

中加中证 500 指数增强型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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:2021 年 08 月 27 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2021年8月26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2021年1月1日起至2021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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
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	48
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66
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	66
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	66
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	66
§8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68

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.....	69
§9 开放式基金份额变动.....	69
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
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.....	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
§12 备查文件目录.....	73
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	74
12.3 查阅方式.....	74

§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	51,378,884.99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	10,972,569.74份	40,406,315.25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
	联系电话	400-00-95526
	电子邮箱	service@bobbns.com
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	夏英	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、基金托管人处

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 (2021年01月01日-2021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	3,959,308.70	5,824,084.83
本期利润	4,196,499.18	6,099,514.78
加权平均基金份额本期利润	0.2173	0.1514
本期加权平均净值利润率	21.10%	14.60%
本期基金份额净值增长率	13.35%	13.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	1,247,705.00	4,476,377.05
期末可供分配基金份额利润	0.1137	0.1108
期末基金资产净值	12,220,274.74	44,882,692.30
期末基金份额净值	1.1137	1.1108
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	11.37%	11.08%

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 ④	①-③	②-④
过去一个月	1.86%	0.68%	1.12%	0.69%	0.74%	-0.01%
过去三个月	9.66%	0.70%	8.41%	0.65%	1.25%	0.05%
过去六个月	13.35%	0.94%	6.61%	0.94%	6.74%	0.00%
自基金合同 生效起至今	11.37%	0.88%	8.75%	0.99%	2.62%	-0.11%

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	1.83%	0.68%	1.12%	0.69%	0.71%	-0.01%
过去三个月	9.58%	0.70%	8.41%	0.65%	1.17%	0.05%
过去六个月	13.17%	0.94%	6.61%	0.94%	6.56%	0.00%
自基金合同 生效起至今	11.08%	0.88%	8.75%	0.99%	2.33%	-0.11%

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-2021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-2021年06月30日)



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

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

§4 管理人报告

4.1 基金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，是第三批银行系试点中首家获批的基金公司，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%、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五十七只基金，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、中加丰泽纯债债券型证券投资基金、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、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、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、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金、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、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）、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)、中加科享混合型证券投资基金(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)。

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

1、任职日期说明：基金经理的任职日期以本基金基金合同生效公告为准。

2、离任日期说明：无。

3、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，国内A股市场波动较大，结构性分化非常明显。春节前经济数据向好，A股市场涨势如虹，春节后，流动性收紧的恐慌引发了A股出现大幅杀跌，进入二季度，风险释放后，A股市场开始震荡上行。从宽基指数的表现看，创业板指数上半年上涨 17.2%，而上证50指数则下跌3.9%。从行业指数看，电气设备、钢铁和化工涨幅靠前，上半年涨幅超过20%，而家用电器、非银金融和国防军工跌幅居前，上半年跌幅超过10%。

今年上半年，中证500指数体现出能涨抗跌的特征。由于指数估值处于历史底部区域，具备较强的安全边际，在一季度的市场下跌中跌幅较小，体现出较强的抗跌性。二季度以来，中证500指数呈现了单边上行的走势，指数涨幅也明显高于沪深300、上证50等指数。

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。今年上半年，量化模型表现较为稳定，基金在严格控制跟踪误差的基础上，不仅战胜了业绩基准指数，也控制住了风险，净值的最大回撤幅度明显小于标的指数。

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1.1137元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为13.35%，同期业绩比较基准收益率为6.61%；截至报告期末中加中证500指数增强C基金份额净值为1.1108元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为13.17%，同期业绩比较基准收益率为6.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受益于出口增长的拉动，今年上半年经济恢复持续向好。随着欧美疫苗接种率的上升和生产生活的逐步恢复，欧美对中国出口产品的需求依赖也会逐渐减弱，下半年出口对国内经济增长的贡献将回落，中国经济复苏的步伐可能会边际放缓。从央行的货币政策来看，7月份央行全面降准，超出市场预期，也说明下半年经济复苏的形势将较为严峻，而市场流动性会继续保持合理宽裕。通过精选个股获得的alpha收益未来会成为产品的收益主要来源。

在投资管理上，我们会坚持采用量化策略进行指数增强和风险管理，力争通过获取持续稳定的超额收益来平抑市场波动的影响，增加投资收益的确定性。

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

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、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基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、本基金每份基金份额享有同等分配权；

4、基金可供分配利润为正的情况下，方可进行收益分配；

5、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；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7、自2021年1月1日至2021年6月30日止，本基金未进行利润分配。

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2021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 中期财务会计报告(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：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,191,704.00	10,442,520.60
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	53,927,155.57	161,723,024.30
其中：股票投资		53,927,155.57	161,723,024.30
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	500,000.00	900,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	659.00	1,616.21
应收股利		-	-
应收申购款		330,952.76	1,128.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		57,950,471.33	173,068,289.81
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2021年06月30日	2020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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		591,835.33	1,856,863.70
应付管理人报酬		36,011.08	119,512.70
应付托管费		6,752.10	22,408.63
应付销售服务费		10,520.37	22,362.49
应付交易费用		-	-
应交税费		-	0.25
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	202,385.41	101,877.53
负债合计		847,504.29	2,123,025.30
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.8	51,378,884.99	174,075,384.28
未分配利润	6.4.7.9	5,724,082.05	-3,130,119.77
所有者权益合计		57,102,967.04	170,945,264.51
负债和所有者权益总计		57,950,471.33	173,068,289.81

注：报告截止日2021年6月30日，A类基金净值人民币1.1137元，基金份额总额10,972,569.74份，C类基金净值人民币1.1108元，基金份额总额40,406,315.25份，总份额合计51,378,884.99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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年0 6月30日
一、收入		11,717,788.77
1.利息收入		36,727.64
其中：存款利息收入	6.4.7.10	13,783.19
债券利息收入		19.13
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		22,925.32
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,962,992.59
其中：股票投资收益	6.4.7.11	10,358,779.38
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	24,315.49
资产支持证券投资收益	6.4.7.12.4	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	579,897.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	512,620.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	205,448.11
减：二、费用		1,421,774.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	248,155.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	46,529.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	62,993.61
4. 交易费用	6.4.7.17	864,917.56
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.05

7. 其他费用	6.4.7.18	199,178.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,296,013.96
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,296,013.96

