

中加中证 500 指数增强型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 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

送出日期:2023 年 08 月 30 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至2023年6月30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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
7.3 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	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	76
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	76
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	76
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	76
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	76
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
7.12 投资组合报告附注	76
§8 基金份额持有人信息	77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	78
§9 开放式基金份额变动	79
§10 重大事件揭示	79
10.1 基金份额持有人大会决议	79
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
10.4 基金投资策略的改变	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	80
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	80
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
10.8 其他重大事件	81
§11 影响投资者决策的其他重要信息	81
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	82
§12 备查文件目录	82
12.1 备查文件目录	82
12.2 存放地点	82
12.3 查阅方式	82

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中加中证500指数增强型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	74,441,474.35份	
基金合同存续期	不定期	
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	22,257,488.31份	52,183,986.04份

2.2 基金产品说明

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。
--	-------------

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		中加基金管理有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凌	朱志明
	联系电话	400-00-95526	4008-888-108
	电子邮箱	service@bobbns.com	service@csc.com.cn
客户服务电话		400-00-95526	95587
传真		010-83197627	010-85130975
注册地址		北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址		北京市西城区南纬路35号	北京市东城区朝内大街2号凯恒中心B座10层
邮政编码		100050	100010
法定代表人		夏远洋	王常青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bobbns.com
基金中期报告备置地点	基金管理人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	中加中证500指数 增强A	中加中证500指数 增强C
本期已实现收益	1,342,955.09	882,881.58
本期利润	2,188,912.69	1,261,347.06
加权平均基金份额本期利润	0.0732	0.0237
本期加权平均净值利润率	7.53%	2.46%
本期基金份额净值增长率	2.38%	2.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-1,080,578.16	-2,960,743.32
期末可供分配基金份额利润	-0.0485	-0.0567
期末基金资产净值	21,176,910.15	49,223,242.72
期末基金份额净值	0.9515	0.9433
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-4.85%	-5.67%

注：1、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；

2、本期已实现收益是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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生额）。

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

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	①-③	②-④

				④		
过去一个月	0.66%	0.83%	-0.77%	0.89%	1.43%	-0.06%
过去三个月	-3.35%	0.71%	-5.10%	0.78%	1.75%	-0.07%
过去六个月	2.38%	0.71%	2.20%	0.75%	0.18%	-0.04%
过去一年	-7.95%	0.90%	-6.65%	0.91%	-1.30%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-4.85%	1.04%	-3.39%	1.07%	-1.46%	-0.03%

中加中证500指数增强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
过去一个月	0.63%	0.83%	-0.77%	0.89%	1.40%	-0.06%
过去三个月	-3.43%	0.71%	-5.10%	0.78%	1.67%	-0.07%
过去六个月	2.23%	0.71%	2.20%	0.75%	0.03%	-0.04%
过去一年	-8.23%	0.90%	-6.65%	0.91%	-1.58%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-5.67%	1.04%	-3.39%	1.07%	-2.28%	-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
(2020年09月27日-2023年06月30日)



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
(2020年09月27日-2023年06月30日)



§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

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地种业（集团）有限公司6%、中国有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

本报告期内，本基金管理人共管理七十五只基金，分别是中加货币市场基金（A/C）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加丰润纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加丰尚纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加丰泽纯债债券型证券投资基金、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加丰享纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加颐享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金、中加颐信纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加颐睿纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐合纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐智纯债债券型证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金、中加裕盈纯债债券型证券投资基金、中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金、中加颐瑾六个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加民丰纯债债券型证券投资基金、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金、中加享润两年定期开放债券型证券投资基金、中加优选中高等级债券型证券投资基金（A/C）、中加科盈混合型证券投资基金（A/C）、中加优享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加安瑞稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）（A/Y）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金、中加中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、中加聚庆六个月定期开放混合型证券投资基金（A/C）、中加核心智造混合型证券投资基金（A/C）、中加优势企业混合型证券投资基金（A/C）、中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、中加博裕纯债债券型证券投资基金、中加新兴成长混合型证券投资基金（A/C）、中加中证500指数增强型证券投资基金（A/C）、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中加新兴消费混合型证券投资基金（A/C）、中加穗盈纯债债券型证券投资基金、中加聚隆六个月持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加丰盈一年定期开放债券型发起式

证券投资基金、中加科鑫混合型证券投资基金(A/C)、中加中债-1-5 年国开行债券指数证券投资基金、中加聚优一年定期开放混合型证券投资基金 (A/C)、中加消费优选混合型证券投资基金 (A/C)、中加喜利回报一年持有期混合型证券投资基金 (A/C)、中加优悦一年定期开放债券型证券投资基金、中加科瑞混合型证券投资基金 (A/C)、中加中债-1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中加邮益一年持有期混合型证券投资基金 (A/C)、中加龙头精选混合型证券投资基金 (A/C)、中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金 (A/C)、中加量化研选混合型证券投资基金 (A/C)、中加恒享三个月定期开放债券型证券投资基金、中加聚享增盈债券型证券投资基金 (A/C)、中加瑞鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加聚安60天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金 (A/C)、中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、中加博盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加中债-新综合债券指数发起式证券投资基金、中加医疗创新混合型发起式证券投资基金 (A/C)、中加安瑞积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)。

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		
钟伟	本基金基金经理	2020-09-27	-	13	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

					<p>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，曾任中加紫金灵活配置混合型证券投资基金（2022年4月22日至2023年6月30日）的基金经理，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）、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（2021年8月13日至今）、中加量化研选混合型证券投资基金（2022年4月11日至今）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金（2023年2月15日至今）的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期说明：本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期。

2、离任日期说明：无。

3、证券从业年限的计算标准遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》，对买卖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。本报告期，本基金的基金管理人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 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

今年上半年A股冲高回落，呈倒V型走势，波动较大。

年初在地产政策放松、疫情防控政策优化下，国内经济呈现企稳回升态势，经济基本面整体处于复苏周期。A股各主要指数也在1月迎来一波持续快速上的涨。2月份以来，受美联储加息预期升温、硅谷银行破产、瑞士信贷被收购等负面事件的影响，A股逐步转入震荡盘整阶段。4月中旬以来，由于经济弱复苏不及市场预期，海外加息预期反复，以及人民币汇率持续贬值，A股开始转入震荡下行阶段。今年上半年主题投资如火如荼，与人工智能相关的TMT板块、受益于国内政策导向的中特估概念轮番演绎。市场结构性行情特征明显。

在报告期内，沪深300、上证50和创业板指的涨跌幅分别为-0.75%、-5.43%和-5.61%，同期中证500的涨跌幅为2.29%。中小市值股票的表现整体好于大市值股票。

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。

4.4.2 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0.9515元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.38%，同期业绩比较基准收益率为2.20%；截至报告期末中加中证500指数增强C基金份额净值为0.9433元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.23%，同期业绩比较基准收益率为2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7月下旬，政治局会议召开定调“加大宏观政策调控力度，着力扩大内需、活跃资本市场、提振信心”。市场对于后续经济预期逐渐企稳。金融地产等顺周期板块引领市场，人民币汇率逐步企稳，北向资金也从净流出转向大幅的净流入。市场风险偏好明显回升。

