

# 中加中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:中信建投证券股份有限公司

送出日期:2023 年 03 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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3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。

本报告期自2022年01月01日起至2022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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	64
8.1 期末基金资产组合情况	64
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
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	67
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	89
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	89
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	89
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	89
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	89
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	89

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	89
8.12 投资组合报告附注 .....	89
§9 基金份额持有人信息 .....	90
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	90
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	91
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情况 .....	91
§10 开放式基金份额变动 .....	92
§11 重大事件揭示 .....	92
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	92
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 .....	92
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	92
11.4 基金投资策略的改变 .....	92
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	92
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 .....	93
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	93
11.8 其他重大事件 .....	94
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	96
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 .....	96
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	96
§13 备查文件目录 .....	96
13.1 备查文件目录 .....	96
13.2 存放地点 .....	96
13.3 查阅方式 .....	96

## §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	105,182,185.75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	48,972,663.07份	56,209,522.68份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指

	数相似的风险收益特征。
--	-------------

## 2.3 基金管理人和基金托管人

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

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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、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	2022年		2021年		2020年09月27日 (基金合同生效日)-2020年12月31日	
	中加中证500指数增强A	中加中证500指数增强C	中加中证500指数增强A	中加中证500指数增强C	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	-11,968,611.96	-10,820,738.88	5,155,221.67	6,236,559.41	-2,167,405.98	-2,544,061.27
本期利润	-13,236,101.24	-11,388,540.78	4,871,315.10	5,765,240.67	-1,823,611.39	-2,449,220.06
加权平均基金份额本期利润	-0.2432	-0.1989	0.1207	0.1271	-0.0193	-0.0239
本期加权平均净值利润率	-24.50%	-20.22%	10.87%	11.68%	-1.98%	-2.45%
本期基金份额净值增长率	-17.67%	-17.92%	14.90%	14.54%	-1.75%	-1.85%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末		2021年末		2020年末	
期末可供分配利润	-3,459,360.12	-4,344,571.80	8,584,849.65	6,824,554.07	-2,009,006.91	-2,008,532.84
期末可供分配基金份额利润	-0.0706	-0.0773	0.1289	0.1242	-0.0226	-0.0236
期末基金资产净值	45,513,302.95	51,864,950.88	75,170,781.11	61,770,915.98	87,401,241.53	83,544,022.98
期末基金份额净值	0.9294	0.9227	1.1289	1.1242	0.9825	0.9815
3.1.3 累计期末指标	2022年末		2021年末		2020年末	
基金份额累计净值增长率	-7.06%	-7.73%	12.89%	12.42%	-1.75%	-1.85%

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

- 2、本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生额）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 中加中证500指数增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.32%	1.02%	2.52%	0.97%	-1.20%	0.05%
过去六个月	-10.09%	1.05%	-8.66%	1.04%	-1.43%	0.01%
过去一年	-17.67%	1.32%	-19.30%	1.31%	1.63%	0.01%
自基金合同生效起至今	-7.06%	1.10%	-5.47%	1.13%	-1.59%	-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
过去三个月	1.24%	1.02%	2.52%	0.97%	-1.28%	0.05%
过去六个月	-10.23%	1.05%	-8.66%	1.04%	-1.57%	0.01%
过去一年	-17.92%	1.32%	-19.30%	1.31%	1.38%	0.01%
自基金合同生效起至今	-7.73%	1.10%	-5.47%	1.13%	-2.26%	-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



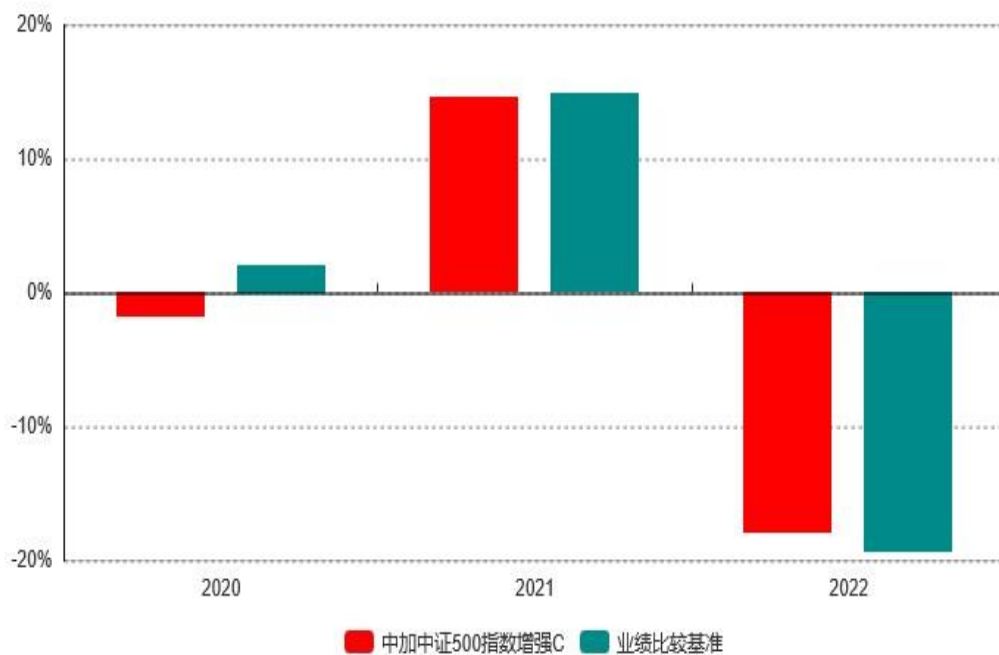
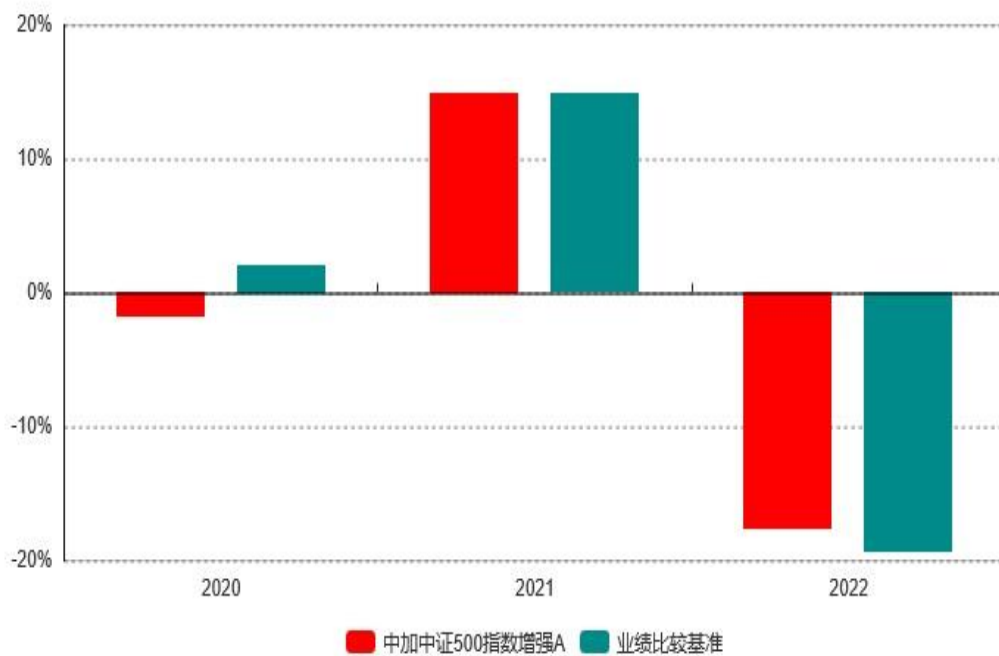
中加中证500指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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



### 3.2.3 自基金合同生效以来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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立至本报告期末未进行利润分配。

## §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

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

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

基金(A/C)、中加中证 500 指数增强型证券投资基金(A/C)、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中加新兴消费混合型证券投资基金(A/C)、中加穗盈纯债债券型证券投资基金、中加聚隆六个月持有期混合型证券投资基金(A/C)、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加科鑫混合型证券投资基金(A/C)、中加中债-1-5 年国开行债券指数证券投资基金、中加聚优一年定期开放混合型证券投资基金(A/C)、中加消费优选混合型证券投资基金(A/C)、中加喜利回报一年持有期混合型证券投资基金(A/C)、中加优悦一年定期开放债券型证券投资基金、中加科瑞混合型证券投资基金(A/C)、中加中债-1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中加邮益一年持有期混合型证券投资基金(A/C)、中加龙头精选混合型证券投资基金(A/C)、中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金(A/C)、中加量化研选混合型证券投资基金(A/C)、中加恒享三个月定期开放债券型证券投资基金、中加聚享增盈债券型证券投资基金(A/C)、中加瑞鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加聚安 60 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金(A/C)、中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中加博盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加中债-新综合债券指数发起式证券投资基金、中加医疗创新混合型发起式证券投资基金(A/C)、中加安瑞积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钟伟	本基金基金经理	2020-09-27	-	13	钟伟先生，复旦大学数学博士。2009年7月至2016年5月，先后在广发基金管理有限公司金融工程部、数量投资部任研究员、基金经理。2013年11月7日至2015年8月任广发中债金融债指数基金的基金经理。2015年2月至2016年5月任广发对冲套利定期开放混

				<p>合型发起式证券投资基金基金经理。2016年5月至2020年3月，任吉富创业投资股份有限公司量化投资部总经理、基金经理。2020年3月加入中加基金管理有限公司，现任中加中证500指数增强型证券投资基金（2020年9月27日至今）、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>
--	--	--	--	--

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

2、离任日期说明：无。

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

4、本基金无基金经理助理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《中加基金管理有限公司公平交

易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定。公司通过事前控制、事中控制、事后控制的方法，保证各投资组合的公平交易，防止不同组合之间的利益输送，保护各类资产委托人的利益。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

2022年A股总体表现低迷，呈震荡下跌趋势，波动剧烈。?

