赎回款	-104,759,910.85	6,377,530.94	-98,382,379.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,480,846.74	-2,850,294.88	59,630,551.86

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	191,115.76	205,783.98
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	67,009.58	40,847.77
结算备付金利息收入	-	-
其他	0.05	694.91
合计	258,125.39	247,326.66

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	6,905,226,795.05	3,772,072,378.02
减：卖出股票成本总额	7,002,487,226.07	3,718,789,994.84
减：交易费用	17,491,613.95	-
买卖股票差价收入	-114,752,044.97	53,282,383.18

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年
----	-------------------------	------------------------------

	12月31日	12月31日
债券投资收益——利息收入	199.53	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	32,530.60	-
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	32,730.13	-

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年12月 31日	2021年01月01日至2021年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	243,384.07	-
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	210,600.00	-
减：应计利息总额	69.21	-
减：交易费用	184.26	-
买卖债券差价收入	32,530.60	-

7.4.7.12 衍生工具收益

无。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022	2021年01月01日至2021

	年12月31日	年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,717,472.45	3,217,553.10
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	7,717,472.45	3,217,553.10

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-24,675,078.69	10,244,349.86
——股票投资	-24,724,505.15	10,244,349.86
——债券投资	49,426.46	-
——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	-24,675,078.69	10,244,349.86

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	312,040.74	2,033,585.17
合计	312,040.74	2,033,585.17

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中归入基金资产的比例按持有期间递减且不低于25%。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	400.00	-
指数使用费	200,000.00	200,000.00
交易费用	-	10,340,693.62
合计	380,400.00	10,710,693.62

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

经基金管理人2021年度第六次临时股东会决议，并经中国证券监督管理委员会证监许可〔2022〕169号文批准，基金管理人股东航天科技财务有限责任公司将其持有的基金管理人25%的股权转让给中信建投证券股份有限公司。于2022年2月10日，基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记，本次股东变更完成后，中信建投证券股份有限公司持有基金管理人100%股权。基金管理人已于2022年2月11日在规定媒介披露上述事项。

关联方名称	与本基金的关系
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

航天科技财务有限责任公司	基金管理人的原股东
元达信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
中信建投 证券股份 有限公司	2,506,037,261.76	18.36%	-	-
中信证券 股份有限 公司	11,142,832,673.20	81.64%	8,008,595,816.58	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例

中信建投 证券股份 有限公司	60,250.88	24.76%	-	-
中信证券 股份有限 公司	183,133.19	75.24%	-	-

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中信建投 证券股份 有限公司	1,319,407.22	14.06%	-	-
中信证券 股份有限 公司	8,064,481.99	85.94%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例

中信证券 股份有限 公司	5,829,690.30	100.00%	-	-
--------------------	--------------	---------	---	---

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,981,273.47	2,526,144.05
其中：支付销售机构的客户维护费	1,749,968.17	1,088,150.93

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%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：
日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	530,836.50	336,819.21

注：支付基金托管人中信证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售	本期
------	----

服务费的各关联方名称	2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C	合计
中信建投基金管理有限公司	0.00	56,933.87	56,933.87
中信建投证券股份有限公司	0.00	148,039.21	148,039.21
中信证券股份有限公司	0.00	358,503.35	358,503.35
合计	0.00	563,476.43	563,476.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C	合计
中信建投基金管理有限公司	0.00	11,561.09	11,561.09
中信建投证券股份有限公司	0.00	69,842.09	69,842.09
中信证券股份有限公司	0.00	235,358.61	235,358.61
合计	0.00	316,761.79	316,761.79

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类的基金资产净值×0.30%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券股份有限公司-证券户	9,562,679.71	43,593.82	28,234,539.36	40,847.77
中信建投证券股份有限公司-证券户	6,638,855.34	23,415.76	-	-

注：本基金证券户的存款由中信建投证券股份有限公司和中信证券股份有限公司保管，按约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年01月01日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额

中信建投证券股份有限公司	001227	兰州银行	网下配售	7,868	28,088.76
中信证券股份有限公司	301117	佳缘科技	网下配售	2,616	122,428.80
中信建投证券股份有限公司	301236	软通动力	网下配售	6,223	453,532.24
中信证券股份有限公司	688150	莱特光电	网下配售	5,626	124,053.30
中信建投证券股份有限公司	688153	唯捷创芯	网下配售	4,958	330,202.80
中信证券股份有限公司	301109	军信股份	网下配售	8,452	294,214.12
中信证券股份有限公司	688326	经纬恒润	网下配售	2,277	275,517.00
中信建投证券股份有限公司	688119	中钢洛耐	网下配售	33,327	168,634.62
中信建投证券股份有限公司	301266	宇邦新材	网下配售	5,161	138,624.46
中信证券股份有限公司	301238	瑞泰新材	网下配售	16,407	314,686.26
中信证券股份有限公司	688047	龙芯中科	网下配售	4,018	241,321.08

中信建投证券股份有限公司	688322	奥比中光	网下配售	8,201	254,148.99
中信证券股份有限公司	301269	华大九天	网下配售	5,436	177,702.84
中信建投证券股份有限公司	301308	江波龙	网下配售	4,845	269,721.15
中信证券股份有限公司	688380	中微半导	网下配售	7,433	229,382.38
中信证券股份有限公司	688041	海光信息	网下配售	9,663	347,868.00
中信建投证券股份有限公司	688203	海正生材	网下配售	5,761	96,093.48
中信证券股份有限公司	301171	易点天下	网下配售	7,942	144,385.56
中信证券股份有限公司	688271	联影医疗	网下配售	2,430	267,008.40
中信建投证券股份有限公司	688381	帝奥微	网下配售	3,797	158,258.96
中信证券股份有限公司	688439	振华风光	网下配售	3,122	209,142.78
中信证券股份有限公司	301296	新巨丰	网下配售	10,411	189,376.09

中信证券股份有限公司	301349	信德新材	网下配售	980	136,102.40
中信证券股份有限公司	688114	华大智造	网下配售	2,134	186,042.12
中信证券股份有限公司	688061	灿瑞科技	网下配售	2,052	231,239.88
中信建投证券股份有限公司	001300	三柏硕	网下配售	763	8,522.71
中信证券股份有限公司	603151	邦基科技	网下配售	535	9,603.25
中信证券股份有限公司	688426	康为世纪	网下配售	3,776	184,948.48
中信证券股份有限公司	688432	有研硅	网下配售	16,997	168,440.27
中信建投证券股份有限公司	001338	永顺泰	网下配售	1,649	11,246.18
中信证券股份有限公司	301335	天元宠物	网下配售	4,192	209,516.16
中信证券股份有限公司	301377	鼎泰高科	网下配售	7,695	176,061.60
中信建投证券股份有限公司	603130	云中马	网下配售	480	9,465.60

中信建投 证券股份 有限公司	301311	昆船智能	网下配售	8,320	115,481.60
中信建投 证券股份 有限公司	688143	长盈通	网下配售	1,938	69,128.46
中信建投 证券股份 有限公司	688172	燕东微	网下配售	12,937	284,355.26
中信证券 股份有限 公司	002948	青岛银行	网下配售	105,780	338,496.00
中信证券 股份有限 公司	601016	节能风电	网下配售	90,990	207,457.20
上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日					
关联方名 称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张 /股）	总金额
中信建投 证券股份 有限公司	688167	炬光科技	网下配售	2,014	158,481.66
中信建投 证券股份 有限公司	301100	风光股份	网下配售	5,985	166,442.85
中信建投 证券股份 有限公司	600927	永安期货	网下配售	1,859	33,406.23
中信建投 证券股份 有限公司	301177	迪阿股份	网下配售	4,224	493,701.12
中信证券	688192	迪哲医药	网下配售	5,913	310,905.54

股份有限 公司					
中信证券 股份有限 公司	600935	华塑股份	网下配售	4,811	18,955.34
中信证券 股份有限 公司	688739	成大生物	网下配售	3,211	353,210.00
中信建投 证券股份 有限公司	301090	华润材料	网下配售	23,890	249,650.50
中信证券 股份有限 公司	688280	精进电动	网下配售	19,620	270,363.60
中信证券 股份有限 公司	688211	中科微至	网下配售	2,550	230,010.00
中信建投 证券股份 有限公司	688553	汇宇制药	网下配售	6,740	261,983.80
中信建投 证券股份 有限公司	688697	纽威数控	网下配售	5,837	44,069.35
中信建投 证券股份 有限公司	688707	振华新材	网下配售	8,130	95,527.50
中信证券 股份有限 公司	301059	金三江	网下配售	2,581	20,880.29
中信证券 股份有限 公司	688187	时代电气	网下配售	6,377	200,110.26
中信证券	688776	国光电气	网下配售	1,447	74,433.68

股份有限 公司					
中信证券 股份有限 公司	301049	超越科技	网下配售	1,954	37,790.36
中信证券 股份有限 公司	301050	雷电微力	网下配售	1,797	108,970.08
中信证券 股份有限 公司	688766	普冉股份	网下配售	522	77,725.80
中信证券 股份有限 公司	688798	艾为电子	网下配售	1,110	85,003.80
中信建投 证券股份 有限公司	688385	复旦微电	网下配售	8,852	55,147.96
中信建投 证券股份 有限公司	300774	倍杰特	网下配售	4,435	20,267.95
中信证券 股份有限 公司	688509	正元地信	网下配售	15,433	30,403.01
中信证券 股份有限 公司	688071	华依科技	网下配售	1,101	15,116.73
中信建投 证券股份 有限公司	1210	金房节能	网下配售	311	8,711.11
中信证券 股份有限 公司	301028	东亚机械	网下配售	7,329	38,916.99
中信证券	688305	科德数控	网下配售	1,496	16,500.88

