

中加中证 500 指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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:2026 年 08 月 28 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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月27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2026年01月01日起至2026年06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	7
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
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	75
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	75
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	75
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	75
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
7.12 投资组合报告附注	75
§8 基金份额持有人信息	76
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77

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77

§9 开放式基金份额变动 78

§10 重大事件揭示78

10.1 基金份额持有人大会决议78

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 78

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼78

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79

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况79

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 79

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 81

§12 备查文件目录81

12.1 备查文件目录81

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	32,606,324.25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	14,295,318.03份	18,311,006.22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	邱珂磊
	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	010-56162085
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	北京市朝阳区景辉街16号院1号楼泰康集团大厦8层/18层， 北京市朝阳区光华路10号院 中信大厦82层
邮政编码		100050	100020
法定代表人		杨琳	刘成

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.bobbns.com
基金中期报告置备地点	北京市西城区南纬路35号

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 (2026年01月01日-2026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	2,204,575.39	3,153,206.29
本期利润	2,605,883.07	3,465,452.53
加权平均基金份额本期利润	0.1977	0.1675
本期加权平均净值利润率	14.16%	12.21%
本期基金份额净值增长率	16.97%	16.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	6,346,328.16	7,675,747.49
期末可供分配基金份额利润	0.4439	0.4192
期末基金资产净值	21,135,761.52	26,601,375.80
期末基金份额净值	1.4785	1.4528
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	47.85%	45.28%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	13.40%	1.46%	17.61%	1.56%	-4.21%	-0.10%
过去六个月	16.97%	1.47%	19.93%	1.58%	-2.96%	-0.11%
过去一年	46.24%	1.24%	49.68%	1.35%	-3.44%	-0.11%
过去三年	55.39%	1.29%	48.15%	1.41%	7.24%	-0.12%
过去五年	32.76%	1.21%	31.61%	1.30%	1.15%	-0.09%
自基金合同生效起至今	47.85%	1.18%	43.13%	1.26%	4.72%	-0.08%

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
过去三个月	13.32%	1.46%	17.61%	1.56%	-4.29%	-0.10%
过去六个月	16.79%	1.47%	19.93%	1.58%	-3.14%	-0.11%
过去一年	45.80%	1.24%	49.68%	1.35%	-3.88%	-0.11%
过去三年	54.01%	1.29%	48.15%	1.41%	5.86%	-0.12%
过去五年	30.79%	1.21%	31.61%	1.30%	-0.82%	-0.09%
自基金合同生效起至今	45.28%	1.18%	43.13%	1.26%	2.15%	-0.08%

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-2026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-2026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%。

截至报告期末，本基金管理人共管理83只基金，涵盖股票型基金、债券型基金、混合型基金、货币市场基金以及基金中基金等多种基金类型，为投资者提供丰富的选择。

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	-	16	钟伟先生，复旦大学数学博士。2009年7月至2016年5月，先后在广发基金管理有限公司金融工程部、数量投资部任研究员、基金经理。2013年11月7日至2015年8月任广发中债金融债指数基金的基金经理。2015年2月至2016年5月任广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2016年5月至2020年3月，任吉富创业投资股份有限公司量化投资部总经理、基金经理。2020年3月加入中加基金管理有限公司，现任基金经理。

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》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人始终将合规经营与基金运作的规范性置于首位。针对监管部门就2023年现场检查发现问题出具的警示函，基金管理人就检查期间所涉责任人员进行追溯问责。基金管理人召开了年中工作会暨合规工作大会，对合规管理工作进行总结部署，持续强化全员合规意识。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的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金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股市场呈现大盘震荡上行、成长赛道结构性牛市、市场极致分化的特征。年初在全球降息预期与流动性宽松的背景下，A股市场延续了去年底的上漲行情，商业航天和AI应用等题材活跃，引领“春季躁动”行情。2月底，美伊冲突爆发，中东地缘政治风险冲击，油价上涨引发全球通胀担忧，市场避险情绪浓厚，资金涌向能源与红利板块。A股受此外部利空影响，市场震荡下行。4月份中东地缘冲突局势缓和后市场回暖，CPO和存储率先启动，沪指探底回升。5月份海外存储龙头业绩超预期催化，半导体设备、光通信连续放量，AI科技产业链业绩兑现带动成长板块持续走强。6月份科

技主线全面爆发，创业板、科创50指数创下阶段新高乃至历史新高，月末科技板块高潮后出现获利回吐。

本报告期，沪深300指数上涨7.55%，中证500指数上涨20.97%，中证1000上涨15.99%。从市场风格来看，中小盘成长风格相对占优，大盘价值风格承压。

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1.4785元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为16.97%，同期业绩比较基准收益率为19.93%；截至报告期末中加中证500指数增强C基金份额净值为1.4528元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为16.79%，同期业绩比较基准收益率为19.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经历了上半年的科技板块的极致抱团后，下半年A股面临“外紧内松”的宏观环境，企业盈利修复与AI产业大趋势仍然会是支撑上涨上行的核心支柱。市场风格料由极致的分化走向以科技为主的更为均衡的风格。市场投资者也会更青睐能在科技浪潮中有业绩支撑的公司。

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，由分管基金运营的公司领导任估值小组负责人，成员由分管风险合规的公司领导、固定收益部、权益投资部、基金运营部（营销服务部）、风险管理部、法律合规与内控部、集中交易部等部门负责人及业务骨干组成，若估值小组认为必要，可适当增减小组成员，业务骨干由估值小组认定和调整。基金经理可依据专业判断就估值政策标准等议题参与讨论并提出意见建议，但不能参与最终估值决策。估值小组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，以及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历。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的情形，曾发生连续六十个工作日基金资产净值低于人民币五千万元的情形，本基金管理人已将相关解决方案上报中国证监会。自2026年5月11日起又发生连续二十个工作日基金资产净值低于人民币五千万元的情形，截至本报告期末基金资产净值尚未恢复至五千万元以上。

本报告期内，本基金迷你期间的信息披露费、审计费等固定费用由基金管理人承担。

§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2026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：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,624,560.83	2,031,284.04
结算备付金		1,063.56	1,056.12
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	44,312,921.48	30,467,228.85
其中：股票投资		44,312,292.28	30,467,228.85
基金投资		-	-
债券投资		629.20	-
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		176,400.73	10,135.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		48,114,946.60	32,509,704.26
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025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		310,869.80	222,802.81
应付管理人报酬		30,887.34	24,449.70
应付托管费		5,791.38	4,584.31
应付销售服务费		6,820.90	6,336.38
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.02	0.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	23,439.84	106.85
负债合计		377,809.28	258,280.10
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	32,606,324.25	25,789,033.62
未分配利润	6.4.7.8	15,130,813.07	6,462,390.54
净资产合计		47,737,137.32	32,251,424.16
负债和净资产总计		48,114,946.60	32,509,704.26

注：报告截止日2026年06月30日，A类基金份额净值为1.4785元，A类基金份额总额14,295,318.03份；C类基金份额净值为1.4528元，C类基金份额总额18,311,006.22份，总份额合计32,606,324.25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：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		6,354,809.65	2,181,797.88
1.利息收入		9,073.25	7,508.47
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,657.14	5,356.37

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		416.11	2,152.10
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,552,780.54	1,080,891.29
其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,181,156.68	733,689.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	0.04	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	371,623.82	347,201.58
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	713,553.92	1,080,201.40
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	79,401.94	13,196.72
减：二、营业总支出		283,474.05	219,308.04
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	185,753.88	124,088.72
2.托管费	6.4.10.2.2	34,828.85	23,266.64
3.销售服务费	6.4.10.2.3	42,342.57	28,063.78
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		-	0.01
8.其他费用	6.4.7.19	20,548.75	43,888.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,071,335.60	1,962,489.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,071,335.60	1,962,489.84
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,071,335.60	1,962,489.84

6.3 净资产变动表

会计主体：中加中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	25,789,033.62	6,462,390.54	32,251,424.16
二、本期期初净资产	25,789,033.62	6,462,390.54	32,251,424.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,817,290.63	8,668,422.53	15,485,713.16
（一）、综合收益总额	-	6,071,335.60	6,071,335.60
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	6,817,290.63	2,597,086.93	9,414,377.56

