

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	28
§8 投资组合报告	69
8.1 期末基金资产组合情况.....	69
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	69
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	71
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	78
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	98
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	98
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	99

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	99
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	99
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	99
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	99
8.12 投资组合报告附注	99
§9 基金份额持有人信息	101
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	101
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	101
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	101
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	102
§10 开放式基金份额变动	103
§11 重大事件揭示	104
11.1 基金份额持有人大会决议	104
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	104
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	104
11.4 基金投资策略的改变	104
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	104
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	104
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	104
11.8 其他重大事件	107
§12 影响投资者决策的其他重要信息	112
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	112
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	112
§13 备查文件目录	113
13.1 备查文件目录	113
13.2 存放地点	113
13.3 查阅方式	113

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中金中证 500	
基金主代码	003016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 22 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	244,766,875.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中金中证 500A	中金中证 500C
下属分级基金的交易代码:	003016	003578
报告期末下属分级基金的份额总额	169,311,490.39 份	75,455,385.28 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	本基金股票投资主要策略为标的指数投资策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合，然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化，力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券投资策略；5、股指期货投资策略；6、参与转融通证券出借业务投资策略。详见《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
--------	---

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		中金基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵璧	郭明
	联系电话	010-63211122	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95588
传真		010-66159121	010-66105798
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100004	100140
法定代表人		胡长生	陈四清

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1. 1 期 间数 据和 指标	2021 年		2020 年		2019 年	
	中金中证 500A	中金中证 500C	中金中证 500A	中金中证 500C	中金中证 500A	中金中证 500C
本期 已实 现收 益	44,916,225. 61	28,548,535. 33	30,226,602. 65	26,944,359. 09	13,554,769 .17	3,966,128. 24
本期 利润	52,204,497. 58	29,000,027. 26	31,548,104. 47	28,012,804. 74	18,180,922 .40	4,087,244. 60
加权 平均 基金 份额 本期 利润	0.4309	0.3751	0.4204	0.4996	0.2538	0.1948
本期 加权 平均 净值 利润 率	24.63%	21.73%	31.73%	35.61%	25.45%	19.20%
本期 基金	25.96%	25.47%	40.72%	40.14%	33.75%	32.83%

份额 净值 增长 率						
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末 可供 分配 利润	155,504,476 .65	68,428,203. 05	41,392,738. 60	37,296,061. 64	6,250,826. 09	2,579,784. 33
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.9185	0.9069	0.5307	0.5270	0.0878	0.0896
期末 基金 资产 净值	326,457,937 .09	144,563,730 .64	119,390,553 .39	108,061,474 .81	77,421,437 .89	31,375,561 .08
期末 基金 份额 净值	1.9281	1.9159	1.5307	1.5270	1.0878	1.0896
3.1. 3 累计	2021 年末		2020 年末		2019 年末	

期末指标						
基金份额累计净值增长率	92.81%	77.45%	53.07%	41.43%	8.78%	0.92%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3、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孰低数。

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

中金中证 500A

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	4.50%	0.70%	3.43%	0.72%	1.07%	-0.02%
过去六个月	12.43%	0.87%	7.72%	0.91%	4.71%	-0.04%
过去一年	25.96%	0.95%	14.83%	0.92%	11.13%	0.03%
过去三年	137.07%	1.25%	72.29%	1.31%	64.78%	-0.06%
过去五年	88.13%	1.23%	17.26%	1.27%	70.87%	-0.04%
自基金合同生效起至今	92.81%	1.20%	14.20%	1.24%	78.61%	-0.04%

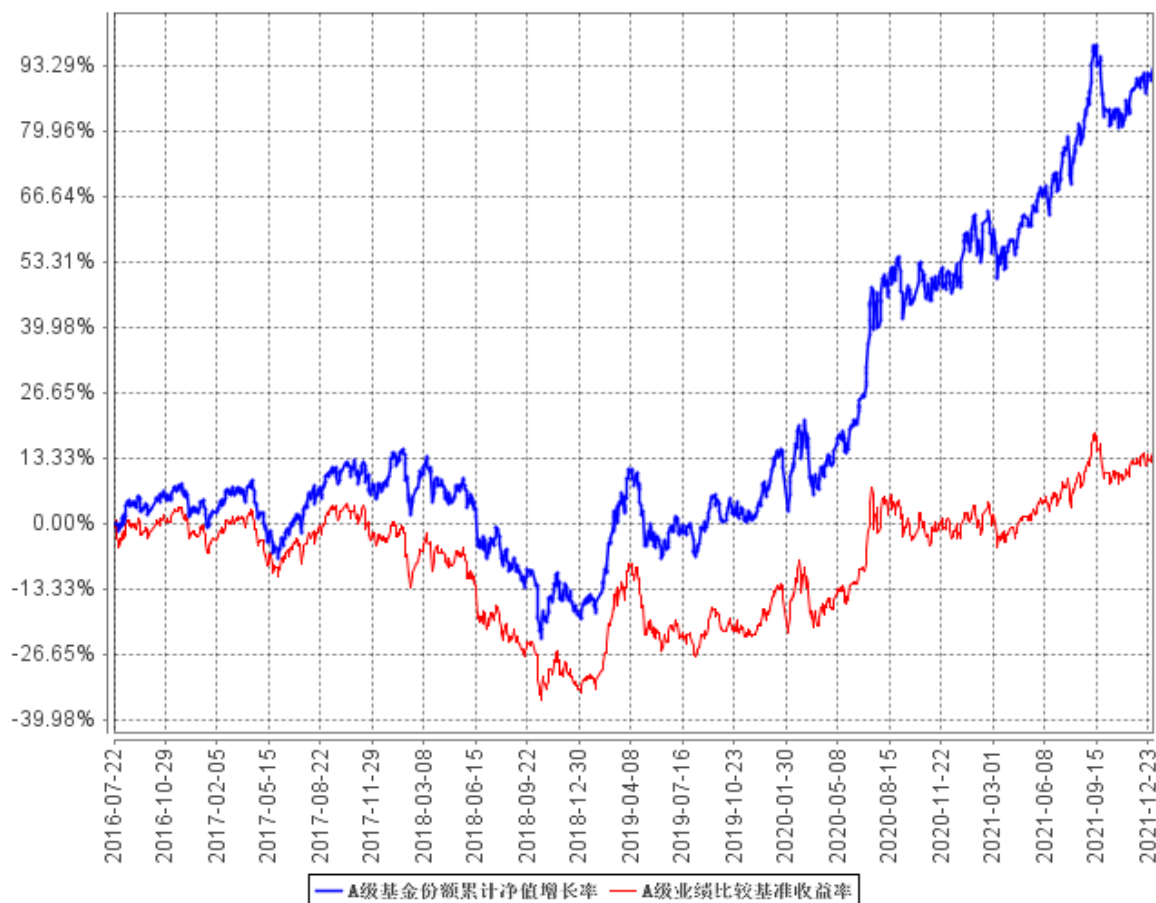
中金中证 500C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

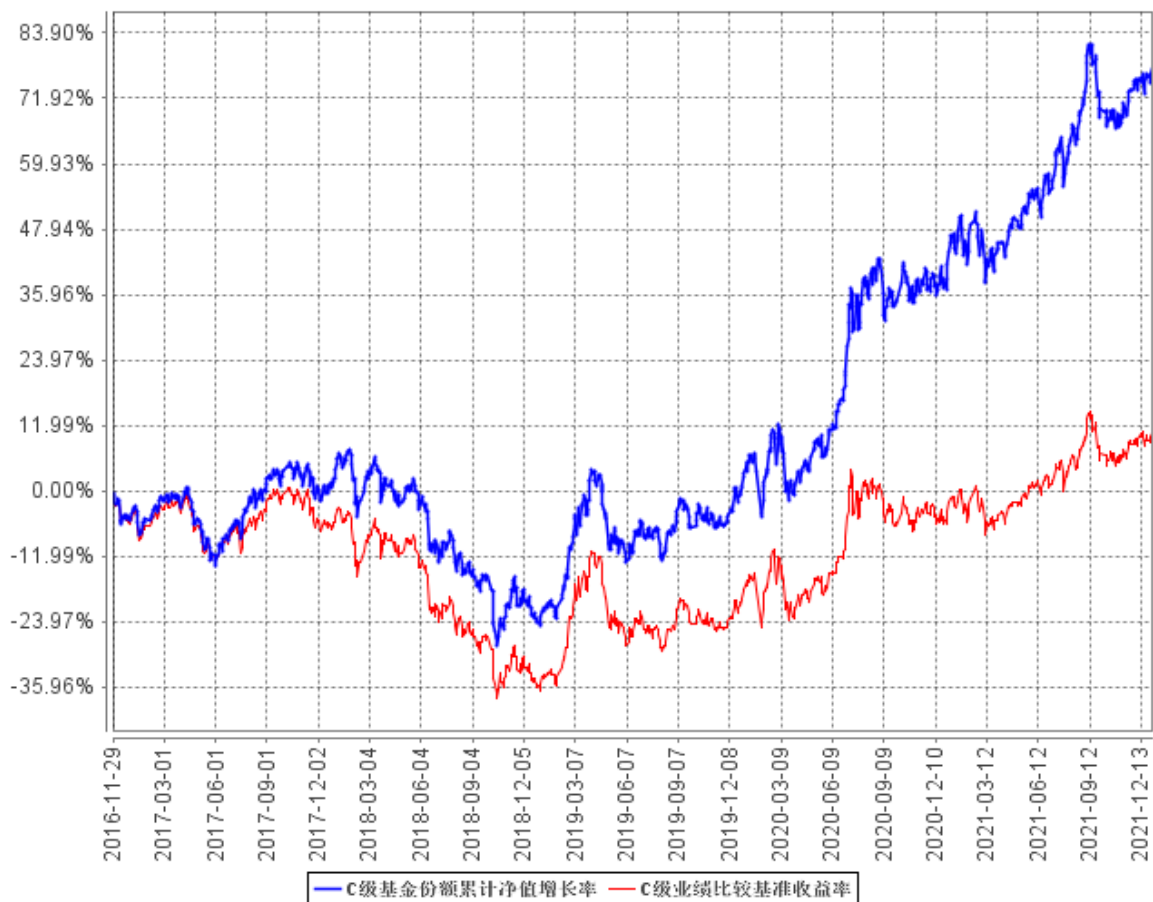
过去三个月	4.40%	0.70%	3.43%	0.72%	0.97%	-0.02%
过去六个月	12.20%	0.87%	7.72%	0.91%	4.48%	-0.04%
过去一年	25.47%	0.95%	14.83%	0.92%	10.64%	0.03%
过去三年	133.56%	1.25%	72.29%	1.31%	61.27%	-0.06%
过去五年	86.99%	1.23%	17.26%	1.27%	69.73%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	77.45%	1.22%	10.46%	1.26%	66.99%	-0.04%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