2022年初，在国内经济面临较大下行压力和海外市场加息预期的影响下，A股市场发生较大的调整，前期拥挤的高成长赛道出现大幅杀跌；2月份俄乌战争的爆发，海外股市和商品市场大幅波动，3月-4月上海疫情形势严峻，进一步加剧了A股市场的下跌。

5月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，在随后两个月展开了全面的反弹行情。

三季度受美联储大幅度加息、俄乌地缘冲突加剧以及企业盈利增速出现回落等因素影响，A股市场转入了震荡下行的调整趋势，四季度海外加息预期带动人民币贬值，国内疫情防控政策出现调整，全国疫情形势再度严峻，A股从前期的下跌行情转为震荡盘整的走势。

在报告期内，沪深300、上证50和创业板指的涨跌幅分别为-21.63%、-19.52%和-29.37%，中证500的涨跌幅为-20.31%。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加中证500指数增强A基金份额净值为0.9294元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-17.67%，同期业绩比较基准收益率为-19.30%；截至报告期末中加中证500指数增强C基金份额净值为0.9227元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-17.92%，同期业绩比较基准收益率为-19.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年，随着国内防疫政策的调整，我国经济有望迎来疫后复苏。1月PMI大幅回升，站上了枯荣线，好于市场一致预期。1月社会融资规模增量为5.98万亿元，1月新增人民币贷款达4.9万亿元，创历史单月最高值，超出市场预期。在2022年低基数作用下，加上政策的扶持，2023年经济增速有望恢复正常水平。

货币供应方面，M2增速较上月提高0.8个百分点至12.6%，货币政策短期内不太会转向，料继续保持适度宽松的方向。今年A股市场整体机会大于风险。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规，切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，由督察长、监察稽核部门定期与不定期的对基金的投资、交易、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。加强合规风险的事前控制，认真履行依法监督检查职责，促进基金运作的合法合规性和风险管理水平的提高；严格事前的监督审查和控制机制，对基金募集、市场营销、受托资产的投资管理、信息披露等方面均进行事先的合法合规审查工作；在风控系统中设置投资合规参数，对投资行为进行事中监控和预警；根据业务发展情况开展专项稽核，通过事后检查的方式促使投资运作合法合规。除此之外，公司监察稽核部门对各业务部门拟定的制度规范进行合规性审核，确保业务流程的合法合规；对公司员工进行法律法规宣导并组织合规培训，增强员工合规意识并营造公司整体的合规文化氛围。

同时，基金管理人还制定了具体、严格的投资授权流程和权限；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并根据相关规定呈报中国证监会或其派出机构以及公司董事会。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金2022年末进行本期利润分配。

#### 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 12 月 31 日，本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 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2302406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	中加中证500指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的中加中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。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(以下简称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注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,公允反映了该基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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

	<p>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，我们独立于该基金，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	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人中加基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2022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。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。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。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，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注7.4.2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。在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于</p>

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。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：(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。(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。(3) 评价该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。(4) 对该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，就可能导致对该基金持续经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该基金不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与该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。
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	李砾、刘宇宁
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	2023-03-29

## §7 年度财务报表

### 7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	5,294,466.74	7,496,409.07
结算备付金		1,010.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	91,837,051.58	129,617,278.78
其中：股票投资		91,837,051.58	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	499,856.27	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		35,121.06	121,193.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	275.05
资产总计		97,667,505.65	140,635,156.57
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,540.26	3,264,369.80
应付管理人报酬		66,788.43	94,778.48
应付托管费		12,522.85	17,771.00
应付销售服务费		13,400.28	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	7.4.7.6	195,000.00	300,020.01
负债合计		289,251.82	3,693,459.48
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	105,182,185.75	121,532,293.37
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-7,803,931.92	15,409,403.72

净资产合计		97,378,253.83	136,941,697.09
负债和净资产总计		97,667,505.65	140,635,156.57

注：报告截止日2022年12月31日，A类基金份额净值为0.9294元，A类基金份额总额48,972,663.07份；C类基金份额净值为0.9227元，C类基金份额总额56,209,522.68份，总份额合计105,182,185.75份。

## 7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-23,060,694.00	14,549,584.48
1.利息收入		48,847.65	68,533.14
其中：存款利息收入	7.4.7.9	37,868.18	38,743.74
债券利息收入		-	24.29
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		10,979.47	29,765.11
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-21,300,757.69	14,970,563.18
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-23,280,608.83	13,874,110.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	88,077.78	30,840.50
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-27,120.00
股利收益	7.4.7.13	1,891,773.36	1,092,731.92

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）	7.4.7.14	-1,835,291.18	-755,225.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	26,507.22	265,713.47
<b>减：二、营业总支出</b>		1,563,948.02	3,913,028.71
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	884,362.23	754,511.66
2. 托管费	7.4.10.2.2	165,817.87	141,470.95
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	168,767.87	149,118.86
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	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		0.05	0.05
8. 其他费用	7.4.7.17	345,000.00	2,867,927.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-24,624,642.02	10,636,555.77
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-24,624,642.02	10,636,555.77
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-24,624,642.02	10,636,555.77

### 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31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）	-16,350,107.62	-	-23,213,335.64	-39,563,443.26
（一）、综合收益总额	-	-	-24,624,642.02	-24,624,642.02
（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）	-16,350,107.62	-	1,411,306.38	-14,938,801.24
其中：1.基金申购款	26,859,006.92	-	53,174.56	26,912,181.48
2.基金赎回款	-43,209,114.54	-	1,358,131.82	-41,850,982.72
（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)	105,182,185.75	-	-7,803,931.92	97,378,253.83
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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(基金净值)	174,075,384.28	-	-3,130,119.77	170,945,264.51
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-52,543,090.91	-	18,539,523.49	-34,003,567.42
(一)、综合收益总额	-	-	10,636,555.77	10,636,555.77
(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)	-52,543,090.91	-	7,902,967.72	-44,640,123.19
其中: 1.基金申	132,270,839.37	-	14,729,359.64	147,000,199.01

购款				
2.基金 赎回款	-184,813,930.28	-	-6,826,391.92	-191,640,322.20
(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)	121,532,293.37	-	15,409,403.72	136,941,697.09

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:

夏远洋

陈昕

陈昕

-----  
基金管理人负责人

-----  
主管会计工作负责人

-----  
会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中加中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于2020年8月25日证监许可[2020]1946号文注册,由中加基金管理有限公司(以下简称“中加基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加中证500指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)公开募集。本基金为契约型开放式股票型基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金,托管人为中信建投证券股份有限公司(以下简称“中信建投证券”)。

本基金通过中加基金直销中心公开发售,募集期为2020年9月14日起至2020年9月23日止。本基金于2020年9月27日成立,成立之日基金实收份额为204,983,003.67份(含利息转份额8,598.59份),发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

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

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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注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要求，真实、完整地反映了本基金2022年12月31日的财务状况、2022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日起至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

##### (a) 金融资产的分类

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

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

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

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

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

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

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

##### (b) 金融负债的分类

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后, 对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### 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

##### (a) 金融工具的初始确认

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

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

##### (b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

- 以摊余成本计量的金融资产

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后, 对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

##### (c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时, 本基金终止确认该金融资产:

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;

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

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

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

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

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

#### (d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

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

#### 预期信用损失准备的列报

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

#### 核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 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，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 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

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

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

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

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

##### 公允价值变动收益

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

#### 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。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额



进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国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。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。