6.3 所有者权益（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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	174,075,384.28	-3,130,119.77	170,945,264.51
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	10,296,013.96	10,296,013.96
三、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)	-122,696,499.29	-1,441,812.14	-124,138,311.43
其中：1.基金申购款	33,993,872.89	1,585,982.47	35,579,855.36
2.基金赎回款	-156,690,372.18	-3,027,794.61	-159,718,166.79
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	51,378,884.99	5,724,082.05	57,102,967.04

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：

夏英

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,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

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本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2021年6月30日的财务状况、2021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2021年1月1日至2021年6月30日止。

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

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

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。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

(1) 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计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

(2) 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

(3) 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

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

金融资产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：

(1) 所转移金融资产的账面价值

(2) 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

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，参考类似投资品种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：

- (1) 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；
- (2) 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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

股票投资收益、债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成本的差额确认。

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(如适用)后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的收入差异较小的可采用合同利率。

公允价值变动损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。

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。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的支出差异较小的可采用合同利率。

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 外币交易

无。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中债金融估值中心有限公司独立提供。

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2008]132号文《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、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征收方式调整工作的通知》、[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》、[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《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]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产

进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务规定，本基金适用的主要税项列示如下：

1. 印花税

(1)自2008年9月19日起，证券（股票）交易印花税征收方式调整为单边征税，即对出让方按1‰的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

(2)股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东(本基金)支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 企业所得税

(1)自2014年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

(2)对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东(本基金)支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东(本基金)应缴纳的企业所得税。

3. 个人所得税

(1)自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

(2)股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东(本基金)支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东(本基金)应缴纳的个人所得税。

(3)自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。对证券投资基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利，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继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4. 增值税

(1)经国务院批准，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，金融业全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。本基金适用不征增值税项目：存款利息收入。本基金适用免征增值税项目：①国债、地方政府债利息收入；②证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的金融商品转让收入；③金融同业往来利息收入。

(2)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

(3)自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳

税额的除外；管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(4)增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按5%、3%和2%的比例缴纳。

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	
	2021年06月30日	
活期存款	3,167,838.49	
定期存款	-	
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	23,865.51	
合计	3,191,704.00	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	52,975,899.34	53,927,155.57	951,256.23
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	52,975,899.34	53,927,155.57	951,256.23

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 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金在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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	623.96
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	35.04
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	659.00

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产（其他应收款和待摊费用）。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	266.46
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	39,671.58
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	102,940.00
合计	202,385.41

注：预提费用包括预提信息披露费、预提审计费和预提账户维护费。

6.4.7.8 实收基金

6.4.7.8.1 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 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	88,955,946.18	88,955,946.18
本期申购	4,730,139.56	4,730,139.56
本期赎回(以“-”号填列)	-82,713,516.00	-82,713,516.00
本期末	10,972,569.74	10,972,569.74

6.4.7.8.2 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 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	85,119,438.10	85,119,438.10
本期申购	29,263,733.33	29,263,733.33
本期赎回(以“-”号填列)	-73,976,856.18	-73,976,856.18
本期末	40,406,315.25	40,406,315.25

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.9 未分配利润

6.4.7.9.1 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	-2,009,006.91	454,302.26	-1,554,704.65
本期利润	3,959,308.70	237,190.48	4,196,499.18
本期基金份额交易产生的变动数	-575,007.52	-819,082.01	-1,394,089.53
其中：基金申购款	415,011.09	-72,551.79	342,459.30
基金赎回款	-990,018.61	-746,530.22	-1,736,548.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,375,294.27	-127,589.27	1,247,705.00

6.4.7.9.2 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	-2,008,532.84	433,117.72	-1,575,415.12
本期利润	5,824,084.83	275,429.95	6,099,514.78

本期基金份额交易产生的变动数	1,130,994.00	-1,178,716.61	-47,722.61
其中：基金申购款	1,644,228.52	-400,705.35	1,243,523.17
基金赎回款	-513,234.52	-778,011.26	-1,291,245.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,946,545.99	-470,168.94	4,476,377.05

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	12,318.80
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,003.23
结算备付金利息收入	-
其他	461.16
合计	13,783.19

注：其他存款利息收入为券商保证金利息收入，其他为申购款利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	421,687,652.25
减：卖出股票成本总额	411,328,872.87
买卖股票差价收入	10,358,779.38

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
----	-------------------------------

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	24,315.49
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	24,315.49

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	125,335.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	101,000.00
减：应收利息总额	19.71
买卖债券差价收入	24,315.49

注：本基金本报告期内无债转股业务。

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券投资赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	579,897.72
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	579,897.72

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1.交易性金融资产	512,620.43
——股票投资	512,620.43
——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	512,620.43

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	205,448.11
合计	205,448.11

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	864,917.56
银行间市场交易费用	-
合计	864,917.56

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
合计	199,178.95

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 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
中信建投证券	723,635,865.41	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期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 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
中信建投证券	226,335.90	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 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中信建投证券	207,500,000.00	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 2021年01月01日至2021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	377,471.81	10 0.0 0%	-	-

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、经手费和深圳过户费的净额列示。

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 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	248,155.45
其中：支付销售机构的客户维护费	62,927.14

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，逐日累计至每月月底，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
	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	46,529.19

注：支付基金托管人中信建投证券的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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		
	2021年01月01日至2021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	27,131.81	27,131.81
北京银行股份有限公司	0.00	2,321.36	2,321.36
中信建投证券股份有限公司	0.00	31,732.41	31,732.41
合计	0.00	61,185.58	61,185.58

注：本基金仅针对C类基金份额收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日该类基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C类基金日基金销售服务费=C类基金前一日基金资产净值×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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中信建投证券股份有限公司	3,167,838.49	12,318.80

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021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	601963	重庆银行	网下发行	7,472	80,921.76
中信建投	688689	银河微电	网下发行	1,857	26,016.57

证券 股份 有限 公司					
中信 建投 证券 股份 有限 公司	003035	南网能源	网下发行	11,046	15,464.40
中信 建投 证券 股份 有限 公司	605305	中际联合	网下发行	294	11,154.36
中信 建投 证券 股份 有限 公司	603511	爱慕股份	网下发行	454	9,529.46
中信 建投 证券 股份 有限 公司	601528	瑞丰银行	网下发行	1,680	13,641.60
中信 建投 证券 股份 有限 公司	601665	齐鲁银行	网下发行	5,201	27,877.36