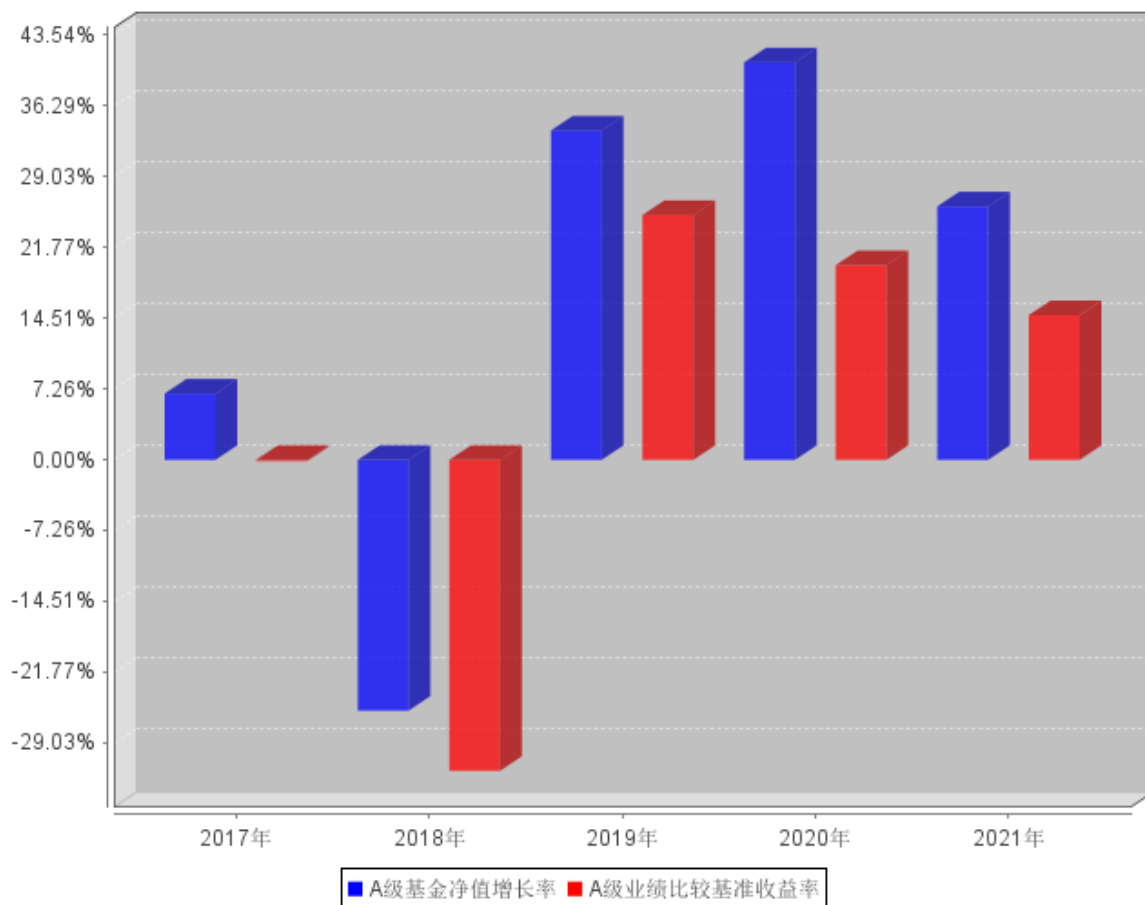


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

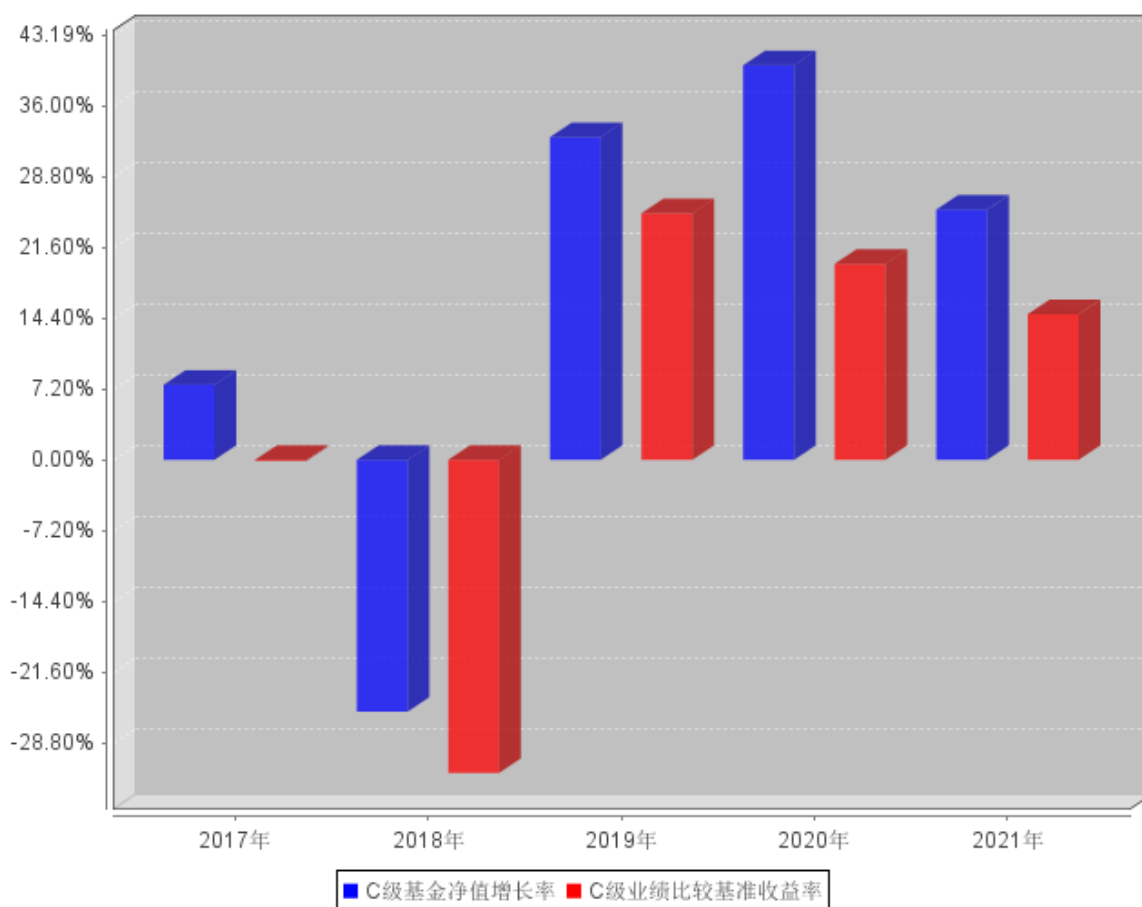


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，自成立以来本基金未进行收益分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司共管理 38 只公募基金，证券投资基金管理规模 813.07 亿元。

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		
耿帅军	本基金基金经理	2020年10月29日	-	10年	耿帅军先生，理学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所金融工程分析师，中信证券股份有限公司研究部副总裁、金融工程分析师，中国国际金融股份有限公司研究部执行总经理、金融工程分析师。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。
魏宇	本基金基金经理	2017年3月28日	2021年11月4日	11年	魏宇先生，统计学博士。历任北京尊嘉资产管理有限公司高

					级研究员；中金基金管理有限公司高级经理，量化专户投资经理，量化指数部基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《中金基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施效果评估、信息披露与报告制度等多方面进行了规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，公司建立了科学合理的投资运作体系和规范的投资流程，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输

送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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%。

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

在报告期内，本组合严格遵守基金合同的约定，基于深入的研究和完备的风控流程进行组合管理，在严格控制组合偏离度的基础上，利用量化选股策略精选个股，在控制组合跟踪误差的同时增强基金阿尔法收益。未来将继续努力开发和改进选股策略，在遵守合同约定和法律法规的前提下管理组合，争取在超额收益方面有更好的表现。

回顾过去一年国内宏观环境，作为最早从疫情中复苏的国家之一，中国在主要经济体中率先从宽松政策退出，而着力对经济发展中的长期结构性问题进行调整。反映在经济增长上，全年的经济平稳运行，进出口数据是其中亮点。通胀方面，上中下游价格分化，受终端消费复苏尚不充分，及猪肉价格下跌等因素影响，CPI（居民消费价格指数）全年在低位运行；而在全球供给压力凸显，大宗商品价格持续上涨等影响下，PPI（生产价格指数）数据不断走高，CPI（居民消费价格指数）与 PPI（生产价格指数）间剪刀差达到历史上较为极端的水平。流动性方面，国内率先从疫情期间宽松政策中退出，M2（广义货币）与社融增速等整体下行。

2021 年全年市场表现反映了上述宏观环境变化。经历连续两年多结构性上涨行情后的 A 股市场，估值分化程度较大，成长风格与价值风格间的估值差处于历史较高水平。消费、医药等稳健成长行业，和新能源、半导体等高景气成长赛道受无风险收益率变化，投资者风险偏好波动，市场微观结构震荡，及盈利增长预期调整等因素影响，分别在全年不同时点由强转弱。而四季度之后，伴随宏观增长预期转弱，稳增长政策预期强化等，估值处于历史相对低位的相关价值类风格开始收获一定超额收益。全年来看，A 股市场整体震荡，结构分化，成交活跃。主要宽基指数中，中证 500 上涨 15.58%，创业板上涨 12.02%，科创 50 上涨 0.37%，沪深 300 下跌 5.20%。风格表现方面，中小市值优于大市值，成长战胜价值。从行业板块表现看，电力设备与新能源、化工、有色、煤炭等涨幅排名居前，消费者服务、非银、家电等板块表现相对较弱。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证 500A 基金份额净值为 1.9281 元，本报告期基金份额净值增长率为

25.96%；截至本报告期末中金中证 500C 基金份额净值为 1.9159 元，本报告期基金份额净值增长率为 25.47%；同期业绩比较基准收益率为 14.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，我们认为结构性行情仍可能是 A 股市场的主要特征，但在经济周期变迁、政策基调转化的宏观背景，和估值相对分化、微观结构调整的市场环境下，市场结构性特征将与此前几年有一定变化。投资者整体将在长期前景与短期业绩、景气周期与估值位置等矛盾间做审慎权衡，市场在再均衡的过程中，标的性价比将重新成为投资决策的核心关切，我们将对此进行积极动态跟踪与评估。此外，我们始终坚信代表中国经济高质量发展方向的优质权益资产有望收获穿越传统经济周期的长期增长，这些资产也将构成我们重点关注和挖掘的结构性机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作，强化制度完善及对制度执行情况的监督检查，相关主要工作如下：

1) 紧密跟踪及落实法律法规、自律规则及监管要求，不断完善基金运作管理内部制度建设，促进依法合规展业。2) 研究、投资交易方面，围绕内幕交易、利用未公开信息交易等重点防范的违法违规行为和各项最新监管要求，开展合规培训，进一步提高员工合规守法意识。3) 营销与销售方面，落实《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及配套规则，持续对基金宣传推介材料、销售协议等材料文件进行合规审查，定期开展投资者适当性培训及销售业务专项培训，加强销售行为管理。4) 基金运作保障方面，持续为注册登记、基金会计、资金清算等业务提供合规咨询，适时开展合规检查，为基金运营安全提供法律合规支持。5) 信息披露方面，有序执行《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露内容的真实、准确、完整、及时、规范。6) 以《季度监察稽核项目表》为基础，对基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，同时有重点地开展定期不定期的合规检查、内部稽核，促进公司合规运作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施不断完善，坚持维护基金份额持有人合法权益。本基金管理人将继续合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益，提高监察稽核工作的有效性。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年

中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、投研部门、基金运营部、风险管理部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，本基金托管人在对中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全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，中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的管理人——中金基金管理有限公司在中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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。本报告期内，中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2203117 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“中金中证 500 基金”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）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编制，公允反映了中金中证 500 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中金中证 500 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>中金中证 500 基金管理人中金基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括中金中证 500 基金 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我</p>

	<p>们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中金中证 500 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非中金中证 500 基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中金中证 500 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中金中证 500 基金持续经</p>

	<p>营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中金中证 500 基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	管祎铭 李瑞丛
会计师事务所的地址	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
审计报告日期	2022 年 3 月 30 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	9,611,735.26	3,771,581.11
结算备付金		3,880,799.72	4,845,719.85
存出保证金		141,017.86	105,644.12
交易性金融资产	7.4.7.2	468,179,941.80	225,864,333.76
其中：股票投资		443,036,762.90	213,271,593.76
基金投资		-	-
债券投资		25,143,178.90	12,592,740.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	4,152,780.53
应收利息	7.4.7.5	434,133.03	219,773.23
应收股利		-	-
应收申购款		2,837,968.95	413,065.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		485,085,596.62	239,372,897.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		6,900,000.00	6,000,000.00
应付证券清算款		4,612,759.33	3,005,746.40
应付赎回款		739,747.71	928,091.75
应付管理人报酬		195,077.54	98,341.06
应付托管费		58,523.28	29,502.31
应付销售服务费		50,545.17	38,424.52
应付交易费用	7.4.7.7	1,306,341.99	1,693,108.47
应交税费		-	0.29
应付利息		-1,808.22	-2,345.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	202,742.09	130,000.00
负债合计		14,063,928.89	11,920,869.53
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	244,766,875.67	148,763,227.96
未分配利润	7.4.7.10	226,254,792.06	78,688,800.24
所有者权益合计		471,021,667.73	227,452,028.20
负债和所有者权益总计		485,085,596.62	239,372,897.73