### 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

本基金自2022年1月1日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>》。

### (a)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。

### (b)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项目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

执行上述会计政策对本基金资产负债表的影响汇总如下：

#### (i)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、买入返售金融资产、应收申购款和其他资产，对应的账面价值分别为人民币7,496,409.07元、3,400,000.00元、121,193.67元和275.05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、买入返售金融资产和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币7,497,811.73元、3,398,871.92元和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、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币3,264,369.80元、94,778.48元、17,771.00元、16,520.19元和300,020.01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、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币3,264,369.80元、94,778.48元、17,771.00元、16,520.19元和300,020.01元。

于2021年12月31日，本基金持有的银行存款、交易性金融资产和买入返售金融资产等对应的应计利息余额均列示在其他资产科目中。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、交易性金融资产和买入返售金融资产等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未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》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(6)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

## 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	4,477,754.53	6,662,164.67
等于：本金	4,476,821.09	6,662,164.67
加：应计利息	933.44	-
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	816,712.21	834,244.40

等于：本金	816,594.63	834,244.40
加：应计利息	117.58	-
减：坏账准备	-	-
合计	5,294,466.74	7,496,409.07

注：其他存款为本基金存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		93,988,932.27	-	91,837,051.58	-2,151,880.69
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		93,988,932.27	-	91,837,051.58	-2,151,880.69
项目		上年度末 2021年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		129,930,868.29	-	129,614,278.78	-316,589.51
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,000.00	-	3,000.00	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,000.00	-	3,000.00	-
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	129,933,868.29	-	129,617,278.78	-316,589.51

#### 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未持有衍生金融资产/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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	499,856.27	-
银行间市场	-	-
合计	499,856.27	-
项目	上年度末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,400,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,400,000.00	-

##### 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未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	275.05
其他应收款	-	-

待摊费用	-	-
合计	-	275.05

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	20.01
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	65,000.00	80,000.00
预提费用-信息披露费	80,000.00	120,000.00
其他应付	50,000.00	100,000.00
合计	195,000.00	300,020.01

注：其他应付款为应付指数使用费。

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 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12月31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	5,050,419.08	5,050,419.08
本期赎回(以“-”号填列)	-22,663,687.47	-22,663,687.47
本期末	48,972,663.07	48,972,663.07

##### 7.4.7.7.2 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12月31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	21,808,587.84	21,808,587.84
本期赎回(以“-”号填列)	-20,545,427.07	-20,545,427.07
本期末	56,209,522.68	56,209,522.68

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 中加中证500指数增强A

单位：人民币元

项目 (中加中证500指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	10,653,449.37	-2,068,599.72	8,584,849.65
本期利润	-11,968,611.96	-1,267,489.28	-13,236,101.24
本期基金份额交易产生的变动数	96,403.70	1,095,487.77	1,191,891.47
其中：基金申购款	215,326.18	-265,023.51	-49,697.33
基金赎回款	-118,922.48	1,360,511.28	1,241,588.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,218,758.89	-2,240,601.23	-3,459,360.12

##### 7.4.7.8.2 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	-10,820,738.88	-567,801.90	-11,388,540.78

本期基金份额交易产生的变动数	512,762.55	-293,347.64	219,414.91
其中：基金申购款	1,276,716.81	-1,173,844.92	102,871.89
基金赎回款	-763,954.26	880,497.28	116,543.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,778,097.03	-2,566,474.77	-4,344,571.80

#### 7.4.7.9 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	30,778.18	32,247.93
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	7,090.00	5,354.09
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	1,141.72
合计	37,868.18	38,743.74

注：其他存款利息收入为券商保证金利息收入，其他为申购款利息收入。

#### 7.4.7.10 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	1,309,785,359.78	1,121,206,412.52
减：卖出股票成本总额	1,330,168,218.84	1,107,332,301.76
减：交易费用	2,897,749.77	-
买卖股票差价收入	-23,280,608.83	13,874,110.76

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	67.44	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	88,010.34	30,840.50
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	88,077.78	30,840.50

## 7.4.7.11.2 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12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日
卖出债券(债转股 及债券到期兑付) 成交总额	535,196.20	154,864.90
减：卖出债券(债 转股及债券到期兑 付)成本总额	447,100.00	124,000.00
减：应计利息总额	68.48	24.40
减：交易费用	17.38	-
买卖债券差价收入	88,010.34	30,840.50

## 7.4.7.12 衍生工具收益

## 7.4.7.12.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
----	--------	-------------

	2022年01月01日至2022年 12月31日	2021年01月01日至2021年 12月31日
期货投资	-	-27,120.00

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,891,773.36	1,092,731.92
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	1,891,773.36	1,092,731.92

#### 7.4.7.14 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12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-1,835,291.18	-755,225.31
——股票投资	-1,835,291.18	-755,225.31
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	-1,835,291.18	-755,225.31

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	26,507.22	265,713.47
合计	26,507.22	265,713.47

#### 7.4.7.16 信用减值损失

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	65,000.00	80,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	200,000.00	200,000.00
交易费用	-	2,467,927.19
合计	345,000.00	2,867,927.19

### 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

#### 7.4.9.1 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。

#### 7.4.9.2 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
The Bank of Nova Scotia	基金管理人股东
中国有研科技集团有限公司	基金管理人股东
北京乾融投资（集团）有限公司	基金管理人股东
中地种业（集团）有限公司	基金管理人股东
绍兴越华开发经营有限公司	基金管理人股东
北银丰业资产管理有限公司	基金管理人控股子公司
中加国际资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021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
中信建投 证券	2,600,835,064.19	100.00%	2,193,098,479.66	100.00%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

##### 7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021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
中信建投 证券	535,196.20	100.00%	281,865.77	100.00%

## 7.4.10.1.4 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12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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	96,700,000.00	100.00%	281,300,000.00	100.00%

## 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 2022年01月01日至2022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
中信建投 证券	1,365,571.55	100.00%	-	-
关联方名	上年度可比期间			

称	2021年01月01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
中信建投证券	1,144,247.63	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。

#### 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 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	884,362.23	754,511.66
其中：支付销售机构的客户维护费	103,064.70	116,134.84

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	165,817.87	141,470.95

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

##### 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 2022年01月01日至2022年12月31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	107,801.57	107,801.57
北京银行股份有限公司	0.00	1,322.18	1,322.18
中信建投证券股份有限公司	0.00	48,992.09	48,992.09
合计	0.00	158,115.84	158,115.84
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12月31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	84,001.88	84,001.88
北京银行股份有限公司	0.00	3,390.03	3,390.03
中信建投证券股份有限公司	0.00	56,661.40	56,661.40
合计	0.00	144,053.31	144,053.31

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

**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**

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

**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**

无。

**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**

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。

**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**

报告期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 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021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
中信建投 证券-托 管户	4,477,754.53	30,778.18	6,662,164.67	32,247.93
中信建投 证券-证 券资金户	816,594.63	7,090.00	834,244.40	5,354.09

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。

## 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 2022年01月01日至2022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：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	443.00	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	826.00	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	110.00	11,000.00
中信建投证券股份有限公司	110085	通22转债	原股东优先配售	190.00	19,000.00
中信建投证券股份有限公司	688281	华秦科技	网下发行	284.00	53,818.00
中信建投证券股份有限公司	301181	标榜股份	网下发行	915.00	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

有限公司					
中信建投 证券股份 有限公司	688223	晶科能源	网下发行	14,342	71,710.00
中信建投 证券股份 有限公司	301206	三元生物	网下发行	505.00	55,196.50
中信建投 证券股份 有限公司	001236	弘业期货	网下发行	1,399	2,602.14
中信建投 证券股份 有限公司	113062	常银转债	原股东优 先配售	2,870	287,000.00
中信建投 证券股份 有限公司	001300	三柏硕	网下发行	763.00	8,522.71
中信建投 证券股份 有限公司	001338	永顺泰	网下发行	1,649	11,246.18
中信建投 证券股份 有限公司	603130	云中马	网下发行	480.00	9,465.60
上年度可比期间 2021年01月01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：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
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
中信建投 证券股份 有限公司	001210	金房节能	网下发行	251	7,030.51
中信建投 证券股份 有限公司	301090	华润材料	网下发行	4,457	46,575.65
中信建投 证券股份 有限公司	688553	汇宇制药	网下发行	1,428	55,506.36
中信建投 证券股份 有限公司	688285	高铁电气	网下发行	9,095	65,302.10
中信建投 证券股份 有限公司	688182	灿勤科技	网下发行	5,369	56,374.50
中信建投 证券股份 有限公司	002142	宁波银行	原股东优 先配售	60	1,198.20

中信建投 证券股份 有限公司	301168	通灵股份	网下发行	1,050	41,034.00
中信建投 证券股份 有限公司	301177	迪阿股份	网下发行	660	77,140.80
中信建投 证券股份 有限公司	600927	永安期货	网下发行	1,859	33,406.23
中信建投 证券股份 有限公司	301100	风光股份	网下发行	1,496	41,603.76
中信建投 证券股份 有限公司	688248	南网科技	网下发行	4,201	51,420.24
中信建投 证券股份 有限公司	688167	炬光科技	网下发行	345	27,148.05
中信建投 证券股份 有限公司	688262	国芯科技	网下发行	1,121	47,059.58
中信建投 证券股份 有限公司	113634	珀莱转债	原股东优 先配售	30	3,000.00

