

中加中证 500 指数增强型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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:2022 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至2022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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	58
7.1 期末基金资产组合情况	58
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	60
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81
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	81
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	82
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	82
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	82
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
7.12 投资组合报告附注	82
§8 基金份额持有人信息	83
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
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	84

§9 开放式基金份额变动.....	84
§10 重大事件揭示.....	85
10.1 基金份额持有人大会决议.....	85
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.....	85
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
10.4 基金投资策略的改变.....	85
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
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.....	85
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
10.8 其他重大事件.....	86
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
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.....	88
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	88
§12 备查文件目录.....	88
12.1 备查文件目录.....	88
12.2 存放地点.....	88
12.3 查阅方式.....	88

§ 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	106,442,042.75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	48,057,227.16份	58,384,815.59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 (2022年01月01日-2022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	-9,666,342.11	-8,182,047.30
本期利润	-8,234,385.39	-5,533,270.90
加权平均基金份额本期利润	-0.1347	-0.0941
本期加权平均净值利润率	-13.39%	-9.45%
本期基金份额净值增长率	-8.43%	-8.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	1,083,039.54	988,429.19
期末可供分配基金份额利润	0.0225	0.0169
期末基金资产净值	49,678,538.62	60,013,199.63
期末基金份额净值	1.0337	1.0279
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	3.37%	2.79%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中加中证500指数增强A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	8.86%	1.13%	6.74%	1.05%	2.12%	0.08%
过去三个月	3.17%	1.70%	1.99%	1.66%	1.18%	0.04%
过去六个月	-8.43%	1.57%	-11.65%	1.55%	3.22%	0.02%
过去一年	-7.18%	1.27%	-4.83%	1.26%	-2.35%	0.01%
自基金合同 生效起至今	3.37%	1.12%	3.49%	1.15%	-0.12%	-0.03%

中加中证500指数增强C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	8.83%	1.13%	6.74%	1.05%	2.09%	0.08%
过去三个月	3.10%	1.71%	1.99%	1.66%	1.11%	0.05%
过去六个月	-8.57%	1.57%	-11.65%	1.55%	3.08%	0.02%
过去一年	-7.46%	1.27%	-4.83%	1.26%	-2.63%	0.01%
自基金合同 生效起至今	2.79%	1.12%	3.49%	1.15%	-0.70%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中加中证500指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年09月27日-2022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-2022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，本基金合同生效已满一年。

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七十二只基金，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、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加丰享纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加颐享纯债债券型证券投资基金、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（A/C）、中加瑞享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加安瑞稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、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发起式基金中基金（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）、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加科鑫混合型证券投资基金（A/C）、中加中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、中加聚优一年定期开放混合型证券投资基金（A/C）、中加消费优选混合型证券投资基金（A/C）、中加喜利回报一年持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加优悦一年定期开放债券型证券投资基金、中加科瑞混合型证券投资基金（A/C）、中加中债-1-5年政策性金融债指数证券投资基金、中加邮益一年持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加龙头精选混合型证券投资基金（A/C）、中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加量化研选混合型证券投资基金（A/C）、中加恒享三个月定期开放债券型证券投资基金、中加聚享增盈债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加聚安60天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金。

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

					<p>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）、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（2021年8月13日至今）、中加量化研选混合型证券投资基金（2022年4月11日至今）、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金（2022年4月22日至今）的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

2、离任日期说明：无。

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

4、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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A股市场先抑后扬，波动很大。先后受美国通胀抬升引发的美联储加息、俄乌战争爆发引发的大宗商品价格暴涨、国内新冠疫情反复等不利因素的影响，A股在今年前4个月经历了三波较大幅度的下跌。5月份以来，受国内疫情形势好转和稳增长政策的支持，经济基本面边际得到改善，市场也逐步走出低谷，开启了一轮波澜壮阔的反弹行情。

在报告期内，沪深300、上证50和创业板指的涨跌幅分别为-9.22%、-6.6%和-15.4%，中证500的涨跌幅为-12.3%。

随着市场涨跌趋势的变化，市场的风格也发生明显变化。在4月份之前的下跌过程中，低估的价值风格表现突出，5月份以来的市场反弹中，市场风格又切换为高成长的风格。前期超跌板块本轮反弹涨幅最大，电力设备、汽车、国防军工、有色金属等板块领涨市场，从底部以来的反弹幅度超过35%。

本基金采用量化多因子模型选股模型对股票投资价值做定量分析，在此基础上构建股票投资组合，基金的持股非常分散。报告期内，基金保持仓位稳定，在严格控制跟踪误差的基础上，力争获得持续稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加中证500指数增强A基金份额净值为1.0337元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.43%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%；截至报告期末中加中证500指数增强C基金份额净值为1.0279元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.57%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在4月经济数据见底之后，5、6月份的规模以上工业增加值同比数据已经连续2个月转正，经济基本面正处于弱复苏的状态。7月份PMI数据又重返枯荣线以下，经济的复苏依然面临较大的压力，虽然海外持续加息，但国内的货币政策短期内不太会发生动摇。国内市场流动性有望继续保持较为宽松的状态。

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2022年1月1日至2022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 2022 年 6 月 30 日，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中加中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,091,786.54	7,496,409.07
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	103,239,127.80	129,617,278.78
其中：股票投资		103,239,127.80	129,614,278.78
基金投资		-	-
债券投资		-	3,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	700,000.00	3,400,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		40,949.15	121,193.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	275.05
资产总计		110,071,863.49	140,635,156.57
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-

应付赎回款		82,610.61	3,264,369.80
应付管理人报酬		70,227.07	94,778.48
应付托管费		13,167.57	17,771.00
应付销售服务费		14,459.19	16,520.19
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	199,660.80	300,020.01
负债合计		380,125.24	3,693,459.48
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	106,442,042.75	121,532,293.37
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	3,249,695.50	15,409,403.72
净资产合计		109,691,738.25	136,941,697.09
负债和净资产总计		110,071,863.49	140,635,156.57

注：报告截止日2022年06月30日，A类基金份额净值为1.0337元，A类基金份额总额48,057,227.16份；C类基金份额净值为1.0279元，C类基金份额总额58,384,815.59份，总份额合计106,442,042.75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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-12,915,148.40	11,717,788.77
1. 利息收入		31,046.22	36,727.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	21,536.44	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		9,509.78	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）		-17,048,847.36	10,962,992.59
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-18,445,477.81	10,358,779.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	18,149.15	24,315.49
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
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	1,378,481.30	579,897.72
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.15	4,080,733.12	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	21,919.62	205,448.11
减：二、营业总支出		852,507.89	1,421,774.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	476,917.52	248,155.45
2. 托管费	6.4.10.2. 2	89,421.97	46,529.19
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	86,989.42	62,993.61

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.03	0.05
8. 其他费用	6.4.7.18	199,178.95	1,064,096.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,767,656.29	10,296,013.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,767,656.29	10,296,013.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-13,767,656.29	10,296,013.96

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中加中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	121,532,293.37	-	15,409,403.72	136,941,697.09
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	121,532,293.37	-	15,409,403.72	136,941,697.09

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-15,090,250.62	-	-12,159,708.22	-27,249,958.84
(一)、综合收益总额	-	-	-13,767,656.29	-13,767,656.29
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-15,090,250.62	-	1,607,948.07	-13,482,302.55
其中: 1. 基金申购款	20,562,837.45	-	248,656.99	20,811,494.44
2. 基金赎回款	-35,653,088.07	-	1,359,291.08	-34,293,796.99
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	106,442,042.75	-	3,249,695.50	109,691,738.25
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	174,075,384.28	-	-3,130,119.77	170,945,264.51
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	174,075,384.	-	-3,130,119.7	170,945,264.