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，中金中证 500A 基金份额净值 1.9281 元，基金份额总额 169,311,490.39 份；中金中证 500C 基金份额净值 1.9159 元，基金份额总额 75,455,385.28 份。中金中证 500 份额总额合计为 244,766,875.67 份。

7.2 利润表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2021年1月1日至2021 年12月31日	2020年1月1日至 2020年12月31日
一、收入		95,773,601.87	68,547,312.71
1.利息收入		541,117.62	257,457.84
其中：存款利息收入	7.4.7.11	90,693.42	62,475.52
债券利息收入		450,424.20	194,982.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		87,349,343.88	65,463,540.17
其中：股票投资收益	7.4.7.12	83,412,442.82	63,701,233.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-11,842.93	239,196.53
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	3,948,743.99	1,523,109.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	7,739,763.90	2,389,947.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	143,376.47	436,367.23
减：二、费用		14,569,077.03	8,986,403.50
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,718,051.79	883,314.28
2. 托管费	7.4.10.2.2	515,415.49	264,994.23
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	533,013.01	310,163.68
4. 交易费用	7.4.7.19	11,382,617.35	7,255,679.45

5. 利息支出		174,306.24	69,499.95
其中：卖出回购金融资产支出		174,306.24	69,499.95
6. 税金及附加		0.02	0.55
7. 其他费用	7.4.7.20	245,673.13	202,751.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		81,204,524.84	59,560,909.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		81,204,524.84	59,560,909.21

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	148,763,227.96	78,688,800.24	227,452,028.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	81,204,524.84	81,204,524.84
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）	96,003,647.71	66,361,466.98	162,365,114.69
其中：1. 基金申购款	399,614,351.98	298,404,949.47	698,019,301.45
2. 基金赎回款	-303,610,704.27	-232,043,482.49	-535,654,186.76

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）	244,766,875.67	226,254,792.06	471,021,667.73
项目	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年12月31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）	99,966,388.55	8,830,610.42	108,796,998.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	59,560,909.21	59,560,909.21
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）	48,796,839.41	10,297,280.61	59,094,120.02
其中：1. 基金申购款	286,029,669.34	87,907,451.66	373,937,121.00
2. 基金赎回款	-237,232,829.93	-77,610,171.05	-314,843,000.98
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）	148,763,227.96	78,688,800.24	227,452,028.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>孙菁</u>	<u>—</u>	<u>白娜</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（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 2016 年 7 月 5 日证监许可 [2016] 1517 号《关于准予中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式指数型基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）。

本基金通过中金基金直销中心、中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）及中国中金财富证券有限公司（以下简称“中金财富证券”）公开发售，于 2016 年 7 月 18 日募集。经向中国证监会备案，《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2016 年 7 月 22 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 10,001,000.00 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。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金销售费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股（含存托凭证）。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、存托凭证、衍生工具（权证、

股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、债券回购、银行存款等固定收益类资产,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)。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。

7.4.2 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。

7.4.3 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 7.4.2 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的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,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。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

7.4.4.8 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。

7.4.4.9 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。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款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。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，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相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后两类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

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。

7.4.4.13 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》(以下简称“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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、

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

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

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

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

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红

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

(e)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。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	9,611,735.26	3,771,581.11
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	-	-
合计：	9,611,735.26	3,771,581.11

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	429,747,361.28	443,036,762.90	13,289,401.62
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	25,189,598.20	25,143,178.90	-46,419.30
	银行间市场	-	-	-
	合计	25,189,598.20	25,143,178.90	-46,419.30
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		454,936,959.48	468,179,941.80	13,242,982.32
项目	上年度末			
	2020年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		207,733,705.34	213,271,593.76	5,537,888.42
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	12,627,410.00	12,592,740.00	-34,670.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	12,627,410.00	12,592,740.00	-34,670.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		220,361,115.34	225,864,333.76	5,503,218.42

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	834.98	477.47
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,739.76	2,217.38
应收债券利息	431,488.44	217,026.02
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	69.85	52.36
合计	434,133.03	219,773.23

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,306,341.99	1,693,108.47
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,306,341.99	1,693,108.47

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	-	-
指数使用费	17,742.09	10,000.00
应付信息披露费	120,000.00	80,000.00
其他	65,000.00	40,000.00
合计	202,742.09	130,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 500A		
项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,997,814.79	77,997,814.79
本期申购	240,792,368.80	240,792,368.80
本期赎回（以“-”号填列）	-149,478,693.20	-149,478,693.20
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	169,311,490.39	169,311,490.39

金额单位：人民币元

中金中证 500C	
项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,765,413.17	70,765,413.17
本期申购	158,821,983.18	158,821,983.18
本期赎回（以“-”号填列）	-154,132,011.07	-154,132,011.07
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	75,455,385.28	75,455,385.28

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金中证 500A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	42,098,569.86	-705,831.26	41,392,738.60
本期利润	44,916,225.61	7,288,271.97	52,204,497.58
本期基金份额交易产生的变动数	68,489,681.18	-4,940,470.66	63,549,210.52
其中：基金申购款	187,590,039.53	-6,320,144.06	181,269,895.47
基金赎回款	-119,100,358.35	1,379,673.40	-117,720,684.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	155,504,476.65	1,641,970.05	157,146,446.70

单位：人民币元

中金中证 500C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	37,971,958.50	-675,896.86	37,296,061.64
本期利润	28,548,535.33	451,491.93	29,000,027.26
本期基金份额交易产生的变动数	1,907,709.22	904,547.24	2,812,256.46

其中：基金申购款	120,369,079.64	-3,234,025.64	117,135,054.00
基金赎回款	-118,461,370.42	4,138,572.88	-114,322,797.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,428,203.05	680,142.31	69,108,345.36

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年 12月31日	2020年1月1日至2020年12月31 日
活期存款利息收入	23,586.52	26,309.45
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	64,975.81	35,030.82
其他	2,131.09	1,135.25
合计	90,693.42	62,475.52

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021 年12月31日	2020年1月1日至2020 年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	83,412,442.82	63,701,233.72
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	83,412,442.82	63,701,233.72

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年1月1日至2021 年12月31日	2020年1月1日至2020 年12月31日
卖出股票成交总额	4,256,582,365.08	2,723,185,844.03
减：卖出股票成本总额	4,173,169,922.26	2,659,484,610.31
买卖股票差价收入	83,412,442.82	63,701,233.72

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31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	-11,842.93	239,196.53
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	-11,842.93	239,196.53

7.4.7.13.2 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1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	23,786,186.87	6,446,640.95
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	23,272,130.00	6,089,526.13

减：应收利息总额	525,899.80	117,918.29
买卖债券差价收入	-11,842.93	239,196.53

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月

	月 31 日	31 日
股票投资产生的股利收益	3,948,743.99	1,523,109.92
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	3,948,743.99	1,523,109.92

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	7,739,763.90	2,389,947.47
——股票投资	7,751,513.20	2,463,646.77
——债券投资	-11,749.30	-73,699.30
——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	7,739,763.90	2,389,947.47

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12

	12月31日	月31日
基金赎回费收入	142,869.67	436,048.35
基金转换费收入	506.80	318.88
合计	143,376.47	436,367.23

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年 12月31日	2020年1月1日至2020年12 月31日
交易所市场交易费用	11,382,617.35	7,255,679.45
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
期货交易费用	-	-
合计	11,382,617.35	7,255,679.45

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021 年12月31日	2020年1月1日至2020年 12月31日
审计费用	65,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	55,737.17	40,000.00
汇划手续费	4,935.96	4,751.36
律师费用	-	30,000.00
公证费	-	8,000.00

合计	245,673.13	202,751.36
----	------------	------------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
工商银行	基金托管人
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（“中金财富证券”，原“中国中投证券有限责任公司”）	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构
中金资本运营有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金浦成投资有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金期货有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中国国际金融（香港）有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金私募股权投资管理有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日

	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
中金公司	355,690,001.60	4.14%	629,520,223.69	11.49%
中金财富证券	247,035,470.90	2.87%	1,276,418,844.60	23.30%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
中金公司	1,003,900.00	1.95%	215,400.20	1.09%
中金财富证券	-	-	3,966,295.17	20.10%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
中金公司	136,300,000.00	8.27%	85,300,000.00	12.32%
中金财富证券	24,000,000.00	1.46%	170,700,000.00	24.66%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方的交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中金公司	260,118.88	4.12%	-	-
中金财富证券	180,657.80	2.86%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中金公司	460,371.00	11.49%	137,367.31	8.11%
中金财富	933,447.84	23.30%	339,346.00	20.04%

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

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还获得证券研究综合服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,718,051.79
其中：支付销售机构的客户维护费	470,138.18	207,863.05

注：支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.50% 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 × 0.50% / 当年天

数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	515,415.49	264,994.23

注：支付基金托管人工商银行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

7.4.10.2.3 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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	229,441.57	229,441.57
中金公司	-	687.66	687.66
中金财富证券	-	13,102.86	13,102.86
合计	-	243,232.09	243,232.09
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	163,593.63	163,593.63
中金公司	-	644.51	644.51
中金财富证券	-	9,177.11	9,177.11
合计	-	173,415.25	173,415.25

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；
2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末。其计算公式为：C 类基金份额每日应计提的销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	1,014,198.78	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,014,198.78	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.5990%	-

项目	上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	1,014,198.78	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,014,198.78	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.3003%	-

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金总赎回份额含转换出份额；
2、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.10.5.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	9,611,735.26	23,586.52	3,771,581.11	26,309.45

注：本基金的活期银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期

2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中金公司	003033	征和工业	网下发行	301	7,007.28
中金公司	301058	中粮工科	网下发行	3,223	11,441.65
中金公司	001213	中铁特货	网下发行	5,818	23,039.28
中金公司	601156	东航物流	网下发行	2,090	32,959.30
中金公司	605090	九丰能源	网下发行	1,090	37,681.30
中金公司	688733	壹石通	网下发行	3,409	52,805.41
中金公司	688148	芳源股份	网下发行	11,860	54,318.80
中金公司	688316	青云科技	网下发行	984	62,680.80
中金公司	688696	极米科技	网下发行	537	71,813.01
中金公司	301039	中集车辆	网下发行	14,482	100,794.72
中金公司	688425	铁建重工	网下发行	37,802	108,491.74
中金公司	688728	格科微	网下发行	8,867	127,507.46
中金公司	301088	戎美股份	网下发行	4,261	141,294.76
中金公司	688303	大全能源	网下发行	6,916	148,624.84
中金公司	301127	天源环保	网下发行	13,859	166,723.77
中金公司	688187	时代电气	网下发行	6,716	210,748.08
中金公司	688235	百济神州	网下发行	4,804	925,250.40
上年度可比期间					
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中金公司	300831	派瑞股份	网下发行	1,716	6,829.68
中金公司	003010	若羽臣	网下发行	562	8,542.40
中金公司	003012	东鹏控股	网下发行	2,278	25,855.30
中金公司	003022	联泓新科	网下发行	2,304	26,403.84
中金公司	603565	中谷物流	网下发行	1,200	26,628.00

中金公司	688505	复旦张江	网下发行	5,254	47,023.30
中金公司	688617	惠泰医疗	网下发行	769	57,259.74
中金公司	688165	埃夫特	网下发行	9,135	58,007.25
中金公司	688365	光云科技	网下发行	5,458	58,946.40
中金公司	688520	神州细胞	网下发行	2,744	70,356.16
中金公司	688256	寒武纪	网下发行	1,172	75,465.08
中金公司	300901	中胤时尚	网下发行	9,611	86,114.56
中金公司	688301	奕瑞科技	网下发行	826	98,789.60
中金公司	688338	赛科希德	网下发行	2,105	105,986.75
中金公司	688180	君实生物	网下发行	1,974	109,557.00
中金公司	300866	安克创新	网下发行	2,311	153,265.52
中金公司	688185	康希诺	网下发行	1,026	215,162.46
中金公司	300999	金龙鱼	网下发行	12,870	330,759.00
中金公司	688981	中芯国际	网下发行	31,582	867,241.72