当前市场整体估值水平处于历史中位数以下，中小盘风格的指数估值处于历史底部区域，安全边际较高。在经济弱复苏的背景下，央行在6月降息后，货币政策预计维持稳健宽松。七月政治局会议后，预期后续对于消费、地产、数字经济等一系列方向会出台更多的政策，有利于经济复苏。从中长期来看，当前A股市场具备较好的投资价值和配置价值，A股市场后续的机会大于风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组和风险内控小组。公司负责人（或其指定管理人员）任估值小组负责人，成员由固定收益部负责人、投资研究部门相关业务负责人、运营保障部门负责人、基金会计人员、投资研究相关人员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司分管风险管理业务的副总经理任风险内控小组负责人，成员包括风险管理部门、监察稽核部门相关人员、交易员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 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进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未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 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，中信建投证券股份有限公司在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和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。截至 2023 年 6 月 30 日，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中加中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,820,647.86	5,294,466.74
结算备付金		1,012.32	1,010.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	66,388,100.04	91,837,051.58
其中：股票投资		66,386,199.88	91,837,051.58

基金投资		-	-
债券投资		1,900.16	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	399,923.78	499,856.27
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		9,925.27	35,121.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		70,619,609.27	97,667,505.65
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		21,269.00	1,540.26
应付管理人报酬		45,900.09	66,788.43
应付托管费		8,606.28	12,522.85

应付销售服务费		12,037.58	13,400.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	131,643.45	195,000.00
负债合计		219,456.40	289,251.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	74,441,474.35	105,182,185.75
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-4,041,321.48	-7,803,931.92
净资产合计		70,400,152.87	97,378,253.83
负债和净资产总计		70,619,609.27	97,667,505.65

注：报告截止日2023年06月30日，A类基金份额净值为0.9515元，A类基金份额总额22,257,488.31份；C类基金份额净值为0.9433元，C类基金份额总额52,183,986.04份，总份额合计74,441,474.35份。

6.2 利润表

会计主体：中加中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		4,079,644.26	-12,915,148.40
1.利息收入		19,515.49	31,046.22
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,992.90	21,536.44
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		5,522.59	9,509.78

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,805,954.07	-17,048,847.36
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,614,819.37	-18,445,477.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	8,025.79	18,149.15
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,183,108.91	1,378,481.30
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）	6.4.7.16	1,224,423.08	4,080,733.12
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	29,751.62	21,919.62
减：二、营业总支出		629,384.51	852,507.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	320,993.41	476,917.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	60,186.29	89,421.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	76,300.72	86,989.42
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		0.03	0.03

8. 其他费用	6.4.7.19	171,904.06	199,178.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,450,259.75	-13,767,656.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,450,259.75	-13,767,656.29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,450,259.75	-13,767,656.29

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中加中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30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）	105,182,185.75	-	-7,803,931.92	97,378,253.83
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）	105,182,185.75	-	-7,803,931.92	97,378,253.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-30,740,711.40	-	3,762,610.44	-26,978,100.96
（一）、综合收益总额	-	-	3,450,259.75	3,450,259.75

(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)	-30,740,711.40	-	312,350.69	-30,428,360.71
其中: 1.基金申购款	9,299,171.21	-	-279,392.82	9,019,778.39
2.基金赎回款	-40,039,882.61	-	591,743.51	-39,448,139.10
(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)	74,441,474.35	-	-4,041,321.48	70,400,152.87
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30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)	121,532,293.37	-	15,409,403.72	136,941,697.09
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）	121,532,293.37	-	15,409,403.72	136,941,697.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,090,250.62	-	-12,159,708.22	-27,249,958.84
（一）、综合收益总额	-	-	-13,767,656.29	-13,767,656.29
（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）	-15,090,250.62	-	1,607,948.07	-13,482,302.55
其中：1.基金申购款	20,562,837.45	-	248,656.99	20,811,494.44
2.基金赎回款	-35,653,088.07	-	1,359,291.08	-34,293,796.99
（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）	106,442,042.75	-	3,249,695.50	109,691,738.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

夏远洋

陈昕

陈昕

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中加中证500指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金")依据中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")于2020年8月5日证监许可[2020]1946号《关于准予中加中证500指数增强型证券投资基金注册的批复》核准,由中加基金管理有限公司(以下简称"中加基金")依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加中证500指数增强型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金管理有限公司,托管人为中信建投证券股份有限公司(以下简称"中信建投证券")。

本基金通过中加基金直销中心及代销机构公开发售,募集期为2020年9月14日至2020年9月23日。本基金于2020年9月27日成立,成立之日基金实收份额为204,983,003.67份(含利息转份额人民币8598.59元),发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中加中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《中加中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外,为更好地实现投资目标,本基金的投资范围还可包括国内依法发行和上市的其他股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、可转换债券、可交换债券(含分离交易可转债)、央行票据、同业存单、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款(协议存款、通知存款、定期存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2023年06月30日的财务状况、2023年中期的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告所采用的会计政策、会计估计相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金财务报表的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的编制期间为2023年01月01日至2023年06月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被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，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b)金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a)金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b)金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 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；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内(若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债权投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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对应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；A类基金份额和C类基金份额之间由于A类基金份额不收取而C类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；基金可供分配利润为正的前提下，方可进行收益分配；投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关

于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据中国基金业协会中基协字 [2022] 566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》(以下简称"估值处理标准")，在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

自2018年1月1日起，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018年1月1日(含)以后，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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

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

(4)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司(“挂牌公司”)取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)

的，其股息红利所得暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。

(5)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	3,258,803.74
等于：本金	3,258,193.36
加：应计利息	610.38
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	561,844.12
等于：本金	561,759.12
加：应计利息	85.00
减：坏账准备	-
合计	3,820,647.86

注：其他存款为本基金存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	67,313,657.49	-	66,386,199.88	-927,457.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,900.00	0.16	1,900.16
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,900.00	0.16	1,900.16
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	67,315,557.49	0.16	66,388,100.04	-927,457.61

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	399,923.78	-
银行间市场	-	-
合计	399,923.78	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	24.69
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-审计费	32,232.48
预提费用-信息披露费	39,671.58
其他应付	59,714.70
合计	131,643.45

注：其他应付款为应付指数使用费。

6.4.7.7 实收基金**6.4.7.7.1 中加中证500指数增强A**

金额单位：人民币元

项目 (中加中证500指数增强A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,972,663.07	48,972,663.07
本期申购	6,196,398.87	6,196,398.87
本期赎回（以“-”号填列）	-32,911,573.63	-32,911,573.63
本期末	22,257,488.31	22,257,488.31

6.4.7.7.2 中加中证500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (中加中证500指数增强C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
----------------------	-------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,209,522.68	56,209,522.68
本期申购	3,102,772.34	3,102,772.34
本期赎回（以“-”号填列）	-7,128,308.98	-7,128,308.98
本期末	52,183,986.04	52,183,986.04

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中加中证500指数增强A

单位：人民币元

项目 (中加中证500指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,218,758.89	-2,240,601.23	-3,459,360.12
本期利润	1,342,955.09	845,957.60	2,188,912.69
本期基金份额交易产生的变动数	-321,221.65	511,090.92	189,869.27
其中：基金申购款	36,706.96	-225,716.34	-189,009.38
基金赎回款	-357,928.61	736,807.26	378,878.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-197,025.45	-883,552.71	-1,080,578.16