其中：1.基金申购款	40,051,814.44	15,516,508.25	55,568,322.69
2.基金赎回款	-33,234,523.81	-12,919,421.32	-46,153,945.13
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	32,606,324.25	15,130,813.07	47,737,137.32
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	37,874,498.30	-2,159,974.44	35,714,523.86
二、本期期初净资产	37,874,498.30	-2,159,974.44	35,714,523.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,468,915.15	2,226,139.90	-9,242,775.25
（一）、综合收益总额	-	1,962,489.84	1,962,489.84
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-11,468,915.15	263,650.06	-11,205,265.09
其中：1.基金申购款	12,882,148.90	-741,017.56	12,141,131.34
2.基金赎回款	-24,351,064.05	1,004,667.62	-23,346,396.43
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产	-	-	-

变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	26,405,583.15	66,165.46	26,471,748.61

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:

杨琳	于春玲	于春玲
-----	-----	-----
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25日证监许可[2020]1946号文注册,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》(以下简称“基金合同”)公开募集。本基金为契约型开放式股票型基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金,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公开发售,募集期为2020年9月14日起至2020年9月23日止。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8,598.59份),发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据经中国证监会备案的基金合同和《中加中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》的相关内容,本基金将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,并不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。本基金两类基金份额分别设置代码,分别公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资者在认购/申购基金份额时可自行选择基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、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,本基金投资范围主要为标的指数成份股(含存托凭证)及备选成份股(含存托凭证)。此外,为更好地实现投资目标,本基金的投资范围还包括国内依法发行上市的其他股票(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、次级债、地方政府

债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、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》(以下合称"企业会计准则")的要求,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称"基金业协会")颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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及附注6.4.2中所列示的中国证监会和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2026年06月30日的财务状况、2026年度中期的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。本期财务报表的编制期间为2026年1月1日至2026年6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。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征,在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量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。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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。

(2)金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金无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。

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

(1)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。

(2)金融工具的后续计量

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

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债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。

(3)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)。

(4)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础, 对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

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。

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。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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为利息收入。

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及资产支持证券投资，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其变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动(包括于估值日采用合同约定的估值汇率将外币折算为人民币所产生的折算差额)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券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

管理人报酬、托管费和销售服务费(若有)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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；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的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；由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；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

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，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《关于固定收益品种的估值处理标准》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《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》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小

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》、财税[2025] 4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。
- 本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入, 自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对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。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。
- (2) 对本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。
- 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。
- (3) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公司（“挂牌公司”）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。对本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。
- 对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。
- (4) 本基金卖出股票按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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。
- (5) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026年06月30日
活期存款	921,424.32
等于：本金	921,114.86
加：应计利息	309.46
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	2,703,136.51
等于：本金	2,702,977.37
加：应计利息	159.14
合计	3,624,560.83

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 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		42,841,343.87	-	44,312,292.28	1,470,948.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	400.00	0.04	629.20	229.16
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	400.00	0.04	629.20	229.16
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		42,841,743.87	0.04	44,312,921.48	1,471,177.57

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末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 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	66.09
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	3,425.00
预提费用-信息披露费	17,123.75
其他应付	2,825.00
合计	23,439.84

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	
	2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,576,460.06	8,576,460.06
本期申购	15,138,931.38	15,138,931.38
本期赎回（以“-”号填列）	-9,420,073.41	-9,420,073.41
本期末	14,295,318.03	14,295,318.03

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	
	2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,212,573.56	17,212,573.56
本期申购	24,912,883.06	24,912,883.06
本期赎回（以“-”号填列）	-23,814,450.40	-23,814,450.40
本期末	18,311,006.22	18,311,006.22

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
上年度末	2,168,336.03	96,257.25	2,264,593.28
本期期初	2,168,336.03	96,257.25	2,264,593.28
本期利润	2,204,575.39	401,307.68	2,605,883.07
本期基金份额交易产生的变动数	1,973,416.74	-3,449.60	1,969,967.14
其中：基金申购款	5,615,604.69	362,484.25	5,978,088.94
基金赎回款	-3,642,187.95	-365,933.85	-4,008,121.80

本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,346,328.16	494,115.33	6,840,443.49

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
上年度末	4,014,921.60	182,875.66	4,197,797.26
本期期初	4,014,921.60	182,875.66	4,197,797.26
本期利润	3,153,206.29	312,246.24	3,465,452.53
本期基金份额交易产生的变动数	507,619.60	119,500.19	627,119.79
其中：基金申购款	8,635,891.69	902,527.62	9,538,419.31
基金赎回款	-8,128,272.09	-783,027.43	-8,911,299.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,675,747.49	614,622.09	8,290,369.58

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	5,922.87
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,726.35
结算备付金利息收入	7.44
其他	0.48
合计	8,657.14

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
	2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	236,898,561.73
减：卖出股票成本总额	231,471,043.89
减：交易费用	246,361.16
买卖股票差价收入	5,181,156.68

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
	2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	0.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）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	0.04

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金在本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资基金收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资基金收益项目构成

本基金在本报告期内无资产支持证券投资基金收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资基金收益——买卖资产支持证券差价收入

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

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

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 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	371,623.82
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	371,623.82

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	713,553.92
——股票投资	713,324.76
——债券投资	229.16
——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	713,553.92

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	76,280.94
转换费收入	3,121.00
合计	79,401.94

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	3,425.00
信息披露费	17,123.75
证券出借违约金	-
合计	20,548.75

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、关联关系

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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025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	481,501,344.29	100.00%	301,183,687.30	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

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债券交易。

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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
中信建投 证券	9,830,000.00	100.00%	25,610,000.00	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 2026年01月01日至2026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	97,033.04	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025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	60,711.71	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 2026年01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	185,753.88	124,088.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	78,318.35	57,488.14
应支付基金管理人的净管理费	107,435.53	66,600.58

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 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	34,828.85	23,266.64

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 2026年01月01日至2026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	-	101.89	101.89
北京银行	-	21,724.06	21,724.06

股份有限 公司			
中信建投 证券股份 有限公司	-	9,544.95	9,544.95
合计	-	31,370.90	31,370.90
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025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	-	96.92	96.92
北京银行 股份有限 公司	-	3,786.96	3,786.96
中信建投 证券股份 有限公司	-	12,621.45	12,621.45
合计	-	16,505.33	16,505.33

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未发生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。

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未发生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。

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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025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-托管户	921,424.32	5,922.87	778,498.91	4,138.31
中信建投证券股份有限公司-证券资金户	2,703,136.51	2,726.35	2,377,281.16	1,210.28

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基金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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与各关联方承销的证券。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026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

于2026年06月30日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2026年06月30日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2026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2026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2026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、法律合规与内控部门、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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	629.20	-
未评级	-	-

合计	629.20	-
----	--------	---

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(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。

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 2026年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资 金	3,624,560.83	-	-	-	3,624,560.83
结算备 付金	1,063.56	-	-	-	1,063.56
交易性 金融资 产	629.20	-	-	44,312,292.28	44,312,921.48
应收申 购款	-	-	-	176,400.73	176,400.73
资产总 计	3,626,253.59	-	-	44,488,693.01	48,114,946.60
负债					
应付赎 回款	-	-	-	310,869.80	310,869.80
应付管 理人报 酬	-	-	-	30,887.34	30,887.34

应付托 管费	-	-	-	5,791.38	5,791.38
应付销 售服务 费	-	-	-	6,820.90	6,820.90
应交税 费	-	-	-	0.02	0.02
其他负 债	-	-	-	23,439.84	23,439.84
负债总 计	-	-	-	377,809.28	377,809.28
利率敏 感度缺 口	3,626,253.59	-	-	44,110,883.73	47,737,137.32
上年度 末 2025年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资 金	2,031,284.04	-	-	-	2,031,284.04
结算备 付金	1,056.12	-	-	-	1,056.12
交易性 金融资 产	-	-	-	30,467,228.85	30,467,228.85
应收申 购款	-	-	-	10,135.25	10,135.25
资产总 计	2,032,340.16	-	-	30,477,364.10	32,509,704.26
负债					
应付赎 回款	-	-	-	222,802.81	222,802.81
应付管 理人报 酬	-	-	-	24,449.70	24,449.70