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股未上市	41.98	41.98	3,685	154,696.30	154,696.30	-

301136	招标股份	2021年 12月31日	2022 年1月 11日	新股未 上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
001234	泰慕士	2021年 12月31日	2022 年1月 11日	新股未 上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
688385	复旦微电	2021年 7月27日	2022 年2月 7日	新股流 通受限	6.23	48.58	8,986	55,982.78	436,539.88	-
688778	厦钨新能	2021年 7月29日	2022 年2月 7日	新股流 通受限	24.50	100.74	3,739	91,605.50	376,666.86	-
688766	普冉股份	2021年 8月12日	2022 年2月 23日	新股流 通受限	148.90	342.73	574	85,468.60	196,727.02	-
688257	新锐股份	2021年 10月19日	2022 年4月 27日	新股流 通受限	62.30	61.10	2,754	171,574.20	168,269.40	-
688787	海天瑞声	2021年 8月5日	2022 年2月 14日	新股流 通受限	36.94	87.35	817	30,179.98	71,364.95	-
688622	禾信仪器	2021年 9月3日	2022 年3月 14日	新股流 通受限	17.70	56.93	1,204	21,310.80	68,543.72	-
301050	雷电微力	2021年 8月17日	2022 年2月 24日	新股流 通受限	60.64	234.74	187	11,339.68	43,896.38	-
301029	怡合达	2021年 7月14日	2022 年1月	新股流 通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-

		日	24日							
301211	亨迪 药业	2021年 12月14日	2022 年6月 22日	新股流 通受限	25.80	33.65	759	19,582.20	25,540.35	-
301069	凯盛 新材	2021年 9月16日	2022 年3月 28日	新股流 通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301127	天源 环保	2021年 12月23日	2022 年6月 30日	新股流 通受限	12.03	17.12	1,386	16,673.58	23,728.32	-
301035	润丰 股份	2021年 7月21日	2022 年1月 28日	新股流 通受限	22.04	56.28	395	8,705.80	22,230.60	-
301221	光庭 信息	2021年 12月15日	2022 年6月 22日	新股流 通受限	69.89	88.72	228	15,934.92	20,228.16	-
300994	久祺 股份	2021年 8月2日	2022 年2月 14日	新股流 通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301060	兰卫 医学	2021年 9月6日	2022 年3月 14日	新股流 通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301039	中集 车辆	2021年 7月1日	2022 年1月 10日	新股流 通受限	6.96	12.51	1,449	10,085.04	18,126.99	-
301168	通灵 股份	2021年 12月2日	2022 年6月 10日	新股流 通受限	39.08	52.13	312	12,192.96	16,264.56	-
301101	明月	2021年	2022	新股流	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-

	镜片	2021年 12月9日	2022年 6月16日	通受限							
301090	华润 材料	2021年 10月19日	2022年 4月26日	新股流 通受限	10.45	11.22	1,413	14,765.85	15,853.86	-	
301100	风光 股份	2021年 12月10日	2022年 6月17日	新股流 通受限	27.81	31.14	505	14,044.05	15,725.70	-	
301166	优宁 维	2021年 12月21日	2022年 6月28日	新股流 通受限	86.06	94.50	165	14,199.90	15,592.50	-	
301089	拓新 药业	2021年 10月20日	2022年 4月27日	新股流 通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-	
301180	万祥 科技	2021年 11月9日	2022年 5月16日	新股流 通受限	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-	
301189	奥尼 电子	2021年 12月21日	2022年 6月28日	新股流 通受限	66.18	56.62	261	17,272.98	14,777.82	-	
301046	能辉 科技	2021年 8月10日	2022年 2月17日	新股流 通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-	
301111	粤万 年青	2021年 11月30日	2022年 6月7日	新股流 通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-	
301188	力诺 特玻	2021年 11月4日	2022年 5月11日	新股流 通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-	

301091	深城交	2021年 10月20日	2022 年4月 29日	新股流 通受限	36.50	31.31	415	15,147.50	12,993.65	-
301199	迈赫股份	2021年 11月30日	2022 年6月 7日	新股流 通受限	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301138	华研精机	2021年 12月8日	2022 年6月 15日	新股流 通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301026	浩通科技	2021年 7月8日	2022 年1月 17日	新股流 通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301126	达嘉维康	2021年 11月30日	2022 年6月 7日	新股流 通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301190	善水科技	2021年 12月17日	2022 年6月 24日	新股流 通受限	27.85	27.46	453	12,616.05	12,439.38	-
301185	鸥玛软件	2021年 11月11日	2022 年5月 19日	新股流 通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301093	华兰股份	2021年 10月21日	2022 年5月 5日	新股流 通受限	58.08	49.85	242	14,055.36	12,063.70	-
301021	英诺激光	2021年 6月28日	2022 年1月 6日	新股流 通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301048	金鹰重工	2021年 8月11日	2022 年2月	新股流 通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-

		日	28日							
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股流通受限	43.99	50.77	211	9,281.89	10,712.47	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股流通受限	79.60	78.53	136	10,825.60	10,680.08	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股流通受限	33.16	24.67	427	14,159.32	10,534.09	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	36.31	35.52	282	10,239.42	10,016.64	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股流通受限	57.27	53.71	182	10,423.14	9,775.22	-
301045	天禄科技	2021年8月6日	2022年2月17日	新股流通受限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301182	凯旺	2021年	2022	新股流	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-

	科技	2021年12月16日	2022年6月23日	通受限							
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-	
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-	
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-	
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	新股流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-	
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-	
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-	
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-	
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-	
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-	

301033	迈普医学	2021年 7月15日	2022 年1月 26日	新股流 通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021年 8月17日	2022 年2月 24日	新股流 通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021年 7月15日	2022 年1月 24日	新股流 通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021年 8月27日	2022 年3月 7日	新股流 通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021年 7月21日	2022 年2月 16日	新股流 通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021年 8月2日	2022 年2月 11日	新股流 通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021年 9月22日	2022 年3月 29日	新股流 通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301058	中粮工科	2021年 9月1日	2022 年3月 9日	新股流 通受限	3.55	18.24	323	1,146.65	5,891.52	-
300854	中兰环保	2021年 9月8日	2022 年3月 17日	新股流 通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021年 9月9日	2022 年3月	新股流 通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-

			24 日							
301038	深水 规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股流 通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三 江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股流 通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝 集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 19 日	新股流 通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立 佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新股流 通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭 酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	新股流 通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信 工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	新股流 通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆 新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股流 通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地 海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股流 通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳 液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股流 通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

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股票需要锁定的，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业股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日，本基金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人民币 6,900,000.00 元，于 2022 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型股票基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制在合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资（上年度末：同）。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

7.4.13.3 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。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，对基金组合的流动性管理

的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性压力测试、流动性风险预警、指标超标及危机的处理、流动性风险管理工具、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司投资风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性指标进行监控。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在行业 and 个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	9,611,735.26	-	-	-	9,611,735.26
结算备付金	3,514,687.93	-	-	366,111.79	3,880,799.72
存出保证金	141,017.86	-	-	-	141,017.86
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	443,036,762.90	443,036,762.90
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	25,143,178.90	-	-	-	25,143,178.90
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	434,133.03	434,133.03
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,837,968.95	2,837,968.95
资产总计	38,410,619.95	-	-	446,674,976.67	485,085,596.62
负债					
卖出回购金融资产款	6,900,000.00	-	-	-	6,900,000.00
应付证券清算款	-	-	-	4,612,759.33	4,612,759.33
应付赎回款	-	-	-	739,747.71	739,747.71
应付管理人报酬	-	-	-	195,077.54	195,077.54
应付托管费	-	-	-	58,523.28	58,523.28
应付交易费用	-	-	-	1,306,341.99	1,306,341.99
应付销售服务费	-	-	-	50,545.17	50,545.17
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-1,808.22	-1,808.22
其他负债	-	-	-	202,742.09	202,742.09
负债总计	6,900,000.00	-	-	7,163,928.89	14,063,928.89
利率敏感度缺口	31,510,619.95	-	-	439,511,047.78	471,021,667.73
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	3,771,581.11	-	-	-	3,771,581.11
结算备付金	4,479,608.06	-	-	366,111.79	4,845,719.85
存出保证金	105,644.12	-	-	-	105,644.12
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	213,271,593.76	213,271,593.76
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	12,592,740.00	-	-	-	12,592,740.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	4,152,780.53	4,152,780.53
应收利息	-	-	-	219,773.23	219,773.23
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	413,065.13	413,065.13
资产总计	20,949,573.29	-	-	218,423,324.44	239,372,897.73
负债					
卖出回购金融资产款	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	3,005,746.40	3,005,746.40
应付赎回款	-	-	-	928,091.75	928,091.75
应付管理人报酬	-	-	-	98,341.06	98,341.06
应付托管费	-	-	-	29,502.31	29,502.31
应付交易费用	-	-	-	1,693,108.47	1,693,108.47
应付销售服务费	-	-	-	38,424.52	38,424.52
应交税费	-	-	-	0.29	0.29
应付利息	-	-	-	-2,345.27	-2,345.27
其他负债	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	6,000,000.00	-	-	5,920,869.53	11,920,869.53
利率敏感度缺口	14,949,573.29	-	-	212,502,454.91	227,452,028.20

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	18,746.03	7,225.68
市场利率上升 25 个基点	-18,746.03	-7,225.68	

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的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的股票，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	443,036,762.90	94.06	213,271,593.76	93.77
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	443,036,762.90	94.06	213,271,593.76	93.77

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	23,248,899.32	10,564,548.55

	业绩比较基准下降 5%	-23,248,899.32	-10,564,548.55
--	-------------	----------------	----------------

7.4.14 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

下表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 12 月 31 日，本基金持有的持续以公允价值计量的资产总额为人民币 468,179,941.80 元，属于第一层次的交易性金融资产为人民币 440,665,467.96 元，均为股票投资；属于第二层次的交易性金融资产为人民币 27,278,823.61 元，其中股票投资为人民币 2,135,644.71 元，债券投资为人民币 25,143,178.90 元；属于第三层次的交易性金融资产为人民币 235,650.23 元，均为股票投资。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的持续以公允价值计量的资产总额为人民币 225,864,333.76 元，属于第一层次的交易性金融资产为人民币 211,312,943.27 元，均为股票投资；属于第二层次的交易性金融资产为人民币 14,404,814.80 元，其中股票投资为人民币 1,812,074.80 元，债券投资为人民币 12,592,740.00 元；属于第三层次的交易性金融资产为人民币 146,575.69 元，均为股票投资。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次，账面价值为人民币 2,371,294.94 元（2020 年 12 月 31 日：人民币 1,958,650.49 元）。于 2021 年 12 月 31 日及 2020 年 12 月 31 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 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2020 年 12 月 31 日：无）。

(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应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	443,036,762.90	91.33
	其中：股票	443,036,762.90	91.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,143,178.90	5.18
	其中：债券	25,143,178.90	5.18
	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	13,492,534.98	2.78
8	其他各项资产	3,413,119.84	0.70
9	合计	485,085,596.62	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	9,643,400.00	2.05
B	采矿业	17,124,263.82	3.64
C	制造业	266,830,632.67	56.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,463,443.19	4.34
E	建筑业	5,766,297.00	1.22
F	批发和零售业	16,667,221.40	3.54
G	交通运输、仓储和邮政业	8,432,496.95	1.79
H	住宿和餐饮业	5,338,460.00	1.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,361,106.00	5.60
J	金融业	34,103,044.59	7.24

K	房地产业	8,010,951.20	1.70
L	租赁和商务服务业	4,291,084.00	0.91
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,599,090.00	0.98
R	文化、体育和娱乐业	12,272,289.00	2.61
S	综合	-	-
	合计	439,903,779.82	93.39

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,463,076.03	0.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	38,856.85	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	269,232.36	0.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	251,321.92	0.05