6.4.7.8.2 中加中证500指数增强C

单位：人民币元

项目 (中加中证500指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,778,097.03	-2,566,474.77	-4,344,571.80
本期利润	882,881.58	378,465.48	1,261,347.06
本期基金份额交易产生的变动数	2,849.06	119,632.36	122,481.42
其中：基金申购款	-23,200.99	-67,182.45	-90,383.44

基金赎回款	26,050.05	186,814.81	212,864.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-892,366.39	-2,068,376.93	-2,960,743.32

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
活期存款利息收入	11,475.28	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	2,515.30	
结算备付金利息收入	2.32	
其他	-	
合计	13,992.90	

注：其他存款利息收入为券商保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
卖出股票成交总额	470,029,394.63	
减：卖出股票成本总额	467,393,012.87	
减：交易费用	1,021,562.39	
买卖股票差价收入	1,614,819.37	

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
债券投资收益——利息收入	35.30	
债券投资收益——买卖债券（债转股）	7,990.49	

及债券到期兑付) 差价收入	
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	8,025.79

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	643,012.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	632,266.00
减：应计利息总额	2,753.25
减：交易费用	2.86
买卖债券差价收入	7,990.49

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,183,108.91
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,183,108.91

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	1,224,423.08
——股票投资	1,224,423.08
——债券投资	-
——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	1,224,423.08

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	29,751.62
合计	29,751.62

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
合计	171,904.06

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中加基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
北京银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30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	910,499,014.94	100.00%	1,313,894,741.24	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
中信建投证券	1,238,533.40	100.00%	185,350.44	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交	成交金额	占当期债券回购成交

		总额的 比例		总额的 比例
中信建投 证券	73,790,000.00	100.00%	79,600,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30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	479,826.14	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30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	687,726.61	100.00%	-	-

注：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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至202 3年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	320,993.41	476,917.52

其中：支付销售机构的客户维护费	45,919.18	54,000.14
-----------------	-----------	-----------

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,186.29	89,421.97

注：支付基金托管人中信建投证券股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加中证500指数增强A	中加中证500指数增强C	合计
中加基金 管理有限 公司	0.00	52,333.60	52,333.60
北京银行 股份有限 公司	0.00	756.50	756.50
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	18,665.21	18,665.21
合计	0.00	71,755.31	71,755.31
获得销售 服务费的	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加中证500指数增强A	中加中证500指数增强C	合计
中加基金管理有限公司	0.00	54,252.80	54,252.80
北京银行股份有限公司	0.00	675.21	675.21
中信建投证券股份有限公司	0.00	26,734.66	26,734.66
合计	0.00	81,662.67	81,662.67

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日C类资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C类基金份额销售服务费=前一日C类份额基金资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信建投证券股份有限公司	3,258,803.74	11,475.28	3,074,217.14	19,012.34

注：1、本基金托管户的银行存款由基金托管人中信建投证券股份有限公司存放在交通银行北京三里河支行，按银行活期利率计息。

2、本基金证券资金户的存款为本基金存放于中信建投证券股份有限公司专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率及规则计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信建投证券股份有限公司	001337	四川黄金	网下发行	795	5,636.55
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信建投证券股份有限公司	603272	联翔股份	网下发行	443	6,042.52

中信建投 证券股份 有限公司	601089	福元医药	网下发行	1,749	25,570.38
中信建投 证券股份 有限公司	688153	唯捷创芯	网下发行	826	55,011.60
中信建投 证券股份 有限公司	688197	首药控股	网下发行	3,465	138,253.50
中信建投 证券股份 有限公司	113057	中银转债	原股东优 先配售	110	11,000.00
中信建投 证券股份 有限公司	110085	通22转债	原股东优 先配售	190	19,000.00
中信建投 证券股份 有限公司	688281	华秦科技	网下发行	284	53,818.00
中信建投 证券股份 有限公司	301181	标榜股份	网下发行	915	36,828.75
中信建投 证券股份 有限公司	001227	兰州银行	网下发行	7,868	28,088.76
中信建投 证券股份 有限公司	688223	晶科能源	网下发行	14,342	71,710.00
中信建投 证券股份 有限公司	301206	三元生物	网下发行	505	55,196.50

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127086	恒邦转债	2023-06-12	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	19	1,900.00	1,900.16	-

6.4.12.2 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
601298	青岛港	2023-06-28	重大资产重组	6.97	2023-07-03	7.40	45,700	329,764.05	318,529.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2023年06月30日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年06月30日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2023年06月30日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的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范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指本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。

本基金的银行存款主要存放在本基金的托管人和信用风险较低的商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人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；在交易所进行的交易均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。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	1,900.16	-
未评级	-	-
合计	1,900.16	-

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的债务融资工具。

3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额（如有）计息但该利息金额不重大以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金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，除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6.4.12（如有）外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。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。

报告期内，本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性风险管理相关制度，对基金组合资产流动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率敏感度缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存	3,820,647.86	-	-	-	3,820,647.86

款					
结算备付金	-	-	-	1,012.32	1,012.32
交易性金融资产	1,900.16	-	-	66,386,199.88	66,388,100.04
买入返售金融资产	399,923.78	-	-	-	399,923.78
应收申购款	-	-	-	9,925.27	9,925.27
资产总计	4,222,471.80	-	-	66,397,137.47	70,619,609.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,269.00	21,269.00
应付管理人报酬	-	-	-	45,900.09	45,900.09
应付托管费	-	-	-	8,606.28	8,606.28
应付销售服务费	-	-	-	12,037.58	12,037.58
其他负债	-	-	-	131,643.45	131,643.45
负债总计	-	-	-	219,456.40	219,456.40
利率敏感度缺口	4,222,471.80	-	-	66,177,681.07	70,400,152.87
上年度末 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	5,294,466.74	-	-	-	5,294,466.74
结算备付金	-	-	-	1,010.00	1,010.00
交易性金融资产	-	-	-	91,837,051.58	91,837,051.58
买入返	499,856.27	-	-	-	499,856.27

售金融资产					
应收申购款	-	-	-	35,121.06	35,121.06
资产总计	5,794,323.01	-	-	91,873,182.64	97,667,505.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,540.26	1,540.26
应付管理人报酬	-	-	-	66,788.43	66,788.43
应付托管费	-	-	-	12,522.85	12,522.85
应付销售服务费	-	-	-	13,400.28	13,400.28
其他负债	-	-	-	195,000.00	195,000.00
负债总计	-	-	-	289,251.82	289,251.82
利率敏感度缺口	5,794,323.01	-	-	91,583,930.82	97,378,253.83

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末持有的交易性债券投资和资产支持证券投资金额占比不重大，于上期末未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格的风险。此外，本基金管理人对本基金所持

有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022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	66,386,199.88	94.30	91,837,051.58	94.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,900.16	-	-	-
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	66,388,100.04	94.30	91,837,051.58	94.31

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	3,222,862.83	4,457,387.40
	业绩比较基准下降5%	-3,222,862.83	-4,457,387.40

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	66,067,670.88	91,832,801.78
第二层次	320,429.16	4,249.80
第三层次	-	-
合计	66,388,100.04	91,837,051.58

6.4.14.2.2 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。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2022年12月31日：无）。

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2023年06月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	66,386,199.88	94.01
	其中：股票	66,386,199.88	94.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,900.16	0.00
	其中：债券	1,900.16	0.00
	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	399,923.78	0.57
	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	3,821,660.18	5.41
8	其他各项资产	9,925.27	0.01
9	合计	70,619,609.27	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	891,251.00	1.27
B	采矿业	4,175,344.00	5.93
C	制造业	36,457,740.28	51.79