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022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	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
600459	贵研铂业	2022-12-22	1个月内（含）	配股未上市	10.91	15.74	270	2,945.70	4,249.80	-

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科创板股票及创业板股票确定需要锁定的，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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2022年12月31日，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2022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余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31日止，基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2022年12月31日，本基金未持有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。

#### 7.4.13.2 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 7.4.13.2.4 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	上年度末
--------	-----	------



	2022年12月31日	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.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 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。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，本基金承担的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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7.4.12（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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年1 2月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,294,466.74	-	-	-	5,294,466.74
结算备付金	-	-	-	1,010.00	1,010.00
交易性金融资产	-	-	-	91,837,051.58	91,837,051.58
买入返售金融资产	499,856.27	-	-	-	499,856.27
应收申购款	-	-	-	35,121.06	35,121.06
资产总计	5,794,323.01	-	-	91,873,182.64	97,667,505.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,540.26	1,540.26
应付管理人报	-	-	-	66,788.43	66,788.43

酬					
应付托管费	-	-	-	12,522.85	12,522.85
应付销售服务费	-	-	-	13,400.28	13,400.28
其他负债	-	-	-	195,000.00	195,000.00
负债总计	-	-	-	289,251.82	289,251.82
利率敏感度缺口	5,794,323.01	-	-	91,583,930.82	97,378,253.83
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
其他资产	-	-	-	275.05	275.05
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	-	-	-	300,020.01	300,020.01

债					
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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和资产支持证券投资金额占比不重大，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 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

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。

##### 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 2022年12月31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	91,837,051.58	94.31	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	91,837,051.58	94.31	129,617,278.78	94.65

#### 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	4,457,387.40	5,473,288.09
	业绩比较基准下降5%	-4,457,387.40	-5,473,288.09

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	91,832,801.78	129,304,924.68
第二层次	4,249.80	215,499.03
第三层次	-	96,855.07
合计	91,837,051.58	129,617,278.78

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	3,000.00	93,855.07	96,855.07
当期购买	-	187,792.25	187,792.25
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	215,499.03	215,499.03
转出第三层次	3,000.00	496,819.82	499,819.82
当期利得或损失总额	-	-326.53	-326.53
其中：计入损益的利得或损失	-	-326.53	-326.53
计入其他综合	-	-	-

收益的利得或损失			
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比同期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	95,577.03	95,577.03
当期购买	127,000.00	4,086,714.41	4,213,714.41
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	124,000.00	4,104,562.57	4,228,562.57
当期利得或损失总额	-	16,126.20	16,126.20
其中：计入损益的利得或损失	-	16,126.20	16,126.20
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	3,000.00	93,855.07	96,855.07
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价	采用的估值	不可观察输入值
----	--------	-------	---------

	值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	-	-	-	-	-
债券投资	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	93,855.07	发行价格	不适用	不适用	不适用
债券投资	3,000.00	发行价格	不适用	不适用	不适用

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31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）。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2022年12月31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。

## §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	91,837,051.58	94.03
	其中：股票	91,837,051.58	94.03
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	499,856.27	0.51
	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	5,295,476.74	5.42
8	其他各项资产	35,121.06	0.04
9	合计	97,667,505.65	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	1,071,903.00	1.10
B	采矿业	2,724,626.00	2.80
C	制造业	50,262,439.24	51.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,316,499.00	1.35
E	建筑业	647,517.00	0.66
F	批发和零售业	2,683,899.00	2.76
G	交通运输、仓储和邮政业	1,125,480.00	1.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,379,410.40	4.50
J	金融业	6,499,153.00	6.67
K	房地产业	2,503,333.00	2.57
L	租赁和商务服务业	1,216,322.00	1.25
M	科学研究和技术服务业	1,080,590.00	1.11
N	水利、环境和公共设施管	715,172.00	0.73

	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	77,903.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	1,889,142.00	1.94
S	综合	-	-
	合计	78,193,388.64	80.30

### 8.2.2 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	288,561.00	0.30
B	采矿业	292,906.00	0.30
C	制造业	9,566,531.94	9.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	480,704.00	0.49
E	建筑业	171,980.00	0.18
F	批发和零售业	235,762.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	163,296.00	0.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	777,112.00	0.80
J	金融业	1,045,181.00	1.07
K	房地产业	125,686.00	0.13
L	租赁和商务服务业	290,754.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	132,288.00	0.14
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	55,132.00	0.06
Q	卫生和社会工作	1,182.00	0.00

R	文化、体育和娱乐业	16,587.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	13,643,662.94	14.01

### 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港股通股票。

## 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(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	601231	环旭电子	211,400	3,431,022.00	3.52
2	688063	派能科技	8,400	2,651,460.00	2.72
3	002497	雅化集团	85,000	1,976,250.00	2.03
4	688819	天能股份	53,475	1,964,671.50	2.02
5	300832	新产业	32,100	1,609,494.00	1.65
6	600153	建发股份	108,300	1,478,295.00	1.52
7	000878	云南铜业	116,500	1,368,875.00	1.41
8	002422	科伦药业	50,840	1,352,852.40	1.39
9	002250	联化科技	86,200	1,336,100.00	1.37
10	000553	安道麦A	139,800	1,265,190.00	1.30
11	600895	张江高科	110,400	1,251,936.00	1.29
12	002831	裕同科技	36,900	1,220,283.00	1.25
13	603317	天味食品	43,320	1,190,433.60	1.22
14	300390	天华超净	21,300	1,190,244.00	1.22
15	300115	长盈精密	112,500	1,162,125.00	1.19
16	601928	凤凰传媒	144,900	1,147,608.00	1.18
17	600435	北方导航	97,100	1,126,360.00	1.16
18	603737	三棵树	9,400	1,070,002.00	1.10
19	000932	华菱钢铁	226,900	1,066,430.00	1.10

20	002384	东山精密	40,900	1,011,457.00	1.04
21	600566	济川药业	36,500	993,530.00	1.02
22	000728	国元证券	151,800	960,894.00	0.99
23	600699	均胜电子	68,300	959,615.00	0.99
24	600718	东软集团	94,700	942,265.00	0.97
25	002048	宁波华翔	66,900	929,910.00	0.95
26	603613	国联股份	10,510	929,504.40	0.95
27	601555	东吴证券	141,500	923,995.00	0.95
28	601077	渝农商行	249,000	878,970.00	0.90
29	002595	豪迈科技	36,800	851,920.00	0.87
30	600985	淮北矿业	66,300	848,640.00	0.87
31	000537	广宇发展	61,300	810,999.00	0.83
32	688006	杭可科技	18,166	795,125.82	0.82
33	600967	内蒙一机	95,300	787,178.00	0.81
34	600521	华海药业	35,800	782,588.00	0.80
35	300009	安科生物	83,200	778,752.00	0.80
36	600998	九州通	56,300	734,152.00	0.75
37	300308	中际旭创	26,400	713,592.00	0.73
38	603056	德邦股份	34,200	712,386.00	0.73
39	002124	天邦食品	116,500	711,815.00	0.73
40	600871	石化油服	356,700	706,266.00	0.73
41	300017	网宿科技	125,600	700,848.00	0.72
42	300070	碧水源	146,400	692,472.00	0.71
43	000937	冀中能源	101,700	646,812.00	0.66
44	603688	石英股份	4,800	630,336.00	0.65
45	002152	广电运通	63,000	626,220.00	0.64
46	603444	吉比特	2,000	625,680.00	0.64
47	600499	科达制造	43,300	615,293.00	0.63
48	600160	巨化股份	37,700	584,727.00	0.60
49	002653	海思科	26,000	578,500.00	0.59
50	300146	汤臣倍健	24,800	565,936.00	0.58