N	水利、环境和公共设施管理业	45,080.03	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	37,932.31	0.01
S	综合	-	-
	合计	3,132,983.08	0.67

8.2.3 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通过港股通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002340	格林美	638,500	6,608,475.00	1.40
2	600884	杉杉股份	181,000	5,931,370.00	1.26
3	002180	纳思达	119,600	5,712,096.00	1.21
4	600862	中航高科	158,100	5,653,656.00	1.20
5	300253	卫宁健康	335,000	5,614,600.00	1.19
6	300088	长信科技	412,600	5,479,328.00	1.16
7	600487	亨通光电	353,608	5,346,552.96	1.14
8	600754	锦江酒店	91,100	5,338,460.00	1.13
9	600038	中直股份	66,200	5,315,860.00	1.13
10	000988	华工科技	190,600	5,310,116.00	1.13
11	600141	兴发集团	139,940	5,300,927.20	1.13
12	600529	山东药玻	117,700	5,167,030.00	1.10
13	601636	旗滨集团	298,600	5,106,060.00	1.08
14	000738	航发控制	168,000	5,087,040.00	1.08

15	002797	第一创业	690,300	5,052,996.00	1.07
16	002212	天融信	262,500	5,032,125.00	1.07
17	300146	汤臣倍健	185,400	4,998,384.00	1.06
18	002353	杰瑞股份	124,880	4,995,200.00	1.06
19	000999	华润三九	145,700	4,988,768.00	1.06
20	000970	中科三环	310,300	4,980,315.00	1.06
21	002138	顺络电子	128,700	4,913,766.00	1.04
22	000039	中集集团	285,900	4,906,044.00	1.04
23	600875	东方电气	228,691	4,898,561.22	1.04
24	000998	隆平高科	210,300	4,891,578.00	1.04
25	002080	中材科技	140,800	4,790,016.00	1.02
26	600177	雅戈尔	692,460	4,771,049.40	1.01
27	601689	拓普集团	89,700	4,754,100.00	1.01
28	002299	圣农发展	196,600	4,751,822.00	1.01
29	002444	巨星科技	155,500	4,744,305.00	1.01
30	002557	洽洽食品	77,100	4,730,856.00	1.00
31	002249	大洋电机	537,700	4,726,383.00	1.00
32	002439	启明星辰	165,500	4,721,715.00	1.00
33	000739	普洛药业	134,493	4,719,359.37	1.00
34	000932	华菱钢铁	920,100	4,701,711.00	1.00
35	002078	太阳纸业	408,700	4,695,963.00	1.00
36	600549	厦门钨业	204,700	4,632,361.00	0.98
37	600998	九州通	313,545	4,615,382.40	0.98
38	300244	迪安诊断	137,000	4,599,090.00	0.98
39	601128	常熟银行	693,300	4,582,713.00	0.97
40	601997	贵阳银行	696,000	4,530,960.00	0.96
41	002092	中泰化学	473,600	4,518,144.00	0.96
42	300463	迈克生物	154,600	4,512,774.00	0.96

43	000750	国海证券	1,095,400	4,502,094.00	0.96
44	603712	七一二	103,400	4,477,220.00	0.95
45	600764	中国海防	110,000	4,472,600.00	0.95
46	002203	海亮股份	356,600	4,432,538.00	0.94
47	600642	申能股份	599,971	4,421,786.27	0.94
48	002408	齐翔腾达	420,880	4,419,240.00	0.94
49	600803	新奥股份	240,000	4,406,400.00	0.94
50	600580	卧龙电驱	240,300	4,395,087.00	0.93
51	002390	信邦制药	590,600	4,382,252.00	0.93
52	600188	兖矿能源	185,694	4,369,379.82	0.93
53	603228	景旺电子	126,500	4,368,045.00	0.93
54	600216	浙江医药	254,500	4,346,860.00	0.92
55	603638	艾迪精密	134,958	4,307,859.36	0.91
56	002183	怡亚通	648,200	4,291,084.00	0.91
57	000825	太钢不锈	608,900	4,286,656.00	0.91
58	600500	中化国际	500,700	4,285,992.00	0.91
59	002925	盈趣科技	124,650	4,241,839.50	0.90
60	000598	兴蓉环境	668,300	4,223,656.00	0.90
61	600755	厦门国贸	583,500	4,207,035.00	0.89
62	002250	联化科技	233,100	4,188,807.00	0.89
63	600446	金证股份	292,500	4,188,600.00	0.89
64	300182	捷成股份	660,100	4,178,433.00	0.89
65	600037	歌华有线	478,800	4,155,984.00	0.88
66	002075	沙钢股份	711,700	4,149,211.00	0.88
67	002294	信立泰	151,400	4,136,248.00	0.88
68	600195	中牧股份	315,948	4,129,440.36	0.88
69	000686	东北证券	468,000	4,109,040.00	0.87
70	600373	中文传媒	328,100	4,055,316.00	0.86

71	600707	彩虹股份	594,600	4,055,172.00	0.86
72	300072	三聚环保	510,930	4,051,674.90	0.86
73	601098	中南传媒	422,000	4,038,540.00	0.86
74	000089	深圳机场	549,900	4,025,268.00	0.85
75	002387	维信诺	433,700	4,024,736.00	0.85
76	000062	深圳华强	232,400	4,004,252.00	0.85
77	600064	南京高科	428,180	3,999,201.20	0.85
78	601958	金钼股份	564,800	3,868,880.00	0.82
79	601139	深圳燃气	435,600	3,846,348.00	0.82
80	600729	重庆百货	147,600	3,840,552.00	0.82
81	601611	中国核建	382,600	3,814,522.00	0.81
82	300741	华宝股份	79,500	3,804,075.00	0.81
83	603515	欧普照明	180,700	3,751,332.00	0.80
84	600006	东风汽车	550,700	3,750,267.00	0.80
85	600623	华谊集团	411,300	3,742,830.00	0.79
86	001872	招商港口	220,301	3,734,101.95	0.79
87	600871	石化油服	1,738,900	3,721,246.00	0.79
88	000671	阳光城	1,205,500	3,640,610.00	0.77
89	603355	莱克电气	122,420	3,589,354.40	0.76
90	000046	泛海控股	1,896,900	3,566,172.00	0.76
91	601198	东兴证券	300,300	3,492,489.00	0.74
92	600908	无锡银行	577,677	3,275,428.59	0.70
93	603786	科博达	40,200	3,228,060.00	0.69
94	000690	宝新能源	540,601	3,200,357.92	0.68
95	600348	华阳股份	264,600	3,135,510.00	0.67
96	002867	周大生	154,200	2,741,676.00	0.58
97	002368	太极股份	75,700	2,084,778.00	0.44
98	000090	天健集团	332,500	1,951,775.00	0.41

99	002429	兆驰股份	296,800	1,442,448.00	0.31
100	002155	湖南黄金	116,500	1,206,940.00	0.26
101	600776	东方通信	92,000	1,058,920.00	0.22
102	600259	广晟有色	16,700	822,308.00	0.17
103	300308	中际旭创	16,800	714,000.00	0.15
104	002945	华林证券	51,000	696,660.00	0.15
105	601298	青岛港	118,300	673,127.00	0.14
106	300001	特锐德	26,300	654,081.00	0.14
107	002153	石基信息	19,600	563,304.00	0.12
108	000537	广宇发展	15,400	371,140.00	0.08
109	600131	国网信通	16,700	364,895.00	0.08
110	600095	湘财股份	29,100	294,492.00	0.06
111	600967	内蒙一机	17,200	205,540.00	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	688385	复旦微电	8,986	436,539.88	0.09
2	688778	厦钨新能	3,739	376,666.86	0.08
3	688032	禾迈股份	422	297,083.78	0.06
4	688190	云路股份	2,448	290,039.04	0.06
5	688766	普冉股份	574	196,727.02	0.04
6	688257	新锐股份	2,754	168,269.40	0.04
7	688262	国芯科技	3,685	154,696.30	0.03
8	688265	南模生物	1,741	121,957.05	0.03
9	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.02
10	688787	海天瑞声	817	71,364.95	0.02

11	688622	禾信仪器	1,204	68,543.72	0.01
12	301050	雷电微力	187	43,896.38	0.01
13	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
14	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.01
15	301211	亨迪药业	759	25,540.35	0.01
16	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
17	301127	天源环保	1,386	23,728.32	0.01
18	301035	润丰股份	395	22,230.60	0.00
19	301221	光庭信息	228	20,228.16	0.00
20	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
21	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
22	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
23	301039	中集车辆	1,449	18,126.99	0.00
24	301168	通灵股份	312	16,264.56	0.00
25	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
26	301090	华润材料	1,413	15,853.86	0.00
27	301100	风光股份	505	15,725.70	0.00
28	301166	优宁维	165	15,592.50	0.00
29	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
30	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
31	301189	奥尼电子	261	14,777.82	0.00
32	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
33	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
34	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
35	301091	深城交	415	12,993.65	0.00
36	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
37	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
38	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00

39	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
40	301190	善水科技	453	12,439.38	0.00
41	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
42	301093	华兰股份	242	12,063.70	0.00
43	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
44	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
45	301179	泽宇智能	211	10,712.47	0.00
46	301096	百诚医药	136	10,680.08	0.00
47	301088	戎美股份	427	10,534.09	0.00
48	301092	争光股份	282	10,016.64	0.00
49	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
50	301108	洁雅股份	182	9,775.22	0.00
51	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
52	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
53	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
54	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
55	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
56	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
57	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
58	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
59	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
60	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
61	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
62	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
63	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
64	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
65	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
66	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00

67	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
68	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
69	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
70	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
71	301058	中粮工科	323	5,891.52	0.00
72	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
73	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
74	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
75	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
76	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
77	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
78	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
79	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
80	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
81	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
82	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
83	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
84	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000988	华工科技	102,528,765.57	45.08
2	600563	法拉电子	96,673,095.45	42.50
3	600549	厦门钨业	88,771,653.43	39.03
4	600497	驰宏锌锗	80,361,063.11	35.33
5	002127	南极电商	79,087,681.71	34.77

6	300182	捷成股份	74,254,453.46	32.65
7	600637	东方明珠	73,370,067.08	32.26
8	600755	厦门国贸	70,706,024.94	31.09
9	600580	卧龙电驱	68,322,514.56	30.04
10	601198	东兴证券	65,692,452.70	28.88
11	002797	第一创业	60,539,659.74	26.62
12	600884	杉杉股份	56,503,915.21	24.84
13	002705	新宝股份	49,671,562.98	21.84
14	603888	新华网	47,887,149.95	21.05
15	000050	深天马 A	47,229,681.30	20.76
16	002429	兆驰股份	45,789,551.52	20.13
17	600089	特变电工	38,038,662.68	16.72
18	601233	桐昆股份	28,687,637.09	12.61
19	601098	中南传媒	26,879,841.06	11.82
20	000090	天健集团	25,741,934.40	11.32
21	001872	招商港口	24,050,175.75	10.57
22	002250	联化科技	23,621,777.15	10.39
23	002074	国轩高科	22,882,018.72	10.06
24	600064	南京高科	22,429,673.80	9.86
25	002701	奥瑞金	22,022,201.04	9.68
26	002340	格林美	21,653,090.00	9.52
27	300146	汤臣倍健	20,763,866.03	9.13
28	600141	兴发集团	20,622,926.08	9.07
29	002138	顺络电子	20,305,687.87	8.93
30	600216	浙江医药	19,016,399.00	8.36
31	000750	国海证券	18,673,664.00	8.21
32	601689	拓普集团	18,547,208.05	8.15
33	600707	彩虹股份	18,482,800.40	8.13