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,742,261.00	2.47
E	建筑业	590,672.00	0.84
F	批发和零售业	3,006,126.40	4.27
G	交通运输、仓储和邮政业	1,485,888.00	2.11
H	住宿和餐饮业	89,065.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,214,680.20	1.73
J	金融业	4,734,844.20	6.73
K	房地产业	985,485.00	1.40
L	租赁和商务服务业	150,688.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	24,160.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	454,415.00	0.65
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	2,416,949.00	3.43
S	综合	808,589.00	1.15
	合计	59,228,158.08	84.13

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	101,971.00	0.14
C	制造业	4,718,740.00	6.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	333,279.00	0.47
E	建筑业	149,478.80	0.21
F	批发和零售业	525,079.00	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	161,921.00	0.23

H	住宿和餐饮业	39,914.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	373,137.00	0.53
J	金融业	275,634.00	0.39
K	房地产业	125,498.00	0.18
L	租赁和商务服务业	114,467.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	6,468.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	137,541.00	0.20
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	94,914.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	7,158,041.80	10.17

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

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	002600	领益智造	243,000	1,679,130.00	2.39
2	002422	科伦药业	55,000	1,632,400.00	2.32
3	601717	郑煤机	130,400	1,623,480.00	2.31
4	600998	九州通	150,080	1,557,830.40	2.21
5	002152	广电运通	126,200	1,479,064.00	2.10

6	002985	北摩高科	28,500	1,257,420.00	1.79
7	600909	华安证券	253,400	1,183,378.00	1.68
8	600623	华谊集团	164,000	1,021,720.00	1.45
9	600271	航天信息	74,000	1,013,060.00	1.44
10	002273	水晶光电	84,700	1,011,318.00	1.44
11	600582	天地科技	169,700	989,351.00	1.41
12	601928	凤凰传媒	78,800	898,320.00	1.28
13	600038	中直股份	22,400	891,968.00	1.27
14	002028	思源电气	19,000	887,680.00	1.26
15	601958	金钼股份	75,700	844,055.00	1.20
16	600060	海信视像	33,400	826,650.00	1.17
17	600985	淮北矿业	69,100	796,032.00	1.13
18	002299	圣农发展	41,400	792,810.00	1.13
19	000878	云南铜业	67,300	743,665.00	1.06
20	600707	彩虹股份	156,000	742,560.00	1.05
21	601869	长飞光纤	19,900	736,499.00	1.05
22	000009	中国宝安	60,600	731,442.00	1.04
23	300115	长盈精密	60,500	720,555.00	1.02
24	600956	新天绿能	81,400	709,808.00	1.01
25	600535	天士力	48,800	708,088.00	1.01
26	000750	国海证券	199,100	666,985.00	0.95
27	002249	大洋电机	114,800	654,360.00	0.93
28	600871	石化油服	325,900	645,282.00	0.92
29	601198	东兴证券	80,300	644,006.00	0.91
30	002110	三钢闽光	152,000	641,440.00	0.91
31	600597	光明乳业	60,700	631,280.00	0.90
32	600549	厦门钨业	33,065	629,226.95	0.89
33	603218	日月股份	32,300	613,377.00	0.87
34	601168	西部矿业	56,000	588,560.00	0.84
35	688082	盛美上海	5,200	574,080.00	0.82
36	002439	启明星辰	18,500	550,560.00	0.78

37	001914	招商积余	36,400	547,820.00	0.78
38	603883	老百姓	18,000	537,300.00	0.76
39	002203	海亮股份	44,586	535,477.86	0.76
40	601098	中南传媒	44,000	510,400.00	0.72
41	600498	烽火通信	23,900	486,843.00	0.69
42	600699	均胜电子	27,400	483,336.00	0.69
43	600801	华新水泥	37,000	456,950.00	0.65
44	300003	乐普医疗	20,000	452,200.00	0.64
45	300487	蓝晓科技	7,200	449,424.00	0.64
46	002739	万达电影	35,800	448,932.00	0.64
47	600820	隧道股份	73,900	444,139.00	0.63
48	600580	卧龙电驱	29,600	432,456.00	0.61
49	601969	海南矿业	63,200	415,856.00	0.59
50	002223	鱼跃医疗	11,400	410,286.00	0.58
51	002683	广东宏大	13,900	409,216.00	0.58
52	688819	天能股份	10,955	403,582.20	0.57
53	603056	德邦股份	25,000	385,500.00	0.55
54	600511	国药股份	9,800	380,730.00	0.54
55	002056	横店东磁	20,200	367,842.00	0.52
56	000967	盈峰环境	72,400	365,620.00	0.52
57	002384	东山精密	13,900	360,010.00	0.51
58	601128	常熟银行	52,500	358,050.00	0.51
59	002025	航天电器	5,600	357,280.00	0.51
60	000089	深圳机场	51,300	356,535.00	0.51
61	000581	威孚高科	21,900	344,925.00	0.49
62	603529	爱玛科技	10,400	335,088.00	0.48
63	601231	环旭电子	21,961	328,536.56	0.47
64	600373	中文传媒	24,000	319,680.00	0.45
65	601298	青岛港	45,700	318,529.00	0.45
66	300866	安克创新	3,500	306,250.00	0.44
67	600409	三友化工	54,800	298,660.00	0.42

68	600642	申能股份	42,600	297,774.00	0.42
69	600161	天坛生物	10,000	271,500.00	0.39
70	300146	汤臣倍健	11,200	268,576.00	0.38
71	000869	张裕 A	8,600	263,676.00	0.37
72	002250	联化科技	24,700	258,362.00	0.37
73	688520	神州细胞	4,532	257,145.68	0.37
74	000728	国元证券	37,600	245,152.00	0.35
75	002563	森马服饰	37,900	235,738.00	0.33
76	600155	华创云信	36,900	229,518.00	0.33
77	600517	国网英大	39,900	227,430.00	0.32
78	600655	豫园股份	33,100	227,066.00	0.32
79	301029	怡合达	5,000	223,400.00	0.32
80	000709	河钢股份	96,600	218,316.00	0.31
81	002465	海格通信	20,900	216,106.00	0.31
82	601000	唐山港	61,200	216,036.00	0.31
83	000898	鞍钢股份	76,200	211,836.00	0.30
84	601077	渝农商行	57,700	207,143.00	0.29
85	300073	当升科技	4,100	206,353.00	0.29
86	002244	滨江集团	22,700	200,214.00	0.28
87	688009	中国通号	33,600	194,880.00	0.28
88	603927	中科软	5,000	192,800.00	0.27
89	600863	内蒙华电	45,700	189,655.00	0.27
90	000400	许继电气	8,200	189,010.00	0.27
91	601577	长沙银行	23,900	185,464.00	0.26
92	600927	永安期货	11,200	182,112.00	0.26
93	000739	普洛药业	10,000	177,400.00	0.25
94	600968	海油发展	55,500	170,385.00	0.24
95	000156	华数传媒	19,300	167,910.00	0.24
96	000060	中金岭南	34,500	163,875.00	0.23
97	601139	深圳燃气	21,400	156,006.00	0.22
98	600827	百联股份	11,600	155,092.00	0.22