股份有限公司					
中信证券股份有限公司	688226	威腾电气	网下配售	2,693	17,289.06
中信证券股份有限公司	688425	铁建重工	网下配售	20,370	58,461.90
中信建投证券股份有限公司	688625	呈和科技	网下配售	2,297	37,854.56
中信建投证券股份有限公司	603511	爱慕股份	网下配售	553	11,607.47
中信证券股份有限公司	300993	玉马遮阳	网下配售	4,097	49,573.70
中信证券股份有限公司	688575	亚辉龙	网下配售	2,199	32,545.20
中信建投证券股份有限公司	605305	中际联合	网下配售	368	13,961.92
中信证券股份有限公司	605060	联德股份	网下配售	883	13,765.97
中信证券股份有限公司	688819	天能股份	网下配售	2,554	106,731.66

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688506	百利天恒	2022-12-28	1个月内（含）	新股未上市	24.70	24.70	10,712	264,586.40	264,586.40	-
688172	燕东微	2022-12-09	6个月以上	科创板打新限售	21.98	17.96	12,937	284,355.26	232,348.52	-
688205	德科立	2022-08-02	6个月以上	科创板打新限售	48.51	48.98	4,293	208,253.43	210,271.14	-
688496	清越科技	2022-12-21	6个月以上	科创板打新限售	9.16	8.65	12,000	109,920.00	103,800.00	-
688244	永信至诚	2022-10-12	6个月以上	科创板打新限售	49.19	50.14	1,506	74,080.14	75,510.84	-
301269	华大九天	2022-07-21	6个月以上	创业板打新限售	32.69	87.94	544	17,783.36	47,839.36	-

3013 27	华宝 新能	2022 -09-0 8	6个月以 上	创业 板打 新限 售	237.5 0	176.9 7	170	40,37 5.00	30,08 4.90	-
3013 08	江波 龙	2022 -07-2 7	6个月以 上	创业 板打 新限 售	55.67	56.72	485	26,99 9.95	27,50 9.20	-
3013 67	怡和 嘉业	2022 -10-2 1	6个月以 上	创业 板打 新限 售	119.8 8	175.7 8	143	17,14 2.84	25,13 6.54	-
3012 67	华夏 眼科	2022 -10-2 6	6个月以 上	创业 板打 新限 售	50.88	66.20	318	16,17 9.84	21,05 1.60	-
3011 52	天力 锂能	2022 -08-1 9	6个月以 上	创业 板打 新限 售	57.00	46.64	380	21,66 0.00	17,72 3.20	-
3013 63	美好 医疗	2022 -09-2 8	6个月以 上	创业 板打 新限 售	30.66	37.85	433	13,27 5.78	16,38 9.05	-
3012 96	新巨 丰	2022 -08-2 6	6个月以 上	创业 板打 新限 售	18.19	14.90	1,042	18,95 3.98	15,52 5.80	-
3013 89	隆扬 电子	2022 -10-1 8	6个月以 上	创业 板打 新限 售	22.50	17.16	886	19,93 5.00	15,20 3.76	-
3013 28	维峰 电子	2022 -08-3	6个月以 上	创业 板打	78.80	76.96	191	15,05 0.80	14,69 9.36	-

		0		新限售						
3011 21	紫建 电子	2022 -08-0 1	6个月以 上	创业 板打 新限售	61.07	49.77	290	17,71 0.30	14,43 3.30	-
3013 35	天元 宠物	2022 -11-1 1	6个月以 上	创业 板打 新限售	49.98	33.82	420	20,99 1.60	14,20 4.40	-
3011 71	易点 天下	2022 -08-1 0	6个月以 上	创业 板打 新限售	18.18	17.72	795	14,45 3.10	14,08 7.40	-
3013 39	通行 宝	2022 -09-0 2	6个月以 上	创业 板打 新限售	18.78	15.59	901	16,92 0.78	14,04 6.59	-
3013 77	鼎泰 高科	2022 -11-1 1	6个月以 上	创业 板打 新限售	22.88	17.63	770	17,61 7.60	13,57 5.10	-
3013 11	昆船 智能	2022 -11-2 3	6个月以 上	创业 板打 新限售	13.88	15.86	832	11,54 8.16	13,19 5.52	-
3012 97	富乐 德	2022 -12-2 3	6个月以 上	创业 板打 新限售	8.48	12.99	1,015	8,60 7.20	13,18 4.85	-
3013 38	凯格 精机	2022 -08-0 8	6个月以 上	创业 板打 新限售	46.33	48.99	257	11,90 6.81	12,59 0.43	-

301115	建科股份	2022-08-23	6个月以上	创业板打新限售	42.05	24.04	520	21,866.00	12,500.80	-
301280	珠城科技	2022-12-19	6个月以上	创业板打新限售	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301283	聚胶股份	2022-08-26	6个月以上	创业板打新限售	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301290	东星医疗	2022-11-23	6个月以上	创业板打新限售	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-
301277	新天地	2022-11-09	6个月以上	创业板打新限售	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301361	众智科技	2022-11-08	6个月以上	创业板打新限售	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301273	瑞晨环保	2022-10-11	6个月以上	创业板打新限售	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301349	信德新材	2022-08-30	6个月以上	创业板打新限售	138.88	103.52	98	13,610.24	10,144.96	-
301318	维海德	2022-08-0	6个月以上	创业板打	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-

		3		新限售						
3013 98	星源 卓镁	2022 -12-0 8	6个月以 上	创业 板打 新限售	34.40	28.94	255	8,77 2.00	7,37 9.70	-
3012 76	嘉曼 服饰	2022 -09-0 1	6个月以 上	创业 板打 新限售	40.66	22.61	303	12,31 9.98	6,85 0.83	-
3013 88	欣灵 电气	2022 -10-2 6	6个月以 上	创业 板打 新限售	25.88	21.60	292	7,55 6.96	6,30 7.20	-
3013 68	丰立 智能	2022 -12-0 7	6个月以 上	创业 板打 新限售	22.33	18.52	337	7,52 5.21	6,24 1.24	-
3012 70	汉仪 股份	2022 -08-1 9	6个月以 上	创业 板打 新限售	25.68	28.37	210	5,39 2.80	5,95 7.70	-
3012 31	荣信 文化	2022 -08-3 1	6个月以 上	创业 板打 新限售	25.49	20.38	275	7,00 9.75	5,60 4.50	-
3013 09	万得 凯	2022 -09-0 8	6个月以 上	创业 板打 新限售	39.00	24.46	228	8,89 2.00	5,57 6.88	-
3013 16	慧博 云通	2022 -09-2 9	6个月以 上	创业 板打 新限售	7.60	14.32	359	2,72 8.40	5,14 0.88	-

注：1、根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。”

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600038	中直股份	2022-1-22 2022-2-6	重大事項	46.41	2023-01-10	51.05	16,800	786,297.31	779,688.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、风险管理部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人的托管账户，开立于招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	343,562.98	-
未评级	-	-
合计	343,562.98	-

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2022年12月31日，除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。

本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2022年12月31日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2022年12月31日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查

与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	29,621,148.05	-	-	-	29,621,148.05
交易性金融资产	-	-	343,562.98	416,534,772.21	416,878,335.19
应收申购款	-	-	-	546,101.96	546,101.96
资产总计	29,621,148.05	-	343,562.98	417,080,874.17	447,045,585.20
负债					
应付赎回	-	-	-	870,070.84	870,070.84

回款					
应付管理人报酬	-	-	-	287,088.00	287,088.00
应付托管费	-	-	-	38,278.42	38,278.42
应付销售服务费	-	-	-	58,388.15	58,388.15
应交税费	-	-	-	4.62	4.62
其他负债	-	-	-	280,055.02	280,055.02
负债总计	-	-	-	1,533,885.05	1,533,885.05
利率敏感度缺口	29,621,148.05	-	343,562.98	415,546,989.12	445,511,700.15
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	44,726,419.22	-	-	-	44,726,419.22
交易性金融资产	-	-	-	674,161,400.26	674,161,400.26
应收申购款	-	-	-	1,721,157.41	1,721,157.41
其他资产	-	-	-	14,531.44	14,531.44
资产总计	44,726,419.22	-	-	675,897,089.11	720,623,508.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,085,302.98	3,085,302.98
应付管理人报酬	-	-	-	463,254.59	463,254.59
应付托管费	-	-	-	61,767.28	61,767.28
应付销售服务费	-	-	-	101,236.18	101,236.18

费					
其他负债	-	-	-	100,986.95	100,986.95
负债总计	-	-	-	3,812,547.98	3,812,547.98
利率敏感度缺口	44,726,419.22	-	-	672,084,541.13	716,810,960.35

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为0.08%（2021年12月31日：无），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2021年12月31日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金为指数增强型基金，以中证500指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2022年12月31日		2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	416,534,772.21	93.50	674,161,400.26	94.05
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	343,562.98	0.08	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	416,878,335.19	93.57	674,161,400.26	94.05