(基金净值)	28		7	51
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-122,696.49 9.29	-	8,854,201.82	-113,842.29 7.47
(一)、综合收益总额	-	-	10,296,013.9 6	10,296,013.9 6
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-122,696.49 9.29	-	-1,441,812.1 4	-124,138.31 1.43
其中: 1. 基金申购款	33,993,872.8 9	-	1,585,982.47	35,579,855.3 6
2. 基金赎回款	-156,690.37 2.18	-	-3,027,794.6 1	-159,718.16 6.79
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	51,378,884.9 9	-	5,724,082.05	57,102,967.0 4

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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2022年6月30日和2021年6月30日的财务状况、2022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

除下文6.4.5.1会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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2022年01月01日至2022年06月30日。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(一) 金融资产的分类

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

本基金持有的股票投资、基金投资及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。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

1. 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
2. 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本基金可以将本应以摊余成本计量的金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，

本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(二) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

2. 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

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。

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

(一) 金融工具的初始确认

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

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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。

(二) 金融工具的后续计量

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

2. 以摊余成本计量的金融资产

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

3. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

4. 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(三) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

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) 因转移金融资产而收到的对价。

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

(四) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备，本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

对于应收账款，本基金始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

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

1. 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

2. 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似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。

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。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并计入投资收益。

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

债券利息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）后的净额确认为当期损益。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，计算利息计入当期损益。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计入当期损益。

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。

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

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配。每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告，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，投资人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；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；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；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。

6.4.4.12 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

本基金自2022年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第23号—金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第24号—套期会计(修订)》及《企业会计准则第37号—金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和2022年中国证监会发布的修订的《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〉》。

(一) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于2006年颁布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》和《企业会计准则第24号—套期保值》以及财政部于2014年修订的《企业会计准则第37号—金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的未来现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日(即2022年1月1日)未终止确认的金融工具的分类和计量(含减值)进行追溯调整。本基金未调整比较

财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入2022年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

1. 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款6,662,164.67元、存出保证金834,244.40元、买入返售金融资产3,400,000.00元、应收利息275.05元、应收申购款121,193.67元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款6,663,302.21元、存出保证金834,509.51元、买入返售金融资产3,398,871.92元、应收申购款121,193.67元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币129,617,278.78元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币129,617,279.25元。

以摊余成本计量的金融负债

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款3,264,369.80元、应付赎回费20.01元、应付管理人报酬94,778.48元、应付托管费17,771.00元、应付销售服务费16,520.19元和其他负债300,000.00元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款3,264,369.80元、应付赎回费20.01元、应付管理人报酬94,778.48元、应付托管费17,771.00元、应付销售服务费16,520.19元和其他负债300,000.00元。

于2021年12月31日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(二) 修订的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

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税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 2022年06月30日
活期存款	3,074,217.14
等于：本金	3,073,451.88
加：应计利息	765.26

减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	3,017,569.40
等于：本金	3,017,352.95
加：应计利息	216.45
减：坏账准备	-
合计	6,091,786.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	99,474,984.19	-	103,239,127.80	3,764,143.61
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	99,474,984.19	-	103,239,127.80	3,764,143.61
----	---------------	---	----------------	--------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2022年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	700,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	700,000.00	-

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 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）。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4.35
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用-审计费	39,671.58
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	100,477.50
合计	199,660.80

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中加中证500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (中加中证500指数增强A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	66,585,931.46	66,585,931.46
本期申购	2,690,333.55	2,690,333.55
本期赎回(以“-”号填列)	-21,219,037.85	-21,219,037.85
本期末	48,057,227.16	48,057,227.16

6.4.7.7.2 中加中证500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (中加中证500指数增强C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	54,946,361.91	54,946,361.91
本期申购	17,872,503.90	17,872,503.90
本期赎回(以“-”号填列)	-14,434,050.22	-14,434,050.22
本期末	58,384,815.59	58,384,815.59

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中加中证500指数增强A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

(中加中证500指数增强A)			
本期期初	10,653,449.37	-2,068,599.72	8,584,849.65
本期利润	-9,666,342.11	1,431,956.72	-8,234,385.39
本期基金份额交易产生的变动数	95,932.28	1,174,914.92	1,270,847.20
其中：基金申购款	205,482.56	-151,856.35	53,626.21
基金赎回款	-109,550.28	1,326,771.27	1,217,220.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,083,039.54	538,271.92	1,621,311.46

6.4.7.8.2 中加中证500指数增强C

单位：人民币元

项目 (中加中证500指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	8,529,879.30	-1,705,325.23	6,824,554.07
本期利润	-8,182,047.30	2,648,776.40	-5,533,270.90
本期基金份额交易产生的变动数	640,597.19	-303,496.32	337,100.87
其中：基金申购款	1,252,104.08	-1,057,073.30	195,030.78
基金赎回款	-611,506.89	753,576.98	142,070.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	988,429.19	639,954.85	1,628,384.04

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	19,012.34
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,524.10

结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	21,536.44

注：其他存款利息收入为券商保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	665,096,683.31
减：卖出股票成本总额	682,068,275.57
减：交易费用	1,473,885.55
买卖股票差价收入	-18,445,477.81

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	12.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	18,136.71
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	18,149.15

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）	103,250.06

成交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	85,100.00
减：应计利息总额	13.25
减：交易费用	0.10
买卖债券差价收入	18,136.71

注：本基金本报告期内无债转股业务。

6.4.7.12 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 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,378,481.30
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,378,481.30

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	4,080,733.12

——股票投资	4,080,733.12
——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	4,080,733.12

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	21,919.62
合计	21,919.62

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
中信建投 证券	1,313,894,741.24	100.00%	723,635,865.41	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
中信建投 证券	185,350.44	100.00%	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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
中信建投 证券	79,600,000.00	100.00%	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 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例

		例		
中信建投 证券	687,726.61	100.00%	-	-
关联方名 称	上年度可比期间 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	100.00%	-	-

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至202 2年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	476,917.52	248,155.45
其中：支付销售机构的客户维护费	54,000.14	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 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 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	89,421.97	46,529.19

注：支付基金托管人中信建投证券股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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 2022年01月01日至2022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	54,252.80	54,252.80
北京银行股份有限公司	0.00	675.21	675.21
中信建投证券股份有限公司	0.00	26,734.66	26,734.66
合计	-	81,662.67	81,662.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年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	-	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

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

6.4.10.4 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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信建投证券股份有限公司	3,074,217.14	19,012.34	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 2022年01月01日至2022年06月30日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信建投证券股份有限公司	603272	联翔股份	网下发行	443	6,042.52
中信建投证券股份有限公司	601089	福元医药	网下发行	1,749	25,570.38
中信建投证券股份有限公司	688153	唯捷创芯	网下发行	826	55,011.60
中信建投证券股份有限公司	688197	首药控股	网下发行	3,465	138,253.50
中信建投证券股份有限公司	113057	中银转债	原股东优先配售	110	11,000.00
中信	110085	通22转债	原股东优先配售	190	19,000.00