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金在本报告期末进行过利润分配。

6.4.12 期末（2021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：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688686	奥普特	2020-12-24	2021-07-01	首次公开发行带锁定期	78.49	451.00	699	54,864.51	315,249.00	-
688819	天能股份	2021-01-07	2021-07-19	首次公开发行带锁定期	41.79	43.69	1,844	77,060.76	80,564.36	-
688689	银河微电	2021-01-15	2021-07-27	首次公开发行带锁定期	14.01	35.62	1,857	26,016.57	66,146.34	-
688317	之江生物	2021-01-08	2021-07-19	首次公开发行带锁定期	43.22	63.82	1,025	44,300.50	65,415.50	-

605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	327	10,320.12	10,320.12	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	首次公开发行带锁定期	12.25	53.71	134	1,641.50	7,197.14	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	首次公开发行带锁定期	4.31	13.11	530	2,284.30	6,948.30	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	首次公开发行带锁定期	12.76	43.38	154	1,965.04	6,680.52	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	首次公开发行带锁定期	3.37	10.44	636	2,143.32	6,639.84	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	首次公开发行带锁定期	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	首次公开发行带锁定期	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
3009	三友	2021-	2021-	首次	24.69	31.71	168	4,14	5,32	-

32	联众	01-15	07-22	公开发 行带锁 定期				7.92	7.28	
----	----	-------	-------	------------------	--	--	--	------	------	--

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

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
600460	士兰微	2021-06-30	重大资产重组	56.35	-	-	1,500	65,747.65	84,525.00	-
600811	东方集团	2021-06-30	重大资产重组	3.05	-	-	76,600	251,863.38	233,630.00	-

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2021年6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2021年6月30日止，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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在控制风险并保持资产流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

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。

本基金的银行存款存放在信用良好的金融机构，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金投资于信用类产品以及投资于资产支持证券的信用级别评级应为BBB以上（含BBB），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。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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

无。

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所持金融工具变现的难易程度。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。

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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金所持大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，除前文披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。

于2021年6月30日，本基金所承担的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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

报告期内，本基金的流动性风险管理，按照《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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年06 月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,191,704.00	-	-	-	3,191,704.00
交易性金融资产	-	-	-	53,927,155.57	53,927,155.57
买入返售金融资产	500,000.00	-	-	-	500,000.00
应收利息	-	-	-	659.00	659.00
应收申购款	-	-	-	330,952.76	330,952.76
资产总计	3,691,704.00	-	-	54,258,767.33	57,950,471.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	591,835.33	591,835.33
应付管理人报酬	-	-	-	36,011.08	36,011.08
应付托管费	-	-	-	6,752.10	6,752.10
应付销售服务费	-	-	-	10,520.37	10,520.37
其他应付款	-	-	-	102,940.00	102,940.00
预提费用	-	-	-	99,178.95	99,178.95
应付赎回费	-	-	-	266.46	266.46
负债总计	-	-	-	847,504.29	847,504.29

利率敏感 度缺口	3,691,704.00	-	-	53,411,263.04	57,102,967.04
上年度末 2020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	10,442,520.60	-	-	-	10,442,520.60
交易性金 融资产	-	-	-	161,723,024.30	161,723,024.30
买入返售 金融资产	900,000.00	-	-	-	900,000.00
应收利息	-	-	-	1,616.21	1,616.21
应收申购 款	-	-	-	1,128.70	1,128.70
资产总计	11,342,520.60	-	-	161,725,769.21	173,068,289.81
负债					
应付赎回 款	-	-	-	1,856,863.70	1,856,863.70
应付管理 人报酬	-	-	-	119,512.70	119,512.70
应付托管 费	-	-	-	22,408.63	22,408.63
应付销售 服务费	-	-	-	22,362.49	22,362.49
应交税费	-	-	-	0.25	0.25
其他应付 款	-	-	-	50,000.00	50,000.00
预提费用	-	-	-	50,000.00	50,000.00
应付赎回 费	-	-	-	1,877.53	1,877.53
负债总计	-	-	-	2,123,025.30	2,123,025.30
利率敏感 度缺口	11,342,520.60	-	-	159,602,743.91	170,945,264.51

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年6月30日，本基金未持有交易性债券（2020年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020年12月31日：同）。

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金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 2021年06月30日		上年度末 2020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	53,927,155.57	94.44	161,723,024.30	94.61
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	53,927,155.57	94.44	161,723,024.30	94.61

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2021年6月30日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)以公允价值计量的资产和负债

下述列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。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。

于2021年6月30日，本基金持有的持续的公允价值计量资产中属于第一层次的股票投资余额为53,026,572.82元，属于第二层次的股票投资余额为572,107.63元，属于第三层次的股票投资余额为328,475.12元。

于2021年6月30日，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的三个层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(a)第二层次及第三层次的公允价值计量

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。

(b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2)其他金融工具的公允价值(期末非以公允价值计量的项目)

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

§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	53,927,155.57	93.06
	其中：股票	53,927,155.57	93.06

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	500,000.00	0.86
	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	3,191,704.00	5.51
8	其他各项资产	331,611.76	0.57
9	合计	57,950,471.33	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	-	-
B	采矿业	1,221,855.33	2.14
C	制造业	30,358,471.10	53.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,314,930.00	2.30
E	建筑业	740,202.00	1.30
F	批发和零售业	1,665,218.00	2.92
G	交通运输、仓储和邮政业	1,118,067.92	1.96
H	住宿和餐饮业	212,266.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,905,405.75	5.09
J	金融业	2,467,176.00	4.32
K	房地产业	1,508,473.00	2.64
L	租赁和商务服务业	56,644.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	24,850.00	0.04

N	水利、环境和公共设施管理业	396,424.00	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	31,214.80	0.05
Q	卫生和社会工作	153,200.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	1,227,607.38	2.15
S	综合	149,814.00	0.26
	合计	45,551,819.28	79.77