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	22,356,276.06	35,702,045.18
	业绩比较基准下降5%	-22,356,276.06	-35,702,045.18

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	414,722,551.78	669,919,101.89
第二层次	1,044,274.40	2,625,944.49
第三层次	1,111,509.01	1,616,353.88
合计	416,878,335.19	674,161,400.26

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,616,353.88	1,616,353.88
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,326,469.08	1,326,469.08

转出第三层次	-	1,352,189.82	1,352,189.82
当期利得或损失总额	-	-479,124.13	-479,124.13
其中:计入损益的利得或损失	-	-479,124.13	-479,124.13
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,111,509.01	1,111,509.01
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-82,963.80	-82,963.80
项目	上年度可比同期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	725,709.51	725,709.51
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	890,644.37	890,644.37
其中:计入损益的利得或损失	-	890,644.37	890,644.37
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,616,353.88	1,616,353.88
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	890,644.37	890,644.37

注：于2022年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产-股票投资	1,111,509.01	亚式期权	预期波动率	21.27%~247.56%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产-股票投资	1,616,353.88	亚式期权	预期波动率	29.27%~274.17%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021年12月31日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	416,534,772.21	93.18
	其中：股票	416,534,772.21	93.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	343,562.98	0.08
	其中：债券	343,562.98	0.08
	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	29,621,148.05	6.63
8	其他各项资产	546,101.96	0.12
9	合计	447,045,585.20	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	3,562,254.22	0.80
B	采矿业	21,786,190.72	4.89
C	制造业	213,738,429.06	47.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,416,367.00	3.01
E	建筑业	2,828,827.00	0.63
F	批发和零售业	10,360,275.00	2.33
G	交通运输、仓储和邮政业	6,990,036.00	1.57

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,133,011.99	5.19
J	金融业	16,110,236.00	3.62
K	房地产业	17,017,313.22	3.82
L	租赁和商务服务业	4,413,671.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	5,785,794.00	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	1,948,180.00	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,736,657.00	0.61
R	文化、体育和娱乐业	5,458,755.00	1.23
S	综合	-	-
	合计	349,285,997.21	78.40

8.2.2 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	1,929,704.00	0.43
B	采矿业	447,114.00	0.10
C	制造业	51,470,615.41	11.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,464,862.00	0.33
E	建筑业	2,294,809.00	0.52
F	批发和零售业	1,099,690.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	446,774.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,508,259.52	0.79
J	金融业	988,492.00	0.22
K	房地产业	888,857.00	0.20

L	租赁和商务服务业	222,859.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	1,463,805.97	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	773,601.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	222,676.00	0.05
Q	卫生和社会工作	21,051.60	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	67,248,775.00	15.09

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002273	水晶光电	482,000	5,682,780.00	1.28
2	002422	科伦药业	196,100	5,218,221.00	1.17
3	300308	中际旭创	183,800	4,968,114.00	1.12
4	300017	网宿科技	696,000	3,883,680.00	0.87
5	600160	巨化股份	241,100	3,739,461.00	0.84
6	600143	金发科技	382,100	3,702,549.00	0.83
7	601869	长飞光纤	112,734	3,678,510.42	0.83
8	002409	雅克科技	71,700	3,611,529.00	0.81
9	002250	联化科技	224,000	3,472,000.00	0.78
10	002384	东山精密	140,200	3,467,146.00	0.78
11	603127	昭衍新药	59,300	3,463,713.00	0.78

12	002152	广电运通	343,900	3,418,366.00	0.77
13	300115	长盈精密	329,300	3,401,669.00	0.76
14	000970	中科三环	245,300	3,345,892.00	0.75
15	300009	安科生物	352,600	3,300,336.00	0.74
16	300724	捷佳伟创	27,800	3,169,756.00	0.71
17	000012	南玻 A	472,128	3,167,978.88	0.71
18	300861	美畅股份	63,500	3,121,660.00	0.70
19	600582	天地科技	599,200	3,115,840.00	0.70
20	600435	北方导航	265,700	3,082,120.00	0.69
21	300136	信维通信	185,700	3,065,907.00	0.69
22	000537	广宇发展	227,614	3,011,333.22	0.68
23	600131	国网信通	197,000	2,947,120.00	0.66
24	300832	新产业	57,300	2,873,022.00	0.64
25	600718	东软集团	284,900	2,834,755.00	0.64
26	601665	齐鲁银行	672,300	2,803,491.00	0.63
27	002430	杭氧股份	71,100	2,798,496.00	0.63
28	300244	迪安诊断	108,900	2,736,657.00	0.61
29	600879	航天电子	398,800	2,711,840.00	0.61
30	600060	海信视像	199,101	2,695,827.54	0.61
31	002831	裕同科技	78,900	2,609,223.00	0.59
32	600968	海油发展	902,600	2,599,488.00	0.58
33	600521	华海药业	115,300	2,520,458.00	0.57
34	300073	当升科技	44,400	2,504,160.00	0.56
35	600008	首创环保	874,600	2,475,118.00	0.56
36	002353	杰瑞股份	87,000	2,428,170.00	0.55
37	600566	济川药业	88,985	2,422,171.70	0.54
38	603456	九洲药业	56,710	2,406,205.30	0.54
39	601958	金钼股份	206,700	2,387,385.00	0.54
40	603613	国联股份	26,800	2,370,192.00	0.53
41	002625	光启技术	138,300	2,353,866.00	0.53
42	300682	朗新科技	106,800	2,347,464.00	0.53

43	000400	许继电气	117,300	2,342,481.00	0.53
44	600499	科达制造	160,700	2,283,547.00	0.51
45	600755	厦门国贸	318,600	2,274,804.00	0.51
46	002745	木林森	274,400	2,225,384.00	0.50
47	603345	安井食品	13,500	2,185,380.00	0.49
48	002705	新宝股份	130,900	2,179,485.00	0.49
49	600873	梅花生物	208,800	2,125,584.00	0.48
50	002048	宁波华翔	146,000	2,029,400.00	0.46
51	300373	扬杰科技	38,100	2,004,060.00	0.45
52	002192	融捷股份	20,400	1,997,160.00	0.45
53	600376	首开股份	347,300	1,976,137.00	0.44
54	600325	华发股份	215,800	1,955,148.00	0.44
55	603317	天味食品	71,100	1,953,828.00	0.44
56	002738	中矿资源	29,100	1,939,806.00	0.44
57	002244	滨江集团	218,700	1,931,121.00	0.43
58	002056	横店东磁	102,900	1,928,346.00	0.43
59	000937	冀中能源	297,902	1,894,656.72	0.43
60	300699	光威复材	25,900	1,871,275.00	0.42
61	600985	淮北矿业	141,200	1,807,360.00	0.41
62	000402	金融街	342,600	1,798,650.00	0.40
63	601187	厦门银行	305,500	1,750,515.00	0.39
64	601828	美凯龙	372,500	1,747,025.00	0.39
65	002739	万达电影	122,459	1,714,426.00	0.38
66	600500	中化国际	258,000	1,705,380.00	0.38
67	603688	石英股份	12,900	1,694,028.00	0.38
68	600259	广晟有色	42,100	1,692,420.00	0.38
69	002497	雅化集团	70,600	1,641,450.00	0.37
70	600927	永安期货	101,100	1,629,732.00	0.37
71	000729	燕京啤酒	153,000	1,624,860.00	0.36
72	300003	乐普医疗	69,900	1,605,603.00	0.36
73	002124	天邦食品	262,202	1,602,054.22	0.36

74	600871	石化油服	808,200	1,600,236.00	0.36
75	002683	广东宏大	59,000	1,590,640.00	0.36
76	600546	山煤国际	108,100	1,566,369.00	0.35
77	603355	莱克电气	55,700	1,561,828.00	0.35
78	601718	际华集团	536,500	1,561,215.00	0.35
79	600909	华安证券	338,000	1,551,420.00	0.35
80	600895	张江高科	136,600	1,549,044.00	0.35
81	600549	厦门钨业	78,000	1,524,900.00	0.34
82	300568	星源材质	71,300	1,515,838.00	0.34
83	002444	巨星科技	79,000	1,499,420.00	0.34
84	601778	晶科科技	268,200	1,475,100.00	0.33
85	300866	安克创新	24,700	1,463,969.00	0.33
86	300182	捷成股份	325,500	1,454,985.00	0.33
87	688567	孚能科技	53,300	1,440,699.00	0.32
88	688819	天能股份	39,000	1,432,860.00	0.32
89	000415	渤海租赁	641,500	1,417,715.00	0.32
90	600699	均胜电子	100,400	1,410,620.00	0.32
91	002507	涪陵榨菜	54,700	1,409,619.00	0.32
92	601333	广深铁路	618,700	1,404,449.00	0.32
93	601231	环旭电子	86,300	1,400,649.00	0.31
94	601699	潞安环能	81,100	1,366,535.00	0.31
95	002146	荣盛发展	628,700	1,364,279.00	0.31
96	300144	宋城演艺	93,300	1,362,180.00	0.31
97	300676	华大基因	26,100	1,349,109.00	0.30
98	600820	隧道股份	253,100	1,333,837.00	0.30
99	000553	安道麦A	146,000	1,321,300.00	0.30
100	000591	太阳能	175,500	1,286,415.00	0.29
101	600380	健康元	113,900	1,285,931.00	0.29
102	601058	赛轮轮胎	128,100	1,283,562.00	0.29
103	600580	卧龙电驱	103,000	1,283,380.00	0.29
104	688006	杭可科技	29,200	1,278,084.00	0.29