建投 证券 股份 有限 公司					
中信 建投 证券 股份 有限 公司	688281	华秦科技	网下发行	284	53,818.00
中信 建投 证券 股份 有限 公司	301181	标榜股份	网下发行	915	36,828.75
中信 建投 证券 股份 有限 公司	001227	兰州银行	网下发行	7,868	28,088.76
中信 建投 证券 股份 有限 公司	688223	晶科能源	网下发行	14,342	71,710.00
中信 建投 证券 股份 有限	301206	三元生物	网下发行	505	55,196.50

公司					
上年度可比期间 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
中信建投证券股份有限公司	688689	银河微电	网下发行	1,857	26,016.57
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

有限公司					
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——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301136	招标股份	2021-12-31	6个月以上	首次公开发行带锁定期	10.52	19.74	3,925	41,291.00	77,479.50	-
688102	斯瑞新材	2022-03-	6个月以	首次公开发行	10.48	12.23	4,953	51,907.4	60,575.1	-

		09	上	带锁定期				4	9	
688115	思林杰	2022-03-07	6个月以上	首次公开发行带锁定期	65.65	38.46	646	42,409.90	24,845.16	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6个月以上	首次公开发行带锁定期	50.31	70.37	85	4,276.35	5,981.45	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	6个月以上	首次公开发行带锁定期	46.80	54.44	98	4,586.40	5,335.12	-
301235	华康医疗	2022-01-21	6个月以上	首次公开发行带锁定期	39.30	37.93	140	5,502.00	5,310.20	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6个月以上	首次公开发行带锁定期	20.08	20.34	248	4,979.84	5,044.32	-
301201	诚达药业	2022-01-12	6个月以上	首次公开发行带锁定期	72.69	71.54	66	4,797.54	4,721.64	-
301158	德石股份	2022-01-07	6个月以上	首次公开发行带锁定期	15.64	20.38	231	3,612.84	4,707.78	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月以上	首次公开发行带锁定期	56.88	56.42	71	4,038.48	4,005.82	-

301206	三元生物	2022-01-26	6个月以上	首次公开发行带锁定期	73.35	45.69	76	5,574.30	3,472.44	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月以上	首次公开发行带锁定期	37.23	25.39	113	4,206.99	2,869.07	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月以上	首次公开发行带锁定期	40.25	30.59	92	3,703.00	2,814.28	-
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月以上	首次公开发行带锁定期	55.57	30.03	77	4,278.89	2,312.31	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月以上	首次公开发行带锁定期	64.08	37.52	41	2,627.28	1,538.32	-

注：1. 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。

2. 本基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数量中。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2022年06月30日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022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2022年06月30日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款主要存放在本基金的托管人和信用风险较低的股份制商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	3,000.00
未评级	-	-
合计	-	3,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 以上数据不合同业存单及资产支持证券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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

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

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12(如有)外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	6,091,786.54	-	-	-	6,091,786.54
交易性金融资产	-	-	-	103,239,127.80	103,239,127.80
买入返售金融资产	700,000.00	-	-	-	700,000.00
应收申购款	-	-	-	40,949.15	40,949.15
资产总计	6,791,786.54	-	-	103,280,076.95	110,071,863.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	82,610.61	82,610.61
应付管理人报酬	-	-	-	70,227.07	70,227.07
应付托管费	-	-	-	13,167.57	13,167.57
应付销售服务费	-	-	-	14,459.19	14,459.19
其他负债	-	-	-	199,660.80	199,660.80
负债总计	-	-	-	380,125.24	380,125.24
利率敏感度缺口	6,791,786.54	-	-	102,899,951.71	109,691,738.25
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,496,409.07	-	-	-	7,496,409.07
交易性金融资产	3,000.00	-	-	129,614,278.78	129,617,278.78
买入返售金融资产	3,400,000.00	-	-	-	3,400,000.00
其他资	-	-	-	275.05	275.05

产					
应收申购款	-	-	-	121,193.67	121,193.67
资产总计	10,899,409.07	-	-	129,735,747.50	140,635,156.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,264,369.80	3,264,369.80
应付管理人报酬	-	-	-	94,778.48	94,778.48
应付托管费	-	-	-	17,771.00	17,771.00
应付销售服务费	-	-	-	16,520.19	16,520.19
其他负债	-	-	-	300,020.01	300,020.01
负债总计	-	-	-	3,693,459.48	3,693,459.48
利率敏感度缺口	10,899,409.07	-	-	126,042,288.02	136,941,697.09

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格的风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	103,239,127.80	94.12	129,614,278.78	94.65
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	3,000.00	-
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	103,239,127.80	94.12	129,617,278.78	94.65

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较标准以外的其他市场变量保持不变；Beta系数是根据成立以来的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	4,929,812.95	5,473,288.09
	业绩比较基准下降5%	-4,929,812.95	-5,473,288.09

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	103,028,115.20	129,304,924.68
第二层次	-	215,499.03
第三层次	211,012.60	96,855.07
合计	103,239,127.80	129,617,278.78

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2021年12月31日：无）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2022年06月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	103,239,127.80	93.79
	其中：股票	103,239,127.80	93.79
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	700,000.00	0.64
	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	6,091,786.54	5.53
8	其他各项资产	40,949.15	0.04
9	合计	110,071,863.49	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	361,618.00	0.33
B	采矿业	4,372,192.36	3.99
C	制造业	51,917,252.31	47.33

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,640,373.00	2.41
E	建筑业	1,781,372.00	1.62
F	批发和零售业	2,339,932.20	2.13
G	交通运输、仓储和邮政业	3,315,088.80	3.02
H	住宿和餐饮业	76,880.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,214,016.15	5.66
J	金融业	7,723,735.10	7.04
K	房地产业	1,029,007.00	0.94
L	租赁和商务服务业	1,392,024.87	1.27
M	科学研究和技术服务业	1,112,279.00	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	46,954.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,180,110.00	1.99
R	文化、体育和娱乐业	1,465,031.00	1.34
S	综合	1,634,836.00	1.49
	合计	89,602,701.79	81.69

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	106,247.00	0.10
B	采矿业	601,930.00	0.55
C	制造业	8,791,333.67	8.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	389,411.20	0.36
E	建筑业	179,902.00	0.16
F	批发和零售业	1,234,626.00	1.13

G	交通运输、仓储和邮政业	60,452.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	242,079.12	0.22
J	金融业	868,287.00	0.79
K	房地产业	408,660.00	0.37
L	租赁和商务服务业	412,085.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	87,834.02	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	221,846.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	22,931.00	0.02
S	综合	8,802.00	0.01
	合计	13,636,426.01	12.43

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	300037	新宙邦	71,160	3,740,169.60	3.41
2	600486	扬农化工	19,000	2,532,320.00	2.31
3	300244	迪安诊断	70,100	2,180,110.00	1.99
4	600582	天地科技	451,800	2,159,604.00	1.97