34	600006	东风汽车	18,450,135.02	8.11
35	603638	艾迪精密	18,097,479.01	7.96
36	603225	新凤鸣	18,055,595.72	7.94
37	603355	莱克电气	17,898,533.80	7.87
38	002092	中泰化学	17,772,694.00	7.81
39	002444	巨星科技	16,969,865.32	7.46
40	600862	中航高科	16,893,336.44	7.43
41	603260	合盛硅业	16,570,037.60	7.29
42	002212	天融信	16,537,244.30	7.27
43	000598	兴蓉环境	16,527,542.80	7.27
44	002078	太阳纸业	16,505,547.08	7.26
45	002557	洽洽食品	16,385,519.08	7.20
46	603377	东方时尚	15,957,658.80	7.02
47	002390	信邦制药	15,564,765.00	6.84
48	603515	欧普照明	15,424,585.94	6.78
49	002080	中材科技	15,291,816.07	6.72
50	603444	吉比特	14,748,654.34	6.48
51	002925	盈趣科技	14,737,231.82	6.48
52	002408	齐翔腾达	14,522,992.93	6.39
53	600754	锦江酒店	14,499,013.14	6.37
54	300072	三聚环保	14,418,208.00	6.34
55	600729	重庆百货	14,342,537.71	6.31
56	000739	普洛药业	14,339,213.40	6.30
57	601611	中国核建	14,249,509.65	6.26
58	601958	金钼股份	14,226,846.16	6.25
59	002709	天赐材料	14,194,651.02	6.24
60	600038	中直股份	14,194,058.00	6.24
61	600373	中文传媒	14,064,489.95	6.18

62	000999	华润三九	14,054,618.49	6.18
63	000690	宝新能源	13,846,305.00	6.09
64	002028	思源电气	13,779,260.90	6.06
65	300115	长盈精密	13,746,121.50	6.04
66	000089	深圳机场	13,721,226.99	6.03
67	600188	兖矿能源	13,717,357.99	6.03
68	000998	隆平高科	13,618,978.05	5.99
69	002203	海亮股份	13,598,097.44	5.98
70	600642	申能股份	13,588,671.61	5.97
71	000799	酒鬼酒	13,476,529.41	5.92
72	300207	欣旺达	13,421,876.00	5.90
73	600623	华谊集团	13,381,222.85	5.88
74	000807	云铝股份	13,378,857.00	5.88
75	300088	长信科技	13,347,314.87	5.87
76	600998	九州通	13,133,554.15	5.77
77	600871	石化油服	13,079,136.00	5.75
78	600500	中化国际	13,021,891.96	5.73
79	002353	杰瑞股份	12,931,730.28	5.69
80	002294	信立泰	12,810,150.64	5.63
81	600195	中牧股份	12,677,270.80	5.57
82	600827	百联股份	12,628,680.36	5.55
83	300274	阳光电源	12,512,567.72	5.50
84	300741	华宝股份	12,458,782.50	5.48
85	000970	中科三环	12,458,764.00	5.48
86	002249	大洋电机	12,412,348.00	5.46
87	002183	怡亚通	12,376,933.72	5.44
88	601636	旗滨集团	12,251,681.00	5.39
89	603228	景旺电子	11,964,302.93	5.26

90	000012	南玻A	11,940,512.95	5.25
91	603786	科博达	11,929,090.00	5.24
92	000825	太钢不锈	11,725,438.00	5.16
93	000932	华菱钢铁	11,679,866.00	5.14
94	600811	东方集团	11,506,413.00	5.06
95	601128	常熟银行	11,503,262.00	5.06
96	300244	迪安诊断	11,479,923.93	5.05
97	600529	山东药玻	11,400,163.56	5.01
98	601997	贵阳银行	11,354,482.74	4.99
99	600177	雅戈尔	11,313,265.04	4.97
100	603712	七一二	11,305,155.00	4.97
101	002368	太极股份	11,213,817.79	4.93
102	603737	三棵树	11,209,433.28	4.93
103	002387	维信诺	11,161,813.00	4.91
104	000738	航发控制	11,128,064.27	4.89
105	002511	中顺洁柔	10,844,970.00	4.77
106	600201	生物股份	10,823,411.00	4.76
107	600348	华阳股份	10,702,771.00	4.71
108	000039	中集集团	10,690,797.60	4.70
109	600764	中国海防	10,645,167.26	4.68
110	002155	湖南黄金	10,579,171.00	4.65
111	000009	中国宝安	10,462,299.59	4.60
112	600409	三友化工	10,445,277.00	4.59
113	600446	金证股份	10,432,368.09	4.59
114	600132	重庆啤酒	10,294,472.24	4.53
115	002299	圣农发展	10,292,413.00	4.53
116	603345	安井食品	10,179,378.80	4.48
117	601799	星宇股份	10,101,845.76	4.44

118	300001	特锐德	10,014,628.70	4.40
119	600426	华鲁恒升	9,937,021.70	4.37
120	600908	无锡银行	9,919,618.67	4.36
121	600875	东方电气	9,915,869.37	4.36
122	600339	中油工程	9,912,023.00	4.36
123	300463	迈克生物	9,804,121.56	4.31
124	002075	沙钢股份	9,802,443.00	4.31
125	000960	锡业股份	9,665,881.30	4.25
126	000898	鞍钢股份	9,624,766.42	4.23
127	300253	卫宁健康	9,604,299.97	4.22
128	600460	士兰微	9,602,389.00	4.22
129	002180	纳思达	9,573,249.00	4.21
130	000758	中色股份	9,489,466.12	4.17
131	600037	歌华有线	9,453,948.61	4.16
132	600258	首旅酒店	9,452,516.08	4.16
133	600487	亨通光电	9,395,207.40	4.13
134	600392	盛和资源	9,360,359.40	4.12
135	600079	人福医药	9,335,862.78	4.10
136	603882	金域医学	9,305,515.00	4.09
137	002048	宁波华翔	9,208,442.73	4.05
138	002439	启明星辰	9,202,446.56	4.05
139	000671	阳光城	9,149,082.00	4.02
140	300009	安科生物	9,114,916.72	4.01
141	001914	招商积余	8,779,280.00	3.86
142	688002	睿创微纳	8,722,747.04	3.83
143	600803	新奥股份	8,701,636.78	3.83
144	300357	我武生物	8,662,663.00	3.81
145	002867	周大生	8,534,510.64	3.75

146	002625	光启技术	8,500,286.00	3.74
147	601966	玲珑轮胎	8,479,462.29	3.73
148	002223	鱼跃医疗	8,459,811.80	3.72
149	002985	北摩高科	8,417,318.73	3.70
150	603486	科沃斯	8,394,398.00	3.69
151	002635	安洁科技	8,312,258.00	3.65
152	002156	通富微电	8,196,572.80	3.60
153	600511	国药股份	8,131,146.00	3.57
154	600546	山煤国际	8,125,142.23	3.57
155	002568	百润股份	8,102,406.14	3.56
156	603885	吉祥航空	8,092,593.20	3.56
157	000686	东北证券	8,043,816.73	3.54
158	002124	天邦股份	7,993,295.84	3.51
159	600835	上海机电	7,735,361.00	3.40
160	300496	中科创达	7,713,494.48	3.39
161	000830	鲁西化工	7,674,066.00	3.37
162	300699	光威复材	7,525,223.20	3.31
163	000959	首钢股份	7,523,515.66	3.31
164	600737	中粮糖业	7,497,751.00	3.30
165	600985	淮北矿业	7,497,270.45	3.30
166	002648	卫星化学	7,460,522.38	3.28
167	600765	中航重机	7,415,905.00	3.26
168	601068	中铝国际	7,283,558.00	3.20
169	601298	青岛港	7,182,042.68	3.16
170	603708	家家悦	7,107,432.00	3.12
171	600643	爱建集团	7,102,459.00	3.12
172	600068	葛洲坝	7,100,328.00	3.12
173	000301	东方盛虹	7,055,298.00	3.10

174	600060	海信视像	7,017,847.51	3.09
175	002791	坚朗五金	7,000,025.00	3.08
176	600160	巨化股份	6,977,072.00	3.07
177	002595	豪迈科技	6,950,487.94	3.06
178	002683	宏大爆破	6,938,030.00	3.05
179	600350	山东高速	6,916,308.00	3.04
180	600329	中新药业	6,912,651.00	3.04
181	000062	深圳华强	6,912,167.28	3.04
182	601717	郑煤机	6,863,578.00	3.02
183	603317	天味食品	6,857,781.10	3.02
184	300482	万孚生物	6,838,063.00	3.01
185	601168	西部矿业	6,824,944.99	3.00
186	603338	浙江鼎力	6,787,428.40	2.98
187	600699	均胜电子	6,779,130.69	2.98
188	300024	机器人	6,765,463.84	2.97
189	300012	华测检测	6,691,774.00	2.94
190	600535	天士力	6,610,399.60	2.91
191	600158	中体产业	6,367,429.34	2.80
192	600260	ST 凯乐	6,352,951.00	2.79
193	603893	瑞芯微	6,323,722.67	2.78
194	002317	众生药业	6,319,068.06	2.78
195	600259	广晟有色	6,317,339.00	2.78
196	603605	珀莱雅	6,315,892.97	2.78
197	600787	中储股份	6,300,978.00	2.77
198	002831	裕同科技	6,262,921.00	2.75
199	600171	上海贝岭	6,254,855.57	2.75
200	600782	新钢股份	6,191,984.00	2.72
201	603983	丸美股份	6,168,179.79	2.71

202	002946	新乳业	6,157,558.26	2.71
203	603290	斯达半导	6,118,759.00	2.69
204	600733	北汽蓝谷	6,114,721.00	2.69
205	300058	蓝色光标	6,099,424.00	2.68
206	000887	中鼎股份	6,056,641.91	2.66
207	688099	晶晨股份	6,017,164.62	2.65
208	601139	深圳燃气	5,987,647.74	2.63
209	600398	海澜之家	5,926,212.00	2.61
210	002815	崇达技术	5,913,073.14	2.60
211	300010	豆神教育	5,875,197.82	2.58
212	601928	凤凰传媒	5,829,377.75	2.56
213	603806	福斯特	5,800,784.00	2.55
214	002396	星网锐捷	5,788,676.00	2.55
215	603816	顾家家居	5,783,934.88	2.54
216	600820	隧道股份	5,725,892.00	2.52
217	601598	中国外运	5,716,883.00	2.51
218	600956	新天绿能	5,712,441.00	2.51
219	600315	上海家化	5,712,270.00	2.51
220	600967	内蒙一机	5,692,655.00	2.50
221	000729	燕京啤酒	5,682,131.00	2.50
222	002385	大北农	5,677,144.00	2.50
223	000990	诚志股份	5,628,095.65	2.47
224	600155	华创阳安	5,622,468.52	2.47
225	000636	风华高科	5,568,188.00	2.45
226	600704	物产中大	5,541,760.00	2.44
227	600039	四川路桥	5,540,913.00	2.44
228	600338	西藏珠峰	5,540,113.08	2.44
229	600728	佳都科技	5,499,758.00	2.42

230	002030	达安基因	5,485,626.42	2.41
231	002572	索菲亚	5,481,226.00	2.41
232	000967	盈峰环境	5,452,359.07	2.40
233	000975	银泰黄金	5,444,698.76	2.39
234	601969	海南矿业	5,437,698.00	2.39
235	600801	华新水泥	5,374,561.85	2.36
236	603198	迎驾贡酒	5,276,874.13	2.32
237	600517	国网英大	5,269,977.00	2.32
238	600143	金发科技	5,184,454.00	2.28
239	688321	微芯生物	5,139,889.86	2.26
240	600435	北方导航	5,119,761.00	2.25
241	601179	中国西电	5,118,159.00	2.25
242	002013	中航机电	5,112,305.00	2.25
243	300285	国瓷材料	5,077,344.00	2.23
244	600120	浙江东方	5,035,203.10	2.21
245	600507	方大特钢	4,988,662.00	2.19
246	002174	游族网络	4,964,739.00	2.18
247	002920	德赛西威	4,921,489.00	2.16
248	002419	天虹股份	4,909,158.00	2.16
249	600312	平高电气	4,885,406.00	2.15
250	600556	天下秀	4,868,803.00	2.14
251	300316	晶盛机电	4,841,113.00	2.13
252	600053	九鼎投资	4,825,439.00	2.12
253	002221	东华能源	4,800,284.00	2.11
254	000623	吉林敖东	4,800,005.22	2.11
255	300017	网宿科技	4,774,094.00	2.10
256	000937	冀中能源	4,766,564.00	2.10
257	601828	美凯龙	4,737,853.50	2.08