105	600967	内蒙一机	153,800	1,270,388.00	0.29
106	600118	中国卫星	58,900	1,269,295.00	0.28
107	002653	海思科	56,800	1,263,800.00	0.28
108	300390	天华超净	22,600	1,262,888.00	0.28
109	000738	航发控制	48,700	1,248,668.00	0.28
110	002506	协鑫集成	427,800	1,244,898.00	0.28
111	300070	碧水源	260,800	1,233,584.00	0.28
112	603379	三美股份	43,100	1,226,626.00	0.28
113	600956	新天绿能	126,700	1,221,388.00	0.27
114	300253	卫宁健康	118,000	1,213,040.00	0.27
115	002249	大洋电机	231,900	1,187,328.00	0.27
116	600066	宇通客车	156,500	1,175,315.00	0.26
117	300630	普利制药	47,300	1,166,418.00	0.26
118	002985	北摩高科	25,400	1,145,540.00	0.26
119	601000	唐山港	405,200	1,110,248.00	0.25
120	603786	科博达	16,800	1,105,944.00	0.25
121	688538	和辉光电	405,600	1,087,008.00	0.24
122	600901	江苏租赁	195,000	1,068,600.00	0.24
123	300146	汤臣倍健	46,500	1,061,130.00	0.24
124	002299	圣农发展	44,700	1,058,943.00	0.24
125	000728	国元证券	166,800	1,055,844.00	0.24
126	002294	信立泰	32,100	1,054,485.00	0.24
127	603719	良品铺子	28,300	1,043,421.00	0.23
128	002505	鹏都农牧	401,600	1,036,128.00	0.23
129	002690	美亚光电	43,300	1,034,870.00	0.23
130	002019	亿帆医药	84,100	1,030,225.00	0.23
131	603737	三棵树	9,000	1,024,470.00	0.23
132	601598	中国外运	266,000	1,021,440.00	0.23
133	600339	中油工程	336,900	1,003,962.00	0.23
134	001203	大中矿业	77,600	1,003,368.00	0.23
135	603056	德邦股份	47,900	997,757.00	0.22

136	003035	南网能源	171,600	972,972.00	0.22
137	300604	长川科技	21,500	958,470.00	0.22
138	300741	华宝股份	40,400	950,612.00	0.21
139	600398	海澜之家	177,600	941,280.00	0.21
140	000623	吉林敖东	60,200	902,398.00	0.20
141	600511	国药股份	32,200	898,380.00	0.20
142	002966	苏州银行	113,400	882,252.00	0.20
143	600637	东方明珠	132,600	881,790.00	0.20
144	000807	云铝股份	79,200	880,704.00	0.20
145	300363	博腾股份	21,500	878,275.00	0.20
146	600329	达仁堂	30,000	873,000.00	0.20
147	002131	利欧股份	490,300	867,831.00	0.19
148	600208	新湖中宝	340,300	864,362.00	0.19
149	002399	海普瑞	67,200	863,520.00	0.19
150	601108	财通证券	120,400	857,248.00	0.19
151	002195	二三四五	426,121	856,503.21	0.19
152	600064	南京高科	129,500	855,995.00	0.19
153	688009	中国通号	178,100	853,099.00	0.19
154	300474	景嘉微	15,200	829,464.00	0.19
155	001914	招商积余	53,900	828,982.00	0.19
156	601992	金隅集团	326,000	828,040.00	0.19
157	600170	上海建工	318,300	827,580.00	0.19
158	000060	中金岭南	200,600	822,460.00	0.18
159	000155	川能动力	45,500	811,720.00	0.18
160	688385	复旦微电	11,624	811,471.44	0.18
161	601128	常熟银行	107,100	808,605.00	0.18
162	000739	普洛药业	37,200	801,288.00	0.18
163	601928	凤凰传媒	100,800	798,336.00	0.18
164	300058	蓝色光标	157,900	797,395.00	0.18
165	000999	华润三九	17,000	795,770.00	0.18
166	600038	中直股份	16,800	779,688.00	0.18

167	600167	联美控股	123,300	779,256.00	0.17
168	603927	中科软	26,300	778,743.00	0.17
169	600959	江苏有线	260,400	773,388.00	0.17
170	300618	寒锐钴业	19,300	772,965.00	0.17
171	600027	华电国际	129,600	762,048.00	0.17
172	600489	中金黄金	92,800	760,032.00	0.17
173	600863	内蒙华电	215,800	753,142.00	0.17
174	603444	吉比特	2,400	750,816.00	0.17
175	000887	中鼎股份	51,700	748,099.00	0.17
176	000027	深圳能源	117,600	747,936.00	0.17
177	600096	云天化	34,100	717,464.00	0.16
178	603712	七一二	20,500	715,860.00	0.16
179	600032	浙江新能	62,200	714,678.00	0.16
180	000967	盈峰环境	157,400	714,596.00	0.16
181	301029	怡合达	10,500	690,270.00	0.15
182	600704	物产中大	140,900	677,729.00	0.15
183	001227	兰州银行	179,500	676,715.00	0.15
184	002078	太阳纸业	58,500	673,920.00	0.15
185	601156	东航物流	43,900	669,914.00	0.15
186	603868	飞科电器	9,900	666,567.00	0.15
187	000598	兴蓉环境	135,200	661,128.00	0.15
188	000998	隆平高科	39,900	641,193.00	0.14
189	600782	新钢股份	149,200	610,228.00	0.14
190	600667	太极实业	117,500	606,300.00	0.14
191	000932	华菱钢铁	128,400	603,480.00	0.14
192	601568	北元集团	106,400	603,288.00	0.14
193	300168	万达信息	70,700	596,001.00	0.13
194	601666	平煤股份	54,200	585,902.00	0.13
195	002155	湖南黄金	44,900	581,455.00	0.13
196	002368	太极股份	20,600	579,478.00	0.13
197	300558	贝达药业	11,600	571,532.00	0.13

198	600026	中远海能	47,300	569,965.00	0.13
199	002595	豪迈科技	24,100	557,915.00	0.13
200	601555	东吴证券	83,700	546,561.00	0.12
201	300357	我武生物	9,900	545,490.00	0.12
202	601969	海南矿业	72,600	537,966.00	0.12
203	002572	索菲亚	29,400	533,904.00	0.12
204	002203	海亮股份	46,700	527,710.00	0.12
205	000831	中国稀土	16,000	526,080.00	0.12
206	002557	洽洽食品	10,500	525,000.00	0.12
207	002080	中材科技	24,400	522,892.00	0.12
208	600827	百联股份	42,500	515,100.00	0.12
209	000778	新兴铸管	141,000	514,650.00	0.12
210	603228	景旺电子	25,300	512,072.00	0.11
211	688301	奕瑞科技	1,100	503,668.00	0.11
212	600528	中铁工业	63,600	485,268.00	0.11
213	601298	青岛港	86,100	483,021.00	0.11
214	600377	宁沪高速	58,600	481,692.00	0.11
215	000709	河钢股份	212,130	479,413.80	0.11
216	600155	华创阳安	72,600	471,900.00	0.11
217	603605	珀莱雅	2,800	468,944.00	0.11
218	600998	九州通	35,900	468,136.00	0.11
219	000703	恒逸石化	65,100	457,653.00	0.10
220	000785	居然之家	110,400	451,536.00	0.10
221	000960	锡业股份	31,800	448,380.00	0.10
222	600298	安琪酵母	9,908	448,039.76	0.10
223	603939	益丰药房	7,000	446,880.00	0.10
224	002385	大北农	50,200	446,780.00	0.10
225	002439	启明星辰	17,100	445,968.00	0.10
226	000883	湖北能源	105,700	443,940.00	0.10
227	002025	航天电器	6,700	443,875.00	0.10
228	600642	申能股份	80,700	443,043.00	0.10

229	600177	雅戈尔	69,900	442,467.00	0.10
230	000898	鞍钢股份	165,700	442,419.00	0.10
231	600369	西南证券	117,800	441,750.00	0.10
232	000930	中粮科技	52,800	441,408.00	0.10
233	600663	陆家嘴	45,300	441,222.00	0.10
234	600848	上海临港	37,000	441,040.00	0.10
235	002153	石基信息	29,400	440,706.00	0.10
236	002434	万里扬	54,700	440,335.00	0.10
237	600390	五矿资本	86,600	439,928.00	0.10
238	600201	生物股份	48,800	439,688.00	0.10
239	002939	长城证券	53,100	439,668.00	0.10
240	601158	重庆水务	85,700	439,641.00	0.10
241	002372	伟星新材	20,600	439,604.00	0.10
242	601198	东兴证券	56,900	439,268.00	0.10
243	600859	王府井	15,600	438,984.00	0.10
244	600378	昊华科技	10,200	437,682.00	0.10
245	603233	大参林	11,000	435,600.00	0.10
246	000825	太钢不锈	100,800	435,456.00	0.10
247	600885	宏发股份	13,000	434,330.00	0.10
248	002568	百润股份	11,600	433,376.00	0.10
249	601607	上海医药	24,300	433,269.00	0.10
250	002028	思源电气	11,300	431,886.00	0.10
251	300296	利亚德	69,200	391,672.00	0.09
252	600348	华阳股份	26,500	377,625.00	0.08
253	002850	科达利	3,100	368,311.00	0.08
254	688779	长远锂科	24,700	360,373.00	0.08
255	002867	周大生	22,900	321,287.00	0.07
256	688088	虹软科技	13,878	312,393.78	0.07
257	688390	固德威	902	291,427.18	0.07
258	603596	伯特利	3,300	263,340.00	0.06
259	688063	派能科技	824	260,095.60	0.06