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	19,178.40	0.03
B	采矿业	203,115.00	0.36
C	制造业	5,692,494.91	9.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,126.52	0.12
E	建筑业	33,499.12	0.06
F	批发和零售业	174,762.14	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	298,369.00	0.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	409,444.95	0.72
J	金融业	624,136.60	1.09
K	房地产业	336,547.00	0.59
L	租赁和商务服务业	206,798.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	41,444.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	130,262.65	0.23
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	115,170.00	0.20
S	综合	18,988.00	0.03
	合计	8,375,336.29	14.67

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	603515	欧普照明	79,402	2,038,249.34	3.57
2	300271	华宇软件	83,352	1,604,526.00	2.81
3	000807	云铝股份	107,700	1,281,630.00	2.24
4	600038	中直股份	24,100	1,271,034.00	2.23
5	600803	新奥股份	72,800	1,201,928.00	2.10
6	300463	迈克生物	28,300	1,191,147.00	2.09
7	002557	洽洽食品	26,665	1,149,261.50	2.01
8	600885	宏发股份	16,700	1,047,090.00	1.83
9	000581	威孚高科	45,700	951,931.00	1.67
10	600563	法拉电子	5,900	934,324.00	1.64
11	601098	中南传媒	105,352	929,204.64	1.63
12	603638	艾迪精密	21,560	924,277.20	1.62
13	002648	卫星石化	22,820	894,315.80	1.57
14	601003	柳钢股份	147,155	868,214.50	1.52
15	600201	生物股份	48,500	846,325.00	1.48
16	603225	新凤鸣	41,100	834,330.00	1.46
17	603260	合盛硅业	10,600	815,246.00	1.43

18	002080	中材科技	29,634	775,521.78	1.36
19	600729	重庆百货	26,200	719,190.00	1.26
20	600350	山东高速	116,600	717,090.00	1.26
21	001914	招商积余	38,800	666,584.00	1.17
22	002423	中粮资本	71,200	644,360.00	1.13
23	601636	旗滨集团	34,000	631,040.00	1.11
24	601869	长飞光纤	22,400	545,664.00	0.96
25	600329	中新药业	19,200	539,328.00	0.94
26	000830	鲁西化工	27,100	507,583.00	0.89
27	002572	索菲亚	20,500	496,100.00	0.87
28	600739	辽宁成大	23,500	489,035.00	0.86
29	600039	四川路桥	74,300	465,861.00	0.82
30	002028	思源电气	14,600	449,534.00	0.79
31	603355	莱克电气	7,000	435,610.00	0.76
32	603707	健友股份	9,900	413,325.00	0.72
33	601233	桐昆股份	16,900	407,121.00	0.71
34	600643	爱建集团	55,700	388,786.00	0.68
35	601168	西部矿业	32,400	386,532.00	0.68
36	600062	华润双鹤	31,718	377,761.38	0.66
37	002439	启明星辰	12,500	362,625.00	0.64
38	002985	北摩高科	3,500	341,250.00	0.60
39	603786	科博达	4,500	339,750.00	0.59
40	600390	五矿资本	54,800	327,704.00	0.57
41	601577	长沙银行	34,900	312,006.00	0.55
42	601512	中新集团	29,800	296,808.00	0.52
43	002281	光迅科技	12,000	295,200.00	0.52
44	600985	淮北矿业	22,273	271,953.33	0.48
45	603444	吉比特	500	265,000.00	0.46
46	002128	露天煤业	25,300	263,373.00	0.46
47	603605	珀莱雅	1,300	255,723.00	0.45
48	002925	盈趣科技	6,500	252,915.00	0.44

49	601717	郑煤机	20,800	241,904.00	0.42
50	002595	豪迈科技	8,900	237,630.00	0.42
51	000898	鞍钢股份	53,300	237,185.00	0.42
52	600811	东方集团	76,600	233,630.00	0.41
53	600808	马钢股份	53,800	230,802.00	0.40
54	002266	浙富控股	43,300	216,067.00	0.38
55	000012	南玻 A	20,400	208,896.00	0.37
56	600266	城建发展	43,900	208,086.00	0.36
57	601128	常熟银行	33,400	207,080.00	0.36
58	603568	伟明环保	7,900	180,357.00	0.32
59	002203	海亮股份	16,800	178,752.00	0.31
60	600970	中材国际	18,900	173,313.00	0.30
61	600380	健康元	12,500	171,625.00	0.30
62	603156	养元饮品	5,900	168,622.00	0.30
63	600801	华新水泥	9,500	166,915.00	0.29
64	000046	泛海控股	71,600	164,680.00	0.29
65	000513	丽珠集团	3,200	160,064.00	0.28
66	300244	迪安诊断	4,000	153,200.00	0.27
67	600377	宁沪高速	15,600	152,256.00	0.27
68	300146	汤臣倍健	4,600	151,340.00	0.27
69	000009	中国宝安	8,200	149,814.00	0.26
70	601689	拓普集团	3,800	142,234.00	0.25
71	000671	阳光城	27,200	141,440.00	0.25
72	002653	海思科	6,550	140,956.00	0.25
73	600373	中文传媒	14,109	139,114.74	0.24
74	600859	王府井	4,700	135,736.00	0.24
75	603486	科沃斯	590	134,567.20	0.24
76	300253	卫宁健康	8,200	133,414.00	0.23
77	002408	齐翔腾达	10,700	132,894.00	0.23
78	002212	天融信	6,600	130,482.00	0.23
79	300037	新宙邦	1,300	130,130.00	0.23

80	603056	德邦股份	11,100	121,989.00	0.21
81	600580	卧龙电驱	8,900	118,370.00	0.21
82	300618	寒锐钴业	1,500	118,260.00	0.21
83	002563	森马服饰	9,800	117,110.00	0.21
84	002690	美亚光电	2,100	117,096.00	0.21
85	603858	步长制药	5,100	114,699.00	0.20
86	600446	金证股份	7,800	112,632.00	0.20
87	600258	首旅酒店	4,600	109,756.00	0.19
88	002867	周大生	5,500	108,735.00	0.19
89	002353	杰瑞股份	2,300	102,810.00	0.18
90	600754	锦江酒店	1,800	102,510.00	0.18
91	600967	内蒙一机	10,100	102,212.00	0.18
92	603589	口子窖	1,500	101,535.00	0.18
93	300316	晶盛机电	2,000	101,000.00	0.18
94	600486	扬农化工	900	100,593.00	0.18
95	002268	卫士通	5,000	97,400.00	0.17
96	000988	华工科技	4,100	96,432.00	0.17
97	600315	上海家化	1,600	96,224.00	0.17
98	600195	中牧股份	8,000	95,680.00	0.17
99	000630	铜陵有色	35,000	95,200.00	0.17
100	002078	太阳纸业	7,100	94,785.00	0.17
101	601699	潞安环能	7,800	92,118.00	0.16
102	000723	美锦能源	12,100	91,476.00	0.16
103	600779	水井坊	718	90,719.30	0.16
104	600875	东方电气	8,200	89,954.00	0.16
105	300357	我武生物	1,400	89,768.00	0.16
106	002946	新乳业	5,700	86,355.00	0.15
107	000636	风华高科	2,800	84,616.00	0.15
108	600460	士兰微	1,500	84,525.00	0.15
109	603893	瑞芯微	600	83,676.00	0.15
110	300699	光威复材	1,100	83,545.00	0.15