99	601555	东吴证券	21,900	151,986.00	0.22
100	002690	美亚光电	5,900	151,925.00	0.22
101	000975	银泰黄金	12,700	148,590.00	0.21
102	603737	三棵树	2,260	147,849.20	0.21
103	600995	南网储能	13,400	147,534.00	0.21
104	300438	鹏辉能源	3,000	144,120.00	0.20
105	000738	航发控制	5,800	141,520.00	0.20
106	000553	安道麦A	16,300	137,572.00	0.20
107	300724	捷佳伟创	1,200	134,820.00	0.19
108	002185	华天科技	13,800	126,960.00	0.18
109	000729	燕京啤酒	10,100	125,947.00	0.18
110	002409	雅克科技	1,700	123,896.00	0.18
111	600329	达仁堂	2,700	121,203.00	0.17
112	603338	浙江鼎力	2,100	117,621.00	0.17
113	600566	济川药业	3,900	113,256.00	0.16
114	600970	中材国际	8,400	107,100.00	0.15
115	000537	广宇发展	9,000	105,030.00	0.15
116	600718	东软集团	9,700	103,402.00	0.15
117	600109	国金证券	11,900	103,173.00	0.15
118	600967	内蒙一机	10,100	102,010.00	0.14
119	600755	厦门国贸	13,000	100,620.00	0.14
120	002518	科士达	2,500	100,025.00	0.14
121	600258	首旅酒店	4,700	89,065.00	0.13
122	002266	浙富控股	21,500	88,795.00	0.13
123	000031	大悦城	24,100	88,206.00	0.13
124	600372	中航电子	5,700	86,526.00	0.12
125	688072	拓荆科技	200	85,194.00	0.12
126	000807	云铝股份	6,400	81,472.00	0.12
127	300604	长川科技	1,700	80,733.00	0.11
128	002195	岩山科技	27,700	80,053.00	0.11
129	000932	华菱钢铁	16,500	78,705.00	0.11

130	300748	金力永磁	2,600	77,792.00	0.11
131	002595	豪迈科技	2,200	77,286.00	0.11
132	600673	东阳光	10,700	77,147.00	0.11
133	688516	奥特维	400	75,360.00	0.11
134	300888	稳健医疗	1,800	75,006.00	0.11
135	600497	驰宏锌锗	14,800	74,296.00	0.11
136	600350	山东高速	11,500	73,255.00	0.10
137	000027	深圳能源	11,100	73,149.00	0.10
138	600160	巨化股份	5,300	73,034.00	0.10
139	688002	睿创微纳	1,600	71,680.00	0.10
140	600008	首创环保	24,800	71,424.00	0.10
141	002429	兆驰股份	12,900	70,950.00	0.10
142	000423	东阿阿胶	1,300	69,485.00	0.10
143	000415	渤海租赁	32,000	67,200.00	0.10
144	688777	中控技术	1,040	65,291.20	0.09
145	300285	国瓷材料	2,300	63,020.00	0.09
146	002497	雅化集团	3,500	62,230.00	0.09
147	000887	中鼎股份	4,700	61,523.00	0.09
148	000937	冀中能源	9,600	61,248.00	0.09
149	600862	中航高科	2,400	60,744.00	0.09
150	600066	宇通客车	4,000	58,960.00	0.08
151	300017	网宿科技	8,000	56,880.00	0.08
152	600079	人福医药	2,100	56,574.00	0.08
153	000591	太阳能	8,000	54,240.00	0.08
154	603885	吉祥航空	3,500	54,005.00	0.08
155	000636	风华高科	3,400	52,156.00	0.07
156	600521	华海药业	2,800	51,548.00	0.07
157	002831	裕同科技	2,100	51,219.00	0.07
158	002673	西部证券	7,800	49,530.00	0.07
159	600598	北大荒	3,700	49,321.00	0.07
160	000998	隆平高科	3,200	49,120.00	0.07

161	603444	吉比特	100	49,111.00	0.07
162	601665	齐鲁银行	12,500	49,000.00	0.07
163	002507	涪陵榨菜	2,650	48,521.50	0.07
164	300144	宋城演艺	3,900	48,360.00	0.07
165	603026	胜华新材	800	47,400.00	0.07
166	600435	北方导航	4,100	47,109.00	0.07
167	000519	中兵红箭	2,500	45,225.00	0.06
168	600141	兴发集团	2,000	44,440.00	0.06
169	000831	中国稀土	1,500	44,400.00	0.06
170	600848	上海临港	3,700	44,215.00	0.06
171	601108	财通证券	6,100	44,164.00	0.06
172	601966	玲珑轮胎	1,900	42,218.00	0.06
173	600487	亨通光电	2,800	41,048.00	0.06
174	000547	航天发展	4,000	40,000.00	0.06
175	600764	中国海防	1,400	38,108.00	0.05
176	000987	越秀资本	5,900	37,465.00	0.05
177	002078	太阳纸业	3,500	37,415.00	0.05
178	600056	中国医药	2,800	36,344.00	0.05
179	002500	山西证券	6,500	36,270.00	0.05
180	600095	湘财股份	4,400	34,320.00	0.05
181	600782	新钢股份	9,200	34,132.00	0.05
182	002557	洽洽食品	800	33,240.00	0.05
183	603317	天味食品	2,260	33,018.60	0.05
184	601718	际华集团	11,100	32,967.00	0.05
185	603379	三美股份	1,400	32,914.00	0.05
186	000513	丽珠集团	800	31,128.00	0.04
187	002624	完美世界	1,800	30,402.00	0.04
188	688385	复旦微电	600	30,060.00	0.04
189	688390	固德威	175	29,200.50	0.04
190	600195	中牧股份	2,500	29,200.00	0.04
191	000623	吉林敖东	1,800	28,872.00	0.04

192	000598	兴蓉环境	5,300	28,779.00	0.04
193	002653	海思科	1,200	28,320.00	0.04
194	600170	上海建工	10,300	27,707.00	0.04
195	002183	怡亚通	5,300	27,030.00	0.04
196	600879	航天电子	3,000	25,470.00	0.04
197	603858	步长制药	1,200	24,708.00	0.04
198	688006	杭可科技	809	24,650.23	0.04
199	000997	新大陆	1,300	24,570.00	0.03
200	601880	辽港股份	15,500	24,180.00	0.03
201	300182	捷成股份	3,700	23,347.00	0.03
202	603688	石英股份	200	22,768.00	0.03
203	000930	中粮科技	2,800	22,680.00	0.03
204	603156	养元饮品	900	22,230.00	0.03
205	688295	中复神鹰	600	22,008.00	0.03
206	000970	中科三环	1,700	21,794.00	0.03
207	601598	中国外运	4,600	21,436.00	0.03
208	002936	郑州银行	9,100	20,930.00	0.03
209	600901	江苏金租	5,040	20,815.20	0.03
210	600415	小商品城	2,400	20,472.00	0.03
211	002791	坚朗五金	300	19,413.00	0.03
212	601568	北元集团	3,600	18,972.00	0.03
213	000683	远兴能源	2,500	17,975.00	0.03
214	601228	广州港	5,400	17,442.00	0.02
215	001227	兰州银行	5,900	16,874.00	0.02
216	300357	我武生物	500	16,815.00	0.02
217	002368	太极股份	400	16,468.00	0.02
218	300058	蓝色光标	1,700	16,439.00	0.02
219	603127	昭衍新药	400	16,360.00	0.02
220	300136	信维通信	800	16,064.00	0.02
221	603225	新凤鸣	1,400	15,470.00	0.02
222	300009	安科生物	1,500	15,000.00	0.02