260	600598	北大荒	18,900	260,064.00	0.06
261	601872	招商轮船	45,000	251,550.00	0.06
262	603650	彤程新材	8,100	249,723.00	0.06
263	300888	稳健医疗	3,300	235,950.00	0.05
264	600917	重庆燃气	27,600	219,696.00	0.05
265	600079	人福医药	8,900	212,621.00	0.05
266	688777	中控技术	2,300	208,909.00	0.05
267	000513	丽珠集团	5,800	188,384.00	0.04
268	601016	节能风电	47,800	182,118.00	0.04
269	600764	中国海防	7,500	172,200.00	0.04
270	688116	天奈科技	1,746	134,686.44	0.03
271	000156	华数传媒	17,200	128,828.00	0.03
272	600648	外高桥	10,500	125,475.00	0.03
273	600271	航天信息	11,900	123,879.00	0.03
274	002945	华林证券	9,000	118,620.00	0.03
275	603858	步长制药	4,800	100,848.00	0.02
276	601456	国联证券	7,300	82,125.00	0.02
277	688289	圣湘生物	3,200	70,240.00	0.02
278	002081	金螳螂	12,600	61,110.00	0.01
279	601717	郑煤机	4,900	54,684.00	0.01
280	300677	英科医疗	2,500	52,575.00	0.01
281	300001	特锐德	3,300	50,193.00	0.01
282	601990	南京证券	5,800	45,994.00	0.01
283	000997	新大陆	3,400	44,234.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300761	立华股份	23,100	791,175.00	0.18
2	300856	科思股份	15,100	787,465.00	0.18

3	300910	瑞丰新材	6,300	776,853.00	0.17
4	600481	双良节能	59,800	773,812.00	0.17
5	300002	神州泰岳	177,900	772,086.00	0.17
6	600037	歌华有线	94,800	771,672.00	0.17
7	600732	爱旭股份	20,400	771,528.00	0.17
8	002459	晶澳科技	12,800	769,152.00	0.17
9	601908	京运通	117,000	768,690.00	0.17
10	603609	禾丰股份	64,800	767,232.00	0.17
11	300502	新易盛	32,200	764,750.00	0.17
12	002463	沪电股份	64,200	763,980.00	0.17
13	603259	药明康德	9,400	761,400.00	0.17
14	002959	小熊电器	12,600	760,032.00	0.17
15	002085	万丰奥威	127,300	757,435.00	0.17
16	002938	鹏鼎控股	27,600	757,344.00	0.17
17	000921	海信家电	57,400	755,958.00	0.17
18	601567	三星医疗	56,000	754,880.00	0.17
19	002318	久立特材	45,300	753,792.00	0.17
20	603185	上机数控	7,100	751,535.00	0.17
21	603920	世运电路	52,200	750,636.00	0.17
22	002478	常宝股份	133,100	749,353.00	0.17
23	002955	鸿合科技	31,700	746,535.00	0.17
24	300532	今天国际	51,500	745,720.00	0.17
25	002756	永兴材料	8,000	737,360.00	0.17
26	600785	新华百货	34,700	643,338.00	0.14
27	605077	华康股份	19,200	582,528.00	0.13
28	603105	芯能科技	38,600	568,578.00	0.13
29	300575	中旗股份	25,700	562,059.00	0.13
30	300705	九典制药	23,000	558,900.00	0.13
31	300494	盛天网络	36,900	550,917.00	0.12
32	600995	南网储能	38,200	550,844.00	0.12
33	605060	联德股份	21,300	549,753.00	0.12

34	603901	永创智能	34,700	548,260.00	0.12
35	603600	永艺股份	56,100	546,975.00	0.12
36	603586	金麒麟	41,400	545,652.00	0.12
37	002832	比音勒芬	21,300	545,493.00	0.12
38	603035	常熟汽饰	25,600	544,000.00	0.12
39	002303	美盈森	153,500	543,390.00	0.12
40	600284	浦东建设	80,600	543,244.00	0.12
41	300982	苏文电能	11,000	542,300.00	0.12
42	688599	天合光能	8,500	541,960.00	0.12
43	300130	新国都	44,900	541,943.00	0.12
44	002997	瑞鹄模具	22,200	541,680.00	0.12
45	002947	恒铭达	27,400	541,150.00	0.12
46	002204	大连重工	104,200	540,798.00	0.12
47	603319	湘油泵	36,200	540,466.00	0.12
48	688518	联赢激光	18,500	540,385.00	0.12
49	603129	春风动力	4,800	540,096.00	0.12
50	600742	一汽富维	64,600	540,056.00	0.12
51	300580	贝斯特	29,000	539,980.00	0.12
52	601702	华峰铝业	36,100	539,695.00	0.12
53	301193	家联科技	16,300	539,693.00	0.12
54	301096	百诚医药	7,900	539,649.00	0.12
55	603187	海容冷链	17,000	539,240.00	0.12
56	002937	兴瑞科技	23,800	539,070.00	0.12
57	301004	嘉益股份	18,100	539,018.00	0.12
58	600491	龙元建设	85,500	537,795.00	0.12
59	002887	绿茵生态	63,400	537,632.00	0.12
60	002839	张家港行	116,600	537,526.00	0.12
61	300272	开能健康	103,000	536,630.00	0.12
62	603676	卫信康	33,700	536,504.00	0.12
63	002662	京威股份	162,700	535,283.00	0.12
64	603179	新泉股份	13,900	535,011.00	0.12

65	002790	瑞尔特	62,700	534,831.00	0.12
66	300035	中科电气	25,900	533,022.00	0.12
67	603040	新坐标	31,200	532,896.00	0.12
68	603906	龙蟠科技	23,000	532,450.00	0.12
69	300230	永利股份	140,800	532,224.00	0.12
70	688559	海目星	9,200	532,128.00	0.12
71	603305	旭升集团	16,500	531,960.00	0.12
72	002050	三花智控	25,000	530,500.00	0.12
73	002475	立讯精密	16,700	530,225.00	0.12
74	688123	聚辰股份	5,200	526,240.00	0.12
75	688556	高测股份	7,000	525,140.00	0.12
76	300450	先导智能	13,000	523,250.00	0.12
77	688047	龙芯中科	4,018	343,338.10	0.08
78	688506	百利天恒	10,712	264,586.40	0.06
79	300750	宁德时代	600	236,052.00	0.05
80	603199	九华旅游	8,300	235,969.00	0.05
81	603998	方盛制药	29,200	233,892.00	0.05
82	688172	燕东微	12,937	232,348.52	0.05
83	600821	金开新能	32,000	231,680.00	0.05
84	002594	比亚迪	900	231,273.00	0.05
85	000735	罗牛山	32,700	231,189.00	0.05
86	002772	众兴菌业	27,600	229,632.00	0.05
87	000417	合肥百货	42,000	228,900.00	0.05
88	601319	中国人保	43,700	228,114.00	0.05
89	600795	国电电力	53,400	228,018.00	0.05
90	300498	温氏股份	11,600	227,708.00	0.05
91	600236	桂冠电力	39,500	227,520.00	0.05
92	300109	新开源	9,400	227,480.00	0.05
93	002697	红旗连锁	40,400	227,452.00	0.05
94	603363	傲农生物	17,600	226,864.00	0.05
95	002100	天康生物	27,300	226,863.00	0.05

96	000600	建投能源	43,200	226,800.00	0.05
97	000876	新希望	17,500	225,925.00	0.05
98	601006	大秦铁路	33,800	225,784.00	0.05
99	300511	雪榕生物	35,000	225,750.00	0.05
100	002003	伟星股份	22,300	225,676.00	0.05
101	300716	国立科技	16,400	225,500.00	0.05
102	601138	工业富联	24,500	224,910.00	0.05
103	002518	科士达	3,900	224,640.00	0.05
104	300881	盛德鑫泰	7,000	224,630.00	0.05
105	601390	中国中铁	40,400	224,624.00	0.05
105	600039	四川路桥	20,200	224,624.00	0.05
107	600660	福耀玻璃	6,400	224,448.00	0.05
108	002649	博彦科技	21,800	224,322.00	0.05
109	000568	泸州老窖	1,000	224,280.00	0.05
110	002714	牧原股份	4,600	224,250.00	0.05
110	002597	金禾实业	6,900	224,250.00	0.05
112	300628	亿联网络	3,700	224,183.00	0.05
113	002548	金新农	37,300	224,173.00	0.05
114	603668	天马科技	12,500	224,000.00	0.05
115	000521	长虹美菱	53,200	223,972.00	0.05
116	603086	先达股份	17,100	223,839.00	0.05
117	603612	索通发展	8,600	223,772.00	0.05
118	601088	中国神华	8,100	223,722.00	0.05
119	000425	徐工机械	44,100	223,587.00	0.05
120	600741	华域汽车	12,900	223,557.00	0.05
121	603556	海兴电力	12,700	223,520.00	0.05
122	600971	恒源煤电	31,200	223,392.00	0.05
123	000651	格力电器	6,900	223,008.00	0.05
124	000915	华特达因	4,900	222,950.00	0.05
125	002004	华邦健康	43,700	222,870.00	0.05
126	600057	厦门象屿	21,700	222,859.00	0.05