111	601615	明阳智能	5,100	82,569.00	0.14
112	002958	青农商行	18,600	79,608.00	0.14
113	002532	天山铝业	9,400	78,866.00	0.14
114	002603	以岭药业	2,700	78,732.00	0.14
115	000039	中集集团	4,100	74,538.00	0.13
116	002048	宁波华翔	3,600	70,200.00	0.12
117	002440	闰土股份	7,700	68,145.00	0.12
118	688099	晶晨股份	600	67,320.00	0.12
119	000999	华润三九	2,500	66,875.00	0.12
120	601997	贵阳银行	9,300	66,588.00	0.12
121	300251	光线传媒	6,100	65,941.00	0.12
122	000062	深圳华强	3,800	64,258.00	0.11
123	600871	石化油服	32,500	64,025.00	0.11
124	603737	三棵树	360	63,360.00	0.11
125	600219	南山铝业	17,300	62,280.00	0.11
126	000400	许继电气	4,900	62,034.00	0.11
127	600398	海澜之家	8,500	61,540.00	0.11
128	002124	天邦股份	8,760	61,407.60	0.11
129	002156	通富微电	2,500	60,100.00	0.11
130	000488	晨鸣纸业	7,300	59,422.00	0.10
131	600208	新湖中宝	19,100	58,064.00	0.10
132	002511	中顺洁柔	2,100	57,855.00	0.10
133	600089	特变电工	4,500	57,825.00	0.10
134	002419	天虹股份	8,800	57,728.00	0.10
135	002396	星网锐捷	2,700	57,645.00	0.10
136	002013	中航机电	5,700	57,399.00	0.10
137	600271	航天信息	4,400	57,332.00	0.10
138	601139	深圳燃气	8,300	54,448.00	0.10
139	300285	国瓷材料	1,100	53,625.00	0.09
140	600497	驰宏锌锗	12,300	53,013.00	0.09
141	000050	深天马 A	3,700	52,466.00	0.09

142	002382	蓝帆医疗	2,500	52,125.00	0.09
143	600835	上海机电	3,200	52,000.00	0.09
144	002709	天赐材料	480	51,158.40	0.09
145	600637	东方明珠	6,200	50,778.00	0.09
146	600528	中铁工业	6,200	50,220.00	0.09
147	600516	方大炭素	6,700	49,848.00	0.09
148	000738	航发控制	2,300	47,909.00	0.08
149	600376	首开股份	8,400	47,040.00	0.08
150	002340	格林美	4,900	45,815.00	0.08
151	601068	中铝国际	12,800	44,160.00	0.08
152	002500	山西证券	6,500	43,615.00	0.08
153	601801	皖新传媒	9,200	43,424.00	0.08
154	600188	兖州煤业	2,800	43,008.00	0.08
155	600511	国药股份	1,300	42,978.00	0.08
156	603885	吉祥航空	2,800	42,728.00	0.07
157	603228	景旺电子	1,592	41,710.40	0.07
158	600498	烽火通信	2,200	40,986.00	0.07
159	600901	江苏租赁	7,800	40,560.00	0.07
160	600667	太极实业	4,300	39,130.00	0.07
161	300207	欣旺达	1,200	39,072.00	0.07
162	603883	老百姓	700	36,876.00	0.06
163	002110	三钢闽光	5,300	35,722.00	0.06
164	000778	新兴铸管	9,600	35,712.00	0.06
165	601928	凤凰传媒	5,000	35,700.00	0.06
166	002180	纳思达	1,100	35,420.00	0.06
167	000739	普洛药业	1,200	35,280.00	0.06
168	002185	华天科技	2,200	33,858.00	0.06
169	601456	国联证券	2,100	32,340.00	0.06
170	600737	中粮糖业	3,200	32,032.00	0.06
171	603377	东方时尚	2,920	31,214.80	0.05
172	601992	金隅集团	11,400	30,666.00	0.05

173	002081	金螳螂	3,800	30,096.00	0.05
174	002368	太极股份	1,500	30,090.00	0.05
175	600823	世茂股份	7,400	29,896.00	0.05
176	002030	达安基因	1,320	28,036.80	0.05
177	002056	横店东磁	2,100	27,300.00	0.05
178	600782	新钢股份	4,800	26,784.00	0.05
179	600170	上海建工	9,700	26,772.00	0.05
180	600153	建发股份	3,300	26,730.00	0.05
180	600056	中国医药	2,200	26,730.00	0.05
182	002002	鸿达兴业	6,700	26,331.00	0.05
183	300741	华宝股份	500	25,360.00	0.04
184	603868	飞科电器	600	25,236.00	0.04
185	600928	西安银行	5,400	25,164.00	0.04
186	003035	南网能源	2,500	24,850.00	0.04
187	600755	厦门国贸	3,000	24,630.00	0.04
188	002936	郑州银行	6,700	24,589.00	0.04
189	600064	南京高科	2,600	24,154.00	0.04
190	002948	青岛银行	4,800	23,856.00	0.04
191	002701	奥瑞金	4,500	23,130.00	0.04
192	000983	山西焦煤	2,700	22,437.00	0.04
193	002010	传化智联	2,900	22,359.00	0.04
194	600827	百联股份	1,100	22,165.00	0.04
195	600787	中储股份	4,100	21,853.00	0.04
196	600325	华发股份	3,200	21,568.00	0.04
197	600567	山鹰国际	6,100	21,045.00	0.04
198	300630	普利制药	400	20,960.00	0.04
199	600717	天津港	5,300	20,776.00	0.04
200	601598	中国外运	4,100	20,705.00	0.04
201	000598	兴蓉环境	3,900	20,319.00	0.04
202	000629	攀钢钒钛	8,800	20,152.00	0.04
203	600535	天士力	1,300	19,253.00	0.03