应付托管费	-	-	-	4,584.31	4,584.31
应付销售服务费	-	-	-	6,336.38	6,336.38
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
其他负债	-	-	-	106.85	106.85
负债总计	-	-	-	258,280.10	258,280.10
利率敏感度缺口	2,032,340.16	-	-	30,219,084.00	32,251,424.16

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 2026年06月30日		上年度末 2025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	44,312,292.28	92.83	30,467,228.85	94.47
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	629.20	-	-	-
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	44,312,921.48	92.83	30,467,228.85	94.47

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,152,796.99	1,453,128.64
	业绩比较基准下降5%	-2,152,796.99	-1,453,128.64

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	44,312,921.48	30,412,061.85
第二层次	-	55,167.00
第三层次	-	-
合计	44,312,921.48	30,467,228.85

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2026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（上年度期末：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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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2026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	44,312,292.28	92.10
	其中：股票	44,312,292.28	92.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	629.20	0.00
	其中：债券	629.20	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	-	-
	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	3,625,624.39	7.54
8	其他各项资产	176,400.73	0.37
9	合计	48,114,946.60	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	200,200.00	0.42
B	采矿业	1,119,627.20	2.35
C	制造业	30,691,367.93	64.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,306,202.00	2.74
E	建筑业	320,067.00	0.67
F	批发和零售业	762,461.00	1.60

G	交通运输、仓储和邮政业	434,932.00	0.91
H	住宿和餐饮业	8,995.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,474,532.61	3.09
J	金融业	2,270,824.40	4.76
K	房地产业	82,018.00	0.17
L	租赁和商务服务业	176,815.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	139,986.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	115,020.00	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,012.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	7,052.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	39,112,112.14	81.93

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	29,757.50	0.06
B	采矿业	288,366.00	0.60
C	制造业	3,511,600.40	7.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,920.00	0.14
E	建筑业	31,897.00	0.07
F	批发和零售业	255,119.00	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	55,485.00	0.12
H	住宿和餐饮业	1,820.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	384,091.24	0.80

J	金融业	229,958.00	0.48
K	房地产业	13,010.00	0.03
L	租赁和商务服务业	35,974.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	78,033.00	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	19,200.00	0.04
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	4,185.00	0.01
S	综合	194,764.00	0.41
	合计	5,200,180.14	10.89

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所有股票投资明细

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

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	001309	德明利	1,300	1,225,770.00	2.57
2	300857	协创数据	3,040	1,033,296.00	2.16
3	301536	星宸科技	6,600	849,486.00	1.78
4	605358	立昂微	10,300	799,280.00	1.67
5	603338	浙江鼎力	18,700	794,750.00	1.66
6	300373	扬杰科技	4,600	723,258.00	1.52
7	603979	金诚信	12,200	720,166.00	1.51
8	300919	中伟新材	15,500	678,125.00	1.42
9	002432	九安医疗	9,200	650,256.00	1.36

10	688387	信科移动-U	29,000	575,360.00	1.21
11	603444	吉比特	1,500	537,630.00	1.13
12	600166	福田汽车	182,100	529,911.00	1.11
13	603225	新凤鸣	26,300	516,795.00	1.08
14	600100	同方股份	75,000	513,750.00	1.08
15	600497	驰宏锌锗	41,600	503,776.00	1.06
16	603175	超颖电子	5,500	489,995.00	1.03
17	300604	长川科技	1,400	477,988.00	1.00
18	002841	视源股份	13,800	476,514.00	1.00
19	603160	汇顶科技	7,700	475,167.00	1.00
20	600378	昊华科技	6,100	459,818.00	0.96
21	600685	中船防务	18,000	457,920.00	0.96
22	603298	杭叉集团	19,000	453,340.00	0.95
23	601108	财通证券	47,500	410,875.00	0.86
24	000050	深天马A	41,400	410,274.00	0.86
25	600105	永鼎股份	6,000	404,880.00	0.85
26	603699	纽威股份	7,900	397,370.00	0.83
27	600498	烽火通信	5,300	390,080.00	0.82
28	301606	绿联科技	6,300	384,426.00	0.81
29	002025	航天电器	4,900	373,478.00	0.78
30	000709	河钢股份	188,700	366,078.00	0.77
31	600535	天士力	26,400	349,272.00	0.73
32	600884	杉杉股份	24,700	334,685.00	0.70
33	002281	光迅科技	1,300	334,022.00	0.70
34	002487	大金重工	5,700	330,429.00	0.69
35	300475	香农芯创	1,100	330,000.00	0.69
36	603728	鸣志电器	5,400	328,968.00	0.69
37	600369	西南证券	81,800	328,836.00	0.69
38	600157	永泰能源	200,500	322,805.00	0.68
39	600801	华新建材	20,600	321,360.00	0.67
40	601880	辽港股份	229,000	316,020.00	0.66

41	001389	广合科技	1,300	308,425.00	0.65
42	601128	常熟银行	52,970	308,285.40	0.65
43	601139	深圳燃气	53,700	303,942.00	0.64
44	600885	宏发股份	8,800	303,512.00	0.64
45	600298	安琪酵母	8,200	296,840.00	0.62
46	300395	菲利华	2,200	294,206.00	0.62
47	688692	达梦数据	1,200	293,148.00	0.61
48	600109	国金证券	33,000	289,740.00	0.61
49	300073	当升科技	5,800	278,632.00	0.58
50	688213	思特威-W	2,523	270,137.61	0.57
51	002738	中矿资源	4,500	265,455.00	0.56
52	300620	光库科技	700	264,740.00	0.55
53	002185	华天科技	11,700	261,027.00	0.55
54	603486	科沃斯	5,100	258,825.00	0.54
55	688002	睿创微纳	1,577	243,946.13	0.51
56	002273	水晶光电	6,800	241,264.00	0.51
57	600906	财达证券	32,100	239,466.00	0.50
58	603308	应流股份	3,900	235,560.00	0.49
59	300054	鼎龙股份	2,200	233,134.00	0.49
60	603092	德力佳	4,200	226,674.00	0.47
61	603179	新泉股份	4,500	223,425.00	0.47
62	688180	君实生物-U	6,600	223,212.00	0.47
63	300548	长芯博创	800	222,400.00	0.47
64	001286	陕西能源	21,600	219,024.00	0.46
65	300458	全志科技	5,540	218,608.40	0.46
66	002152	广电运通	23,200	217,616.00	0.46
67	688728	格科微	10,338	217,511.52	0.46
68	600352	浙江龙盛	17,400	210,714.00	0.44
69	688469	芯联集成-U	19,500	206,895.00	0.43
70	601233	桐昆股份	9,200	199,180.00	0.42
71	000951	中国重汽	10,200	199,002.00	0.42

72	603920	世运电路	4,100	196,964.00	0.41
73	002414	高德红外	14,200	188,292.00	0.39
74	002851	麦格米特	1,100	183,898.00	0.39
75	002064	华峰化学	18,600	176,514.00	0.37
76	600312	平高电气	9,900	174,834.00	0.37
77	603087	甘李药业	3,000	170,280.00	0.36
78	600598	北大荒	15,700	170,188.00	0.36
79	600688	上海石化	57,500	168,475.00	0.35
80	300953	震裕科技	1,200	160,440.00	0.34
81	600170	上海建工	71,800	159,396.00	0.33
82	600704	物产中大	33,700	159,064.00	0.33
83	002409	雅克科技	700	157,150.00	0.33
84	002850	科达利	800	151,440.00	0.32
85	002271	东方雨虹	12,300	146,001.00	0.31
86	603119	浙江荣泰	2,200	145,948.00	0.31
87	300142	沃森生物	11,200	145,488.00	0.30
88	003031	中瓷电子	800	144,240.00	0.30
89	600062	华润双鹤	8,800	141,152.00	0.30
90	300012	华测检测	10,100	139,986.00	0.29
91	688347	华虹宏力	400	134,520.00	0.28
92	688349	三一重能	8,859	134,479.62	0.28
93	600765	中航重机	9,900	127,908.00	0.27
94	603341	龙旗科技	3,000	127,470.00	0.27
95	600521	华海药业	8,700	125,280.00	0.26
96	688220	翱捷科技-U	1,000	124,320.00	0.26
97	300285	国瓷材料	1,200	123,816.00	0.26
98	300957	贝泰妮	3,800	119,738.00	0.25
99	601699	潞安环能	8,100	115,668.00	0.24
100	301358	湖南裕能	1,500	113,805.00	0.24
101	000519	中兵红箭	5,400	113,778.00	0.24
102	601608	中信重工	23,700	113,049.00	0.24