127	601825	沪农商行	37,900	222,852.00	0.05
128	000560	我爱我家	89,100	222,750.00	0.05
129	300192	科德教育	31,100	222,676.00	0.05
130	300673	佩蒂股份	12,600	222,390.00	0.05
131	000090	天健集团	40,700	222,222.00	0.05
132	002129	TCL中环	5,900	222,194.00	0.05
133	601633	长城汽车	7,500	222,150.00	0.05
134	000517	荣安地产	75,300	222,135.00	0.05
135	000002	万科A	12,200	222,040.00	0.05
136	002821	凯莱英	1,500	222,000.00	0.05
137	600322	天房发展	98,200	221,932.00	0.05
138	002965	祥鑫科技	3,800	221,198.00	0.05
139	600233	圆通速递	11,000	220,990.00	0.05
140	002312	川发龙蟒	21,000	220,920.00	0.05
141	000408	藏格矿业	8,500	220,745.00	0.05
142	300639	凯普生物	13,100	220,735.00	0.05
143	600933	爱柯迪	12,100	220,341.00	0.05
144	300796	贝斯美	10,900	220,180.00	0.05
145	603529	爱玛科技	4,800	220,176.00	0.05
146	600438	通威股份	5,700	219,906.00	0.05
147	601012	隆基绿能	5,200	219,752.00	0.05
148	603867	新化股份	6,800	219,640.00	0.05
149	300298	三诺生物	6,500	219,245.00	0.05
150	002258	利尔化学	12,200	219,112.00	0.05
151	600050	中国联通	48,900	219,072.00	0.05
152	300438	鹏辉能源	2,800	218,372.00	0.05
153	600150	中国船舶	9,800	218,344.00	0.05
154	301035	润丰股份	2,500	217,750.00	0.05
155	603599	广信股份	7,400	217,560.00	0.05
156	603876	鼎胜新材	5,300	217,512.00	0.05
157	603659	璞泰来	4,100	212,749.00	0.05

158	688205	德科立	4,293	210,271.14	0.05
159	301363	美好医疗	4,326	179,544.68	0.04
160	301297	富乐德	10,147	150,256.17	0.03
161	301335	天元宠物	4,192	147,884.08	0.03
162	301311	昆船智能	8,320	145,957.76	0.03
163	301280	珠城科技	2,783	132,065.20	0.03
164	301277	新天地	4,384	125,209.57	0.03
165	301290	东星医疗	3,291	122,423.13	0.03
166	301361	众智科技	5,169	115,134.16	0.03
167	688496	清越科技	12,000	103,800.00	0.02
168	301398	星源卓镁	2,549	78,837.80	0.02
169	688244	永信至诚	1,506	75,510.84	0.02
170	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.02
171	301316	慧博云通	3,584	67,028.63	0.02
172	301368	丰立智能	3,368	66,558.14	0.01
173	301269	华大九天	544	47,839.36	0.01
174	301238	瑞泰新材	1,641	36,906.09	0.01
175	301327	华宝新能	170	30,084.90	0.01
176	301308	江波龙	485	27,509.20	0.01
177	301367	怡和嘉业	143	25,136.54	0.01
178	301267	华夏眼科	318	21,051.60	0.00
179	301152	天力锂能	380	17,723.20	0.00
180	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
181	301389	隆扬电子	886	15,203.76	0.00
182	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
183	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
184	301171	易点天下	795	14,087.40	0.00
185	301339	通行宝	901	14,046.59	0.00
186	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
187	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
188	301115	建科股份	520	12,500.80	0.00

189	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
190	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
191	301349	信德新材	98	10,144.96	0.00
192	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
193	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
194	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
195	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
196	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
197	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600566	济川药业	38,935,788.51	5.43
2	600718	东软集团	35,222,316.01	4.91
3	603456	九洲药业	33,081,462.94	4.62
4	600582	天地科技	32,710,933.81	4.56
5	600673	东阳光	30,250,436.20	4.22
6	601128	常熟银行	29,032,903.72	4.05
7	600348	华阳股份	29,010,451.45	4.05
8	000519	中兵红箭	27,454,720.49	3.83
9	000930	中粮科技	27,136,589.39	3.79
10	600380	健康元	26,687,479.28	3.72
11	002815	崇达技术	26,590,451.00	3.71
12	002505	鹏都农牧	26,476,269.16	3.69
13	601598	中国外运	26,308,661.00	3.67
14	300009	安科生物	26,266,342.00	3.66
15	601718	际华集团	26,212,390.00	3.66
16	000778	新兴铸管	25,799,114.85	3.60

17	601156	东航物流	25,313,743.81	3.53
18	600160	巨化股份	25,275,151.44	3.53
19	600497	驰宏锌锗	25,258,087.13	3.52
20	601717	郑煤机	25,243,550.50	3.52
21	002390	信邦制药	25,140,444.49	3.51
22	603613	国联股份	25,014,437.95	3.49
23	601958	金钼股份	24,902,600.00	3.47
24	600499	科达制造	24,902,262.01	3.47
25	601187	厦门银行	24,598,125.00	3.43
26	600968	海油发展	24,205,407.00	3.38
27	300418	昆仑万维	23,837,810.03	3.33
28	000598	兴蓉环境	23,757,995.40	3.31
29	000970	中科三环	23,707,763.00	3.31
30	600970	中材国际	23,696,390.68	3.31
31	002422	科伦药业	23,148,365.69	3.23
32	300296	利亚德	23,054,201.00	3.22
33	002416	爱施德	22,687,739.97	3.17
34	600131	国网信通	22,605,585.98	3.15
35	600728	佳都科技	22,593,502.80	3.15
36	600572	康恩贝	22,328,755.00	3.12
37	600415	小商品城	22,073,501.50	3.08
38	300017	网宿科技	21,997,187.12	3.07
39	600985	淮北矿业	21,971,793.83	3.07
40	300072	海新能科	21,812,872.00	3.04
41	601869	长飞光纤	21,500,236.22	3.00
42	601699	潞安环能	21,476,117.36	3.00
43	000402	金融街	21,262,703.90	2.97
44	600008	首创环保	21,060,195.00	2.94
45	600867	通化东宝	20,920,241.68	2.92
46	300363	博腾股份	20,812,661.00	2.90
47	002507	涪陵榨菜	20,786,554.35	2.90

48	600549	厦门钨业	20,754,530.00	2.90
49	300168	万达信息	20,694,639.88	2.89
50	002468	申通快递	20,681,009.30	2.89
51	600959	江苏有线	20,431,950.40	2.85
52	600256	广汇能源	20,301,105.36	2.83
53	000988	华工科技	20,218,659.60	2.82
54	600546	山煤国际	20,183,976.17	2.82
55	688006	杭可科技	20,177,135.97	2.81
56	600787	中储股份	20,174,555.72	2.81
57	600487	亨通光电	20,116,355.27	2.81
58	600141	兴发集团	19,809,798.00	2.76
59	002019	亿帆医药	19,492,875.40	2.72
60	000960	锡业股份	19,384,972.00	2.70
61	001914	招商积余	19,234,799.76	2.68
62	002705	新宝股份	19,196,494.18	2.68
63	601866	中远海发	19,154,523.00	2.67
64	000401	冀东水泥	19,117,469.45	2.67
65	601872	招商轮船	18,777,304.00	2.62
66	002745	木林森	18,709,601.00	2.61
67	603127	昭衍新药	18,526,751.04	2.58
68	000983	山西焦煤	18,381,505.00	2.56
69	600521	华海药业	18,153,217.00	2.53
70	002004	华邦健康	18,104,582.00	2.53
71	000729	燕京啤酒	18,093,067.00	2.52
72	600233	圆通速递	18,026,292.33	2.51
73	603355	莱克电气	17,851,723.00	2.49
74	300308	中际旭创	17,809,729.64	2.48
75	300212	易华录	17,791,159.08	2.48
76	300244	迪安诊断	17,758,113.00	2.48
77	300630	普利制药	17,567,181.72	2.45
78	600967	内蒙一机	17,555,747.00	2.45

79	600039	四川路桥	17,545,622.37	2.45
80	600765	中航重机	17,490,710.14	2.44
81	002434	万里扬	17,283,102.84	2.41
82	600737	中粮糖业	17,248,107.00	2.41
83	002010	传化智联	17,231,220.00	2.40
84	002396	星网锐捷	17,207,583.00	2.40
85	601298	青岛港	17,143,293.00	2.39
86	002124	天邦食品	17,131,979.06	2.39
87	600879	航天电子	17,058,570.07	2.38
88	600875	东方电气	17,048,366.00	2.38
89	002180	纳思达	16,905,829.00	2.36
90	600732	爱旭股份	16,894,747.68	2.36
91	600909	华安证券	16,873,488.20	2.35
92	002244	滨江集团	16,870,466.00	2.35
93	002212	天融信	16,857,039.00	2.35
94	300037	新宙邦	16,853,368.88	2.35
95	000709	河钢股份	16,851,764.25	2.35
96	600782	新钢股份	16,742,880.00	2.34
97	600325	华发股份	16,736,007.95	2.33
98	300073	当升科技	16,706,443.94	2.33
99	002966	苏州银行	16,680,965.06	2.33
100	600511	国药股份	16,678,702.46	2.33
101	002152	广电运通	16,617,820.00	2.32
102	600155	华创阳安	16,601,114.00	2.32
103	600597	光明乳业	16,489,777.29	2.30
104	000060	中金岭南	16,358,094.00	2.28
105	300182	捷成股份	16,233,898.76	2.26
106	002756	永兴材料	16,209,458.38	2.26
107	601665	齐鲁银行	16,199,884.00	2.26
108	000537	广宇发展	16,138,264.92	2.25
109	002273	水晶光电	16,127,948.20	2.25