51	002966	苏州银行	72,500	564,050.00	0.58
52	300682	朗新科技	25,500	560,490.00	0.58
53	300012	华测检测	24,500	546,350.00	0.56
54	601990	南京证券	66,000	523,380.00	0.54
55	002945	华林证券	39,700	523,246.00	0.54
56	000415	渤海租赁	236,000	521,560.00	0.54
57	600143	金发科技	53,700	520,353.00	0.53
58	603658	安图生物	8,300	513,355.00	0.53
59	601717	郑煤机	45,800	511,128.00	0.52
60	000709	河钢股份	223,500	505,110.00	0.52
61	000959	首钢股份	129,600	488,592.00	0.50
62	300861	美畅股份	9,700	476,852.00	0.49
63	600398	海澜之家	89,600	474,880.00	0.49
64	688390	固德威	1,468	474,296.12	0.49
65	300699	光威复材	6,500	469,625.00	0.48
66	002738	中矿资源	6,800	453,288.00	0.47
67	603127	昭衍新药	7,700	449,757.00	0.46
68	002385	大北农	49,400	439,660.00	0.45
69	600956	新天绿能	45,100	434,764.00	0.45
70	600350	山东高速	72,600	413,094.00	0.42
71	002673	西部证券	67,500	411,075.00	0.42
72	300363	博腾股份	9,800	400,330.00	0.41
73	601665	齐鲁银行	93,700	390,729.00	0.40
74	600879	航天电子	53,400	363,120.00	0.37
75	002299	圣农发展	15,200	360,088.00	0.37
76	600909	华安证券	78,300	359,397.00	0.37
77	603355	莱克电气	12,570	352,462.80	0.36
78	300212	易华录	16,800	342,888.00	0.35
79	600415	小商品城	65,000	340,600.00	0.35
80	300144	宋城演艺	23,000	335,800.00	0.34
81	002625	光启技术	19,700	335,294.00	0.34

82	000785	居然之家	80,400	328,836.00	0.34
83	300888	稳健医疗	4,500	321,750.00	0.33
84	002399	海普瑞	24,000	308,400.00	0.32
85	000729	燕京啤酒	28,600	303,732.00	0.31
86	600325	华发股份	31,900	289,014.00	0.30
87	600739	辽宁成大	21,800	274,462.00	0.28
88	002739	万达电影	19,500	273,000.00	0.28
89	601992	金隅集团	105,700	268,478.00	0.28
90	600970	中材国际	31,500	268,380.00	0.28
91	603605	珀莱雅	1,600	267,968.00	0.28
92	002025	航天电器	4,000	265,000.00	0.27
93	600170	上海建工	99,000	257,400.00	0.26
94	603267	鸿远电子	2,500	252,900.00	0.26
95	600517	国网英大	50,500	244,420.00	0.25
96	000999	华润三九	5,000	234,050.00	0.24
97	002273	水晶光电	18,900	222,831.00	0.23
98	600498	烽火通信	16,700	219,438.00	0.23
99	601696	中银证券	20,200	213,514.00	0.22
100	000598	兴蓉环境	43,000	210,270.00	0.22
101	600535	天士力	18,900	203,364.00	0.21
102	002985	北摩高科	4,400	198,440.00	0.20
103	002131	利欧股份	110,100	194,877.00	0.20
104	000027	深圳能源	30,400	193,344.00	0.20
105	600968	海油发展	65,800	189,504.00	0.19
106	002557	洽洽食品	3,700	185,000.00	0.19
107	688301	奕瑞科技	400	183,152.00	0.19
108	600141	兴发集团	6,200	179,800.00	0.18
109	600839	四川长虹	67,000	176,880.00	0.18
110	600027	华电国际	26,500	155,820.00	0.16
111	000050	深天马 A	17,800	154,148.00	0.16
112	600208	新湖中宝	59,600	151,384.00	0.16

113	601666	平煤股份	13,900	150,259.00	0.15
114	603719	良品铺子	4,000	147,480.00	0.15
115	000778	新兴铸管	38,400	140,160.00	0.14
116	000738	航发控制	5,400	138,456.00	0.14
117	600927	永安期货	8,400	135,408.00	0.14
118	601098	中南传媒	13,300	132,734.00	0.14
119	002705	新宝股份	7,900	131,535.00	0.14
120	603345	安井食品	800	129,504.00	0.13
121	600109	国金证券	14,700	127,890.00	0.13
122	000155	川能动力	6,900	123,096.00	0.13
123	600820	隧道股份	23,100	121,737.00	0.13
124	600862	中航高科	5,400	120,366.00	0.12
125	600582	天地科技	23,100	120,120.00	0.12
126	000750	国海证券	35,400	117,882.00	0.12
127	600380	健康元	10,000	112,900.00	0.12
128	601958	金钼股份	9,000	103,950.00	0.11
129	300776	帝尔激光	800	100,800.00	0.10
130	600765	中航重机	3,100	96,379.00	0.10
131	002249	大洋电机	17,500	89,600.00	0.09
132	003035	南网能源	14,900	84,483.00	0.09
133	002507	涪陵榨菜	3,200	82,464.00	0.08
134	601699	潞安环能	4,700	79,195.00	0.08
135	601869	长飞光纤	2,400	78,312.00	0.08
136	300244	迪安诊断	3,100	77,903.00	0.08
137	600873	梅花生物	7,400	75,332.00	0.08
138	600901	江苏租赁	13,100	71,788.00	0.07
139	300724	捷佳伟创	600	68,412.00	0.07
140	300073	当升科技	1,200	67,680.00	0.07
141	300136	信维通信	3,500	57,785.00	0.06
142	000039	中集集团	8,100	57,024.00	0.06
143	600863	内蒙华电	15,800	55,142.00	0.06

144	300003	乐普医疗	2,400	55,128.00	0.06
145	000012	南玻 A	8,000	53,680.00	0.06
146	002465	海格通信	6,600	53,592.00	0.06
147	601718	际华集团	16,700	48,597.00	0.05
148	600808	马钢股份	17,200	48,332.00	0.05
149	601016	节能风电	12,600	48,006.00	0.05
150	600066	宇通客车	6,200	46,562.00	0.05
151	002195	二三四五	20,400	41,004.00	0.04
152	600157	永泰能源	26,200	40,086.00	0.04
153	600271	航天信息	3,700	38,517.00	0.04
154	600095	湘财股份	5,000	37,800.00	0.04
155	600315	上海家化	1,100	35,035.00	0.04
156	002372	伟星新材	1,600	34,144.00	0.04
157	603233	大参林	800	31,680.00	0.03
158	688289	圣湘生物	1,400	30,730.00	0.03
159	002409	雅克科技	600	30,222.00	0.03
160	300568	星源材质	1,400	29,764.00	0.03
161	002430	杭氧股份	700	27,552.00	0.03
162	601828	美凯龙	5,400	25,326.00	0.03
163	600642	申能股份	4,400	24,156.00	0.02
164	603927	中科软	800	23,688.00	0.02
165	002028	思源电气	600	22,932.00	0.02
166	000967	盈峰环境	5,000	22,700.00	0.02
167	600486	扬农化工	200	20,780.00	0.02
168	600500	中化国际	3,000	19,830.00	0.02
169	002030	达安基因	1,200	18,672.00	0.02
170	688777	中控技术	200	18,166.00	0.02
171	601607	上海医药	1,000	17,830.00	0.02
172	600008	首创环保	6,300	17,829.00	0.02
173	603712	七一二	500	17,460.00	0.02
174	601128	常熟银行	1,800	13,590.00	0.01



175	600549	厦门钨业	600	11,730.00	0.01
176	600372	中航电子	700	11,179.00	0.01
177	600298	安琪酵母	200	9,044.00	0.01
178	000883	湖北能源	1,900	7,980.00	0.01
179	000581	威孚高科	400	7,092.00	0.01
180	688385	复旦微电	100	6,981.00	0.01
181	600021	上海电力	600	6,006.00	0.01
182	600782	新钢股份	1,200	4,908.00	0.01
183	000623	吉林敖东	200	2,998.00	0.00
184	601456	国联证券	100	1,125.00	0.00

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600732	爱旭股份	20,600	779,092.00	0.80
2	300523	辰安科技	32,000	667,840.00	0.69
3	002756	永兴材料	6,500	599,105.00	0.62
4	600150	中国船舶	21,100	470,108.00	0.48
5	002318	久立特材	23,800	396,032.00	0.41
6	600236	桂冠电力	65,100	374,976.00	0.39
7	300575	中旗股份	17,000	371,790.00	0.38
8	603876	鼎胜新材	8,900	365,256.00	0.38
9	603301	振德医疗	9,000	342,450.00	0.35
10	688556	高测股份	4,554	341,641.08	0.35
11	601901	方正证券	47,900	305,602.00	0.31
12	300498	温氏股份	14,700	288,561.00	0.30
13	002821	凯莱英	1,800	266,400.00	0.27
14	688559	海目星	4,400	254,496.00	0.26
15	601689	拓普集团	4,300	251,894.00	0.26
16	300101	振芯科技	9,700	237,650.00	0.24