103	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	0.23
104	688578	艾力斯	1,000	109,200.00	0.23
105	600606	绿地控股	89,400	108,174.00	0.23
106	600511	国药股份	4,100	106,764.00	0.22
107	000883	湖北能源	24,200	104,544.00	0.22
108	000683	博源化工	18,100	104,256.00	0.22
109	300972	万辰集团	600	104,046.00	0.22
110	600143	金发科技	6,700	103,515.00	0.22
111	002966	苏州银行	14,700	102,312.00	0.21
112	000893	亚钾国际	2,500	102,225.00	0.21
113	600909	华安证券	9,200	102,212.00	0.21
114	600098	广州发展	16,700	98,697.00	0.21
115	603379	三美股份	1,300	98,657.00	0.21
116	603816	顾家家居	4,400	98,384.00	0.21
117	002266	浙富控股	19,400	98,164.00	0.21
118	000415	渤海租赁	23,800	96,866.00	0.20
119	600711	盛屯矿业	8,800	96,536.00	0.20
120	300454	深信服	1,000	96,200.00	0.20
121	002429	兆驰股份	9,200	95,588.00	0.20
122	600517	国网英大	19,100	89,388.00	0.19
123	688475	萤石网络	3,100	84,785.00	0.18
124	002120	韵达股份	13,300	84,588.00	0.18
125	301526	国际复材	1,800	84,006.00	0.18
126	000967	盈峰环境	7,900	83,187.00	0.17
127	600380	健康元	8,700	81,954.00	0.17
128	000598	兴蓉环境	12,400	79,608.00	0.17
129	688331	荣昌生物	600	78,156.00	0.16
130	688538	和辉光电-U	30,000	78,000.00	0.16
131	002831	裕同科技	2,163	76,916.28	0.16
132	002008	大族激光	500	75,055.00	0.16
133	600499	科达制造	5,300	73,140.00	0.15

134	600707	彩虹股份	4,200	70,938.00	0.15
135	600398	海澜之家	13,400	70,082.00	0.15
136	688266	泽璟制药-U	600	69,996.00	0.15
137	000960	锡业股份	1,600	68,304.00	0.14
138	002624	完美世界	5,400	67,068.00	0.14
139	002821	凯莱英	400	64,800.00	0.14
140	300058	蓝色光标	4,600	63,296.00	0.13
141	601179	中国西电	4,100	61,172.00	0.13
142	002436	兴森科技	1,200	61,140.00	0.13
143	000783	长江证券	5,900	57,525.00	0.12
144	600816	建元信托	22,200	54,168.00	0.11
145	002335	科华数据	1,270	53,911.50	0.11
146	600348	华阳股份	6,800	52,020.00	0.11
147	000703	恒逸石化	3,800	51,566.00	0.11
148	600483	福能股份	4,900	49,931.00	0.10
149	600131	国网信通	3,400	49,640.00	0.10
150	603156	养元饮品	1,000	49,070.00	0.10
151	688192	迪哲医药-U	1,200	47,916.00	0.10
152	601665	齐鲁银行	8,300	47,891.00	0.10
153	600141	兴发集团	1,000	46,970.00	0.10
154	000800	一汽解放	7,800	46,410.00	0.10
155	600595	中孚实业	8,000	44,960.00	0.09
156	000539	粤电力A	6,300	42,903.00	0.09
157	600316	洪都航空	1,500	41,910.00	0.09
158	000733	振华科技	700	39,648.00	0.08
159	000729	燕京啤酒	3,900	39,507.00	0.08
160	600563	法拉电子	200	38,160.00	0.08
161	300346	南大光电	400	37,060.00	0.08
162	300666	江丰电子	100	36,860.00	0.08
163	002056	横店东磁	1,200	36,576.00	0.08
164	001221	悍高集团	900	36,198.00	0.08

165	001203	大中矿业	1,200	35,940.00	0.08
166	600808	马钢股份	14,200	35,500.00	0.07
167	601198	东兴证券	2,600	35,334.00	0.07
168	600390	五矿资本	7,600	34,656.00	0.07
169	002444	巨星科技	1,100	34,210.00	0.07
170	000060	中金岭南	4,500	34,065.00	0.07
171	000831	中国稀土	600	33,294.00	0.07
172	688568	中科星图	800	33,176.00	0.07
173	603345	安井食品	400	32,076.00	0.07
174	300567	精测电子	100	31,760.00	0.07
175	300623	捷捷微电	700	31,493.00	0.07
176	601118	海南橡胶	6,100	30,012.00	0.06
177	002926	华西证券	3,600	29,412.00	0.06
178	600601	方正科技	2,100	29,064.00	0.06
179	603233	大参林	1,900	28,557.00	0.06
180	000623	吉林敖东	1,600	28,368.00	0.06
181	600177	雅戈尔	3,700	27,861.00	0.06
182	600208	衢州发展	9,700	27,451.00	0.06
183	600021	上海电力	1,800	27,126.00	0.06
184	600282	南钢股份	5,900	27,081.00	0.06
185	002500	山西证券	5,200	26,832.00	0.06
186	600927	永安期货	2,100	26,145.00	0.05
187	688018	乐鑫科技	200	25,584.00	0.05
188	600339	中油工程	8,200	25,174.00	0.05
189	002472	双环传动	600	24,906.00	0.05
190	000728	国元证券	3,300	24,717.00	0.05
191	300003	乐普医疗	2,000	23,700.00	0.05
192	688187	时代电气	338	23,207.08	0.05
193	688615	合合信息	200	22,620.00	0.05
194	000032	深桑达A	900	22,455.00	0.05
195	600516	方大炭素	3,600	22,212.00	0.05

196	601865	福莱特	2,100	22,071.00	0.05
197	600663	陆家嘴	3,500	21,980.00	0.05
198	000983	山西焦煤	3,700	21,460.00	0.04
199	601611	中国核建	1,900	21,185.00	0.04
200	688375	国博电子	200	20,860.00	0.04
201	300017	网宿科技	1,600	20,816.00	0.04
202	600486	扬农化工	400	20,280.00	0.04
203	002252	上海莱士	4,500	19,530.00	0.04
203	000400	许继电气	900	19,530.00	0.04
204	300001	特锐德	500	18,915.00	0.04
205	000987	越秀资本	2,400	18,768.00	0.04
206	600126	杭钢股份	3,000	18,390.00	0.04
207	003022	联泓新科	700	18,130.00	0.04
208	603939	益丰药房	1,000	17,980.00	0.04
209	601155	新城控股	1,700	17,442.00	0.04
210	300699	光威复材	600	17,190.00	0.04
211	601666	平煤股份	2,400	17,160.00	0.04
212	600292	电投水电	1,400	16,856.00	0.04
213	600153	建发股份	2,100	16,653.00	0.03
214	000738	航发控制	900	16,461.00	0.03
215	600566	济川药业	700	15,533.00	0.03
216	002085	万丰奥威	1,400	15,526.00	0.03
217	601598	中国外运	3,100	15,376.00	0.03
218	600008	首创环保	5,400	14,688.00	0.03
219	000830	鲁西化工	1,200	14,400.00	0.03
220	600655	豫园股份	3,500	14,385.00	0.03
221	300432	富临精工	700	14,063.00	0.03
222	600536	中国软件	500	14,060.00	0.03
223	688166	博瑞医药	400	14,004.00	0.03
224	601717	中创智领	1,000	13,910.00	0.03
225	000997	新大陆	800	13,040.00	0.03