5	002815	崇达技术	138,494	1,774,108.14	1.62
6	600673	东阳光	180,500	1,622,695.00	1.48
7	300769	德方纳米	3,480	1,422,206.40	1.30
8	000553	安道麦A	116,000	1,404,760.00	1.28
9	600350	山东高速	267,200	1,402,800.00	1.28
10	601872	招商轮船	241,900	1,393,344.00	1.27
11	000559	万向钱潮	210,400	1,249,776.00	1.14
12	000728	国元证券	197,200	1,226,584.00	1.12
13	600959	江苏有线	373,100	1,216,306.00	1.11
14	300482	万孚生物	29,500	1,200,945.00	1.09
15	002797	第一创业	185,400	1,188,414.00	1.08
16	600572	康恩贝	259,700	1,150,471.00	1.05
17	600597	光明乳业	90,100	1,137,963.00	1.04
18	000778	新兴铸管	229,600	1,106,672.00	1.01
19	000960	锡业股份	62,400	1,046,448.00	0.95
20	603198	迎驾贡酒	15,700	1,022,698.00	0.93
21	002756	永兴材料	6,700	1,019,807.00	0.93
22	600648	外高桥	74,452	1,012,547.20	0.92
23	601992	金隅集团	357,400	989,998.00	0.90
24	002240	盛新锂能	16,100	971,796.00	0.89
25	300390	天华超净	11,000	961,400.00	0.88
26	600256	广汇能源	87,500	922,250.00	0.84
27	300308	中际旭创	29,100	903,555.00	0.82
28	000738	航发控制	32,100	902,010.00	0.82
29	600985	淮北矿业	61,900	901,264.00	0.82
30	300012	华测检测	37,900	879,659.00	0.80
31	600373	中文传媒	84,400	843,156.00	0.77
32	600415	小商品城	150,700	839,399.00	0.77
33	600667	太极实业	111,600	823,608.00	0.75
34	601077	渝农商行	218,700	809,190.00	0.74
35	600917	重庆燃气	110,700	799,254.00	0.73

36	600839	四川长虹	277,500	799,200.00	0.73
37	000598	兴蓉环境	153,600	784,896.00	0.72
38	000970	中科三环	40,365	758,054.70	0.69
39	000709	河钢股份	331,400	748,964.00	0.68
40	601168	西部矿业	62,700	741,741.00	0.68
41	002831	裕同科技	25,000	738,750.00	0.67
42	603927	中科软	30,000	699,600.00	0.64
43	002396	星网锐捷	30,900	699,576.00	0.64
44	601615	明阳智能	20,500	692,900.00	0.63
45	300630	普利制药	19,000	667,850.00	0.61
46	002505	鹏都农牧	195,700	663,423.00	0.60
47	000519	中兵红箭	22,300	650,045.00	0.59
48	002004	华邦健康	112,300	626,634.00	0.57
49	600160	巨化股份	47,200	620,680.00	0.57
50	002948	青岛银行	167,800	607,436.00	0.55
51	002465	海格通信	66,100	600,849.00	0.55
52	002212	天融信	58,875	597,581.25	0.54
53	300363	博腾股份	7,600	592,724.00	0.54
54	600131	国网信通	43,100	579,695.00	0.53
55	600095	湘财股份	73,100	562,139.00	0.51
56	300009	安科生物	55,200	558,072.00	0.51
57	000750	国海证券	153,300	556,479.00	0.51
58	600970	中材国际	56,400	546,516.00	0.50
59	601699	潞安环能	33,700	492,694.00	0.45
60	601555	东吴证券	69,840	483,991.20	0.44
61	600177	雅戈尔	72,400	480,012.00	0.44
62	600372	中航电子	23,000	445,970.00	0.41
63	601928	凤凰传媒	61,700	441,155.00	0.40
64	603605	珀莱雅	2,640	436,075.20	0.40
65	688099	晶晨股份	4,222	426,422.00	0.39
66	601128	常熟银行	52,300	399,572.00	0.36

67	600580	卧龙电驱	27,700	399,434.00	0.36
68	600901	江苏租赁	77,200	396,036.00	0.36
69	603613	国联股份	4,410	390,726.00	0.36
70	688188	柏楚电子	1,715	377,368.60	0.34
71	603267	鸿远电子	2,800	376,124.00	0.34
72	600863	内蒙华电	103,000	375,950.00	0.34
73	600325	华发股份	47,500	359,575.00	0.33
74	300618	寒锐钴业	6,200	359,104.00	0.33
75	600166	福田汽车	126,400	357,712.00	0.33
76	002625	光启技术	20,600	355,762.00	0.32
77	000930	中粮科技	39,000	352,560.00	0.32
78	600867	通化东宝	33,500	346,390.00	0.32
79	002985	北摩高科	5,790	339,178.20	0.31
80	600392	盛和资源	15,000	339,000.00	0.31
81	300073	当升科技	3,700	334,258.00	0.30
82	600563	法拉电子	1,600	328,256.00	0.30
83	600282	南钢股份	101,400	319,410.00	0.29
84	688185	康希诺	1,600	318,528.00	0.29
85	600141	兴发集团	7,200	316,728.00	0.29
86	603786	科博达	5,000	307,850.00	0.28
87	600499	科达制造	14,900	307,536.00	0.28
88	000050	深天马 A	29,500	294,115.00	0.27
89	600968	海油发展	113,400	292,572.00	0.27
90	002500	山西证券	48,320	277,356.80	0.25
91	300017	网宿科技	51,400	275,504.00	0.25
92	600236	桂冠电力	44,800	272,832.00	0.25
93	002690	美亚光电	12,520	271,433.60	0.25
94	688521	芯原股份	5,484	270,909.60	0.25
95	600885	宏发股份	6,420	268,677.00	0.24
96	000937	冀中能源	35,300	263,338.00	0.24
97	002422	科伦药业	13,800	258,060.00	0.24

98	600039	四川路桥	24,400	256,932.00	0.23
99	601828	美凯龙	42,100	255,126.00	0.23
100	002191	劲嘉股份	23,300	249,776.00	0.23
101	600536	中国软件	6,130	248,816.70	0.23
102	000630	铜陵有色	74,900	244,174.00	0.22
103	600765	中航重机	7,500	241,350.00	0.22
104	002439	启明星辰	11,900	237,167.00	0.22
105	600208	新湖中宝	85,000	234,600.00	0.21
106	002416	爱施德	25,200	234,360.00	0.21
107	601958	金钼股份	26,400	233,376.00	0.21
108	300888	稳健医疗	3,400	226,100.00	0.21
109	600967	内蒙一机	24,100	219,792.00	0.20
110	000932	华菱钢铁	40,400	205,636.00	0.19
111	002624	完美世界	14,100	202,617.00	0.18
112	000415	渤海租赁	92,800	201,376.00	0.18
113	600008	首创环保	68,900	199,810.00	0.18
114	002384	东山精密	8,700	199,491.00	0.18
115	600862	中航高科	7,000	196,700.00	0.18
116	002497	雅化集团	5,900	192,635.00	0.18
117	000729	燕京啤酒	19,500	188,370.00	0.17
118	603355	莱克电气	7,400	186,702.00	0.17
119	300463	迈克生物	9,100	186,459.00	0.17
120	600718	东软集团	16,100	185,311.00	0.17
121	688009	中国通号	40,900	185,277.00	0.17
122	601866	中远海发	60,500	181,500.00	0.17
123	300474	景嘉微	2,600	177,814.00	0.16
124	603077	和邦生物	41,700	177,642.00	0.16
125	300182	捷成股份	32,000	176,000.00	0.16
126	003035	南网能源	27,600	175,260.00	0.16
127	603658	安图生物	3,500	171,115.00	0.16
128	600909	华安证券	37,400	170,170.00	0.16