258	000501	鄂武商 A	4,707,616.94	2.07
259	002926	华西证券	4,704,976.00	2.07
260	002081	金螳螂	4,679,791.06	2.06
261	600153	建发股份	4,678,740.00	2.06
262	002242	九阳股份	4,665,197.00	2.05
263	300376	易事特	4,654,926.00	2.05
264	300037	新宙邦	4,571,611.00	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	600563	法拉电子	99,769,520.64	43.86
2	000988	华工科技	95,288,527.89	41.89
3	600549	厦门钨业	84,577,298.01	37.18
4	600497	驰宏锌锗	80,999,560.42	35.61
5	002127	南极电商	76,786,246.04	33.76
6	600637	东方明珠	73,118,189.30	32.15
7	300182	捷成股份	70,277,656.10	30.90
8	600755	厦门国贸	65,948,296.03	28.99
9	600580	卧龙电驱	64,739,272.22	28.46
10	601198	东兴证券	63,086,151.59	27.74
11	600884	杉杉股份	54,911,861.75	24.14
12	002797	第一创业	54,909,350.91	24.14
13	603888	新华网	47,822,122.09	21.03
14	000050	深天马 A	47,007,186.62	20.67
15	002705	新宝股份	46,603,342.18	20.49
16	600089	特变电工	43,362,139.24	19.06
17	002429	兆驰股份	41,932,391.81	18.44

18	601233	桐昆股份	29,907,782.38	13.15
19	002074	国轩高科	26,555,279.65	11.68
20	000090	天健集团	23,775,929.09	10.45
21	601098	中南传媒	22,878,926.00	10.06
22	603260	合盛硅业	21,622,899.04	9.51
23	001872	招商港口	20,191,231.96	8.88
24	600141	兴发集团	19,675,766.80	8.65
25	002701	奥瑞金	19,041,105.98	8.37
26	600064	南京高科	18,417,511.59	8.10
27	002709	天赐材料	17,528,769.61	7.71
28	002138	顺络电子	17,496,832.00	7.69
29	603444	吉比特	17,222,108.23	7.57
30	002250	联化科技	17,108,605.16	7.52
31	603225	新凤鸣	16,962,116.54	7.46
32	601689	拓普集团	16,918,607.55	7.44
33	002340	格林美	16,171,420.82	7.11
34	000807	云铝股份	15,927,629.54	7.00
35	600216	浙江医药	15,194,086.00	6.68
36	002092	中泰化学	14,979,946.30	6.59
37	300146	汤臣倍健	14,501,470.30	6.38
38	600006	东风汽车	14,499,193.00	6.37
39	603377	东方时尚	14,451,800.20	6.35
40	002028	思源电气	14,276,100.25	6.28
41	300274	阳光电源	14,265,670.00	6.27
42	002444	巨星科技	14,180,815.55	6.23
43	002080	中材科技	13,982,826.80	6.15
44	603355	莱克电气	13,922,317.66	6.12
45	603486	科沃斯	13,877,400.00	6.10

46	300115	长盈精密	13,850,861.00	6.09
47	600132	重庆啤酒	13,812,617.40	6.07
48	000799	酒鬼酒	13,725,927.00	6.03
49	300207	欣旺达	13,596,119.15	5.98
50	000750	国海证券	13,581,440.00	5.97
51	600707	彩虹股份	13,295,858.00	5.85
52	002557	洽洽食品	13,251,076.62	5.83
53	002078	太阳纸业	13,201,580.00	5.80
54	603638	艾迪精密	13,174,970.50	5.79
55	600426	华鲁恒升	13,123,886.40	5.77
56	000598	兴蓉环境	12,949,708.98	5.69
57	601799	星宇股份	12,910,738.01	5.68
58	603515	欧普照明	12,833,992.72	5.64
59	000739	普洛药业	12,792,256.04	5.62
60	600862	中航高科	12,722,521.13	5.59
61	002212	天融信	12,475,275.46	5.48
62	000012	南玻A	12,257,797.53	5.39
63	600038	中直股份	12,107,045.00	5.32
64	601611	中国核建	12,093,080.51	5.32
65	600188	兖矿能源	11,983,908.46	5.27
66	603737	三棵树	11,958,861.48	5.26
67	600827	百联股份	11,875,970.00	5.22
68	002511	中顺洁柔	11,754,611.00	5.17
69	002408	齐翔腾达	11,671,250.99	5.13
70	600258	首旅酒店	11,500,476.13	5.06
71	600811	东方集团	11,334,991.00	4.98
72	300496	中科创达	11,253,056.10	4.95
73	300357	我武生物	10,984,889.15	4.83

74	000009	中国宝安	10,950,839.87	4.81
75	600201	生物股份	10,874,043.00	4.78
76	000690	宝新能源	10,844,808.64	4.77
77	000960	锡业股份	10,812,778.05	4.75
78	601966	玲珑轮胎	10,798,537.39	4.75
79	600409	三友化工	10,708,791.69	4.71
80	000089	深圳机场	10,704,528.00	4.71
81	600373	中文传媒	10,681,849.20	4.70
82	601958	金钼股份	10,671,515.17	4.69
83	600729	重庆百货	10,662,548.13	4.69
84	600392	盛和资源	10,550,104.96	4.64
85	002368	太极股份	10,472,892.02	4.60
86	002203	海亮股份	10,471,054.60	4.60
87	300088	长信科技	10,448,386.56	4.59
88	603882	金域医学	10,411,969.00	4.58
89	000999	华润三九	10,333,050.00	4.54
90	600339	中油工程	10,306,872.00	4.53
91	002353	杰瑞股份	10,293,782.02	4.53
92	000898	鞍钢股份	10,269,820.54	4.52
93	000998	隆平高科	10,259,723.98	4.51
94	600623	华谊集团	10,206,921.97	4.49
95	600642	申能股份	10,174,833.41	4.47
96	002249	大洋电机	10,155,236.04	4.46
97	002155	湖南黄金	10,116,621.34	4.45
98	300072	三聚环保	10,063,797.87	4.42
99	300001	特锐德	10,062,083.95	4.42
100	002390	信邦制药	10,046,844.19	4.42
101	002925	盈趣科技	10,025,407.49	4.41

102	000970	中科三环	9,769,205.42	4.30
103	600875	东方电气	9,745,101.72	4.28
104	300012	华测检测	9,725,258.40	4.28
105	600460	士兰微	9,652,808.00	4.24
106	600699	均胜电子	9,646,453.00	4.24
107	603786	科博达	9,634,295.00	4.24
108	600754	锦江酒店	9,597,388.06	4.22
109	600500	中化国际	9,587,910.87	4.22
110	002294	信立泰	9,564,867.00	4.21
111	600871	石化油服	9,558,214.00	4.20
112	600079	人福医药	9,520,349.29	4.19
113	600060	海信视像	9,487,874.00	4.17
114	603345	安井食品	9,445,487.76	4.15
115	600195	中牧股份	9,408,781.82	4.14
116	603712	七一二	9,282,099.09	4.08
117	002223	鱼跃医疗	9,185,092.00	4.04
118	000758	中色股份	9,110,285.92	4.01
119	002048	宁波华翔	9,100,461.03	4.00
120	600348	华阳股份	9,086,697.98	3.99
121	002124	天邦股份	9,066,298.08	3.99
122	300009	安科生物	9,001,000.00	3.96
123	002625	光启技术	8,870,463.00	3.90
124	000301	东方盛虹	8,790,443.00	3.86
125	601168	西部矿业	8,784,405.00	3.86
126	002635	安洁科技	8,783,660.00	3.86
127	600737	中粮糖业	8,751,988.00	3.85
128	603338	浙江鼎力	8,700,214.16	3.83
129	688002	睿创微纳	8,642,682.45	3.80

130	002183	怡亚通	8,624,653.00	3.79
131	002156	通富微电	8,615,123.16	3.79
132	001914	招商积余	8,604,467.00	3.78
133	000830	鲁西化工	8,587,503.00	3.78
134	601717	郑煤机	8,563,415.00	3.76
135	002568	百润股份	8,547,248.00	3.76
136	603806	福斯特	8,496,069.00	3.74
137	600998	九州通	8,486,458.94	3.73
138	600350	山东高速	8,469,507.00	3.72
139	002648	卫星化学	8,367,076.98	3.68
140	300741	华宝股份	8,282,383.17	3.64
141	603317	天味食品	8,278,917.20	3.64
142	603885	吉祥航空	8,234,088.00	3.62
143	600782	新钢股份	8,072,969.99	3.55
144	600765	中航重机	8,049,936.29	3.54
145	300699	光威复材	7,979,239.60	3.51
146	603228	景旺电子	7,925,050.75	3.48
147	000738	航发控制	7,921,697.00	3.48
148	601068	中铝国际	7,915,337.00	3.48
149	600068	葛洲坝	7,905,178.00	3.48
150	600985	淮北矿业	7,898,489.68	3.47
151	600546	山煤国际	7,870,992.03	3.46
152	002985	北摩高科	7,861,895.30	3.46
153	000959	首钢股份	7,838,632.26	3.45
154	601298	青岛港	7,781,801.00	3.42
155	600835	上海机电	7,779,441.00	3.42
156	600511	国药股份	7,582,121.00	3.33
157	601636	旗滨集团	7,571,940.00	3.33

158	600529	山东药玻	7,571,861.10	3.33
159	000825	太钢不锈	7,435,301.00	3.27
160	601128	常熟银行	7,411,933.00	3.26
161	002791	坚朗五金	7,323,766.00	3.22
162	002867	周大生	7,309,428.59	3.21
163	600643	爱建集团	7,294,480.00	3.21
164	603708	家家悦	7,260,909.00	3.19
165	600329	中新药业	7,197,213.00	3.16
166	002572	索菲亚	7,179,320.52	3.16
167	300285	国瓷材料	7,178,771.00	3.16
168	300482	万孚生物	7,084,658.90	3.11
169	600507	方大特钢	7,040,015.40	3.10
170	603893	瑞芯微	7,030,894.40	3.09
171	300595	欧普康视	7,027,216.50	3.09
172	600764	中国海防	7,026,562.00	3.09
173	300244	迪安诊断	6,970,100.40	3.06
174	002013	中航机电	6,941,120.00	3.05
175	300024	机器人	6,936,156.92	3.05
176	600160	巨化股份	6,871,316.50	3.02
177	002174	游族网络	6,849,953.28	3.01
178	600908	无锡银行	6,849,721.00	3.01
179	601928	凤凰传媒	6,838,307.25	3.01
180	600535	天士力	6,785,823.00	2.98
181	000636	风华高科	6,747,343.00	2.97
182	600171	上海贝岭	6,704,830.98	2.95
183	603605	珀莱雅	6,692,310.59	2.94
184	600446	金证股份	6,642,102.90	2.92
185	002387	维信诺	6,596,520.00	2.90

186	600704	物产中大	6,586,684.41	2.90
187	600177	雅戈尔	6,524,599.40	2.87
188	002683	宏大爆破	6,512,215.00	2.86
189	600338	西藏珠峰	6,474,750.00	2.85
190	600787	中储股份	6,418,664.00	2.82
191	603983	丸美股份	6,415,413.00	2.82
192	002056	横店东磁	6,402,174.00	2.81
193	000039	中集集团	6,400,978.71	2.81
194	002317	众生药业	6,392,110.00	2.81
195	002831	裕同科技	6,375,594.00	2.80
196	601997	贵阳银行	6,361,171.60	2.80
197	600158	中体产业	6,263,350.85	2.75
198	002815	崇达技术	6,230,744.01	2.74
199	000887	中鼎股份	6,209,864.00	2.73
200	600315	上海家化	6,169,963.00	2.71
201	600039	四川路桥	6,070,238.00	2.67
202	300058	蓝色光标	6,063,804.00	2.67
203	000932	华菱钢铁	6,029,546.23	2.65
204	600260	ST 凯乐	6,013,766.00	2.64
205	002563	森马服饰	5,988,855.70	2.63
206	601969	海南矿业	5,983,240.00	2.63
207	002396	星网锐捷	5,971,876.00	2.63
208	600486	扬农化工	5,964,907.00	2.62
209	600155	华创阳安	5,953,717.24	2.62
210	002946	新乳业	5,947,913.75	2.62
211	603290	斯达半导	5,916,589.00	2.60
212	601598	中国外运	5,904,378.15	2.60
213	002273	水晶光电	5,893,747.00	2.59