223	300395	菲利华	300	14,760.00	0.02
224	601187	厦门银行	2,900	14,558.00	0.02
225	600316	洪都航空	600	14,070.00	0.02
226	002010	传化智联	2,600	13,832.00	0.02
227	600563	法拉电子	100	13,730.00	0.02
228	600928	西安银行	3,800	13,376.00	0.02
229	600637	东方明珠	1,700	13,294.00	0.02
230	600418	江淮汽车	1,000	12,590.00	0.02
231	001872	招商港口	700	12,089.00	0.02
232	300253	卫宁健康	1,100	11,902.00	0.02
233	002081	金螳螂	2,600	11,726.00	0.02
234	600839	四川长虹	2,300	11,615.00	0.02
235	002092	中泰化学	1,700	10,965.00	0.02
236	600126	杭钢股份	2,500	10,850.00	0.02
237	600739	辽宁成大	800	10,520.00	0.01
238	002423	中粮资本	1,300	10,400.00	0.01
239	603826	坤彩科技	200	10,000.00	0.01
240	603712	七一二	300	9,063.00	0.01
241	601778	晶科科技	1,700	8,398.00	0.01
242	300418	昆仑万维	200	8,056.00	0.01
243	600348	华阳股份	1,000	7,910.00	0.01
244	300012	华测检测	400	7,800.00	0.01
245	600556	天下秀	1,100	7,799.00	0.01
246	000959	首钢股份	2,200	7,700.00	0.01
247	600489	中金黄金	700	7,231.00	0.01
248	600377	宁沪高速	700	6,881.00	0.01
249	002192	融捷股份	100	6,683.00	0.01
250	000401	冀东水泥	900	6,633.00	0.01
251	000785	居然之家	1,500	5,715.00	0.01
252	600143	金发科技	600	5,238.00	0.01
253	002532	天山铝业	800	4,792.00	0.01

254	002373	千方科技	300	4,092.00	0.01
255	002511	中顺洁柔	300	3,345.00	0.00
256	600885	宏发股份	100	3,185.00	0.00
257	000563	陕国投 A	900	2,745.00	0.00
258	002353	杰瑞股份	100	2,513.00	0.00
259	600032	浙江新能	200	2,512.00	0.00
260	002156	通富微电	100	2,260.00	0.00
261	300677	英科医疗	100	2,200.00	0.00
262	688778	厦钨新能	40	1,980.00	0.00
263	688289	圣湘生物	100	1,684.00	0.00
264	002608	江苏国信	200	1,514.00	0.00
265	601016	节能风电	400	1,468.00	0.00
266	600297	广汇汽车	300	624.00	0.00

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

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	300457	赢合科技	18,700	330,242.00	0.47
2	600362	江西铜业	17,300	328,354.00	0.47
3	603368	柳药集团	12,000	296,520.00	0.42
4	601766	中国中车	44,800	291,200.00	0.41
5	002381	双箭股份	32,000	247,040.00	0.35
6	000338	潍柴动力	14,400	179,424.00	0.25
7	600023	浙能电力	32,400	164,268.00	0.23
8	002929	润建股份	3,300	143,253.00	0.20
9	002937	兴瑞科技	5,800	142,680.00	0.20
10	603609	禾丰股份	15,500	141,050.00	0.20
11	000921	海信家电	5,000	134,750.00	0.19
12	000913	钱江摩托	7,200	131,256.00	0.19
13	601006	大秦铁路	16,100	119,623.00	0.17

14	002149	西部材料	7,100	119,209.00	0.17
15	600094	大名城	36,500	112,785.00	0.16
16	600120	浙江东方	29,300	112,219.00	0.16
17	600019	宝钢股份	19,700	110,714.00	0.16
18	002233	塔牌集团	14,200	109,624.00	0.16
19	605123	派克新材	1,000	108,650.00	0.15
20	600011	华能国际	11,200	103,712.00	0.15
21	600583	海油工程	16,300	95,355.00	0.14
22	600728	佳都科技	13,700	94,941.00	0.13
23	600729	重庆百货	3,000	94,320.00	0.13
24	601003	柳钢股份	23,200	93,728.00	0.13
25	300109	新开源	3,700	92,019.00	0.13
26	688551	科威尔	1,400	91,812.00	0.13
27	603567	珍宝岛	6,000	89,760.00	0.13
28	600057	厦门象屿	10,300	89,610.00	0.13
29	601019	山东出版	9,500	87,115.00	0.12
30	600973	宝胜股份	17,300	83,905.00	0.12
31	600039	四川路桥	7,880	77,302.80	0.11
32	601600	中国铝业	13,600	74,664.00	0.11
33	600908	无锡银行	12,700	68,072.00	0.10
34	600425	青松建化	15,100	66,742.00	0.09
35	605077	华康股份	2,500	66,200.00	0.09
36	688138	清溢光电	3,000	63,330.00	0.09
37	600612	老凤祥	900	62,892.00	0.09
38	603878	武进不锈	7,400	62,530.00	0.09
39	600512	腾达建设	22,200	59,496.00	0.08
40	601727	上海电气	12,400	56,668.00	0.08
41	600941	中国移动	600	55,980.00	0.08
42	600419	天润乳业	3,400	55,148.00	0.08
43	000063	中兴通讯	1,200	54,648.00	0.08
44	600929	雪天盐业	6,600	52,404.00	0.07

45	603220	中贝通信	3,000	51,150.00	0.07
46	603588	高能环境	5,400	50,598.00	0.07
47	002446	盛路通信	5,300	50,085.00	0.07
48	603323	苏农银行	11,300	47,573.00	0.07
49	300433	蓝思科技	4,000	47,040.00	0.07
50	600098	广州发展	7,600	46,968.00	0.07
51	300294	博雅生物	1,200	43,536.00	0.06
52	000910	大亚圣象	5,500	42,955.00	0.06
53	601686	友发集团	6,200	42,408.00	0.06
54	601311	骆驼股份	4,500	41,760.00	0.06
55	600054	黄山旅游	3,200	40,960.00	0.06
56	002588	史丹利	6,600	40,128.00	0.06
57	002829	星网宇达	900	39,537.00	0.06
58	603059	倍加洁	1,700	38,658.00	0.05
59	603690	至纯科技	1,100	38,324.00	0.05
60	000900	现代投资	8,500	34,255.00	0.05
61	600789	鲁抗医药	5,100	32,742.00	0.05
62	601567	三星医疗	2,500	31,575.00	0.04
63	600210	紫江企业	5,800	30,856.00	0.04
64	002179	中航光电	680	30,838.00	0.04
65	000922	佳电股份	2,300	30,268.00	0.04
66	002956	西麦食品	1,900	29,697.00	0.04
67	002391	长青股份	4,300	29,541.00	0.04
68	300791	仙乐健康	1,000	29,040.00	0.04
69	000950	重药控股	4,200	28,266.00	0.04
70	601827	三峰环境	3,400	25,160.00	0.04
71	600488	津药药业	4,400	24,728.00	0.04
72	603385	惠达卫浴	3,200	24,096.00	0.03
73	002727	一心堂	900	23,760.00	0.03
74	601163	三角轮胎	1,400	22,218.00	0.03
75	601877	正泰电器	800	22,120.00	0.03