226	000932	华菱钢铁	3,700	12,839.00	0.03
227	601696	中银证券	1,000	12,650.00	0.03
228	600968	海油发展	3,700	12,321.00	0.03
229	000088	盐田港	3,000	12,270.00	0.03
230	688281	华秦科技	240	12,055.20	0.03
231	300679	电连技术	200	11,998.00	0.03
232	601555	东吴证券	1,500	11,880.00	0.02
233	300487	蓝晓科技	200	11,770.00	0.02
234	002244	滨江集团	1,500	11,400.00	0.02
235	600095	湘财股份	1,500	11,295.00	0.02
236	300383	光环新网	900	11,196.00	0.02
237	688778	厦钨新能	200	10,880.00	0.02
238	000528	柳工	1,400	10,570.00	0.02
239	601016	节能风电	2,600	10,088.00	0.02
240	600332	白云山	500	10,020.00	0.02
241	600637	东方明珠	1,200	9,972.00	0.02
242	688599	天合光能	700	9,884.00	0.02
243	600171	上海贝岭	300	9,582.00	0.02
244	000027	深圳能源	1,500	9,300.00	0.02
245	603833	欧派家居	300	9,033.00	0.02
246	600754	锦江酒店	500	8,995.00	0.02
247	600820	隧道股份	1,700	8,857.00	0.02
248	002078	太阳纸业	700	8,743.00	0.02
249	600132	重庆啤酒	200	8,260.00	0.02
250	603786	科博达	200	8,182.00	0.02
251	601966	玲珑轮胎	800	8,152.00	0.02
252	300677	英科医疗	200	7,834.00	0.02
253	600295	鄂尔多斯	700	7,504.00	0.02
254	000537	绿发电力	1,000	7,310.00	0.02
255	600862	中航高科	400	7,212.00	0.02
256	300002	神州泰岳	900	7,029.00	0.01

257	002812	恩捷股份	100	6,691.00	0.01
258	600350	山东高速	600	6,678.00	0.01
259	002340	格林美	1,000	6,610.00	0.01
260	601991	大唐发电	900	6,372.00	0.01
261	600562	国睿科技	300	6,366.00	0.01
262	002299	圣农发展	400	6,064.00	0.01
263	600582	天地科技	1,300	5,785.00	0.01
264	601019	山东出版	900	5,760.00	0.01
265	300627	华测导航	200	5,680.00	0.01
266	601958	金钼股份	200	5,622.00	0.01
267	600985	淮北矿业	400	5,620.00	0.01
268	603589	口子窖	300	5,604.00	0.01
269	688336	三生国健	100	5,310.00	0.01
270	002155	湖南黄金	200	4,774.00	0.01
271	688819	天能股份	200	4,440.00	0.01
272	603858	步长制药	300	4,380.00	0.01
273	688772	珠海冠宇	200	3,926.00	0.01
274	002465	海格通信	300	3,831.00	0.01
275	600848	上海临港	500	3,745.00	0.01
276	600995	南网储能	300	3,690.00	0.01
277	000155	川能动力	300	3,594.00	0.01
278	601997	贵阳银行	700	3,591.00	0.01
279	600602	云赛智联	200	3,216.00	0.01
280	300748	金力永磁	100	3,085.00	0.01
281	002603	以岭药业	200	3,000.00	0.01
282	600901	江苏金租	500	2,875.00	0.01
283	600988	赤峰黄金	100	2,632.00	0.01
284	002984	森麒麟	200	2,614.00	0.01
285	600578	京能电力	400	2,580.00	0.01
286	600038	中直股份	100	2,529.00	0.01
287	000937	冀中能源	590	2,348.20	0.00

288	300735	光弘科技	100	2,274.00	0.00
289	600546	山煤国际	200	2,186.00	0.00
290	002044	美年健康	400	2,012.00	0.00
291	002130	沃尔核材	100	1,896.00	0.00
292	601112	振石股份	100	1,823.00	0.00
293	000629	钒钛股份	500	1,670.00	0.00
294	000034	神州数码	60	1,665.00	0.00
295	600977	中国电影	100	1,292.00	0.00
296	600737	中粮糖业	100	1,233.00	0.00
297	603766	隆鑫通用	100	1,193.00	0.00
298	002670	国盛证券	100	1,100.00	0.00
299	601216	君正集团	200	892.00	0.00
300	601577	长沙银行	100	871.00	0.00
301	603606	东方电缆	20	830.20	0.00
302	603737	三棵树	20	482.00	0.00
303	688425	铁建重工	100	402.00	0.00
304	601106	中国一重	100	330.00	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	600150	中国船舶	6,200	209,498.00	0.44
2	600673	东阳光	5,800	194,764.00	0.41
3	601899	紫金矿业	6,200	155,868.00	0.33
4	002396	星网锐捷	7,730	148,184.10	0.31
5	601360	三六零	16,500	143,385.00	0.30
6	600320	振华重工	33,600	138,768.00	0.29
7	600183	生益科技	800	138,720.00	0.29
8	603061	金海通	200	100,444.00	0.21

9	300358	楚天科技	12,400	99,200.00	0.21
10	600739	辽宁成大	9,800	99,078.00	0.21
11	600482	中国动力	3,000	98,400.00	0.21
12	601766	中国中车	16,800	87,360.00	0.18
13	000338	潍柴动力	3,200	87,200.00	0.18
14	000166	申万宏源	18,800	82,720.00	0.17
15	301489	思泉新材	500	82,290.00	0.17
16	002922	伊戈尔	2,400	78,720.00	0.16
17	688372	伟测科技	400	74,400.00	0.16
18	601059	信达证券	4,200	67,998.00	0.14
19	300590	移为通信	4,700	67,445.00	0.14
20	600577	精达股份	6,800	66,504.00	0.14
21	002493	荣盛石化	6,000	64,500.00	0.14
22	002049	紫光国微	700	62,125.00	0.13
23	600372	中航机载	5,600	60,760.00	0.13
24	603118	共进股份	5,000	60,550.00	0.13
25	600875	东方电气	2,100	60,417.00	0.13
26	601231	环旭电子	1,800	58,320.00	0.12
27	000553	安道麦A	10,800	57,780.00	0.12
28	600037	歌华有线	9,000	56,430.00	0.12
29	300184	力源信息	3,200	56,160.00	0.12
30	000426	兴业银锡	1,600	52,736.00	0.11
31	603680	今创集团	5,300	51,993.00	0.11
32	000938	紫光股份	1,800	51,948.00	0.11
33	601901	方正证券	7,100	51,120.00	0.11
34	688275	万润新能	400	51,020.00	0.11
35	300201	海伦哲	2,400	50,568.00	0.11
36	600489	中金黄金	2,600	46,930.00	0.10
37	603112	华翔股份	2,800	46,844.00	0.10
38	603305	旭升集团	3,800	46,056.00	0.10
39	002947	恒铭达	600	45,630.00	0.10

40	600989	宝丰能源	2,100	42,693.00	0.09
41	000933	神火股份	2,000	42,400.00	0.09
42	600331	宏达股份	3,800	41,762.00	0.09
43	605056	咸亨国际	2,600	41,600.00	0.09
44	002602	世纪华通	2,900	40,890.00	0.09
45	002768	国恩股份	740	38,524.40	0.08
46	600233	圆通速递	2,300	36,225.00	0.08
47	688717	艾罗能源	400	33,028.00	0.07
48	600395	盘江股份	7,200	32,832.00	0.07
49	002484	江海股份	300	31,500.00	0.07
50	688221	前沿生物-U	1,400	31,360.00	0.07
51	002169	智光电气	2,100	30,744.00	0.06
52	002558	巨人网络	1,100	30,316.00	0.06
53	601138	工业富联	400	28,860.00	0.06
54	000657	中钨高新	300	28,716.00	0.06
55	000792	盐湖股份	900	27,171.00	0.06
56	002497	雅化集团	1,300	26,481.00	0.06
57	600741	华域汽车	1,700	26,384.00	0.06
58	002384	东山精密	100	26,235.00	0.05
59	688173	希荻微	1,366	26,145.24	0.05
60	600116	三峡水利	4,600	25,760.00	0.05
61	601600	中国铝业	3,100	25,482.00	0.05
62	002648	卫星化学	1,000	23,490.00	0.05
63	688390	固德威	200	21,702.00	0.05
64	301246	宏源药业	800	21,520.00	0.05
65	000810	创维数字	1,600	21,200.00	0.04
66	002475	立讯精密	300	21,120.00	0.04
67	000950	重药控股	4,200	21,042.00	0.04
68	603989	艾华集团	400	21,000.00	0.04
69	600645	中源协和	1,200	20,532.00	0.04
70	688208	道通科技	800	20,152.00	0.04