214	000729	燕京啤酒	5,891,638.00	2.59
215	603816	顾家家居	5,878,547.00	2.58
216	600733	北汽蓝谷	5,838,251.00	2.57
217	603198	迎驾贡酒	5,823,805.00	2.56
218	603883	老百姓	5,790,658.00	2.55
219	600956	新天绿能	5,786,295.00	2.54
220	600259	广晟有色	5,757,623.28	2.53
221	600398	海澜之家	5,721,326.00	2.52
222	002595	豪迈科技	5,717,041.00	2.51
223	300316	晶盛机电	5,705,402.95	2.51
224	600517	国网英大	5,697,772.00	2.51
225	300010	豆神教育	5,676,517.00	2.50
226	600728	佳都科技	5,665,630.00	2.49
227	000990	诚志股份	5,660,125.00	2.49
228	600739	辽宁成大	5,652,547.00	2.49
229	000975	银泰黄金	5,637,284.00	2.48
230	002030	达安基因	5,621,309.00	2.47
231	600820	隧道股份	5,619,202.00	2.47
232	002180	纳思达	5,598,966.00	2.46
233	688099	晶晨股份	5,593,302.49	2.46
234	002670	国盛金控	5,581,901.11	2.45
235	600801	华新水泥	5,542,380.00	2.44
236	600143	金发科技	5,526,015.11	2.43
237	600967	内蒙一机	5,472,739.00	2.41
238	002299	圣农发展	5,421,389.00	2.38
239	002385	大北农	5,410,865.00	2.38
240	600823	世茂股份	5,386,166.00	2.37
241	000937	冀中能源	5,327,637.00	2.34

242	000967	盈峰环境	5,317,422.00	2.34
243	002221	东华能源	5,292,971.00	2.33
244	600435	北方导航	5,246,250.00	2.31
245	600037	歌华有线	5,208,998.00	2.29
246	002920	德赛西威	5,203,305.00	2.29
247	688321	微芯生物	5,173,198.35	2.27
248	601179	中国西电	5,157,153.00	2.27
249	600372	中航电子	5,138,245.04	2.26
250	300376	易事特	5,137,192.00	2.26
251	600487	亨通光电	5,117,452.56	2.25
252	300474	景嘉微	5,111,872.80	2.25
253	600879	航天电子	5,096,913.00	2.24
254	600053	九鼎投资	5,070,650.42	2.23
255	002038	双鹭药业	5,058,529.00	2.22
256	688088	虹软科技	5,028,644.59	2.21
257	300037	新宙邦	5,020,368.66	2.21
258	600312	平高电气	5,005,202.00	2.20
259	002507	涪陵榨菜	4,997,266.01	2.20
260	000513	丽珠集团	4,973,136.64	2.19
261	000623	吉林敖东	4,899,263.00	2.15
262	300017	网宿科技	4,834,854.52	2.13
263	002419	天虹股份	4,829,072.00	2.12
264	600667	太极实业	4,824,753.00	2.12
265	601828	美凯龙	4,781,262.43	2.10
266	002242	九阳股份	4,778,763.17	2.10
267	600153	建发股份	4,774,583.92	2.10
268	601003	柳钢股份	4,768,718.00	2.10
269	600120	浙江东方	4,753,166.60	2.09

270	600803	新奥股份	4,713,995.70	2.07
271	002081	金螳螂	4,713,770.27	2.07
272	600556	天下秀	4,699,280.81	2.07
273	000501	鄂武商 A	4,682,430.00	2.06
274	002281	光迅科技	4,562,075.56	2.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,395,240,076.36
卖出股票收入（成交）总额	4,256,638,863.24

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	24,818,790.00	5.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	324,388.90	0.07
	其中：政策性金融债	324,388.90	0.07
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,143,178.90	5.34

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019654	21 国债 06	118,000	11,803,540.00	2.51
2	019649	21 国债 01	75,000	7,501,500.00	1.59
3	019641	20 国债 11	55,000	5,513,750.00	1.17
4	018006	国开 1702	3,230	324,388.90	0.07

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	141,017.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	434,133.03
5	应收申购款	2,837,968.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,413,119.84

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688385	复旦微电	436,539.88	0.09	流通受限
2	688778	厦钨新能	376,666.86	0.08	流通受限
3	688766	普冉股份	196,727.02	0.04	流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
中 金 中 证 500A	21,077	8,033.00	41,899,692.17	24.75%	127,411,798.22	75.25%
中 金 中 证 500C	10,235	7,372.29	21,816,926.30	28.91%	53,638,458.98	71.09%
合计	31,312	7,817.03	63,716,618.47	26.03%	181,050,257.20	73.97%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	中金中证 500A	1,656,515.23	0.9784%
	中金中证 500C	8,054.13	0.0107%
	合计	1,664,569.36	0.6801%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	中金中证 500A	>100

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金中证 500C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 500A	0
	中金中证 500C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金已成立满三年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）基金份额总额	10,001,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	77,997,814.79	70,765,413.17
本报告期基金总申购份额	240,792,368.80	158,821,983.18
减:本报告期基金总赎回份额	149,478,693.20	154,132,011.07
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	169,311,490.39	75,455,385.28

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2021 年 3 月 5 日，本基金管理人发布公告，赵璧先生自 2021 年 3 月 3 日担任公司督察长；李虹女士同日起不再担任公司督察长。同日，本基金管理人发布公告，公司股东中金公司于 2021 年 3 月作出股东决定，赵璧先生不再担任公司第三届董事会董事，任命邱延冰先生担任公司第三届董事会董事。

2021 年 6 月 2 日，本基金管理人发布公告，杨毓莹女士自 2021 年 6 月 1 日起担任公司独立董事；王元先生同日起不再担任公司独立董事。

2021 年 12 月 3 日，本基金管理人发布公告，席晓峰先生、李耀光先生自 2021 年 12 月 2 日起担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。本基金本报告期内应支付审计费用 65,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	数量	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	
招商证券	2	1,515,209,630.70	17.55%	1,108,073.86	17.55%	-
长江证券	4	1,114,966,216.06	12.91%	815,375.83	12.91%	-
兴业证券	2	798,540,122.99	9.25%	583,974.33	9.25%	-
东方财富证 券	2	752,046,025.16	8.71%	549,971.20	8.71%	-
海通证券	2	731,379,860.20	8.47%	534,858.83	8.47%	-
太平洋	2	654,680,424.66	7.58%	478,769.42	7.58%	-
华创证券	2	617,353,957.45	7.15%	451,471.56	7.15%	-
东兴证券	1	447,702,946.26	5.18%	327,407.30	5.18%	-
中金公司	2	355,690,001.60	4.12%	260,118.88	4.12%	-
浙商证券	2	297,950,414.84	3.45%	217,890.44	3.45%	-
东北证券	2	249,447,328.51	2.89%	182,419.03	2.89%	-
天风证券	2	249,259,025.68	2.89%	182,285.42	2.89%	-
中金财富证 券	2	247,035,470.90	2.86%	180,657.80	2.86%	-
东方证券	2	234,855,410.49	2.72%	171,747.70	2.72%	-
国盛证券	2	220,994,437.82	2.56%	161,613.70	2.56%	-
申港证券	1	147,541,907.58	1.71%	107,897.34	1.71%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金报告期内新增交易单元：东北证券 2 个，东方财富证券 2 个，东方证券 2 个，东兴证券 1 个，国盛证券 2 个，海通证券 2 个，太平洋 2 个，浙商证券 2 个。

2、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，

能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
招商证券	3,507,600.00	6.82%	316,400,000.00	19.19%	-	-
长江证券	-	-	217,500,000.00	13.19%	-	-
兴业证券	2,486.00	0.00%	153,500,000.00	9.31%	-	-
东方财富证券	54,390.00	0.11%	163,000,000.00	9.89%	-	-
海通证券	21,669,398.20	42.12%	149,800,000.00	9.09%	-	-
太平洋	1,501,650.00	2.92%	84,000,000.00	5.10%	-	-
华创证券	6,012,637.99	11.69%	152,000,000.00	9.22%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	1,003,900.00	1.95%	136,300,000.00	8.27%	-	-
浙商证券	2,510,250.00	4.88%	53,400,000.00	3.24%	-	-
东北证券	-	-	53,000,000.00	3.22%	-	-
天风证券	15,188,600.00	29.52%	53,500,000.00	3.25%	-	-
中金财富证券	-	-	24,000,000.00	1.46%	-	-
东方证券	-	-	61,000,000.00	3.70%	-	-

国盛证券	-	-	31,000,000.00	1.88%	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021年1月5日
2	中金基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证监会规定媒介	2021年1月16日
3	中金基金管理有限公司旗下基金2020年第4季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021年1月22日
4	中金中证500指数增强型发起式证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2021年1月22日
5	中金基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2021年2月8日
6	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021年2月24日
7	中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2021年3月5日
8	中金基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2021年3月5日
9	中金基金管理有限公司关于设立厦门分公司的公告	中国证监会规定媒介	2021年3月6日
10	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021年3月6日
11	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引	中国证监会规定媒介	2021年3月30日

	第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告		
12	中金基金管理有限公司中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 30 日
13	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 30 日
14	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 30 日
15	中金基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 31 日
16	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年年度报告及摘要	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 31 日
17	中金基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 22 日
18	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 22 日
19	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 18 日
20	关于不法分子假冒“中金基金”名义进行诈骗的风险提示	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 26 日
21	关于不法分子假冒“中金基金”名义虚构“中金基金静态战略投资项目”进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 27 日
22	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 29 日
23	中金基金管理有限公司关于公司独立董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 2 日
24	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 12 日

25	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021年7月2日
26	关于不法分子假冒“中金基金”名义虚构“中金基金静态战略投资项目”进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2021年7月8日
27	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021年7月16日
28	中金基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021年7月21日
29	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2021年7月21日
30	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》修改基金合同及托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2021年7月30日
31	中金基金管理有限公司中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2021年7月30日
32	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2021年7月30日
33	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2021年7月30日
34	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021年7月31日
35	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021年8月11日
36	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021年8月12日
37	中金基金管理有限公司关于提示投资者及时上传身份证照片并持续完善身份信	中国证监会规定媒介	2021年8月26日

	息的公告		
38	中金基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 8 月 31 日
39	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金 2021 年中期报告	中国证监会规定媒介	2021 年 8 月 31 日
40	中金基金管理有限公司关于旗下基金投 资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 9 月 1 日
41	中金基金管理有限公司关于旗下基金投 资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 9 月 1 日
42	中金基金管理有限公司关于旗下基金投 资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 9 月 2 日
43	中金基金管理有限公司关于旗下基金投 资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 10 月 20 日
44	中金基金管理有限公司旗下基金 2021 年 第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 10 月 27 日
45	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2021 年 10 月 27 日
46	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2021 年 11 月 5 日
47	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金更新招募说明书(2021 年第 3 号)	中国证监会规定媒介	2021 年 11 月 9 日
48	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金基金产品资料概要(更新)(2021 年第 3 号)	中国证监会规定媒介	2021 年 11 月 9 日
49	中金基金管理有限公司副总经理变更公 告	中国证监会规定媒介	2021 年 12 月 3 日
50	中金基金管理有限公司关于旗下基金投 资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 12 月 8 日
51	中金基金管理有限公司关于旗下基金投	中国证监会规定媒介	2021 年 12 月 24

	资关联方承销期内承销证券的公告		日
--	-----------------	--	---

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、本报告期内在指定媒介上披露的有关中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人和/或基金托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件和复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日