17	600057	厦门象屿	23,100	237,237.00	0.24
18	000568	泸州老窖	1,000	224,280.00	0.23
19	002258	利尔化学	12,300	220,908.00	0.23
20	603906	龙蟠科技	9,300	215,295.00	0.22
21	601825	沪农商行	36,200	212,856.00	0.22
22	600545	卓郎智能	73,800	208,854.00	0.21
23	002938	鹏鼎控股	7,200	197,568.00	0.20
24	002947	恒铭达	9,900	195,525.00	0.20
25	002478	常宝股份	34,100	191,983.00	0.20
26	603612	索通发展	6,800	176,936.00	0.18
27	002847	盐津铺子	1,600	173,264.00	0.18
28	002004	华邦健康	31,700	161,670.00	0.17
29	300856	科思股份	3,000	156,450.00	0.16
30	000860	顺鑫农业	5,200	155,064.00	0.16
31	000686	东北证券	22,600	146,900.00	0.15
32	688599	天合光能	2,200	140,272.00	0.14
33	301035	润丰股份	1,500	130,650.00	0.13
34	300438	鹏辉能源	1,600	124,784.00	0.13
35	600179	安通控股	36,200	119,098.00	0.12
36	600958	东方证券	13,300	118,902.00	0.12
37	000895	双汇发展	4,300	111,499.00	0.11
38	601857	中国石油	22,400	111,328.00	0.11
39	601038	一拖股份	9,800	110,740.00	0.11
40	000543	皖能电力	23,600	105,728.00	0.11
41	600690	海尔智家	4,300	105,178.00	0.11
42	600037	歌华有线	12,900	105,006.00	0.11
43	600565	迪马股份	48,100	103,896.00	0.11
44	300551	古鳌科技	8,800	102,784.00	0.11
45	000913	钱江摩托	5,500	101,640.00	0.10
46	600129	太极集团	3,300	99,198.00	0.10
47	002955	鸿合科技	4,000	94,200.00	0.10

48	000733	振华科技	800	91,384.00	0.09
49	000534	万泽股份	6,400	90,240.00	0.09
50	000567	海德股份	6,400	89,088.00	0.09
51	002287	奇正藏药	3,800	86,830.00	0.09
52	601117	中国化学	10,800	85,752.00	0.09
53	300887	谱尼测试	2,600	84,786.00	0.09
54	601838	成都银行	5,500	84,150.00	0.09
55	603661	恒林股份	2,900	82,563.00	0.08
56	002085	万丰奥威	13,800	82,110.00	0.08
57	002311	海大集团	1,300	80,249.00	0.08
58	601088	中国神华	2,900	80,098.00	0.08
59	688235	百济神州	600	79,470.00	0.08
60	600256	广汇能源	7,900	71,258.00	0.07
61	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.07
62	600710	苏美达	10,500	61,740.00	0.06
63	000726	鲁泰 A	7,900	58,302.00	0.06
64	601009	南京银行	5,300	55,226.00	0.06
65	300192	科德教育	7,700	55,132.00	0.06
66	600685	中船防务	2,500	51,900.00	0.05
67	002594	比亚迪	200	51,394.00	0.05
68	600893	航发动力	1,100	46,508.00	0.05
69	600438	通威股份	1,200	46,296.00	0.05
70	600233	圆通速递	2,200	44,198.00	0.05
71	603368	柳药集团	2,200	41,074.00	0.04
72	688139	海尔生物	600	37,980.00	0.04
73	000059	华锦股份	5,500	37,400.00	0.04
74	603031	安孚科技	800	37,320.00	0.04
75	688019	安集科技	200	36,000.00	0.04
76	600039	四川路桥	3,200	35,584.00	0.04
77	300662	科锐国际	700	34,300.00	0.04
78	603959	百利科技	3,100	32,767.00	0.03

79	603259	药明康德	400	32,400.00	0.03
80	600987	航民股份	4,300	31,175.00	0.03
81	000034	神州数码	1,400	30,716.00	0.03
82	600188	兖矿能源	900	30,222.00	0.03
83	002204	大连重工	5,300	27,507.00	0.03
84	000408	藏格矿业	1,000	25,970.00	0.03
85	600926	杭州银行	1,900	24,852.00	0.03
86	688126	沪硅产业	1,400	24,654.00	0.03
87	002968	新大正	1,000	21,790.00	0.02
88	002920	德赛西威	200	21,068.00	0.02
89	300260	新莱应材	300	20,130.00	0.02
90	600976	健民集团	400	19,876.00	0.02
91	600522	中天科技	1,200	19,380.00	0.02
92	603800	道森股份	700	18,676.00	0.02
93	600481	双良节能	1,400	18,116.00	0.02
94	000858	五粮液	100	18,069.00	0.02
95	603050	科林电气	1,100	17,303.00	0.02
96	002829	星网宇达	500	17,195.00	0.02
97	600158	中体产业	1,900	16,587.00	0.02
98	000521	长虹美菱	3,700	15,577.00	0.02
99	002967	广电计量	900	15,102.00	0.02
10 0	300570	太辰光	1,000	14,460.00	0.01
10 1	002338	奥普光电	600	13,374.00	0.01
10 2	003020	立方制药	400	12,920.00	0.01
10 3	601138	工业富联	1,400	12,852.00	0.01
10 4	000935	四川双马	600	12,600.00	0.01
10 5	000417	合肥百货	2,300	12,535.00	0.01

10 6	300795	米奥会展	300	12,243.00	0.01
10 7	002459	晶澳科技	200	12,018.00	0.01
10 8	603815	交建股份	1,500	11,325.00	0.01
10 9	603129	春风动力	100	11,252.00	0.01
11 0	000810	创维数字	800	11,152.00	0.01
11 1	600600	青岛啤酒	100	10,750.00	0.01
11 2	603118	共进股份	1,000	7,950.00	0.01
11 3	002634	棒杰股份	800	7,864.00	0.01
11 4	600285	羚锐制药	600	7,824.00	0.01
11 5	688278	特宝生物	200	7,786.00	0.01
11 6	600785	新华百货	400	7,416.00	0.01
11 7	603665	康隆达	200	7,266.00	0.01
11 8	603108	润达医疗	700	7,077.00	0.01
11 9	603300	华铁应急	1,100	6,974.00	0.01
12 0	002737	葵花药业	300	6,954.00	0.01
12 1	000090	天健集团	1,200	6,552.00	0.01
12 2	000651	格力电器	200	6,464.00	0.01
12 3	600295	鄂尔多斯	400	6,076.00	0.01

12 4	600089	特变电工	300	6,024.00	0.01
12 5	601788	光大证券	400	5,948.00	0.01
12 6	002179	中航光电	100	5,776.00	0.01
12 7	002832	比音勒芬	200	5,122.00	0.01
12 8	600389	江山股份	100	4,408.00	0.00
12 9	600459	贵研铂业	270	4,249.80	0.00
13 0	605599	菜百股份	400	4,072.00	0.00
13 1	600888	新疆众和	400	3,276.00	0.00
13 2	600073	上海梅林	300	2,385.00	0.00
13 3	300365	恒华科技	200	1,522.00	0.00
13 4	300494	盛天网络	100	1,493.00	0.00
13 5	603399	吉翔股份	100	1,380.00	0.00
13 6	688158	优刻得	100	1,251.00	0.00
13 7	002219	新里程	300	1,182.00	0.00
13 8	000950	重药控股	200	1,016.00	0.00
13 9	601881	中国银河	100	929.00	0.00
14 0	601375	中原证券	200	728.00	0.00
14 1	688336	三生国健	35	444.50	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	688099	晶晨股份	12,265,511.29	8.96
2	300037	新宙邦	11,591,122.60	8.46
3	600718	东软集团	11,181,861.00	8.17
4	300363	博腾股份	10,990,954.92	8.03
5	002180	纳思达	9,823,387.00	7.17
6	000960	锡业股份	9,391,029.10	6.86
7	300244	迪安诊断	9,169,474.88	6.70
8	600141	兴发集团	8,475,916.00	6.19
9	002815	崇达技术	8,253,210.75	6.03
10	600282	南钢股份	8,247,523.00	6.02
11	002422	科伦药业	8,037,495.25	5.87
12	000997	新大陆	7,976,178.32	5.82
13	002756	永兴材料	7,835,106.68	5.72
14	601555	东吴证券	7,758,369.72	5.67
15	300390	天华超净	7,737,608.10	5.65
16	600765	中航重机	7,499,410.08	5.48
17	000553	安道麦A	7,356,157.54	5.37
18	300769	德方纳米	7,311,932.84	5.34
19	000733	振华科技	7,096,427.88	5.18
20	600486	扬农化工	7,023,152.40	5.13
21	300699	光威复材	6,715,740.00	4.90
22	600233	圆通速递	6,249,175.00	4.56
23	002384	东山精密	6,195,222.00	4.52
24	300630	普利制药	5,807,483.89	4.24
25	300308	中际旭创	5,796,777.00	4.23
26	000728	国元证券	5,764,557.00	4.21