71	300132	青松股份	3,500	19,880.00	0.04
72	601068	中铝国际	4,500	19,440.00	0.04
73	603588	高能环境	1,000	19,200.00	0.04
74	600570	恒生电子	900	19,071.00	0.04
75	600509	天富能源	2,200	18,590.00	0.04
76	002115	三维通信	1,700	17,510.00	0.04
77	002458	益生股份	2,230	17,327.10	0.04
78	600941	中国移动	200	17,226.00	0.04
79	600426	华鲁恒升	700	16,744.00	0.04
80	000708	中信特钢	1,300	16,406.00	0.03
81	688045	必易微	200	16,156.00	0.03
82	002284	亚太股份	1,700	16,133.00	0.03
83	601995	中金公司	400	14,460.00	0.03
84	603638	艾迪精密	600	14,070.00	0.03
85	000977	浪潮信息	200	14,000.00	0.03
86	301382	蜂助手	300	13,800.00	0.03
87	600309	万华化学	200	13,682.00	0.03
88	002415	海康威视	400	13,680.00	0.03
89	600397	江钨装备	500	13,615.00	0.03
90	600019	宝钢股份	2,500	13,575.00	0.03
91	688400	凌云光	200	13,240.00	0.03
92	600230	沧州大化	1,000	13,020.00	0.03
93	603876	鼎胜新材	500	13,005.00	0.03
94	601126	四方股份	200	12,640.00	0.03
95	688097	博众精工	200	12,610.00	0.03
96	300970	华绿生物	680	12,430.40	0.03
97	605020	永和股份	300	12,216.00	0.03
98	600887	伊利股份	500	11,980.00	0.03
99	300134	大富科技	1,400	11,970.00	0.03
100	603317	天味食品	900	11,709.00	0.02
101	600388	龙净环保	800	11,640.00	0.02

102	603969	银龙股份	1,600	11,632.00	0.02
103	002437	誉衡药业	4,200	11,340.00	0.02
104	600251	冠农股份	1,300	11,232.00	0.02
105	600487	亨通光电	100	10,934.00	0.02
106	600026	中远海能	600	10,764.00	0.02
107	688063	派能科技	200	10,654.00	0.02
108	002034	旺能环境	700	10,605.00	0.02
109	688321	微芯生物	400	10,532.00	0.02
110	600662	外服控股	2,600	10,478.00	0.02
111	002378	章源钨业	300	10,044.00	0.02
112	002399	海普瑞	1,100	9,878.00	0.02
113	001914	招商积余	1,200	9,792.00	0.02
114	300206	理邦仪器	800	9,784.00	0.02
115	300504	天邑股份	600	9,678.00	0.02
116	603025	大豪科技	700	9,548.00	0.02
117	688049	炬芯科技	200	9,382.00	0.02
118	600196	复星医药	400	8,988.00	0.02
119	605300	佳禾食品	900	8,775.00	0.02
120	600018	上港集团	1,800	8,496.00	0.02
121	001322	箭牌家居	1,400	8,456.00	0.02
122	300573	兴齐眼药	200	8,152.00	0.02
123	002382	蓝帆医疗	1,600	8,128.00	0.02
124	002545	东方铁塔	500	8,110.00	0.02
125	603615	茶花股份	500	8,075.00	0.02
126	600966	博汇纸业	1,600	7,648.00	0.02
127	002439	启明星辰	600	7,590.00	0.02
128	601061	中信金属	700	7,539.00	0.02
129	601339	百隆东方	1,100	7,447.00	0.02
130	603239	浙江仙通	500	7,405.00	0.02
131	601117	中国化学	1,000	7,350.00	0.02
132	603196	璞源材料	300	7,332.00	0.02

133	600872	中炬高新	400	6,944.00	0.01
134	601916	浙商银行	2,600	6,838.00	0.01
135	002721	金一文化	3,000	6,660.00	0.01
136	300769	德方纳米	100	6,650.00	0.01
137	000807	云铝股份	300	6,642.00	0.01
138	300014	亿纬锂能	100	6,503.00	0.01
139	688472	阿特斯	600	6,492.00	0.01
140	002588	史丹利	800	6,320.00	0.01
141	601607	上海医药	400	6,160.00	0.01
142	002134	天津普林	200	6,084.00	0.01
143	002297	博云新材	200	5,798.00	0.01
144	002641	公元股份	1,500	5,790.00	0.01
145	301060	兰卫医学	700	5,719.00	0.01
146	301075	多瑞医药	100	5,701.00	0.01
147	603818	曲美家居	1,900	5,643.00	0.01
148	603336	宏辉果蔬	700	5,544.00	0.01
149	300098	高新兴	1,200	5,508.00	0.01
150	600963	岳阳林纸	1,800	5,472.00	0.01
151	600460	士兰微	100	5,466.00	0.01
152	000725	京东方A	600	5,208.00	0.01
153	300715	凯伦股份	300	4,938.00	0.01
154	003816	中国广核	1,200	4,692.00	0.01
155	000600	建投能源	500	4,375.00	0.01
156	600361	创新新材	1,200	4,320.00	0.01
157	601949	中国出版	900	4,185.00	0.01
158	300323	华灿光电	200	4,080.00	0.01
159	600496	精工钢构	1,300	4,030.00	0.01
160	002511	中顺洁柔	600	3,990.00	0.01
161	002292	奥飞娱乐	600	3,936.00	0.01
162	601618	中国中冶	1,600	3,904.00	0.01
163	601828	美凯龙	1,900	3,876.00	0.01

164	600997	开滦股份	800	3,800.00	0.01
165	600114	东睦股份	100	3,776.00	0.01
166	600189	泉阳泉	500	3,765.00	0.01
167	000589	贵州轮胎	900	3,654.00	0.01
168	301201	诚达药业	100	3,636.00	0.01
169	301215	中汽股份	700	3,633.00	0.01
170	603093	南华期货	200	3,630.00	0.01
171	002798	帝欧水华	700	3,493.00	0.01
172	603819	神力股份	300	3,435.00	0.01
173	603012	创力集团	400	3,280.00	0.01
174	600918	中泰证券	600	3,192.00	0.01
175	002837	英维克	40	3,182.40	0.01
176	300016	北陆药业	400	3,068.00	0.01
177	000899	赣能股份	300	2,898.00	0.01
178	600050	中国联通	700	2,800.00	0.01
178	000061	农产品	500	2,800.00	0.01
179	301290	东星医疗	100	2,725.00	0.01
180	300369	绿盟科技	500	2,720.00	0.01
181	002795	永和智控	400	2,676.00	0.01
182	301116	益客食品	300	2,568.00	0.01
183	000877	天山股份	700	2,541.00	0.01
184	300099	尤洛卡	400	2,528.00	0.01
185	600210	紫江企业	400	2,480.00	0.01
186	300917	特发服务	100	2,438.00	0.01
187	002048	宁波华翔	100	2,300.00	0.00
188	688609	九联科技	200	2,202.00	0.00
189	002412	汉森制药	400	2,200.00	0.00
190	002899	英派斯	100	2,180.00	0.00
191	600690	海尔智家	100	2,041.00	0.00
192	600724	宁波富达	400	2,028.00	0.00
193	002283	天润工业	200	1,930.00	0.00