76	000028	国药一致	500	21,805.00	0.03
77	002948	青岛银行	6,900	21,597.00	0.03
78	600754	锦江酒店	500	21,170.00	0.03
79	600323	瀚蓝环境	1,100	20,823.00	0.03
80	300232	洲明科技	2,200	20,108.00	0.03
81	002236	大华股份	1,000	19,750.00	0.03
82	002237	恒邦股份	1,800	19,602.00	0.03
83	600694	大商股份	1,100	19,503.00	0.03
84	605009	豪悦护理	400	19,200.00	0.03
85	688126	沪硅产业	900	18,810.00	0.03
86	601007	金陵饭店	2,200	18,744.00	0.03
87	002782	可立克	1,200	18,348.00	0.03
88	000751	锌业股份	5,400	17,820.00	0.03
89	000823	超声电子	1,800	17,064.00	0.02
90	601728	中国电信	2,900	16,327.00	0.02
91	600731	湖南海利	2,100	16,317.00	0.02
92	600138	中青旅	1,300	16,263.00	0.02
93	600562	国睿科技	1,000	16,200.00	0.02
94	000990	诚志股份	2,100	16,002.00	0.02
95	600837	海通证券	1,600	14,752.00	0.02
96	300900	广联航空	500	14,405.00	0.02
97	000417	合肥百货	2,800	13,104.00	0.02
98	002077	大港股份	800	11,960.00	0.02
99	002752	昇兴股份	2,500	11,875.00	0.02
100	002839	张家港行	2,700	11,421.00	0.02
101	688261	东微半导	80	11,189.60	0.02
102	688722	同益中	600	11,124.00	0.02
103	002419	天虹股份	1,900	11,115.00	0.02

10 4	002661	克明食品	1,000	11,010.00	0.02
10 5	600983	惠而浦	1,400	10,626.00	0.02
10 6	300855	图南股份	300	10,596.00	0.02
10 7	688336	三生国健	600	10,254.00	0.01
10 8	300910	瑞丰新材	200	10,060.00	0.01
10 9	000726	鲁泰A	1,400	9,576.00	0.01
11 0	000521	长虹美菱	1,200	9,168.00	0.01
11 1	002443	金洲管道	1,300	8,658.00	0.01
11 2	002946	新乳业	600	8,610.00	0.01
11 3	605168	三人行	100	8,594.00	0.01
11 4	002582	好想你	1,100	8,591.00	0.01
11 5	601500	通用股份	2,100	8,589.00	0.01
11 6	688599	天合光能	200	8,522.00	0.01
11 7	002402	和而泰	500	8,490.00	0.01
11 8	601117	中国化学	1,000	8,280.00	0.01
11 9	300133	华策影视	1,100	7,799.00	0.01
12 0	601137	博威合金	500	7,780.00	0.01
12 1	600312	平高电气	600	7,434.00	0.01

12 2	600007	中国国贸	400	7,408.00	0.01
12 3	000544	中原环保	1,000	7,180.00	0.01
12 4	601333	广深铁路	1,800	7,128.00	0.01
12 5	688123	聚辰股份	130	6,983.60	0.01
12 6	600668	尖峰集团	600	6,912.00	0.01
12 7	000685	中山公用	900	6,813.00	0.01
12 8	002885	京泉华	300	6,552.00	0.01
12 9	300416	苏试试验	300	6,468.00	0.01
13 0	600332	白云山	200	6,376.00	0.01
13 1	603367	辰欣药业	400	6,072.00	0.01
13 2	688676	金盘科技	200	6,058.00	0.01
13 3	688100	威胜信息	200	5,962.00	0.01
13 4	601010	文峰股份	2,400	5,880.00	0.01
13 5	300633	开立医疗	100	5,450.00	0.01
13 6	300080	易成新能	1,000	5,090.00	0.01
13 7	002580	圣阳股份	500	4,695.00	0.01
13 8	002609	捷顺科技	400	4,664.00	0.01
13 9	600606	绿地控股	1,600	4,400.00	0.01

14 0	300123	亚光科技	600	4,368.00	0.01
14 1	000531	穗恒运 A	600	4,338.00	0.01
14 2	600050	中国联通	900	4,320.00	0.01
14 3	603733	仙鹤股份	200	4,170.00	0.01
14 4	002947	恒铭达	200	4,168.00	0.01
14 5	002297	博云新材	500	4,015.00	0.01
14 6	002852	道道全	300	3,879.00	0.01
14 7	600261	阳光照明	1,000	3,650.00	0.01
14 8	002952	亚世光电	200	3,546.00	0.01
14 9	601020	华钰矿业	400	3,436.00	0.00
15 0	603071	物产环能	200	3,318.00	0.00
15 1	300648	星云股份	100	3,218.00	0.00
15 2	600028	中国石化	500	3,180.00	0.00
15 3	600183	生益科技	200	2,840.00	0.00
15 4	600748	上实发展	700	2,765.00	0.00
15 5	605599	菜百股份	200	2,642.00	0.00
15 6	601113	华鼎股份	800	2,592.00	0.00
15 7	600266	城建发展	500	2,540.00	0.00

15 8	000055	方大集团	500	2,475.00	0.00
15 9	600075	新疆天业	500	2,355.00	0.00
16 0	002293	罗莱生活	200	2,300.00	0.00
16 1	601607	上海医药	100	2,241.00	0.00
16 2	601212	白银有色	800	2,176.00	0.00
16 3	000822	山东海化	300	2,043.00	0.00
16 4	002895	川恒股份	100	1,970.00	0.00
16 5	000759	中百集团	400	1,804.00	0.00
16 6	000917	电广传媒	200	1,462.00	0.00
16 7	600526	菲达环保	300	1,446.00	0.00
16 8	603997	继峰股份	100	1,430.00	0.00
16 9	600328	中盐化工	130	1,170.00	0.00
17 0	300194	福安药业	300	1,164.00	0.00
17 1	688669	聚石化学	60	1,087.80	0.00
17 2	002322	理工能科	100	1,040.00	0.00
17 3	000828	东莞控股	100	915.00	0.00
17 4	600987	航民股份	100	823.00	0.00
17 5	600682	南京新百	100	801.00	0.00

17 6	600200	江苏吴中	100	721.00	0.00
17 7	002701	奥瑞金	100	451.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	002422	科伦药业	3,578,159.00	3.67
2	600998	九州通	3,458,888.51	3.55
3	600582	天地科技	3,260,425.19	3.35
4	600985	淮北矿业	3,130,015.00	3.21
5	300017	网宿科技	2,959,271.00	3.04
6	603056	德邦股份	2,863,799.00	2.94
7	600500	中化国际	2,848,318.00	2.93
8	688385	复旦微电	2,798,332.49	2.87
9	000728	国元证券	2,754,937.00	2.83
10	002152	广电运通	2,745,617.00	2.82
11	000878	云南铜业	2,686,624.00	2.76
12	601699	潞安环能	2,672,302.00	2.74
13	600699	均胜电子	2,641,998.00	2.71
14	601717	郑煤机	2,574,499.00	2.64
15	002056	横店东磁	2,548,356.00	2.62
16	600623	华谊集团	2,527,643.00	2.60
17	600298	安琪酵母	2,460,376.00	2.53
18	600580	卧龙电驱	2,439,281.00	2.50
19	601128	常熟银行	2,424,588.00	2.49
20	600956	新天绿能	2,389,844.00	2.45
21	600131	国网信通	2,357,410.00	2.42
22	600022	山东钢铁	2,332,746.00	2.40