129	600201	生物股份	18,400	168,544.00	0.15
130	000563	陕国投 A	52,800	164,736.00	0.15
131	000402	金融街	27,000	160,650.00	0.15
132	603026	石大胜华	1,100	159,885.00	0.15
133	600598	北大荒	10,800	159,408.00	0.15
134	000830	鲁西化工	9,200	159,068.00	0.15
135	002028	思源电气	4,300	153,338.00	0.14
136	001872	招商港口	9,788	152,692.80	0.14
137	600820	隧道股份	24,800	151,776.00	0.14
138	002268	卫士通	3,300	141,603.00	0.13
139	603589	口子窖	2,400	140,664.00	0.13
140	000488	晨鸣纸业	24,600	138,744.00	0.13
141	002506	协鑫集成	36,800	136,896.00	0.12
142	600497	驰宏锌锗	26,100	135,459.00	0.12
143	603345	安井食品	800	134,296.00	0.12
144	600566	济川药业	4,900	133,084.00	0.12
145	600875	东方电气	8,000	131,600.00	0.12
146	600739	辽宁成大	9,000	131,220.00	0.12
147	600535	天士力	12,200	128,222.00	0.12
148	000983	山西焦煤	9,500	127,205.00	0.12
149	603868	飞科电器	1,600	121,200.00	0.11
150	002128	电投能源	8,048	115,247.36	0.11
151	603156	养元饮品	4,900	111,328.00	0.10
152	601179	中国西电	23,500	109,980.00	0.10
153	000998	隆平高科	6,600	109,956.00	0.10
154	300136	信维通信	6,500	109,525.00	0.10
155	600528	中铁工业	13,500	108,675.00	0.10
156	002185	华天科技	11,500	107,870.00	0.10
157	002925	盈趣科技	5,000	107,600.00	0.10
158	002368	太极股份	5,500	105,655.00	0.10
159	600507	方大特钢	15,100	105,549.00	0.10

160	002030	达安基因	6,100	104,859.00	0.10
161	601139	深圳燃气	15,100	104,794.00	0.10
162	600390	五矿资本	20,600	100,734.00	0.09
163	000400	许继电气	5,100	97,920.00	0.09
164	601108	财通证券	12,100	95,227.00	0.09
165	601118	海南橡胶	19,300	92,254.00	0.08
166	601718	际华集团	29,400	91,140.00	0.08
167	002557	洽洽食品	1,600	91,088.00	0.08
168	600195	中牧股份	7,400	90,724.00	0.08
169	600811	东方集团	32,000	90,560.00	0.08
170	000547	航天发展	7,500	89,550.00	0.08
171	600848	上海临港	6,400	86,784.00	0.08
172	600064	南京高科	7,800	85,800.00	0.08
173	002155	湖南黄金	6,900	83,766.00	0.08
174	000783	长江证券	13,700	81,241.00	0.07
175	600329	达仁堂	3,300	81,114.00	0.07
176	601665	齐鲁银行	16,400	80,032.00	0.07
177	600380	健康元	6,300	77,805.00	0.07
178	600258	首旅酒店	3,100	76,880.00	0.07
179	002468	申通快递	6,400	76,288.00	0.07
180	002203	海亮股份	6,509	75,178.95	0.07
181	603939	益丰药房	1,400	73,962.00	0.07
182	601456	国联证券	6,000	73,620.00	0.07
183	002078	太阳纸业	5,900	72,629.00	0.07
184	000012	南玻 A	9,600	71,232.00	0.06
185	601696	中银证券	5,100	67,830.00	0.06
186	002183	怡亚通	9,400	67,774.00	0.06
187	002673	西部证券	10,200	66,708.00	0.06
188	002249	大洋电机	10,700	65,698.00	0.06
189	000807	云铝股份	6,600	65,208.00	0.06
190	002595	豪迈科技	2,900	64,786.00	0.06

191	000825	太钢不锈	11,700	63,765.00	0.06
192	001203	大中矿业	5,600	63,280.00	0.06
193	600482	中国动力	3,900	61,269.00	0.06
194	300253	卫宁健康	6,900	60,582.00	0.06
195	000629	攀钢钒钛	15,800	60,040.00	0.05
196	600398	海澜之家	12,600	59,850.00	0.05
197	600511	国药股份	2,200	58,916.00	0.05
198	000987	越秀金控	8,370	58,841.10	0.05
199	300676	华大基因	800	57,360.00	0.05
200	002867	周大生	3,600	55,908.00	0.05
201	000027	深圳能源	8,700	55,767.00	0.05
202	002936	郑州银行	20,500	55,145.00	0.05
203	600271	航天信息	5,000	54,700.00	0.05
204	300832	新产业	1,200	54,132.00	0.05
205	300212	易华录	3,100	53,940.00	0.05
206	600171	上海贝岭	2,100	52,563.00	0.05
207	300357	我武生物	1,000	52,030.00	0.05
208	000988	华工科技	2,200	50,974.00	0.05
209	600056	中国医药	3,360	49,795.20	0.05
210	603866	桃李面包	2,980	49,319.00	0.04
211	002195	二三四五	21,100	47,475.00	0.04
212	300699	光威复材	800	47,096.00	0.04
213	600316	洪都航空	1,500	45,360.00	0.04
214	600728	佳都科技	7,000	45,220.00	0.04
215	600737	中粮糖业	6,000	45,120.00	0.04
216	601162	天风证券	14,100	44,838.00	0.04
217	601016	节能风电	9,300	44,640.00	0.04
218	000898	鞍钢股份	13,200	42,504.00	0.04
219	000887	中鼎股份	2,300	41,952.00	0.04
220	600376	首开股份	8,500	41,735.00	0.04
221	600755	厦门国贸	5,500	41,250.00	0.04

222	000513	丽珠集团	1,100	39,831.00	0.04
223	600717	天津港	9,600	38,496.00	0.04
224	600315	上海家化	900	38,475.00	0.04
225	600782	新钢股份	7,400	37,296.00	0.03
226	600787	中储股份	6,300	35,847.00	0.03
227	600663	陆家嘴	3,400	35,224.00	0.03
228	688819	天能股份	1,000	34,580.00	0.03
229	600529	山东药玻	1,200	33,540.00	0.03
230	002532	天山铝业	5,100	33,303.00	0.03
231	600435	北方导航	3,700	31,894.00	0.03
232	688029	南微医学	360	31,392.00	0.03
233	603883	老百姓	910	30,830.80	0.03
234	002945	华林证券	2,000	30,500.00	0.03
235	600216	浙江医药	2,200	30,030.00	0.03
236	002407	多氟多	600	29,346.00	0.03
237	002372	伟星新材	1,200	28,848.00	0.03
238	688088	虹软科技	900	28,431.00	0.03
239	002010	传化智联	4,409	28,349.87	0.03
240	000062	深圳华强	2,200	27,940.00	0.03
241	000999	华润三九	600	27,000.00	0.02
242	600879	航天电子	4,100	26,609.00	0.02
243	000401	冀东水泥	2,400	25,248.00	0.02
244	601187	厦门银行	4,200	25,032.00	0.02
245	600705	中航产融	7,100	24,566.00	0.02
246	000686	东北证券	3,500	24,465.00	0.02
247	002745	木林森	2,400	23,448.00	0.02
248	600498	烽火通信	1,600	23,168.00	0.02
249	603707	健友股份	800	22,560.00	0.02
250	000717	韶钢松山	6,300	22,050.00	0.02
251	001965	招商公路	2,700	20,601.00	0.02
252	601990	南京证券	2,400	20,016.00	0.02