194	600232	金鹰股份	300	1,890.00	0.00
195	600375	汉马科技	500	1,845.00	0.00
196	301073	君亭酒店	100	1,820.00	0.00
197	002757	南兴股份	100	1,805.00	0.00
198	603719	良品铺子	200	1,730.00	0.00
199	002582	好想你	200	1,690.00	0.00
200	600425	青松建化	500	1,635.00	0.00
201	000425	徐工机械	200	1,618.00	0.00
202	600356	恒丰纸业	200	1,482.00	0.00
203	002379	宏桥控股	100	1,477.00	0.00
204	605599	菜百股份	100	1,370.00	0.00
205	300055	万邦达	200	1,286.00	0.00
206	601789	宁波建工	300	1,203.00	0.00
207	603711	香飘飘	100	1,111.00	0.00
208	603071	物产环能	100	1,106.00	0.00
209	002752	昇兴股份	200	1,104.00	0.00
210	603901	永创智能	100	1,087.00	0.00
210	603085	天成自控	100	1,087.00	0.00
211	000839	国安股份	400	1,036.00	0.00
212	603889	新澳股份	200	1,022.00	0.00
213	600633	浙数文化	100	1,018.00	0.00
214	600104	上汽集团	100	976.00	0.00
215	002707	众信旅游	200	960.00	0.00
216	002701	奥瑞金	200	852.00	0.00
217	601512	中新集团	100	780.00	0.00
218	603966	法兰泰克	90	733.50	0.00
219	600973	宝胜股份	100	709.00	0.00
220	002595	豪迈科技	15	699.00	0.00
221	000949	新乡化纤	100	634.00	0.00
222	002563	森马服饰	100	504.00	0.00
223	002344	海宁皮城	100	350.00	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	300857	协创数据	2,115,336.00	6.56
2	300373	扬杰科技	2,035,699.00	6.31
3	600685	中船防务	1,974,717.00	6.12
4	603979	金诚信	1,939,295.00	6.01
5	603699	纽威股份	1,802,830.00	5.59
6	002738	中矿资源	1,795,704.00	5.57
7	002410	广联达	1,660,959.00	5.15
8	301536	星宸科技	1,659,626.00	5.15
9	600487	亨通光电	1,631,349.00	5.06
10	002414	高德红外	1,615,154.00	5.01
11	603444	吉比特	1,596,459.00	4.95
12	603225	新凤鸣	1,576,565.00	4.89
13	000933	神火股份	1,574,963.00	4.88
14	001389	广合科技	1,522,435.00	4.72
15	601168	西部矿业	1,437,401.00	4.46
16	002008	大族激光	1,434,067.00	4.45
17	603379	三美股份	1,432,689.00	4.44
18	603659	璞泰来	1,387,623.00	4.30
19	601108	财通证券	1,387,443.00	4.30
20	300604	长川科技	1,379,725.00	4.28
21	000426	兴业银锡	1,374,435.00	4.26
22	603160	汇顶科技	1,372,919.00	4.26
23	600549	厦门钨业	1,361,530.00	4.22
24	601865	福莱特	1,358,598.00	4.21

25	600062	华润双鹤	1,357,640.00	4.21
26	601231	环旭电子	1,355,467.00	4.20
27	603341	龙旗科技	1,350,672.00	4.19
28	600884	杉杉股份	1,333,762.00	4.14
29	600166	福田汽车	1,316,145.00	4.08
30	688213	思特威-W	1,311,763.82	4.07
31	600380	健康元	1,297,990.00	4.02
32	605358	立昂微	1,295,939.00	4.02
33	002281	光迅科技	1,293,527.99	4.01
34	600498	烽火通信	1,289,503.00	4.00
35	002841	视源股份	1,260,380.00	3.91
36	002624	完美世界	1,248,767.00	3.87
37	300136	信维通信	1,232,523.00	3.82
38	600141	兴发集团	1,201,354.00	3.72
39	300073	当升科技	1,192,789.00	3.70
40	600098	广州发展	1,181,137.00	3.66
41	600352	浙江龙盛	1,177,282.00	3.65
42	600312	平高电气	1,170,551.00	3.63
43	600885	宏发股份	1,170,260.00	3.63
44	603728	鸣志电器	1,155,578.00	3.58
45	601128	常熟银行	1,132,519.00	3.51
46	000050	深天马A	1,119,526.00	3.47
47	600998	九州通	1,104,941.00	3.43
48	000657	中钨高新	1,102,152.00	3.42
49	600038	中直股份	1,074,998.00	3.33
50	000960	锡业股份	1,060,899.00	3.29
51	002185	华天科技	1,056,063.00	3.27
52	600906	财达证券	1,055,039.00	3.27
53	300395	菲利华	1,054,688.00	3.27
54	300450	先导智能	1,040,404.00	3.23
55	300454	深信服	1,029,708.00	3.19

56	688469	芯联集成-U	1,013,638.39	3.14
57	601717	中创智领	1,013,317.00	3.14
58	002156	通富微电	1,010,617.00	3.13
59	001309	德明利	987,020.00	3.06
60	601965	中国汽研	985,556.00	3.06
61	002432	九安医疗	979,775.00	3.04
62	601139	深圳燃气	979,065.00	3.04
63	600497	驰宏锌锗	969,337.00	3.01
64	600369	西南证券	968,534.00	3.00
65	002025	航天电器	965,046.00	2.99
66	300919	中伟新材	963,324.00	2.99
67	603338	浙江鼎力	957,023.00	2.97
68	000709	河钢股份	947,949.00	2.94
69	601198	东兴证券	942,609.00	2.92
70	600100	同方股份	940,207.00	2.92
71	301308	江波龙	933,714.00	2.90
72	002138	顺络电子	928,382.00	2.88
73	601608	中信重工	917,938.00	2.85
74	601233	桐昆股份	897,687.00	2.78
75	600909	华安证券	892,972.00	2.77
76	603606	东方电缆	889,094.00	2.76
77	600801	华新建材	865,037.00	2.68
78	600582	天地科技	862,698.00	2.67
79	002595	豪迈科技	857,404.00	2.66
80	600511	国药股份	842,859.00	2.61
81	300567	精测电子	826,159.00	2.56
82	600348	华阳股份	823,481.00	2.55
83	600528	中铁工业	818,398.00	2.54
84	600499	科达制造	812,803.00	2.52
85	688002	睿创微纳	812,497.08	2.52
86	300735	光弘科技	808,646.00	2.51

87	002340	格林美	803,395.00	2.49
88	600131	国网信通	799,345.00	2.48
89	002056	横店东磁	796,068.00	2.47
90	600536	中国软件	795,608.00	2.47
91	000887	中鼎股份	792,404.00	2.46
92	002152	广电运通	787,317.00	2.44
93	603298	杭叉集团	786,051.00	2.44
94	688475	萤石网络	772,234.84	2.39
95	600157	永泰能源	767,052.00	2.38
96	300003	乐普医疗	755,691.00	2.34
97	603920	世运电路	749,363.00	2.32
98	688728	格科微	741,398.92	2.30
99	300207	欣旺达	737,256.00	2.29
100	002128	电投能源	719,530.00	2.23
101	600298	安琪酵母	708,865.00	2.20
102	600143	金发科技	695,532.00	2.16
103	688387	信科移动-U	692,965.31	2.15
104	300548	长芯博创	689,946.00	2.14
105	300496	中科创达	688,743.00	2.14
106	688525	佰维存储	681,636.49	2.11
107	601399	国机重装	674,408.00	2.09
108	601106	中国一重	671,123.00	2.08
109	002273	水晶光电	670,716.00	2.08
110	601958	金钼股份	669,648.00	2.08
111	601665	齐鲁银行	664,303.00	2.06
112	002851	麦格米特	661,700.00	2.05
113	600739	辽宁成大	655,956.00	2.03
114	002850	科达利	652,703.00	2.02
115	603707	健友股份	651,739.00	2.02
116	601991	大唐发电	648,857.00	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	300857	协创数据	2,711,845.00	8.41
2	600487	亨通光电	2,327,538.00	7.22
3	300373	扬杰科技	2,157,760.00	6.69
4	002008	大族激光	2,073,256.00	6.43
5	600498	烽火通信	1,991,972.00	6.18
6	601168	西部矿业	1,892,693.00	5.87
7	002156	通富微电	1,859,856.00	5.77
8	000426	兴业银锡	1,828,890.00	5.67
9	600685	中船防务	1,796,885.00	5.57
10	600549	厦门钨业	1,788,368.00	5.55
11	603699	纽威股份	1,737,749.00	5.39
12	002414	高德红外	1,731,235.00	5.37
13	603341	龙旗科技	1,729,003.00	5.36
14	002410	广联达	1,632,411.00	5.06
15	300604	长川科技	1,608,729.00	4.99
16	002738	中矿资源	1,582,516.00	4.91
17	001389	广合科技	1,564,534.00	4.85
18	601865	福莱特	1,547,853.00	4.80
19	000933	神火股份	1,521,026.00	4.72
20	002281	光迅科技	1,474,257.00	4.57
21	600038	中直股份	1,467,220.00	4.55
22	603379	三美股份	1,461,698.00	4.53
23	300136	信维通信	1,437,171.00	4.46
24	300454	深信服	1,428,012.00	4.43
25	603659	璞泰来	1,424,401.00	4.42
26	300073	当升科技	1,423,483.00	4.41