27	000970	中科三环	5,759,764.10	4.21
28	603317	天味食品	5,725,272.60	4.18
29	000750	国海证券	5,718,426.00	4.18
30	000729	燕京啤酒	5,631,389.00	4.11
31	600566	济川药业	5,616,469.00	4.10
32	600732	爱旭股份	5,612,601.00	4.10
33	002250	联化科技	5,581,093.00	4.08
34	601717	郑煤机	5,561,923.00	4.06
35	001872	招商港口	5,560,376.86	4.06
36	000937	冀中能源	5,530,738.00	4.04
37	002240	盛新锂能	5,529,046.00	4.04
38	600131	国网信通	5,522,910.62	4.03
39	600348	华阳股份	5,485,637.82	4.01
40	600582	天地科技	5,463,196.58	3.99
41	600499	科达制造	5,417,072.00	3.96
42	600546	山煤国际	5,369,167.00	3.92
43	002004	华邦健康	5,366,933.00	3.92
44	002212	天融信	5,343,292.68	3.90
45	603228	景旺电子	5,326,006.66	3.89
46	601231	环旭电子	5,253,700.00	3.84
47	600022	山东钢铁	5,167,316.00	3.77
48	601098	中南传媒	5,145,068.00	3.76
49	600160	巨化股份	5,008,112.00	3.66
50	000039	中集集团	4,999,888.32	3.65
51	600597	光明乳业	4,992,947.00	3.65
52	603444	吉比特	4,974,099.00	3.63
53	603712	七一二	4,971,672.39	3.63
54	601958	金钼股份	4,936,835.00	3.61
55	603786	科博达	4,922,340.56	3.59
56	600885	宏发股份	4,892,518.60	3.57
57	600153	建发股份	4,855,141.00	3.55



58	002468	申通快递	4,849,861.00	3.54
59	600970	中材国际	4,832,886.84	3.53
60	603613	国联股份	4,802,839.00	3.51
61	603198	迎驾贡酒	4,780,840.70	3.49
62	000686	东北证券	4,780,483.98	3.49
63	600188	兖矿能源	4,766,421.44	3.48
64	600985	淮北矿业	4,610,001.00	3.37
65	600549	厦门钨业	4,560,883.00	3.33
66	600521	华海药业	4,524,367.00	3.30
67	600373	中文传媒	4,516,481.00	3.30
68	601928	凤凰传媒	4,488,294.00	3.28
69	600155	华创阳安	4,474,064.00	3.27
70	688819	天能股份	4,430,016.60	3.23
71	000778	新兴铸管	4,399,472.00	3.21
72	600673	东阳光	4,171,224.00	3.05
73	000878	云南铜业	4,152,694.00	3.03
74	002625	光启技术	4,151,618.67	3.03
75	000959	首钢股份	4,104,229.00	3.00
76	600917	重庆燃气	4,077,533.00	2.98
77	601077	渝农商行	4,072,910.00	2.97
78	002557	洽洽食品	4,059,005.00	2.96
79	002128	电投能源	4,022,923.12	2.94
80	688006	杭可科技	4,015,565.58	2.93
81	600967	内蒙一机	4,006,037.00	2.93
82	600873	梅花生物	3,991,515.00	2.91
83	601866	中远海发	3,983,018.00	2.91
84	600909	华安证券	3,973,040.00	2.90
85	300017	网宿科技	3,966,344.00	2.90
86	002048	宁波华翔	3,944,035.00	2.88
87	601577	长沙银行	3,915,237.52	2.86
88	601869	长飞光纤	3,891,167.00	2.84

89	000090	天健集团	3,875,885.61	2.83
90	600256	广汇能源	3,844,796.00	2.81
91	002966	苏州银行	3,835,166.00	2.80
92	600325	华发股份	3,830,019.00	2.80
93	000709	河钢股份	3,824,494.00	2.79
94	000519	中兵红箭	3,809,242.86	2.78
95	000932	华菱钢铁	3,792,762.00	2.77
96	002028	思源电气	3,726,614.78	2.72
97	601168	西部矿业	3,708,403.28	2.71
98	688005	容百科技	3,701,663.04	2.70
99	002010	传化智联	3,654,373.78	2.67
100	000930	中粮科技	3,654,151.00	2.67
101	000559	万向钱潮	3,623,297.80	2.65
102	603707	健友股份	3,576,129.79	2.61
103	000629	钒钛股份	3,567,847.00	2.61
104	600064	南京高科	3,555,059.00	2.60
105	600380	健康元	3,550,178.00	2.59
106	000738	航发控制	3,537,413.00	2.58
107	600039	四川路桥	3,525,302.00	2.57
108	600201	生物股份	3,421,663.00	2.50
109	600236	桂冠电力	3,398,092.83	2.48
110	601615	明阳智能	3,313,704.53	2.42
111	300009	安科生物	3,277,807.63	2.39
112	300832	新产业	3,271,747.30	2.39
113	603355	莱克电气	3,269,566.45	2.39
114	000598	兴蓉环境	3,259,845.66	2.38
115	601016	节能风电	3,237,447.00	2.36
116	002497	雅化集团	3,208,804.09	2.34
117	600438	通威股份	3,154,748.00	2.30
118	000415	渤海租赁	3,150,553.71	2.30
119	600867	通化东宝	3,136,888.00	2.29

120	600959	江苏有线	3,113,273.00	2.27
121	600487	亨通光电	3,105,697.00	2.27
122	603927	中科软	3,066,059.60	2.24
123	601665	齐鲁银行	3,040,288.00	2.22
124	000877	天山股份	3,032,465.00	2.21
125	300482	万孚生物	3,000,333.00	2.19
126	002831	裕同科技	2,999,468.52	2.19
127	000983	山西焦煤	2,946,610.00	2.15
128	002595	豪迈科技	2,924,649.40	2.14
129	002423	中粮资本	2,900,829.70	2.12
130	688063	派能科技	2,882,168.34	2.10
131	002396	星网锐捷	2,877,937.00	2.10
132	600435	北方导航	2,855,005.00	2.08
133	600095	湘财股份	2,846,726.00	2.08
134	600968	海油发展	2,842,625.00	2.08
135	600875	东方电气	2,836,764.45	2.07
136	002465	海格通信	2,833,571.00	2.07
137	600572	康恩贝	2,825,519.00	2.06
138	601872	招商轮船	2,819,258.00	2.06
139	600699	均胜电子	2,806,811.00	2.05
140	601699	潞安环能	2,805,300.00	2.05
141	002152	广电运通	2,797,659.50	2.04
142	000402	金融街	2,796,846.00	2.04
143	001914	招商积余	2,786,040.00	2.03
144	300073	当升科技	2,783,975.00	2.03
145	601156	东航物流	2,782,835.00	2.03
146	002797	第一创业	2,763,513.00	2.02

#### 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	300037	新宙邦	14,904,752.20	10.88
2	688099	晶晨股份	13,324,936.23	9.73
3	300244	迪安诊断	11,487,639.00	8.39
4	600141	兴发集团	10,773,725.62	7.87
5	000960	锡业股份	10,664,408.82	7.79
6	600718	东软集团	9,998,026.11	7.30
7	300363	博腾股份	9,903,607.00	7.23
8	002180	纳思达	9,614,999.09	7.02
9	000733	振华科技	9,314,922.00	6.80
10	002815	崇达技术	8,845,669.26	6.46
11	600282	南钢股份	8,108,458.00	5.92
12	002422	科伦药业	7,431,145.00	5.43
13	000997	新大陆	7,423,024.74	5.42
14	300769	德方纳米	7,351,227.40	5.37
15	600765	中航重机	7,337,615.40	5.36
16	601555	东吴证券	6,819,028.86	4.98
17	002756	永兴材料	6,751,244.00	4.93
18	601699	潞安环能	6,481,428.00	4.73
19	000039	中集集团	6,466,988.76	4.72
20	300390	天华超净	6,334,733.32	4.63
21	600486	扬农化工	6,241,851.00	4.56
22	000729	燕京啤酒	6,229,361.00	4.55
23	600233	圆通速递	6,224,032.61	4.55
24	000553	安道麦A	6,212,794.00	4.54
25	300630	普利制药	6,141,002.18	4.48
26	600546	山煤国际	6,125,799.00	4.47
27	601958	金钼股份	6,070,371.40	4.43
28	600803	新奥股份	6,044,678.22	4.41
29	600131	国网信通	6,031,726.00	4.40
30	300699	光威复材	5,829,430.00	4.26