253	600623	华谊集团	2,400	19,920.00	0.02
254	002399	海普瑞	1,100	19,338.00	0.02
255	002048	宁波华翔	1,100	17,622.00	0.02
256	002266	浙富控股	3,600	17,244.00	0.02
257	603568	伟明环保	500	16,685.00	0.02
258	603650	彤程新材	500	16,290.00	0.01
259	600928	西安银行	4,300	15,781.00	0.01
260	688006	杭可科技	200	14,012.00	0.01
261	000021	深科技	1,200	13,968.00	0.01
262	600801	华新水泥	700	13,657.00	0.01
263	000997	新大陆	1,000	13,210.00	0.01
264	300070	碧水源	2,500	13,025.00	0.01
265	600895	张江高科	1,000	12,450.00	0.01
266	000009	中国宝安	900	12,141.00	0.01
267	600118	中国卫星	600	12,048.00	0.01
268	600299	安迪苏	1,200	11,496.00	0.01
269	002653	海思科	700	11,277.00	0.01
270	000537	广宇发展	800	10,392.00	0.01
271	600556	天下秀	1,200	9,876.00	0.01
272	600546	山煤国际	500	9,730.00	0.01
273	000039	中集集团	688	9,528.80	0.01
274	600126	杭钢股份	1,800	9,216.00	0.01
275	300724	捷佳伟创	100	8,935.00	0.01
276	002281	光迅科技	500	8,790.00	0.01
277	600377	宁沪高速	800	6,856.00	0.01
278	002966	苏州银行	1,120	6,832.00	0.01
279	600517	国网英大	1,300	6,747.00	0.01
280	600079	人福医药	400	6,400.00	0.01
281	600233	圆通速递	300	6,117.00	0.01
282	000028	国药一致	200	5,958.00	0.01
283	603517	绝味食品	100	5,782.00	0.01

284	688289	圣湘生物	192	5,685.12	0.01
285	601098	中南传媒	500	4,720.00	0.00
286	002156	通富微电	300	4,620.00	0.00
287	300677	英科医疗	160	4,057.60	0.00
288	300024	机器人	400	4,032.00	0.00
289	002508	老板电器	100	3,603.00	0.00
290	300257	开山股份	200	2,992.00	0.00
291	000623	吉林敖东	200	2,952.00	0.00
292	600062	华润双鹤	100	2,566.00	0.00
293	002081	金螳螂	500	2,540.00	0.00
294	601991	大唐发电	1,000	2,430.00	0.00
295	000581	威孚高科	100	1,925.00	0.00
296	601608	中信重工	500	1,895.00	0.00
297	001914	招商积余	100	1,797.00	0.00
298	601198	东兴证券	200	1,780.00	0.00
299	600155	华创阳安	200	1,696.00	0.00
300	601568	北元集团	200	1,268.00	0.00
301	601298	青岛港	100	547.00	0.00
302	601003	柳钢股份	100	405.00	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	002383	合众思壮	110,100	657,297.00	0.60
2	000034	神州数码	34,900	531,178.00	0.48
3	601677	明泰铝业	20,820	495,516.00	0.45
4	600389	江山股份	7,800	473,694.00	0.43
5	300661	圣邦股份	2,550	464,151.00	0.42
6	603337	杰克股份	20,300	436,044.00	0.40
7	600438	通威股份	7,200	430,992.00	0.39

8	600188	兖矿能源	9,600	379,008.00	0.35
9	600649	城投控股	84,800	362,944.00	0.33
10	002013	中航机电	27,800	343,330.00	0.31
11	000933	神火股份	26,100	341,388.00	0.31
12	600873	梅花生物	29,200	329,376.00	0.30
13	300475	香农芯创	15,900	320,385.00	0.29
14	600089	特变电工	10,500	287,595.00	0.26
15	601933	永辉超市	66,400	284,192.00	0.26
16	002748	世龙实业	18,300	270,657.00	0.25
17	300268	佳沃食品	8,500	252,875.00	0.23
18	601231	环旭电子	17,300	248,428.00	0.23
19	600030	中信证券	11,350	245,841.00	0.22
20	603300	华铁应急	27,900	222,363.00	0.20
21	601211	国泰君安	13,300	202,160.00	0.18
22	300601	康泰生物	4,380	197,888.40	0.18
23	300957	贝泰妮	900	195,777.00	0.18
24	601009	南京银行	18,700	194,854.00	0.18
25	601390	中国中铁	29,300	179,902.00	0.16
26	002216	三全食品	8,800	172,392.00	0.16
27	300504	天邑股份	9,100	161,616.00	0.15
28	601857	中国石油	28,600	151,580.00	0.14
29	603013	亚普股份	10,800	150,876.00	0.14
30	000625	长安汽车	8,580	148,605.60	0.14
31	000915	华特达因	3,500	144,725.00	0.13
32	002792	通宇通讯	11,200	135,072.00	0.12
33	603392	万泰生物	845	131,228.50	0.12
34	603588	高能环境	10,700	123,371.00	0.11
35	600057	厦门象屿	14,000	123,060.00	0.11
36	002841	视源股份	1,600	120,512.00	0.11
37	600690	海尔智家	4,300	118,078.00	0.11
38	600176	中国巨石	6,600	114,906.00	0.10

39	000767	晋控电力	29,400	109,662.00	0.10
40	002696	百洋股份	18,100	106,247.00	0.10
41	603177	德创环保	6,500	98,475.00	0.09
42	003816	中国广核	33,100	92,680.00	0.08
43	300532	今天国际	7,100	91,164.00	0.08
44	002318	久立特材	5,300	84,747.00	0.08
45	002301	齐心集团	12,500	82,500.00	0.08
46	600449	宁夏建材	6,600	80,322.00	0.07
47	301136	招标股份	3,925	77,479.50	0.07
48	600741	华域汽车	3,200	73,600.00	0.07
49	688200	华峰测控	200	71,280.00	0.06
50	002471	中超控股	26,700	67,551.00	0.06
51	601916	浙商银行	20,200	67,064.00	0.06
52	301035	润丰股份	800	65,960.00	0.06
53	600320	振华重工	19,616	65,909.76	0.06
54	600578	京能电力	20,800	65,104.00	0.06
55	603995	甬金股份	1,875	63,112.50	0.06
56	002466	天齐锂业	500	62,400.00	0.06
57	688102	斯瑞新材	4,953	60,575.19	0.06
58	600428	中远海特	12,700	60,452.00	0.06
59	000938	紫光股份	3,100	60,140.00	0.05
60	605358	立昂微	864	58,216.32	0.05
61	605123	派克新材	400	56,288.00	0.05
62	600760	中航沈飞	900	54,405.00	0.05
63	002432	九安医疗	900	54,054.00	0.05
64	300233	金城医药	1,700	48,501.00	0.04
65	002267	陕天然气	6,900	48,231.00	0.04
66	002192	融捷股份	300	46,110.00	0.04
67	000700	模塑科技	8,700	45,327.00	0.04
68	600310	桂东电力	12,540	43,012.20	0.04
69	300662	科锐国际	800	41,512.00	0.04