204	600867	通化东宝	1,600	19,104.00	0.03
205	600707	彩虹股份	2,000	18,820.00	0.03
206	600862	中航高科	600	18,468.00	0.03
207	600177	雅戈尔	2,800	18,452.00	0.03
208	000563	陕国投 A	5,700	18,354.00	0.03
209	601958	金钼股份	2,800	18,144.00	0.03
210	603719	良品铺子	400	18,000.00	0.03
211	600718	东软集团	1,800	17,604.00	0.03
212	600418	江淮汽车	1,400	17,402.00	0.03
213	601179	中国西电	4,200	17,304.00	0.03
214	603927	中科软	400	17,180.00	0.03
215	600507	方大特钢	2,500	16,950.00	0.03
216	600863	内蒙华电	7,000	16,310.00	0.03
217	600908	无锡银行	2,800	16,240.00	0.03
218	600998	九州通	1,000	15,370.00	0.03
219	600158	中体产业	1,300	14,833.00	0.03
220	000681	视觉中国	1,100	14,223.00	0.02
221	600415	小商品城	2,700	13,905.00	0.02
222	000027	深圳能源	1,500	13,755.00	0.02
223	002038	双鹭药业	1,300	13,689.00	0.02
224	600776	东方通信	1,100	13,640.00	0.02
225	600282	南钢股份	3,700	13,172.00	0.02
226	600409	三友化工	1,300	13,143.00	0.02
227	600388	龙净环保	1,500	12,780.00	0.02
228	002926	华西证券	1,300	12,519.00	0.02
229	002797	第一创业	1,700	12,138.00	0.02
230	300058	蓝色光标	2,000	12,100.00	0.02
231	000060	中金岭南	2,600	11,752.00	0.02
232	600556	天下秀	1,100	11,616.00	0.02
233	000028	国药一致	300	11,352.00	0.02
234	600839	四川长虹	3,800	11,058.00	0.02

235	000528	柳工	1,200	9,840.00	0.02
236	002839	张家港行	1,800	9,792.00	0.02
237	601333	广深铁路	4,600	9,752.00	0.02
238	002399	海普瑞	600	9,558.00	0.02
239	002745	木林森	700	9,380.00	0.02
240	600549	厦门钨业	400	8,332.00	0.01
241	000061	农产品	1,500	8,280.00	0.01
242	600517	国网英大	1,200	8,172.00	0.01
243	600917	重庆燃气	1,000	8,170.00	0.01
244	002705	新宝股份	300	7,875.00	0.01
245	002138	顺络电子	200	7,754.00	0.01
246	600699	均胜电子	300	7,656.00	0.01
247	300009	安科生物	500	7,450.00	0.01
248	001872	招商港口	401	6,784.92	0.01
249	300115	长盈精密	320	6,592.00	0.01
250	000559	万向钱潮	1,200	6,372.00	0.01
251	002831	裕同科技	200	5,938.00	0.01
252	600312	平高电气	1,000	5,840.00	0.01
253	603650	彤程新材	119	5,723.90	0.01
254	600155	华创阳安	500	5,350.00	0.01
255	600968	海油发展	1,900	4,921.00	0.01
256	688088	虹软科技	85	4,738.75	0.01
257	601228	广州港	1,300	4,134.00	0.01
258	002422	科伦药业	200	3,990.00	0.01
259	002966	苏州银行	500	3,675.00	0.01
260	603256	宏和科技	400	3,656.00	0.01
261	300088	长信科技	400	3,304.00	0.01
262	002152	广电运通	200	2,606.00	0.00
263	600256	广汇能源	700	2,331.00	0.00
264	000930	中粮科技	200	1,802.00	0.00
265	600022	山东钢铁	900	1,548.00	0.00

266	000501	鄂武商 A	100	1,170.00	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	688686	奥普特	699	315,249.00	0.55
2	603267	鸿远电子	2,400	307,008.00	0.54
3	603606	东方电缆	13,100	263,834.00	0.46
4	002920	德赛西威	2,300	253,184.00	0.44
5	601211	国泰君安	14,200	243,388.00	0.43
6	300782	卓胜微	360	193,500.00	0.34
7	603489	八方股份	800	189,104.00	0.33
8	300280	紫天科技	5,000	182,550.00	0.32
9	002064	华峰化学	12,600	178,920.00	0.31
10	603129	春风动力	1,400	173,712.00	0.30
11	000923	河钢资源	8,500	162,095.00	0.28
12	600522	中天科技	16,000	160,000.00	0.28
13	600309	万华化学	1,400	152,348.00	0.27
14	603337	杰克股份	5,500	147,015.00	0.26
15	000708	中信特钢	6,800	141,712.00	0.25
16	600298	安琪酵母	2,600	141,388.00	0.25
17	600132	重庆啤酒	700	138,565.00	0.24
18	603039	泛微网络	2,060	137,093.00	0.24
19	300726	宏达电子	1,900	133,931.00	0.23
20	300573	兴齐眼药	900	126,927.00	0.22
21	000048	京基智农	6,420	118,449.00	0.21
22	300677	英科医疗	900	112,320.00	0.20
23	603599	广信股份	3,700	111,296.00	0.19
24	002968	新大正	2,550	111,052.50	0.19