27	601231	环旭电子	1,367,704.00	4.24
28	301536	星宸科技	1,363,470.00	4.23
29	600884	杉杉股份	1,358,231.00	4.21
30	600380	健康元	1,323,778.00	4.10
31	603444	吉比特	1,312,419.00	4.07
32	000050	深天马A	1,310,709.00	4.06
33	301308	江波龙	1,292,940.00	4.01
34	600909	华安证券	1,289,801.00	4.00
35	600166	福田汽车	1,237,894.00	3.84
36	600141	兴发集团	1,207,820.00	3.75
37	600062	华润双鹤	1,190,367.00	3.69
38	600131	国网信通	1,174,174.00	3.64
39	600096	云天化	1,151,411.00	3.57
40	603225	新凤鸣	1,147,604.99	3.56
41	600098	广州发展	1,140,207.00	3.54
42	600312	平高电气	1,137,287.00	3.53
43	000657	中钨高新	1,133,027.00	3.51
44	601717	中创智领	1,120,969.00	3.48
45	300450	先导智能	1,120,645.00	3.47
46	601108	财通证券	1,115,846.00	3.46
47	688213	思特威-W	1,111,657.66	3.45
48	600998	九州通	1,101,524.15	3.42
49	002185	华天科技	1,090,300.00	3.38
50	002624	完美世界	1,080,970.00	3.35
51	002841	视源股份	1,069,003.00	3.31
52	603979	金诚信	1,054,284.00	3.27
53	002138	顺络电子	1,041,185.00	3.23
54	002056	横店东磁	1,038,421.00	3.22
55	600511	国药股份	1,021,510.00	3.17
56	601128	常熟银行	1,009,158.00	3.13
57	603160	汇顶科技	989,326.00	3.07

58	000887	中鼎股份	985,586.00	3.06
59	300395	菲利华	980,950.00	3.04
60	601608	中信重工	974,263.00	3.02
61	600906	财达证券	968,687.00	3.00
62	600582	天地科技	954,789.00	2.96
63	600352	浙江龙盛	942,899.00	2.92
64	300567	精测电子	937,842.00	2.91
65	600885	宏发股份	937,648.00	2.91
66	600499	科达制造	932,174.00	2.89
67	000960	锡业股份	928,718.00	2.88
68	600528	中铁工业	928,030.00	2.88
69	601198	东兴证券	909,579.00	2.82
70	601965	中国汽研	893,694.00	2.77
71	603606	东方电缆	892,227.00	2.77
72	002595	豪迈科技	886,906.00	2.75
73	600739	辽宁成大	884,832.00	2.74
74	300496	中科创达	884,126.00	2.74
75	002335	科华数据	869,921.00	2.70
76	002436	兴森科技	857,916.00	2.66
77	600988	赤峰黄金	854,353.00	2.65
78	688469	芯联集成-U	842,726.55	2.61
79	601918	新集能源	834,336.00	2.59
80	603728	鸣志电器	834,023.00	2.59
81	688525	佰维存储	822,737.00	2.55
82	300207	欣旺达	815,088.00	2.53
83	600348	华阳股份	811,698.00	2.52
84	601233	桐昆股份	805,880.00	2.50
85	600578	京能电力	794,119.00	2.46
86	300146	汤臣倍健	790,406.00	2.45
87	000709	河钢股份	786,987.00	2.44
88	601665	齐鲁银行	786,676.00	2.44

89	601991	大唐发电	778,558.00	2.41
90	002025	航天电器	773,057.00	2.40
91	300735	光弘科技	766,524.00	2.38
92	601958	金钼股份	753,031.00	2.33
93	002340	格林美	749,903.00	2.33
94	688475	萤石网络	738,137.59	2.29
95	300003	乐普医疗	737,581.00	2.29
96	688002	睿创微纳	734,710.32	2.28
97	002202	金风科技	728,744.00	2.26
98	603707	健友股份	716,055.00	2.22
99	002128	电投能源	714,177.00	2.21
100	600536	中国软件	709,732.00	2.20
101	603049	中策橡胶	702,538.00	2.18
102	600369	西南证券	684,369.00	2.12
103	601577	长沙银行	680,216.29	2.11
104	688728	格科微	660,156.27	2.05
105	601106	中国一重	655,971.00	2.03
106	300285	国瓷材料	651,388.00	2.02

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	244,602,782.56
卖出股票收入（成交）总额	236,898,561.73

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)	629.20	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	629.20	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	123272	中汽转债	4	629.20	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约定的备选股票库。

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	176,400.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	176,400.73

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 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
中加 中证5 00指 数增 强A	721	19,827.07	0.00	0.00%	14,295,318.03	100.00%
中加 中证5 00指 数增 强C	1,219	15,021.33	0.00	0.00%	18,311,006.22	100.00%
合计	1,940	16,807.38	0.00	0.00%	32,606,324.25	100.00%

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	221,345.25	1.55%
	中加中证500指数 增强C	741,587.71	4.05%
	合计	962,932.96	2.95%

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	10~50
	中加中证500指数	-

本基金基金经理持有本开放式基金	增强C	
	合计	10~50
	中加中证500指数增强A	0~10
	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	8,576,460.06	17,212,573.56
本报告期基金总申购份额	15,138,931.38	24,912,883.06
减：本报告期基金总赎回份额	9,420,073.41	23,814,450.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	14,295,318.03	18,311,006.22

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：无。

基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况：自2026年1月起，中信建投证券股份有限公司托管部行政负责人由朱志明变更为孙祥磊。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	中加基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026年06月30日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控等
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视监管检查指出的问题，已及时通过完善制度、优化流程和系统功能等措施完成整改。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
中信建投证券	2	481,501,344.29	100.00%	97,033.04	100.00%	-

注：1.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：研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，研究报告分析严谨，观点独立、客观；在符合相关法规及执业规范的前提下，能根据公司的特定要求提供专题研究报告；具备较强的服务意识，能主动为公司投资组合提供及时的市场信息及各种路演、公司联合调研、券商会议的信息和参加机会等；
- （4）交易能力：证券交易的交易委托和成交回报的及时性和有效性。

2.券商及交易单元的选择流程如下：

- （1）权益投资部根据日常券商研究服务情况提议开立（含首次开立和新增开立）或关闭相关席位，挑选时应考虑在证券交易所都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；
- （2）总经理办公会负责审批、确定券商席位的首次开立事宜，投资决策委员会负责审批券商除首次开立以外新增及关闭席位事宜；
- （3）券商名单及相应的席位租用安排确定后，权益投资部负责协调办理咨询服务协议或研究服务协议签署等相关事宜，集中交易部负责协调办理正式租用席位协议签署等相关事宜。

10.7.2 基金租用或者通过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

				比例				
中信建投证 券	-	-	9,830,000.0 0	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2025年第4季度 报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-20
2	中加中证500指数增强型证 券投资基金招募说明书（更 新）	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-24
3	中加中证500指数增强型证 券投资基金（A类份额）产品 资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-24
4	中加中证500指数增强型证 券投资基金（C类份额）产品 资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-24
5	中加中证500指数增强型证 券投资基金2025年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-27
6	中加中证500指数增强型证 券投资基金2026年第1季度 报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-04-21

§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

本报告期内不存在单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

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
二〇二六年八月二十八日