110	300070	碧水源	16,114,085.00	2.25
111	603379	三美股份	16,083,607.97	2.24
112	002444	巨星科技	16,081,957.00	2.24
113	600037	歌华有线	15,865,721.80	2.21
114	300769	德方纳米	15,826,011.52	2.21
115	600500	中化国际	15,811,963.00	2.21
116	601016	节能风电	15,807,889.73	2.21
117	600956	新天绿能	15,805,581.02	2.20
118	000553	安道麦A	15,793,683.30	2.20
119	601333	广深铁路	15,665,786.00	2.19
120	600667	太极实业	15,642,077.62	2.18
121	002353	杰瑞股份	15,630,103.48	2.18
122	000031	大悦城	15,561,162.00	2.17
123	300832	新产业	15,509,804.00	2.16
124	002375	亚厦股份	15,501,556.00	2.16
125	002572	索菲亚	15,435,029.49	2.15
126	300474	景嘉微	15,410,826.94	2.15
127	000062	深圳华强	15,321,028.08	2.14
128	600208	新湖中宝	15,227,778.87	2.12
129	600372	中航电子	15,190,551.14	2.12
130	600820	隧道股份	15,189,135.00	2.12
131	601611	中国核建	15,162,021.43	2.12
132	600764	中国海防	15,147,826.99	2.11
133	600392	盛和资源	15,132,386.00	2.11
134	601077	渝农商行	15,056,707.00	2.10
135	002384	东山精密	15,005,061.74	2.09
136	600839	四川长虹	14,990,593.00	2.09
137	002683	广东宏大	14,940,049.00	2.08
138	000039	中集集团	14,886,333.35	2.08
139	600486	扬农化工	14,841,397.54	2.07
140	601615	明阳智能	14,738,996.00	2.06

141	600315	上海家化	14,700,192.00	2.05
142	002430	杭氧股份	14,677,796.65	2.05
143	600435	北方导航	14,631,318.00	2.04
144	600717	天津港	14,539,517.40	2.03
145	600663	陆家嘴	14,517,200.16	2.03

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600566	济川药业	35,946,010.17	5.01
2	600348	华阳股份	34,429,424.91	4.80
3	600673	东阳光	34,137,966.48	4.76
4	601128	常熟银行	34,056,580.40	4.75
5	603456	九洲药业	33,729,224.53	4.71
6	600718	东软集团	30,929,249.68	4.31
7	601156	东航物流	30,053,554.66	4.19
8	600582	天地科技	29,778,750.60	4.15
9	601598	中国外运	29,451,850.00	4.11
10	002505	鹏都农牧	28,664,558.40	4.00
11	000519	中兵红箭	28,361,433.00	3.96
12	603613	国联股份	27,911,863.06	3.89
13	600970	中材国际	27,694,335.40	3.86
14	002815	崇达技术	26,743,110.00	3.73
15	000930	中粮科技	26,718,499.51	3.73
16	000598	兴蓉环境	26,643,550.97	3.72
17	601717	郑煤机	26,551,383.18	3.70
18	002416	爱施德	26,493,264.12	3.70
19	000778	新兴铸管	26,240,262.30	3.66
20	601699	潞安环能	26,228,156.00	3.66
21	601958	金钼股份	26,214,465.00	3.66

22	300418	昆仑万维	26,133,224.30	3.65
23	000970	中科三环	25,678,764.02	3.58
24	600380	健康元	25,382,930.11	3.54
25	002390	信邦制药	25,164,406.18	3.51
26	600160	巨化股份	24,850,370.00	3.47
27	000988	华工科技	24,786,184.72	3.46
28	600141	兴发集团	24,723,401.24	3.45
29	600497	驰宏锌锗	24,712,747.87	3.45
30	601718	际华集团	24,474,198.00	3.41
31	600415	小商品城	24,423,462.76	3.41
32	300072	海新能科	24,361,371.00	3.40
33	300009	安科生物	23,769,313.63	3.32
34	600256	广汇能源	23,620,742.00	3.30
35	600968	海油发展	23,479,374.00	3.28
36	000960	锡业股份	23,399,266.48	3.26
37	300363	博腾股份	22,903,108.00	3.20
38	600546	山煤国际	22,872,654.00	3.19
39	600499	科达制造	22,802,872.45	3.18
40	300296	利亚德	22,355,812.12	3.12
41	002422	科伦药业	22,312,002.21	3.11
42	002468	申通快递	22,285,221.26	3.11
43	601187	厦门银行	22,219,740.00	3.10
44	600959	江苏有线	22,074,383.50	3.08
45	600572	康恩贝	22,015,372.27	3.07
46	600131	国网信通	21,726,276.04	3.03
47	600728	佳都科技	21,595,508.20	3.01
48	000729	燕京啤酒	21,318,173.00	2.97
49	300168	万达信息	21,273,576.12	2.97
50	600787	中储股份	21,181,213.97	2.95
51	601872	招商轮船	21,168,736.80	2.95
52	001914	招商积余	21,148,246.88	2.95

53	002244	滨江集团	20,987,124.00	2.93
54	002180	纳思达	20,957,219.00	2.92
55	600867	通化东宝	20,687,471.79	2.89
56	600487	亨通光电	20,265,538.03	2.83
57	600233	圆通速递	20,107,059.82	2.81
58	002010	传化智联	20,050,068.00	2.80
59	002434	万里扬	19,863,758.00	2.77
60	600325	华发股份	19,836,112.53	2.77
61	000709	河钢股份	19,809,469.19	2.76
62	601615	明阳智能	19,638,192.00	2.74
63	688006	杭可科技	19,638,145.48	2.74
64	600985	淮北矿业	19,633,213.61	2.74
65	002396	星网锐捷	19,311,794.00	2.69
66	600039	四川路桥	19,305,338.98	2.69
67	002745	木林森	19,304,797.00	2.69
68	002507	涪陵榨菜	19,253,604.01	2.69
69	000983	山西焦煤	19,232,193.00	2.68
70	603379	三美股份	19,112,939.14	2.67
71	600765	中航重机	18,950,240.40	2.64
72	000402	金融街	18,917,513.71	2.64
73	002128	电投能源	18,859,946.60	2.63
74	300630	普利制药	18,816,362.43	2.63
75	601866	中远海发	18,781,029.00	2.62
76	300212	易华录	18,704,334.92	2.61
77	002004	华邦健康	18,640,411.18	2.60
78	300244	迪安诊断	18,531,724.22	2.59
79	000401	冀东水泥	18,413,972.66	2.57
80	000060	中金岭南	18,284,849.92	2.55
81	300017	网宿科技	18,263,499.92	2.55
82	600008	首创环保	18,253,545.80	2.55
83	600875	东方电气	18,187,352.00	2.54

84	002019	亿帆医药	18,180,448.95	2.54
85	600549	厦门钨业	18,143,499.00	2.53
86	002557	洽洽食品	18,095,004.24	2.52
87	600967	内蒙一机	18,030,089.96	2.52
88	002212	天融信	17,753,127.00	2.48
89	000039	中集集团	17,548,492.45	2.45
90	600909	华安证券	17,526,977.00	2.45
91	601333	广深铁路	17,525,774.00	2.44
92	002156	通富微电	17,283,179.10	2.41
93	000062	深圳华强	17,255,797.10	2.41
94	002705	新宝股份	17,221,796.40	2.40
95	600732	爱旭股份	16,703,561.08	2.33
96	601298	青岛港	16,688,313.16	2.33
97	600500	中化国际	16,660,779.50	2.32
98	600737	中粮糖业	16,611,476.00	2.32
99	300474	景嘉微	16,394,893.33	2.29
100	300037	新宙邦	16,385,081.45	2.29
101	601869	长飞光纤	16,337,413.31	2.28
102	600597	光明乳业	16,328,148.01	2.28
103	601611	中国核建	16,246,177.22	2.27
104	603589	口子窖	16,238,269.00	2.27
105	300699	光威复材	16,213,988.00	2.26
106	000031	大悦城	16,145,511.00	2.25
107	600782	新钢股份	16,116,590.00	2.25
108	300769	德方纳米	16,069,218.80	2.24
109	603868	飞科电器	16,030,581.57	2.24
110	000553	安道麦A	15,954,933.10	2.23
111	600155	华创阳安	15,887,978.00	2.22
112	601016	节能风电	15,872,281.20	2.21
113	603127	昭衍新药	15,866,700.04	2.21
114	002368	太极股份	15,839,883.68	2.21