31	000970	中科三环	5,769,221.54	4.21
32	002212	天融信	5,757,668.50	4.20
33	600673	东阳光	5,703,107.00	4.16
34	001872	招商港口	5,671,232.63	4.14
35	600348	华阳股份	5,592,431.50	4.08
36	600155	华创阳安	5,583,084.00	4.08
37	002384	东山精密	5,569,769.52	4.07
38	300751	迈为股份	5,475,099.50	4.00
39	002240	盛新锂能	5,454,779.00	3.98
40	000750	国海证券	5,429,229.00	3.96
41	688005	容百科技	5,428,623.91	3.96
42	600732	爱旭股份	5,427,326.44	3.96
43	600582	天地科技	5,254,066.00	3.84
44	002468	申通快递	5,233,011.38	3.82
45	300308	中际旭创	5,226,037.00	3.82
46	601098	中南传媒	5,209,262.00	3.80
47	603444	吉比特	5,170,771.66	3.78
48	002004	华邦健康	5,162,038.00	3.77
49	600256	广汇能源	5,137,630.00	3.75
50	600022	山东钢铁	5,113,322.00	3.73
51	000959	首钢股份	5,091,668.00	3.72
52	600970	中材国际	5,060,119.08	3.70
53	601717	郑煤机	5,012,100.00	3.66
54	603228	景旺电子	4,996,320.00	3.65
55	000728	国元证券	4,904,053.00	3.58
56	603613	国联股份	4,901,655.00	3.58
57	600597	光明乳业	4,900,711.00	3.58
58	603198	迎驾贡酒	4,869,615.00	3.56
59	603712	七一二	4,852,698.00	3.54
60	000937	冀中能源	4,848,484.00	3.54
61	600499	科达制造	4,789,735.00	3.50

62	000090	天健集团	4,747,757.44	3.47
63	002010	传化智联	4,658,342.19	3.40
64	600188	兖矿能源	4,629,351.66	3.38
65	600549	厦门钨业	4,610,643.00	3.37
66	300418	昆仑万维	4,609,469.85	3.37
67	600885	宏发股份	4,607,527.19	3.36
68	600566	济川药业	4,583,340.21	3.35
69	600373	中文传媒	4,573,525.00	3.34
70	603786	科博达	4,568,819.00	3.34
71	600160	巨化股份	4,543,090.00	3.32
72	000686	东北证券	4,529,697.00	3.31
73	603317	天味食品	4,526,943.00	3.31
74	002396	星网锐捷	4,427,447.00	3.23
75	600325	华发股份	4,387,883.00	3.20
76	000519	中兵红箭	4,375,917.86	3.20
77	600064	南京高科	4,341,137.38	3.17
78	603156	养元饮品	4,309,891.40	3.15
79	688188	柏楚电子	4,268,126.14	3.12
80	002128	电投能源	4,219,027.92	3.08
81	000778	新兴铸管	4,176,062.00	3.05
82	002048	宁波华翔	4,132,638.00	3.02
83	601866	中远海发	4,125,285.00	3.01
84	600917	重庆燃气	4,102,071.88	3.00
85	600873	梅花生物	4,074,210.44	2.98
86	002250	联化科技	4,028,889.92	2.94
87	601168	西部矿业	3,984,933.67	2.91
88	600201	生物股份	3,975,024.00	2.90
89	002625	光启技术	3,931,307.00	2.87
90	000629	钒钛股份	3,931,058.00	2.87
91	601577	长沙银行	3,917,955.00	2.86
92	600985	淮北矿业	3,916,691.00	2.86

93	000930	中粮科技	3,880,501.00	2.83
94	603707	健友股份	3,788,234.42	2.77
95	002557	洽洽食品	3,787,764.00	2.77
96	601615	明阳智能	3,756,899.76	2.74
97	600153	建发股份	3,724,573.00	2.72
98	600039	四川路桥	3,720,225.00	2.72
99	603267	鸿远电子	3,694,481.97	2.70
100	600521	华海药业	3,669,717.00	2.68
101	601869	长飞光纤	3,637,328.00	2.66
102	600909	华安证券	3,621,912.00	2.64
103	600572	康恩贝	3,606,722.00	2.63
104	600271	航天信息	3,569,862.56	2.61
105	000738	航发控制	3,563,428.00	2.60
106	000559	万向钱潮	3,491,723.00	2.55
107	600380	健康元	3,459,699.00	2.53
108	000598	兴蓉环境	3,378,518.50	2.47
109	600967	内蒙一机	3,367,471.00	2.46
110	603290	斯达半导	3,362,701.00	2.46
111	000988	华工科技	3,346,126.83	2.44
112	002966	苏州银行	3,344,885.80	2.44
113	600095	湘财股份	3,341,101.00	2.44
114	600875	东方电气	3,332,102.00	2.43
115	000709	河钢股份	3,317,970.00	2.42
116	002203	海亮股份	3,307,030.93	2.41
117	600350	山东高速	3,250,261.58	2.37
118	002465	海格通信	3,241,369.00	2.37
119	600867	通化东宝	3,238,672.36	2.37
120	002028	思源电气	3,236,422.92	2.36
121	002416	爱施德	3,214,427.00	2.35
122	300017	网宿科技	3,191,452.00	2.33
123	605358	立昂微	3,180,114.06	2.32

124	601928	凤凰传媒	3,170,429.60	2.32
125	600438	通威股份	3,108,584.00	2.27
126	600959	江苏有线	3,097,243.00	2.26
127	601077	渝农商行	3,095,917.00	2.26
128	000415	渤海租赁	3,094,216.84	2.26
129	300223	北京君正	3,049,258.00	2.23
130	600236	桂冠电力	2,997,097.00	2.19
131	002670	国盛金控	2,994,497.00	2.19
132	601016	节能风电	2,962,435.00	2.16
133	000983	山西焦煤	2,958,093.00	2.16
134	688536	思瑞浦	2,955,971.22	2.16
135	002013	中航机电	2,952,204.00	2.16
136	603225	新凤鸣	2,952,027.00	2.16
137	601598	中国外运	2,939,743.00	2.15
138	601872	招商轮船	2,931,842.00	2.14
139	603927	中科软	2,920,957.00	2.13
140	601128	常熟银行	2,920,550.00	2.13
141	603355	莱克电气	2,909,403.00	2.12
142	600968	海油发展	2,884,160.00	2.11
143	600639	浦东金桥	2,881,082.00	2.10
144	600487	亨通光电	2,879,391.00	2.10
145	000630	铜陵有色	2,872,562.00	2.10
146	688006	杭可科技	2,863,815.61	2.09
147	002505	鹏都农牧	2,835,765.00	2.07
148	002423	中粮资本	2,791,124.86	2.04
149	600497	驰宏锌锗	2,788,951.61	2.04
150	002797	第一创业	2,783,345.00	2.03
151	603589	口子窖	2,760,643.00	2.02
152	000932	华菱钢铁	2,741,847.00	2.00

#### 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	1,294,226,282.82
卖出股票收入（成交）总额	1,309,785,359.78

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

### 8.5 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。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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 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。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

### 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	35,121.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,121.06

#### 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未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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

#### 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，分项之和与合计可能有尾差。

## §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

	(户)					
中加中证500指数增强A	939	52,154.06	36,607,026.24	74.75%	12,365,636.83	25.25%
中加中证500指数增强C	2,032	27,662.17	36,494,652.50	64.93%	19,714,870.18	35.07%
合计	2,971	35,402.96	73,101,678.74	69.50%	32,080,507.01	30.50%

## 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	中加中证500指数增强A	132,341.09	0.27%
	中加中证500指数增强C	532,276.65	0.95%
	合计	664,617.74	0.63%

## 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	50~100
	合计	50~100

## §10 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	5,050,419.08	21,808,587.84
减：本报告期基金总赎回份额	22,663,687.47	20,545,427.07
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	48,972,663.07	56,209,522.68

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。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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

基金管理人的重大人事变动：无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 11.4 基金投资策略的改变

无。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。本报告期内应支付审计费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。

## 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	2,600,835,064.19	100.00%	1,365,573.74	100.00%	-

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

2.公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

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

3.券商及交易单元的选择流程如下：

- （1）投资研究部经集体讨论后遵照《中加基金管理有限公司交易单元管理办法》标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；
- （2）公司执行委员会负责审批、确定券商名单及相应的席位租用安排；
- （3）券商名单及相应的席位租用安排确定后，由监察稽核门部负责审查相关协议内容，交易室负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

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

### 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		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	535,196.20	100.00%	96,700,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 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	2022-01-27
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	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-02

	券投资基金关联交易公告		
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
13	中加中证500指数增强型证券投资基金2022年第2季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-20
14	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	2022-08-01
15	中加中证500指数增强型证券投资基金2022年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-08-30
16	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	2022-09-16
17	中加基金管理有限公司关于中加中证500指数增强型证券投资基金关联交易公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-10-13
18	中加中证500指数增强型证券投资基金2022年第3季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-10-26
19	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	2022-11-12
20	中加中证500指数增强型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-07
21	中加中证500指数增强型证	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-07

	券投资基金产品资料概要更新		
22	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	2022-12-07

## §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

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	20220101-20221231	27,966,341.83	0.00	0.00	27,966,341.83	26.59%
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。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

基金管理人处

### 13.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司



客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：[www.bobbns.com](http://www.bobbns.com)

中加基金管理有限公司

二〇二三年三月三十日