25	600966	博汇纸业	8,200	107,010.00	0.19
26	600596	新安股份	5,900	104,548.00	0.18
27	600565	迪马股份	37,700	95,758.00	0.17
28	002919	名臣健康	2,100	94,920.00	0.17
29	002913	奥士康	1,200	93,540.00	0.16
30	603010	万盛股份	4,140	86,815.80	0.15
31	002601	龙麟佰利	2,400	82,992.00	0.15
32	603466	风语筑	5,020	82,077.00	0.14
33	603678	火炬电子	1,200	81,000.00	0.14
34	688819	天能股份	1,844	80,564.36	0.14
35	300659	中孚信息	2,200	73,854.00	0.13
36	601901	方正证券	7,800	73,008.00	0.13
37	002876	三利谱	1,100	71,170.00	0.12
38	600475	华光环能	6,900	70,380.00	0.12
39	603229	奥翔药业	2,100	70,119.00	0.12
40	300747	锐科激光	600	68,436.00	0.12
41	600548	深高速	7,800	68,016.00	0.12
42	600452	涪陵电力	4,700	67,539.00	0.12
43	688689	银河微电	1,857	66,146.34	0.12
44	300226	上海钢联	1,100	65,505.00	0.11
45	688317	之江生物	1,025	65,415.50	0.11
46	601919	中远海控	2,100	64,134.00	0.11
47	601998	中信银行	11,400	58,140.00	0.10
48	600976	健民集团	1,000	58,000.00	0.10
49	000538	云南白药	500	57,860.00	0.10
50	600323	瀚蓝环境	2,500	54,475.00	0.10
51	002929	润建股份	2,100	53,802.00	0.09
52	300755	华致酒行	1,300	53,053.00	0.09
53	000001	平安银行	2,300	52,026.00	0.09
54	600606	绿地控股	9,300	50,685.00	0.09
55	002961	瑞达期货	2,300	49,036.00	0.09

56	300679	电连技术	1,700	48,994.00	0.09
57	688180	君实生物	600	48,726.00	0.09
58	000785	居然之家	7,600	46,132.00	0.08
59	000951	中国重汽	1,700	46,002.00	0.08
60	600809	山西汾酒	100	44,800.00	0.08
61	600368	五洲交通	12,200	42,212.00	0.07
62	300012	华测检测	1,300	41,444.00	0.07
63	000915	华特达因	1,500	40,095.00	0.07
64	600800	渤海化学	9,000	38,970.00	0.07
65	000885	城发环境	4,000	38,240.00	0.07
66	002466	天齐锂业	600	37,212.00	0.07
67	000049	德赛电池	810	37,179.00	0.07
68	002977	天箭科技	400	34,464.00	0.06
69	600926	杭州银行	2,300	33,925.00	0.06
70	601155	新城控股	800	33,280.00	0.06
71	300788	中信出版	900	33,093.00	0.06
72	300059	东方财富	1,000	32,790.00	0.06
73	600817	宏盛科技	2,400	32,616.00	0.06
74	603877	太平鸟	600	32,028.00	0.06
75	601107	四川成渝	10,300	31,518.00	0.06
76	000863	三湘印象	9,550	31,419.50	0.06
77	000100	TCL科技	3,900	29,835.00	0.05
78	000725	京东方 A	4,700	29,328.00	0.05
79	600012	皖通高速	4,500	29,070.00	0.05
80	601838	成都银行	2,200	27,808.00	0.05
81	000921	海信家电	1,900	27,303.00	0.05
82	300476	胜宏科技	1,200	26,220.00	0.05
83	601528	瑞丰银行	1,680	26,157.60	0.05
84	300454	深信服	100	25,948.00	0.05
85	601100	恒立液压	300	25,776.00	0.05
86	300661	圣邦股份	100	25,273.00	0.04

87	002918	蒙娜丽莎	800	25,112.00	0.04
88	600085	同仁堂	600	24,510.00	0.04
89	300662	科锐国际	400	24,248.00	0.04
90	300790	宇瞳光学	700	23,751.00	0.04
91	002142	宁波银行	600	23,382.00	0.04
92	000683	远兴能源	5,000	23,350.00	0.04
93	002262	恩华药业	1,500	23,025.00	0.04
94	002020	京新药业	2,700	22,950.00	0.04
95	688667	菱电电控	200	22,002.00	0.04
96	002636	金安国纪	1,300	21,086.00	0.04
97	300894	火星人	302	20,536.00	0.04
98	603896	寿仙谷	500	20,370.00	0.04
99	603567	珍宝岛	1,200	19,548.00	0.03
100	002032	苏泊尔	300	19,137.00	0.03
101	600603	广汇物流	4,700	18,988.00	0.03
102	300122	智飞生物	100	18,673.00	0.03
103	600690	海尔智家	700	18,137.00	0.03
104	601225	陕西煤业	1,500	17,775.00	0.03
105	601857	中国石油	3,100	16,399.00	0.03
106	300496	中科创达	100	15,706.00	0.03
107	603181	皇马科技	900	15,543.00	0.03
108	300973	立高食品	100	15,500.00	0.03
109	002332	仙琚制药	1,200	15,048.00	0.03
110	300394	天孚通信	580	14,685.60	0.03
111	600533	栖霞建设	4,600	14,352.00	0.03
112	600406	国电南瑞	600	13,944.00	0.02
113	002960	青鸟消防	500	13,080.00	0.02
114	603639	海利尔	700	12,593.00	0.02
115	300737	科顺股份	400	12,576.00	0.02
116	002841	视源股份	100	12,429.00	0.02
117	000933	神火股份	1,300	12,285.00	0.02

118	603477	巨星农牧	1,000	11,880.00	0.02
119	002541	鸿路钢构	200	11,670.00	0.02
120	001208	华菱线缆	1,508	11,656.84	0.02
121	300724	捷佳伟创	100	11,601.00	0.02
122	603186	华正新材	300	10,938.00	0.02
123	300910	瑞丰新材	100	10,455.00	0.02
124	600694	大商股份	500	10,380.00	0.02
125	605287	德才股份	327	10,320.12	0.02
126	002051	中工国际	1,600	10,192.00	0.02
127	000063	中兴通讯	300	9,969.00	0.02
128	600019	宝钢股份	1,200	9,168.00	0.02
129	300596	利安隆	200	8,666.00	0.02
130	601006	大秦铁路	1,300	8,554.00	0.01
131	603171	税友股份	445	8,544.00	0.01
132	002293	罗莱生活	600	8,034.00	0.01
133	603768	常青股份	500	7,870.00	0.01
134	601018	宁波港	1,900	7,505.00	0.01
135	002116	中国海诚	1,200	7,392.00	0.01
136	002714	牧原股份	120	7,298.40	0.01
137	688526	科前生物	200	7,244.00	0.01
138	300937	药易购	134	7,197.14	0.01
139	000429	粤高速 A	1,000	7,170.00	0.01
140	300571	平治信息	200	7,060.00	0.01
141	300922	天秦装备	201	7,000.83	0.01
142	300931	通用电梯	530	6,948.30	0.01
143	601918	新集能源	1,400	6,846.00	0.01
144	300940	南极光	154	6,680.52	0.01
145	300933	中辰股份	636	6,639.84	0.01
146	300927	江天化学	217	6,531.70	0.01
147	300982	苏文电能	100	5,595.00	0.01
148	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.01