23	603218	日月股份	2,286,048.00	2.35
24	600143	金发科技	2,282,408.00	2.34
25	600271	航天信息	2,273,945.00	2.34
26	002273	水晶光电	2,268,196.46	2.33
27	601928	凤凰传媒	2,262,337.00	2.32
28	002738	中矿资源	2,203,725.95	2.26
29	688819	天能股份	2,203,380.13	2.26
30	000738	航发控制	2,179,872.00	2.24
31	688390	固德威	2,151,631.00	2.21
32	601869	长飞光纤	2,139,151.00	2.20
33	600435	北方导航	2,122,985.00	2.18
34	000750	国海证券	2,068,400.00	2.12
35	601168	西部矿业	2,063,877.00	2.12
36	601958	金钼股份	2,059,643.00	2.12
37	601298	青岛港	2,055,626.00	2.11
38	002625	光启技术	2,035,915.00	2.09
39	000898	鞍钢股份	2,031,063.00	2.09
40	300724	捷佳伟创	2,028,132.00	2.08
41	002600	领益智造	1,978,986.00	2.03
42	002250	联化科技	1,959,998.00	2.01

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	601231	环旭电子	4,495,599.00	4.62
2	300017	网宿科技	4,008,297.00	4.12
3	688063	派能科技	3,985,112.11	4.09
4	688819	天能股份	3,825,772.07	3.93
5	000878	云南铜业	3,452,615.00	3.55
6	000728	国元证券	3,425,977.00	3.52

7	600699	均胜电子	3,381,054.00	3.47
8	600435	北方导航	3,294,168.00	3.38
9	002422	科伦药业	3,279,775.60	3.37
10	600985	淮北矿业	3,132,977.00	3.22
11	603056	德邦股份	3,054,445.54	3.14
12	600500	中化国际	2,871,789.10	2.95
13	601699	潞安环能	2,847,205.00	2.92
14	603317	天味食品	2,803,652.60	2.88
15	600998	九州通	2,800,166.00	2.88
16	688385	复旦微电	2,767,504.63	2.84
17	002250	联化科技	2,759,728.00	2.83
18	600143	金发科技	2,737,988.85	2.81
19	300115	长盈精密	2,679,203.00	2.75
20	002653	海思科	2,601,948.20	2.67
21	300832	新产业	2,596,835.00	2.67
22	688390	固德威	2,595,610.81	2.67
23	600582	天地科技	2,566,079.00	2.64
24	002738	中矿资源	2,562,531.80	2.63
25	002497	雅化集团	2,539,589.00	2.61
26	600131	国网信通	2,538,356.00	2.61
27	601928	凤凰传媒	2,470,447.00	2.54
28	600153	建发股份	2,459,396.95	2.53
29	000932	华菱钢铁	2,455,438.14	2.52
30	002625	光启技术	2,416,742.00	2.48
31	002048	宁波华翔	2,380,000.00	2.44
32	600298	安琪酵母	2,376,371.00	2.44
33	601077	渝农商行	2,363,502.00	2.43
34	600022	山东钢铁	2,317,982.00	2.38
35	600967	内蒙一机	2,309,424.00	2.37
36	600566	济川药业	2,234,536.00	2.29
37	601555	东吴证券	2,217,838.00	2.28

38	000738	航发控制	2,210,645.44	2.27
39	002131	利欧股份	2,184,955.00	2.24
40	002945	华林证券	2,138,073.00	2.20
41	603737	三棵树	2,128,591.00	2.19
42	600956	新天绿能	2,080,672.00	2.14
43	002056	横店东磁	2,049,571.00	2.10
44	600580	卧龙电驱	2,042,760.00	2.10
45	300861	美畅股份	2,031,127.00	2.09
46	601128	常熟银行	2,030,945.00	2.09
47	300390	天华新能	2,009,616.20	2.06
48	300724	捷佳伟创	1,998,789.00	2.05
49	600380	健康元	1,987,119.00	2.04
50	300699	光威复材	1,956,737.40	2.01
51	600160	巨化股份	1,950,532.28	2.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	440,717,738.09
卖出股票收入（成交）总额	470,029,394.63

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照成交单价乘以成交数量填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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)	1,900.16	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,900.16	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127086	恒邦转债	19	1,900.16	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,925.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,925.27

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 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	持有份额	占总份 额比例

	数 (户)			比例		
中加 中证5 00指 数增 强A	891	24,980.35	8,640,684.41	38.8 2%	13,616,803.90	61.18%
中加 中证5 00指 数增 强C	1,9 31	27,024.33	36,494,652.50	69.9 3%	15,689,333.54	30.07%
合计	2,8 22	26,378.98	45,135,336.91	60.6 3%	29,306,137.44	39.37%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	中加中证500指数 增强A	132,341.09	0.59%
	中加中证500指数 增强C	532,276.65	1.02%
	合计	664,617.74	0.89%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	中加中证500指数 增强A	-
	中加中证500指数 增强C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基	中加中证500指数	0~10

金	增强A	
	中加中证500指数 增强C	50~100
	合计	50~100

§9 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
基金合同生效日(2020年09月27日)基金份额总额	96,019,344.11	108,963,659.56
本报告期期初基金份额总额	48,972,663.07	56,209,522.68
本报告期基金总申购份额	6,196,398.87	3,102,772.34
减：本报告期基金总赎回份额	32,911,573.63	7,128,308.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	22,257,488.31	52,183,986.04

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。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人本报告期内重大人事变动情况：本报告期内，公司原董事长夏英先生离任，夏远洋先生担任公司董事长。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日起至今聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	
中信建投	2	910,499,014.94	100.00%	479,826.14	100.00%	-

注：1.根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发【2019】14号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的30%”的分仓规定。

2.公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

- （1）基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；
- （2）公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；
- （3）研究服务实力。

3.券商及交易单元的选择流程如下：

- （1）权益投资部经集体讨论后遵照《中加基金管理有限公司交易单元管理办法》标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；
- （2）公司投资决策委员会负责审批、确定券商名单及相应的席位租用安排；

(3) 券商名单及相应的席位租用安排确定后,由监察稽核部负责审查相关协议内容,集中交易部负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

4.权益投资部于每年第一季度内根据《券商选择标准评分表》对券商进行重新评估,拟定是否需要新增、续用或取消券商、调整相应席位安排,并报公司投资决策委员会审批、确定。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
中信建投	1,238,533.40	100.00%	73,790,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中加中证500指数增强型证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-20
2	中加基金管理有限公司关于中加中证500指数增强型证券投资基金关联交易公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-25
3	中加中证500指数增强型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-30
4	中加中证500指数增强型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-21

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	20230101-20230	27,966,341.83	0.00	27,966,341.83	0.00	0.00%

构		221					
	2	20230306-20230630	16,999,575.01	0.00	0.00	16,999,575.01	22.84%
	3	20230222-20230630	19,495,077.49	0.00	0.00	19,495,077.49	26.19%
产品特有风险							
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 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

12.2 存放地点

基金管理人处

12.3 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

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

二〇二三年八月三十日