115	603355	莱克电气	15,810,500.77	2.21
116	002683	广东宏大	15,796,063.92	2.20
117	600511	国药股份	15,753,890.40	2.20
118	300182	捷成股份	15,729,340.19	2.19
119	002966	苏州银行	15,685,474.94	2.19
120	000959	首钢股份	15,519,428.02	2.17
121	600663	陆家嘴	15,456,474.12	2.16
122	002430	杭氧股份	15,427,892.90	2.15
123	600521	华海药业	15,398,498.55	2.15
124	002756	永兴材料	15,378,043.26	2.15
125	002506	协鑫集成	15,377,439.02	2.15
126	000887	中鼎股份	15,295,178.00	2.13
127	601077	渝农商行	15,258,906.78	2.13
128	600372	中航电子	15,141,232.28	2.11
129	002444	巨星科技	15,081,980.00	2.10
130	600879	航天电子	14,998,941.23	2.09
131	002048	宁波华翔	14,961,736.72	2.09
132	600839	四川长虹	14,943,625.44	2.08
133	600667	太极实业	14,904,785.78	2.08
134	601000	唐山港	14,892,609.21	2.08
135	600037	歌华有线	14,839,280.10	2.07
136	601689	拓普集团	14,828,022.40	2.07
137	300070	碧水源	14,827,357.00	2.07
138	000738	航发控制	14,784,037.40	2.06
139	002124	天邦食品	14,782,006.00	2.06
140	600392	盛和资源	14,758,405.00	2.06
141	601456	国联证券	14,750,599.00	2.06
142	002375	亚厦股份	14,684,755.00	2.05
143	600339	中油工程	14,593,124.44	2.04
144	600739	辽宁成大	14,486,734.08	2.02
145	300257	开山股份	14,485,708.00	2.02

146	600064	南京高科	14,483,363.20	2.02
147	000537	广宇发展	14,474,727.00	2.02
148	000559	万向钱潮	14,439,138.78	2.01
149	300073	当升科技	14,400,996.58	2.01
150	600764	中国海防	14,372,360.22	2.01

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,769,585,103.17
卖出股票收入（成交）总额	6,905,226,795.05

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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)	343,562.98	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	343,562.98	0.08

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110089	兴发转债	1,460	166,071.02	0.04
2	113659	莱克转债	1,080	126,487.38	0.03

3	113063	赛轮转债	400	51,004.58	0.01
---	--------	------	-----	-----------	------

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无余额。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无余额。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无余额。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	546,101.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	546,101.96

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信建投中证500增强A	13,012	12,308.20	13,385,022.52	8.3576%	146,769,241.00	91.6424%
中信建投中证500	13,900	11,993.00	19,559,524.82	11.7332%	147,143,230.76	88.2668%

增强 C						
合计	26,400	12,380.95	32,944,547.34	10.0792%	293,912,471.76	89.9208%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信建投中证500增强A	456,913.15	0.2853%
	中信建投中证500增强C	57,643.34	0.0346%
	合计	514,556.49	0.1574%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的 数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	中信建投中证500增强A	0~10
	中信建投中证500增强C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	中信建投中证500增强A	0~10
	中信建投中证500增强C	0~10
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C
基金合同生效日(2020年05月09日)基金份额总额	109,947,302.18	162,449,314.06
本报告期期初基金份额总额	193,697,880.00	232,946,227.85
本报告期基金总申购份额	71,141,146.06	157,575,185.81
减：本报告期基金总赎回份额	104,684,762.54	223,818,658.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	160,154,263.52	166,702,755.58

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用60,000.00元整，该审计机构自2020年5月9日（基金合同生效日）起为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

中信证券（券商柜台）	2	11,142,832,673.20	81.64%	8,064,481.99	85.94%	-
中信建投证券	3	2,506,037,261.76	18.36%	1,319,407.22	14.06%	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字〔2007〕48号）的规定及本基金管理人的《中信建投基金管理有限公司公募基金交易单元管理办法》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）证券经纪商的选择由公司权益投资相关部门负责人根据证券经纪商投资研究服务综合评价，作出交易单元开设或撤销的相关决定。经公司分管领导通过后，方可办理相关的交易单元开设或撤销事宜。

（2）权益投资相关部门每季度组织相关部门完成对各往来证券经纪商的研究服务评估。权益投资相关部门根据评估结果调整确定个别证券经纪商的交易金额及比率限制的参考。

（3）评估实行评分制，具体如下：

分配权重（100分）=基础研究服务（70%）+综合研究服务（20%）+特别研究服务（10%）。基础研究服务占70%权重和综合研究服务占20%权重，由权益投资相关部门组织投研条线相关人员进行打分；特别研究服务占10%权重，由系统跟踪股票涨跌幅后生成得分。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券（券商柜台）	183,133.19	75.24%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	60,250.88	24.76%	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-05
2	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-08
3	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-08
4	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-15
5	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-17
6	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票及相关风险提示的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-20
7	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2021年第4季度报告提示性公告	规定报刊	2022-01-24
8	中信建投中证500指数增强型证券投资基金2021年第4季度报告	规定网站	2022-01-24
9	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加上海	规定网站、规定报刊	2022-01-27

	万得基金销售有限公司为代 销机构并开通定期定额投资 业务的公告		
10	中信建投基金管理有限公司 关于公司股东变更的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-27
11	关于调整中信建投中证500 指数增强型证券投资基金在 中国中金财富证券有限公司 申购及定投起点金额的公告	规定网站、规定报刊	2022-02-09
12	中信建投基金管理有限公司 关于完成股东变更工商变更 登记的公告	规定网站、规定报刊	2022-02-11
13	关于中信建投中证500指数 增强型证券投资基金增加和 耕传承基金销售有限公司为 代销机构并开通定期定额投 资业务及开展费率优惠的公 告	规定网站、规定报刊	2022-02-14
14	关于调整中信建投中证500 指数增强型证券投资基金在 京东肯特瑞基金销售有限公 司申购及定投起点金额的公 告	规定网站、规定报刊	2022-02-22
15	中信建投基金管理有限公司 关于旗下部分基金投资关联 方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-03-10
16	关于中信建投基金管理有限 公司旗下部分基金参加中信 建投证券股份有限公司基金 申购(含定投)费率优惠活 动的公告	规定网站、规定报刊	2022-03-11
17	关于中信建投中证500指数 增强型证券投资基金投资关 联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-03-11

18	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2021年年度报告提示性公告	规定报刊	2022-03-31
19	中信建投中证500指数增强型证券投资基金2021年年度报告	规定网站	2022-03-31
20	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-02
21	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-07
22	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加济安财富（北京）基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-08
23	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-12
24	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加北京创金启富基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-14
25	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加上海联泰基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-19
26	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年第1季	规定报刊	2022-04-22

	度报告提示性公告		
27	中信建投中证500指数增强型证券投资基金2022年第1季度报告	规定网站	2022-04-22
28	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资及开展费率优惠业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-25
29	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-28
30	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加招商银行股份有限公司招赢通为销售平台并开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-29
31	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加招商银行股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-05-10
32	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加交通银行股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资及开展费率优惠业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-05-17
33	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-05-28
34	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加青岛	规定网站、规定报刊	2022-05-30

	意才基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资及开展费率优惠业务的公告		
35	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中信建投证券股份有限公司调整定投起点金额的公告	规定网站、规定报刊	2022-05-31
36	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-06-01
37	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-06-11
38	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-06-15
39	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-06-18
40	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-02
41	中信建投基金管理有限公司关于暂停北京微动利基金销售有限公司和喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-18
42	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年第2季度报告提示性公告	规定报刊	2022-07-21
43	中信建投中证500指数增强型证券投资基金2022年第2季度报告	规定网站	2022-07-21

44	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-23
45	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-29
46	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加中国银河证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-29
47	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-29
48	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-30
49	中信建投基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司和北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-03
50	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-06
51	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-11
52	中信建投基金管理有限公司	规定网站、规定报刊	2022-08-11

	关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告		
53	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-12
54	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-13
55	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-17
56	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-20
57	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资及开展费率优惠业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-25
58	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-27
59	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年中期报告提示性公告	规定报刊	2022-08-31
60	中信建投中证500指数增强型证券投资基金2022年中期报告	规定网站	2022-08-31
61	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-09-01
62	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关	规定网站、规定报刊	2022-09-03

	关联方承销证券的公告		
63	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加招商证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-09-21
64	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加财咨道信息技术有限公司为代销机构并开通定期定额投资及开展费率优惠业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-09-23
65	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-10-13
66	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-10-14
67	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-10-14
68	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-10-20
69	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年第3季度报告提示性公告	规定报刊	2022-10-26
70	中信建投中证500指数增强型证券投资基金2022年第3季度报告	规定网站	2022-10-26
71	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金增加信达证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-10-27

72	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加兴业银行股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-10-28
73	关于中信建投基金管理有限公司旗下基金在销售机构开通定投业务、定投起点金额及申购费率优惠业务的提示性公告	规定网站、规定报刊	2022-11-01
74	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-11-04
75	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-11-05
76	中信建投中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	规定网站	2022-11-11
77	中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要	规定网站	2022-11-11
78	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告（一）	规定网站、规定报刊	2022-11-12
79	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告（二）	规定网站、规定报刊	2022-11-12
80	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-11-12
81	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联	规定网站、规定报刊	2022-11-25

	方承销证券的公告		
82	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-11-30
83	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加泛华普益基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资及开展费率优惠业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-12-01
84	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-12-03
85	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-12-10

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投中证500指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司

二〇二三年三月三十一日