70	002648	卫星化学	1,600	41,360.00	0.04
71	600328	中盐化工	1,700	40,035.00	0.04
72	603003	龙宇燃油	5,200	38,688.00	0.04
73	601099	太平洋	12,800	38,272.00	0.03
74	601838	成都银行	2,300	38,134.00	0.03
75	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.03
76	600713	南京医药	7,400	36,038.00	0.03
77	000917	电广传媒	6,700	35,577.00	0.03
78	300533	冰川网络	1,300	34,190.00	0.03
79	002032	苏泊尔	600	33,804.00	0.03
80	601998	中信银行	7,000	33,250.00	0.03
81	688177	百奥泰	1,500	32,790.00	0.03
82	601988	中国银行	10,000	32,600.00	0.03
83	002943	宇晶股份	600	30,900.00	0.03
84	600900	长江电力	1,300	30,056.00	0.03
85	002759	天际股份	1,100	29,898.00	0.03
86	002371	北方华创	100	27,712.00	0.03
87	600288	大恒科技	1,900	27,550.00	0.03
88	300025	华星创业	5,300	26,235.00	0.02
89	300293	蓝英装备	2,500	26,000.00	0.02
90	688115	思林杰	646	24,845.16	0.02
91	000836	富通信息	8,400	24,780.00	0.02
92	600639	浦东金桥	1,800	24,462.00	0.02
93	002042	华孚时尚	5,700	21,546.00	0.02
94	002878	元隆雅图	1,100	21,230.00	0.02
95	000541	佛山照明	4,100	21,033.00	0.02
96	002510	天汽模	4,300	17,501.00	0.02
97	603659	璞泰来	200	16,880.00	0.02
98	600019	宝钢股份	2,800	16,856.00	0.02
99	603899	晨光股份	300	16,824.00	0.02
10	002343	慈文传媒	2,900	16,443.00	0.01

0					
10 1	600459	贵研铂业	900	16,299.00	0.01
10 2	600362	江西铜业	900	16,047.00	0.01
10 3	600104	上汽集团	900	16,029.00	0.01
10 4	300900	广联航空	600	16,020.00	0.01
10 5	688136	科兴制药	600	15,900.00	0.01
10 6	600976	健民集团	300	15,345.00	0.01
10 7	000919	金陵药业	2,000	15,140.00	0.01
10 8	000948	南天信息	1,200	14,760.00	0.01
10 9	300777	中简科技	300	14,460.00	0.01
11 0	300775	三角防务	300	14,445.00	0.01
11 1	002544	普天科技	600	13,650.00	0.01
11 2	000733	振华科技	100	13,597.00	0.01
11 3	600547	山东黄金	700	12,992.00	0.01
11 4	002459	晶澳科技	160	12,624.00	0.01
11 5	000567	海德股份	830	12,284.00	0.01
11 6	600028	中国石化	3,000	12,240.00	0.01

11 7	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
11 8	688065	凯赛生物	100	11,180.00	0.01
11 9	002258	利尔化学	460	10,865.20	0.01
12 0	002615	哈尔斯	1,700	10,574.00	0.01
12 1	600048	保利发展	600	10,476.00	0.01
12 2	600295	鄂尔多斯	560	10,108.00	0.01
12 3	300170	汉得信息	1,000	9,010.00	0.01
12 4	600805	悦达投资	1,800	8,802.00	0.01
12 5	000652	泰达股份	2,200	8,800.00	0.01
12 6	000403	派林生物	400	8,784.00	0.01
12 7	002276	万马股份	1,100	8,602.00	0.01
12 8	002795	永和智控	1,000	8,220.00	0.01
12 9	000708	中信特钢	400	8,060.00	0.01
13 0	002133	广宇集团	2,200	7,986.00	0.01
13 1	300647	超频三	700	7,868.00	0.01
13 2	002415	海康威视	200	7,240.00	0.01
13	300583	赛托生物	300	6,780.00	0.01

3					
13 4	601728	中国电信	1,800	6,714.00	0.01
13 5	601900	南方传媒	800	6,488.00	0.01
13 6	002472	双环传动	200	6,368.00	0.01
13 7	000016	深康佳 A	1,000	6,050.00	0.01
13 8	301122	采纳股份	85	5,981.45	0.01
13 9	002410	广联达	100	5,444.00	0.00
14 0	301117	佳缘科技	98	5,335.12	0.00
14 1	301235	华康医疗	140	5,310.20	0.00
14 2	301228	实朴检测	248	5,044.32	0.00
14 3	301201	诚达药业	66	4,721.64	0.00
14 4	301158	德石股份	231	4,707.78	0.00
14 5	600232	金鹰股份	800	4,560.00	0.00
14 6	688575	亚辉龙	200	4,184.00	0.00
14 7	301207	华兰疫苗	71	4,005.82	0.00
14 8	300612	宣亚国际	200	3,920.00	0.00
14 9	002736	国信证券	400	3,828.00	0.00

150	002009	天奇股份	200	3,700.00	0.00
151	301206	三元生物	76	3,472.44	0.00
152	600596	新安股份	160	3,464.00	0.00
153	301123	奕东电子	113	2,869.07	0.00
154	600696	岩石股份	100	2,846.00	0.00
155	301181	标榜股份	92	2,814.28	0.00
156	603506	南都物业	200	2,792.00	0.00
157	002832	比音勒芬	100	2,520.00	0.00
158	300834	星辉环材	77	2,312.31	0.00
159	301196	唯科科技	41	1,538.32	0.00
160	000040	东旭蓝天	200	666.00	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	300037	新宙邦	8,171,812.00	5.97
2	600718	东软集团	7,769,468.00	5.67
3	000960	锡业股份	6,931,179.10	5.06
4	688099	晶晨股份	6,536,898.42	4.77