149	300932	三友联众	168	5,327.28	0.01
150	603681	永冠新材	200	5,040.00	0.01
151	600585	海螺水泥	100	4,105.00	0.01
152	300925	法本信息	155	4,074.95	0.01
153	003005	竞业达	100	3,914.00	0.01
154	300803	指南针	100	3,860.00	0.01
155	600818	中路股份	400	3,720.00	0.01
156	603612	索通发展	200	3,594.00	0.01
157	605011	杭州热电	404	3,587.52	0.01
158	603811	诚意药业	200	3,470.00	0.01
159	002283	天润工业	600	3,324.00	0.01
160	600426	华鲁恒升	100	3,095.00	0.01
161	600020	中原高速	600	1,950.00	0.00
162	601988	中国银行	200	616.00	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	603515	欧普照明	3,835,692.00	2.24
2	300463	迈克生物	3,546,991.00	2.07
3	603444	吉比特	3,363,118.93	1.97
4	603260	合盛硅业	3,275,820.00	1.92
5	601799	星宇股份	3,233,100.53	1.89
6	600563	法拉电子	3,035,052.00	1.78
7	000990	诚志股份	2,757,016.00	1.61
8	603806	福斯特	2,747,857.00	1.61
9	603568	伟明环保	2,598,002.20	1.52
10	603882	金城医学	2,590,158.82	1.52
11	601615	明阳智能	2,518,697.00	1.47

12	600426	华鲁恒升	2,456,185.00	1.44
13	600038	中直股份	2,443,741.00	1.43
14	600132	重庆啤酒	2,428,056.04	1.42
15	600779	水井坊	2,362,889.00	1.38
16	002423	中粮资本	2,346,076.00	1.37
17	000807	云铝股份	2,301,061.00	1.35
18	002064	华峰化学	2,213,973.78	1.30
19	600885	宏发股份	2,126,615.97	1.24
20	002557	洽洽食品	2,098,812.50	1.23

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603515	欧普照明	6,923,583.75	4.05
2	603650	彤程新材	6,404,236.50	3.75
3	603882	金域医学	6,227,467.22	3.64
4	002028	思源电气	6,136,105.94	3.59
5	600779	水井坊	5,421,848.50	3.17
6	603737	三棵树	4,994,774.32	2.92
7	002925	盈趣科技	4,933,904.20	2.89
8	603568	伟明环保	4,816,741.46	2.82
9	600062	华润双鹤	4,780,735.83	2.80
10	601799	星宇股份	4,656,724.40	2.72
11	603260	合盛硅业	4,176,726.00	2.44
12	600507	方大特钢	4,100,864.11	2.40
13	603444	吉比特	4,067,844.00	2.38
14	002920	德赛西威	3,997,612.13	2.34
15	600132	重庆啤酒	3,979,536.36	2.33
16	002124	天邦股份	3,899,701.78	2.28
17	002080	中材科技	3,872,800.00	2.27

18	600373	中文传媒	3,840,122.00	2.25
19	001872	招商港口	3,831,260.00	2.24
20	002056	横店东磁	3,683,977.00	2.16
21	603806	福斯特	3,652,713.16	2.14
22	600388	龙净环保	3,545,816.75	2.07
23	000581	威孚高科	3,494,435.00	2.04

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	303,020,383.71
卖出股票收入（成交）总额	421,687,652.25

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	659.00
5	应收申购款	330,952.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	331,611.76

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688686	奥普特	315,249.00	0.55	首次公开发行带锁定期

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500指数增强A	503	21,814.25	0.00	0.00%	10,972,569.74	100.00%
中加中证500指数增强C	443	91,210.64	25,023,931.53	61.93%	15,382,383.72	38.07%
合计	946	54,311.72	25,023,931.53	48.70%	26,354,953.46	51.30%

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	11,060.35	0.10%
	中加中证500指数增强C	204,597.06	0.51%
	合计	215,657.41	0.42%

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金	中加中证500指数增强A	-
	中加中证500指数增强C	10~50
	合计	10~50

§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	88,955,946.18	85,119,438.10
本报告期基金总申购份额	4,730,139.56	29,263,733.33
减：本报告期基金总赎回份额	82,713,516.00	73,976,856.18
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,972,569.74	40,406,315.25

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人事变动情况：

无。

基金托管人本报告期内人事变动情况：无。

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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处罚。

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	723,635,865.41	100.00%	377,471.81	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) 投资研究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) 公司执行委员会负责审批、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，由监察稽核部门负责审查相关协议内容，交易室负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

4. 投资研究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，并报公司执行委员会审批、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	226,335.90	100.00%	207,500.00	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	2021-01-18
2	中加中证500指数增强型证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
3	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	2021-01-26
4	中加基金管理有限公司关于	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-08

	旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告		
5	中加中证500指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-08
6	中加中证500指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-08
7	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	2021-02-10
8	中加中证500指数增强型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-10
9	中加中证500指数增强型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
10	中加基金管理有限公司关于修订公司旗下部分公开募集证券投资基金的基金合同部分条款的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-31
11	中加中证500指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-31
12	中加中证500指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-31
13	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	2021-04-06
14	中加中证500指数增强型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-06
15	中加中证500指数增强型证券投资基金2021年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21
16	中加基金管理有限公司关于	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-27

	中加中证500指数增强型证券投资基金关联交易公告		
17	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	2021-05-18
18	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	2021-06-10
19	中加基金管理有限公司关于在中信建投证券股份有限公司开通基金定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-11
20	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	2021-06-16

§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	20210101-20210127	49,999,000.00	-	49,999,000.00	0.00	0.00%
	2	20210202-20210630	0.00	19,495,077.49	0.00	19,495,077.49	37.94%
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、基金托管人处

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

基金托管人地址：北京市东城区朝内大街2号凯恒中心B座10层

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：www.bobbns.com

中加基金管理有限公司
二〇二一年八月二十七日