5	600141	兴发集团	6,431,096.00	4.70
6	000997	新大陆	6,251,036.32	4.56
7	002180	纳思达	5,824,725.00	4.25
8	000733	振华科技	5,625,744.88	4.11
9	002815	崇达技术	4,996,980.75	3.65
10	601555	东吴证券	4,669,907.72	3.41
11	000039	中集集团	4,646,009.32	3.39
12	600765	中航重机	4,535,030.08	3.31
13	600348	华阳股份	4,495,164.82	3.28
14	002384	东山精密	4,335,490.00	3.17
15	600486	扬农化工	4,306,629.40	3.14
16	000553	安道麦A	4,267,370.00	3.12
17	603712	七一二	4,200,986.39	3.07
18	603198	迎驾贡酒	4,128,147.70	3.01
19	300630	普利制药	4,123,275.89	3.01
20	300244	迪安诊断	4,118,108.88	3.01
21	001872	招商港口	4,040,819.12	2.95
22	002212	天融信	4,027,131.68	2.94
23	600188	兖矿能源	3,999,042.68	2.92
24	000970	中科三环	3,915,709.10	2.86
25	300363	博腾股份	3,871,108.00	2.83
26	000090	天健集团	3,869,031.61	2.83
27	600885	宏发股份	3,844,194.60	2.81
28	603786	科博达	3,704,226.56	2.70
29	600917	重庆燃气	3,675,769.00	2.68
30	000729	燕京啤酒	3,583,801.00	2.62
31	601866	中远海发	3,513,575.00	2.57
32	600546	山煤国际	3,487,221.00	2.55
33	600282	南钢股份	3,485,856.00	2.55
34	002010	传化智联	3,381,668.78	2.47
35	601168	西部矿业	3,342,339.28	2.44

36	688005	容百科技	3,233,690.44	2.36
37	300308	中际旭创	3,225,637.00	2.36
38	600673	东阳光	3,181,355.00	2.32
39	600201	生物股份	3,152,238.00	2.30
40	000750	国海证券	3,151,829.00	2.30
41	600233	圆通速递	3,129,599.00	2.29
42	000629	攀钢钒钛	3,126,552.00	2.28
43	601615	明阳智能	3,050,442.53	2.23
44	000877	天山股份	3,032,465.00	2.21
45	300769	德方纳米	3,013,497.00	2.20
46	600582	天地科技	2,996,037.66	2.19
47	002028	思源电气	2,973,516.78	2.17
48	603707	健友股份	2,945,654.40	2.15
49	603444	吉比特	2,865,355.00	2.09
50	002128	电投能源	2,762,489.12	2.02

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600141	兴发集团	8,729,005.62	6.37
2	000733	振华科技	7,950,952.00	5.81
3	688099	晶晨股份	7,797,552.76	5.69
4	300037	新宙邦	7,766,086.00	5.67
5	600718	东软集团	7,413,743.51	5.41
6	000960	锡业股份	7,400,067.82	5.40
7	000039	中集集团	6,188,735.00	4.52
8	600803	新奥股份	6,044,678.22	4.41
9	002180	纳思达	5,597,599.09	4.09
10	300751	迈为股份	5,475,099.50	4.00
11	000997	新大陆	5,474,062.74	4.00

12	688005	容百科技	4,992,653.91	3.65
13	000090	天健集团	4,747,757.44	3.47
14	600348	华阳股份	4,615,609.50	3.37
15	300418	昆仑万维	4,534,724.85	3.31
16	002384	东山精密	4,521,255.52	3.30
17	002010	传化智联	4,370,671.00	3.19
18	002815	崇达技术	4,351,417.16	3.18
19	601699	潞安环能	4,350,986.00	3.18
20	601555	东吴证券	4,315,675.06	3.15
21	300244	迪安诊断	4,313,502.00	3.15
22	000729	燕京啤酒	4,271,359.00	3.12
23	600546	山煤国际	4,248,865.00	3.10
24	600765	中航重机	4,203,913.40	3.07
25	603712	七一二	4,087,428.00	2.98
26	001872	招商港口	4,010,315.93	2.93
27	002212	天融信	3,941,423.00	2.88
28	300630	普利制药	3,887,630.18	2.84
29	300363	博腾股份	3,841,397.00	2.81
30	603444	吉比特	3,832,491.66	2.80
31	603156	养元饮品	3,662,384.40	2.67
32	688188	柏楚电子	3,570,372.34	2.61
33	600188	兖矿能源	3,545,107.66	2.59
34	600201	生物股份	3,529,983.00	2.58
35	601866	中远海发	3,484,399.00	2.54
36	000629	攀钢钒钛	3,387,541.00	2.47
37	603290	斯达半导	3,362,701.00	2.46
38	603198	迎驾贡酒	3,295,799.00	2.41
39	002048	宁波华翔	3,291,044.00	2.40
40	600885	宏发股份	3,279,955.39	2.40
41	000970	中科三环	3,277,731.59	2.39
42	600233	圆通速递	3,263,676.61	2.38

43	603707	健友股份	3,185,085.82	2.33
44	600282	南钢股份	3,145,233.00	2.30
45	605358	立昂微	3,127,298.30	2.28
46	002203	海亮股份	3,058,661.00	2.23
47	000553	安道麦A	3,051,848.00	2.23
48	300223	北京君正	3,049,258.00	2.23
49	000959	首钢股份	2,986,172.00	2.18
50	688536	思瑞浦	2,955,971.22	2.16
51	600673	东阳光	2,947,514.00	2.15
52	002396	星网锐捷	2,943,587.00	2.15
53	603786	科博达	2,942,319.00	2.15
54	002670	国盛金控	2,935,848.00	2.14
55	601168	西部矿业	2,873,568.00	2.10
56	600917	重庆燃气	2,861,601.88	2.09
57	600639	浦东金桥	2,856,785.00	2.09
58	603225	新凤鸣	2,842,279.00	2.08
59	000988	华工科技	2,822,652.83	2.06
60	601615	明阳智能	2,814,546.00	2.06
61	002128	电投能源	2,801,196.00	2.05
62	600271	航天信息	2,797,683.00	2.04
63	600155	华创阳安	2,793,946.00	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	651,612,391.47
卖出股票收入（成交）总额	665,096,683.31

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	40,949.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	40,949.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
中加 中证5 00指 数增 强A	902	53,278.52	36,607,026.24	76.1 7%	11,450,200.92	23.83%
中加 中证5 00指 数增	2,73 2	21,370.72	36,494,652.50	62.5 1%	21,890,163.09	37.49%

强C						
合计	3,634	29,290.60	73,101,678.74	68.68%	33,340,364.01	31.32%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中加中证500指数增强A	132,341.09	0.28%
	中加中证500指数增强C	205,291.54	0.35%
	合计	337,632.63	0.32%

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	0~10
	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	66,585,931.46	54,946,361.91
本报告期基金总申购份额	2,690,333.55	17,872,503.90
减：本报告期基金总赎回份额	21,219,037.85	14,434,050.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	48,057,227.16	58,384,815.59

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人本报告期内重大人事变动情况：无。

基金托管人本报告期内重大人事变动情况：无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日期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

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期	佣金	占当期	

	单元数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
中信建投	2	1,313,894,741.24	100.00%	687,726.61	100.00%	-

注：1. 公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

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

2. 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。

3. 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	185,350.44	100.00%	79,600,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中加中证500指数增强型证券投资基金2021年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
2	中加基金管理有限公司关于	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-27

	中加中证500指数增强型证券投资基金关联交易公告		
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	2022-02-12
4	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	2022-03-01
5	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	2022-03-02
6	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	2022-03-17
7	中加中证500指数增强型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-30
8	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	2022-03-30
9	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	2022-04-02
10	中加中证500指数增强型证券投资基金2022年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
11	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	2022-05-13
12	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	2022-06-24

§ 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	20220101-20220630	27,966,341.83	0.00	0.00	27,966,341.83	26.27%
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
二〇二二年八月三十日